

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年9月12日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	上坪 直樹
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	D C日本株式インデックスファンドA
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】**（１）【ファンドの名称】**

DC日本株式インデックスファンドA

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

2023年 9月13日から2024年 3月11日までとします。

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

れます。

(8) 【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

(照会先)

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。)

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

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

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

<ファンドの特色>

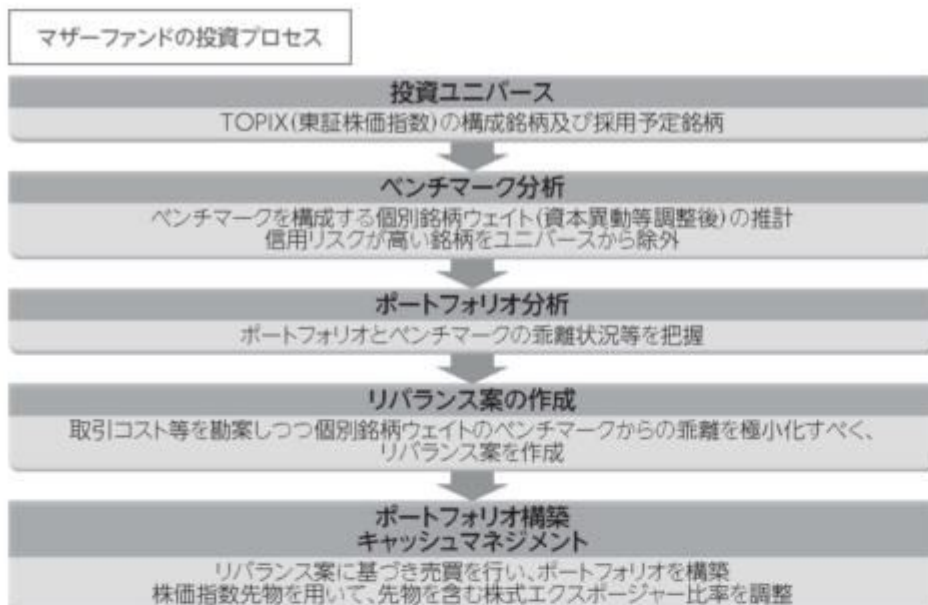
わが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

TOPIX（東証株価指数）（配当込み）^(注)とは

株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

(注) TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の著作権等について

1. TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下、「配当込みTOPIX」という。）の指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有する。
2. JPXは、配当込みTOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、配当込みTOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又は配当込みTOPIXに係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。
3. JPXは、配当込みTOPIXの指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の配当込みTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではない。
4. JPXは、配当込みTOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、JPXは、配当込みTOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
5. 本件商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではない。
6. JPXは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負わない。
7. JPXは、当社又は本件商品の購入者のニーズを配当込みTOPIXの指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではない。
8. 以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

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



分配方針

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

主な投資制限

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

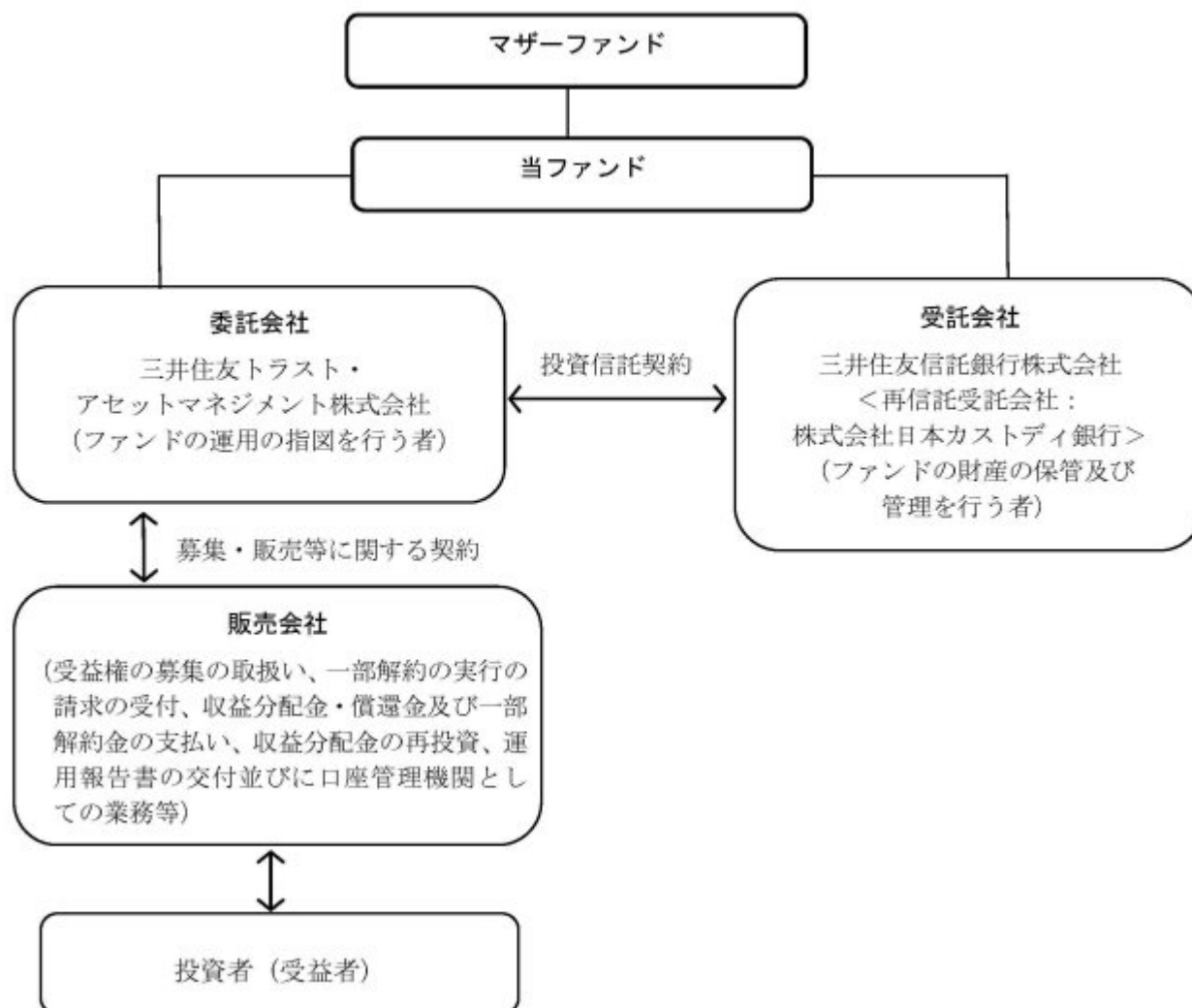
2002年12月11日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

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

当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンドに変更

（３）【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2023年 6月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

運用方針

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

投資態度

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

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - A．有価証券
 - B．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記

（５）投資制限＜約款に定める投資制限＞Ｊ．、Ｋ．及びＬ．に定めるものに限り、）

Ｃ．金銭債権（上記Ａ．、Ｂ．及び下記Ｄ．に掲げるものに該当するものを除きます。）

Ｄ．約束手形（上記Ａ．に掲げるものに該当するものを除きます。）

２．次に掲げる特定資産以外の資産

Ａ．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

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

Ａ．株券又は新株引受権証券

Ｂ．国債証券

Ｃ．地方債証券

Ｄ．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

Ｊ．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

Ｑ．預託証券（金融商品取引法第２条第１項第２０号で定めるものをいいます。）

Ｒ．外国法人が発行する譲渡性預金証券

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

Ｔ．抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第１６号で定めるものをいいます。）

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

Ｖ．外国の者に対する権利で上記Ｕ．の有価証券の性質を有するもの

なお、上記Ａ．の証券又は証書並びに上記Ｌ．及び上記Ｑ．の証券又は証書のうち上記Ａ．の証券

又は証券の性質を有するものを以下「株式」といい、上記B．から上記F．までの証券並びに上記L．及び上記Q．の証券又は証券のうち上記B．から上記F．までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記M．の証券及び上記N．の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用指図できる金融商品

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

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

B．金融商品による運用の特例

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

(参考)マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2．運用方法

(1) 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

株式への投資は、原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引（「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

信託財産に属する資産の価格変動リスク回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、スワップ取引を行うことができます。

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

3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

（3）【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

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

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

A．株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

C．新株引受権証券等への投資割合

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

D．投資信託証券への投資割合

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

E．同一銘柄の株式への投資割合

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

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

G．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

H．投資する株式等の範囲

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

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

I．信用取引の運用指図

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

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

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

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

ことができるものとします。

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

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

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

< その他の留意点 >

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

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

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

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

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

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

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

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

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

確定拠出年金制度の加入者等はファンドの受益者ではありませんが、当該加入者等がファンドのリスクを実質的に負うこととなります。

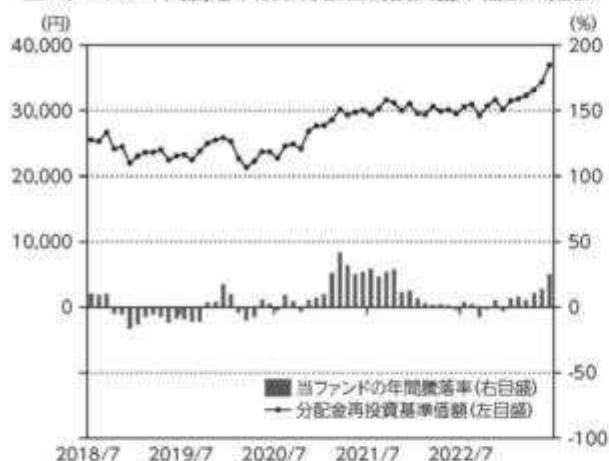
（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

【参考情報】

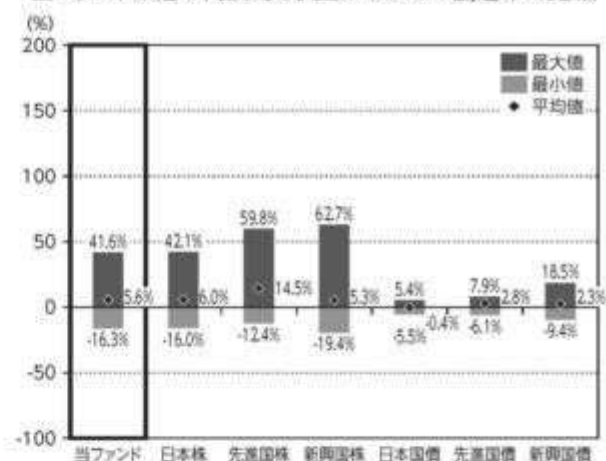
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

*当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2018年7月～2023年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.2035%（税抜 0.185%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.1045% （税抜 0.095%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.066% （税抜 0.06%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.033% （税抜 0.03%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料
 先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料
 組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
 財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
 上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2023年 6月30日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2023年6月30日現在の状況について記載してあります。

【DC日本株式インデックスファンドA】

（１）【投資状況】

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	1,774,523,830	99.95
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		890,629	0.05
合計（純資産総額）		1,775,414,459	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
--------	----	-----	----	------------	------------	-----------	-----------	----------

日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	657,913,329	2.2844	1,502,939,037	2.6972	1,774,523,830	99.95
----	-----------	-------------	-------------	--------	---------------	--------	---------------	-------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第11期計算期間末	(2013年12月10日)	1,706,614,466	1,706,614,466	16,944	16,944
第12期計算期間末	(2014年12月10日)	1,877,015,127	1,877,015,127	19,290	19,290
第13期計算期間末	(2015年12月10日)	1,988,050,902	1,988,050,902	21,457	21,457
第14期計算期間末	(2016年12月12日)	2,061,339,551	2,061,339,551	21,720	21,720
第15期計算期間末	(2017年12月11日)	2,209,160,180	2,209,160,180	26,176	26,176
第16期計算期間末	(2018年12月10日)	1,975,360,863	1,975,360,863	23,361	23,361
第17期計算期間末	(2019年12月10日)	2,105,502,404	2,105,502,404	25,822	25,822
第18期計算期間末	(2020年12月10日)	1,905,184,214	1,905,184,214	27,212	27,212
第19期計算期間末	(2021年12月10日)	1,498,036,766	1,498,036,766	30,784	30,784
第20期計算期間末	(2022年12月12日)	1,490,944,258	1,490,944,258	31,186	31,186
	2022年 6月末日	1,429,343,816		29,525	
	7月末日	1,475,230,210		30,617	
	8月末日	1,489,131,996		30,973	
	9月末日	1,410,999,901		29,265	
	10月末日	1,476,670,288		30,747	
	11月末日	1,521,246,585		31,639	
	12月末日	1,452,437,494		30,186	

2023年 1月末日	1,522,167,664		31,509
2月末日	1,528,332,200		31,798
3月末日	1,561,854,921		32,328
4月末日	1,590,823,546		33,189
5月末日	1,623,358,800		34,376
6月末日	1,775,414,459		36,959

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第11期計算期間	2012年12月11日～2013年12月10日	0
第12期計算期間	2013年12月11日～2014年12月10日	0
第13期計算期間	2014年12月11日～2015年12月10日	0
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	0
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	0
第16期計算期間	2017年12月12日～2018年12月10日	0
第17期計算期間	2018年12月11日～2019年12月10日	0
第18期計算期間	2019年12月11日～2020年12月10日	0
第19期計算期間	2020年12月11日～2021年12月10日	0
第20期計算期間	2021年12月11日～2022年12月12日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第11期計算期間	2012年12月11日～2013年12月10日	62.0
第12期計算期間	2013年12月11日～2014年12月10日	13.8
第13期計算期間	2014年12月11日～2015年12月10日	11.2
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	1.2
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	20.5
第16期計算期間	2017年12月12日～2018年12月10日	10.8
第17期計算期間	2018年12月11日～2019年12月10日	10.5
第18期計算期間	2019年12月11日～2020年12月10日	5.4
第19期計算期間	2020年12月11日～2021年12月10日	13.1
第20期計算期間	2021年12月11日～2022年12月12日	1.3
第21期中間計算期間	2022年12月13日～2023年 6月12日	15.8

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第11期計算期間	2012年12月11日～2013年12月10日	414,067,395	528,195,942	1,007,187,707
第12期計算期間	2013年12月11日～2014年12月10日	287,570,199	321,702,300	973,055,606
第13期計算期間	2014年12月11日～2015年12月10日	334,502,702	381,040,919	926,517,389
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	221,175,855	198,632,883	949,060,361
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	199,865,073	304,958,532	843,966,902
第16期計算期間	2017年12月12日～2018年12月10日	159,092,319	157,488,542	845,570,679
第17期計算期間	2018年12月11日～2019年12月10日	109,110,724	139,292,136	815,389,267
第18期計算期間	2019年12月11日～2020年12月10日	181,680,786	296,943,765	700,126,288
第19期計算期間	2020年12月11日～2021年12月10日	96,749,997	310,248,007	486,628,278
第20期計算期間	2021年12月11日～2022年12月12日	73,704,889	82,251,802	478,081,365
第21期中間計算期間	2022年12月13日～2023年 6月12日	41,000,056	46,164,326	472,917,095

(注)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

日本株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	352,209,382,060	98.51
新株予約権証券	日本	5,871,000	0.00
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		5,317,045,333	1.49
合計(純資産総額)		357,532,298,393	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資 比率 （％）
株価指数先物取引	買建	日本	5,170,880,000	1.45

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	5,914,200	1,888.94	11,171,568,948	2,308.50	13,652,930,700	3.82
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	761,900	11,459.96	8,731,343,524	12,965.00	9,878,033,500	2.76
日本	株式	キーエンス	電気機器	107,800	58,424.08	6,298,115,824	67,850.00	7,314,230,000	2.05
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,643,500	936.21	6,219,711,135	1,065.00	7,075,327,500	1.98
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	34,605,000	153.29	5,304,863,448	170.50	5,900,152,500	1.65
日本	株式	三菱商事	卸売業	694,800	4,362.99	3,031,405,452	6,930.00	4,814,964,000	1.35
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	775,200	5,519.38	4,278,623,376	6,159.00	4,774,456,800	1.34
日本	株式	日立製作所	電気機器	529,000	6,723.91	3,556,948,390	8,896.00	4,705,984,000	1.32
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	228,000	15,193.86	3,464,200,080	20,560.00	4,687,680,000	1.31
日本	株式	任天堂	その他製品	680,000	5,534.73	3,763,616,400	6,542.00	4,448,560,000	1.24
日本	株式	三井物産	卸売業	808,800	3,859.68	3,121,709,184	5,411.00	4,376,416,800	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	956,000	4,200.70	4,015,869,200	4,527.00	4,327,812,000	1.21
日本	株式	第一三共	医薬品	941,100	4,273.59	4,021,875,549	4,550.00	4,282,005,000	1.20
日本	株式	信越化学工業	化学	896,800	3,434.73	3,080,265,864	4,768.00	4,275,942,400	1.20
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	702,200	4,130.74	2,900,605,628	5,687.00	3,993,411,400	1.12
日本	株式	HOYA	精密機器	228,200	13,690.81	3,124,242,842	17,075.00	3,896,515,000	1.09
日本	株式	ダイキン工業	機械	129,900	22,224.46	2,886,957,354	29,265.00	3,801,523,500	1.06
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	875,500	3,097.83	2,712,150,165	4,341.00	3,800,545,500	1.06
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	819,800	4,202.13	3,444,906,174	4,563.00	3,740,747,400	1.05
日本	株式	KDDI	情報・通信業	834,800	4,022.76	3,358,200,048	4,450.00	3,714,860,000	1.04
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	532,900	5,977.94	3,185,644,226	6,773.00	3,609,331,700	1.01
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,048,500	2,719.51	2,851,406,235	3,315.00	3,475,777,500	0.97
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,534,100	1,992.76	3,057,093,116	2,199.00	3,373,485,900	0.94
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	586,000	4,090.35	2,396,945,100	5,601.00	3,282,186,000	0.92
日本	株式	S M C	機械	35,300	62,777.08	2,216,030,924	79,480.00	2,805,644,000	0.78
日本	株式	村田製作所	電気機器	326,700	7,466.31	2,439,243,477	8,236.00	2,690,701,200	0.75
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,735,800	1,479.48	2,568,081,384	1,540.00	2,673,132,000	0.75
日本	株式	ファナック	電気機器	525,200	4,394.66	2,308,075,432	5,032.00	2,642,806,400	0.74
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	392,800	6,047.80	2,375,575,840	6,205.00	2,437,324,000	0.68
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,124,300	1,343.09	1,510,036,087	2,027.00	2,278,956,100	0.64

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.29
		建設業	1.97
		食料品	3.34
		繊維製品	0.42
		パルプ・紙	0.16
		化学	5.96
		医薬品	5.11
		石油・石炭製品	0.41
		ゴム製品	0.75
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.86
		非鉄金属	0.65
		金属製品	0.51
		機械	5.51
		電気機器	18.05
		輸送用機器	7.84
		精密機器	2.54
		その他製品	2.31
		電気・ガス業	1.26
		陸運業	2.88
		海運業	0.54
		空運業	0.51
		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	8.12
		卸売業	6.75
		小売業	4.27
		銀行業	6.01
		証券、商品先物取引業	0.70
		保険業	2.26
その他金融業	1.12		
不動産業	1.78		
サービス業	4.77		
	小計	98.51	
新株予約権証券			0.00
合計			98.51

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	226	円	5,103,903,850	5,170,880,000	1.45

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

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

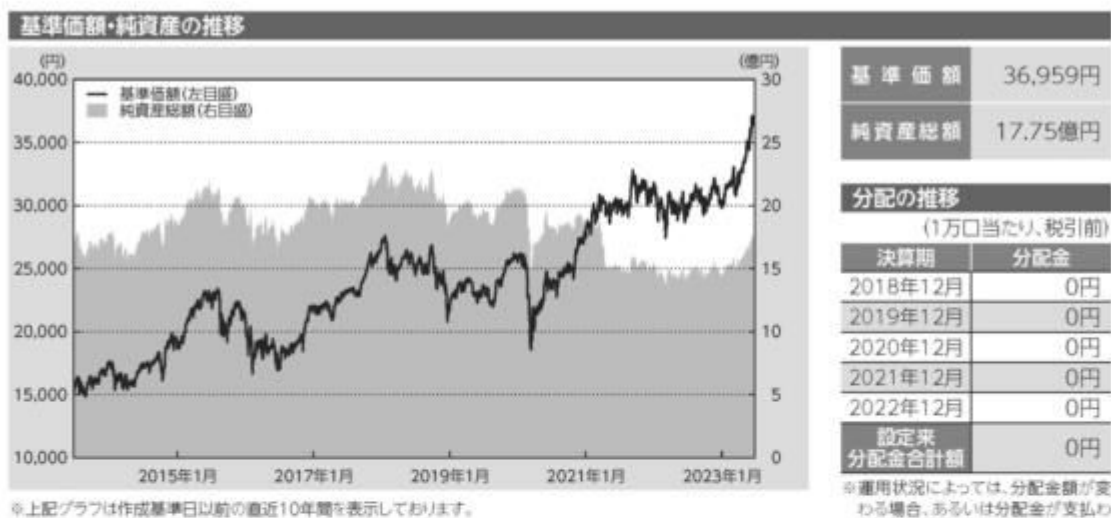
参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2002年12月11日

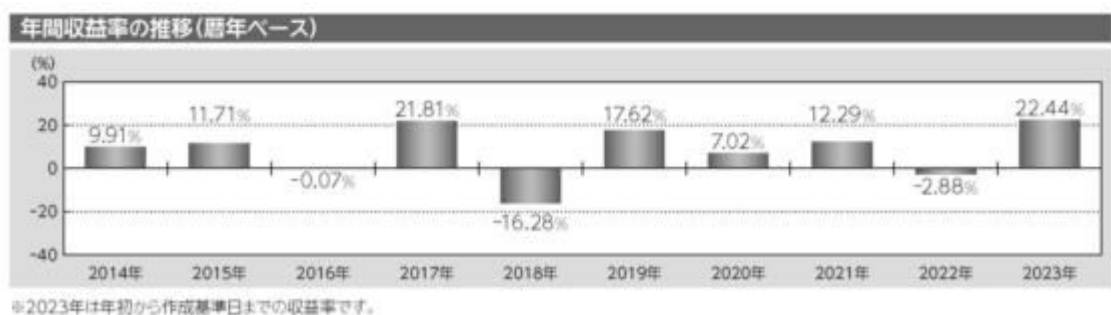
作成基準日：2023年6月30日



主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.8%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.8%
キーエンス	日本	株式	電気機器	2.0%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	2.0%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.6%
三菱商事	日本	株式	卸売業	1.3%
三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.3%
日立製作所	日本	株式	電気機器	1.3%
東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	1.3%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.2%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。



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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に

規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

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

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

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

約の実行の請求の受付を中止することができます。

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2002年12月11日設定）

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

（4）【計算期間】

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

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

（5）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

（1）投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

（2）投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

す。

委託会社は、ファンドの繰上償還について、あらかじめ、ファンドを繰上償還しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1) 投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社

の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き＞に従い、新受託会社を選任します。

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4 【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第20期計算期間(2021年12月11日から2022年12月12日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DC日本株式インデックスファンドA】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第19期 (2021年12月10日現在)	第20期 (2022年12月12日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,246,760	4,056,812
親投資信託受益証券	1,497,281,946	1,490,197,194
未収入金	226,753	1,445,542
流動資産合計	1,501,755,459	1,495,699,548
資産合計	1,501,755,459	1,495,699,548
負債の部		
流動負債		
未払解約金	465,468	1,562,817
未払受託者報酬	417,089	409,293
未払委託者報酬	2,836,134	2,783,169
未払利息	2	11
流動負債合計	3,718,693	4,755,290
負債合計	3,718,693	4,755,290
純資産の部		
元本等		
元本	486,628,278	478,081,365
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,011,408,488	1,012,862,893
(分配準備積立金)	415,176,139	381,959,629
元本等合計	1,498,036,766	1,490,944,258
純資産合計	1,498,036,766	1,490,944,258
負債純資産合計	1,501,755,459	1,495,699,548

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第19期		第20期	
	自	2020年12月11日 至 2021年12月10日	自	2021年12月11日 至 2022年12月12日
営業収益				
受取利息		10		5
有価証券売買等損益		228,740,422		26,514,358
営業収益合計		228,740,432		26,514,363
営業費用				
支払利息		1,430		1,117
受託者報酬		891,853		807,931
委託者報酬		6,064,479		5,493,852
営業費用合計		6,957,762		6,302,900
営業利益又は営業損失（ ）		221,782,670		20,211,463
経常利益又は経常損失（ ）		221,782,670		20,211,463
当期純利益又は当期純損失（ ）		221,782,670		20,211,463
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（ ）		70,907,824		3,398,385
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,205,057,926		1,011,408,488
剰余金増加額又は欠損金減少額		192,266,876		147,817,090
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		192,266,876		147,817,090
剰余金減少額又は欠損金増加額		536,791,160		169,972,533
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		536,791,160		169,972,533
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,011,408,488		1,012,862,893

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第20期計算期間は2021年12月11日から2022年12月12日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第19期 (2021年12月10日現在)	第20期 (2022年12月12日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	486,628,278口	478,081,365口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.0784円 (30,784円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.1186円 (31,186円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第19期 自 2020年12月11日 至 2021年12月10日			第20期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	29,354,805円	費用控除後の配当等収益額	A	31,473,498円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	121,520,041円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	833,893,910円	収益調整金額	C	877,660,136円
分配準備積立金額	D	264,301,293円	分配準備積立金額	D	350,486,131円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,249,070,049円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,259,619,765円
当ファンドの期末残存口数	F	486,628,278口	当ファンドの期末残存口数	F	478,081,365口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	25,667円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	26,347円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	第20期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第20期 (2022年12月12日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第19期	第20期
	自 2020年12月11日 至 2021年12月10日	自 2021年12月11日 至 2022年12月12日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	700,126,288円	486,628,278円
期中追加設定元本額	96,749,997円	73,704,889円
期中一部解約元本額	310,248,007円	82,251,802円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第19期 (2021年12月10日現在)	第20期 (2022年12月12日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	167,535,087	30,980,138
合計	167,535,087	30,980,138

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	656,358,877	1,490,197,194	
合計		656,358,877	1,490,197,194	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2022年12月12日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,106,157,301
株式	303,094,875,790
派生商品評価勘定	4,442,050
未収入金	96,300
未収配当金	211,751,670
差入委託証拠金	76,672,600
流動資産合計	305,493,995,711
資産合計	305,493,995,711
負債の部	
流動負債	
前受金	4,442,600
未払解約金	46,868,697
未払利息	5,838
流動負債合計	51,317,135
負債合計	51,317,135
純資産の部	
元本等	
元本	134,534,227,972
剰余金	
剰余金又は欠損金()	170,908,450,604
元本等合計	305,442,678,576
純資産合計	305,442,678,576
負債純資産合計	305,493,995,711

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年12月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2022年12月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	134,534,227,972口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産額	1口当たり純資産額 2.2704円 (1万口当たり純資産額) (22,704円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2022年12月12日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2022年12月12日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年12月12日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年12月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年12月11日
期首元本額	133,943,427,216円
期中追加設定元本額	9,526,954,019円
期中一部解約元本額	8,936,153,263円
期末元本額	134,534,227,972円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	610,621,201円
D C日本株式インデックスファンド	283,631,392円
D C日本株式インデックスファンドL	53,754,754,375円
D C日本株式インデックスファンドA	656,358,877円
D Cバランスファンド30	2,420,068,558円
D Cバランスファンド50	3,819,181,075円
D Cバランスファンド70	2,342,318,550円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	575,264,424円
日本株式インデックスe	1,438,801,495円
インデックスコレクション（国内株式）	21,775,351,800円
インデックスコレクション（バランス株式30）	12,330,510,861円
インデックスコレクション（バランス株式50）	3,049,104,879円
インデックスコレクション（バランス株式70）	2,816,993,928円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,673,559,908円
日本株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	2,745,102,289円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	796,306,354円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	42,636,677円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	469,318,827円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	57,609,189円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	123,161,710円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	51,683,614円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	616,733,753円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	394,618,432円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	6,854,032,888円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	668,371,906円

区分	2022年12月12日現在
V Aバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	60,256,872円
V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,087,328,817円
V Aポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	21,885,009円
バランスV A 40（適格機関投資家専用）	139,635,786円
バランスファンドV A（適格機関投資家専用）	1,794,917,538円
V Aバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	47,305,628円
V Aバランス50-50（適格機関投資家専用）	50,487,054円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	15,447,852円
バランスファンドV A 2（適格機関投資家専用）	513,876,652円
バランスV A 25L（適格機関投資家専用）	239,335,979円
バランスファンドV A 3（適格機関投資家専用）	3,970,578,033円
世界バランスV A 25（適格機関投資家専用）	79,256,864円
国内バランスV A 30（適格機関投資家専用）	32,561,154円
国内バランスV A 25（適格機関投資家専用）	7,695,706円
V Aバランス20-80（適格機関投資家専用）	105,389,126円
私募日本株式インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	2,172,940円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年12月12日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	4,652,533,737
合計	4,652,533,737

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本株式マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年12月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超	
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,927,542,400	-	4,442,600
	合計	1,927,542,400	-	4,442,600

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,700	3,625.00	20,662,500	
ニッスイ	150,400	523.00	78,659,200	
マルハニチロ	23,200	2,381.00	55,239,200	
雪国まいたけ	12,800	995.00	12,736,000	
カネコ種苗	5,000	1,415.00	7,075,000	
サカタのタネ	19,000	4,470.00	84,930,000	
ホクト	13,400	1,875.00	25,125,000	
ホクリヨウ	2,100	678.00	1,423,800	
住石ホールディングス	23,400	410.00	9,594,000	
日鉄鉱業	6,000	3,050.00	18,300,000	
三井松島ホールディングス	6,800	3,245.00	22,066,000	
I N P E X	556,400	1,429.00	795,095,600	
石油資源開発	17,400	3,905.00	67,947,000	
K & O エナジーグループ	6,800	2,273.00	15,456,400	
ショーボンドホールディングス	20,500	5,770.00	118,285,000	
ミライト・ワン	52,200	1,532.00	79,970,400	
タマホーム	10,600	2,573.00	27,273,800	
サンヨーホームズ	1,800	710.00	1,278,000	
日本アクア	6,300	868.00	5,468,400	
ファーストコーポレーション	3,900	713.00	2,780,700	
ベステラ	3,200	925.00	2,960,000	
R o b o t H o m e	25,600	176.00	4,505,600	
キャンディル	2,300	499.00	1,147,700	
ダイセキ環境ソリューション	3,000	826.00	2,478,000	
第一カッター興業	3,900	1,084.00	4,227,600	
安藤・間	87,200	839.00	73,160,800	
東急建設	42,800	631.00	27,006,800	
コムシスホールディングス	50,900	2,428.00	123,585,200	
ピーアールホールディングス	23,900	333.00	7,958,700	
高松コンストラクショングループ	9,800	1,904.00	18,659,200	
東建コーポレーション	4,900	7,400.00	36,260,000	
ソネック	1,600	960.00	1,536,000	
ヤマウラ	7,600	992.00	7,539,200	
オリエンタル白石	54,100	275.00	14,877,500	

大成建設	104,700	4,160.00	435,552,000
大林組	376,400	1,005.00	378,282,000
清水建設	316,400	715.00	226,226,000
飛鳥建設	11,600	997.00	11,565,200
長谷工コーポレーション	108,600	1,494.00	162,248,400
松井建設	9,800	556.00	5,448,800
銭高組	1,300	2,631.00	3,420,300
鹿島建設	233,300	1,532.00	357,415,600
不動テトラ	7,300	1,468.00	10,716,400
大末建設	3,800	1,174.00	4,461,200
鉄建建設	7,500	1,755.00	13,162,500
西松建設	17,800	3,940.00	70,132,000
三井住友建設	84,900	415.00	35,233,500
大豊建設	4,400	4,095.00	18,018,000
佐田建設	6,700	459.00	3,075,300
ナカノフドー建設	7,500	319.00	2,392,500
奥村組	17,100	2,935.00	50,188,500
東鉄工業	14,500	2,525.00	36,612,500
イチケン	2,400	1,762.00	4,228,800
富士ピー・エス	4,700	442.00	2,077,400
浅沼組	8,400	2,937.00	24,670,800
戸田建設	129,500	722.00	93,499,000
熊谷組	18,200	2,566.00	46,701,200
北野建設	2,000	2,449.00	4,898,000
植木組	3,000	1,297.00	3,891,000
矢作建設工業	14,300	753.00	10,767,900
ピーエス三菱	13,300	610.00	8,113,000
日本ハウスホールディングス	20,900	399.00	8,339,100
新日本建設	14,800	731.00	10,818,800
東亜道路工業	2,100	5,800.00	12,180,000
日本道路	2,100	5,910.00	12,411,000
東亜建設工業	9,000	2,259.00	20,331,000
日本国土開発	31,500	563.00	17,734,500
若築建設	4,700	2,755.00	12,948,500
東洋建設	34,100	832.00	28,371,200
五洋建設	149,200	634.00	94,592,800
世紀東急工業	13,900	768.00	10,675,200
福田組	4,000	4,655.00	18,620,000
住友林業	80,700	2,407.00	194,244,900
日本基礎技術	6,700	506.00	3,390,200
巴コーポレーション	11,800	395.00	4,661,000
大和ハウス工業	294,100	3,104.00	912,886,400

ライト工業	20,000	1,931.00	38,620,000
積水ハウス	329,700	2,395.00	789,631,500
日特建設	10,000	904.00	9,040,000
北陸電気工事	7,200	666.00	4,795,200
ユアテック	23,200	720.00	16,704,000
日本リーテック	6,900	770.00	5,313,000
四電工	4,400	1,707.00	7,510,800
中電工	16,300	2,058.00	33,545,400
関電工	57,700	856.00	49,391,200
きんでん	74,100	1,445.00	107,074,500
東京エネシス	10,500	911.00	9,565,500
トーエネック	3,500	3,430.00	12,005,000
住友電設	10,000	2,410.00	24,100,000
日本電設工業	17,300	1,629.00	28,181,700
エクシオグループ	51,600	2,150.00	110,940,000
新日本空調	5,800	1,869.00	10,840,200
九電工	25,600	3,235.00	82,816,000
三機工業	23,300	1,546.00	36,021,800
日揮ホールディングス	104,100	1,730.00	180,093,000
中外炉工業	3,400	1,604.00	5,453,600
ヤマト	8,800	711.00	6,256,800
太平電業	6,500	3,045.00	19,792,500
高砂熱学工業	25,400	1,748.00	44,399,200
三晃金属工業	1,300	2,985.00	3,880,500
朝日工業社	4,400	2,075.00	9,130,000
明星工業	18,100	738.00	13,357,800
大気社	12,700	3,460.00	43,942,000
ダイダン	6,900	2,152.00	14,848,800
日比谷総合設備	9,000	1,901.00	17,109,000
フィル・カンパニー	1,900	1,020.00	1,938,000
テスホールディングス	11,300	1,085.00	12,260,500
インフロニア・ホールディングス	110,300	1,026.00	113,167,800
東洋エンジニアリング	13,900	559.00	7,770,100
レイズネクスト	15,200	1,232.00	18,726,400
ニッポン	28,500	1,594.00	45,429,000
日清製粉グループ本社	97,700	1,562.00	152,607,400
日東富士製粉	1,900	4,365.00	8,293,500
昭和産業	9,200	2,412.00	22,190,400
鳥越製粉	8,500	622.00	5,287,000
中部飼料	14,600	1,027.00	14,994,200
フィード・ワン	15,400	668.00	10,287,200
東洋精糖	2,000	856.00	1,712,000

日本甜菜製糖	6,100	1,619.00	9,875,900
D M三井製糖ホールディングス	10,500	1,967.00	20,653,500
塩水港精糖	12,600	196.00	2,469,600
日新製糖	5,500	1,734.00	9,537,000
森永製菓	21,700	3,820.00	82,894,000
中村屋	2,600	3,090.00	8,034,000
江崎グリコ	30,200	3,625.00	109,475,000
名糖産業	4,200	1,633.00	6,858,600
井村屋グループ	5,800	2,204.00	12,783,200
不二家	7,200	2,580.00	18,576,000
山崎製パン	70,700	1,596.00	112,837,200
第一屋製パン	2,000	399.00	798,000
モロゾフ	3,400	3,530.00	12,002,000
亀田製菓	6,700	4,330.00	29,011,000
寿スピリッツ	11,200	7,540.00	84,448,000
カルビー	48,400	3,020.00	146,168,000
森永乳業	19,200	4,485.00	86,112,000
六甲バター	7,700	1,373.00	10,572,100
ヤクルト本社	75,500	8,760.00	661,380,000
明治ホールディングス	65,500	6,730.00	440,815,000
雪印メグミルク	25,600	1,741.00	44,569,600
プリマハム	14,200	2,080.00	29,536,000
日本ハム	41,300	3,630.00	149,919,000
林兼産業	3,200	464.00	1,484,800
丸大食品	10,600	1,397.00	14,808,200
S Foods	11,700	2,891.00	33,824,700
柿安本店	4,100	2,155.00	8,835,500
伊藤ハム米久ホールディングス	82,100	677.00	55,581,700
サッポロホールディングス	34,800	3,590.00	124,932,000
アサヒグループホールディングス	244,100	4,273.00	1,043,039,300
キリンホールディングス	476,800	2,110.50	1,006,286,400
宝ホールディングス	72,100	1,050.00	75,705,000
オエノンホールディングス	31,600	279.00	8,816,400
養命酒製造	3,500	1,796.00	6,286,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	82,800	1,460.00	120,888,000
サントリー食品インターナショナル	74,400	4,570.00	340,008,000
ダイドーグループホールディングス	6,000	4,855.00	29,130,000
伊藤園	39,400	5,110.00	201,334,000
キーコーヒー	11,800	2,058.00	24,284,400
ユニカフェ	3,500	980.00	3,430,000
ジャパンフーズ	1,700	1,062.00	1,805,400
日清オイリオグループ	14,900	3,200.00	47,680,000

不二製油グループ本社	24,600	2,052.00	50,479,200
かどや製油	1,300	3,520.00	4,576,000
J・オイルミルズ	10,800	1,511.00	16,318,800
キッコーマン	70,000	7,530.00	527,100,000
味の素	258,600	4,486.00	1,160,079,600
ブルドックソース	4,200	1,707.00	7,169,400
キューピー	56,800	2,439.00	138,535,200
ハウス食品グループ本社	32,300	2,757.00	89,051,100
カゴメ	49,200	3,045.00	149,814,000
焼津水産化学工業	4,700	809.00	3,802,300
アリアケジャパン	9,200	4,635.00	42,642,000
ピエトロ	1,500	1,803.00	2,704,500
エバラ食品工業	2,800	3,090.00	8,652,000
やまみ	1,000	1,310.00	1,310,000
ニチレイ	48,400	2,800.00	135,520,000
東洋水産	53,400	5,440.00	290,496,000
イトアンドホールディングス	4,500	2,264.00	10,188,000
大冷	1,300	1,884.00	2,449,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,700	576.00	3,859,200
日清食品ホールディングス	37,600	10,580.00	397,808,000
永谷園ホールディングス	5,200	1,983.00	10,311,600
一正蒲鉾	4,500	721.00	3,244,500
フジッコ	10,900	1,869.00	20,372,100
ロック・フィールド	12,900	1,476.00	19,040,400
日本たばこ産業	695,500	2,824.00	1,964,092,000
ケンコーマヨネーズ	7,300	1,561.00	11,395,300
わらべや日洋ホールディングス	7,800	1,926.00	15,022,800
なとり	6,600	2,038.00	13,450,800
イフジ産業	1,800	912.00	1,641,600
ファーマフーズ	16,300	1,492.00	24,319,600
ユーグレナ	68,000	931.00	63,308,000
紀文食品	8,200	947.00	7,765,400
ピクルスホールディングス	6,200	1,069.00	6,627,800
ミヨシ油脂	3,700	995.00	3,681,500
理研ビタミン	9,100	1,752.00	15,943,200
片倉工業	10,100	1,805.00	18,230,500
ゲンゼ	8,200	4,005.00	32,841,000
東洋紡	46,900	1,017.00	47,697,300
ユニチカ	34,100	253.00	8,627,300
富士紡ホールディングス	4,400	3,375.00	14,850,000
倉敷紡績	8,200	2,204.00	18,072,800
シキボウ	6,000	950.00	5,700,000

日本毛織	31,000	986.00	30,566,000
トーア紡コーポレーション	4,200	358.00	1,503,600
帝国繊維	12,400	1,639.00	20,323,600
帝人	103,600	1,300.00	134,680,000
東レ	720,700	723.40	521,354,380
住江織物	1,900	1,790.00	3,401,000
日本フェルト	6,900	406.00	2,801,400
イチカワ	1,700	1,295.00	2,201,500
日東製網	1,200	1,360.00	1,632,000
アツギ	6,600	387.00	2,554,200
ダイニック	2,800	607.00	1,699,600
セーレン	20,900	2,538.00	53,044,200
ソトー	3,500	835.00	2,922,500
東海染工	1,200	1,120.00	1,344,000
小松マテーレ	15,700	785.00	12,324,500
ワコールホールディングス	20,800	2,282.00	47,465,600
ホギメディカル	14,500	3,485.00	50,532,500
T S Iホールディングス	38,700	456.00	17,647,200
マツオカコーポレーション	3,000	1,059.00	3,177,000
ワールド	13,900	1,271.00	17,666,900
三陽商会	4,100	1,245.00	5,104,500
ナイガイ	4,000	262.00	1,048,000
オンワードホールディングス	70,100	321.00	22,502,100
ルックホールディングス	3,100	2,547.00	7,895,700
ゴールドウイン	19,100	9,530.00	182,023,000
デサント	18,600	3,255.00	60,543,000
キング	5,000	483.00	2,415,000
ヤマトインターナショナル	9,000	249.00	2,241,000
特種東海製紙	5,300	2,794.00	14,808,200
王子ホールディングス	447,700	536.00	239,967,200
日本製紙	56,000	970.00	54,320,000
三菱製紙	12,900	278.00	3,586,200
北越コーポレーション	67,900	788.00	53,505,200
中越パルプ工業	4,300	955.00	4,106,500
巴川製紙所	3,400	750.00	2,550,000
大王製紙	47,500	1,032.00	49,020,000
阿波製紙	2,600	300.00	780,000
レンゴー	97,900	868.00	84,977,200
トーモク	6,200	1,576.00	9,771,200
ザ・パック	8,000	2,429.00	19,432,000
北の達人コーポレーション	45,300	295.00	13,363,500
クラレ	170,900	1,105.00	188,844,500

旭化成	671,200	999.00	670,528,800
共和レザー	6,200	503.00	3,118,600
昭和電工	103,900	2,221.00	230,761,900
住友化学	797,300	483.00	385,095,900
住友精化	4,500	4,180.00	18,810,000
日産化学	51,000	6,610.00	337,110,000
ラサ工業	4,100	1,976.00	8,101,600
クレハ	9,200	8,770.00	80,684,000
多木化学	4,200	4,880.00	20,496,000
テイカ	7,200	1,233.00	8,877,600
石原産業	19,400	1,122.00	21,766,800
片倉コープアグリ	2,200	1,601.00	3,522,200
日本曹達	11,500	4,115.00	47,322,500
東ソー	143,500	1,630.00	233,905,000
トクヤマ	34,700	1,860.00	64,542,000
セントラル硝子	17,200	3,250.00	55,900,000
東亜合成	55,300	1,130.00	62,489,000
大阪ソーダ	6,400	4,220.00	27,008,000
関東電化工業	20,800	985.00	20,488,000
デンカ	39,100	3,190.00	124,729,000
信越化学工業	183,900	17,100.00	3,144,690,000
日本カーバイド工業	4,100	1,262.00	5,174,200
堺化学工業	8,200	1,810.00	14,842,000
第一稀元素化学工業	9,800	1,132.00	11,093,600
エア・ウォーター	101,400	1,563.00	158,488,200
日本酸素ホールディングス	104,300	2,181.00	227,478,300
日本化学工業	3,600	1,790.00	6,444,000
東邦アセチレン	2,300	1,103.00	2,536,900
日本パーカライズン	53,200	949.00	50,486,800
高压ガス工業	15,600	671.00	10,467,600
チタン工業	1,300	1,544.00	2,007,200
四国化成工業	12,800	1,302.00	16,665,600
戸田工業	2,400	2,718.00	6,523,200
ステラ ケミファ	6,400	2,558.00	16,371,200
保土谷化学工業	3,000	3,010.00	9,030,000
日本触媒	16,400	5,360.00	87,904,000
大日精化工業	7,500	1,716.00	12,870,000
カネカ	24,600	3,365.00	82,779,000
三菱瓦斯化学	80,300	1,911.00	153,453,300
三井化学	90,400	3,090.00	279,336,000
J S R	100,300	2,884.00	289,265,200
東京応化工業	18,800	6,730.00	126,524,000

大阪有機化学工業	8,100	2,091.00	16,937,100
三菱ケミカルグループ	725,300	718.30	520,982,990
KHネオケム	17,900	2,800.00	50,120,000
ダイセル	158,000	1,008.00	159,264,000
住友ベークライト	15,900	4,240.00	67,416,000
積水化学工業	223,200	1,873.00	418,053,600
日本ゼオン	64,500	1,326.00	85,527,000
アイカ工業	27,100	3,250.00	88,075,000
UBE	55,400	1,950.00	108,030,000
積水樹脂	15,600	1,751.00	27,315,600
タキロンシーアイ	23,500	508.00	11,938,000
旭有機材	7,200	2,615.00	18,828,000
ニチバン	6,700	1,745.00	11,691,500
リケンテクノス	23,200	477.00	11,066,400
大倉工業	5,000	1,963.00	9,815,000
積水化成成品工業	15,100	391.00	5,904,100
群栄化学工業	2,500	2,385.00	5,962,500
タイガースポリマー	4,900	403.00	1,974,700
ミライアル	3,300	1,534.00	5,062,200
ダイキアクシス	4,000	722.00	2,888,000
ダイキョーニシカワ	23,700	559.00	13,248,300
竹本容器	3,600	750.00	2,700,000
森六ホールディングス	5,400	1,733.00	9,358,200
恵和	3,500	3,395.00	11,882,500
日本化薬	82,100	1,177.00	96,631,700
カーリットホールディングス	9,700	707.00	6,857,900
日本精化	6,100	2,343.00	14,292,300
扶桑化学工業	10,000	3,490.00	34,900,000
トリケミカル研究所	14,300	2,299.00	32,875,700
ADEKA	37,500	2,203.00	82,612,500
日油	33,200	5,610.00	186,252,000
新日本理化	14,800	238.00	3,522,400
ハリマ化成グループ	7,500	832.00	6,240,000
花王	261,700	5,471.00	1,431,760,700
第一工業製薬	3,900	1,930.00	7,527,000
石原ケミカル	4,900	1,245.00	6,100,500
日華化学	4,300	868.00	3,732,400
ニイタカ	2,100	2,090.00	4,389,000
三洋化成工業	6,600	4,125.00	27,225,000
有機合成薬品工業	7,900	298.00	2,354,200
大日本塗料	13,100	754.00	9,877,400
日本ペイントホールディングス	475,600	1,189.00	565,488,400

関西ペイント	98,500	1,764.00	173,754,000
神東塗料	9,000	129.00	1,161,000
中国塗料	19,900	980.00	19,502,000
日本特殊塗料	6,800	851.00	5,786,800
藤倉化成	14,400	410.00	5,904,000
太陽ホールディングス	16,300	2,445.00	39,853,500
D I C	42,000	2,438.00	102,396,000
サカタインクス	23,900	1,085.00	25,931,500
東洋インキＳＣホールディングス	21,000	1,843.00	38,703,000
T & K T O K A	9,500	1,124.00	10,678,000
富士フイルムホールディングス	206,500	7,018.00	1,449,217,000
資生堂	224,700	6,562.00	1,474,481,400
ライオン	129,100	1,466.00	189,260,600
高砂香料工業	7,300	2,703.00	19,731,900
マンダム	23,200	1,436.00	33,315,200
ミルボン	15,900	5,570.00	88,563,000
ファンケル	47,100	2,579.00	121,470,900
コーセー	21,900	15,250.00	333,975,000
コタ	9,000	1,700.00	15,300,000
シーボン	1,400	1,591.00	2,227,400
ポーラ・オルビスホールディングス	55,200	1,881.00	103,831,200
ノエビアホールディングス	9,600	5,790.00	55,584,000
アジュバンホールディングス	2,600	948.00	2,464,800
新日本製薬	6,100	1,390.00	8,479,000
エステー	8,300	1,506.00	12,499,800
アグロ カネショウ	4,300	1,740.00	7,482,000
コニシ	18,000	1,694.00	30,492,000
長谷川香料	22,300	3,115.00	69,464,500
星光P M C	5,500	533.00	2,931,500
小林製薬	32,900	8,240.00	271,096,000
荒川化学工業	9,100	999.00	9,090,900
メック	8,900	2,411.00	21,457,900
日本高純度化学	2,800	2,584.00	7,235,200
タカラバイオ	29,000	1,805.00	52,345,000
J C U	12,200	3,295.00	40,199,000
新田ゼラチン	6,600	975.00	6,435,000
O A T アグリオ	4,400	1,626.00	7,154,400
デクセリアルズ	31,100	3,065.00	95,321,500
アース製薬	9,700	5,250.00	50,925,000
北興化学工業	10,800	860.00	9,288,000
大成ラミック	3,400	3,130.00	10,642,000
クミアイ化学工業	42,800	887.00	37,963,600

日本農薬	19,700	715.00	14,085,500
アキレス	7,000	1,280.00	8,960,000
有沢製作所	17,600	1,317.00	23,179,200
日東電工	78,100	8,430.00	658,383,000
レック	15,300	800.00	12,240,000
三光合成	14,800	449.00	6,645,200
きもと	15,800	232.00	3,665,600
藤森工業	8,500	3,165.00	26,902,500
前澤化成工業	6,900	1,372.00	9,466,800
未来工業	3,900	1,456.00	5,678,400
ウェーブロックホールディングス	3,200	635.00	2,032,000
J S P	7,600	1,484.00	11,278,400
エフピコ	20,400	3,675.00	74,970,000
天馬	9,100	2,032.00	18,491,200
信越ポリマー	19,900	1,213.00	24,138,700
東リ	24,100	223.00	5,374,300
ニフコ	38,800	3,435.00	133,278,000
バルカー	9,000	2,650.00	23,850,000
ユニ・チャーム	224,200	5,194.00	1,164,494,800
ショーエイコーポレーション	3,100	555.00	1,720,500
協和キリン	130,100	3,080.00	400,708,000
武田薬品工業	952,400	4,051.00	3,858,172,400
アステラス製薬	1,031,400	2,129.00	2,195,850,600
住友ファーマ	79,900	1,049.00	83,815,100
塩野義製薬	137,600	6,863.00	944,348,800
わかもと製薬	10,700	235.00	2,514,500
日本新薬	25,400	7,870.00	199,898,000
中外製薬	336,900	3,614.00	1,217,556,600
科研製薬	18,500	3,855.00	71,317,500
エーザイ	130,900	9,580.00	1,254,022,000
ロート製薬	52,200	4,465.00	233,073,000
小野薬品工業	207,700	3,423.00	710,957,100
久光製薬	24,000	3,860.00	92,640,000
持田製薬	12,900	3,360.00	43,344,000
参天製薬	202,600	1,135.00	229,951,000
扶桑薬品工業	3,500	1,993.00	6,975,500
日本ケミファ	1,200	1,670.00	2,004,000
ツムラ	33,900	2,964.00	100,479,600
キッセイ薬品工業	16,700	2,502.00	41,783,400
生化学工業	20,600	949.00	19,549,400
栄研化学	17,500	1,854.00	32,445,000
鳥居薬品	5,800	2,850.00	16,530,000

JCRファーマ	36,500	1,885.00	68,802,500
東和薬品	16,600	2,119.00	35,175,400
富士製薬工業	7,100	997.00	7,078,700
ゼリア新薬工業	15,000	2,246.00	33,690,000
第一三共	937,600	4,373.00	4,100,124,800
キョーリン製薬ホールディングス	23,400	1,729.00	40,458,600
大幸薬品	19,700	465.00	9,160,500
ダイト	8,100	2,474.00	20,039,400
大塚ホールディングス	246,300	4,561.00	1,123,374,300
大正製薬ホールディングス	23,900	5,410.00	129,299,000
ペプチドリーム	52,200	1,692.00	88,322,400
あすか製薬ホールディングス	11,100	1,225.00	13,597,500
サワイグループホールディングス	24,600	4,090.00	100,614,000
日本コークス工業	97,100	90.00	8,739,000
ニチレキ	12,700	1,251.00	15,887,700
ユシロ化学工業	5,600	814.00	4,558,400
ビーピー・カストロール	4,100	933.00	3,825,300
富士石油	22,000	252.00	5,544,000
MORESCO	3,500	1,137.00	3,979,500
出光興産	119,500	3,075.00	367,462,500
ENEOSホールディングス	1,944,300	446.10	867,352,230
コスモエネルギーホールディングス	40,800	3,855.00	157,284,000
横浜ゴム	61,200	2,220.00	135,864,000
TOYO TIRE	61,800	1,556.00	96,160,800
ブリヂストン	343,700	5,061.00	1,739,465,700
住友ゴム工業	105,600	1,174.00	123,974,400
藤倉コンポジット	7,600	823.00	6,254,800
オカモト	6,000	3,730.00	22,380,000
フコク	5,700	1,068.00	6,087,600
ニッタ	10,900	2,910.00	31,719,000
住友理工	20,900	588.00	12,289,200
三ツ星ベルト	15,700	3,395.00	53,301,500
バンドー化学	17,100	991.00	16,946,100
日東紡績	12,900	2,036.00	26,264,400
AGC	109,500	4,575.00	500,962,500
日本板硝子	54,900	612.00	33,598,800
石塚硝子	1,700	1,443.00	2,453,100
日本山村硝子	4,100	574.00	2,353,400
日本電気硝子	44,000	2,504.00	110,176,000
オハラ	5,200	1,207.00	6,276,400
住友大阪セメント	15,200	3,150.00	47,880,000
太平洋セメント	68,600	2,082.00	142,825,200

日本ヒューム	9,500	643.00	6,108,500
日本コンクリート工業	21,100	226.00	4,768,600
三谷セキサン	4,500	3,975.00	17,887,500
アジアパイルホールディングス	16,900	523.00	8,838,700
東海カーボン	90,300	1,135.00	102,490,500
日本カーボン	6,200	4,360.00	27,032,000
東洋炭素	6,800	3,945.00	26,826,000
ノリタケカンパニーリミテド	5,400	4,005.00	21,627,000
TOTO	71,000	4,830.00	342,930,000
日本碍子	127,400	1,794.00	228,555,600
日本特殊陶業	82,000	2,561.00	210,002,000
MARUWA	4,000	17,520.00	70,080,000
品川リフラクトリーズ	3,000	3,885.00	11,655,000
黒崎播磨	2,200	4,870.00	10,714,000
ヨータイ	7,200	1,398.00	10,065,600
東京窯業	10,100	265.00	2,676,500
ニッカトー	4,900	482.00	2,361,800
フジインコーポレーテッド	8,600	7,330.00	63,038,000
クニミネ工業	3,200	862.00	2,758,400
エーアンドエーマテリアル	2,000	869.00	1,738,000
ニチアス	27,200	2,431.00	66,123,200
ニチハ	13,500	2,719.00	36,706,500
日本製鉄	495,800	2,241.00	1,111,087,800
神戸製鋼所	222,700	616.00	137,183,200
中山製鋼所	22,800	736.00	16,780,800
合同製鐵	5,500	1,950.00	10,725,000
JFEホールディングス	295,900	1,551.00	458,940,900
東京製鐵	31,100	1,273.00	39,590,300
共英製鋼	12,600	1,226.00	15,447,600
大和工業	18,300	4,570.00	83,631,000
東京鐵鋼	5,300	1,398.00	7,409,400
大阪製鐵	5,100	1,078.00	5,497,800
淀川製鋼所	12,600	2,497.00	31,462,200
丸一鋼管	33,700	2,777.00	93,584,900
モリ工業	2,500	2,764.00	6,910,000
大同特殊鋼	14,000	4,420.00	61,880,000
日本高周波鋼業	3,800	313.00	1,189,400
日本冶金工業	8,100	4,265.00	34,546,500
山陽特殊製鋼	11,000	2,150.00	23,650,000
愛知製鋼	6,400	2,208.00	14,131,200
日本金属	2,400	942.00	2,260,800
大平洋金属	7,900	2,041.00	16,123,900

新日本電工	70,800	385.00	27,258,000
栗本鐵工所	5,300	1,752.00	9,285,600
虹技	1,400	910.00	1,274,000
三菱製鋼	7,000	1,007.00	7,049,000
日亜鋼業	11,400	233.00	2,656,200
日本精線	1,500	4,250.00	6,375,000
エンビプロ・ホールディングス	7,700	714.00	5,497,800
シンニッタン	12,100	222.00	2,686,200
新家工業	2,400	2,172.00	5,212,800
大紀アルミニウム工業所	15,800	1,294.00	20,445,200
日本軽金属ホールディングス	29,900	1,543.00	46,135,700
三井金属鉱業	32,200	3,180.00	102,396,000
東邦亜鉛	6,600	2,192.00	14,467,200
三菱マテリアル	73,900	2,231.00	164,870,900
住友金属鉱山	128,400	4,799.00	616,191,600
D O W Aホールディングス	24,900	4,380.00	109,062,000
古河機械金属	16,300	1,287.00	20,978,100
大阪チタニウムテクノロジーズ	16,300	4,195.00	68,378,500
東邦チタニウム	20,000	2,814.00	56,280,000
U A C J	15,500	2,307.00	35,758,500
C Kサンエツ	2,700	4,075.00	11,002,500
古河電気工業	36,900	2,634.00	97,194,600
住友電気工業	382,300	1,580.00	604,034,000
フジクラ	118,800	1,122.00	133,293,600
昭和電線ホールディングス	12,400	1,775.00	22,010,000
東京特殊電線	1,500	5,650.00	8,475,000
タツタ電線	22,700	426.00	9,670,200
カナレ電気	1,800	1,490.00	2,682,000
平河ヒューテック	6,400	1,137.00	7,276,800
リョービ	11,900	1,204.00	14,327,600
アーレスティ	12,400	417.00	5,170,800
アサヒホールディングス	44,800	2,004.00	89,779,200
稲葉製作所	6,500	1,402.00	9,113,000
宮地エンジニアリンググループ	3,100	3,430.00	10,633,000
トーカロ	30,400	1,200.00	36,480,000
アルファC o	4,100	937.00	3,841,700
S U M C O	210,800	2,001.00	421,810,800
川田テクノロジーズ	2,600	3,370.00	8,762,000
R S T e c h n o l o g i e s	3,600	8,570.00	30,852,000
ジェイテックコーポレーション	1,500	2,350.00	3,525,000
信和	6,100	783.00	4,776,300
東洋製罐グループホールディングス	73,300	1,607.00	117,793,100

ホッカホールディングス	5,900	1,304.00	7,693,600	
コロナ	6,200	869.00	5,387,800	
横河ブリッジホールディングス	14,600	1,880.00	27,448,000	
駒井ハルテック	1,800	1,610.00	2,898,000	
高田機工	900	2,431.00	2,187,900	
三和ホールディングス	102,000	1,259.00	128,418,000	
文化シャッター	31,900	1,089.00	34,739,100	
三協立山	15,200	551.00	8,375,200	
アルインコ	8,400	1,010.00	8,484,000	
東洋シャッター	2,500	489.00	1,222,500	
L I X I L	161,300	2,065.00	333,084,500	
日本フィルコン	7,200	451.00	3,247,200	
ノーリツ	16,300	1,491.00	24,303,300	
長府製作所	11,200	1,956.00	21,907,200	
リンナイ	20,100	10,100.00	203,010,000	
ダイニチ工業	5,500	670.00	3,685,000	
日東精工	16,000	518.00	8,288,000	
三洋工業	1,300	1,732.00	2,251,600	
岡部	17,800	715.00	12,727,000	
ジーテクト	12,300	1,455.00	17,896,500	
東プレ	19,500	1,198.00	23,361,000	
高周波熱錬	18,100	678.00	12,271,800	
東京製網	6,500	846.00	5,499,000	
サンコール	9,800	629.00	6,164,200	
モリテック スチール	8,100	235.00	1,903,500	
パイオラックス	15,300	1,680.00	25,704,000	
エイチワン	11,400	622.00	7,090,800	
日本発條	97,900	892.00	87,326,800	
中央発條	6,100	720.00	4,392,000	
アドバネクス	1,300	1,126.00	1,463,800	
立川ブラインド工業	5,000	1,123.00	5,615,000	
三益半導体工業	10,000	2,564.00	25,640,000	
日本ドライケミカル	2,600	1,515.00	3,939,000	
日本製鋼所	29,900	2,850.00	85,215,000	
三浦工業	45,300	3,205.00	145,186,500	
タクマ	33,400	1,275.00	42,585,000	
ツガミ	24,200	1,255.00	30,371,000	
オークマ	10,900	5,040.00	54,936,000	
芝浦機械	12,100	2,608.00	31,556,800	
アマダ	173,000	1,073.00	185,629,000	
アイダエンジニアリング	22,400	804.00	18,009,600	
T A K I S A W A	2,900	1,080.00	3,132,000	

F U J I	47,100	2,088.00	98,344,800
牧野フライス製作所	12,000	4,505.00	54,060,000
オーエスジー	51,800	1,961.00	101,579,800
ダイジェット工業	1,200	820.00	984,000
旭ダイヤモンド工業	31,400	691.00	21,697,400
D M G 森精機	65,800	1,775.00	116,795,000
ソディック	30,000	749.00	22,470,000
ディスコ	17,400	40,650.00	707,310,000
日東工器	5,300	1,519.00	8,050,700
日進工具	9,100	1,085.00	9,873,500
パンチ工業	9,300	410.00	3,813,000
富士ダイス	5,200	596.00	3,099,200
豊和工業	6,000	918.00	5,508,000
ニデックオーケーケー	4,300	971.00	4,175,300
東洋機械金属	7,600	550.00	4,180,000
津田駒工業	2,000	593.00	1,186,000
エンシュウ	2,400	691.00	1,658,400
島精機製作所	17,300	1,987.00	34,375,100
オプトラン	16,000	2,461.00	39,376,000
N C ホールディングス	2,200	2,019.00	4,441,800
イワキポンプ	7,300	1,244.00	9,081,200
フリー	11,400	1,207.00	13,759,800
ヤマシンフィルタ	26,000	495.00	12,870,000
日阪製作所	10,600	816.00	8,649,600
やまびこ	17,800	1,132.00	20,149,600
野村マイクロ・サイエンス	3,700	4,625.00	17,112,500
平田機工	5,200	5,480.00	28,496,000
ペガサスミシン製造	12,000	892.00	10,704,000
マルマエ	5,300	1,798.00	9,529,400
タツモ	6,000	1,658.00	9,948,000
ナプテスコ	68,000	3,495.00	237,660,000
三井海洋開発	13,600	1,390.00	18,904,000
レオン自動機	11,400	1,115.00	12,711,000
S M C	35,100	62,610.00	2,197,611,000
ホソカワミクロン	8,300	2,836.00	23,538,800
ユニオンツール	4,800	3,575.00	17,160,000
オイレス工業	15,200	1,463.00	22,237,600
日精エー・エス・ビー機械	4,900	4,750.00	23,275,000
サトーホールディングス	15,400	1,876.00	28,890,400
技研製作所	11,300	3,145.00	35,538,500
日本エアテック	5,500	1,222.00	6,721,000
カワタ	3,200	838.00	2,681,600

日精樹脂工業	8,200	973.00	7,978,600
オカダアイヨン	3,400	1,522.00	5,174,800
ワイエイシイホールディングス	4,600	1,627.00	7,484,200
小松製作所	507,800	3,107.00	1,577,734,600
住友重機械工業	64,200	2,880.00	184,896,000
日立建機	43,200	3,120.00	134,784,000
日工	16,200	611.00	9,898,200
巴工業	4,700	2,385.00	11,209,500
井関農機	10,200	1,234.00	12,586,800
TOWA	11,100	1,945.00	21,589,500
丸山製作所	1,900	1,547.00	2,939,300
北川鉄工所	4,300	1,200.00	5,160,000
ローツェ	5,700	8,290.00	47,253,000
タカキタ	3,200	466.00	1,491,200
クボタ	573,600	2,004.00	1,149,494,400
荏原実業	5,400	2,313.00	12,490,200
三菱化工機	3,500	2,040.00	7,140,000
月島機械	14,800	958.00	14,178,400
帝国電機製作所	8,200	2,274.00	18,646,800
新東工業	22,100	654.00	14,453,400
澁谷工業	10,200	2,446.00	24,949,200
アイチ コーポレーション	15,500	773.00	11,981,500
小森コーポレーション	25,200	812.00	20,462,400
鶴見製作所	8,300	1,967.00	16,326,100
住友精密工業	1,600	3,645.00	5,832,000
日本ギア工業	3,800	320.00	1,216,000
酒井重工業	1,800	3,515.00	6,327,000
荏原製作所	44,400	5,120.00	227,328,000
石井鐵工所	1,300	2,460.00	3,198,000
西島製作所	9,400	1,548.00	14,551,200
北越工業	11,000	1,159.00	12,749,000
ダイキン工業	129,400	21,980.00	2,844,212,000
オルガノ	14,900	2,962.00	44,133,800
トーヨーカネツ	4,200	2,491.00	10,462,200
栗田工業	60,600	5,840.00	353,904,000
椿本チエイン	15,400	3,040.00	46,816,000
大同工業	4,500	738.00	3,321,000
木村化工機	8,400	724.00	6,081,600
アネスト岩田	18,500	900.00	16,650,000
ダイフク	55,900	6,860.00	383,474,000
サムコ	3,600	3,735.00	13,446,000
加藤製作所	5,200	752.00	3,910,400

油研工業	1,700	1,806.00	3,070,200
タダノ	57,300	967.00	55,409,100
フジテック	39,700	3,300.00	131,010,000
C K D	30,000	2,017.00	60,510,000
平和	36,100	2,427.00	87,614,700
理想科学工業	9,700	2,223.00	21,563,100
S A N K Y O	21,300	5,300.00	112,890,000
日本金銭機械	12,000	1,164.00	13,968,000
マースグループホールディングス	6,400	2,306.00	14,758,400
フクシマガリレイ	8,000	4,295.00	34,360,000
オーイズミ	4,200	417.00	1,751,400
ダイコク電機	6,000	1,795.00	10,770,000
竹内製作所	19,700	2,978.00	58,666,600
アマノ	30,800	2,407.00	74,135,600
J U K I	16,900	673.00	11,373,700
ジャノメ	11,100	602.00	6,682,200
マックス	13,400	1,992.00	26,692,800
グローリー	28,100	2,231.00	62,691,100
新晃工業	11,000	1,477.00	16,247,000
大和冷機工業	16,700	1,155.00	19,288,500
セガサミーホールディングス	87,200	1,831.00	159,663,200
日本ピストンリング	3,700	1,203.00	4,451,100
リケン	4,300	2,228.00	9,580,400
T P R	12,700	1,203.00	15,278,100
ツバキ・ナカシマ	26,800	1,013.00	27,148,400
ホシザキ	69,800	4,585.00	320,033,000
大豊工業	9,500	667.00	6,336,500
日本精工	199,200	728.00	145,017,600
N T N	213,700	283.00	60,477,100
ジェイテクト	96,500	953.00	91,964,500
不二越	8,000	3,795.00	30,360,000
日本トムソン	26,600	579.00	15,401,400
T H K	62,600	2,658.00	166,390,800
ユーシン精機	8,700	670.00	5,829,000
前澤給装工業	7,700	991.00	7,630,700
イーグル工業	12,000	1,048.00	12,576,000
前澤工業	7,100	601.00	4,267,100
日本ピラー工業	10,100	2,854.00	28,825,400
キッツ	40,000	819.00	32,760,000
マキタ	134,900	3,155.00	425,609,500
三井E & Sホールディングス	49,000	394.00	19,306,000
日立造船	88,900	828.00	73,609,200

三菱重工業	189,500	5,436.00	1,030,122,000
I H I	68,300	3,870.00	264,321,000
スター精密	20,500	1,726.00	35,383,000
日清紡ホールディングス	88,200	977.00	86,171,400
イビデン	62,200	5,530.00	343,966,000
コニカミノルタ	242,500	557.00	135,072,500
ブラザー工業	144,900	2,100.00	304,290,000
ミネベアミツミ	188,600	2,202.00	415,297,200
日立製作所	544,100	7,051.00	3,836,449,100
東芝	208,600	4,642.00	968,321,200
三菱電機	1,120,100	1,364.50	1,528,376,450
富士電機	65,900	5,580.00	367,722,000
東洋電機製造	3,900	863.00	3,365,700
安川電機	128,400	4,625.00	593,850,000
シンフォニアテクノロジー	12,000	1,470.00	17,640,000
明電舎	16,400	1,934.00	31,717,600
オリジン	2,400	1,245.00	2,988,000
山洋電気	4,700	6,040.00	28,388,000
デンヨー	8,300	1,544.00	12,815,200
P H C ホールディングス	15,200	1,580.00	24,016,000
ソシオネクスト	11,200	6,380.00	71,456,000
東芝テック	16,200	3,570.00	57,834,000
芝浦メカトロニクス	2,100	10,840.00	22,764,000
マブチモーター	27,000	3,885.00	104,895,000
日本電産	263,200	8,246.00	2,170,347,200
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	8,500	501.00	4,258,500
トレックス・セミコンダクター	5,200	2,860.00	14,872,000
東光高岳	6,700	1,789.00	11,986,300
ダブル・スコープ	35,400	1,635.00	57,879,000
ダイヘン	9,800	4,035.00	39,543,000
ヤーマン	21,300	1,347.00	28,691,100
J V C ケンウッド	99,400	417.00	41,449,800
ミマキエンジニアリング	10,700	641.00	6,858,700
I - P E X	6,200	1,288.00	7,985,600
日新電機	26,000	1,292.00	33,592,000
大崎電気工業	25,700	531.00	13,646,700
オムロン	99,300	6,988.00	693,908,400
日東工業	14,600	2,303.00	33,623,800
I D E C	16,000	3,145.00	50,320,000
正興電機製作所	4,400	1,003.00	4,413,200
不二電機工業	2,400	1,127.00	2,704,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	35,700	2,094.00	74,755,800

サクサホールディングス	2,300	1,271.00	2,923,300
メルコホールディングス	3,000	3,035.00	9,105,000
テクノメディカ	2,800	1,704.00	4,771,200
日本電気	153,300	4,660.00	714,378,000
富士通	108,000	18,495.00	1,997,460,000
沖電気工業	49,000	708.00	34,692,000
岩崎通信機	4,700	767.00	3,604,900
電気興業	5,100	2,053.00	10,470,300
サンケン電気	10,100	6,930.00	69,993,000
ナカヨ	1,700	1,073.00	1,824,100
アイホン	6,600	1,873.00	12,361,800
ルネサスエレクトロニクス	707,300	1,295.50	916,307,150
セイコーエプソン	144,300	2,091.00	301,731,300
ワコム	86,300	631.00	54,455,300
アルバック	25,700	6,090.00	156,513,000
アクセル	4,200	1,514.00	6,358,800
E I Z O	7,900	3,370.00	26,623,000
日本信号	24,700	1,022.00	25,243,400
京三製作所	22,700	416.00	9,443,200
能美防災	14,800	1,563.00	23,132,400
ホーチキ	8,300	1,416.00	11,752,800
星和電機	4,900	447.00	2,190,300
エレコム	26,100	1,424.00	37,166,400
パナソニック ホールディングス	1,280,200	1,222.00	1,564,404,400
シャープ	130,500	1,041.00	135,850,500
アンリツ	76,300	1,434.00	109,414,200
富士通ゼネラル	30,700	3,170.00	97,319,000
ソニーグループ	759,100	10,875.00	8,255,212,500
T D K	171,700	4,775.00	819,867,500
帝国通信工業	5,100	1,379.00	7,032,900
タムラ製作所	46,500	809.00	37,618,500
アルプスアルパイン	97,000	1,305.00	126,585,000
池上通信機	3,400	536.00	1,822,400
日本電波工業	13,200	1,818.00	23,997,600
鈴木	6,700	901.00	6,036,700
メイコー	11,900	2,938.00	34,962,200
日本トリム	2,500	2,470.00	6,175,000
ローランド ディー . ジー .	6,200	3,035.00	18,817,000
フォスター電機	10,000	910.00	9,100,000
S M K	2,600	2,360.00	6,136,000
ヨコオ	8,700	2,437.00	21,201,900
ホシデン	26,100	1,575.00	41,107,500

ヒロセ電機	17,900	17,770.00	318,083,000
日本航空電子工業	22,200	2,262.00	50,216,400
TOA	12,500	779.00	9,737,500
マクセル	23,700	1,415.00	33,535,500
古野電気	14,400	1,012.00	14,572,800
スミダコーポレーション	10,100	1,531.00	15,463,100
アイコム	4,200	2,800.00	11,760,000
リオン	4,600	1,925.00	8,855,000
横河電機	118,600	2,421.00	287,130,600
新電元工業	4,100	3,150.00	12,915,000
アズビル	75,000	3,840.00	288,000,000
東亜ディーケーケー	5,400	824.00	4,449,600
日本光電工業	49,700	3,160.00	157,052,000
チノー	4,500	1,798.00	8,091,000
共和電業	10,100	368.00	3,716,800
日本電子材料	7,100	1,497.00	10,628,700
堀場製作所	23,900	6,240.00	149,136,000
アドバンテスト	84,500	9,810.00	828,945,000
小野測器	4,700	399.00	1,875,300
エスベック	8,700	1,974.00	17,173,800
キーエンス	107,400	55,950.00	6,009,030,000
日置電機	5,700	6,640.00	37,848,000
シスメックス	92,600	8,879.00	822,195,400
日本マイクロニクス	17,900	1,426.00	25,525,400
メガチップス	8,900	2,580.00	22,962,000
OBARA GROUP	5,100	3,520.00	17,952,000
澤藤電機	1,500	1,141.00	1,711,500
原田工業	5,100	842.00	4,294,200
コーセル	14,700	900.00	13,230,000
イリソ電子工業	9,900	4,485.00	44,401,500
オブテックスグループ	19,800	2,032.00	40,233,600
千代田インテグレ	4,500	2,379.00	10,705,500
レーザーテック	53,000	25,910.00	1,373,230,000
スタンレー電気	76,500	2,759.00	211,063,500
岩崎電気	3,600	2,420.00	8,712,000
ウシオ電機	56,200	1,791.00	100,654,200
岡谷電機産業	9,300	270.00	2,511,000
ヘリオス テクノ ホールディング	10,600	417.00	4,420,200
エノモト	2,900	1,879.00	5,449,100
日本セラミック	11,000	2,596.00	28,556,000
遠藤照明	5,200	724.00	3,764,800
古河電池	8,100	1,108.00	8,974,800

双信電機	5,000	401.00	2,005,000
山一電機	9,500	1,751.00	16,634,500
図研	9,400	3,210.00	30,174,000
日本電子	26,900	4,265.00	114,728,500
カシオ計算機	79,900	1,348.00	107,705,200
ファナック	105,300	21,080.00	2,219,724,000
日本シイエムケイ	23,300	526.00	12,255,800
エンプラス	3,200	4,405.00	14,096,000
大真空	13,400	791.00	10,599,400
ローム	49,600	10,640.00	527,744,000
浜松ホトニクス	86,100	7,070.00	608,727,000
三井ハイテック	11,100	7,220.00	80,142,000
新光電気工業	38,000	3,770.00	143,260,000
京セラ	166,700	6,892.00	1,148,896,400
太陽誘電	52,300	4,355.00	227,766,500
村田製作所	325,500	7,354.00	2,393,727,000
双葉電子工業	20,900	567.00	11,850,300
北陸電気工業	4,200	1,259.00	5,287,800
ニチコン	22,100	1,331.00	29,415,100
日本ケミコン	10,800	1,730.00	18,684,000
K O A	16,400	2,046.00	33,554,400
市光工業	16,200	391.00	6,334,200
小糸製作所	129,200	2,073.00	267,831,600
ミツバ	20,100	474.00	9,527,400
S C R E E Nホールディングス	18,300	9,230.00	168,909,000
キャノン電子	12,000	1,566.00	18,792,000
キャノン	588,700	3,105.00	1,827,913,500
リコー	269,000	1,050.00	282,450,000
象印マホービン	32,200	1,671.00	53,806,200
M U T O Hホールディングス	1,600	1,697.00	2,715,200
東京エレクトロン	75,700	45,250.00	3,425,425,000
イノテック	7,400	1,270.00	9,398,000
トヨタ紡織	45,200	1,823.00	82,399,600
芦森工業	2,000	1,253.00	2,506,000
ユニプレス	19,300	807.00	15,575,100
豊田自動織機	78,500	7,620.00	598,170,000
モリタホールディングス	18,800	1,137.00	21,375,600
三櫻工業	16,400	635.00	10,414,000
デンソー	221,300	7,255.00	1,605,531,500
東海理化電機製作所	30,300	1,466.00	44,419,800
川崎重工業	80,900	3,095.00	250,385,500
名村造船所	27,500	449.00	12,347,500

日本車輛製造	4,100	1,932.00	7,921,200
三菱ロジスネクスト	17,100	840.00	14,364,000
近畿車輛	1,500	1,053.00	1,579,500
日産自動車	1,524,300	462.00	704,226,600
いすゞ自動車	312,000	1,696.00	529,152,000
トヨタ自動車	5,892,100	1,963.00	11,566,192,300
日野自動車	138,300	594.00	82,150,200
三菱自動車工業	418,600	591.00	247,392,600
エフテック	7,400	514.00	3,803,600
レシップホールディングス	4,200	480.00	2,016,000
G M B	2,100	746.00	1,566,600
ファルテック	1,700	600.00	1,020,000
武蔵精密工業	26,200	1,686.00	44,173,200
日産車体	18,900	807.00	15,252,300
新明和工業	33,700	1,018.00	34,306,600
極東開発工業	18,900	1,351.00	25,533,900
トピー工業	8,700	1,622.00	14,111,400
ティラド	2,700	2,499.00	6,747,300
曙ブレーキ工業	65,500	161.00	10,545,500
タチエス	17,000	1,049.00	17,833,000
N O K	41,700	1,225.00	51,082,500
フタバ産業	28,800	359.00	10,339,200
K Y B	10,300	3,365.00	34,659,500
大同メタル工業	21,000	486.00	10,206,000
プレス工業	47,900	427.00	20,453,300
ミクニ	12,300	342.00	4,206,600
太平洋工業	24,600	1,066.00	26,223,600
河西工業	14,300	158.00	2,259,400
アイシン	82,800	3,660.00	303,048,000
マツダ	354,900	1,065.00	377,968,500
今仙電機製作所	6,800	675.00	4,590,000
本田技研工業	872,200	3,261.00	2,844,244,200
スズキ	197,100	4,655.00	917,500,500
S U B A R U	339,500	2,230.00	757,085,000
安永	4,700	689.00	3,238,300
ヤマハ発動機	168,600	3,325.00	560,595,000
T B K	10,600	250.00	2,650,000
エクセディ	17,500	1,616.00	28,280,000
豊田合成	31,300	2,110.00	66,043,000
愛三工業	17,700	696.00	12,319,200
盟和産業	1,500	917.00	1,375,500
日本プラスト	8,400	410.00	3,444,000

ヨロズ	10,100	742.00	7,494,200
エフ・シー・シー	19,000	1,383.00	26,277,000
シマノ	43,900	23,375.00	1,026,162,500
テイ・エス テック	49,100	1,578.00	77,479,800
ジャムコ	5,800	1,533.00	8,891,400
テルモ	335,300	3,997.00	1,340,194,100
クリエートメディック	3,500	896.00	3,136,000
日機装	26,800	1,006.00	26,960,800
日本エム・ディ・エム	6,400	981.00	6,278,400
島津製作所	130,700	4,050.00	529,335,000
JMS	10,000	505.00	5,050,000
長野計器	7,800	1,126.00	8,782,800
ブイ・テクノロジー	5,300	2,666.00	14,129,800
東京計器	8,200	1,328.00	10,889,600
愛知時計電機	4,200	1,323.00	5,556,600
インターアクション	6,500	1,527.00	9,925,500
オーバル	9,500	500.00	4,750,000
東京精密	23,500	4,405.00	103,517,500
マニー	47,200	2,206.00	104,123,200
ニコン	166,800	1,236.00	206,164,800
トプコン	56,500	1,601.00	90,456,500
オリンパス	670,800	2,669.50	1,790,700,600
理研計器	6,600	4,970.00	32,802,000
タムロン	8,000	3,280.00	26,240,000
HOYA	231,800	13,795.00	3,197,681,000
シード	5,500	495.00	2,722,500
ノーリツ鋼機	10,200	2,730.00	27,846,000
A & D ホロンホールディングス	15,700	1,079.00	16,940,300
朝日インテック	141,700	2,544.00	360,484,800
シチズン時計	118,000	583.00	68,794,000
リズム	3,300	1,725.00	5,692,500
大研医器	8,100	452.00	3,661,200
メニコン	36,800	2,948.00	108,486,400
シンシア	1,000	553.00	553,000
松風	4,900	2,342.00	11,475,800
セイコーグループ	16,600	3,030.00	50,298,000
ニプロ	89,500	1,019.00	91,200,500
KYORITSU	15,900	121.00	1,923,900
中本パックス	3,200	1,559.00	4,988,800
スノーピーク	18,400	2,406.00	44,270,400
パラマウントベッドホールディングス	24,800	2,570.00	63,736,000
トランザクション	8,300	1,228.00	10,192,400

粧美堂	2,900	356.00	1,032,400	
ニホンフラッシュ	10,100	900.00	9,090,000	
前田工織	11,700	3,180.00	37,206,000	
永大産業	11,400	225.00	2,565,000	
アートネイチャー	11,000	780.00	8,580,000	
バンダイナムコホールディングス	98,000	8,952.00	877,296,000	
アイフィスジャパン	3,000	612.00	1,836,000	
SHOEI	11,300	5,540.00	62,602,000	
フランスベッドホールディングス	13,300	934.00	12,422,200	
パイロットコーポレーション	16,800	4,845.00	81,396,000	
萩原工業	7,200	1,101.00	7,927,200	
フジシールインターナショナル	21,700	1,782.00	38,669,400	
タカラトミー	49,600	1,242.00	61,603,200	
広済堂ホールディングス	7,200	1,958.00	14,097,600	
エステールホールディングス	2,500	631.00	1,577,500	
タカノ	4,000	672.00	2,688,000	
プロネクサス	8,900	952.00	8,472,800	
ホクシン	8,200	157.00	1,287,400	
ウッドワン	3,600	888.00	3,196,800	
大建工業	6,500	2,130.00	13,845,000	
凸版印刷	140,300	2,040.00	286,212,000	
大日本印刷	127,300	2,710.00	344,983,000	
共同印刷	3,000	2,811.00	8,433,000	
NISSHA	20,400	1,870.00	38,148,000	
光村印刷	900	1,175.00	1,057,500	
TAKARA & COMPANY	7,400	2,107.00	15,591,800	
アシックス	99,000	3,075.00	304,425,000	
ツツミ	2,400	1,921.00	4,610,400	
ローランド	7,900	3,855.00	30,454,500	
小松ウオール工業	3,900	1,831.00	7,140,900	
ヤマハ	67,600	5,480.00	370,448,000	
河合楽器製作所	2,900	2,566.00	7,441,400	
クリナップ	12,000	674.00	8,088,000	
ピジョン	68,300	2,239.00	152,923,700	
兼松サステック	700	1,585.00	1,109,500	
キングジム	9,500	906.00	8,607,000	
リンテック	21,500	2,169.00	46,633,500	
イトーキ	22,000	544.00	11,968,000	
任天堂	677,500	5,684.00	3,850,910,000	
三菱鉛筆	15,200	1,394.00	21,188,800	
タカラスタンダード	20,800	1,315.00	27,352,000	
コクヨ	51,700	1,812.00	93,680,400	

ナカバヤシ	11,600	485.00	5,626,000
グローブライド	8,700	2,698.00	23,472,600
オカムラ	32,300	1,368.00	44,186,400
美津濃	10,700	2,890.00	30,923,000
東京電力ホールディングス	967,300	510.00	493,323,000
中部電力	395,400	1,284.00	507,693,600
関西電力	414,400	1,166.00	483,190,400
中国電力	170,900	656.00	112,110,400
北陸電力	101,300	541.00	54,803,300
東北電力	262,300	643.00	168,658,900
四国電力	91,600	713.00	65,310,800
九州電力	247,400	705.00	174,417,000
北海道電力	103,700	441.00	45,731,700
沖縄電力	25,100	1,020.00	25,602,000
電源開発	80,800	2,086.00	168,548,800
エフオン	7,800	523.00	4,079,400
イーレックス	19,000	2,480.00	47,120,000
レノバ	28,500	2,637.00	75,154,500
東京瓦斯	226,900	2,598.00	589,486,200
大阪瓦斯	217,400	2,152.00	467,844,800
東邦瓦斯	42,200	2,669.00	112,631,800
北海道瓦斯	6,400	1,640.00	10,496,000
広島ガス	22,600	339.00	7,661,400
西部ガスホールディングス	10,100	1,680.00	16,968,000
静岡ガス	24,500	1,118.00	27,391,000
メタウォーター	13,400	1,737.00	23,275,800
SBSホールディングス	9,600	2,863.00	27,484,800
東武鉄道	117,900	3,180.00	374,922,000
相鉄ホールディングス	35,400	2,163.00	76,570,200
東急	300,900	1,713.00	515,441,700
京浜急行電鉄	121,700	1,354.00	164,781,800
小田急電鉄	162,700	1,744.00	283,748,800
京王電鉄	56,700	4,940.00	280,098,000
京成電鉄	69,200	3,850.00	266,420,000
富士急行	13,200	4,970.00	65,604,000
東日本旅客鉄道	182,000	7,783.00	1,416,506,000
西日本旅客鉄道	137,100	5,742.00	787,228,200
東海旅客鉄道	82,700	16,380.00	1,354,626,000
西武ホールディングス	129,800	1,416.00	183,796,800
鴻池運輸	18,300	1,581.00	28,932,300
西日本鉄道	28,700	2,642.00	75,825,400
ハマキョウレックス	8,400	3,340.00	28,056,000

サカイ引越センター	5,100	4,495.00	22,924,500
近鉄グループホールディングス	107,100	4,505.00	482,485,500
阪急阪神ホールディングス	142,800	4,120.00	588,336,000
南海電気鉄道	51,200	2,927.00	149,862,400
京阪ホールディングス	44,300	3,460.00	153,278,000
神戸電鉄	2,900	3,225.00	9,352,500
名古屋鉄道	118,400	2,182.00	258,348,800
山陽電気鉄道	8,100	2,120.00	17,172,000
アルプス物流	8,500	1,149.00	9,766,500
ヤマトホールディングス	137,200	2,319.00	318,166,800
山九	27,300	4,915.00	134,179,500
丸運	5,200	217.00	1,128,400
丸全昭和運輸	6,600	3,060.00	20,196,000
センコーグループホールディングス	56,700	982.00	55,679,400
トナミホールディングス	2,400	3,775.00	9,060,000
ニッコンホールディングス	34,300	2,374.00	81,428,200
日本石油輸送	1,100	2,209.00	2,429,900
福山通運	9,000	3,345.00	30,105,000
セイノーホールディングス	66,700	1,202.00	80,173,400
エスライン	3,000	795.00	2,385,000
神奈川中央交通	3,000	3,330.00	9,990,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	25,900	1,509.00	39,083,100
C & F ロジホールディングス	10,300	1,198.00	12,339,400
九州旅客鉄道	75,700	2,966.00	224,526,200
S Gホールディングス	205,600	2,025.00	416,340,000
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	40,000	8,040.00	321,600,000
日本郵船	287,000	3,076.00	882,812,000
商船三井	189,200	3,315.00	627,198,000
川崎汽船	91,700	2,554.00	234,201,800
N S ユナイテッド海運	6,000	3,875.00	23,250,000
飯野海運	40,500	946.00	38,313,000
共栄タンカー	3,100	932.00	2,889,200
乾汽船	14,200	1,935.00	27,477,000
日本航空	263,100	2,741.00	721,157,100
A N Aホールディングス	291,500	2,903.50	846,370,250
パスコ	2,100	1,331.00	2,795,100
トランコム	3,100	7,650.00	23,715,000
日新	8,100	1,997.00	16,175,700
三菱倉庫	23,000	3,180.00	73,140,000
三井倉庫ホールディングス	10,000	3,520.00	35,200,000
住友倉庫	29,400	1,957.00	57,535,800
澁澤倉庫	4,300	2,051.00	8,819,300

東陽倉庫	14,200	253.00	3,592,600
日本トランスシティ	21,600	510.00	11,016,000
ケイヒン	1,900	1,511.00	2,870,900
中央倉庫	5,200	928.00	4,825,600
川西倉庫	1,800	993.00	1,787,400
安田倉庫	7,300	924.00	6,745,200
ファイズホールディングス	2,000	945.00	1,890,000
東洋埠頭	3,100	1,277.00	3,958,700
上組	53,300	2,697.00	143,750,100
サンリツ	2,400	705.00	1,692,000
キムラユニティー	5,100	765.00	3,901,500
キューソー流通システム	6,400	994.00	6,361,600
東海運	6,300	279.00	1,757,700
エーアイティー	6,700	1,420.00	9,514,000
内外トランスライン	3,900	2,244.00	8,751,600
日本コンセプト	3,300	1,627.00	5,369,100
NEC ネットエスアイ	36,000	1,617.00	58,212,000
クロスキャット	6,200	1,515.00	9,393,000
システナ	181,300	421.00	76,327,300
デジタルアーツ	6,800	6,290.00	42,772,000
日鉄ソリューションズ	18,400	3,335.00	61,364,000
キューブシステム	6,500	1,056.00	6,864,000
コア	4,900	1,454.00	7,124,600
手間いらず	1,800	5,020.00	9,036,000
ラクーンホールディングス	10,800	1,196.00	12,916,800
ソリトンシステムズ	5,700	1,081.00	6,161,700
ソフトクリエイイトホールディングス	4,500	3,320.00	14,940,000
T I S	121,000	3,750.00	453,750,000
J N S ホールディングス	5,200	338.00	1,757,600
グリー	57,900	744.00	43,077,600
G M O ペパボ	1,600	2,022.00	3,235,200
コーエーテクモホールディングス	67,500	2,424.00	163,620,000
三菱総合研究所	5,300	4,915.00	26,049,500
電算	1,300	1,611.00	2,094,300
A G S	4,700	669.00	3,144,300
ファインデックス	8,800	525.00	4,620,000
ブレインパッド	10,900	842.00	9,177,800
K L a b	21,200	447.00	9,476,400
ポルトゥウィンホールディングス	18,500	858.00	15,873,000
ネクソン	278,100	3,030.00	842,643,000
アイスタイル	34,600	623.00	21,555,800
エムアップホールディングス	13,300	1,297.00	17,250,100

エイチーム	8,100	920.00	7,452,000
エニグモ	13,900	660.00	9,174,000
テクノスジャパン	9,100	484.00	4,404,400
コロプラ	41,900	668.00	27,989,200
ブロードリーフ	63,200	439.00	27,744,800
クロス・マーケティンググループ	4,500	758.00	3,411,000
デジタルハーツホールディングス	6,800	1,928.00	13,110,400
システム情報	9,700	888.00	8,613,600
メディアドゥ	4,400	1,933.00	8,505,200
じげん	31,800	376.00	11,956,800
ブイキューブ	13,100	782.00	10,244,200
エンカレッジ・テクノロジー	2,800	511.00	1,430,800
サイバーリンクス	3,600	1,019.00	3,668,400
フィックスターズ	12,300	1,313.00	16,149,900
CARTA HOLDINGS	5,300	1,667.00	8,835,100
オブティム	9,000	1,146.00	10,314,000
セレス	4,500	928.00	4,176,000
SHIFT	7,900	28,770.00	227,283,000
ティーガイア	11,300	1,638.00	18,509,400
セック	1,500	2,604.00	3,906,000
テクマトリックス	19,700	1,724.00	33,962,800
プロシップ	4,800	1,510.00	7,248,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	33,000	2,130.00	70,290,000
GMOペイメントゲートウェイ	24,600	12,390.00	304,794,000
ザッパラス	4,300	365.00	1,569,500
システムリサーチ	3,400	2,054.00	6,983,600
インターネットイニシアティブ	60,100	2,474.00	148,687,400
さくらインターネット	12,300	515.00	6,334,500
ヴィンクス	3,300	1,616.00	5,332,800
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,300	3,890.00	12,837,000
SRAホールディングス	5,500	3,105.00	17,077,500
システムインテグレータ	3,500	457.00	1,599,500
朝日ネット	11,800	573.00	6,761,400
eBASE	15,400	592.00	9,116,800
アバントグループ	13,700	1,577.00	21,604,900
アドソル日進	4,600	1,464.00	6,734,400
ODKソリューションズ	2,600	598.00	1,554,800
フリービット	6,700	1,004.00	6,726,800
コムチュア	14,300	2,643.00	37,794,900
サイバーコム	1,800	1,495.00	2,691,000
アステリア	8,600	816.00	7,017,600
アイル	6,100	2,050.00	12,505,000

マークラインズ	5,900	2,788.00	16,449,200
メディカル・データ・ビジョン	16,200	998.00	16,167,600
g u m i	17,800	775.00	13,795,000
ショーケース	2,900	351.00	1,017,900
モバイルファクトリー	2,400	892.00	2,140,800
テラスカイ	4,700	2,721.00	12,788,700
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,700	1,953.00	11,132,100
P C Iホールディングス	4,600	1,039.00	4,779,400
アイビーシー	2,000	418.00	836,000
ネオジャパン	3,700	1,001.00	3,703,700
P R T I M E S	2,800	2,486.00	6,960,800
ラクス	51,000	1,730.00	88,230,000
ランドコンピュータ	2,700	900.00	2,430,000
ダブルスタンダード	4,400	2,127.00	9,358,800
オープンドア	7,600	1,848.00	14,044,800
マイネット	3,800	456.00	1,732,800
アカツキ	5,200	2,200.00	11,440,000
ベネフィットジャパン	800	1,283.00	1,026,400
U b i c o mホールディングス	3,400	2,120.00	7,208,000
カナミックネットワーク	15,700	641.00	10,063,700
ノムラシステムコーポレーション	11,200	122.00	1,366,400
チェンジ	26,400	2,485.00	65,604,000
シンクロ・フード	7,100	440.00	3,124,000
オークネット	5,700	1,825.00	10,402,500
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	572.00	1,315,600
セグエグループ	3,100	938.00	2,907,800
エイトレッド	1,700	1,461.00	2,483,700
マクロミル	24,500	1,041.00	25,504,500
ビーグリー	1,900	1,283.00	2,437,700
オロ	3,300	1,931.00	6,372,300
ユーザーローカル	4,000	1,590.00	6,360,000
テモナ	2,500	318.00	795,000
ニーズウェル	3,500	799.00	2,796,500
マネーフォワード	25,900	4,620.00	119,658,000
サインポスト	4,200	715.00	3,003,000
電算システムホールディングス	5,300	2,244.00	11,893,200
ソルクシーズ	9,100	365.00	3,321,500
フェイス	3,300	519.00	1,712,700
プロトコーポレーション	13,600	1,217.00	16,551,200
ハイマックス	3,500	1,452.00	5,082,000
野村総合研究所	220,800	3,245.00	716,496,000
サイバネットシステム	9,200	911.00	8,381,200

C Eホールディングス	5,800	576.00	3,340,800
日本システム技術	4,600	1,590.00	7,314,000
インテージホールディングス	14,700	1,399.00	20,565,300
東邦システムサイエンス	3,100	1,001.00	3,103,100
ソースネクスト	55,200	292.00	16,118,400
インフォコム	13,900	1,999.00	27,786,100
シンプレクス・ホールディングス	18,000	2,268.00	40,824,000
HEROZ	3,700	1,122.00	4,151,400
ラクスル	15,200	3,055.00	46,436,000
メルカリ	48,400	2,887.00	139,730,800
I P S	3,500	2,925.00	10,237,500
F I G	12,700	449.00	5,702,300
システムサポート	4,700	1,471.00	6,913,700
イーソル	7,000	883.00	6,181,000
アルテリア・ネットワークス	10,100	1,234.00	12,463,400
東海ソフト	1,900	909.00	1,727,100
ウイングアーク1st	11,100	2,250.00	24,975,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,000	1,641.00	4,923,000
サーバーワークス	2,200	2,567.00	5,647,400
東名	900	1,492.00	1,342,800
ヴィッツ	1,200	1,013.00	1,215,600
トピラシステムズ	2,800	918.00	2,570,400
S a n s a n	40,200	1,623.00	65,244,600
L i n k - U	2,200	941.00	2,070,200
ギフトィ	11,600	2,303.00	26,714,800
ベース	3,700	3,690.00	13,653,000
J M D C	17,700	5,040.00	89,208,000
フォーカスシステムズ	8,000	994.00	7,952,000
クレスコ	8,400	1,746.00	14,666,400
フジ・メディア・ホールディングス	103,500	1,071.00	110,848,500
オービック	36,000	20,760.00	747,360,000
ジャストシステム	15,500	3,115.00	48,282,500
T D C ソフト	9,200	1,474.00	13,560,800
Zホールディングス	1,531,900	361.50	553,781,850
トレンドマイクロ	62,200	6,550.00	407,410,000
I Dホールディングス	7,400	904.00	6,689,600
日本オラクル	20,600	8,070.00	166,242,000
アルファシステムズ	3,400	4,180.00	14,212,000
フューチャー	26,900	1,624.00	43,685,600
C A C H o l d i n g s	6,700	1,526.00	10,224,200
S Bテクノロジー	4,600	1,973.00	9,075,800
トーセ	3,000	754.00	2,262,000

オービックビジネスコンサルタント	21,200	4,350.00	92,220,000
伊藤忠テクノソリューションズ	57,800	3,200.00	184,960,000
アイティフォー	14,300	827.00	11,826,100
東計電算	1,500	5,660.00	8,490,000
エクスネット	1,600	999.00	1,598,400
大塚商会	61,000	4,325.00	263,825,000
サイボウズ	14,900	2,441.00	36,370,900
電通国際情報サービス	13,100	4,270.00	55,937,000
A C C E S S	12,900	900.00	11,610,000
デジタルガレージ	19,100	4,375.00	83,562,500
E Mシステムズ	18,100	882.00	15,964,200
ウェザーニューズ	3,800	7,360.00	27,968,000
C I J	10,000	918.00	9,180,000
ビジネスエンジニアリング	2,300	2,319.00	5,333,700
日本エンタープライズ	12,100	141.00	1,706,100
WOWOW	6,200	1,225.00	7,595,000
スカラ	10,800	745.00	8,046,000
インテリジェント ウェイブ	5,900	753.00	4,442,700
WOW WORLD GROUP	2,000	1,121.00	2,242,000
I M A G I C A G R O U P	9,200	710.00	6,532,000
ネットワンシステムズ	40,100	3,345.00	134,134,500
システムソフト	38,800	99.00	3,841,200
アルゴグラフィックス	9,900	3,610.00	35,739,000
マーベラス	17,700	669.00	11,841,300
エイベックス	18,400	1,546.00	28,446,400
B I P R O G Y	39,600	3,270.00	129,492,000
兼松エレクトロニクス	6,900	4,380.00	30,222,000
都築電気	5,800	1,289.00	7,476,200
T B S ホールディングス	55,200	1,556.00	85,891,200
日本テレビホールディングス	95,400	1,039.00	99,120,600
朝日放送グループホールディングス	10,300	624.00	6,427,200
テレビ朝日ホールディングス	26,200	1,351.00	35,396,200
スカパーJ S A Tホールディングス	95,800	483.00	46,271,400
テレビ東京ホールディングス	7,800	1,837.00	14,328,600
日本BS放送	4,000	911.00	3,644,000
ビジョン	14,200	1,296.00	18,403,200
スマートバリュー	2,900	471.00	1,365,900
U S E N - N E X T H O L D I N G S	9,700	2,178.00	21,126,600
ワイヤレスゲート	5,200	273.00	1,419,600
コネクシオ	7,300	1,225.00	8,942,500
クロップス	1,900	1,065.00	2,023,500
日本電信電話	1,379,000	3,730.00	5,143,670,000

K D D I	831,600	3,984.00	3,313,094,400
ソフトバンク	1,728,900	1,476.50	2,552,720,850
光通信	12,700	18,380.00	233,426,000
エムティーアイ	10,100	522.00	5,272,200
GMOインターネットグループ	40,000	2,487.00	99,480,000
ファイバーゲート	5,900	911.00	5,374,900
アйдママーケティングコミュニケーション	2,900	281.00	814,900
K A D O K A W A	56,900	2,672.00	152,036,800
学研ホールディングス	18,100	963.00	17,430,300
ゼンリン	18,600	838.00	15,586,800
昭文社ホールディングス	5,100	290.00	1,479,000
インプレスホールディングス	10,100	213.00	2,151,300
アイネット	6,600	1,295.00	8,547,000
松竹	6,200	12,140.00	75,268,000
東宝	67,400	5,320.00	358,568,000
東映	3,000	18,950.00	56,850,000
エヌ・ティ・ティ・データ	337,700	2,057.00	694,648,900
ピー・シー・エー	6,600	1,300.00	8,580,000
ビジネスブレイン太田昭和	4,700	1,913.00	8,991,100
D T S	23,500	3,110.00	73,085,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	54,100	6,290.00	340,289,000
シーイーシー	15,200	1,531.00	23,271,200
カブコン	107,000	4,370.00	467,590,000
アイ・エス・ビー	5,600	1,290.00	7,224,000
ジャステック	6,700	1,181.00	7,912,700
S C S K	87,900	2,089.00	183,623,100
N S W	4,200	2,125.00	8,925,000
アイネス	7,600	1,366.00	10,381,600
T K C	19,300	3,620.00	69,866,000
富士ソフト	12,200	7,570.00	92,354,000
N S D	38,500	2,392.00	92,092,000
コナミグループ	46,100	6,220.00	286,742,000
福井コンピュータホールディングス	7,500	2,798.00	20,985,000
J B C Cホールディングス	7,900	1,917.00	15,144,300
ミロク情報サービス	9,900	1,445.00	14,305,500
ソフトバンクグループ	622,300	6,205.00	3,861,371,500
高千穂交易	4,100	2,173.00	8,909,300
オルバヘルスケアホールディングス	1,900	1,522.00	2,891,800
伊藤忠食品	2,600	5,120.00	13,312,000
エレマテック	10,200	1,522.00	15,524,400
あらた	8,700	4,020.00	34,974,000
トーメンデバイス	1,600	5,480.00	8,768,000

東京エレクトロン デバイス	4,200	6,810.00	28,602,000
円谷フィールズホールディングス	9,800	2,510.00	24,598,000
双日	120,500	2,470.00	297,635,000
アルフレッサ ホールディングス	114,000	1,617.00	184,338,000
横浜冷凍	30,900	1,017.00	31,425,300
ラサ商事	5,200	1,023.00	5,319,600
アルコニックス	15,000	1,323.00	19,845,000
神戸物産	87,800	3,530.00	309,934,000
ハイパー	2,200	507.00	1,115,400
あい ホールディングス	18,200	2,168.00	39,457,600
ディーブイエックス	3,100	968.00	3,000,800
ダイワボウホールディングス	46,400	2,010.00	93,264,000
マクニカホールディングス	27,800	3,500.00	97,300,000
ラクト・ジャパン	4,400	2,073.00	9,121,200
グリムス	4,700	1,881.00	8,840,700
バイタルケーエスケー・ホールディングス	16,600	821.00	13,628,600
八洲電機	9,200	1,019.00	9,374,800
メディアスホールディングス	7,300	758.00	5,533,400
レスターホールディングス	10,900	2,110.00	22,999,000
ジューテックホールディングス	2,600	1,162.00	3,021,200
大光	4,900	664.00	3,253,600
O C H Iホールディングス	2,600	1,226.00	3,187,600
T O K A Iホールディングス	56,100	874.00	49,031,400
黒谷	3,200	585.00	1,872,000
C o m i n i x	2,300	725.00	1,667,500
三洋貿易	11,700	1,107.00	12,951,900
ビューティガレージ	2,100	2,881.00	6,050,100
ウイン・パートナーズ	8,300	990.00	8,217,000
ミタチ産業	2,900	1,128.00	3,271,200
シップヘルスケアホールディングス	40,800	2,658.00	108,446,400
明治電機工業	4,200	1,043.00	4,380,600
デリカフーズホールディングス	4,500	479.00	2,155,500
スターティアホールディングス	2,200	1,038.00	2,283,600
コメダホールディングス	27,800	2,437.00	67,748,600
ピーバンドットコム	1,700	522.00	887,400
アセンテック	3,900	493.00	1,922,700
富士興産	2,600	1,120.00	2,912,000
協栄産業	1,100	1,734.00	1,907,400
フルサト・マルカホールディングス	11,300	3,605.00	40,736,500
ヤマエグループホールディングス	6,400	1,462.00	9,356,800
小野建	10,400	1,436.00	14,934,400
南陽	2,200	1,848.00	4,065,600

佐島電機	7,200	1,261.00	9,079,200
エコートレーディング	2,200	635.00	1,397,000
伯東	6,500	3,860.00	25,090,000
コンドーテック	8,700	976.00	8,491,200
中山福	6,100	323.00	1,970,300
ナガイレーベン	14,400	2,067.00	29,764,800
三菱食品	10,500	3,140.00	32,970,000
松田産業	8,600	2,272.00	19,539,200
第一興商	22,000	3,950.00	86,900,000
メディバルホールディングス	117,800	1,751.00	206,267,800
S P K	5,100	1,392.00	7,099,200
萩原電気ホールディングス	4,400	2,446.00	10,762,400
アズワン	16,600	6,100.00	101,260,000
スズデン	4,000	2,275.00	9,100,000
尾家産業	2,700	942.00	2,543,400
シモジマ	7,800	933.00	7,277,400
ドウシシャ	12,000	1,507.00	18,084,000
小津産業	2,500	1,447.00	3,617,500
高速	5,900	1,792.00	10,572,800
たけびし	4,300	1,511.00	6,497,300
リックス	2,400	2,241.00	5,378,400
丸文	10,200	891.00	9,088,200
ハピネット	9,700	1,912.00	18,546,400
橋本総業ホールディングス	4,500	995.00	4,477,500
日本ライフライン	33,300	931.00	31,002,300
タカショー	9,900	707.00	6,999,300
I D O M	34,400	684.00	23,529,600
進和	7,500	2,062.00	15,465,000
エスケイジャパン	2,800	520.00	1,456,000
ダイトロン	4,500	2,368.00	10,656,000
シークス	16,200	1,425.00	23,085,000
田中商事	3,200	565.00	1,808,000
オーハシテクニカ	5,700	1,376.00	7,843,200
白銅	4,100	2,443.00	10,016,300
ダイコー通産	1,400	1,062.00	1,486,800
伊藤忠商事	699,600	4,266.00	2,984,493,600
丸紅	896,300	1,527.50	1,369,098,250
高島	1,800	2,866.00	5,158,800
長瀬産業	53,400	2,012.00	107,440,800
蝶理	6,100	1,977.00	12,059,700
豊田通商	99,500	5,310.00	528,345,000
三共生興	16,300	477.00	7,775,100

兼松	44,100	1,510.00	66,591,000
ツカモトコーポレーション	1,600	1,340.00	2,144,000
三井物産	830,700	3,999.00	3,321,969,300
日本紙パルプ商事	6,000	4,905.00	29,430,000
カメイ	12,100	1,174.00	14,205,400
東都水産	600	5,300.00	3,180,000
OUGホールディングス	1,700	2,405.00	4,088,500
スターゼン	8,600	2,064.00	17,750,400
山善	30,600	1,000.00	30,600,000
椿本興業	1,800	3,990.00	7,182,000
住友商事	703,100	2,223.00	1,562,991,300
内田洋行	5,000	4,520.00	22,600,000
三菱商事	709,800	4,422.00	3,138,735,600
第一実業	4,000	4,275.00	17,100,000
キャノンマーケティングジャパン	26,300	3,015.00	79,294,500
西華産業	4,500	1,554.00	6,993,000
佐藤商事	7,900	1,199.00	9,472,100
菱洋エレクトロ	9,700	2,361.00	22,901,700
東京産業	10,400	772.00	8,028,800
ユアサ商事	10,200	3,490.00	35,598,000
神鋼商事	2,900	4,475.00	12,977,500
トルク	6,200	236.00	1,463,200
阪和興業	20,400	3,605.00	73,542,000
正栄食品工業	7,600	4,150.00	31,540,000
カナデン	9,200	1,110.00	10,212,000
菱電商事	9,200	1,662.00	15,290,400
岩谷産業	25,900	5,550.00	143,745,000
ナイス	3,100	1,349.00	4,181,900
ニチモウ	1,300	2,606.00	3,387,800
極東貿易	6,800	1,330.00	9,044,000
アステナホールディングス	19,700	430.00	8,471,000
三愛オブリ	31,400	1,231.00	38,653,400
稲畑産業	23,000	2,352.00	54,096,000
G S Iクレオス	6,600	1,447.00	9,550,200
明和産業	15,100	691.00	10,434,100
クワザワホールディングス	3,700	413.00	1,528,100
ワキタ	20,900	1,180.00	24,662,000
東邦ホールディングス	28,300	2,042.00	57,788,600
サンゲツ	28,500	2,105.00	59,992,500
ミツウロコグループホールディングス	14,600	1,007.00	14,702,200
シナネンホールディングス	3,700	3,715.00	13,745,500
伊藤忠エネクス	28,200	1,007.00	28,397,400

サンリオ	32,200	4,560.00	146,832,000
サンワテクノス	5,800	1,473.00	8,543,400
リョーサン	12,000	2,856.00	34,272,000
新光商事	15,300	1,153.00	17,640,900
トーホー	4,900	1,785.00	8,746,500
三信電気	4,600	2,181.00	10,032,600
東陽テクニカ	12,600	1,343.00	16,921,800
モスフードサービス	16,700	3,135.00	52,354,500
加賀電子	9,200	4,230.00	38,916,000
ソーダニッカ	8,300	608.00	5,046,400
立花エレテック	8,300	1,746.00	14,491,800
フォーバル	4,500	941.00	4,234,500
PALTAC	17,900	4,450.00	79,655,000
三谷産業	19,900	316.00	6,288,400
西本Wismettacホールディングス	2,900	3,690.00	10,701,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,588.00	1,588,000
コア商事ホールディングス	8,000	597.00	4,776,000
KPPグループホールディングス	26,500	865.00	22,922,500
ヤマタネ	5,000	1,663.00	8,315,000
丸紅建材リース	1,000	1,717.00	1,717,000
日鉄物産	7,800	5,020.00	39,156,000
泉州電業	5,700	3,025.00	17,242,500
トラスコ中山	23,900	2,137.00	51,074,300
オートバックスセブン	39,500	1,424.00	56,248,000
モリト	8,200	744.00	6,100,800
加藤産業	13,800	3,415.00	47,127,000
北恵	2,600	664.00	1,726,400
イエローハット	20,000	1,727.00	34,540,000
JKホールディングス	9,000	1,024.00	9,216,000
日伝	6,700	1,675.00	11,222,500
北沢産業	6,200	192.00	1,190,400
杉本商事	5,000	1,976.00	9,880,000
因幡電機産業	29,400	2,769.00	81,408,600
東テク	3,800	3,105.00	11,799,000
ミスミグループ本社	171,300	3,385.00	579,850,500
アルテック	6,400	300.00	1,920,000
タキヒヨー	2,800	878.00	2,458,400
蔵王産業	1,900	1,756.00	3,336,400
スズケン	36,200	3,605.00	130,501,000
ジェコス	7,300	797.00	5,818,100
グローセル	12,500	437.00	5,462,500
ローソン	28,200	5,040.00	142,128,000

サンエー	8,700	4,220.00	36,714,000
カワチ薬品	9,000	2,155.00	19,395,000
エービーシー・マート	16,600	7,040.00	116,864,000
ハードオフコーポレーション	4,700	1,401.00	6,584,700
アスクル	27,500	1,560.00	42,900,000
ゲオホールディングス	12,000	2,004.00	24,048,000
アダストリア	13,800	2,006.00	27,682,800
くら寿司	13,300	3,340.00	44,422,000
キャンドウ	4,100	2,188.00	8,970,800
I Kホールディングス	4,100	420.00	1,722,000
パルグループホールディングス	11,200	2,421.00	27,115,200
エディオン	45,100	1,263.00	56,961,300
サーラコーポレーション	24,100	698.00	16,821,800
ワッツ	5,800	707.00	4,100,600
ハローズ	5,200	2,926.00	15,215,200
フジオフードグループ本社	9,400	1,378.00	12,953,200
あみやき亭	2,800	2,902.00	8,125,600
大黒天物産	4,100	5,200.00	21,320,000
ハニーズホールディングス	10,200	1,270.00	12,954,000
ファーマライズホールディングス	2,700	668.00	1,803,600
アルペン	9,500	2,057.00	19,541,500
ハブ	4,000	628.00	2,512,000
クオールホールディングス	15,800	1,162.00	18,359,600
ジーンズホールディングス	6,800	4,735.00	32,198,000
ビックカメラ	75,700	1,292.00	97,804,400
D C Mホールディングス	69,500	1,155.00	80,272,500
Monotaro	161,000	2,213.00	356,293,000
東京一番フーズ	3,000	490.00	1,470,000
きちりホールディングス	3,000	590.00	1,770,000
アークランドサービスホールディングス	9,400	2,218.00	20,849,200
J . フロント リテイリング	141,300	1,164.00	164,473,200
ドトール・日レスホールディングス	20,200	1,695.00	34,239,000
マツキヨココカラ&カンパニー	68,900	6,240.00	429,936,000
ブロンコビリー	6,100	2,493.00	15,207,300
Z O Z O	75,100	3,365.00	252,711,500
トレジャー・ファクトリー	3,500	2,494.00	8,729,000
物語コーポレーション	6,300	6,410.00	40,383,000
三越伊勢丹ホールディングス	191,200	1,300.00	248,560,000
H a m e e	4,800	848.00	4,070,400
マーケットエンタープライズ	1,400	984.00	1,377,600
ウエルシアホールディングス	59,000	3,100.00	182,900,000
クリエイトSDホールディングス	18,800	3,220.00	60,536,000

丸善C H I ホールディングス	14,000	329.00	4,606,000
ミサワ	2,400	615.00	1,476,000
ティーライフ	1,700	1,294.00	2,199,800
チムニー	3,500	1,123.00	3,930,500
シュッピン	8,600	1,246.00	10,715,600
オイシックス・ラ・大地	15,400	1,925.00	29,645,000
ネクステージ	26,000	2,729.00	70,954,000
ジョイフル本田	36,600	1,876.00	68,661,600
鳥貴族ホールディングス	4,300	2,187.00	9,404,100
ホットランド	8,800	1,507.00	13,261,600
すかいらーくホールディングス	155,300	1,597.00	248,014,100
S F Pホールディングス	6,200	1,733.00	10,744,600
綿半ホールディングス	8,900	1,327.00	11,810,300
ヨシックスホールディングス	2,300	2,142.00	4,926,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	37,200	1,100.00	40,920,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,200	1,680.00	8,736,000
B E E N O S	6,500	2,559.00	16,633,500
あさひ	9,600	1,377.00	13,219,200
日本調剤	7,900	1,192.00	9,416,800
コスモス薬品	12,900	14,070.00	181,503,000
トーエル	5,300	721.00	3,821,300
セブン&アイ・ホールディングス	391,300	5,588.00	2,186,584,400
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	85,400	937.00	80,019,800
ツルハホールディングス	27,800	9,490.00	263,822,000
サンマルクホールディングス	9,300	1,682.00	15,642,600
フェリシモ	2,700	1,006.00	2,716,200
トリドールホールディングス	28,300	2,731.00	77,287,300
T O K Y O B A S E	12,300	297.00	3,653,100
ウイルプラスホールディングス	2,300	1,101.00	2,532,300
J Mホールディングス	9,800	1,728.00	16,934,400
サツドラホールディングス	5,400	690.00	3,726,000
アレンザホールディングス	8,700	984.00	8,560,800
串カツ田中ホールディングス	3,100	1,765.00	5,471,500
パロックジャパンリミテッド	7,600	815.00	6,194,000
クスリのアオキホールディングス	11,400	8,160.00	93,024,000
力の源ホールディングス	6,400	945.00	6,048,000
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	65,300	2,845.00	185,778,500
メディカルシステムネットワーク	10,300	413.00	4,253,900
はるやまホールディングス	5,200	438.00	2,277,600
ノジマ	37,200	1,321.00	49,141,200

カップ・クリエイト	17,800	1,381.00	24,581,800
ライトオン	8,600	616.00	5,297,600
良品計画	146,600	1,541.00	225,910,600
パリミキホールディングス	14,900	269.00	4,008,100
アドヴァングループ	11,000	888.00	9,768,000
アルビス	3,800	2,375.00	9,025,000
コナカ	12,400	334.00	4,141,600
ハウス オブ ローゼ	1,500	1,618.00	2,427,000
G - 7ホールディングス	14,300	1,511.00	21,607,300
イオン北海道	16,900	1,136.00	19,198,400
コジマ	22,200	612.00	13,586,400
ヒマラヤ	3,800	927.00	3,522,600
コーナン商事	15,400	3,280.00	50,512,000
エコス	4,300	1,828.00	7,860,400
ワタミ	13,700	1,031.00	14,124,700
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	254,600	2,346.00	597,291,600
西松屋チェーン	25,300	1,369.00	34,635,700
ゼンショーホールディングス	62,200	3,425.00	213,035,000
幸楽苑ホールディングス	7,400	1,008.00	7,459,200
ハークスレイ	4,300	800.00	3,440,000
サイゼリヤ	18,900	3,030.00	57,267,000
V Tホールディングス	43,500	503.00	21,880,500
魚力	3,600	2,140.00	7,704,000
フジ・コーポレーション	6,600	1,271.00	8,388,600
ユナイテッドアローズ	12,200	1,889.00	23,045,800
ハイデイ日高	16,900	1,981.00	33,478,900
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	7,700	204.00	1,570,800
コロワイド	52,300	1,800.00	94,140,000
ピーシーデボコーポレーション	13,400	267.00	3,577,800
壱番屋	9,000	4,580.00	41,220,000
P L A N T	2,900	640.00	1,856,000
スギホールディングス	22,900	6,290.00	144,041,000
薬王堂ホールディングス	6,400	2,655.00	16,992,000
スクロール	17,100	717.00	12,260,700
ヨンドシーホールディングス	9,900	1,734.00	17,166,600
木曽路	17,300	2,094.00	36,226,200
S R S ホールディングス	19,000	858.00	16,302,000
千趣会	21,400	400.00	8,560,000
リテールパートナーズ	17,000	1,237.00	21,029,000
ケーヨー	18,500	903.00	16,705,500
上新電機	10,200	1,900.00	19,380,000

日本瓦斯	60,900	2,091.00	127,341,900
ロイヤルホールディングス	22,000	2,480.00	54,560,000
いなげや	11,200	1,177.00	13,182,400
チヨダ	11,100	760.00	8,436,000
ライフコーポレーション	10,000	2,544.00	25,440,000
リンガーハット	14,600	2,219.00	32,397,400
MrMaxHD	16,200	650.00	10,530,000
AOKIホールディングス	21,400	669.00	14,316,600
オークワ	18,300	914.00	16,726,200
コメリ	17,500	2,579.00	45,132,500
青山商事	24,500	889.00	21,780,500
しまむら	13,300	12,580.00	167,314,000
はせがわ	6,000	348.00	2,088,000
高島屋	85,700	1,697.00	145,432,900
松屋	19,400	985.00	19,109,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	55,400	1,178.00	65,261,200
近鉄百貨店	3,700	2,420.00	8,954,000
丸井グループ	83,800	2,253.00	188,801,400
アクシアル リテイリング	7,800	3,345.00	26,091,000
イオン	384,900	2,828.00	1,088,497,200
イズミ	17,300	2,985.00	51,640,500
平和堂	19,000	2,041.00	38,779,000
フジ	17,500	1,817.00	31,797,500
ヤオコー	12,900	6,800.00	87,720,000
ゼビオホールディングス	15,600	934.00	14,570,400
ケーズホールディングス	90,500	1,111.00	100,545,500
Olympicグループ	4,600	521.00	2,396,600
日産東京販売ホールディングス	15,100	289.00	4,363,900
シルバーライフ	2,700	1,739.00	4,695,300
Genky DrugStores	5,600	3,535.00	19,796,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,100	866.00	1,818,600
ブックオフグループホールディングス	6,800	1,342.00	9,125,600
ギフトホールディングス	2,500	3,770.00	9,425,000
アインホールディングス	15,700	6,340.00	99,538,000
元気寿司	3,600	3,155.00	11,358,000
ヤマダホールディングス	465,900	469.00	218,507,100
アーケランズ	16,700	1,513.00	25,267,100
ニトリホールディングス	45,900	16,035.00	736,006,500
グルメ杵屋	9,400	997.00	9,371,800
愛眼	8,400	173.00	1,453,200
ケーユーホールディングス	6,800	1,310.00	8,908,000
吉野家ホールディングス	44,500	2,355.00	104,797,500

松屋フーズホールディングス	5,400	3,915.00	21,141,000
サガミホールディングス	18,400	1,216.00	22,374,400
関西フードマーケット	10,400	1,304.00	13,561,600
王将フードサービス	7,500	6,040.00	45,300,000
ミニストップ	8,400	1,431.00	12,020,400
アークス	20,900	2,092.00	43,722,800
パローホールディングス	21,800	1,761.00	38,389,800
ベルク	5,700	5,700.00	32,490,000
大庄	6,300	1,060.00	6,678,000
ファーストリテイリング	17,000	83,900.00	1,426,300,000
サンドラッグ	43,100	3,785.00	163,133,500
サクスパー ホールディングス	11,000	778.00	8,558,000
ヤマザワ	2,200	1,302.00	2,864,400
やまや	2,400	2,461.00	5,906,400
ベルーナ	27,600	677.00	18,685,200
いよぎんホールディングス	125,800	656.00	82,524,800
しずおかフィナンシャルグループ	238,800	959.00	229,009,200
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	89,000	933.00	83,037,000
島根銀行	3,600	443.00	1,594,800
じもとホールディングス	7,000	393.00	2,751,000
めぶきフィナンシャルグループ	524,400	296.00	155,222,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,500	2,310.00	31,185,000
九州フィナンシャルグループ	185,900	388.00	72,129,200
ゆうちょ銀行	300,900	1,024.00	308,121,600
富山第一銀行	26,300	525.00	13,807,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	582,500	475.00	276,687,500
西日本フィナンシャルホールディングス	66,900	847.00	56,664,300
三十三フィナンシャルグループ	9,500	1,444.00	13,718,000
第四北越フィナンシャルグループ	16,600	2,511.00	41,682,600
ひろぎんホールディングス	137,900	618.00	85,222,200
おきなわフィナンシャルグループ	10,100	2,053.00	20,735,300
十六フィナンシャルグループ	13,700	2,569.00	35,195,300
北國フィナンシャルホールディングス	8,900	4,365.00	38,848,500
プロクレアホールディングス	12,900	2,092.00	26,986,800
あいちフィナンシャルグループ	14,800	2,180.00	32,264,000
新生銀行	31,200	2,244.00	70,012,800
あおぞら銀行	66,500	2,580.00	171,570,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,928,600	755.50	5,234,557,300
りそなホールディングス	1,348,800	641.30	864,985,440
三井住友トラスト・ホールディングス	195,500	4,205.00	822,077,500
三井住友フィナンシャルグループ	772,300	4,655.00	3,595,056,500
千葉銀行	294,500	830.00	244,435,000

群馬銀行	205,100	428.00	87,782,800	
武蔵野銀行	13,600	1,843.00	25,064,800	
千葉興業銀行	24,700	398.00	9,830,600	
筑波銀行	46,400	198.00	9,187,200	
七十七銀行	33,800	1,894.00	64,017,200	
秋田銀行	7,100	1,698.00	12,055,800	
山形銀行	11,700	1,139.00	13,326,300	
岩手銀行	7,200	1,847.00	13,298,400	
東邦銀行	83,600	206.00	17,221,600	
東北銀行	5,200	982.00	5,106,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	84,400	2,644.00	223,153,600	
スルガ銀行	93,200	406.00	37,839,200	
八十二銀行	216,800	498.00	107,966,400	
山梨中央銀行	10,900	1,037.00	11,303,300	
大垣共立銀行	20,100	1,719.00	34,551,900	
福井銀行	9,400	1,429.00	13,432,600	
清水銀行	4,200	1,463.00	6,144,600	
富山銀行	1,600	1,650.00	2,640,000	
滋賀銀行	17,600	2,486.00	43,753,600	
南都銀行	15,900	2,261.00	35,949,900	
百五銀行	99,400	338.00	33,597,200	
京都銀行	33,500	5,420.00	181,570,000	
紀陽銀行	37,800	1,405.00	53,109,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	67,200	868.00	58,329,600	
山陰合同銀行	66,100	714.00	47,195,400	
鳥取銀行	3,400	1,075.00	3,655,000	
百十四銀行	9,600	1,703.00	16,348,800	
四国銀行	16,800	881.00	14,800,800	
阿波銀行	15,600	1,982.00	30,919,200	
大分銀行	6,400	1,851.00	11,846,400	
宮崎銀行	6,900	2,257.00	15,573,300	
佐賀銀行	6,200	1,549.00	9,603,800	
琉球銀行	24,200	800.00	19,360,000	
セブン銀行	378,600	256.00	96,921,600	
みずほフィナンシャルグループ	1,528,400	1,686.00	2,576,882,400	
高知銀行	3,600	656.00	2,361,600	
山口フィナンシャルグループ	116,700	773.00	90,209,100	
長野銀行	3,300	1,201.00	3,963,300	
名古屋銀行	7,000	3,060.00	21,420,000	
北洋銀行	160,100	228.00	36,502,800	
大光銀行	3,100	1,143.00	3,543,300	
愛媛銀行	14,200	841.00	11,942,200	

トマト銀行	3,500	992.00	3,472,000
京葉銀行	49,100	520.00	25,532,000
栃木銀行	48,400	298.00	14,423,200
北日本銀行	3,700	1,885.00	6,974,500
東和銀行	19,400	524.00	10,165,600
福島銀行	11,100	215.00	2,386,500
大東銀行	4,100	620.00	2,542,000
トモニホールディングス	85,400	328.00	28,011,200
フィデアホールディングス	10,900	1,319.00	14,377,100
池田泉州ホールディングス	135,300	225.00	30,442,500
F P G	43,000	1,131.00	48,633,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	8,700	1,216.00	10,579,200
マーキュリアホールディングス	6,400	593.00	3,795,200
S B Iホールディングス	153,000	2,575.00	393,975,000
ジャフコ グループ	35,300	2,373.00	83,766,900
大和証券グループ本社	755,900	585.00	442,201,500
野村ホールディングス	1,946,600	485.50	945,074,300
岡三証券グループ	93,100	392.00	36,495,200
丸三証券	35,500	404.00	14,342,000
東洋証券	35,600	268.00	9,540,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	115,400	349.00	40,274,600
光世証券	2,800	378.00	1,058,400
水戸証券	29,000	216.00	6,264,000
いちよし証券	19,700	621.00	12,233,700
松井証券	62,600	776.00	48,577,600
マネックスグループ	118,400	424.00	50,201,600
極東証券	13,400	592.00	7,932,800
岩井コスモホールディングス	12,200	1,254.00	15,298,800
アイザワ証券グループ	15,500	682.00	10,571,000
マネーパートナーズグループ	11,500	289.00	3,323,500
スパークス・グループ	11,900	1,693.00	20,146,700
かんぽ生命保険	128,300	2,175.00	279,052,500
S O M P Oホールディングス	181,400	5,639.00	1,022,914,600
アニコム ホールディングス	35,900	657.00	23,586,300
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	238,300	3,917.00	933,421,100
第一生命ホールディングス	538,000	2,607.50	1,402,835,000
東京海上ホールディングス	1,064,200	2,797.00	2,976,567,400
T & Dホールディングス	283,600	1,637.00	464,253,200
アドバンスクリエイト	6,100	1,060.00	6,466,000
全国保証	27,700	5,030.00	139,331,000
あんしん保証	6,800	256.00	1,740,800
イントラスト	4,600	773.00	3,555,800

日本モーゲージサービス	6,300	855.00	5,386,500
C a s a	4,500	875.00	3,937,500
アルヒ	14,400	1,003.00	14,443,200
プレミアグループ	18,000	1,754.00	31,572,000
ネットプロテクションズホールディングス	35,700	497.00	17,742,900
クレディセゾン	67,200	1,706.00	114,643,200
芙蓉総合リース	9,800	8,490.00	83,202,000
みずほリース	15,900	3,255.00	51,754,500
東京センチュリー	19,800	4,575.00	90,585,000
日本証券金融	42,800	1,067.00	45,667,600
アイフル	176,000	408.00	71,808,000
リコーリース	10,100	3,620.00	36,562,000
イオンフィナンシャルサービス	61,000	1,398.00	85,278,000
アコム	189,900	314.00	59,628,600
ジャックス	11,400	4,140.00	47,196,000
オリエントコーポレーション	27,900	1,151.00	32,112,900
オリックス	707,100	2,202.50	1,557,387,750
三菱HCキャピタル	412,700	638.00	263,302,600
九州リースサービス	5,500	675.00	3,712,500
日本取引所グループ	297,200	1,927.00	572,704,400
イー・ギャランティ	17,200	2,278.00	39,181,600
アサックス	5,400	595.00	3,213,000
NECキャピタルソリューション	5,400	2,055.00	11,097,000
大東建託	38,800	14,300.00	554,840,000
いちご	125,300	302.00	37,840,600
日本駐車場開発	130,700	295.00	38,556,500
スター・マイカ・ホールディングス	11,100	713.00	7,914,300
SREホールディングス	5,400	4,290.00	23,166,000
ADワークスグループ	26,600	154.00	4,096,400
ヒューリック	247,500	1,139.00	281,902,500
三栄建築設計	5,800	1,521.00	8,821,800
野村不動産ホールディングス	66,400	3,110.00	206,504,000
三重交通グループホールディングス	24,900	482.00	12,001,800
サムティ	17,300	2,249.00	38,907,700
ディア・ライフ	18,000	608.00	10,944,000
地主	8,600	1,970.00	16,942,000
プレサンスコーポレーション	14,600	1,535.00	22,411,000
ハウスコム	2,700	1,090.00	2,943,000
JPMC	6,400	1,022.00	6,540,800
サンセイランディック	4,400	852.00	3,748,800
フージャースホールディングス	16,300	745.00	12,143,500
オープンハウスグループ	38,900	5,610.00	218,229,000

東急不動産ホールディングス	319,300	695.00	221,913,500
飯田グループホールディングス	93,100	2,101.00	195,603,100
イーランド	2,300	1,562.00	3,592,600
ムゲンエステート	9,300	487.00	4,529,100
And Doホールディングス	6,300	841.00	5,298,300
シーアールイー	5,600	1,366.00	7,649,600
ケイアイスター不動産	5,300	4,875.00	25,837,500
グッドコムアセット	11,300	725.00	8,192,500
ジェイ・エス・ビー	2,900	4,230.00	12,267,000
ロードスターキャピタル	5,200	1,752.00	9,110,400
テンポイノベーション	4,300	985.00	4,235,500
フェイスネットワーク	2,300	1,346.00	3,095,800
パーク24	82,900	1,983.00	164,390,700
パラカ	4,300	1,918.00	8,247,400
三井不動産	459,700	2,613.00	1,201,196,100
三菱地所	670,600	1,836.50	1,231,556,900
平和不動産	17,400	3,930.00	68,382,000
東京建物	101,300	1,844.00	186,797,200
京阪神ビルディング	14,300	1,271.00	18,175,300
住友不動産	191,400	3,412.00	653,056,800
テーオーシー	20,800	667.00	13,873,600
東京楽天地	2,100	4,360.00	9,156,000
スターツコーポレーション	15,600	2,658.00	41,464,800
フジ住宅	16,500	653.00	10,774,500
空港施設	14,900	528.00	7,867,200
明和地所	7,200	629.00	4,528,800
ゴールドクレスト	10,700	1,708.00	18,275,600
エスリード	5,600	1,826.00	10,225,600
日神グループホールディングス	19,600	435.00	8,526,000
日本エスコン	23,700	845.00	20,026,500
MIRARTHホールディングス	53,400	378.00	20,185,200
AVANTIA	6,800	787.00	5,351,600
イオンモール	55,400	1,710.00	94,734,000
毎日コムネット	5,500	704.00	3,872,000
ファースト住建	5,400	997.00	5,383,800
カチタス	28,800	3,155.00	90,864,000
トーセイ	18,400	1,410.00	25,944,000
穴吹興産	3,100	1,967.00	6,097,700
サンフロンティア不動産	18,600	1,127.00	20,962,200
FJネクストホールディングス	12,300	962.00	11,832,600
インテリックス	2,600	534.00	1,388,400
ランドビジネス	3,900	226.00	881,400

サンネクスタグループ	4,600	974.00	4,480,400
グランディハウス	10,900	555.00	6,049,500
日本空港ビルデング	37,600	6,310.00	237,256,000
明豊ファシリティワークス	5,800	706.00	4,094,800
日本工営	7,900	3,430.00	27,097,000
L I F U L L	38,600	235.00	9,071,000
M I X I	25,200	2,426.00	61,135,200
ジェイエイシーリクルートメント	10,000	2,552.00	25,520,000
日本M&Aセンターホールディングス	189,300	1,817.00	343,958,100
メンバーズ	3,300	2,078.00	6,857,400
中広	2,100	378.00	793,800
UTグループ	16,300	2,441.00	39,788,300
アイティメディア	4,300	1,734.00	7,456,200
E・Jホールディングス	7,300	1,282.00	9,358,600
夢真ビーネックスグループ	40,400	1,806.00	72,962,400
コシダカホールディングス	33,200	1,100.00	36,520,000
アルトナー	2,900	1,013.00	2,937,700
パソナグループ	13,500	1,940.00	26,190,000
C D S	2,900	1,798.00	5,214,200
リンクアンドモチベーション	31,800	711.00	22,609,800
エス・エム・エス	42,000	3,490.00	146,580,000
サニーサイドアップグループ	4,200	580.00	2,436,000
パーソルホールディングス	123,500	3,000.00	370,500,000
リニカル	6,500	668.00	4,342,000
クックパッド	31,200	203.00	6,333,600
アイ・ケイ・ケイホールディングス	5,700	679.00	3,870,300
学情	5,100	1,441.00	7,349,100
スタジオアリス	5,600	2,060.00	11,536,000
シミックホールディングス	6,200	1,669.00	10,347,800
エプコ	2,600	710.00	1,846,000
N J S	2,500	2,043.00	5,107,500
総合警備保障	41,000	3,475.00	142,475,000
カカクコム	82,500	2,233.00	184,222,500
アイロムグループ	4,100	2,257.00	9,253,700
セントケア・ホールディング	7,300	858.00	6,263,400
サイネックス	2,200	551.00	1,212,200
ルネサンス	8,000	877.00	7,016,000
ディップ	19,400	3,805.00	73,817,000
デジタルホールディングス	8,800	1,186.00	10,436,800
新日本科学	11,800	2,239.00	26,420,200
キャリアデザインセンター	2,400	1,659.00	3,981,600
ベネフィット・ワン	51,200	2,104.00	107,724,800

エムスリー	218,000	4,123.00	898,814,000
ツカダ・グローバルホールディング	7,100	381.00	2,705,100
アウトソーシング	65,900	971.00	63,988,900
ウェルネット	10,200	607.00	6,191,400
ワールドホールディングス	5,000	2,779.00	13,895,000
ディー・エヌ・エー	47,100	1,797.00	84,638,700
博報堂DYホールディングス	140,800	1,319.00	185,715,200
ぐるなび	20,800	413.00	8,590,400
タカミヤ	15,500	382.00	5,921,000
ジャパンベストレスキューシステム	6,800	863.00	5,868,400
ファンコミュニケーションズ	22,100	439.00	9,701,900
ライク	4,200	1,990.00	8,358,000
ビジネス・ブレークスルー	4,700	382.00	1,795,400
エスプール	31,900	915.00	29,188,500
WDBホールディングス	5,700	2,209.00	12,591,300
ティア	7,000	420.00	2,940,000
CDG	1,400	1,116.00	1,562,400
アドウェイズ	15,600	515.00	8,034,000
バリューコマース	8,400	1,955.00	16,422,000
インフォマート	115,000	433.00	49,795,000
J Pホールディングス	32,500	274.00	8,905,000
エコナックホールディングス	21,400	92.00	1,968,800
CLホールディングス	3,300	810.00	2,673,000
プレステージ・インターナショナル	46,700	701.00	32,736,700
アミューズ	6,100	1,771.00	10,803,100
ドリームインキュベータ	3,400	2,776.00	9,438,400
クイック	8,500	2,000.00	17,000,000
TAC	6,300	210.00	1,323,000
電通グループ	115,800	4,225.00	489,255,000
イオンファンタジー	4,800	2,966.00	14,236,800
シーティーエス	12,400	842.00	10,440,800
ネクシィーズグループ	3,700	665.00	2,460,500
H.U.グループホールディングス	32,400	2,751.00	89,132,400
アルプス技研	9,700	2,105.00	20,418,500
日本空調サービス	12,100	693.00	8,385,300
オリエンタルランド	116,800	19,595.00	2,288,696,000
ダスキン	24,600	2,960.00	72,816,000
明光ネットワークジャパン	14,800	618.00	9,146,400
ファルコホールディングス	5,100	1,737.00	8,858,700
ラウンドワン	92,600	513.00	47,503,800
リゾートトラスト	43,600	2,407.00	104,945,200
ビー・エム・エル	13,700	3,370.00	46,169,000

りらいあコミュニケーションズ	18,400	1,011.00	18,602,400
リソー教育	50,800	345.00	17,526,000
早稲田アカデミー	6,300	1,105.00	6,961,500
ユー・エス・エス	113,500	2,179.00	247,316,500
東京個別指導学院	13,500	530.00	7,155,000
サイバーエージェント	264,100	1,219.00	321,937,900
楽天グループ	510,500	635.00	324,167,500
クリーク・アンド・リバー社	6,600	1,995.00	13,167,000
モーニングスター	18,400	457.00	8,408,800
テー・オー・ダブリュー	24,300	294.00	7,144,200
山田コンサルティンググループ	5,800	1,146.00	6,646,800
セントラルスポーツ	4,200	2,367.00	9,941,400
フルキャストホールディングス	10,600	2,997.00	31,768,200
エン・ジャパン	20,000	2,289.00	45,780,000
リソルホールディングス	1,100	4,560.00	5,016,000
テクノプロ・ホールディングス	74,000	3,775.00	279,350,000
アトラグループ	2,500	203.00	507,500
インターワークス	3,400	369.00	1,254,600
アイ・アールジャパンホールディングス	5,800	1,817.00	10,538,600
K e e P e r 技研	8,000	4,010.00	32,080,000
ファーストロジック	2,000	829.00	1,658,000
三機サービス	2,200	933.00	2,052,600
G u n o s y	7,100	655.00	4,650,500
デザインワン・ジャパン	4,300	212.00	911,600
イー・ガーディアン	4,300	2,731.00	11,743,300
リブセンス	5,800	301.00	1,745,800
ジャパンマテリアル	33,800	2,399.00	81,086,200
ベクトル	17,500	1,290.00	22,575,000
ウチヤマホールディングス	5,400	277.00	1,495,800
チャーム・ケア・コーポレーション	9,400	1,186.00	11,148,400
キャリアリンク	4,100	3,115.00	12,771,500
I B J	7,000	951.00	6,657,000
アサンテ	5,600	1,600.00	8,960,000
バリューHR	9,700	1,672.00	16,218,400
M & A キャピタルパートナーズ	10,200	4,695.00	47,889,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,100	1,118.00	4,583,800
E R I ホールディングス	3,300	1,102.00	3,636,600
アピスト	1,800	2,905.00	5,229,000
シグマクシス・ホールディングス	16,900	1,316.00	22,240,400
ウィルグループ	9,300	1,288.00	11,978,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	13,000	152.00	1,976,000
メドピア	8,800	1,568.00	13,798,400

レアジョブ	2,300	929.00	2,136,700
リクルートホールディングス	816,700	4,308.00	3,518,343,600
エラン	14,800	976.00	14,444,800
土木管理総合試験所	5,300	310.00	1,643,000
日本郵政	1,445,900	1,043.00	1,508,073,700
ベルシステム24ホールディングス	14,900	1,340.00	19,966,000
鎌倉新書	12,800	995.00	12,736,000
S MN	3,100	489.00	1,515,900
グローバルキッズCOMPANY	2,100	576.00	1,209,600
エアトリ	7,200	2,602.00	18,734,400
アトラエ	8,800	1,422.00	12,513,600
ストライク	5,500	4,655.00	25,602,500
ソラスト	30,700	771.00	23,669,700
セラク	4,100	1,199.00	4,915,900
インソース	13,700	3,005.00	41,168,500
ベйкаレント・コンサルティング	87,400	4,800.00	419,520,000
Orchestra Holdings	2,500	2,006.00	5,015,000
アイモバイル	5,900	1,172.00	6,914,800
キャリアインデックス	4,400	354.00	1,557,600
MS - Japan	3,800	1,007.00	3,826,600
船場	2,100	739.00	1,551,900
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	39,400	1,696.00	66,822,400
フルテック	1,700	1,238.00	2,104,600
GameWith	3,900	367.00	1,431,300
MS&Consulting	1,600	625.00	1,000,000
ウェルビー	8,300	782.00	6,490,600
エル・ティー・エス	1,500	3,155.00	4,732,500
ミダックホールディングス	6,800	2,835.00	19,278,000
日総工産	8,600	588.00	5,056,800
キュービーネットホールディングス	5,900	1,434.00	8,460,600
RPAホールディングス	15,700	276.00	4,333,200
スプリックス	4,000	928.00	3,712,000
マネジメントソリューションズ	6,100	3,565.00	21,746,500
プロレド・パートナーズ	3,100	522.00	1,618,200
テノ・ホールディングス	1,700	547.00	929,900
フロンティア・マネジメント	3,800	1,357.00	5,156,600
ピアラ	2,100	647.00	1,358,700
コプロ・ホールディングス	2,000	1,029.00	2,058,000
ギークス	1,800	850.00	1,530,000
カーブスホールディングス	34,100	945.00	32,224,500
フォーラムエンジニアリング	6,700	863.00	5,782,100
Fast Fitness Japan	3,900	1,209.00	4,715,100

ダイレクトマーケティングミックス	12,800	1,325.00	16,960,000
ポピンズ	1,800	1,610.00	2,898,000
LITALICO	8,700	2,253.00	19,601,100
アドバンテッジリスクマネジメント	5,500	414.00	2,277,000
リログループ	61,500	2,191.00	134,746,500
東祥	7,900	1,143.00	9,029,700
ビーウィズ	3,500	1,140.00	3,990,000
TREホールディングス	23,400	1,453.00	34,000,200
人・夢・技術グループ	5,000	1,971.00	9,855,000
エイチ・アイ・エス	28,900	2,035.00	58,811,500
ラックランド	3,500	2,981.00	10,433,500
共立メンテナンス	18,900	5,800.00	109,620,000
イチネンホールディングス	11,900	1,257.00	14,958,300
建設技術研究所	5,700	3,350.00	19,095,000
スペース	8,200	900.00	7,380,000
燦ホールディングス	5,000	1,796.00	8,980,000
スバル興業	700	9,120.00	6,384,000
東京テアトル	4,100	1,118.00	4,583,800
タナベコンサルティンググループ	4,600	639.00	2,939,400
ナガワ	3,000	7,330.00	21,990,000
東京都競馬	9,300	3,775.00	35,107,500
カナモト	20,300	2,335.00	47,400,500
西尾レントオール	10,300	3,110.00	32,033,000
トランス・コスモス	13,800	3,140.00	43,332,000
乃村工藝社	48,300	945.00	45,643,500
藤田観光	4,900	2,926.00	14,337,400
KNT-CTホールディングス	6,600	1,654.00	10,916,400
日本管財	11,700	2,515.00	29,425,500
トーカイ	9,900	1,938.00	19,186,200
セコム	112,400	8,192.00	920,780,800
セントラル警備保障	6,000	2,351.00	14,106,000
丹青社	21,600	714.00	15,422,400
メイテック	44,100	2,506.00	110,514,600
応用地質	10,800	2,075.00	22,410,000
船井総研ホールディングス	23,300	2,767.00	64,471,100
進学会ホールディングス	4,300	304.00	1,307,200
オオバ	7,300	666.00	4,861,800
いであ	2,600	1,693.00	4,401,800
学究社	4,500	1,764.00	7,938,000
ベネッセホールディングス	41,300	1,963.00	81,071,900
イオンディライト	12,300	2,969.00	36,518,700
ナック	5,100	928.00	4,732,800

ダイセキ	22,600	4,545.00	102,717,000	
ステップ	4,600	1,790.00	8,234,000	
合 計	124,603,700		303,094,875,790	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

【中間財務諸表】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第21期中間計算期間(2022年12月13日から2023年6月12日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【DC日本株式インデックスファンドA】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第20期 (2022年12月12日現在)	第21期中間計算期間 (2023年6月12日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,056,812	4,072,012
親投資信託受益証券	1,490,197,194	1,707,146,106
未収入金	1,445,542	227,318
流動資産合計	1,495,699,548	1,711,445,436
資産合計	1,495,699,548	1,711,445,436
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,562,817	148,472
未払受託者報酬	409,293	423,389
未払委託者報酬	2,783,169	2,878,980
未払利息	11	8
流動負債合計	4,755,290	3,450,849
負債合計	4,755,290	3,450,849
純資産の部		
元本等		
元本	478,081,365	472,917,095
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	1,012,862,893	1,235,077,492
(分配準備積立金)	381,959,629	347,060,112
元本等合計	1,490,944,258	1,707,994,587
純資産合計	1,490,944,258	1,707,994,587
負債純資産合計	1,495,699,548	1,711,445,436

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第20期中間計算期間 自 2021年12月11日 至 2022年 6月10日	第21期中間計算期間 自 2022年12月13日 至 2023年 6月12日
営業収益		
受取利息	3	3
有価証券売買等損益	3,617,827	240,174,360
営業収益合計	3,617,824	240,174,363
営業費用		
支払利息	353	519
受託者報酬	398,638	423,389
委託者報酬	2,710,683	2,878,980
営業費用合計	3,109,674	3,302,888
営業利益又は営業損失（ ）	6,727,498	236,871,475
経常利益又は経常損失（ ）	6,727,498	236,871,475
中間純利益又は中間純損失（ ）	6,727,498	236,871,475
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,997,284	9,188,319
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,011,408,488	1,012,862,893
剰余金増加額又は欠損金減少額	82,030,332	92,221,478
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	82,030,332	92,221,478
剰余金減少額又は欠損金増加額	91,537,880	97,690,035
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	91,537,880	97,690,035
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	998,170,726	1,235,077,492

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第21期中間計算期間は2022年12月13日から2023年 6月12日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第20期 (2022年12月12日現在)	第21期中間計算期間 (2023年 6月12日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	478,081,365口	472,917,095口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.1186円 (31,186円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.6116円 (36,116円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第21期中間計算期間 (2023年 6月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

	第21期中間計算期間 (2023年 6月12日現在)
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第20期 自 2021年12月11日 至 2022年12月12日	第21期中間計算期間 自 2022年12月13日 至 2023年 6月12日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	486,628,278円	478,081,365円
期中追加設定元本額	73,704,889円	41,000,056円
期中一部解約元本額	82,251,802円	46,164,326円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2023年 6月12日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	

	2023年 6月12日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	2,695,615,923
株式	347,819,937,808
派生商品評価勘定	58,735,350
未収入金	1,403,700
未収配当金	2,654,191,267
差入委託証拠金	244,488,000
流動資産合計	353,474,372,048
資産合計	353,474,372,048
負債の部	
流動負債	
前受金	58,737,000
未払解約金	220,578,577
未払利息	5,484
流動負債合計	279,321,061
負債合計	279,321,061
純資産の部	
元本等	
元本	134,033,097,855
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	219,161,953,132
元本等合計	353,195,050,987
純資産合計	353,195,050,987
負債純資産合計	353,474,372,048

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 6月12日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

	2023年 6月12日現在

（貸借対照表に関する注記）

	2023年 6月12日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	134,033,097,855口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.6351円 (1万口当たり純資産額) (26,351円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 6月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 6月12日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年12月13日
期首元本額	134,534,227,972円
期中追加設定元本額	5,812,169,076円
期中一部解約元本額	6,313,299,193円
期末元本額	134,033,097,855円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	590,452,046円
DC日本株式インデックスファンド	281,297,230円
DC日本株式インデックスファンドL	53,838,936,893円
DC日本株式インデックスファンドA	647,848,699円
DCバランスファンド30	2,334,100,886円
DCバランスファンド50	3,578,598,620円
DCバランスファンド70	2,366,946,076円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	555,160,460円
日本株式インデックスe	1,420,386,302円
インデックスコレクション（国内株式）	22,463,992,475円
インデックスコレクション（バランス株式30）	12,406,347,239円
インデックスコレクション（バランス株式50）	3,623,097,294円
インデックスコレクション（バランス株式70）	3,360,926,924円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,785,675,507円
日本株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	2,712,321,272円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	681,687,562円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	31,059,090円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	388,280,870円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	49,172,157円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	115,604,719円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	38,833,262円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	511,597,152円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	353,351,436円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	6,132,265,266円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	594,978,112円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	49,820,182円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	977,507,882円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	19,076,923円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	124,040,444円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,577,928,682円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	41,133,450円

区分	2023年 6月12日現在
V A バランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	45,486,284円
V A ファンド 2 5（適格機関投資家専用）	13,917,315円
バランスファンド V A 2（適格機関投資家専用）	463,844,265円
バランス V A 2 5 L（適格機関投資家専用）	231,140,512円
バランスファンド V A 3（適格機関投資家専用）	3,430,599,057円
世界バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	70,762,269円
国内バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	24,668,572円
国内バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	6,995,371円
V A バランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	90,609,531円
私募日本株式インデックスファンド A L（適格機関投資家専用）	2,649,567円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 6月12日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,174,673,000	-	5,233,410,000	58,737,000
	合計	5,174,673,000	-	5,233,410,000	58,737,000

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

2【ファンドの現況】

【DC日本株式インデックスファンドA】

【純資産額計算書】

(2023年 6月30日現在)

資産総額	1,776,949,520円
負債総額	1,535,061円
純資産総額（ - ）	1,775,414,459円
発行済口数	480,370,919口
1口当たり純資産額（ / ）	3.6959円
（1万口当たり純資産額）	（36,959円）

(参考)

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

(2023年 6月30日現在)

資産総額	357,686,862,126円
負債総額	154,563,733円
純資産総額（ - ）	357,532,298,393円
発行済口数	132,555,667,646口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6972円
（1万口当たり純資産額）	（26,972円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

委託会社は、当ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合又は当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行し

ません。

受益権の譲渡

- イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載又は記録するものとします。ただし、上記イ．の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとします。
- ハ．上記イ．の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載又は記録によらなければ、委託会社及び受託会社に対抗することができません。

受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載又は記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2023年6月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[DO（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

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

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

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

委託会社の機構は2023年 9月12日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年6月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	529	14,273,967
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	66	203,577
単位型公社債投資信託	52	170,590
合計	647	14,648,134

3【委託会社等の経理状況】

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

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

		(単位:百万円)	
		前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部			
流動資産			
現金及び預金		21,675	23,067
金銭の信託		14,913	14,693
前払費用		166	198
未収委託者報酬		9,067	9,147
未収運用受託報酬		6,252	5,815
未収収益		179	176
短期差入証拠金		2,528	3,541
その他		2,363	1,566
流動資産合計		57,146	58,207
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	289	255
器具備品	1	687	560
有形固定資産合計		976	816
無形固定資産			
ソフトウェア		6,292	7,203
その他		31	40
無形固定資産合計		6,324	7,244
投資その他の資産			
投資有価証券		6,607	4,063
関係会社株式		5,636	5,636
繰延税金資産		907	1,181
その他		31	31
投資その他の資産合計		13,182	10,911
固定資産合計		20,482	18,972
資産合計		77,629	77,179

		(単位:百万円)	
		前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部			

流動負債		
預り金	47	49
未払金	8,285	7,174
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,561	4,586
その他未払金	3,723	2,588
未払費用	1,049	1,089
未払法人税等	504	726
賞与引当金	578	613
その他	1,958	303
流動負債合計	12,423	9,958
固定負債		
退職給付引当金	820	904
資産除去債務	153	153
その他	12	27
固定負債合計	986	1,086
負債合計	13,410	11,044
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	500	500
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	41,948	44,755
利益剰余金合計	44,548	47,355
株主資本合計	63,788	66,595
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	941	49
繰延ヘッジ損益	509	510
評価・換算差額等合計	431	460
純資産合計	64,219	66,134
負債・純資産合計	77,629	77,179

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

前事業年度

当事業年度

（自 2021年4月1日
至 2022年3月31日）（自 2022年4月1日
至 2023年3月31日）

営業収益		
委託者報酬	41,730	40,724
運用受託報酬	11,883	10,918
その他営業収益	390	351
営業収益合計	54,004	51,993
営業費用		
支払手数料	20,567	20,123
広告宣伝費	286	307
公告費	-	2
調査費	5,567	5,309
調査費	1,062	1,104
委託調査費	4,487	4,191
図書費	17	13
営業雑経費	5,201	5,842
通信費	68	77
印刷費	454	419
協会費	55	58
諸会費	35	38
情報機器関連費	4,473	5,153
その他営業雑経費	112	94
営業費用合計	31,622	31,585
一般管理費		
給料	6,295	6,451
役員報酬	249	318
給料・手当	5,072	5,144
賞与	972	987
退職給付費用	254	252
福利費	632	671
交際費	3	7
旅費交通費	20	122
租税公課	327	289
不動産賃借料	323	327
寄付金	5	-
減価償却費	989	1,698
業務委託費	1,081	1,277
諸経費	1,301	1,454
一般管理費合計	11,234	12,553
営業利益	11,147	7,854

（単位：百万円）

	前事業年度 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	当事業年度 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
営業外収益		

受取利息	2	57
収益分配金	16	4
投資有価証券売却益	0	738
投資有価証券償還益	219	121
デリバティブ利益	-	565
その他	8	11
営業外収益合計	247	1,499
営業外費用		
金銭の信託運用損	332	158
投資有価証券売却損	0	16
為替差損	291	1,227
デリバティブ費用	1,191	-
その他	33	32
営業外費用合計	1,848	1,435
経常利益	9,545	7,918
特別損失		
退職給付費用	120	-
特別損失合計	120	-
税引前当期純利益	9,425	7,918
法人税、住民税及び事業税	3,403	2,350
法人税等調整額	465	119
法人税等合計	2,937	2,470
当期純利益	6,487	5,448

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797

当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	791	65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	444	295	295
当期変動額合計	149	444	295	3,394
当期末残高	941	509	431	64,219

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
剰余金の配当			2,641	2,641	2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	941	509	431	64,219
当期変動額				
剰余金の配当				2,641

当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	891	0	891	891
当期変動額合計	891	0	891	1,915
当期末残高	49	510	460	66,134

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

（2）無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

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

（2）退職給付引当金

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

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

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

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

7．収益及び費用の計上基準

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

（1）投資信託委託業務

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

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

8. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

9. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

(会計方針の変更)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる財務諸表への影響はありません。

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-3項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

(表示方法の変更)

(貸借対照表関係)

前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた4,891百万円は、「短期差入証拠金」2,528百万円、「その他」2,363百万円として組み替えております。

(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 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023年3月31日)	
建 物	146	百万円	184	百万円
器具備品	535	"	681	"
計	681	"	866	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	3,000	-	-	3,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2023年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	配当金の原資	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月22日 定時株主総会	普通株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

(リ - ス取引関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、資金運用については、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針8．ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリ毎に管理しております。

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

（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。

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資

金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（（１）*2、*3及び（注2）参照）。

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

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

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

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

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

（１）時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2022年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1、*2）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*3)	-	196	-	196
資産計	-	196	-	196
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(1,333)	(80)	-	(1,413)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(71)	-	(71)
デリバティブ取引計	(1,333)	(151)	-	(1,485)

(*1) 負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

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

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

当事業年度（2023年3月31日）

区 分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	-	13,733
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	-	3,844	-	3,844
資産計	1,029	16,547	-	17,577
デリバティブ取引(*4)				
ヘッジ会計が適用されていないもの	(10)	(48)	-	(58)
ヘッジ会計が適用されているもの	-	(88)	-	(88)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	-	(147)

(*1) 負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

(*2) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額は960百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,693百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額218百万円）は上記に含めておりません。

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

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2022年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,675	-	-	-
未収委託者報酬	9,067	-	-	-
未収運用受託報酬	6,252	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	108	1,712	0

当事業年度(2023年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	23,067	-	-	-
未収委託者報酬	9,147	-	-	-
未収運用受託報酬	5,815	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	594	2,144	38

(有価証券関係)

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
子会社株式	5,636	5,636

2. その他有価証券

前事業年度（2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（2023年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	292
小計	2,857	3,150	292
合計	3,844	3,772	71

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

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非上場株式	0	0
組合出資金等	133	218

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	3,429	738	16

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）通貨関連

前事業年度（2022年3月31日）

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,498	-	54	54
	英ポンド	277	-	1	1
	カナダドル	111	-	1	1
	スイスフラン	139	-	2	2
	香港ドル	190	-	1	1
	ユーロ	676	-	18	18
	買建				
	ユーロ	21	-	0	0
	合計	6,915	-	80	80

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2023年3月31日）

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,923	-	21	21
	英ポンド	256	-	6	6
	カナダドル	109	-	1	1
	スイスフラン	163	-	2	2
	香港ドル	202	-	0	0
	ユーロ	651	-	19	19
	買建				
	米ドル	152	-	3	3
	合計	7,458	-	48	48

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

（2）株式関連

前事業年度（2022年3月31日）

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	17,197	-	1,333	1,333
合計		17,197	-	1,333	1,333

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

当事業年度（2023年3月31日）

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	12,195	-	9	9
	債券先物取引 売建	182	-	0	0
合計		12,378	-	10	10

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度（2022年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		4,422	-	43
	英ポンド		3,297	-	21
	スイスフラン		79	-	1
	香港ドル		119	-	1
	ユーロ		125	-	3
	人民元		13	-	0
合計			8,057	-	71

当事業年度（2023年3月31日）

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,729	-	6
	英ポンド		3,228	-	81
	スイスフラン		20	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ	21	-	0	
合計			5,082	-	88

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	626	820

退職給付債務の期首残高

626

820

勤務費用	124	133
利息費用	2	3
数理計算上の差異の発生額	-	6
退職給付の支払額	81	57
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	-
その他	18	-
退職給付債務の期末残高	820	911

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表
該当事項はありません。

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	820	911
未認識数理計算上の差異	-	6
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904
退職給付引当金	820	904
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	120	-
その他	18	-
確定給付制度に係る退職給付費用	274	142

(5) 年金資産に関する事項
該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.4%	0.4%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度100百万円、当事業年度109百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	112 百万円	58 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	177 "	187 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	251 "	277 "
税務上の収益認識差額	74 "	- "
税務上の費用認識差額	439	412
繰延ヘッジ損益	224 "	225 "

その他	76	"	75	"
繰延税金資産 合計	1,357	"	1,236	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	415	"	21	"
その他	34	"	32	"
繰延税金負債 合計	450	"	54	"
繰延税金資産の純額	907	"	1,181	"

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第42号 2021年8月12日)に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において

存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	10,395百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,395百万円

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	10,090	未収運用受託報酬	5,421
							投信販売 代行手数料等	9,701	未払手数料	1,995

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（％）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引 役員の兼任	運用受託報酬	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売 代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2022年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2023年3月31日）

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	21,406,512円22銭	22,044,962円63銭
1株当たり当期純利益金額	2,162,405円20銭	1,816,227円49銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3) 通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4) 親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5) その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

2023年9月12日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2023年3月末日現在）

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

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2023年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2023年3月末日現在）

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

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

第3【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

- (5) 目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6) 交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットやSNSのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）、名称や利用上の注意事項等を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9) 目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10) 有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2023年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 藤 澤 孝

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年2月20日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 後藤知弘
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックスファンドAの2021年12月11日から2022年12月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC日本株式インデックスファンドAの2022年12月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年8月24日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックスファンドAの2022年12月13日から2023年6月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DC日本株式インデックスファンドAの2023年6月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年12月13日から2023年6月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。