

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年2月21日提出
【計算期間】	第14期(自 2021年12月1日至 2022年11月30日)
【ファンド名】	国内株式指数ファンド(T O P I X)
【発行者名】	三井住友D S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 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【電話番号】	03-6205-1649
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【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】

- イ 当ファンドは、国内株式インデックス・マザーファンド（B号）（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、日本の株式に投資します。
- ロ 当ファンドは、TOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとして、当該指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
ベンチマークの詳細については、後述の「2 投資方針」をご参照ください。
- ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

(イ) 当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	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います。
投資対象地域	国内	目論見書または信託約款において、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います。
投資対象資産 (収益の源泉)	株式	目論見書または信託約款において、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います。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

(ロ) 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（株式一般））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式であり、ファンドの収益は株式市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「株式」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	日本	目論見書または信託約款において、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います。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、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います。
対象インデックス	TOPIX	目論見書または信託約款において、TOPIXの動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

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)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	特殊型
	内外	不動産投信	
		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	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般				
大型株	年2回	日本		日経225
中小型株	年4回	北米	ファミリーファンド	
債券	年6回(隔月)	欧州		
一般	年12回(毎月)	アジア		
公債	日々	オセアニア		TOPIX
社債	その他	中南米		
その他債券	()	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	
クレジット属性		中近東(中東)		その他
()		エマージング		()
不動産投信				
その他資産				
(投資信託証券(株式一般))				
資産複合				
()				
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。

商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

(2) 【ファンドの沿革】

2009年10月19日 信託契約締結、設定、運用開始。

(3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

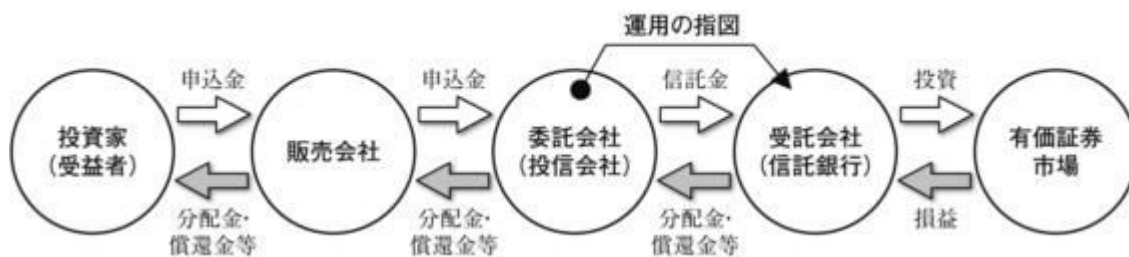
(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

(ハ) 販売会社

委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

運営の仕組み



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2022年12月30日現在）

(ロ) 会社の沿革

1985年7月15日	三生投資顧問株式会社設立
1987年2月20日	証券投資顧問業の登録
1987年6月10日	投資一任契約にかかる業務の認可
1999年1月1日	三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
1999年2月5日	三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
2000年1月27日	証券投資信託委託業の認可取得
2002年12月1日	住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
2013年4月1日	トヨタアセットマネジメント株式会社と合併
2019年4月1日	大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更

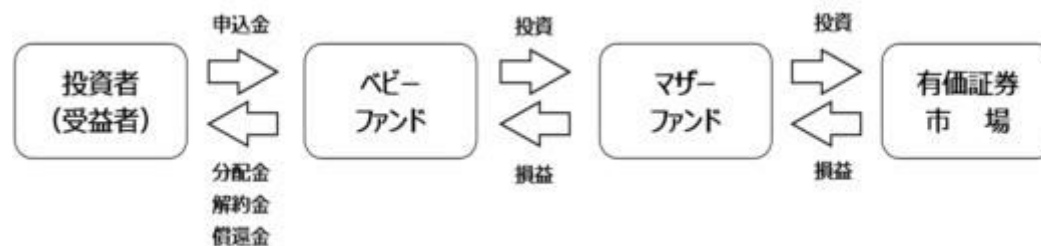
(八) 大株主の状況

(2022年12月30日現在)

名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	16,977,897	50.1
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	7,946,406	23.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	5,080,509	15.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528,000	10.4
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	337,248	1.0

八 ファンドの運用形態（ファミリーファンド方式による運用）

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまとめて「ベビーファンド」とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」に投資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。



2【投資方針】

(1)【投資方針】

イ 基本方針

当ファンドは、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- (ニ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドの特色

1

主として日本の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指します。

- 運用の効率化のため、先物取引およびオプション取引等を利用することがあります。
- 実際の運用は、国内株式インデックス・マザーファンド(B号)への投資を通じて行います。



TOPIX(東証株価指数)とは

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株価指数です。

日本の株式市場を投資対象とする金融商品の運用目標や評価の基準(ベンチマーク)として広く利用されています。

2

株式の実質組入比率は原則として高位を保ちます。

※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドのしくみ

■ファミリーファンド方式を採用し、マザーファンドの組入れを通じて、実際の運用を行います。



TOPIX(東証株価指数)の概要

銘柄数: **2,163**配当利回り: **2.56%**予想PER: **12.73倍**

配当利回りとは

株価に対する実績年間配当金の割合(1株当たり実績年間配当金÷株価)です。

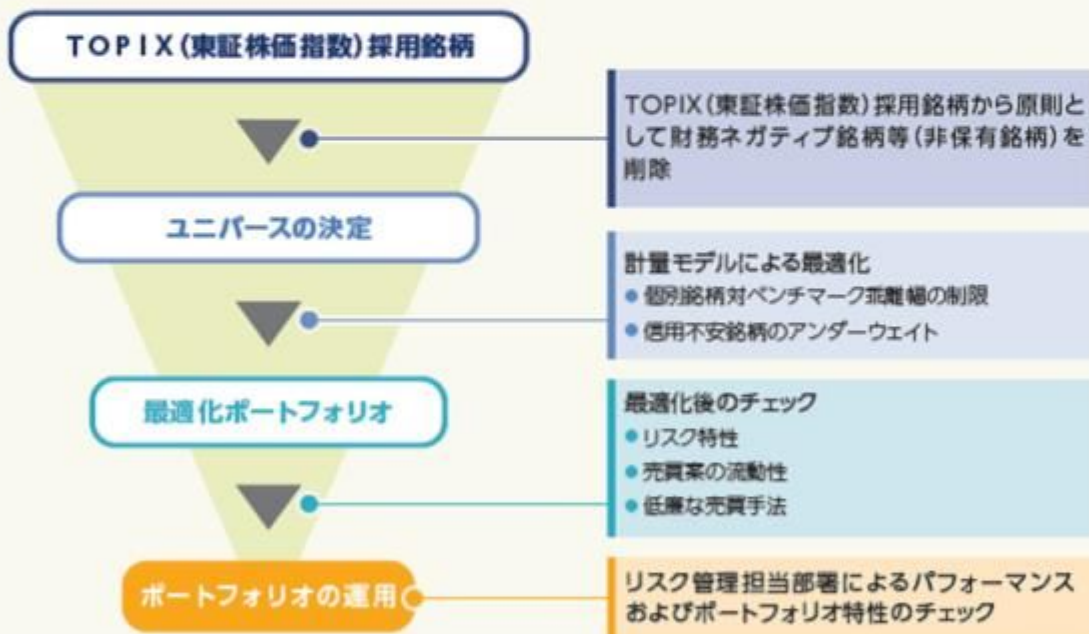
予想PER(Price Earnings Ratio)とは

株価の1株当たり予想利益に対する倍率(株価÷1株当たり予想利益)です。

(注)2022年12月末現在
(出所)Factsetの情報を基に委託会社作成

※データは、上記指数の過去の実績であり、当ファンドの将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。

運用プロセス



最適化(法)とは

計量モデル等に基づいて、インデックスとの連動性を保てるようにインデックス構成銘柄の一部を抽出してポートフォリオを構築する方法です。

※上記の運用プロセスは今後変更される場合があります。

TOPIXの著作権など

- ・ TOPIXの指数値およびTOPIXにかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXにかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。
- ・ JPXは、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXにかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- ・ JPXは、TOPIXの指数値およびTOPIXにかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIX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、TOPIXの指数値およ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、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ・ 当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。
- ・ JPXは、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ・ JPXは、委託会社または当ファンドの購入者のニーズをTOPIXの指数値を算出する銘柄構成およ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は当ファンドの設定、販売およ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。

(2)【投資対象】

イ 投資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。

(イ) 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項の「特定資産」をいいます。以下同じ。)

1. 有価証券
2. デリバティブ取引にかかる権利
3. 約束手形
4. 金銭債権

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、マザーファンドの受益証券または次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(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かかる優先出資証券(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. 特定目的会社にかかる優先出資証券また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。)および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(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または証書(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、有価証券にかか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. 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
 21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券また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号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券(ただし、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。

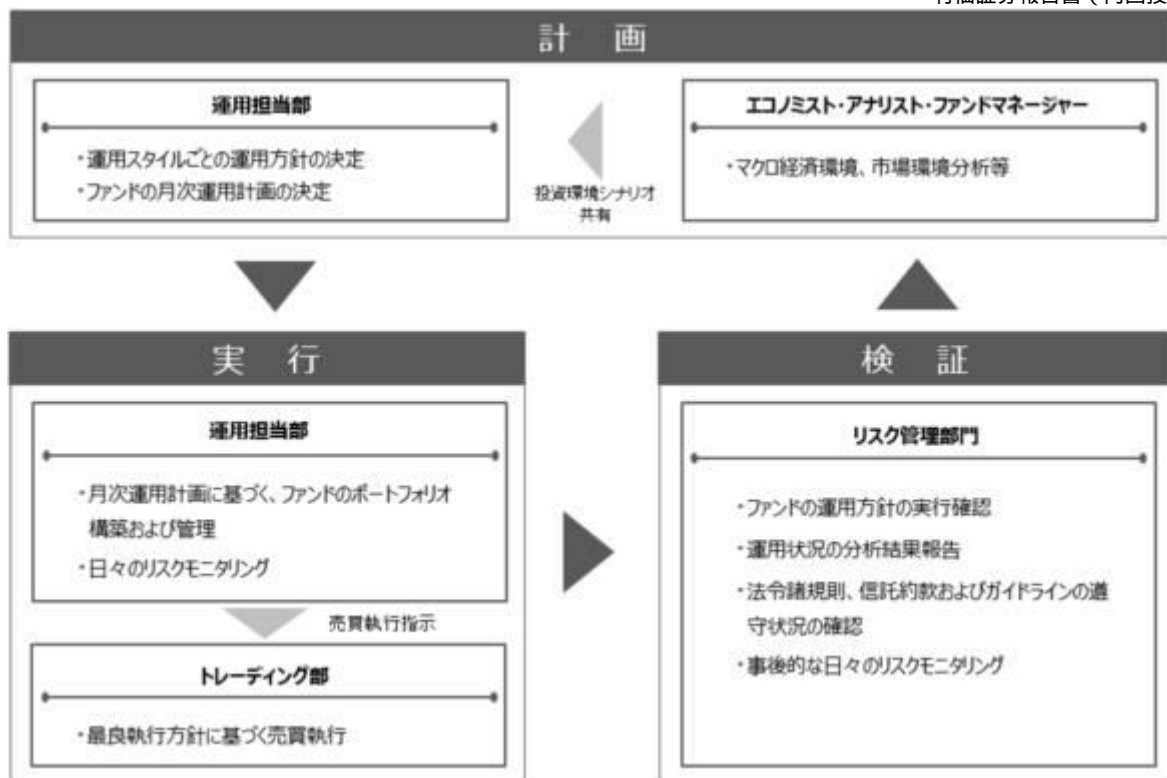
八 投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上記口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前号の権利の性質を有するもの

(3) 【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

ファンドの運用体制は、委託会社の組織変更等により、変更されることがあります。

- 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制
ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

（４）【分配方針】

年１回（原則として毎年11月30日。ただし、休業日の場合は翌営業日。）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

- イ 分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。
- 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については、前記「（１）投資方針」に基づいて運用を行います。

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 株式への実質投資割合には制限を設けません。

実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合

計したものをいいます（以下同じ。）。

□ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

イ 投資する株式等の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場し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、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

（ロ）上記（イ）にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録することが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

□ 信用取引の指図

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

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

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

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

八 先物取引等の指図

（イ）委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本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。）およ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。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。

（ロ）委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、日本の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

（ハ）委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ニ スワップ取引の指図

（イ）委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金

利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

ホ 金利先渡取引および為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引および為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ヘ) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (ト) 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。)を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引

を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

へ 有価証券の貸付けの指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

(ロ) 上記(イ)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(ハ) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

ト 有価証券の空売りの指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(ロ) 上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

(ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

チ 有価証券の借入れの指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。

(ロ) 上記(イ)の借入れの指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

(ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

(ニ) 有価証券の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

リ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

ヌ 外国為替予約取引の指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

(ロ) 外国為替予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

(ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

(ニ) 上記(ロ)において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド

の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ル 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、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て(一部解約に伴う支払資金の手当て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、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
 2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
 3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

ヲ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

法令に基づく投資制限

- イ 同一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第9条)
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すべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。)が、当該株式にかかる議決権の総数に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、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。
- ロ デリバティブ取引にかかる投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号)
委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。)を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。
- ハ 信用リスク集中回避のための投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2)
委託会社は、運用財産に関し、信用リスク(保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。)を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。

(参考情報：国内株式インデックス・マザーファンド(B号)の投資方針等)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

主として日本の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) 主としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ハ) 株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 特別の法律により法人の発行する債券
4. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
5. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
7. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品の各号のうち、第1号から第4号に掲げるものに投資します。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 外貨建資産への投資は行いません。
- (ロ) 株式への投資割合には制限を設けません。
- (ハ) 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およびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (ニ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

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。したがって、投

投資者の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。

運用の結果として信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。また、一定の投資成果を保証するものではありません。

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

(イ) 株式市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況、これらに対する外部的評価の変化等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。特に、企業が倒産や大幅な業績悪化に陥った場合、当該企業の株式の価値が大きく下落し、基準価額が大きく下落する要因となります。

(ロ) 信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。有価証券等の格付けが低い場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

(ハ) 市場流動性リスク

ファンドの資金流入に伴い、有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、必要な取引ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ニ) 対象インデックスの動きと連動しない要因

ファンドは、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いますが、以下の要因等により、対象インデックスの動きに連動しないことがあります。

- ・有価証券売買時のコスト、信託報酬やその他のファンド運営にかかる費用を負担すること
- ・追加設定・一部解約により組入有価証券の売買のタイミング差が生じること
- ・インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差が影響すること
- ・利用可能な指数先物と対象インデックスの動きに不一致が生じること

(ホ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

(ヘ) 換金制限等に関する留意点

ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や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、換金申込みの受け付けが中止となる可能性、既に受け付けた換金申込みが取り消しとなる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性等があります。

(ト) 収益分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンド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およ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、分配金の一部または全部が、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。

□ 投資リスクの管理体制

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、運用リスク管理を行っています。

リスク管理担当部は、信託約款等に定める各種投資制限やリスク指標のモニタリングを実施し、制限に対する抵触等があった場合には運用部門に対処要請等を行い、結果をリスク管理会議へ報告します。

また、ファンドのパフォーマンスの分析・評価を行い、結果を運用評価会議等へ報告することで、運用方針等との整合性を維持するよう適切に管理しています。

さらに、流動性リスク管理について規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングやストレステストを実施するとともに、緊急時対応策等の策定や有効性の検証等を行います。なお、当該流動性リスクの適切な管理の実施等について、定期的にはリスク管理会議へ報告します。

コンプライアンス担当部は、法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行い、結果をコンプライアンス会議に報告します。

（参考情報）投資リスクの定量的比較

「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



※ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	TOPIX (配当込み) 株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社が算出、公表する指数で、日本の株式を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 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指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。
※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

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】

解約手数料はありません。

ただし、解約の際には、1口につき解約請求受付日の基準価額に0.16%の率を乗じて得た信託財産留保額が差し引かれます。

(3) 【信託報酬等】

純資産総額に年0.44%（税抜き0.4%）の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬の配分は以下の通りです。

< 信託報酬の配分（税抜き） >

支払先	料率	役務の内容
委託会社	年0.18%	ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	年0.18%	交付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0.04%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

(4) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.0055%（税抜き0.005%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。2023年4月以降の決算等にかかる財務諸表の監査を行う監査法人を、PwCあらた有限責任監査法人に変更します。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

上記ロ、ハにかかる費用に関しましては、その時々取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

上記(1)～(4)にかかる手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的金額を認識するものがあつたりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

(5) 【課税上の取扱い】

- イ 個別元本について

- (イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)にあたります。
- (ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
- (ハ) 受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。(「元本払戻金(特別分配金)」については、下記の(収益分配金の課税について)を参照。)

ロ 一部解約時および償還時の課税について

個人の受益者については、一部解約時および償還時の譲渡益が課税対象となり、法人の受益者については、一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

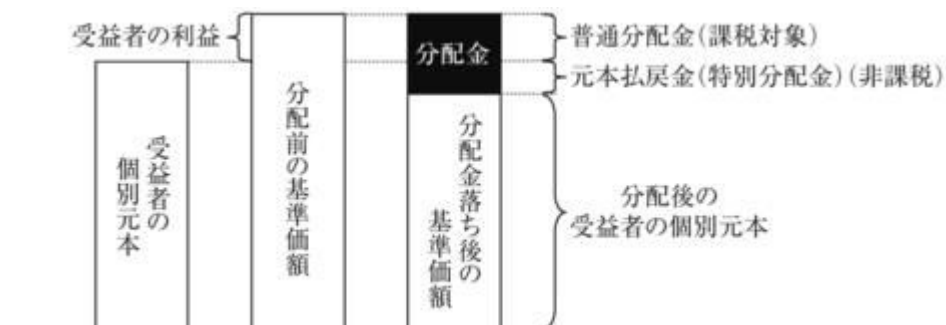
ハ 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。



収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。



上記、の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

・一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（上場株式、公募株式投資信託、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募公社債投資信託および特定公社債をいいます。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り、）および利子所得の金額との損益通算が可能です。

（ロ）法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

なお、当ファンドは、配当控除の適用が可能です。益金不算入制度の適用はありません。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」の適用対象です。ただし、販売会社によっては当ファンドをNISA、ジュニアNISAでの取扱い対象としない場合があります。

※NISA、ジュニアNISAをご利用になる場合、各制度の違いにご留意ください。
また、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

	少額投資非課税制度 NISA	未成年者少額投資非課税制度 ジュニアNISA
対象となる投資信託	公募株式投資信託	
非課税対象	公募株式投資信託から生じる配当所得および譲渡所得	
利用対象となる方	18歳以上の日本居住者 (専用口座が開設される年の1月1日現在)	0～17歳の日本居住者 (専用口座が開設される年の1月1日現在)
非課税の期間	最長5年間(新規の購入は2023年まで)*	
利用できる限度額	120万円/年 (最大600万円)	80万円/年 (最大400万円)

*2024年以降、ジュニアNISAで新規の購入ができなくなります。
なお、今後NISA制度は見直しされる予定です。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2022年12月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

国内株式指数ファンド(T O P I X)

2022年12月30日現在

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	4,852,959,563	100.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	1,738,312	0.04
合計(純資産総額)		4,851,221,251	100.00

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

国内株式指数ファンド(T O P I X)

イ 主要投資銘柄

2022年12月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	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 (B号)	1,492,345,879	3.3993	5,072,901,657	3.2519	4,852,959,563	100.04

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2022年12月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.04
合計	100.04

【投資不動産物件】

国内株式指数ファンド(T O P I X)

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

国内株式指数ファンド(T O P I X)

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

国内株式指数ファンド（TOPIX）

年月日	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5期 (2013年12月 2日)	1,784,220,598	1,784,220,598	14,958	14,958
第6期 (2014年12月 1日)	2,998,182,058	2,998,182,058	17,180	17,180
第7期 (2015年11月30日)	4,703,502,338	4,703,502,338	19,399	19,399
第8期 (2016年11月30日)	4,640,667,258	4,640,667,258	18,362	18,362
第9期 (2017年11月30日)	3,421,101,821	3,421,101,821	22,813	22,813
第10期 (2018年11月30日)	5,145,107,729	5,145,107,729	21,626	21,626
第11期 (2019年12月 2日)	4,156,349,301	4,156,349,301	22,725	22,725
第12期 (2020年11月30日)	3,386,067,572	3,386,067,572	23,760	23,760
第13期 (2021年11月30日)	4,446,080,933	4,446,080,933	26,559	26,559
第14期 (2022年11月30日)	4,753,036,702	4,753,036,702	27,982	27,982
2021年12月末日	4,508,577,471	-	27,481	-
2022年 1月末日	4,662,598,197	-	26,140	-
2月末日	4,680,541,684	-	26,016	-
3月末日	4,773,015,037	-	27,127	-
4月末日	4,860,340,982	-	26,469	-
5月末日	4,830,195,752	-	26,659	-
6月末日	4,738,127,380	-	26,108	-
7月末日	4,759,377,070	-	27,075	-
8月末日	4,601,383,377	-	27,391	-
9月末日	4,640,763,459	-	25,875	-
10月末日	4,835,068,393	-	27,188	-
11月末日	4,753,036,702	-	27,982	-
12月末日	4,851,221,251	-	26,694	-

【分配の推移】

国内株式指数ファンド（TOPIX）

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第5期	2012年12月 1日～2013年12月 2日	0
第6期	2013年12月 3日～2014年12月 1日	0
第7期	2014年12月 2日～2015年11月30日	0
第8期	2015年12月 1日～2016年11月30日	0
第9期	2016年12月 1日～2017年11月30日	0
第10期	2017年12月 1日～2018年11月30日	0
第11期	2018年12月 1日～2019年12月 2日	0

第12期	2019年12月 3日～2020年11月30日	0
第13期	2020年12月 1日～2021年11月30日	0
第14期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0

【収益率の推移】

国内株式指数ファンド（TOPIX）

	収益率（％）
第5期	63.9
第6期	14.9
第7期	12.9
第8期	5.3
第9期	24.2
第10期	5.2
第11期	5.1
第12期	4.6
第13期	11.8
第14期	5.4

（注）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

（４）【設定及び解約の実績】

国内株式指数ファンド（TOPIX）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第5期	4,487,661,625	4,434,132,102
第6期	5,137,237,608	4,584,880,450
第7期	4,567,315,522	3,887,850,632
第8期	2,489,699,707	2,386,992,223
第9期	1,746,929,600	2,774,643,625
第10期	2,256,601,324	1,377,130,832
第11期	785,681,724	1,335,798,481
第12期	1,741,872,921	2,145,723,842
第13期	1,810,231,497	1,561,277,696
第14期	1,548,605,510	1,524,059,041

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

（参考）

（１）投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2022年12月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
-------	------	-------------	-------------

株式	日本	211,581,051,260	98.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,661,167,518	1.24
合計(純資産総額)		214,242,218,778	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	2,648,100,000	1.24
合計	買建	-	2,648,100,000	1.24

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2022年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	4,262,100	2,006.51	8,551,954,800	1,812.50	7,725,056,250	3.61
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	549,100	11,231.46	6,167,195,700	10,035.00	5,510,218,500	2.57
日本	株式	三菱UFJ フィナンシャル・グループ	銀行業	4,851,600	755.10	3,663,443,160	889.00	4,313,072,400	2.01
日本	株式	キーエンス	電気機器	77,600	57,022.59	4,424,953,000	51,420.00	3,990,192,000	1.86
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	997,500	3,819.17	3,809,617,700	3,762.00	3,752,595,000	1.75
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	558,200	4,686.02	2,615,734,300	5,296.00	2,956,227,200	1.38
日本	株式	第一三共	医薬品	678,100	4,511.49	3,059,244,400	4,250.00	2,881,925,000	1.35
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	688,800	4,051.34	2,790,564,600	4,111.00	2,831,656,800	1.32
日本	株式	任天堂	その他製品	490,100	5,888.51	2,885,956,600	5,532.00	2,711,233,200	1.27
日本	株式	日立製作所	電気機器	393,500	7,287.05	2,867,452,500	6,691.00	2,632,908,500	1.23
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	450,200	5,945.03	2,676,450,900	5,644.00	2,540,928,800	1.19
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	590,700	4,327.33	2,556,156,300	4,177.00	2,467,353,900	1.15
日本	株式	KDDI	情報・通信業	601,600	4,108.71	2,471,799,000	3,982.00	2,395,571,200	1.12
日本	株式	三井物産	卸売業	600,800	3,980.89	2,391,717,600	3,853.00	2,314,882,400	1.08
日本	株式	三菱商事	卸売業	513,400	4,597.85	2,360,533,700	4,283.00	2,198,892,200	1.03
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	769,400	2,827.41	2,175,411,800	2,827.50	2,175,478,500	1.02
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	54,800	44,952.99	2,463,423,600	38,880.00	2,130,624,000	0.99
日本	株式	信越化学工業	化学	131,100	17,561.90	2,302,365,400	16,225.00	2,127,097,500	0.99
日本	株式	HOYA	精密機器	165,800	14,047.64	2,329,099,000	12,705.00	2,106,489,000	0.98
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	505,700	4,284.13	2,166,483,600	4,146.00	2,096,632,200	0.98

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,104,100	1,719.95	1,899,000,100	1,856.00	2,049,209,600	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	630,900	3,349.11	2,112,953,100	3,032.00	1,912,888,800	0.89
日本	株式	ダイキン工業	機械	93,600	22,361.90	2,093,074,300	20,200.00	1,890,720,000	0.88
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,250,600	1,497.53	1,872,811,450	1,488.00	1,860,892,800	0.87
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	84,500	19,711.07	1,665,585,200	19,160.00	1,619,020,000	0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	283,100	5,580.35	1,579,797,700	5,660.00	1,602,346,000	0.75
日本	株式	村田製作所	電気機器	235,200	7,446.08	1,751,316,900	6,588.00	1,549,497,600	0.72
日本	株式	ファナック	電気機器	76,200	20,355.70	1,551,104,200	19,835.00	1,511,427,000	0.71
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	745,900	2,125.77	1,585,610,200	2,006.50	1,496,648,350	0.70
日本	株式	S M C	機械	25,400	61,639.94	1,565,654,500	55,580.00	1,411,732,000	0.66

□ 種類別・業種別投資比率

2022年12月30日現在

種類	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	3.48
	繊維製品	0.46
	パルプ・紙	0.18
	化学	6.05
	医薬品	5.73
	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	4.97
	電気機器	16.35
	輸送用機器	7.21
	精密機器	2.55
	その他製品	2.32
	電気・ガス業	1.26
	陸運業	3.10
	海運業	0.63
	空運業	0.52
倉庫・運輸関連業	0.14	
情報・通信業	8.84	
卸売業	5.97	

	小売業	4.71
	銀行業	6.38
	証券、商品先物取引業	0.74
	保険業	2.52
	その他金融業	1.12
	不動産業	1.95
	サービス業	5.30
合計		98.76

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2022年12月30日現在

種類	国/ 地域	取引所 等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	日本	大阪取引 所	TOPIX 先 物 0503 月 2023年 3月	買建	140	日本・円	2,700,769,000	2,648,100,000	1.24

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

参考情報

基準日:2022年12月30日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

基準価額・純資産の推移



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

分配の推移

決算期	分配金
2022年11月	0円
2021年11月	0円
2020年11月	0円
2019年12月	0円
2018年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

主要な資産の状況

国内株式指数ファンド(TOPIX)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.04
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	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(B号)	100.04

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	98.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.24
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て1.24%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.61
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.57
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.01
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.86
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.75
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.38
日本	株式	第一三共	医薬品	1.35
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.32
日本	株式	任天堂	その他製品	1.27
日本	株式	日立製作所	電気機器	1.23

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。

※2022年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ベンチマーク(TOPIX(東証株価指数、配当込み))の情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

イ 申込方法

(イ) ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社に取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(ロ) 原則として午後3時までに取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。

なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受け付けを中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

(ハ) 当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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かかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

(ニ) 定時定額で取得申込みをする「定時定額購入サービス」(販売会社によっては、名称が異なる場合があります。)を利用する場合は、販売会社との間で「定時定額購入サービス」に関する契約を締結します。詳細については、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

ロ 申込価額

取得申込受付日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

ハ 申込手数料

ありません。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター	ホームページ

三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp
-----------------------	--------------	---

お問い合わせは、午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)までとさせていただきます。

へ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

取得申込者は、申込金額(取得申込受付日の基準価額×申込口数)を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

2【換金(解約)手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約請求(一部解約の実行請求)により換金することができます。

お買付けの販売会社にお申し出ください。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時までに解約請求のお申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みに制限を設ける場合があります。

解約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かかるファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかか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または記録が行われます。

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額となります。

解約単位の詳細および一部解約価額につきましては、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、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。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、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券および借入れ有価証券を除きます。)を法令およ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信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(「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(基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。)

投資対象とする親投資信託受益証券は、当該親投資信託受益証券の基準価額で評価します。

なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとします。また、予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

< 主要投資対象の評価方法 >

主要投資対象	有価証券等の評価方法
株式、投資証券等	(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の最終相場で評価します。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 原則として、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価します。
市場デリバティブ取引	原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の発表する清算値段または最終相場で評価します。

国内で取引される資産については原則として基準価額計算日の値、外国で取引される資産については原則として基準価額計算日に知りうる直近の日の値で評価します。

□ 基準価額の算出頻度・照会方法

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。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「内株指数」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター	ホームページ
三井住友DSアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp

お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

(2) 【保管】

ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まるため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

2009年10月19日から下記「(5) その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4) 【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとすることを原則としますが、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するものとします。なお、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】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めると

き、残存口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b~dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b~dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 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。また、受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

- a. 分配金額は、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。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載また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)に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(ロ) 償還金

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載また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かか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また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)に支払われます。

八 信託約款の変更等

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の事項(変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- (ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (ニ) 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います(書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。)
- (ホ) 上記(ロ)から(ニ)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあつても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの)は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれから、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社の事業の全部または一部の譲渡、もしくは分割承継により、当ファンドに関する事業が譲渡・承継されることがあります。

ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.smd-am.co.jp>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

チ 運用にかかる報告書の開示方法

委託会社は毎決算後、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書（全体版）および運用報告書（全体版）の記載事項のうち重要なものを記載した交付運用報告書を作成します。

交付運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。なお、運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページで閲覧できます。

4【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載また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、）に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ロ 償還金請求権

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、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載また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かか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また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、）に支払われます。

償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ハ 一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」の記載をご参照ください。

ニ 書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行使することができます。

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧また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)ならびに同規則第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14期(2021年12月1日から2022年11月30日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【国内株式指数ファンド(TOPIX)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第13期 (2021年11月30日現在)	第14期 (2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	598,572	1,338,051
コール・ローン	17,653,848	8,255,896
親投資信託受益証券	4,455,269,245	4,763,598,927
未収入金	-	3,816,598
流動資産合計	4,473,521,665	4,777,009,472
資産合計	4,473,521,665	4,777,009,472
負債の部		
流動負債		
未払解約金	18,247,021	13,410,658
未払受託者報酬	908,009	1,043,133
未払委託者報酬	8,172,197	9,388,586
その他未払費用	113,505	130,393
流動負債合計	27,440,732	23,972,770
負債合計	27,440,732	23,972,770
純資産の部		
元本等		
元本	1,674,067,430	1,698,613,899
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,772,013,503	3,054,422,803
(分配準備積立金)	240,232,483	342,527,245
元本等合計	4,446,080,933	4,753,036,702
純資産合計	4,446,080,933	4,753,036,702
負債純資産合計	4,473,521,665	4,777,009,472

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第13期		第14期	
	自	2020年12月 1日	自	2021年12月 1日
	至	2021年11月30日	至	2022年11月30日
営業収益				
受取利息		9		203
有価証券売買等損益		410,165,595		344,938,831
営業収益合計		410,165,604		344,939,034
営業費用				
支払利息		12,528		5,426
受託者報酬		1,678,877		2,072,054
委託者報酬		15,109,917		18,649,280
その他費用		211,780		259,182
営業費用合計		17,013,102		20,985,942
営業利益又は営業損失()		393,152,502		323,953,092
経常利益又は経常損失()		393,152,502		323,953,092
当期純利益又は当期純損失()		393,152,502		323,953,092
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()		283,706,828		84,421,859
期首剰余金又は期首欠損金()		1,960,953,943		2,772,013,503
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,987,748,189		2,557,192,219
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,987,748,189		2,557,192,219
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,286,134,303		2,514,314,152
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,286,134,303		2,514,314,152
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		2,772,013,503		3,054,422,803

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第14期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第13期 (2021年11月30日現在)	第14期 (2022年11月30日現在)
	1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,674,067,430口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6559円 (1万口当たりの純資産額26,559円)	1口当たり純資産額 2.7982円 (1万口当たりの純資産額27,982円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第13期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日	第14期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
	分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（70,874,415円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（38,571,259円）、収益調整金（2,531,781,020円）、および分配準備積立金（130,786,809円）より、分配対象収益は2,772,013,503円（1万口当たり16,558.55円）であります。分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第14期 自 2021年12月1日 至 2022年11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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4. 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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 (2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、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(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「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、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第13期(自2020年12月1日至2021年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	197,514,533円
合計	197,514,533円

第14期(自2021年12月1日至2022年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	266,100,175円
合計	266,100,175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。

(関連当事者との取引に関する注記)

第14期 自2021年12月1日 至2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項目	第13期 (2021年11月30日現在)	第14期 (2022年11月30日現在)
期首元本額	1,425,113,629円	1,674,067,430円
期中追加設定元本額	1,810,231,497円	1,548,605,510円
期中一部解約元本額	1,561,277,696円	1,524,059,041円

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	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(B号)	1,398,015,768	4,763,598,927	
	親投資信託受益証券 小計		4,763,598,927	
合 計			4,763,598,927	

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)

国内株式指数ファンド(TOPIX)は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	103,624,846	456,457,514
コール・ローン	3,056,237,624	2,816,383,083
株式	192,569,963,990	218,143,627,430
派生商品評価勘定	-	205,303,100
未収入金	-	209,436,600
未収配当金	1,330,297,687	1,741,212,622
前払金	133,950,000	-
差入委託証拠金	165,240,000	186,390,000
流動資産合計	197,359,314,147	223,758,810,349
資産合計	197,359,314,147	223,758,810,349
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	261,119,400	-
前受金	-	210,290,000
未払金	19,827,373	124,125,858
未払解約金	24,033,101	605,043,303
その他未払費用	14,521	10,581

流動負債合計	304,994,395	939,469,742
負債合計	304,994,395	939,469,742
純資産の部		
元本等		
元本	61,173,269,127	65,393,298,021
剰余金		
剰余金又は欠損金()	135,881,050,625	157,426,042,586
元本等合計	197,054,319,752	222,819,340,607
純資産合計	197,054,319,752	222,819,340,607
負債純資産合計	197,359,314,147	223,758,810,349

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に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によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	61,173,269,127口	65,393,298,021口

2. 1 単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3,2212円 (1万口当たりの純資産額32,212円)	1口当たり純資産額 3,4074円 (1万口当たりの純資産額34,074円)
-----------------	---	---

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 2021年12月1日 至 2022年11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、当ファンドの信託約款に従い、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金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的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目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかると、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</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。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2022年11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券(株式) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

		契 約 額 等		
--	--	---------	--	--

区 分	種 類		うち 1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0312月	5,076,959,400	-	4,815,840,000	261,119,400
	小計	5,076,959,400	-	4,815,840,000	261,119,400
合 計		5,076,959,400	-	4,815,840,000	261,119,400

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0412月	4,351,796,900	-	4,557,100,000	205,303,100
	小計	4,351,796,900	-	4,557,100,000	205,303,100
合 計		4,351,796,900	-	4,557,100,000	205,303,100

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に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。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	62,877,618,349円
同期中における追加設定元本額	10,732,324,295円
同期中における一部解約元本額	12,436,673,517円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,444,432,886円
三井住友・D C年金バランス30(債券重点型)	893,111,379円
三井住友・D C年金バランス50(標準型)	4,314,610,252円
三井住友・D C年金バランス70(株式重点型)	3,302,572,824円

SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	123,293,850円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	4,679,600円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	20,378,358円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	62,968,056円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	145,617,764円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	123,379,159円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	223,865,395円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,383,108,545円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	18,142,394,620円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	277,082,196円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	326,588,940円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	215,307,143円
イオン・バランス戦略ファンド	14,508,106円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	29,487,863円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	154,290,540円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	142,287,008円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	489,286,600円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	261,074,601円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	295,921,518円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	33,623,909円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	440,586,720円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	14,302,327円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	71,078,321円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	69,299,615円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,018,342円
日興FWS・日本株インデックス	300,009,523円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	1,878,586円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,839,797,359円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	12,523,734円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	108,824,691円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,852,669,865円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,648,623,694円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	6,291,332,987円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	41,040,556円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	166,358,728円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	748,263,991円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	46,344,355円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	259,277,705円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	856,981,897円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	603,670,244円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,898,722,676円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	374,931円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	42,261,700円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	47,434,130円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	34,163,089円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,669,461円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	115,063,306円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	248,882,682円

SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	61,933,489円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	39,574,438円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,375,595円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	45,508,490円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	613,464,436円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	180,359,966円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	237,022,466円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	110,132,461円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	259,324,316円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	64,476,018円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	37,709,634円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	55,155,389円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	59,877,017円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	197,029,085円
合計	61,173,269,127円

(2022年11月30日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	61,173,269,127円
同期中における追加設定元本額	11,653,465,066円
同期中における一部解約元本額	7,433,436,172円

2022年11月30日現在の元本の内訳

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,574,760,676円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,036,137,254円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,637,683,641円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,605,989,911円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	147,542,223円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	4,234,860円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	19,508,324円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	63,979,125円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	165,870,052円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	149,775,143円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	266,593,539円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,398,015,768円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	22,016,808,347円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	179,974,667円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	253,617,658円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	167,938,880円
イオン・バランス戦略ファンド	20,272,782円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	41,931,085円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	191,067,731円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	178,416,019円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	669,872,498円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	375,434,831円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	427,891,807円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	49,851,584円

三井住友D S ・国内株式インデックス年金ファンド	813,757,842円
三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型)	39,664,361円
三井住友D S ・年金バランス50(標準型)	202,349,704円
三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)	191,586,051円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2060	5,500,206円
日興FWS・日本株インデックス	1,276,658,198円
三井住友D S ・T O P I Xインデックス・ファンド	18,140,230円
S M A M ・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,564,092,115円
バランスファンドV A (安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	11,882,906円
S M A M ・バランスファンドV A 安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	74,050,540円
S M A M ・バランスファンドV A 25 < 適格機関投資家専用 >	1,456,182,387円
S M A M ・バランスファンドV A 37.5 < 適格機関投資家専用 >	1,446,188,375円
S M A M ・バランスファンドV A 50 < 適格機関投資家専用 >	5,623,103,466円
S M A M ・バランスファンドV L 30 < 適格機関投資家限定 >	37,493,396円
S M A M ・バランスファンドV L 50 < 適格機関投資家限定 >	135,694,110円
S M A M ・バランスファンドV A 75 < 適格機関投資家専用 >	684,565,549円
S M A M ・バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	44,118,775円
S M A M ・インデックス・バランスV A 25 < 適格機関投資家専用 >	254,234,553円
S M A M ・インデックス・バランスV A 50 < 適格機関投資家専用 >	796,235,497円
S M A M ・バランスファンドV A 40 < 適格機関投資家専用 >	533,449,238円
S M A M ・バランスファンドV A 35 < 適格機関投資家専用 >	1,657,079,267円
S M A M ・バランスV A 株40T < 適格機関投資家限定 >	372,784円
S M A M ・グローバルバランス40V A < 適格機関投資家限定 >	36,667,207円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 20A < 適格機関投資家専用 >	39,482,192円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 35A < 適格機関投資家専用 >	32,479,210円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 50A < 適格機関投資家専用 >	16,795,425円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 20L < 適格機関投資家専用 >	95,429,547円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 25L < 適格機関投資家専用 >	219,105,114円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 20A2 < 適格機関投資家専用 >	52,522,560円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 35A2 < 適格機関投資家専用 >	38,723,328円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 50A2 < 適格機関投資家専用 >	7,680,964円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 30L2 < 適格機関投資家専用 >	41,326,285円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 25L2 < 適格機関投資家専用 >	542,525,688円
S M A M ・国内株式インデックスファンド・V A (適格機関投資家専用)	167,317,059円
S M A M ・グローバルバランスファンド(標準型)V A < 適格機関投資家限定 >	202,591,112円
S M A M ・グローバルバランスファンド(債券重視型)V A < 適格機関投資家限定 >	85,721,825円
S M A M ・世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	94,168,528円
S M A M ・世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	44,811,453円
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	42,807,427円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2016-04 < 適格機関投資家限定 >	5,577,900円
S M A M ・マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	7,187,543円
S M A M ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	92,673,351円
S M D A M ・日米3資産バランスオープン < 適格機関投資家限定 >	18,136,348円
合計	65,393,298,021円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極 洋	3,900	3,695.000	14,410,500	
日本水産	106,900	522.000	55,801,800	
マルハニチロ	16,200	2,456.000	39,787,200	
雪国まいたけ	10,600	1,001.000	10,610,600	
カネコ種苗	5,300	1,429.000	7,573,700	
サカタのタネ	13,500	4,690.000	63,315,000	
ホクト	9,400	1,890.000	17,766,000	
住石ホールディングス	21,800	254.000	5,537,200	
日鉄鉱業	4,300	3,145.000	13,523,500	
三井松島HLDGS	5,000	3,225.000	16,125,000	
INPEX	394,000	1,533.000	604,002,000	
石油資源開発	12,300	4,335.000	53,320,500	
K&Oエナジーグループ	4,900	2,427.000	11,892,300	
ショーボンドHD	14,500	6,060.000	87,870,000	
ミライト・ワン	37,200	1,514.000	56,320,800	
タマホーム	7,600	2,479.000	18,840,400	
日本アクア	5,900	880.000	5,192,000	
ROBOT HOME	800	184.000	147,200	
安藤・間	61,900	874.000	54,100,600	
東急建設	32,600	656.000	21,385,600	
コムシスホールディングス	35,900	2,467.000	88,565,300	
ビーアールホールディングス	22,200	337.000	7,481,400	
高松建設	7,200	1,960.000	14,112,000	
東建コーポレーション	3,400	7,950.000	27,030,000	
ヤマウラ	7,600	1,004.000	7,630,400	
オリエンタル白石	41,300	278.000	11,481,400	
大成建設	74,200	4,165.000	309,043,000	
大林組	265,900	1,024.000	272,281,600	
清水建設	223,600	738.000	165,016,800	
飛島建設	10,400	1,022.000	10,628,800	
長谷工コーポレーション	76,900	1,517.000	116,657,300	
松井建設	2,700	562.000	1,517,400	
銭高組	2,100	2,686.000	5,640,600	
鹿島建設	164,900	1,550.000	255,595,000	
不動テトラ	6,000	1,524.000	9,144,000	
大末建設	3,700	1,196.000	4,425,200	
鉄建建設	7,000	1,819.000	12,733,000	
西松建設	13,100	3,915.000	51,286,500	
三井住友建設	63,200	422.000	26,670,400	
大豊建設	3,300	4,440.000	14,652,000	
奥村組	12,300	2,936.000	36,112,800	

東鉄工業	10,300	2,552.000	26,285,600
浅沼組	6,300	2,920.000	18,396,000
戸田建設	92,700	732.000	67,856,400
熊谷組	13,000	2,539.000	33,007,000
北野建設	3,000	2,446.000	7,338,000
矢作建設	11,300	739.000	8,350,700
ピーエス三菱	11,100	603.000	6,693,300
日本ハウスHLDGS	17,800	437.000	7,778,600
新日本建設	10,700	748.000	8,003,600
東亜道路	1,700	6,100.000	10,370,000
日本道路	1,700	6,210.000	10,557,000
東亜建設	6,800	2,354.000	16,007,200
日本国土開発	23,700	572.000	13,556,400
若築建設	3,800	2,733.000	10,385,400
東洋建設	24,800	837.000	20,757,600
五洋建設	106,900	647.000	69,164,300
世紀東急	11,200	798.000	8,937,600
福田組	2,900	4,865.000	14,108,500
住友林業	57,200	2,371.000	135,621,200
巴コーポレーション	15,100	382.000	5,768,200
大和ハウス	208,400	3,159.000	658,335,600
ライト工業	13,500	2,068.000	27,918,000
積水ハウス	233,700	2,567.000	599,907,900
日特建設	8,000	911.000	7,288,000
ユアテック	16,600	719.000	11,935,400
日本リーテック	6,300	734.000	4,624,200
四電工	1,800	1,774.000	3,193,200
中電工	10,100	2,085.000	21,058,500
関電工	38,300	868.000	33,244,400
きんでん	51,500	1,471.000	75,756,500
東京エネシス	8,500	941.000	7,998,500
トーエネック	2,700	3,420.000	9,234,000
住友電設	6,900	2,540.000	17,526,000
日本電設工業	11,900	1,695.000	20,170,500
エクシオグループ	36,400	2,127.000	77,422,800
新日本空調	4,400	1,918.000	8,439,200
九電工	18,300	3,290.000	60,207,000
三機工業	16,200	1,598.000	25,887,600
日揮ホールディングス	74,100	1,893.000	140,271,300
中外炉工業	2,600	1,597.000	4,152,200
ヤマト	10,100	690.000	6,969,000
太平電業	4,800	3,145.000	15,096,000
高砂熱学	17,800	1,794.000	31,933,200
朝日工業社	3,500	2,132.000	7,462,000
明星工業	14,000	724.000	10,136,000
大気社	8,900	3,535.000	31,461,500
ダイダン	5,100	2,200.000	11,220,000
日比谷総合設備	6,800	1,895.000	12,886,000

テスホールディングス	8,700	1,112.000	9,674,400
インフロニアHD	78,400	1,030.000	80,752,000
東洋エンジニア	11,200	582.000	6,518,400
レイズネクスト	10,500	1,255.000	13,177,500
ニッポン	19,400	1,587.000	30,787,800
日清製粉G本社	69,100	1,615.000	111,596,500
日東富士製粉	1,700	4,475.000	7,607,500
昭和産業	6,200	2,448.000	15,177,600
中部飼料	10,800	1,039.000	11,221,200
フィード・ワン	11,100	669.000	7,425,900
日本甜菜糖	5,300	1,627.000	8,623,100
DM三井製糖ホールディ	7,400	1,956.000	14,474,400
日新製糖	4,100	1,683.000	6,900,300
森永製菓	15,600	3,695.000	57,642,000
中村屋	2,900	3,110.000	9,019,000
江崎グリコ	21,600	3,585.000	77,436,000
名糖産業	1,600	1,610.000	2,576,000
井村屋グループ	4,400	2,231.000	9,816,400
不二家	5,000	2,633.000	13,165,000
山崎製パン	50,500	1,581.000	79,840,500
モロゾフ	2,700	3,590.000	9,693,000
亀田製菓	4,800	4,355.000	20,904,000
寿スピリッツ	8,000	7,770.000	62,160,000
カルビー	34,500	2,904.000	100,188,000
森永乳業	13,800	4,445.000	61,341,000
六甲バター	5,900	1,395.000	8,230,500
ヤクルト	53,500	8,750.000	468,125,000
明治ホールディングス	46,300	6,600.000	305,580,000
雪印メグミルク	18,600	1,729.000	32,159,400
プリマハム	9,900	2,041.000	20,205,900
日本ハム	29,300	3,700.000	108,410,000
丸大食品	8,600	1,425.000	12,255,000
S Foods	8,400	2,913.000	24,469,200
柿安本店	3,200	2,171.000	6,947,200
伊藤ハム米久HL DGS	53,400	684.000	36,525,600
サッポロホールディングス	24,800	3,590.000	89,032,000
アサヒグループホールディン	173,100	4,398.000	761,293,800
キリンHD	338,200	2,165.000	732,203,000
宝ホールディングス	51,000	1,068.000	54,468,000
オエノンホールディングス	25,600	282.000	7,219,200
コカ・コーラボトラーズJHD	58,900	1,460.000	85,994,000
サントリー食品インター	52,500	4,665.000	244,912,500
ダイトーグループHD	4,200	4,850.000	20,370,000
伊藤園	27,900	5,270.000	147,033,000
キーコーヒー	8,500	2,070.000	17,595,000
日清オイリオグループ	10,400	3,335.000	34,684,000
不二製油グループ	17,700	2,113.000	37,400,100
かどや製油	2,900	3,500.000	10,150,000

J - オイルミルズ	7,800	1,514.000	11,809,200
キッコーマン	49,500	7,720.000	382,140,000
味の素	183,400	4,335.000	795,039,000
ブルドックソ - ス	3,500	1,720.000	6,020,000
キュービー	40,200	2,447.000	98,369,400
ハウス食品G本社	22,900	2,714.000	62,150,600
カゴメ	35,000	3,050.000	106,750,000
焼津水産化工	11,700	832.000	9,734,400
アリアケジャパン	6,600	4,605.000	30,393,000
ニチレイ	34,600	2,781.000	96,222,600
東洋水産	37,800	5,770.000	218,106,000
イトアンドHLDGS	3,900	2,232.000	8,704,800
日清食品HD	26,600	10,480.000	278,768,000
永谷園ホールディングス	4,100	2,003.000	8,212,300
フジッコ	7,800	1,895.000	14,781,000
ロックフィールド	9,600	1,476.000	14,169,600
日本たばこ産業	492,900	2,815.500	1,387,759,950
ケンコーマヨネーズ	5,500	1,651.000	9,080,500
わらべや日洋HD	6,100	1,848.000	11,272,800
なとり	5,200	2,060.000	10,712,000
ファーマフーズ	11,800	1,285.000	15,163,000
ユーグレナ	49,300	901.000	44,419,300
紀文食品	6,900	943.000	6,506,700
ピクルスホールディングス	1,500	1,083.000	1,624,500
ミヨシ油脂	3,800	986.000	3,746,800
理研ビタミン	6,800	1,776.000	12,076,800
片倉工業	8,200	1,975.000	16,195,000
グンゼ	5,800	3,980.000	23,084,000
東洋紡	34,300	1,035.000	35,500,500
ユニチカ	27,800	268.000	7,450,400
富士紡ホールディングス	3,200	3,385.000	10,832,000
倉敷紡績	6,100	2,179.000	13,291,900
シキボウ	7,900	878.000	6,936,200
日本毛織	22,200	1,008.000	22,377,600
帝国繊維	9,000	1,663.000	14,967,000
帝人	73,500	1,328.000	97,608,000
東レ	511,500	738.600	377,793,900
アツギ	3,000	380.000	1,140,000
ダイニック	6,300	619.000	3,899,700
セーレン	14,700	2,623.000	38,558,100
小松マテーレ	12,300	799.000	9,827,700
ワコールホールディングス	14,900	2,329.000	34,702,100
ホギメディカル	10,300	3,490.000	35,947,000
T S Iホールディングス	29,100	481.000	13,997,100
ワールド	10,400	1,315.000	13,676,000
三陽商会	4,000	1,322.000	5,288,000
オンワードホールディングス	52,100	330.000	17,193,000
ルックホールディングス	3,400	2,497.000	8,489,800

ゴ-ルドウイン	13,400	9,420.000	126,228,000
デサント	13,100	3,350.000	43,885,000
特種東海製紙	4,300	2,833.000	12,181,900
王子ホールディングス	316,800	528.000	167,270,400
日本製紙	40,300	965.000	38,889,500
北越コーポレーション	48,300	777.000	37,529,100
大王製紙	34,200	1,064.000	36,388,800
レンゴー	70,500	866.000	61,053,000
トーモク	5,400	1,600.000	8,640,000
ザ・パック	6,000	2,521.000	15,126,000
北の達人コーポ	34,500	302.000	10,419,000
ク ラ レ	121,000	1,096.000	132,616,000
旭 化 成	475,300	1,019.000	484,330,700
昭和電工	73,700	2,188.000	161,255,600
住友化学	562,900	498.000	280,324,200
住友精化	3,300	4,240.000	13,992,000
日産化学	36,100	6,740.000	243,314,000
ラサ工業	3,400	2,117.000	7,197,800
クレハ	6,500	9,730.000	63,245,000
多木化学	3,000	5,250.000	15,750,000
テイカ	5,400	1,275.000	6,885,000
石原産業	14,300	1,121.000	16,030,300
日本曹達	8,200	4,280.000	35,096,000
東ソー	101,200	1,623.000	164,247,600
トクヤマ	25,000	1,913.000	47,825,000
セントラル硝子	12,300	3,495.000	42,988,500
東亜合成	38,800	1,177.000	45,667,600
大阪ソーダ	4,600	4,130.000	18,998,000
関東電化	15,300	1,026.000	15,697,800
デンカ	27,700	3,310.000	91,687,000
信越化学	130,300	17,570.000	2,289,371,000
日本カ-バイド	4,400	1,307.000	5,750,800
堺 化 学	6,200	1,879.000	11,649,800
第一稀元素化学工	7,600	1,203.000	9,142,800
エア・ウォーター	71,800	1,615.000	115,957,000
日本酸素HLDGS	73,300	2,273.000	166,610,900
日本化学工業	3,200	1,858.000	5,945,600
日本パ-カラijing	36,600	991.000	36,270,600
高压ガス	12,000	648.000	7,776,000
四国化成	9,200	1,351.000	12,429,200
ステラ ケミファ	4,800	2,617.000	12,561,600
保土谷化学	2,500	3,105.000	7,762,500
日本触媒	11,600	5,510.000	63,916,000
大日精化	5,700	1,717.000	9,786,900
カネカ	17,200	3,500.000	60,200,000
三菱瓦斯化学	56,500	1,961.000	110,796,500
三井化学	63,700	3,100.000	197,470,000
J S R	71,200	2,873.000	204,557,600

東京応化工業	13,300	6,840.000	90,972,000
大阪有機化学	5,900	2,113.000	12,466,700
三菱ケミカルグループ	515,300	729.200	375,756,760
K Hネオケム	12,700	2,767.000	35,140,900
ダイセル	112,200	998.000	111,975,600
住友ベークライト	11,200	4,320.000	48,384,000
積水化学	157,200	1,927.000	302,924,400
日本ゼオン	45,700	1,325.000	60,552,500
アイカ工業	19,200	3,235.000	62,112,000
U B E	39,300	1,999.000	78,560,700
積水樹脂	10,700	1,809.000	19,356,300
タキロンシーアイ	16,800	508.000	8,534,400
旭有機材	5,200	2,654.000	13,800,800
ニチバン	5,300	1,754.000	9,296,200
リケンテクノス	17,400	499.000	8,682,600
大倉工業	4,000	2,014.000	8,056,000
群栄化学	2,200	2,424.000	5,332,800
ミライアル	3,600	1,716.000	6,177,600
ダイキョーニシカワ	17,400	590.000	10,266,000
森六ホールディングス	4,400	1,757.000	7,730,800
恵和	2,500	3,725.000	9,312,500
日本化薬	58,100	1,248.000	72,508,800
カーリットホールディングス	8,500	719.000	6,111,500
日本精化	4,300	2,238.000	9,623,400
扶桑化学工業	6,900	3,525.000	24,322,500
トリケミカル	10,300	2,411.000	24,833,300
A D E K A	26,200	2,252.000	59,002,400
日油	23,500	5,780.000	135,830,000
新日本理化	19,100	255.000	4,870,500
ハリマ化成グループ	6,600	841.000	5,550,600
花王	185,700	5,461.000	1,014,107,700
第一工業製薬	3,400	2,009.000	6,830,600
石原ケミカル	4,100	1,234.000	5,059,400
ニイタカ	2,100	2,095.000	4,399,500
三洋化成	4,500	4,405.000	19,822,500
大日本塗料	11,800	767.000	9,050,600
日本ペイントHOLD	336,900	1,120.000	377,328,000
関西ペイント	70,000	1,877.000	131,390,000
中国塗料	14,900	1,033.000	15,391,700
日本特殊塗料	6,200	872.000	5,406,400
藤倉化成	4,000	409.000	1,636,000
太陽ホールディングス	11,500	2,539.000	29,198,500
D I C	29,700	2,506.000	74,428,200
サカタインクス	17,000	1,105.000	18,785,000
東洋インキS Cホールディン	14,300	1,880.000	26,884,000
T & K T O K A	7,400	1,002.000	7,414,800
富士フイルムH L D G S	146,300	7,315.000	1,070,184,500
資生堂	159,400	5,799.000	924,360,600

ライオン	92,100	1,465.000	134,926,500
高砂香料	5,200	2,844.000	14,788,800
マンダム	17,000	1,438.000	24,446,000
ミルボン	11,400	5,700.000	64,980,000
ファンケル	33,400	2,566.000	85,704,400
コーセー	15,500	14,490.000	224,595,000
コタ	6,300	1,683.000	10,602,900
ポーラ・オルビスHD	39,300	1,786.000	70,189,800
ノエビアホールディングス	6,800	5,830.000	39,644,000
新日本製薬	4,800	1,373.000	6,590,400
エステー	6,600	1,538.000	10,150,800
コニシ	12,600	1,723.000	21,709,800
長谷川香料	15,700	3,075.000	48,277,500
小林製薬	23,300	8,500.000	198,050,000
荒川化学工業	7,500	995.000	7,462,500
メック	6,300	2,571.000	16,197,300
日本高純度化学	2,400	2,504.000	6,009,600
タカラバイオ	20,500	1,801.000	36,920,500
JCU	8,600	3,370.000	28,982,000
新田ゼラチン	5,900	1,076.000	6,348,400
OATアグリオ	3,500	1,776.000	6,216,000
デクセリアルズ	22,100	3,230.000	71,383,000
アース製薬	6,900	5,320.000	36,708,000
北興化学	9,700	909.000	8,817,300
大成ラミック	3,900	3,075.000	11,992,500
クミアイ化学	30,700	923.000	28,336,100
日本農薬	14,500	749.000	10,860,500
アキレス	6,000	1,351.000	8,106,000
有沢製作所	13,000	1,284.000	16,692,000
日東電工	55,200	8,610.000	475,272,000
レック	11,800	813.000	9,593,400
三光合成	12,500	459.000	5,737,500
きもと	19,400	238.000	4,617,200
藤森工業	5,900	3,195.000	18,850,500
前澤化成工業	6,200	1,385.000	8,587,000
未来工業	3,200	1,488.000	4,761,600
ジェイ エス ピー	5,600	1,487.000	8,327,200
エフピコ	14,600	3,785.000	55,261,000
天馬	6,400	2,083.000	13,331,200
信越ポリマー	13,800	1,247.000	17,208,600
東リ	9,100	211.000	1,920,100
ニフコ	27,400	3,590.000	98,366,000
バルカー	6,500	2,730.000	17,745,000
ユニ・チャーム	159,000	5,083.000	808,197,000
協和キリン	91,800	3,175.000	291,465,000
武田薬品	675,000	4,050.000	2,733,750,000
アステラス製薬	730,900	2,128.000	1,555,355,200
住友ファーマ	56,900	1,067.000	60,712,300

塩野義製薬	97,600	6,950.000	678,320,000
日本新薬	18,000	8,090.000	145,620,000
中外製薬	238,500	3,624.000	864,324,000
科研製薬	13,300	3,940.000	52,402,000
エーザイ	92,900	9,332.000	866,942,800
ロート製薬	37,000	4,490.000	166,130,000
小野薬品	147,300	3,516.000	517,906,800
久光製薬	17,200	3,870.000	66,564,000
持田製薬	8,900	3,380.000	30,082,000
参天製薬	144,000	1,114.000	160,416,000
扶桑薬品	3,200	2,047.000	6,550,400
ツムラ	24,100	2,999.000	72,275,900
キッセイ薬品工業	11,800	2,534.000	29,901,200
生化学工業	13,500	943.000	12,730,500
栄研化学	11,900	1,903.000	22,645,700
鳥居薬品	4,000	2,902.000	11,608,000
JCRファーマ	26,200	1,912.000	50,094,400
東和薬品	11,900	2,112.000	25,132,800
富士製薬工業	6,600	1,019.000	6,725,400
ゼリア新薬工業	10,500	2,226.000	23,373,000
第一三共	664,400	4,518.000	3,001,759,200
キョーリン製薬HD	16,600	1,770.000	29,382,000
大幸薬品	15,900	523.000	8,315,700
ダイト	5,400	2,594.000	14,007,600
大塚ホールディングス	174,400	4,690.000	817,936,000
大正製薬HD	17,500	5,600.000	98,000,000
ペプチドリーム	37,400	1,712.000	64,028,800
あすか製薬HD	8,400	1,279.000	10,743,600
サワイグループHD	17,400	4,240.000	73,776,000
日本コークス工業	81,600	88.000	7,180,800
ニチレキ	9,400	1,295.000	12,173,000
ユシロ化学	10,500	828.000	8,694,000
富士石油	20,000	275.000	5,500,000
出光興産	84,400	3,240.000	273,456,000
ENEOSホールディングス	1,378,600	466.000	642,427,600
コスモエネルギーHLDGS	29,000	3,880.000	112,520,000
横浜ゴム	43,300	2,255.000	97,641,500
TOYO TIRE	44,100	1,567.000	69,104,700
ブリヂストン	243,500	5,167.000	1,258,164,500
住友ゴム	75,200	1,188.000	89,337,600
藤倉コンポジット	6,600	847.000	5,590,200
オカモト	4,500	3,850.000	17,325,000
ニッタ	7,600	2,930.000	22,268,000
住友理工	15,600	616.000	9,609,600
三ツ星ベルト	11,300	3,430.000	38,759,000
バンドー化学	12,700	999.000	12,687,300
日東紡績	9,400	2,184.000	20,529,600
AGC	77,400	4,600.000	356,040,000

日本電気硝子	31,500	2,532.000	79,758,000
オハラ	5,000	1,265.000	6,325,000
住友大阪セメント	11,300	3,235.000	36,555,500
太平洋セメント	49,100	2,167.000	106,399,700
日本ヒュ - ム	9,500	648.000	6,156,000
日本コンクリ - ト	22,500	234.000	5,265,000
三谷セキサン	3,600	4,210.000	15,156,000
アジアパイルHD	15,100	536.000	8,093,600
東海カーボン	64,800	1,047.000	67,845,600
日本カーボン	4,600	4,335.000	19,941,000
東洋炭素	4,900	3,930.000	19,257,000
ノリタケ	4,200	4,040.000	16,968,000
TOTO	50,200	4,745.000	238,199,000
日本碍子	89,700	1,811.000	162,446,700
日本特殊陶業	58,200	2,680.000	155,976,000
MARUWA	3,000	18,820.000	56,460,000
品川リフラクトリーズ	2,300	3,945.000	9,073,500
黒崎播磨	1,800	5,030.000	9,054,000
ヨータイ	5,000	1,376.000	6,880,000
東京窯業	22,500	270.000	6,075,000
フジインコーポレーテッド	6,500	7,020.000	45,630,000
ニチアス	20,000	2,418.000	48,360,000
ニチハ	9,900	2,823.000	27,947,700
日本製鉄	351,200	2,192.500	770,006,000
神戸製鋼所	173,000	620.000	107,260,000
中山製鋼所	17,300	755.000	13,061,500
合同製鐵	4,400	1,903.000	8,373,200
JFEホールディングス	215,000	1,526.000	328,090,000
東京製鐵	21,900	1,403.000	30,725,700
共英製鋼	13,000	1,293.000	16,809,000
大和工業	14,800	4,710.000	69,708,000
東京鐵鋼	4,500	1,412.000	6,354,000
大阪製鐵	5,600	1,135.000	6,356,000
淀川製鋼所	8,400	2,543.000	21,361,200
丸一鋼管	27,200	2,843.000	77,329,600
モリ工業	2,800	2,813.000	7,876,400
大同特殊鋼	12,000	4,415.000	52,980,000
日本冶金工	5,900	4,305.000	25,399,500
山陽特殊製鋼	7,600	2,213.000	16,818,800
愛知製鋼	7,000	2,273.000	15,911,000
大平洋金属	8,000	2,050.000	16,400,000
新日本電工	52,100	422.000	21,986,200
栗本鉄工所	4,400	1,796.000	7,902,400
三菱製鋼	6,100	995.000	6,069,500
日本精線	2,000	4,365.000	8,730,000
エンビプロHD	10,000	720.000	7,200,000
新家工業	3,100	2,312.000	7,167,200
大紀アルミニウム	11,100	1,295.000	14,374,500

日本軽金属HD	21,700	1,532.000	33,244,400
三井金属	22,900	3,135.000	71,791,500
東邦亜鉛	5,100	2,159.000	11,010,900
三菱マテリアル	52,600	2,187.000	115,036,200
住友鉱山	91,100	4,645.000	423,159,500
DOWAホールディングス	17,900	4,520.000	80,908,000
古河機金	11,100	1,291.000	14,330,100
大阪チタニウム	11,700	4,195.000	49,081,500
東邦チタニウム	14,400	2,748.000	39,571,200
UACJ	11,100	2,305.000	25,585,500
CKサンエツ	2,200	4,225.000	9,295,000
古河電工	26,300	2,597.000	68,301,100
住友電工	270,600	1,600.500	433,095,300
フジクラ	85,300	1,117.000	95,280,100
昭和電線HLDGS	8,900	1,795.000	15,975,500
タツタ電線	16,100	431.000	6,939,100
平河ヒューテック	5,000	1,098.000	5,490,000
リョービ	8,900	1,243.000	11,062,700
アサヒHD	31,700	2,044.000	64,794,800
稲葉製作所	8,900	1,387.000	12,344,300
宮地エンジニアリングG	2,500	3,405.000	8,512,500
トーカロ	21,400	1,242.000	26,578,800
アルファCO	7,400	957.000	7,081,800
SUMCO	149,400	2,023.000	302,236,200
川田テクノロジーズ	2,200	3,370.000	7,414,000
RS TECHNOLOGIES	2,600	8,200.000	21,320,000
信和	11,200	789.000	8,836,800
東洋製罐グループHD	52,000	1,594.000	82,888,000
ホッカンホールディングス	5,800	1,323.000	7,673,400
横河ブリッジHLDGS	10,300	1,933.000	19,909,900
三和ホールディングス	72,000	1,290.000	92,880,000
文化シャッター-	22,600	1,124.000	25,402,400
三協立山	12,500	565.000	7,062,500
アルインコ	7,500	1,000.000	7,500,000
LIXIL	114,200	2,109.000	240,847,800
ノーリツ	11,700	1,484.000	17,362,800
長府製作所	7,900	1,972.000	15,578,800
リンナイ	14,200	10,180.000	144,556,000
日東精工	12,500	523.000	6,537,500
岡部	14,200	719.000	10,209,800
ジーテクト	8,600	1,534.000	13,192,400
東プレ	13,900	1,259.000	17,500,100
高周波熱錬	14,500	680.000	9,860,000
東京製網	5,800	891.000	5,167,800
サンコール	8,400	636.000	5,342,400
モリテックスチル	8,800	245.000	2,156,000
パイオラックス	11,100	1,740.000	19,314,000
日本発条	69,500	915.000	63,592,500

三益半導体	7,000	2,558.000	17,906,000
日本製鋼所	21,400	2,920.000	62,488,000
三浦工業	32,200	3,260.000	104,972,000
タクマ	24,000	1,276.000	30,624,000
ツガミ	17,400	1,184.000	20,601,600
オークマ	7,700	5,210.000	40,117,000
芝浦機械	8,700	2,742.000	23,855,400
アマダ	121,600	1,098.000	133,516,800
アイダエンジニア	16,300	835.000	13,610,500
F U J I	33,300	2,074.000	69,064,200
牧野フライス	8,500	4,615.000	39,227,500
オーエスジー	36,900	1,936.000	71,438,400
旭ダイヤモンド	23,100	720.000	16,632,000
D M G 森精機	46,800	1,831.000	85,690,800
ソディック	21,000	763.000	16,023,000
ディスコ	12,300	40,600.000	499,380,000
日東工器	4,400	1,526.000	6,714,400
日進工具	6,700	1,127.000	7,550,900
パンチ工業	3,300	421.000	1,389,300
豊和工業	6,500	881.000	5,726,500
石川製作所	3,500	1,451.000	5,078,500
島精機製作所	12,300	2,092.000	25,731,600
オプトラン	11,600	2,547.000	29,545,200
N C ホールディングス	2,500	2,096.000	5,240,000
イワキポンプ	5,700	1,307.000	7,449,900
フリー	8,900	1,155.000	10,279,500
ヤマシンフィルタ	20,400	482.000	9,832,800
日阪製作所	9,100	818.000	7,443,800
やまびこ	13,100	1,134.000	14,855,400
野村マイクロ・サイエンス	2,600	4,705.000	12,233,000
平田機工	3,800	5,470.000	20,786,000
ベガサスミシン製造	9,600	967.000	9,283,200
マルマエ	4,200	1,901.000	7,984,200
タツモ	5,000	1,766.000	8,830,000
ナブテスコ	48,400	3,410.000	165,044,000
三井海洋開発	9,900	1,529.000	15,137,100
レオン自動機	8,700	1,170.000	10,179,000
S M C	24,900	61,760.000	1,537,824,000
ホソカワミクロン	6,100	2,944.000	17,958,400
ユニオンツール	3,300	3,510.000	11,583,000
オイレス工業	10,900	1,494.000	16,284,600
日精エーエスビー	3,600	4,210.000	15,156,000
サト - ホールディングス	11,100	1,954.000	21,689,400
技研製作所	8,200	3,285.000	26,937,000
日本エアーテック	5,300	1,172.000	6,211,600
日精樹脂工業	7,200	957.000	6,890,400
オカダアイヨン	1,400	1,547.000	2,165,800
ワイエイシイホールディングス	4,100	1,466.000	6,010,600

小松製作所	360,000	3,179.000	1,144,440,000
住友重機械	45,300	2,912.000	131,913,600
日立建機	30,600	3,210.000	98,226,000
日 工	13,700	620.000	8,494,000
巴工業	4,000	2,418.000	9,672,000
井関農機	8,500	1,277.000	10,854,500
TOWA	8,100	1,969.000	15,948,900
ローツェ	4,000	8,390.000	33,560,000
クボタ	406,500	2,030.000	825,195,000
荏原実業	4,000	2,267.000	9,068,000
三菱化工機	3,100	2,116.000	6,559,600
月島機械	11,600	981.000	11,379,600
帝国電機製作所	6,100	2,367.000	14,438,700
新東工業	17,100	670.000	11,457,000
渋谷工業	7,200	2,478.000	17,841,600
アイチ コーポレーション	11,500	800.000	9,200,000
小森コーポレーション	19,200	814.000	15,628,800
鶴見製作所	6,100	1,996.000	12,175,600
酒井重工業	1,800	3,525.000	6,345,000
荏原製作所	31,400	5,260.000	165,164,000
西島製作所	7,700	1,550.000	11,935,000
北越工業	8,800	1,153.000	10,146,400
ダイキン工業	91,700	22,405.000	2,054,538,500
オルガノ	10,500	2,818.000	29,589,000
ト - ヨ - カネツ	3,700	2,487.000	9,201,900
栗田工業	42,900	6,100.000	261,690,000
椿本チエイン	10,600	3,145.000	33,337,000
大同工業	7,900	770.000	6,083,000
木村化工機	8,600	700.000	6,020,000
アネスト岩田	13,900	944.000	13,121,600
ダイフク	39,600	7,040.000	278,784,000
サムコ	2,700	3,865.000	10,435,500
タダノ	41,400	980.000	40,572,000
フジテック	28,200	3,010.000	84,882,000
C K D	21,300	2,043.000	43,515,900
平和	25,800	2,445.000	63,081,000
理想科学工業	7,000	2,378.000	16,646,000
SANKYO	15,300	5,360.000	82,008,000
日本金銭機械	10,500	1,014.000	10,647,000
マースグループHLDGS	5,500	2,050.000	11,275,000
フクシマガリレイ	5,700	4,350.000	24,795,000
ダイコク電機	5,400	1,606.000	8,672,400
竹内製作所	14,000	3,175.000	44,450,000
ア マ ノ	22,000	2,475.000	54,450,000
JUKI	13,800	671.000	9,259,800
ジャノメ	9,800	620.000	6,076,000
マックス	9,400	2,059.000	19,354,600
グローリー	20,400	2,304.000	47,001,600

新晃工業	8,300	1,548.000	12,848,400
大和冷機工業	11,600	1,225.000	14,210,000
セガサミーホールディングス	62,000	1,823.000	113,026,000
日本ピストンリング	1,200	1,208.000	1,449,600
リケン	3,800	2,277.000	8,652,600
TPR	9,800	1,232.000	12,073,600
ツバキ・ナカシマ	18,000	1,035.000	18,630,000
ホシザキ	49,500	4,635.000	229,432,500
大豊工業	8,000	699.000	5,592,000
日本精工	141,200	760.000	107,312,000
NTN	155,100	290.000	44,979,000
ジェイテクト	68,000	1,010.000	68,680,000
不二越	5,700	3,870.000	22,059,000
日本トムソン	20,400	609.000	12,423,600
THK	44,400	2,669.000	118,503,600
前澤給装工業	6,800	933.000	6,344,400
イーグル工業	9,200	1,109.000	10,202,800
日本ピラ - 工業	7,300	2,765.000	20,184,500
キット	29,000	844.000	24,476,000
マキタ	95,900	3,130.000	300,167,000
日立造船	63,500	896.000	56,896,000
三菱重工業	134,500	5,457.000	733,966,500
IHI	48,500	3,760.000	182,360,000
スター精密	14,600	1,755.000	25,623,000
日清紡ホールディングス	63,300	1,014.000	64,186,200
イビデン	44,000	5,510.000	242,440,000
コニカミノルタ	173,400	569.000	98,664,600
ブラザー工業	102,200	2,214.000	226,270,800
ミネベアミツミ	133,000	2,243.000	298,319,000
日立	385,500	7,299.000	2,813,764,500
東芝	147,900	4,690.000	693,651,000
三菱電機	793,700	1,377.500	1,093,321,750
富士電機	46,600	5,620.000	261,892,000
安川電機	90,900	4,445.000	404,050,500
シンフォニアテクノロジー	9,200	1,507.000	13,864,400
明電舎	12,000	1,987.000	23,844,000
オリジン	3,700	1,316.000	4,869,200
山洋電気	3,500	6,200.000	21,700,000
デンヨー	6,600	1,500.000	9,900,000
PHCホールディングス	10,900	1,595.000	17,385,500
ソシオネクスト	7,500	6,670.000	50,025,000
東芝テック	11,400	3,695.000	42,123,000
芝浦メカトロニクス	1,500	10,980.000	16,470,000
マブチモーター	19,000	4,130.000	78,470,000
日本電産	186,600	8,534.000	1,592,444,400
トレックス・セミコンダクター	3,900	2,926.000	11,411,400
東光高岳	5,200	1,847.000	9,604,400
ダブル・スコープ	19,500	1,868.000	36,426,000

ダイヘン	7,100	4,080.000	28,968,000
ヤーマン	15,700	1,306.000	20,504,200
JVCケンウッド	75,600	370.000	27,972,000
ミマキエンジニアリング	8,500	654.000	5,559,000
I - P E X	5,300	1,309.000	6,937,700
日新電機	18,100	1,341.000	24,272,100
大崎電気	21,400	533.000	11,406,200
オムロン	70,400	7,044.000	495,897,600
日東工業	10,500	2,331.000	24,475,500
I D E C	11,500	3,265.000	37,547,500
ジーエス・ユアサ コーポ	25,600	2,161.000	55,321,600
メルコホールディングス	2,300	3,110.000	7,153,000
日本電気	108,600	4,855.000	527,253,000
富士通	76,500	18,465.000	1,412,572,500
沖電気	36,600	728.000	26,644,800
電気興業	4,000	2,100.000	8,400,000
サンケン電気	7,200	6,630.000	47,736,000
アイホン	5,100	1,917.000	9,776,700
ルネサスエレクトロニクス	500,900	1,316.000	659,184,400
セイコーエプソン	102,200	2,152.000	219,934,400
ワコム	61,400	648.000	39,787,200
アルバック	18,300	5,930.000	108,519,000
アクセル	4,000	1,507.000	6,028,000
E I Z O	5,800	3,595.000	20,851,000
日本信号	17,800	1,033.000	18,387,400
京三製作所	19,400	414.000	8,031,600
能美防災	10,400	1,590.000	16,536,000
ホーチキ	6,400	1,445.000	9,248,000
エレコム	18,500	1,452.000	26,862,000
パナソニック ホールディング	907,300	1,274.000	1,155,900,200
シャープ	92,800	973.000	90,294,400
アンリツ	54,600	1,466.000	80,043,600
富士通ゼネラル	21,900	3,235.000	70,846,500
ソニーグループ	537,900	11,255.000	6,054,064,500
T D K	121,600	4,880.000	593,408,000
帝国通信工業	4,300	1,403.000	6,032,900
タムラ製作所	34,100	816.000	27,825,600
アルプスアルパイン	69,600	1,302.000	90,619,200
日本電波工業	9,600	1,745.000	16,752,000
鈴木	3,000	919.000	2,757,000
メイコー	8,600	3,005.000	25,843,000
日本トリム	2,400	2,462.000	5,908,800
ローランド ディー . ジー .	4,500	3,085.000	13,882,500
フオスタ - 電機	9,100	961.000	8,745,100
S M K	2,300	2,639.000	6,069,700
ヨコオ	6,400	2,414.000	15,449,600
ホシデン	18,700	1,626.000	30,406,200
ヒロセ電機	12,700	18,200.000	231,140,000

日本航空電子	15,700	2,347.000	36,847,900
T O A	10,300	766.000	7,889,800
マクセル	17,400	1,410.000	24,534,000
古野電気	10,700	1,020.000	10,914,000
スミダコーポレーション	8,000	1,462.000	11,696,000
アイコム	3,200	2,785.000	8,912,000
リオン	3,600	2,050.000	7,380,000
横河電機	84,000	2,566.000	215,544,000
新電元工業	3,200	3,335.000	10,672,000
アズビル	53,100	4,175.000	221,692,500
東亜ディーケーケー	7,600	849.000	6,452,400
日本光電工業	35,300	3,195.000	112,783,500
チノール	4,200	1,840.000	7,728,000
日本電子材料	6,400	1,542.000	9,868,800
堀場製作所	17,000	6,240.000	106,080,000
アドバンテスト	59,800	9,130.000	545,974,000
エスベック	6,600	2,058.000	13,582,800
キーエンス	76,100	57,140.000	4,348,354,000
日置電機	4,000	6,820.000	27,280,000
シスメックス	65,500	8,318.000	544,829,000
日本マイクロニクス	12,900	1,459.000	18,821,100
メガチップス	6,500	2,645.000	17,192,500
O B A R A G R O U P	4,400	3,485.000	15,334,000
コーセル	11,500	851.000	9,786,500
イリソ電子工業	7,100	4,760.000	33,796,000
オブテックスグループ	14,300	2,146.000	30,687,800
千代田インテグレ	4,300	2,407.000	10,350,100
レーザーテック	37,500	25,135.000	942,562,500
スタンレー電気	54,000	2,793.000	150,822,000
岩崎電気	3,100	2,546.000	7,892,600
ウシオ電機	40,000	1,782.000	71,280,000
ヘリオステクノH	11,500	446.000	5,129,000
エノモト	2,500	1,942.000	4,855,000
日本セラミック	8,000	2,647.000	21,176,000
古河電池	6,200	1,123.000	6,962,600
双信電機	2,800	425.000	1,190,000
山一電機	7,100	1,845.000	13,099,500
図研	6,700	3,290.000	22,043,000
日本電子	19,000	4,560.000	86,640,000
カシオ	57,100	1,340.000	76,514,000
ファナック	74,600	20,365.000	1,519,229,000
日本シイエムケイ	18,600	578.000	10,750,800
エンプラス	2,400	4,470.000	10,728,000
大真空	10,200	839.000	8,557,800
ローム	35,100	10,850.000	380,835,000
浜松ホトニクス	60,800	7,160.000	435,328,000
三井ハイテック	7,900	7,960.000	62,884,000
新光電気工業	26,800	3,805.000	101,974,000

京セラ	118,100	6,981.000	824,456,100
太陽誘電	37,000	4,365.000	161,505,000
村田製作所	230,500	7,464.000	1,720,452,000
双葉電子工業	17,600	592.000	10,419,200
北陸電気工業	1,600	1,290.000	2,064,000
ニチコン	15,900	1,414.000	22,482,600
日本ケミコン	8,100	1,841.000	14,912,100
K O A	11,800	2,199.000	25,948,200
市光工業	12,900	426.000	5,495,400
小糸製作所	91,100	2,165.000	197,231,500
ミツバ	16,500	533.000	8,794,500
S C R E E Nホールディングス	13,000	9,030.000	117,390,000
キャノン電子	8,700	1,580.000	13,746,000
キャノン	417,300	3,212.000	1,340,367,600
リコー	190,000	1,086.000	206,340,000
象印マホービン	22,700	1,599.000	36,297,300
東京エレクトロン	53,600	45,090.000	2,416,824,000
イノテック	6,000	1,302.000	7,812,000
トヨタ紡織	32,000	1,911.000	61,152,000
ユニプレス	15,000	882.000	13,230,000
豊田自動織機	55,300	7,810.000	431,893,000
モリタホールディングス	14,000	1,266.000	17,724,000
三桜工業	12,500	669.000	8,362,500
デンソー	156,700	7,514.000	1,177,443,800
東海理化電機	20,900	1,552.000	32,436,800
川崎重工業	57,600	2,926.000	168,537,600
日本車輛	3,700	1,965.000	7,270,500
三菱ロジスネクスト	14,000	894.000	12,516,000
日産自動車	1,081,700	491.200	531,331,040
いすゞ自動車	220,600	1,794.000	395,756,400
トヨタ自動車	4,175,600	2,010.500	8,395,043,800
日野自動車	99,000	620.000	61,380,000
三菱自動車工業	297,800	636.000	189,400,800
武蔵精密工業	18,600	1,768.000	32,884,800
日産車体	13,700	832.000	11,398,400
新明和工業	24,700	1,013.000	25,021,100
極東開発工業	13,700	1,363.000	18,673,100
トピー工業	6,900	1,730.000	11,937,000
ティラド	2,500	2,648.000	6,620,000
曙ブレーキ	53,400	165.000	8,811,000
タチエス	13,100	1,096.000	14,357,600
N O K	30,000	1,264.000	37,920,000
フタバ産業	24,000	375.000	9,000,000
K Y B	7,400	3,625.000	26,825,000
大同メタル工業	19,600	495.000	9,702,000
プレス工業	35,700	451.000	16,100,700
ミクニ	13,500	340.000	4,590,000
太平洋工業	17,900	1,079.000	19,314,100

アイシン	58,300	3,765.000	219,499,500
マツダ	252,000	1,091.000	274,932,000
本田技研	618,000	3,356.000	2,074,008,000
スズキ	139,800	4,913.000	686,837,400
SUBARU	241,100	2,351.500	566,946,650
ヤマハ発動機	119,200	3,415.000	407,068,000
T B K	18,500	261.000	4,828,500
エクセディ	12,700	1,668.000	21,183,600
豊田合成	22,200	2,282.000	50,660,400
愛三工業	13,800	702.000	9,687,600
日本プラスト	15,900	427.000	6,789,300
ヨロズ	9,000	805.000	7,245,000
エフ・シー・シー	13,400	1,425.000	19,095,000
シマノ	31,100	23,380.000	727,118,000
テイ・エス テック	34,900	1,607.000	56,084,300
ジャムコ	2,400	1,611.000	3,866,400
テルモ	237,500	4,043.000	960,212,500
日機装	19,500	1,001.000	19,519,500
日本エム・ディ・エム	5,000	1,036.000	5,180,000
島津製作所	92,300	4,180.000	385,814,000
長野計器	6,400	1,155.000	7,392,000
ブイ・テクノロジー	4,100	2,693.000	11,041,300
東京計器	7,000	1,177.000	8,239,000
愛知時計	3,800	1,369.000	5,202,200
インターアクション	5,100	1,583.000	8,073,300
オーバル	8,000	502.000	4,016,000
東京精密	16,600	4,340.000	72,044,000
マニー	33,600	2,260.000	75,936,000
ニコン	118,400	1,334.000	157,945,600
トプコン	40,300	1,647.000	66,374,100
オリンパス	475,400	2,806.000	1,333,972,400
理研計器	4,800	5,000.000	24,000,000
タムロン	5,700	3,465.000	19,750,500
H O Y A	164,300	14,060.000	2,310,058,000
ノーリツ鋼機	7,300	2,634.000	19,228,200
A & Dホロンホールディングス	11,100	1,043.000	11,577,300
朝日インテック	100,500	2,414.000	242,607,000
シチズン時計	83,700	600.000	50,220,000
リズム	3,000	1,764.000	5,292,000
メニコン	26,200	2,905.000	76,111,000
松風	3,700	2,430.000	8,991,000
セイコーグループ	11,800	3,165.000	37,347,000
ニプロ	64,500	1,017.000	65,596,500
スノーピーク	13,300	2,265.000	30,124,500
パラマウントベッドHD	17,300	2,681.000	46,381,300
トランザクション	6,600	1,286.000	8,487,600
ニホンフラッシュ	7,800	965.000	7,527,000
前田工織	8,400	3,245.000	27,258,000

永大産業	27,200	226.000	6,147,200
アートネイチャー	8,900	777.000	6,915,300
バンダイナムコHLDGS	69,400	9,045.000	627,723,000
SHOEI	8,000	5,540.000	44,320,000
フランスベッドHLDGS	10,600	932.000	9,879,200
パイロットコーポレーション	11,900	4,950.000	58,905,000
萩原工業	6,500	1,063.000	6,909,500
フジシールインターナショナル	15,500	1,869.000	28,969,500
タカラトミー	35,300	1,256.000	44,336,800
広済堂ホールディングス	5,500	1,945.000	10,697,500
プロネクサス	7,500	966.000	7,245,000
ウッドワン	5,000	932.000	4,660,000
大建工業	5,000	2,138.000	10,690,000
凸版印刷	98,900	2,132.000	210,854,800
大日本印刷	89,800	2,841.000	255,121,800
共同印刷	2,700	2,904.000	7,840,800
NISSHA	14,600	1,759.000	25,681,400
TAKARA & COMPANY	5,800	2,089.000	12,116,200
アシックス	70,300	2,955.000	207,736,500
ローランド	5,700	4,060.000	23,142,000
小松ウオール工業	3,000	1,840.000	5,520,000
ヤマハ	47,800	5,410.000	258,598,000
河合楽器	2,200	2,579.000	5,673,800
クリナップ	9,700	670.000	6,499,000
ビジョン	49,000	2,044.000	100,156,000
キングジム	7,900	894.000	7,062,600
リンテック	15,200	2,248.000	34,169,600
イトーキ	18,100	535.000	9,683,500
任天堂	480,200	5,894.000	2,830,298,800
三菱鉛筆	10,900	1,394.000	15,194,600
タカラスタンダ-ド	14,200	1,324.000	18,800,800
コクヨ	36,500	1,807.000	65,955,500
ナカバヤシ	3,300	501.000	1,653,300
グローブライド	6,200	2,678.000	16,603,600
オカムラ	22,500	1,415.000	31,837,500
美津濃	7,600	2,869.000	21,804,400
東京電力HD	686,300	499.000	342,463,700
中部電力	278,900	1,288.000	359,223,200
関西電力	292,300	1,166.000	340,821,800
中国電力	121,900	715.000	87,158,500
北陸電力	73,700	537.000	39,576,900
東北電力	186,200	653.000	121,588,600
四国電力	65,800	753.000	49,547,400
九州電力	174,300	718.000	125,147,400
北海道電力	75,200	454.000	34,140,800
沖縄電力	19,100	1,054.000	20,131,400
電源開発	57,500	2,118.000	121,785,000
エフオン	6,800	548.000	3,726,400

イーレックス	13,500	2,522.000	34,047,000
レノバ	20,300	2,731.000	55,439,300
東京瓦斯	160,600	2,526.000	405,675,600
大阪瓦斯	153,600	2,122.000	325,939,200
東邦瓦斯	30,000	2,691.000	80,730,000
北海道瓦斯	5,000	1,692.000	8,460,000
広島ガス	13,700	340.000	4,658,000
西部ガスHLDGS	7,100	1,678.000	11,913,800
静岡ガス	17,000	1,100.000	18,700,000
メタウォーター	9,400	1,789.000	16,816,600
SBSホールディングス	6,600	2,965.000	19,569,000
東武鉄道	83,100	3,310.000	275,061,000
相鉄ホールディングス	25,400	2,190.000	55,626,000
東急	212,200	1,749.000	371,137,800
京浜急行	86,600	1,440.000	124,704,000
小田急電鉄	115,000	1,802.000	207,230,000
京王電鉄	40,200	5,120.000	205,824,000
京成電鉄	48,900	3,915.000	191,443,500
富士急行	9,400	4,920.000	46,248,000
東日本旅客鉄道	129,100	7,811.000	1,008,400,100
西日本旅客鉄道	97,500	5,836.000	569,010,000
東海旅客鉄道	58,700	16,630.000	976,181,000
西武ホールディングス	92,400	1,380.000	127,512,000
鴻池運輸	13,100	1,581.000	20,711,100
西日本鉄道	20,200	2,806.000	56,681,200
ハマキョウレックス	5,900	3,425.000	20,207,500
サカイ引越センター	3,700	4,595.000	17,001,500
近鉄グループHLDGS	75,700	4,900.000	370,930,000
阪急阪神HLDGS	100,700	4,290.000	432,003,000
南海電鉄	36,400	3,010.000	109,564,000
京阪ホールディングス	31,400	3,460.000	108,644,000
神戸電鉄	2,800	3,235.000	9,058,000
名古屋鉄道	84,000	2,259.000	189,756,000
山陽電鉄	6,300	2,235.000	14,080,500
アルプス物流	6,000	1,160.000	6,960,000
ヤマトホールディングス	97,200	2,293.000	222,879,600
山九	19,300	4,945.000	95,438,500
丸全昭和運輸	4,700	3,220.000	15,134,000
センコーグループHLDGS	39,800	1,016.000	40,436,800
トナミホールディングス	1,800	3,650.000	6,570,000
ニッコンホールディングス	24,300	2,419.000	58,781,700
福山通運	6,300	3,500.000	22,050,000
セイノーホールディングス	47,000	1,204.000	56,588,000
神奈川中央交通	2,500	3,365.000	8,412,500
日立物流	16,700	8,890.000	148,463,000
AZ-COM丸和ホールディ	18,500	1,460.000	27,010,000
C&Fロジホールディングス	7,800	1,226.000	9,562,800
九州旅客鉄道	54,100	3,025.000	163,652,500

SGホールディングス	145,400	2,130.000	309,702,000
NIPPON EXPRESS	28,100	8,090.000	227,329,000
日本郵船	202,000	3,037.000	613,474,000
商船三井	133,300	3,365.000	448,554,500
川崎汽船	64,700	2,598.000	168,090,600
NSユナイテッド海運	4,200	3,780.000	15,876,000
明治海運	9,300	721.000	6,705,300
飯野海運	29,000	933.000	27,057,000
乾汽船	10,600	1,827.000	19,366,200
日本航空	185,800	2,733.000	507,791,400
ANAホールディングス	207,300	2,944.500	610,394,850
パスコ	3,200	1,331.000	4,259,200
トランコム	2,200	7,920.000	17,424,000
日新	6,300	2,034.000	12,814,200
三菱倉庫	16,200	3,340.000	54,108,000
三井倉庫HOLD	7,100	3,535.000	25,098,500
住友倉庫	20,400	2,002.000	40,840,800
渋沢倉庫	3,500	2,078.000	7,273,000
東陽倉庫	27,400	257.000	7,041,800
日本トランスシティ	16,000	501.000	8,016,000
川西倉庫	5,200	1,006.000	5,231,200
東洋埠頭	900	1,283.000	1,154,700
上組	37,400	2,799.000	104,682,600
キューソー流通システム	6,600	1,033.000	6,817,800
エーアイティー	5,400	1,437.000	7,759,800
内外トランスライン	3,200	2,204.000	7,052,800
日本コンセプト	2,900	1,747.000	5,066,300
NECネットエスアイ	25,300	1,642.000	41,542,600
クロスキャット	4,800	1,599.000	7,675,200
システナ	126,900	420.000	53,298,000
デジタルアーツ	4,900	6,450.000	31,605,000
日鉄ソリューションズ	12,700	3,435.000	43,624,500
キューブシステム	5,700	1,017.000	5,796,900
コア	3,900	1,470.000	5,733,000
手間いらず	1,300	5,150.000	6,695,000
ラクーンホールディングス	8,500	1,260.000	10,710,000
ソリトンシステムズ	5,100	1,165.000	5,941,500
ソフトクリエイイトHD	3,400	3,520.000	11,968,000
TIS	85,400	3,890.000	332,206,000
グリー	41,900	768.000	32,179,200
コーエーテクモHD	47,800	2,375.000	113,525,000
三菱総合研究所	3,700	5,150.000	19,055,000
ファインデックス	8,000	552.000	4,416,000
ブレインパッド	8,200	893.000	7,322,600
KLab	17,200	490.000	8,428,000
ポルトウウィンホールディング	13,700	937.000	12,836,900
ネクソン	197,100	2,894.000	570,407,400
アイスタイル	25,300	538.000	13,611,400

エムアップホールディングス	9,600	1,354.000	12,998,400
エイチーム	7,000	829.000	5,803,000
エニグモ	11,200	597.000	6,686,400
コロプラ	30,000	686.000	20,580,000
ブロードリーフ	46,400	496.000	23,014,400
クロス・マーケティングG	4,200	783.000	3,288,600
デジタルハーツHLDGS	5,200	1,890.000	9,828,000
システム情報	7,400	898.000	6,645,200
メディアドゥ	3,500	1,910.000	6,685,000
じげん	25,200	357.000	8,996,400
ブイキューブ	10,200	795.000	8,109,000
サイバーリンクス	3,100	1,131.000	3,506,100
ディー・エル・イー	8,600	336.000	2,889,600
フィックスターズ	9,600	1,376.000	13,209,600
CARTA HOLDINGS	4,200	1,700.000	7,140,000
オブティム	7,300	1,162.000	8,482,600
SHIFT	5,600	28,870.000	161,672,000
ティーガイア	8,100	1,652.000	13,381,200
テクマトリックス	14,300	1,646.000	23,537,800
プロシップ	3,900	1,527.000	5,955,300
ガンホー・オンライン・エンター	23,800	2,080.000	49,504,000
GMOペイメントゲートウェイ	17,400	12,160.000	211,584,000
システムリサーチ	2,700	2,031.000	5,483,700
インターネットイニシアティブ	42,400	2,450.000	103,880,000
さくらインターネット	11,100	527.000	5,849,700
ヴィンクス	1,000	1,682.000	1,682,000
GMOグローバルサインHD	2,500	4,000.000	10,000,000
SRAホールディングス	4,100	3,125.000	12,812,500
朝日ネット	9,400	571.000	5,367,400
eBASE	12,100	620.000	7,502,000
アバントグループ	9,800	1,500.000	14,700,000
アドソル日進	4,000	1,508.000	6,032,000
フリービット	5,700	1,156.000	6,589,200
コムチュア	10,300	2,607.000	26,852,100
アステリア	7,500	812.000	6,090,000
アイル	4,400	1,991.000	8,760,400
マークライنز	4,500	2,783.000	12,523,500
メディカル・データ・ビジ	12,200	1,002.000	12,224,400
gumi	13,300	737.000	9,802,100
テラスカイ	3,600	2,800.000	10,080,000
デジタル・インフォメーション	4,500	1,985.000	8,932,500
ネオジャパン	900	1,001.000	900,900
PR TIMES	2,200	2,478.000	5,451,600
ラクス	36,200	1,720.000	62,264,000
ダブルスタンダード	3,400	2,213.000	7,524,200
オープンドア	5,700	1,967.000	11,211,900
アカツキ	4,200	2,274.000	9,550,800
UBICOMホールディングス	2,800	2,295.000	6,426,000

カナミックネットワーク	12,800	645.000	8,256,000
チェンジ	18,800	2,181.000	41,002,800
シンクロ・フード	6,400	476.000	3,046,400
オークネット	4,300	1,951.000	8,389,300
マクロミル	18,000	1,103.000	19,854,000
オロ	2,900	1,867.000	5,414,300
ユーザーローカル	3,200	1,590.000	5,088,000
マネーフォワード	17,200	4,885.000	84,022,000
電算システムHD	4,000	2,272.000	9,088,000
プロトコーポレーション	10,000	1,260.000	12,600,000
野村総合研究所	156,300	2,996.000	468,274,800
サイバネットシステム	8,400	967.000	8,122,800
日本システム技術	3,900	1,734.000	6,762,600
インテージホールディングス	10,600	1,532.000	16,239,200
ソースネクスト	41,100	279.000	11,466,900
インフォコム	9,900	2,046.000	20,255,400
シンプレクスHD	12,900	2,321.000	29,940,900
HEROZ	3,300	1,247.000	4,115,100
ラクスル	11,000	3,065.000	33,715,000
メルカリ	33,600	2,811.000	94,449,600
I P S	2,700	3,075.000	8,302,500
F I G	11,900	409.000	4,867,100
システムサポート	3,900	1,492.000	5,818,800
イーソル	3,100	911.000	2,824,100
アルテリア・ネットワークス	8,300	1,250.000	10,375,000
ウイングアーク1 S T	8,100	2,219.000	17,973,900
サーバーワークス	1,800	2,807.000	5,052,600
S a n s a n	29,000	1,670.000	48,430,000
ギフトィ	8,500	2,261.000	19,218,500
ベース	2,600	3,865.000	10,049,000
J M D C	12,600	5,120.000	64,512,000
フォーカスシステムズ	7,000	1,002.000	7,014,000
クレスコ	6,300	1,735.000	10,930,500
フジ・メディア・HD	73,600	1,077.000	79,267,200
オービック	25,400	21,700.000	551,180,000
ジャストシステム	11,200	3,300.000	36,960,000
T D C ソフト	6,700	1,469.000	9,842,300
Zホールディングス	1,087,200	373.500	406,069,200
トレンドマイクロ	44,100	6,810.000	300,321,000
日本オラクル	14,800	8,030.000	118,844,000
アルファシステムズ	2,400	4,240.000	10,176,000
フューチャー	18,900	1,671.000	31,581,900
C A C H O L D I N G S	4,900	1,532.000	7,506,800
S B テクノロジー	3,600	2,060.000	7,416,000
オービックビジネスC	15,000	4,675.000	70,125,000
伊藤忠テクノソリューションズ	40,800	3,350.000	136,680,000
アイティフォー	11,300	801.000	9,051,300
東計電算	1,400	5,910.000	8,274,000

大塚商会	43,300	4,570.000	197,881,000
サイボウズ	10,800	2,219.000	23,965,200
電通国際情報S	9,100	4,575.000	41,632,500
A C C E S S	10,300	748.000	7,704,400
デジタルガレージ	13,600	4,005.000	54,468,000
イーエムシステムズ	13,500	988.000	13,338,000
ウェザーニューズ	2,800	7,610.000	21,308,000
C I J	7,800	934.000	7,285,200
ビジネスエンジニアリング	2,000	2,219.000	4,438,000
WOWOW	5,800	1,252.000	7,261,600
スカラ	10,000	747.000	7,470,000
インテリジェント ウェイブ	5,300	806.000	4,271,800
I M A G I C A G R O U P	7,000	755.000	5,285,000
ネットワンシステムズ	28,600	3,400.000	97,240,000
アルゴグラフィックス	7,000	3,800.000	26,600,000
マーベラス	13,600	679.000	9,234,400
エイベックス	13,500	1,529.000	20,641,500
B I P R O G Y	28,200	3,285.000	92,637,000
兼松エレクトロニクス	4,800	4,565.000	21,912,000
都築電気	4,600	1,334.000	6,136,400
T B S ホールディングス	39,100	1,568.000	61,308,800
日本テレビH L D S	67,600	1,059.000	71,588,400
朝日放送グループHD	2,600	622.000	1,617,200
テレビ朝日HD	18,800	1,371.000	25,774,800
スカパーJ S A T H D	68,600	508.000	34,848,800
テレビ東京HD	6,000	1,841.000	11,046,000
ビジョン	10,500	1,377.000	14,458,500
U S E N - N E X T H L D G S	7,000	2,351.000	16,457,000
コネクシオ	5,300	1,199.000	6,354,700
日本通信	75,200	222.000	16,694,400
日本電信電話	977,200	3,820.000	3,732,904,000
K D D I	589,400	4,111.000	2,423,023,400
ソフトバンク	1,225,300	1,497.500	1,834,886,750
光通信	9,000	19,170.000	172,530,000
エムティーアイ	9,100	506.000	4,604,600
G M O インターネットグループ	28,500	2,535.000	72,247,500
ファイバーゲート	5,300	940.000	4,982,000
K A D O K A W A	40,500	2,543.000	102,991,500
学研ホールディングス	13,800	1,026.000	14,158,800
ゼンリン	13,600	861.000	11,709,600
アイネット	5,800	1,305.000	7,569,000
松竹	4,500	11,900.000	53,550,000
東宝	47,600	5,290.000	251,804,000
東映	2,100	18,910.000	39,711,000
N T T データ	238,500	2,102.000	501,327,000
ピー・シー・エー	5,300	1,282.000	6,794,600
ビジネスB太田昭和	4,000	1,951.000	7,804,000
D T S	16,300	3,295.000	53,708,500

スクウェア・エニックス・HD	38,400	6,190.000	237,696,000
シーイーシー	11,100	1,513.000	16,794,300
カブコン	75,700	4,175.000	316,047,500
アイ・エス・ビー	4,500	1,308.000	5,886,000
ジャステック	5,600	1,198.000	6,708,800
S C S K	61,900	2,202.000	136,303,800
NSW	3,300	2,170.000	7,161,000
アイネス	6,000	1,444.000	8,664,000
T K C	13,200	3,735.000	49,302,000
富士ソフト	8,500	8,140.000	69,190,000
NSD	26,700	2,560.000	68,352,000
コナミグループ	32,700	6,450.000	210,915,000
福井コンピュータH L D S	5,400	2,944.000	15,897,600
J B C Cホールディングス	5,900	1,959.000	11,558,100
ミロク情報サービス	7,600	1,501.000	11,407,600
ソフトバンクグループ	441,100	5,952.000	2,625,427,200
高千穂交易	3,300	2,190.000	7,227,000
伊藤忠食品	1,800	5,190.000	9,342,000
エレマテック	7,400	1,536.000	11,366,400
あらた	6,200	4,025.000	24,955,000
トーメンデバイス	1,300	5,570.000	7,241,000
東京エレクトロニクスデバイス	3,000	6,870.000	20,610,000
円谷フィールズホールディ	7,200	2,372.000	17,078,400
双日	85,300	2,438.000	207,961,400
アルフレッサホールディングス	81,100	1,666.000	135,112,600
横浜冷凍	24,100	995.000	23,979,500
ラサ商事	5,800	1,009.000	5,852,200
アルコニックス	11,400	1,315.000	14,991,000
神戸物産	62,200	3,575.000	222,365,000
あいホールディングス	12,800	2,220.000	28,416,000
ダイワボウHD	32,900	2,176.000	71,590,400
マクニカホールディングス	19,500	3,445.000	67,177,500
ラクト・ジャパン	3,600	2,121.000	7,635,600
グリムス	3,500	1,815.000	6,352,500
バイタルK S K HD	13,400	826.000	11,068,400
八洲電機	7,800	1,015.000	7,917,000
メディアスホールディングス	6,800	765.000	5,202,000
レスターホールディングス	7,600	2,219.000	16,864,400
ジュテックHD	4,700	1,153.000	5,419,100
T O K A Iホールディングス	39,500	876.000	34,602,000
三洋貿易	8,900	1,139.000	10,137,100
ビューティガレージ	1,800	3,015.000	5,427,000
ウイン・パートナーズ	5,600	992.000	5,555,200
シップヘルスケアHD	29,100	2,773.000	80,694,300
コメダホールディングス	20,300	2,412.000	48,963,600
フルサト・マルカHD	8,000	3,970.000	31,760,000
ヤマエグループHD	5,000	1,433.000	7,165,000
小野建	8,200	1,444.000	11,840,800

佐島電機	6,100	1,348.000	8,222,800
伯東	4,700	3,735.000	17,554,500
コンドーテック	7,300	1,004.000	7,329,200
ナガイレーベン	10,500	2,007.000	21,073,500
三菱食品	8,300	3,250.000	26,975,000
松田産業	6,200	2,303.000	14,278,600
第一興商	15,700	4,090.000	64,213,000
メディバルHD	83,600	1,830.000	152,988,000
S P K	4,800	1,391.000	6,676,800
萩原電気H L D G S	3,700	2,517.000	9,312,900
アズワン	11,800	6,110.000	72,098,000
スズデン	3,800	2,293.000	8,713,400
尾家産業	4,700	926.000	4,352,200
シモジマ	6,200	961.000	5,958,200
ドウシシャ	8,500	1,524.000	12,954,000
高速	4,400	1,768.000	7,779,200
リックス	2,000	2,206.000	4,412,000
丸文	8,600	910.000	7,826,000
ハピネット	7,200	1,941.000	13,975,200
日本ライフライン	24,300	947.000	23,012,100
タカショー	9,100	704.000	6,406,400
I D O M	25,100	748.000	18,774,800
進和	5,800	2,058.000	11,936,400
ダイトロン	3,600	2,446.000	8,805,600
シークス	11,700	1,399.000	16,368,300
オーハシテクニカ	4,900	1,399.000	6,855,100
白銅	3,200	2,493.000	7,977,600
伊藤忠	495,400	4,287.000	2,123,779,800
丸紅	633,000	1,548.000	979,884,000
高島	1,000	2,970.000	2,970,000
長瀬産業	37,200	2,019.000	75,106,800
蝶理	4,400	1,987.000	8,742,800
豊田通商	70,000	5,230.000	366,100,000
三共生興	17,300	483.000	8,355,900
兼松	30,700	1,528.000	46,909,600
三井物産	588,600	3,983.000	2,344,393,800
日本紙パルプ	4,300	5,030.000	21,629,000
カメイ	8,900	1,201.000	10,688,900
スターゼン	6,400	2,077.000	13,292,800
山善	21,400	1,000.000	21,400,000
椿本興業	1,500	3,995.000	5,992,500
住友商事	497,600	2,247.000	1,118,107,200
内田洋行	3,700	4,640.000	17,168,000
三菱商事	502,500	4,605.000	2,314,012,500
第一実業	3,100	4,240.000	13,144,000
キャノンマーケティングJ P N	18,600	3,110.000	57,846,000
西華産業	4,100	1,551.000	6,359,100
佐藤商事	6,100	1,196.000	7,295,600

菱洋エレクトロ	7,400	2,348.000	17,375,200
東京産業	8,400	790.000	6,636,000
ユアサ商事	7,100	3,590.000	25,489,000
神鋼商事	2,200	4,520.000	9,944,000
阪和興業	14,300	3,580.000	51,194,000
正栄食品	5,500	4,275.000	23,512,500
カナデン	7,300	1,103.000	8,051,900
菱電商事	6,700	1,686.000	11,296,200
岩谷産業	18,400	5,770.000	106,168,000
ナイス	3,400	1,318.000	4,481,200
極東貿易	6,000	1,325.000	7,950,000
アステナホールディングス	17,800	417.000	7,422,600
三愛オブリ	22,300	1,292.000	28,811,600
稲畑産業	16,300	2,369.000	38,614,700
G S Iクレオス	5,600	1,458.000	8,164,800
明和産業	11,600	701.000	8,131,600
ワキタ	15,500	1,198.000	18,569,000
東邦ホールディングス	20,800	2,130.000	44,304,000
サンゲツ	20,500	2,101.000	43,070,500
ミツウロコグループ	11,800	1,058.000	12,484,400
シナネンホールディングス	2,700	3,800.000	10,260,000
伊藤忠エネクス	19,300	1,020.000	19,686,000
サンリオ	23,000	4,525.000	104,075,000
サンワテクノス	4,800	1,526.000	7,324,800
リョーサン	8,800	2,842.000	25,009,600
新光商事	12,100	1,125.000	13,612,500
トーホー	4,200	1,731.000	7,270,200
三信電気	3,700	2,246.000	8,310,200
東陽テクニカ	9,500	1,399.000	13,290,500
モスフードサービス	12,000	3,180.000	38,160,000
加賀電子	6,600	4,390.000	28,974,000
立花エレテック	6,000	1,776.000	10,656,000
PALTAC	12,700	4,315.000	54,800,500
三谷産業	19,100	313.000	5,978,300
太平洋興発	9,500	748.000	7,106,000
西本WISMETTAC HD	2,200	3,700.000	8,140,000
コーア商事HLDGS	6,600	621.000	4,098,600
KPPグループホールディン	19,300	972.000	18,759,600
ヤマタネ	5,000	1,696.000	8,480,000
日鉄物産	5,200	5,100.000	26,520,000
泉州電業	3,800	2,788.000	10,594,400
トラスコ中山	16,800	2,087.000	35,061,600
オートバックスセブン	29,000	1,458.000	42,282,000
モリト	7,800	758.000	5,912,400
加藤産業	9,500	3,495.000	33,202,500
イエローハット	14,100	1,724.000	24,308,400
J Kホールディングス	6,800	1,042.000	7,085,600
日伝	5,000	1,700.000	8,500,000

杉本商事	3,800	2,062.000	7,835,600
因幡電機産業	20,200	2,782.000	56,196,400
東 テ ク	2,800	3,275.000	9,170,000
ミスミグループ本社	121,300	3,350.000	406,355,000
タキヒヨー	6,600	900.000	5,940,000
スズケン	25,000	3,695.000	92,375,000
ジェコス	2,000	803.000	1,606,000
ローソン	20,200	4,925.000	99,485,000
サンエー	6,000	4,360.000	26,160,000
カワチ薬品	6,600	2,111.000	13,932,600
エービーシー・マート	11,700	6,970.000	81,549,000
ハードオフコーポレーション	4,200	1,424.000	5,980,800
アスクル	19,700	1,581.000	31,145,700
ゲオホールディングス	8,800	1,961.000	17,256,800
アダストリア	10,000	2,007.000	20,070,000
くら寿司	9,600	3,350.000	32,160,000
キャンドウ	4,500	2,153.000	9,688,500
パルグループHLDGS	8,200	2,421.000	19,852,200
エディオン	31,500	1,254.000	39,501,000
サーラコーポレーション	17,900	750.000	13,425,000
ハローズ	3,700	2,994.000	11,077,800
フジオフードG本社	7,500	1,388.000	10,410,000
ひらまつ	26,400	186.000	4,910,400
大黒天物産	3,000	5,280.000	15,840,000
ハニーズホールディングス	7,800	1,228.000	9,578,400
アルペン	6,800	2,030.000	13,804,000
クオールホールディングス	11,700	1,140.000	13,338,000
ジンスホールディングス	5,000	4,325.000	21,625,000
ビックカメラ	53,500	1,265.000	67,677,500
DCMホールディングス	49,300	1,148.000	56,596,400
MonotaRO	113,900	2,336.000	266,070,400
アークランドサービスHD	6,900	2,222.000	15,331,800
J. フロント リテイリング	100,600	1,159.000	116,595,400
ドトール・日レスHD	14,300	1,691.000	24,181,300
マツキヨココカラ&カンパニー	48,800	5,720.000	279,136,000
ブロンコピリー	5,000	2,500.000	12,500,000
ZOZO	53,300	3,425.000	182,552,500
トレジャー・ファクトリー	2,600	2,396.000	6,229,600
物語コーポレーション	4,500	7,020.000	31,590,000
三越伊勢丹HD	135,700	1,324.000	179,666,800
Hamee	4,300	881.000	3,788,300
ウエルシアHD	41,800	3,020.000	126,236,000
クリエイトSDH	13,000	3,065.000	39,845,000
チムニー	7,500	1,127.000	8,452,500
シュッピン	6,500	1,470.000	9,555,000
オイシックス・ラ・大地	11,000	1,927.000	21,197,000
ネクステージ	18,400	3,085.000	56,764,000
ジョイフル本田	25,600	1,849.000	47,334,400

鳥貴族ホールディングス	3,700	2,445.000	9,046,500
ホットランド	7,400	1,527.000	11,299,800
すかいらくHD	110,600	1,596.000	176,517,600
SFPホールディングス	5,000	1,711.000	8,555,000
綿半ホールディングス	6,800	1,357.000	9,227,600
ユナイテッド・スーパーマーケ	27,800	1,101.000	30,607,800
ゴルフダイジェスト・オン	4,200	1,741.000	7,312,200
BEENOS	4,700	3,180.000	14,946,000
あさひ	6,800	1,332.000	9,057,600
日本調剤	6,100	1,198.000	7,307,800
コスモス薬品	9,100	13,960.000	127,036,000
セブン&アイ・HL DGS	277,300	5,579.000	1,547,056,700
クリエイト・レストランツ・ホール	61,100	939.000	57,372,900
ツルハホールディングス	19,800	8,870.000	175,626,000
サンマルクホールディングス	7,300	1,690.000	12,337,000
フェリシモ	5,000	1,027.000	5,135,000
トリドールホールディングス	20,100	2,692.000	54,109,200
JMホールディングス	7,200	1,759.000	12,664,800
アレンザホールディングス	6,600	984.000	6,494,400
串カツ田中HL DGS	3,600	1,803.000	6,490,800
パロックジャパン	1,400	799.000	1,118,600
クスリのアオキHL DGS	8,100	7,580.000	61,398,000
力の源HD	6,200	909.000	5,635,800
FOOD&LIFE COMPAN	46,400	2,495.000	115,768,000
メディカルシステムネットワーク	5,300	404.000	2,141,200
ノジマ	26,200	1,395.000	36,549,000
カップ・クリエイト	13,500	1,378.000	18,603,000
ライトオン	9,200	636.000	5,851,200
良品計画	104,100	1,449.000	150,840,900
アドヴァングループ	11,000	890.000	9,790,000
アルビス	3,100	2,384.000	7,390,400
G-7ホールディングス	9,900	1,523.000	15,077,700
イオン北海道	13,200	1,178.000	15,549,600
コジマ	16,200	614.000	9,946,800
コーナン商事	10,900	3,310.000	36,079,000
エコス	3,700	1,833.000	6,782,100
ワタミ	11,000	1,059.000	11,649,000
パンパシフィックHD	180,400	2,384.000	430,073,600
西松屋チェーン	18,100	1,395.000	25,249,500
ゼンショーホールディングス	43,900	3,465.000	152,113,500
幸楽苑ホールディングス	6,800	1,030.000	7,004,000
サイゼリヤ	13,700	2,813.000	38,538,100
VTホールディングス	31,100	508.000	15,798,800
フジ・コーポレーション	5,100	1,288.000	6,568,800
ユナイテッドアローズ	9,000	1,885.000	16,965,000
ハイデイ日高	12,100	1,958.000	23,691,800
コロワイド	37,700	1,789.000	67,445,300
荻番屋	6,300	4,555.000	28,696,500

スギホールディングス	16,300	6,190.000	100,897,000
薬王堂ホールディングス	4,600	2,580.000	11,868,000
スクロール	12,800	711.000	9,100,800
ヨンドシーホールディングス	7,600	1,732.000	13,163,200
木曽路	12,900	2,142.000	27,631,800
S R Sホールディングス	16,000	847.000	13,552,000
千 趣 会	17,100	409.000	6,993,900
リテールパートナーズ	12,000	1,237.000	14,844,000
ケーヨー	13,900	903.000	12,551,700
上新電機	7,100	1,905.000	13,525,500
日本瓦斯	43,300	2,103.000	91,059,900
ロイヤルホールディングス	15,800	2,397.000	37,872,600
いなげや	8,100	1,184.000	9,590,400
チヨダ	10,200	763.000	7,782,600
ライフコーポレーション	7,100	2,457.000	17,444,700
リンガーハット	11,300	2,195.000	24,803,500
Mr Max HD	12,200	662.000	8,076,400
A O K Iホールディングス	15,900	686.000	10,907,400
オークワ	13,500	942.000	12,717,000
コメリ	12,300	2,590.000	31,857,000
青山商事	18,200	999.000	18,181,800
しまむら	9,400	12,490.000	117,406,000
高 島 屋	61,300	1,786.000	109,481,800
松 屋	14,400	975.000	14,040,000
エイチ・ツー・オーリテイリング	39,500	1,220.000	48,190,000
近鉄百貨店	4,000	2,465.000	9,860,000
丸井グループ	59,300	2,334.000	138,406,200
アクシアル リテイリング	5,400	3,395.000	18,333,000
イオン	272,800	2,823.000	770,114,400
イ ズ ミ	12,400	3,015.000	37,386,000
平 和 堂	13,200	2,031.000	26,809,200
フ ジ	12,500	1,868.000	23,350,000
ヤオコー	9,100	6,700.000	60,970,000
ゼビオホールディングス	11,300	942.000	10,644,600
ケースホールディングス	64,300	1,140.000	73,302,000
O L Y M P I Cグループ	8,000	524.000	4,192,000
シルバーライフ	2,500	1,557.000	3,892,500
G E N K Y D R U G S T O R E S	4,100	3,460.000	14,186,000
ブックオフGHD	5,200	1,314.000	6,832,800
ギフトホールディングス	1,900	3,950.000	7,505,000
アインホールディングス	11,200	6,730.000	75,376,000
元気寿司	3,300	3,180.000	10,494,000
ヤマダホールディングス	331,000	477.000	157,887,000
アークランズ	12,300	1,498.000	18,425,400
ニトリホールディングス	32,600	15,565.000	507,419,000
グルメ杵屋	8,700	997.000	8,673,900
ケーユーホールディングス	3,300	1,300.000	4,290,000
吉野家ホールディングス	32,000	2,321.000	74,272,000

松屋フーズH L D G S	3,800	3,995.000	15,181,000
サガミホールディングス	14,200	1,221.000	17,338,200
関西フードマーケット	8,100	1,389.000	11,250,900
王将フードサービス	5,100	6,060.000	30,906,000
ミニストップ	7,000	1,423.000	9,961,000
アークス	14,200	2,099.000	29,805,800
パローホールディングス	15,100	1,758.000	26,545,800
ベルク	3,900	5,720.000	22,308,000
大庄	7,800	1,061.000	8,275,800
ファーストリテイリング	12,100	80,810.000	977,801,000
サンドラッグ	30,600	3,660.000	111,996,000
サックスパーホールディング	9,400	800.000	7,520,000
やまや	3,500	2,476.000	8,666,000
ペルーナ	19,700	689.000	13,573,300
いよぎんホールディング	88,100	729.000	64,224,900
しずおかフィナンシャル	168,000	1,005.000	168,840,000
ちゅうぎんフィナンシャル	62,300	968.000	60,306,400
めぶきフィナンシャルG	372,000	312.000	116,064,000
東京きらぼしF G	9,700	2,387.000	23,153,900
九州フィナンシャルG	126,700	397.000	50,299,900
ゆうちょ銀行	212,400	1,051.000	223,232,400
富山第一銀行	21,100	568.000	11,984,800
コンコルディア・フィナンシャル	410,500	477.000	195,808,500
西日本フィナンシャルH D	47,600	874.000	41,602,400
3 3 F G	7,400	1,500.000	11,100,000
第四北越フィナンシャルG	11,100	2,618.000	29,059,800
ひろぎんH L D G S	97,800	632.000	61,809,600
おきなわF G	7,600	2,144.000	16,294,400
十六F G	10,000	2,640.000	26,400,000
北國F H D	6,400	4,455.000	28,512,000
プロクレアホールディングス	9,700	2,159.000	20,942,300
あいちフィナンシャルグル	10,400	2,215.000	23,036,000
新生銀行	22,700	2,339.000	53,095,300
あおぞら銀行	46,700	2,595.000	121,186,500
三菱U F J フィナンシャルG	4,906,500	755.100	3,704,898,150
りそなホールディングス	953,500	660.900	630,168,150
三井住友トラストH D	138,100	4,407.000	608,606,700
三井住友フィナンシャルG	546,500	4,673.000	2,553,794,500
千葉銀行	207,600	834.000	173,138,400
群馬銀行	144,500	451.000	65,169,500
武蔵野銀行	9,900	1,883.000	18,641,700
千葉興業銀行	22,000	376.000	8,272,000
筑波銀行	41,100	212.000	8,713,200
七十七銀行	24,100	1,948.000	46,946,800
秋田銀行	5,900	1,684.000	9,935,600
山形銀行	10,000	1,217.000	12,170,000
岩手銀行	6,000	1,935.000	11,610,000
東邦銀行	67,900	210.000	14,259,000

ふくおかフィナンシャルG	59,600	2,691.000	160,383,600
スルガ銀行	67,700	429.000	29,043,300
八十二銀行	150,800	519.000	78,265,200
山梨中央銀行	9,400	1,043.000	9,804,200
大垣共立銀行	14,500	1,844.000	26,738,000
福井銀行	8,100	1,464.000	11,858,400
清水銀行	1,500	1,529.000	2,293,500
富山銀行	3,400	1,746.000	5,936,400
滋賀銀行	12,400	2,616.000	32,438,400
南都銀行	11,500	2,335.000	26,852,500
百五銀行	72,400	350.000	25,340,000
京都銀行	23,500	5,700.000	133,950,000
紀陽銀行	26,400	1,521.000	40,154,400
ほくほくフィナンシャルG	48,600	929.000	45,149,400
山陰合同銀行	47,000	755.000	35,485,000
百十四銀行	8,100	1,794.000	14,531,400
四国銀行	14,400	919.000	13,233,600
阿波銀行	11,100	2,042.000	22,666,200
大分銀行	5,800	1,980.000	11,484,000
宮崎銀行	5,800	2,318.000	13,444,400
佐賀銀行	5,400	1,610.000	8,694,000
琉球銀行	21,000	835.000	17,535,000
セブン銀行	268,200	261.000	70,000,200
みずほフィナンシャルG	1,081,300	1,717.000	1,856,592,100
山口フィナンシャルG	83,200	816.000	67,891,200
長野銀行	3,300	1,248.000	4,118,400
名古屋銀行	5,100	3,215.000	16,396,500
北洋銀行	117,900	245.000	28,885,500
愛媛銀行	12,000	881.000	10,572,000
京葉銀行	38,400	545.000	20,928,000
栃木銀行	38,200	321.000	12,262,200
東和銀行	16,600	547.000	9,080,200
トモニホールディングス	64,900	349.000	22,650,100
フィデアホール	9,500	1,361.000	12,929,500
池田泉州HD	106,300	232.000	24,661,600
F P G	31,200	1,165.000	36,348,000
ジャパンインベストメントA	6,700	1,227.000	8,220,900
S B Iホールディングス	107,900	2,618.000	282,482,200
ジャフコ グループ	25,400	2,407.000	61,137,800
大和証券G本社	529,900	608.000	322,179,200
野村ホールディングス	1,374,400	500.700	688,162,080
岡三証券グループ	66,100	387.000	25,580,700
丸三証券	29,900	422.000	12,617,800
東洋証券	29,100	283.000	8,235,300
東海東京HD	81,200	357.000	28,988,400
水戸証券	23,700	226.000	5,356,200
いちよし証券	17,000	612.000	10,404,000
松井証券	44,700	786.000	35,134,200

マネックスG	84,300	430.000	36,249,000
極東証券	12,900	616.000	7,946,400
岩井コスモホールディング	10,000	1,274.000	12,740,000
アイザワ証券グループ	11,900	687.000	8,175,300
スパークス・グループ	8,700	1,707.000	14,850,900
かんぽ生命保険	91,200	2,287.000	208,574,400
S O M P Oホールディングス	128,300	6,059.000	777,369,700
アニコム ホールディングス	29,000	725.000	21,025,000
M S & A D	168,400	4,100.000	690,440,000
第一生命H L D G S	381,200	2,543.500	969,582,200
東京海上H D	753,500	2,827.000	2,130,144,500
T & Dホールディングス	201,200	1,668.000	335,601,600
アドバンスクリエイト	7,400	1,072.000	7,932,800
全国保証	19,700	5,100.000	100,470,000
ジェイリース	2,800	3,105.000	8,694,000
日本モーゲージサービス	7,600	860.000	6,536,000
アルヒ	16,200	1,007.000	16,313,400
プレミアグループ	12,900	1,925.000	24,832,500
ネットプロHD	26,000	476.000	12,376,000
クレディセゾン	47,800	1,757.000	83,984,600
芙蓉総合リース	6,800	8,790.000	59,772,000
みずほリース	10,900	3,305.000	36,024,500
東京センチュリー	13,800	4,720.000	65,136,000
日本証券金融	31,400	1,026.000	32,216,400
アイフル	126,300	408.000	51,530,400
リコーリース	7,300	3,650.000	26,645,000
イオンフィナンシャルサービス	42,600	1,469.000	62,579,400
アコム	140,900	321.000	45,228,900
ジャックス	8,000	3,905.000	31,240,000
オリコ	19,800	1,197.000	23,700,600
オリックス	499,800	2,210.500	1,104,807,900
三菱H C キャピタル	287,400	654.000	187,959,600
日本取引所グループ	210,600	1,975.500	416,040,300
イー・ギャランティ	12,500	2,459.000	30,737,500
N E C キャピタルソリューション	4,000	2,080.000	8,320,000
大東建託	27,500	15,320.000	421,300,000
いちご	89,000	309.000	27,501,000
日本駐車場開発	95,800	246.000	23,566,800
スター・マイカ・H L D G S	9,000	716.000	6,444,000
S R E ホールディングス	3,900	4,575.000	17,842,500
ヒューリック	175,000	1,153.000	201,775,000
三栄建築設計	4,700	1,538.000	7,228,600
野村不動産H L D G S	46,800	3,320.000	155,376,000
三重交通グループHD	18,900	492.000	9,298,800
サムティ	10,100	2,274.000	22,967,400
ディア・ライフ	13,500	623.000	8,410,500
地主	7,300	2,036.000	14,862,800
プレサンスコーポレーション	11,400	1,589.000	18,114,600

JPMC	5,800	1,046.000	6,066,800
フージャースHD	13,700	797.000	10,918,900
オープンハウスグループ	27,400	5,780.000	158,372,000
東急不動産HD	225,500	742.000	167,321,000
飯田GHD	65,600	2,193.000	143,860,800
AND DOホールディングス	5,800	853.000	4,947,400
シーアールイー	4,200	1,491.000	6,262,200
ケイアイスター不動産	4,400	4,930.000	21,692,000
グッドコムアセット	8,400	755.000	6,342,000
ジェイ・エス・ビー	2,100	4,365.000	9,166,500
ロードスターキャピタル	3,700	1,740.000	6,438,000
パーク24	58,800	2,005.000	117,894,000
パラカ	4,400	1,908.000	8,395,200
宮越ホールディングス	800	884.000	707,200
三井不動産	325,800	2,776.500	904,583,700
三菱地所	475,700	1,940.000	922,858,000
平和不動産	13,000	4,090.000	53,170,000
東京建物	71,600	1,921.000	137,543,600
京阪神ビルディング	11,000	1,282.000	14,102,000
住友不動産	135,800	3,716.000	504,632,800
テオーシー	16,800	727.000	12,213,600
東京楽天地	1,900	4,355.000	8,274,500
スターツコーポレーション	11,400	2,748.000	31,327,200
フジ住宅	13,700	656.000	8,987,200
空港施設	12,600	539.000	6,791,400
明和地所	9,300	631.000	5,868,300
ゴールドクレスト	8,100	1,764.000	14,288,400
エスリード	4,500	1,888.000	8,496,000
日神グループHLDGS	17,100	430.000	7,353,000
日本エスコン	19,500	838.000	16,341,000
MIRARTHホールディング	43,000	390.000	16,770,000
イオンモール	39,500	1,655.000	65,372,500
カチタス	20,600	3,165.000	65,199,000
トーセイ	13,500	1,402.000	18,927,000
サンフロンティア不動産	13,500	1,172.000	15,822,000
FJネクストホールディングス	9,200	966.000	8,887,200
グランディハウス	4,100	548.000	2,246,800
日本空港ビルデング	26,700	6,220.000	166,074,000
日本工営	5,800	3,525.000	20,445,000
LIFULL	34,300	249.000	8,540,700
MIXI	18,000	2,464.000	44,352,000
ジェイエイシーリクルートメント	7,100	2,587.000	18,367,700
日本M&Aセンターホルデ	134,600	1,840.000	247,664,000
メンバーズ	2,600	2,266.000	5,891,600
UTグループ	11,600	2,695.000	31,262,000
アイティメディア	3,300	1,862.000	6,144,600
E・Jホールディングス	5,700	1,305.000	7,438,500
夢真ビーネックスグループ	28,600	1,922.000	54,969,200

コシダカホールディングス	23,800	1,147.000	27,298,600
パソナグループ	9,500	2,058.000	19,551,000
リンクアンドモチベーション	23,200	711.000	16,495,200
エス・エム・エス	30,000	3,610.000	108,300,000
パーソルホールディングス	87,800	3,150.000	276,570,000
リニカル	6,400	728.000	4,659,200
クックパッド	36,000	212.000	7,632,000
学情	4,100	1,498.000	6,141,800
スタジオアリス	4,700	2,087.000	9,808,900
シミックホールディングス	5,100	1,737.000	8,858,700
総合警備保障	29,300	3,725.000	109,142,500
カカクコム	58,700	2,428.000	142,523,600
アイロムグループ	3,100	2,218.000	6,875,800
セントケア・ホールディング	5,800	854.000	4,953,200
ルネサンス	7,100	901.000	6,397,100
ディップ	13,800	4,095.000	56,511,000
デジタルホールディングス	6,800	1,187.000	8,071,600
新日本科学	8,500	2,763.000	23,485,500
ベネフィット・ワン	36,600	2,160.000	79,056,000
エムスリー	154,600	4,205.000	650,093,000
アウトソーシング	47,200	1,008.000	47,577,600
ウェルネット	9,600	642.000	6,163,200
ワールドホールディングス	4,000	2,905.000	11,620,000
ディー・エヌ・エー	33,800	1,850.000	62,530,000
博報堂D Y H L D G S	100,500	1,331.000	133,765,500
ぐるなび	15,000	419.000	6,285,000
タカミヤ	14,000	385.000	5,390,000
ジャパンベストレスキューS	5,900	872.000	5,144,800
ファンコミュニケーションズ	18,400	441.000	8,114,400
ライク	3,400	2,082.000	7,078,800
エスプール	22,800	939.000	21,409,200
WDBホールディングス	4,200	2,377.000	9,983,400
アドウェイズ	11,500	547.000	6,290,500
バリューコマース	6,300	2,091.000	13,173,300
インフォマート	82,900	454.000	37,636,600
J Pホールディングス	27,400	278.000	7,617,200
プレステージ・インター	33,800	712.000	24,065,600
アミューズ	4,900	1,792.000	8,780,800
ドリームインキュベータ	2,800	2,826.000	7,912,800
クイック	6,500	2,083.000	13,539,500
電通グループ	82,200	4,400.000	361,680,000
ぴあ	2,900	3,280.000	9,512,000
イオンファンタジー	3,700	2,923.000	10,815,100
シーティーエス	10,200	835.000	8,517,000
HUグループHD	23,400	2,775.000	64,935,000
アルプス技研	7,100	2,091.000	14,846,100
日本空調サービス	10,300	708.000	7,292,400
オリエンタルランド	82,800	19,720.000	1,632,816,000

ダスキン	17,700	2,953.000	52,268,100
明光ネットワークジャパン	14,300	617.000	8,823,100
ファルコホールディングス	4,500	1,807.000	8,131,500
ラウンドワン	66,300	610.000	40,443,000
リゾートトラスト	31,300	2,435.000	76,215,500
ピー・エム・エル	9,700	3,460.000	33,562,000
りらいあコミュニケーション	13,000	1,027.000	13,351,000
リソー教育	39,900	323.000	12,887,700
早稲田アカデミー	5,600	1,153.000	6,456,800
ユー・エス・エス	80,700	2,296.000	185,287,200
東京個別指導学院	12,100	529.000	6,400,900
サイバーエージェント	187,700	1,229.000	230,683,300
楽天グループ	345,700	653.000	225,742,100
クリーク・アンド・リバー社	4,900	2,058.000	10,084,200
モーニングスター	15,200	470.000	7,144,000
テー・オー・ダブリュー	22,000	297.000	6,534,000
山田コンサルティングG P	4,900	1,144.000	5,605,600
セントラルスポーツ	3,600	2,416.000	8,697,600
フルキャストホールディングス	7,500	3,075.000	23,062,500
エン・ジャパン	14,300	2,448.000	35,006,400
テクノプロ・ホールディング	52,700	3,790.000	199,733,000
アイ・アールジャパンHD	4,400	1,808.000	7,955,200
K e e P e r 技研	5,700	4,255.000	24,253,500
G u n o s y	6,200	669.000	4,147,800
イー・ガーディアン	3,300	2,866.000	9,457,800
ジャパンマテリアル	24,000	2,433.000	58,392,000
ベクトル	13,000	1,281.000	16,653,000
チャームケアコーポレーション	7,300	1,158.000	8,453,400
キャリアリンク	3,300	3,015.000	9,949,500
I B J	5,600	980.000	5,488,000
アサンテ	5,200	1,601.000	8,325,200
バリューHR	7,500	1,675.000	12,562,500
M & A キャピタルパートナー	7,400	4,855.000	35,927,000
ライドオンエクスプレスHD	4,200	1,123.000	4,716,600
E R I ホールディングス	3,800	1,080.000	4,104,000
シグマクシス・ホールディング	12,300	1,334.000	16,408,200
ウィルグループ	7,000	1,360.000	9,520,000
メドピア	6,500	1,649.000	10,718,500
リクルートホールディングス	578,700	4,329.000	2,505,192,300
エラン	10,500	1,025.000	10,762,500
日本郵政	1,025,700	1,078.000	1,105,704,600
ベルシステム24HLDGS	10,900	1,348.000	14,693,200
鎌倉新書	9,700	840.000	8,148,000
エアトリ	5,400	2,673.000	14,434,200
アトラエ	6,600	1,477.000	9,748,200
ストライク	3,900	4,465.000	17,413,500
ソラスト	22,100	821.000	18,144,100
セラク	3,300	1,239.000	4,088,700

インソース	9,800	3,375.000	33,075,000
ベйкаレントコンサルティング	58,000	4,465.000	258,970,000
ORCHESTRA HLDGS	2,000	2,305.000	4,610,000
アイモバイル	5,000	1,266.000	6,330,000
ジャパンエレベーターSHD	27,700	1,742.000	48,253,400
ウェルビー	6,900	861.000	5,940,900
エル・ティー・エス	1,300	3,495.000	4,543,500
ミダックホールディングス	4,800	3,370.000	16,176,000
キュービーネットHLDGS	5,200	1,493.000	7,763,600
RPAホールディングス	13,600	287.000	3,903,200
マネジメントソリューションズ	4,600	3,825.000	17,595,000
フロンティア・マネジメント	3,400	1,405.000	4,777,000
カーブスホールディングス	24,400	982.000	23,960,800
フォーラムエンジニアリング	700	870.000	609,000
FAST FITNESS JAP	3,200	1,335.000	4,272,000
ダイレクトマーケティングミクス	9,300	1,495.000	13,903,500
LITALICO	6,200	2,338.000	14,495,600
リログループ	44,000	2,263.000	99,572,000
東祥	7,000	1,226.000	8,582,000
ビーウィズ	3,300	1,187.000	3,917,100
TREホールディングス	16,700	1,571.000	26,235,700
人・夢・技術グループ	3,800	2,106.000	8,002,800
エイチ・アイ・エス	20,800	2,015.000	41,912,000
ラックランド	3,300	2,959.000	9,764,700
共立メンテナンス	13,400	6,100.000	81,740,000
イチネンホールディングス	8,900	1,252.000	11,142,800
建設技術研究所	4,200	3,255.000	13,671,000
スペース	7,200	890.000	6,408,000
燦ホールディングス	4,100	1,821.000	7,466,100
東京テアトル	9,000	1,141.000	10,269,000
ナガワ	2,000	7,660.000	15,320,000
東京都競馬	6,800	4,030.000	27,404,000
カナモト	14,600	2,245.000	32,777,000
西尾レントオール	7,300	3,090.000	22,557,000
トランス・コスモス	9,700	3,235.000	31,379,500
乃村工藝社	34,300	1,032.000	35,397,600
藤田観光	4,100	2,980.000	12,218,000
KNT-CTホールディングス	5,700	1,730.000	9,861,000
日本管財	7,900	2,542.000	20,081,800
トーカイ	7,200	1,869.000	13,456,800
セコム	79,600	8,485.000	675,406,000
セントラル警備保障	4,600	2,439.000	11,219,400
丹青社	16,100	798.000	12,847,800
メイテック	31,600	2,548.000	80,516,800
応用地質	7,700	2,096.000	16,139,200
船井総研ホールディン	16,500	2,795.000	46,117,500
学究社	4,900	1,786.000	8,751,400
ベネッセホールディングス	29,900	1,991.000	59,530,900

イオンディライト	8,600	2,925.000	25,155,000	
ダイセキ	16,000	4,700.000	75,200,000	
ステップ	3,600	1,795.000	6,462,000	
合 計	88,126,600		218,143,627,430	

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

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)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

国内株式指数ファンド（TOPIX）

2022年12月30日現在

資産総額	4,861,283,256円
負債総額	10,062,005円
純資産総額（ - ）	4,851,221,251円
発行済口数	1,817,338,413口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	2.6694円 (26,694円)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、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また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は発行されません。

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

（イ）受益権の譲渡

- a. 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または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b. 上記aの申請のある場合には、上記aの振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少およ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または記録するものとします。ただし、上記a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または記録が行われるよう通知するものとします。
- c. 上記a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または記録されている振替口座簿にかか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また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。

（ロ）受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

ホ 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議の上、社振法に定めるところに従い、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。

へ 償還金

償還金は、原則として、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者に支払います。

ト 質権口記載また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または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金およ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。

第二部【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】

イ 資本金の額および株式数

	2022年12月30日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

ハ 会社の機構

委託会社の取締役は8名以内とし、株主総会で選任されます。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、累積投票によらないものとします。

取締役の任期は、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の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定し、必要に応じて取締役会長1名を選定することができます。

二 投資信託の運用の流れ



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投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

2022年12月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託(親投資信託は除きます)は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	700	8,981,757
単位型株式投資信託	97	570,058
追加型公社債投資信託	1	24,802
単位型公社債投資信託	182	292,970
合計	980	9,869,589

3【委託会社等の経理状況】

1 当社の財務諸表は、「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条の規定により、「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)に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「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条の規定により、「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)に基づいて作成しております。

なお、当中間会計期間(2022年4月1日から2022年9月30日まで)は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2 当社は、第37期(2021年4月1日から2022年3月31日まで)の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第38期中間会計期間(2022年4月1日から2022年9月30日まで)の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

	(単位:千円)	
	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	33,048,142	49,008,279
顧客分別金信託	300,036	300,041
前払費用	449,748	475,266
未収入金	132,419	103,809
未収委託者報酬	9,936,096	12,125,117
未収運用受託報酬	2,247,156	2,437,063
未収投資助言報酬	398,108	388,639
未収収益	39,975	36,700

その他の流動資産		6,981	18,458
流動資産合計		46,558,665	64,893,375
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		1,509,450	1,433,442
器具備品		870,855	653,985
土地		710	710
リース資産		13,483	7,357
建設仮勘定		-	5,500
有形固定資産合計		2,394,500	2,100,996
無形固定資産			
ソフトウェア		1,347,889	2,766,476
ソフトウェア仮勘定		1,029,033	100,616
のれん		3,654,491	3,349,950
顧客関連資産		15,671,890	13,558,615
電話加入権		12,727	12,716
商標権		48	42
無形固定資産合計		21,716,080	19,788,417
投資その他の資産			
投資有価証券		22,866,282	14,212,354
関係会社株式		11,246,398	11,246,398
長期差入保証金		1,409,091	1,414,646
長期前払費用		116,117	77,936
会員権		90,479	90,479
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産合計		35,707,619	27,021,065
固定資産合計		59,818,200	48,910,479
資産合計		106,376,866	113,803,855

(単位：千円)

	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		
リース債務	5,153	3,567
顧客からの預り金	20,077	6,045
その他の預り金	169,380	196,515
未払金		
未払収益分配金	1,646	1,969
未払償還金	43,523	152
未払手数料	4,480,697	5,545,582
その他未払金	270,290	48,893
未払費用	5,940,121	7,379,404
未払消費税等	235,647	1,133,332
未払法人税等	762,648	2,455,291
賞与引当金	1,516,622	2,100,323
資産除去債務	-	7,192
その他の流動負債	9,710	40,396
流動負債合計	13,455,519	18,918,667
固定負債		
リース債務	9,678	4,525
繰延税金負債	2,566,958	1,279,409
退職給付引当金	5,258,448	5,084,506
その他の固定負債	40,950	4,620
固定負債合計	7,876,035	6,373,062

負債合計	21,331,554	25,291,730
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	81,927,000	73,466,962
資本剰余金合計	90,555,984	82,095,946
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	-
別途積立金	1,476,959	-
繰越利益剰余金	10,281,242	3,834,794
利益剰余金合計	8,460,037	4,119,040
株主資本計	84,095,946	88,214,986
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	949,365	297,138
評価・換算差額等合計	949,365	297,138
純資産合計	85,045,311	88,512,124
負債・純資産合計	106,376,866	113,803,855

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	2020年4月1日	(自	2021年4月1日
	至	2021年3月31日)	至	2022年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		50,610,457		66,139,024
運用受託報酬		9,450,169		9,652,634
投資助言報酬		1,270,584		1,256,334
その他営業収益				
サービス支 hands 手数料		200,807		199,046
その他		32,820		32,936
営業収益計		61,564,839		77,279,976
営業費用				
支払手数料		22,784,919		30,522,133
広告宣伝費		365,317		330,161
調査費				
調査費		3,061,987		3,196,921
委託調査費		7,810,157		12,192,048
営業雑経費				
通信費		95,163		67,600
印刷費		554,920		494,834
協会費		40,044		34,433
諸会費		29,473		30,488
情報機器関連費		4,562,612		4,767,504
販売促進費		23,614		31,930
その他		163,332		181,301
営業費用合計		39,491,542		51,849,358
一般管理費				
給料				

役員報酬	277,027	263,893
給料・手当	9,280,730	8,664,828
賞与	950,630	991,916
賞与引当金繰入額	1,501,855	2,100,323
交際費	11,815	12,301
寄付金	949	29,273
事務委託費	844,255	1,422,189
旅費交通費	21,023	16,863
租税公課	389,819	476,729
不動産賃借料	1,639,529	1,289,256
退職給付費用	790,144	632,559
固定資産減価償却費	3,040,894	3,133,951
のれん償却費	2,645,986	304,540
諸経費	608,206	256,994
一般管理費合計	22,002,869	19,595,622
営業利益	70,426	5,834,995

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	13,164	7,666
受取利息	2,736	1,836
時効成立分配金・償還金	88,335	43,406
原稿・講演料	2,603	2,587
投資有価証券償還益	57,388	383,608
投資有価証券売却益	162,941	911,268
為替差益	-	4,673
雑収入	72,933	81,640
営業外収益合計	400,104	1,436,686
営業外費用		
投資有価証券償還損	11,762	146,219
投資有価証券売却損	34,473	81,384
為替差損	766	-
雑損失	1,240	2,866
営業外費用合計	48,243	230,470
経常利益	422,288	7,041,212
特別損失		
固定資産除却損	1 54,493	83,651
減損損失	2 28,097,346	-
システム統合関連費用	3 -	375,636
早期退職費用	4 216,200	260,075
本社移転費用	127,044	-
その他特別損失	5,460	67,000
特別損失合計	28,500,544	786,362
税引前当期純利益又は 税引前当期純損失()	28,078,256	6,254,849
法人税、住民税及び事業税	1,549,173	3,101,482
法人税等調整額	693,192	965,673

法人税等合計	855,980	2,135,809
当期純利益又は 当期純損失（ ）	28,934,237	4,119,040

（ 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：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265
当期変動額								
剰余金の配当								711,271
当期純損失（ ）								28,934,237
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）								
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	29,645,508
当期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	10,281,242

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309
当期変動額					
剰余金の配当	711,271	711,271			711,271
当期純損失（ ）	28,934,237	28,934,237			28,934,237
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			571,510	571,510	571,510
当期変動額合計	29,645,508	29,645,508	571,510	571,510	29,073,997
当期末残高	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	10,281,242
当期変動額								
剰余金の配当								
欠損填補			8,460,037	8,460,037				8,460,037
当期純利益								4,119,040

任意積立金の取崩						60,000	1,476,959	1,536,959
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)								
当期変動額合計	-	-	8,460,037	8,460,037	-	60,000	1,476,959	14,116,037
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	-	-	3,834,794

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311
当期変動額					
剰余金の配当					
欠損填補	8,460,037	-			-
当期純利益	4,119,040	4,119,040			4,119,040
任意積立金の取崩	-	-			-
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)			652,227	652,227	652,227
当期変動額合計	12,579,078	4,119,040	652,227	652,227	3,466,812
当期末残高	4,119,040	88,214,986	297,138	297,138	88,512,124

[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

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外

決算日の市場価格等に基づく時価法

(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)

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産(リース資産を除く)

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 4～15年

(2) 無形固定資産(リース資産を除く)

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん 14年

顧客関連資産 6～19年

ソフトウェア(自社利用分) 5年(社内における利用可能期間)

(3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち、当事業年度の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度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。

退職給付見込額の期間帰属方法

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。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. 収益及び費用の計上基準

「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。以下、「収益認識会計基準」という。)等を適用しており、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該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。

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び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) 委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2) 運用受託報酬

運用受託報酬は、対象顧客との投資一任契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(3) 投資助言報酬

投資助言報酬は、対象顧客との投資助言契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の助言期間にわたり収益として認識しております。

(会計方針の変更)

「収益認識会計基準」等を当事業年度の期首から適用し、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該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。当該会計基準等の適用が当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識関係」注記については記載していません。

(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	102,329千円	210,548千円
器具備品	1,153,649千円	1,309,352千円
リース資産	2,830千円	6,073千円

2 当座借越契約

当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	- 千円	- 千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

3 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	93,374千円	57,356千円

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

	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)
建物	18,278千円	- 千円
器具備品	28,604千円	0千円
リース資産	- 千円	- 千円
ソフトウェア	7,610千円	83,651千円
ソフトウェア仮勘定	- 千円	- 千円

2 減損損失

前事業年度において、次のとおり減損損失を計上しております。

(単位：千円)

場所	用途	種類	減損損失
-	その他	のれん	28,097,346

当社は、資産と対応して継続的に収支の把握ができる単位が全社のみであることから全社資産の単一グループとしております。

当社は、当社を存続会社とし、大和住銀投信投資顧問株式会社を消滅会社とする吸収合併に伴って発生したのれんを計上しております。当該のれんについて下期以降の業績は上向いているものの、通期では業績計画を下回る結果となったことを踏まえて将来キャッシュ・フローを見直した結果、のれんの帳簿価額の回収が見込まれなくなったため、帳簿価額を回収可能価額まで減損し、当該減少額を減損損失として計上しております。

なお、回収可能価額は使用価値としており、将来キャッシュ・フローを9.2%で割り引いて算出しております。当事業年度において計上した減損損失はありません。

3 システム統合関連費用

社内システム統合に伴うものであり、主にデータの移行費用などであります。

4 早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

(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. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株

2. 剰余金の配当に関する事項

配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月29日 定時株主総会	普通株式	711,271	21.00	2020年 3月31日	2020年 6月30日

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数

普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株
------	-------------	---	---	-------------

2. 剰余金の配当に関する事項

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月28日 定時株主総会	普通株式	2,540,254	75.00	2022年 3月31日	2022年 6月29日

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
1年以内	1,194,699	1,166,952
1年超	3,497,258	2,323,090
合計	4,691,958	3,490,042

(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、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っています。そのため、資金運用については、短期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確保を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っています。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っていません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収運用受託報酬及び未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。未収委託者報酬は、信託財産中から支弁されるものであり、信託財産については受託者である信託銀行において分別管理されているため、リスクは僅少となっています。

投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて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

信用リスクの管理

当社は、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、営業債権について、取引先毎の期日管理及び残高管理を行うとともに、その状況について取締役会に報告しています。

投資有価証券、子会社株式は発行体の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

市場リスクの管理

投資有価証券については、自己勘定資産の運用・管理に関する規程に従い、各所管部においては所管する有価証券について管理を、経営企画部においては総合的なリスク管理を行い、定期的に時価を把握しています。また、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、その状況について取締役会に報告しています。

なお、事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等については、純資産額に対する保有制限を設けており、また、自社設定投信等の取得・処分に関する規則に従い、定期的に取締役会において報告し、投資家の資金性格、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれていません（注2）参照）。

前事業年度（2021年3月31日）

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
----	----------	----	----

(1)現金及び預金	33,048,142	33,048,142	-
(2)顧客分別金信託	300,036	300,036	-
(3)未収委託者報酬	9,936,096	9,936,096	-
(4)未収運用受託報酬	2,247,156	2,247,156	-
(5)未収投資助言報酬	398,108	398,108	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	22,826,472	22,826,472	-
(7)長期差入保証金	1,409,091	1,409,091	-
資産計	70,165,105	70,165,105	-
(1)顧客からの預り金	20,077	20,077	-
(2)未払手数料	4,480,697	4,480,697	-
負債計	4,500,774	4,500,774	-

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	49,008,279	49,008,279	-
(2)顧客分別金信託	300,041	300,041	-
(3)未収委託者報酬	12,125,117	12,125,117	-
(4)未収運用受託報酬	2,437,063	2,437,063	-
(5)未収投資助言報酬	388,639	388,639	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	14,172,545	14,172,545	-
資産計	78,431,686	78,431,686	-
(1)顧客からの預り金	6,045	6,045	-
(2)未払手数料	5,545,582	5,545,582	-
負債計	5,551,627	5,551,627	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(2)顧客分別金信託、(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬及び(5)未収投資助言報酬
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(6)投資有価証券

これらの時価について、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

負 債

(1)顧客からの預り金及び(2)未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

（注2）市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

（単位：千円）

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	39,809	39,809
合計	39,809	39,809
子会社株式 非上場株式	11,246,398	11,246,398
合計	11,246,398	11,246,398

その他有価証券については、市場価格がないため、「(6) その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式については、市場価格がないため、時価開示の対象とはしておりません。

また時価をもって貸借対照表計上額としている「(6) その他有価証券」は、全て投資信託で構成されております。そのため、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」第26項の経過措置を適用し、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は記載しておりません。

（注3）金銭債権及び満期が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：千円）

区分	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	33,048,142	-	-	-
顧客分別金信託	300,036	-	-	-
未収委託者報酬	9,936,096	-	-	-
未収運用受託報酬	2,247,156	-	-	-
未収投資助言報酬	398,108	-	-	-
長期差入保証金	42,007	1,367,084	-	-
合計	45,971,548	1,367,084	-	-

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

区分	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	49,008,279	-	-	-
顧客分別金信託	300,041	-	-	-
未収委託者報酬	12,125,117	-	-	-
未収運用受託報酬	2,437,063	-	-	-
未収投資助言報酬	388,639	-	-	-
合計	64,259,140	-	-	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度（2021年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2022年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度（2021年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	16,097,433	14,397,606	1,699,827
小計	16,097,433	14,397,606	1,699,827
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	6,729,039	6,994,762	265,723
小計	6,729,039	6,994,762	265,723
合計	22,826,472	21,392,369	1,434,103

(注) 非上場株式等（貸借対照表計上額 39,809千円）については、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	9,299,062	8,672,725	626,337
小計	9,299,062	8,672,725	626,337
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	4,873,482	5,039,817	166,335
小計	4,873,482	5,039,817	166,335
合計	14,172,545	13,712,543	460,001

(注) 非上場株式等（貸借対照表計上額 39,809千円）については、市場価格がないことから、記載しておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,978,622	162,941	34,473

（単位：千円）

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
1,630,219	57,388	11,762

当事業年度(自 2021年 4月 1日 至 2022年 3月31日)

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
4,082,976	911,268	81,384

(単位：千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
7,183,410	383,608	146,219

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、投資有価証券について1,560千円（その他有価証券1,560千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

当事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

(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、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月31日)	当事業年度 (自 2021年 4月 1日 至 2022年 3月31日)
退職給付債務の期首残高	5,299,814	5,258,448
勤務費用	476,308	454,611
利息費用	-	1,013
数理計算上の差異の発生額	67,476	34,553
退職給付の支払額	585,151	595,013
過去勤務費用の発生額	-	-
合併による発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	5,258,448	5,084,506

(2)退職給付債務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：千円)

	前事業年度 (2021年 3月31日)	当事業年度 (2022年 3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	5,258,448	5,084,506
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	5,258,448	5,084,506

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月31日)	当事業年度 (自 2021年 4月 1日 至 2022年 3月31日)
勤務費用	476,308	454,611
利息費用	-	1,013
数理計算上の差異の費用処理額	67,476	34,553
その他	246,359	211,487
確定給付制度に係る退職給付費用	790,144	632,559

(注) その他は、その他の関係会社等からの出向者の年金掛金負担分及び退職給付引当額相当額負担分、退職定年制度適用による割増退職金並びに確定拠出年金への拠出額であります。

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

	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)
割引率	0.020%	0.130%

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239,162千円、当事業年度237,296千円であります。

(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

	(単位：千円)	
	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		
退職給付引当金	1,610,136	1,556,876
賞与引当金	464,389	643,119
調査費	247,208	279,809
未払金	206,090	284,070
未払事業税	66,891	139,522
ソフトウェア償却	90,431	107,998
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	131,391	93,946
その他	35,930	28,056
繰延税金資産小計	2,967,346	3,248,274
評価性引当額(注)	218,966	189,102
繰延税金資産合計	2,748,380	3,059,171
繰延税金負債		
無形固定資産	4,798,732	4,151,648
資産除去債務	-	825
その他有価証券評価差額金	516,605	186,107
繰延税金負債合計	5,315,338	4,338,581
繰延税金資産(負債)の純額	2,566,958	1,279,409

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間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
法定実効税率	税引前当期純損失のため 記載を省略しております。	30.6%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目		1.6
住民税均等割等		0.1
のれん償却費		1.4
その他		0.2
税効果会計適用後の法人税等の負担率		34.1

(収益認識関係)

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は、「セグメント情報等」注記に記載のとおりであります。

(セグメント情報等)

前事業年度(自2020年4月1日至2021年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業

活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	50,610,457	9,450,169	1,270,584	233,628	61,564,839

(2) 地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3. 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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

4. 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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

5. 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。

当事業年度(自 2021年4月1日 至2022年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	66,139,024	9,652,634	1,256,334	231,982	77,279,976

(2) 地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3. 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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

4. 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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

5. 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)

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	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	科目	期末残高
親会社の子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	3,728,851	未払 手数料	863,159
親会社の子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,578,226	未払 手数料	1,070,559

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	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	科目	期末残高
親会社の子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	4,727,024	未払 手数料	1,098,966
親会社の子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	8,397,864	未払 手数料	1,661,614

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

(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	2,510.93円	2,613.28円
1株当たり当期純利益又は 1株当たり当期純損失()	854.27円	121.61円

(注) 1. 前事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、1株当たり当期純損失であり、また、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

当事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、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又は1株当たり当期純損失の算定上の基礎は、次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)
1株当たり当期純利益又は当期純損失		
当期純利益又は当期純損失()(千円)	28,934,237	4,119,040
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益又は 当期純損失()(千円)	28,934,237	4,119,040
期中平均株式数(株)	33,870,060	33,870,060

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

第38期中間会計期間 (2022年 9月 30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	35,409,452
金銭の信託	9,386,865
顧客分別金信託	300,043
前払費用	601,040
未収委託者報酬	11,798,214
未収運用受託報酬	2,759,722
未収投資助言報酬	386,860
未収収益	40,783
その他	307,594
流動資産合計	60,990,577
固定資産	
有形固定資産	1 2,044,583
無形固定資産	
のれん	3,197,680
顧客関連資産	12,501,978
その他	2,865,181
無形固定資産合計	18,564,839
投資その他の資産	
投資有価証券	11,924,303
関係会社株式	11,850,598
その他	1,571,118
貸倒引当金	20,750
投資その他の資産合計	25,325,270
固定資産合計	45,934,694
資産合計	106,925,272
負債の部	
流動負債	
リース債務	2,564
顧客からの預り金	28,648
その他の預り金	93,717
未払金	5,378,614
未払費用	4,957,793
未払法人税等	910,281
前受収益	32,553
賞与引当金	1,973,312

その他	2	482,541
流動負債合計		13,860,025
固定負債		
リース債務		3,243
繰延税金負債		987,563
退職給付引当金		5,137,995
固定負債合計		6,128,802
負債合計		19,988,828
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
その他資本剰余金		73,466,962
資本剰余金合計		82,095,946
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		2,489,135
利益剰余金合計		2,773,380
株主資本合計		86,869,326
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		67,117
評価・換算差額等合計		67,117
純資産合計		86,936,444
負債純資産合計		106,925,272

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第38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		31,446,166
運用受託報酬		4,428,746
投資助言報酬		607,317
その他の営業収益		126,597
営業収益計		36,608,828
営業費用		25,074,910
一般管理費	1	9,497,685
営業利益		2,036,233
営業外収益	2	87,533
営業外費用	3	309,096
経常利益		1,814,670
特別損失	4	6,885
税引前中間純利益		1,807,784
法人税、住民税及び事業税		784,532
法人税等調整額		171,342
法人税等合計		613,189
中間純利益		1,194,594

(3)中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金 繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,834,794
当中間期変動額						
剰余金の配当						2,540,254
中間純利益						1,194,594
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	-	-	-	-	-	1,345,660
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	2,489,135

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	4,119,040	88,214,986	297,138	297,138	88,512,124
当中間期変動額					
剰余金の配当	2,540,254	2,540,254			2,540,254
中間純利益	1,194,594	1,194,594			1,194,594
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）			230,020	230,020	230,020
当中間期変動額 合計	1,345,660	1,345,660	230,020	230,020	1,575,680
当中間期末残高	2,773,380	86,869,326	67,117	67,117	86,936,444

注記事項

(重要な会計方針)

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

その他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（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）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

(2)金銭の信託

運用目的の金銭の信託

時価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産（リース資産を除く）

定率法によっております。但し、建物（建物附属設備を除く）並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	8～50年
器具備品	4～15年

(2)無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん	14年
顧客関連資産	6～19年
ソフトウェア（自社利用分）	5年（社内における利用可能期間）

(3)リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3．引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の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。

(3)退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間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。

退職給付見込額の期間帰属方法

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。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4．収益及び費用の計上基準

「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。以下、「収益認識会計基準」という。）等を適用しており、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該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。

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び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)委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2)運用受託報酬

運用受託報酬は、対象顧客との投資一任契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(3)投資助言報酬

投資助言報酬は、対象顧客との投資助言契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の助言期間にわたり収益として認識しております。

（会計方針の変更）

「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。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用しております。これによる当中間財務諸表に与える影響はありません。

（中間貸借対照表関係）

第38期中間会計期間 (2022年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,632,164千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。	当座借越極度額の総額 10,000,000千円 借入実行残高 - 差引額 10,000,000千円
4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額40,711千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1.一般管理費のうち主要なもの	のれん償却費 152,270千円 減価償却実施額 有形固定資産 173,639千円 無形固定資産 1,441,546千円
2.営業外収益のうち主要なもの	為替差益 7,815千円 受取配当金 1,230千円 投資有価証券償還益 20,660千円 投資有価証券売却益 25,620千円
3.営業外費用のうち主要なもの	投資有価証券償還損 43,419千円 投資有価証券売却損 152,586千円 金銭の信託運用損 113,089千円
4.特別損失のうち主要なもの	固定資産除却損 6,885千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

1.発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株

2.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 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月28日 定時株主総会	普通株式	2,540,254	75.00	2022年 3月31日	2022年 6月29日

(リース取引関係)

第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1.オペレーティング・リース取引 (借主側)	未経過リース料(解約不能のもの) 1年以内 1,161,545千円 1年超 1,742,317千円 合計 2,903,862千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

第38期中間会計期間（2022年9月30日）

2022年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません（（注1）参照）。また、現金及び預金、顧客分別金信託、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、顧客からの預り金、未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価格に近似することから、注記を省略しております。

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 金銭の信託	9,386,865	9,386,865	-
(2) 投資有価証券 その他有価証券	11,884,494	11,884,494	-
資産計	21,271,360	21,271,360	-

（注1）市場価格のない金融商品

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式	39,809
合計	39,809
子会社株式 非上場株式	11,850,598
合計	11,850,598

これらについては、「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2020年3月31日）第5項に従い、1. 金融商品の時価等に関する事項及び2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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又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。

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

（単位：千円）

区分	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
(1) 金銭の信託	-	9,386,865	-	9,386,865
(2) 投資有価証券 その他有価証券	-	11,884,494	-	11,884,494
資産計	-	21,271,360	-	21,271,360

（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

(1) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 投資有価証券 その他有価証券

投資有価証券は、市場での取引頻度が低く、活発な市場における相場価格とは認められないため、公表されている基準価額又は取引金融機関から提示された価格により評価しております。

（有価証券関係）

第38期中間会計期間（2022年9月30日）

1. 子会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 11,850,598千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	4,799,952	4,484,899	315,053
小計	4,799,952	4,484,899	315,053
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	7,084,541	7,290,117	205,575
小計	7,084,541	7,290,117	205,575
合計	11,884,494	11,775,016	109,477

(注)非上場株式等(中間貸借対照表計上額 39,809千円)については、市場価格がないことから、記載しておりません。

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(収益認識関係)

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は、「セグメント情報等」注記に記載のとおりであります。

(セグメント情報等)

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位:千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	31,446,166	4,428,746	607,317	126,597	36,608,828

(2)地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3)主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3. 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。

4. 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

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

5. 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。

(1株当たり情報)

第38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	2,566円76銭
1株当たり中間純利益	35円26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、潜在株式が存在しないため記載していません。	

4【利害関係人との取引制限】

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

- イ 自己また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、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 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、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ハ 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。)または子法人等(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または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等また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。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等また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、また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】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
 - (イ) 定款の変更
該当ありません。
 - (ロ) その他の重要事項
該当ありません。
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実
該当ありません。

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】

- イ 受託会社
 - (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
 - (ロ) 資本金の額 342,037百万円(2022年3月末現在)

- (八) 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。

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 株式会社日本カストディ銀行
- ・ 資本金の額 51,000百万円(2022年3月末現在)
- ・ 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。

□ 販売会社

名称	資本金の額(百万円) 2022年3月末現在	事業の内容
株式会社三井住友銀行	1,770,996	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

□ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書(目論見書)の提供、一部解約の実行の請求の受付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

3【資本関係】

(持株比率5%以上を記載しています。)
該当ありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2022年 2月24日	有価証券届出書
2022年 2月24日	有価証券報告書
2022年 8月25日	有価証券届出書
2022年 8月25日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2022年6月15日

三井住友DS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 羽 太 典 明指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅 野 雅 子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐 藤 栄 裕**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DS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37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DS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並びに監査役及び監査役会の責任

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。

監査役及び監査役会の責任は、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、監査役及び監査役会に対して、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 . 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）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

2023年2月7日

三井住友DS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 菅野 雅子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志**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」に掲げられている国内株式指数ファンド（TOPIX）の2021年12月1日から2022年11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、国内株式指数ファンド（TOPIX）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DS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。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三井住友DS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 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年11月18日

三井住友DS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 菅野 雅子

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄裕

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DS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38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DS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並びに監査役及び監査役会の責任

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。

監査役及び監査役会の責任は、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、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、監査役及び監査役会に対して、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 . 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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。