

【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10月23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
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DC日本株式インデックスファンド

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

2023年10月24日から2024年 4月22日までとします。

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

（ 8 ） 【 申込取扱場所 】

下記の照会先にお問い合わせください。

（ 照会先 ）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（ 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 ）

（ 9 ） 【 払込期日 】

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

（ 10 ） 【 払込取扱場所 】

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

（ 11 ） 【 振替機関に関する事項 】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ） 【 その他 】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

(1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われ

ないファンドをいう。

- (2)追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

(4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

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。

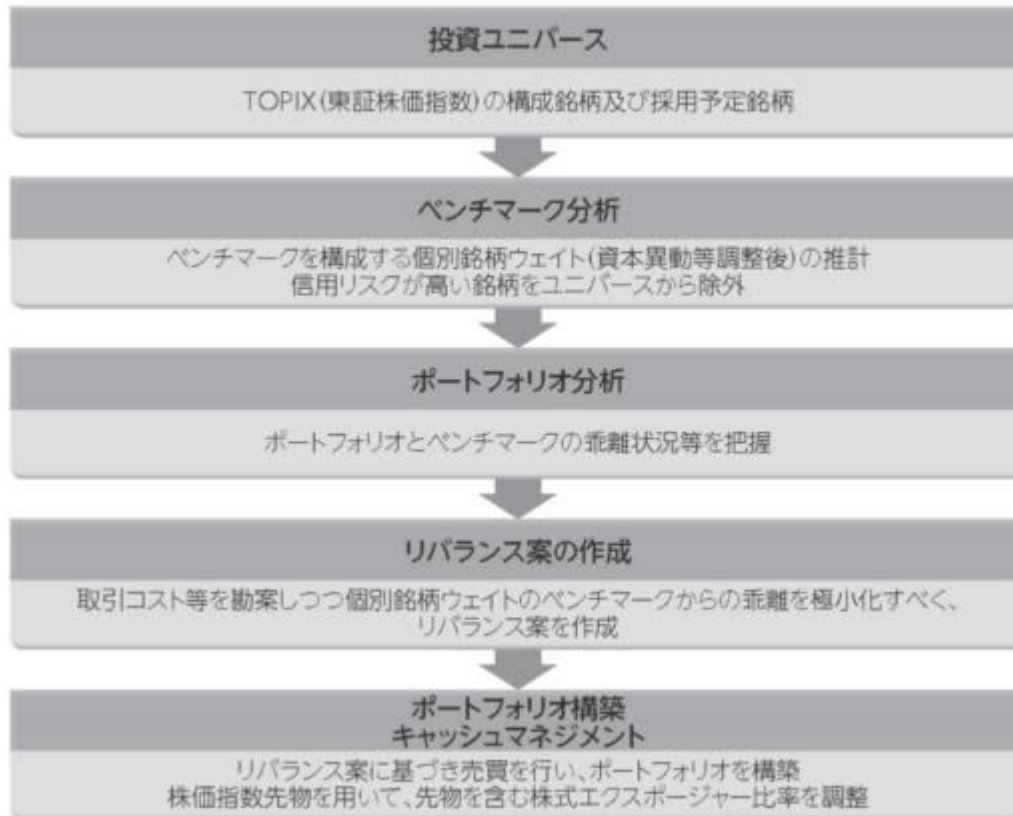
TOPIX(東証株価指数)とは

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。

TOPIX(東証株価指数)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。

マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

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



分配方針

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

主な投資制限

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

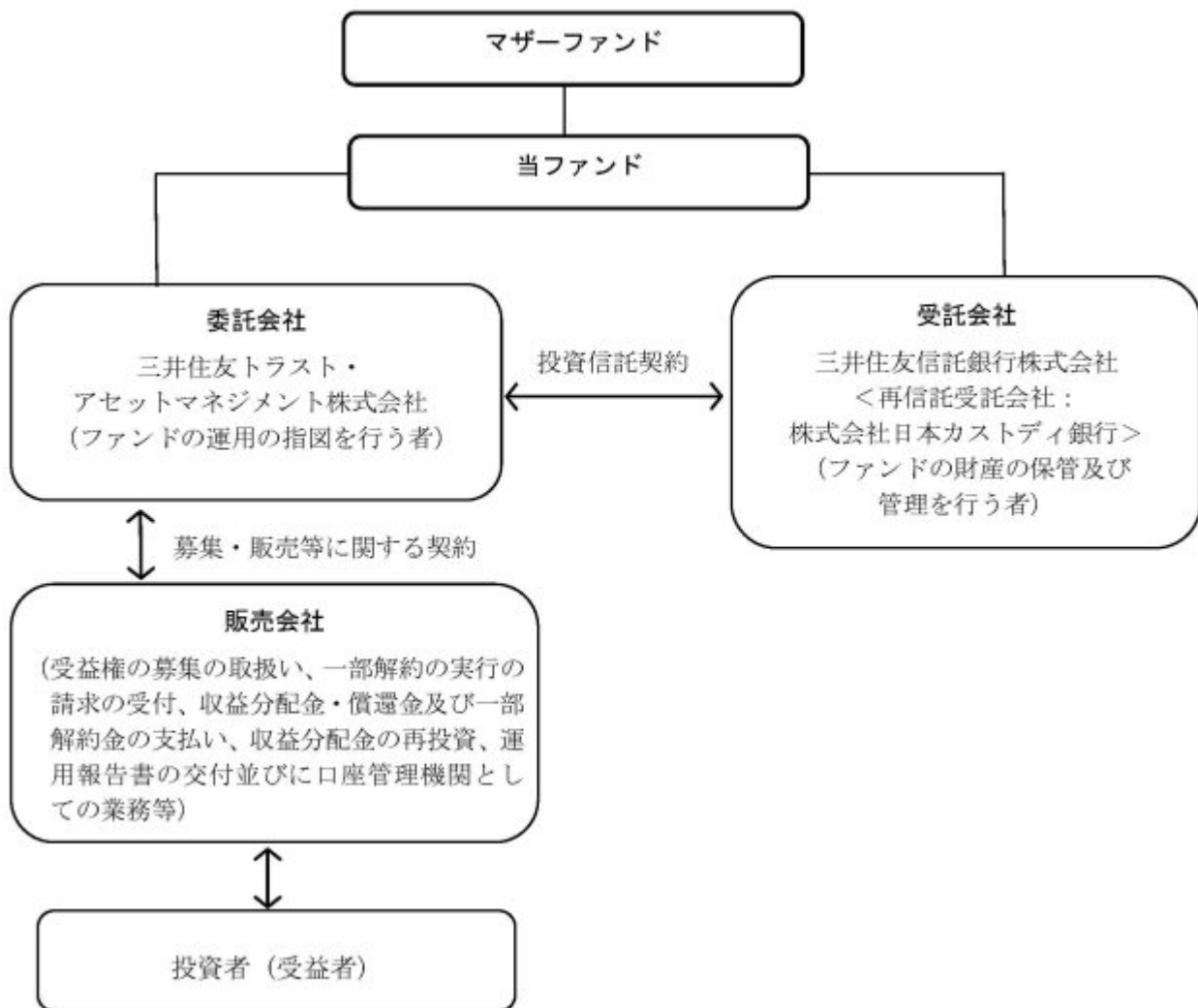
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2002年1月25日	信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始
2012年4月1日	当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継 当ファンドの名称を中央三井DC日本株式インデックスファンドからDC日本株式インデックスファンドに変更 当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンドに変更

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2023年 8月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

運用方針

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

投資態度

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

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- A．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - 1．有価証券
 - 2．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条、第24条及び第25条に定めるものに限りません。）
 - 3．金銭債権（上記1．、2．及び下記4．に掲げるものに該当するものを除きます。）
 - 4．約束手形（上記1．に掲げるものに該当するものを除きます。）
- B．次に掲げる特定資産以外の資産
 - 1．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「日本株式マザーファンド」の

受益証券及び次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）（本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

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

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

運用指図できる金融商品

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

1. 預金

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

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

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2．運用方法

（1）投資対象

わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所では有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場している株式を主要投資対象とします。

（2）投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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。

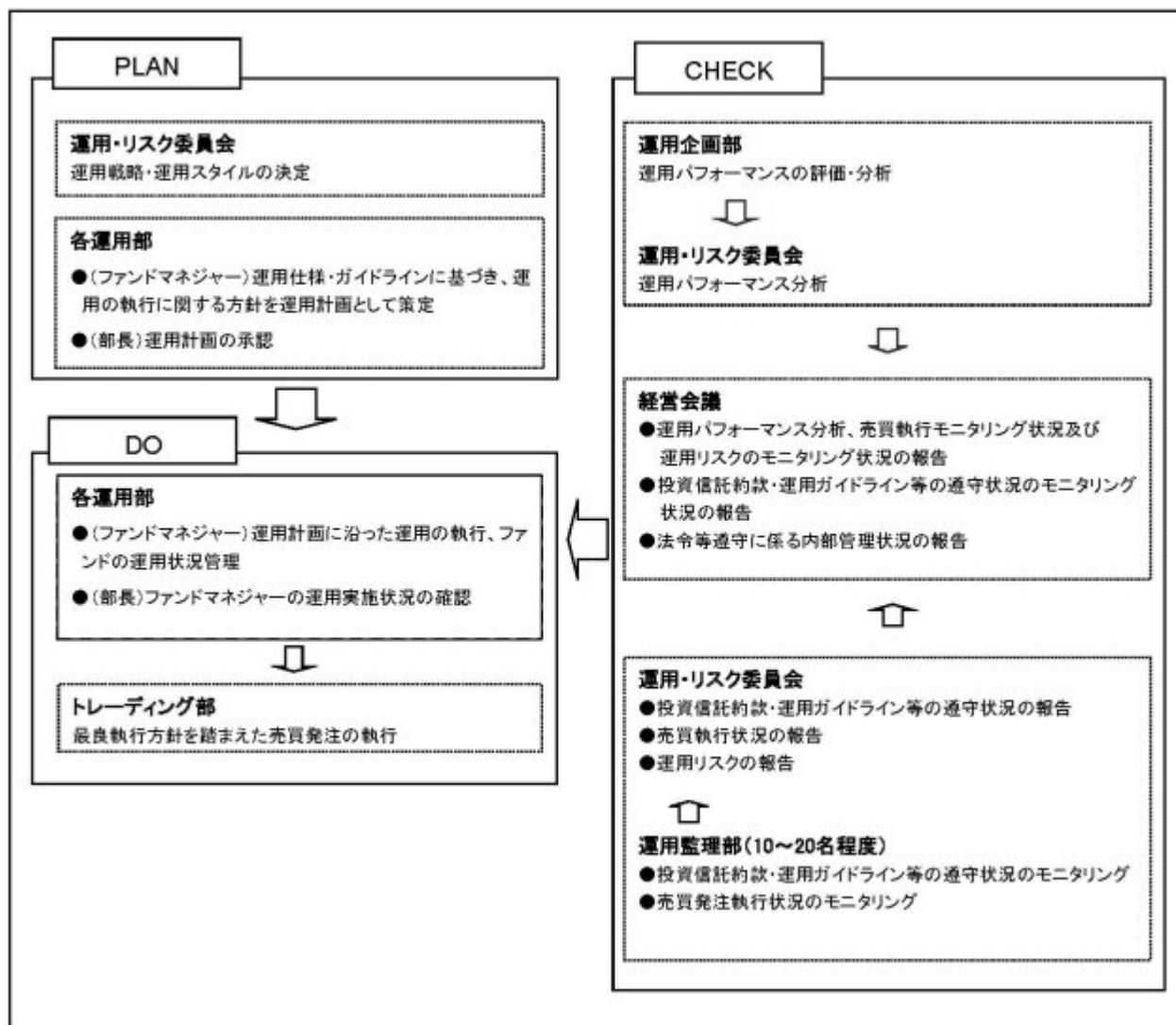
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

A．株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

C．新株引受権証券等への投資割合

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

D．投資信託証券への投資割合

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

E．同一銘柄の株式への投資割合

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

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

G．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

H．投資する株式等の範囲

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

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

I．信用取引の指図範囲

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

ロ．上記イ．の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純

資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

J．先物取引等の運用指図

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

ロ．委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

K．スワップ取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

L．金利先渡取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、金利先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

M．有価証券の貸付の指図及び範囲

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

a．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

b．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．a．及びb．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

N．公社債の空売りの指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算において信託財産に属さない公社債を売付けるとの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

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

のつど別にこれを定めます。

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

< その他の留意点 >

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

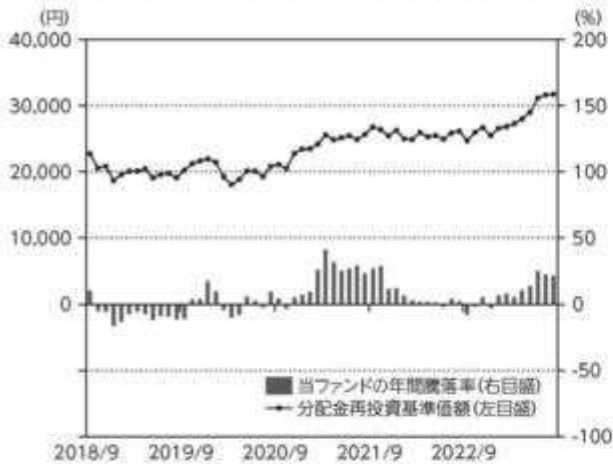
（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

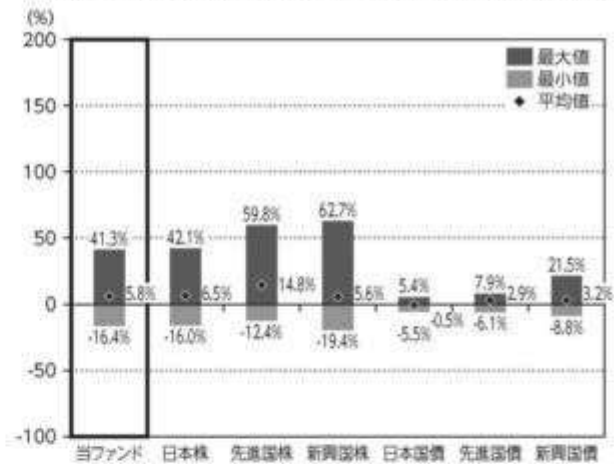
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2018年9月～2023年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数) (配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPX協研が算出、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、投資対象としての可能性を有するマーケットベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。(配当込み)指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る権限又は商標は、株式会社JPX協研又は株式会社JPX協研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利(ノウハウ及び同指数に係る権限又は商標)に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、差支又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村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認定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の購入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、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの機関、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、誤集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権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 Global Emerging Markets Bond Index (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ません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

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

（３）【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.2035%（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 8月31日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

（参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.61%	0.61%	0.00%

※対象期間は2022年1月25日～2023年1月23日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。

※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

以下は、2023年8月31日現在の状況について記載してあります。

【DC日本株式インデックスファンド】

（１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	761,475,864	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		377,894	0.05
合計(純資産総額)		761,853,758	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	276,970,816	2.2745	629,970,121	2.7493	761,475,864	99.95

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第12期計算期間末	(2014年 1月22日)	450,716,817	450,716,817	15,048	15,048
第13期計算期間末	(2015年 1月22日)	469,174,845	469,174,845	16,330	16,330
第14期計算期間末	(2016年 1月22日)	458,945,200	458,945,200	16,379	16,379
第15期計算期間末	(2017年 1月23日)	516,320,280	516,320,280	18,348	18,348
第16期計算期間末	(2018年 1月22日)	671,479,746	671,479,746	23,282	23,282
第17期計算期間末	(2019年 1月22日)	555,028,301	555,028,301	19,471	19,471

第18期計算期間末	(2020年 1月22日)	593,005,814	593,005,814	22,238	22,238
第19期計算期間末	(2021年 1月22日)	646,584,760	646,584,760	24,119	24,119
第20期計算期間末	(2022年 1月24日)	664,869,350	664,869,350	25,453	25,453
第21期計算期間末	(2023年 1月23日)	642,479,034	642,479,034	26,197	26,197
	2022年 8月末日	646,056,498		26,165	
	9月末日	605,462,491		24,719	
	10月末日	635,824,370		25,966	
	11月末日	652,669,162		26,716	
	12月末日	624,035,708		25,485	
	2023年 1月末日	652,142,524		26,598	
	2月末日	659,119,378		26,838	
	3月末日	671,606,808		27,282	
	4月末日	686,278,719		28,005	
	5月末日	705,839,273		29,001	
	6月末日	751,139,188		31,176	
	7月末日	766,405,334		31,627	
	8月末日	761,853,758		31,745	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第12期計算期間	2013年 1月23日～2014年 1月22日	0
第13期計算期間	2014年 1月23日～2015年 1月22日	0
第14期計算期間	2015年 1月23日～2016年 1月22日	0
第15期計算期間	2016年 1月23日～2017年 1月23日	0
第16期計算期間	2017年 1月24日～2018年 1月22日	0
第17期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月22日	0
第18期計算期間	2019年 1月23日～2020年 1月22日	0
第19期計算期間	2020年 1月23日～2021年 1月22日	0
第20期計算期間	2021年 1月23日～2022年 1月24日	0
第21期計算期間	2022年 1月25日～2023年 1月23日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第12期計算期間	2013年 1月23日～2014年 1月22日	46.3
第13期計算期間	2014年 1月23日～2015年 1月22日	8.5
第14期計算期間	2015年 1月23日～2016年 1月22日	0.3
第15期計算期間	2016年 1月23日～2017年 1月23日	12.0
第16期計算期間	2017年 1月24日～2018年 1月22日	26.9
第17期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月22日	16.4

第18期計算期間	2019年 1月23日～2020年 1月22日	14.2
第19期計算期間	2020年 1月23日～2021年 1月22日	8.5
第20期計算期間	2021年 1月23日～2022年 1月24日	5.5
第21期計算期間	2022年 1月25日～2023年 1月23日	2.9
第22期中間計算期間	2023年 1月24日～2023年 7月23日	17.6

(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12期計算期間	2013年 1月23日～2014年 1月22日	86,542,453	91,200,205	299,518,108
第13期計算期間	2014年 1月23日～2015年 1月22日	68,722,554	80,938,767	287,301,895
第14期計算期間	2015年 1月23日～2016年 1月22日	65,174,696	72,268,642	280,207,949
第15期計算期間	2016年 1月23日～2017年 1月23日	50,222,504	49,029,004	281,401,449
第16期計算期間	2017年 1月24日～2018年 1月22日	42,547,977	35,534,313	288,415,113
第17期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月22日	57,375,711	60,736,637	285,054,187
第18期計算期間	2019年 1月23日～2020年 1月22日	35,270,298	53,663,276	266,661,209
第19期計算期間	2020年 1月23日～2021年 1月22日	57,380,336	55,962,546	268,078,999
第20期計算期間	2021年 1月23日～2022年 1月24日	36,855,417	43,720,133	261,214,283
第21期計算期間	2022年 1月25日～2023年 1月23日	26,291,817	42,261,376	245,244,724
第22期中間計算期間	2023年 1月24日～2023年 7月23日	15,954,020	20,461,782	240,736,962

(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	361,582,258,990	99.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,450,799,295	0.67
合計(純資産総額)		364,033,058,285	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	2,027,535,000	0.56

(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	5,988,200	1,895.39	11,350,021,192	2,515.00	15,060,323,000	4.14
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	771,400	11,485.51	8,859,928,928	12,145.00	9,368,653,000	2.57
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,726,600	938.28	6,311,471,150	1,163.50	7,826,399,100	2.15
日本	株式	キーエンス	電気機器	109,100	58,523.09	6,384,870,076	60,520.00	6,602,732,000	1.81
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	35,037,600	153.47	5,377,402,223	168.30	5,896,828,080	1.62
日本	株式	日立製作所	電気機器	535,600	6,757.84	3,619,504,206	9,694.00	5,192,106,400	1.43
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	763,400	5,530.39	4,221,905,850	6,681.00	5,100,275,400	1.40
日本	株式	三菱商事	卸売業	703,500	4,400.77	3,095,948,122	7,196.00	5,062,386,000	1.39
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	230,800	15,276.76	3,525,876,355	21,575.00	4,979,510,000	1.37
日本	株式	三井物産	卸売業	818,900	3,882.48	3,179,364,021	5,432.00	4,448,264,800	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	968,000	4,204.50	4,069,959,657	4,508.00	4,363,744,000	1.20
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	830,000	4,209.42	3,493,823,292	5,220.00	4,332,600,000	1.19
日本	株式	任天堂	その他製品	688,500	5,547.89	3,819,728,332	6,267.00	4,314,829,500	1.19
日本	株式	信越化学工業	化学	908,000	3,453.26	3,135,565,447	4,659.00	4,230,372,000	1.16
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	886,500	3,116.52	2,762,800,625	4,703.00	4,169,209,500	1.15
日本	株式	第一三共	医薬品	952,800	4,276.77	4,074,908,581	4,299.00	4,096,087,200	1.13
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	711,000	4,152.54	2,952,456,826	5,472.00	3,890,592,000	1.07
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,553,300	1,996.43	3,101,059,230	2,410.00	3,743,453,000	1.03
日本	株式	HOYA	精密機器	231,000	13,735.15	3,172,820,742	16,155.00	3,731,805,000	1.03
日本	株式	KDDI	情報・通信業	845,200	4,026.87	3,403,516,033	4,325.00	3,655,490,000	1.00
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	539,500	5,990.41	3,231,828,933	6,545.00	3,531,027,500	0.97
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,061,700	2,726.82	2,895,064,981	3,227.00	3,426,105,900	0.94
日本	株式	ダイキン工業	機械	131,500	22,333.11	2,936,803,978	25,225.00	3,317,087,500	0.91
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	593,300	4,109.76	2,438,323,016	5,249.00	3,114,231,700	0.86
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,757,900	1,480.52	2,602,608,905	1,670.00	2,935,693,000	0.81

日本	株式	村田製作所	電気機器	330,800	7,480.43	2,474,529,417	8,185.00	2,707,598,000	0.74
日本	株式	S M C	機械	35,700	62,945.32	2,247,147,992	70,600.00	2,520,420,000	0.69
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	397,700	6,048.42	2,405,457,101	5,981.00	2,378,643,700	0.65
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,033,200	1,954.95	2,019,862,269	2,214.50	2,288,021,400	0.63
日本	株式	デンソー	輸送用機器	224,900	6,802.98	1,529,990,906	9,959.00	2,239,779,100	0.62

(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	0.09
		鉱業	0.36
		建設業	2.09
		食料品	3.36
		繊維製品	0.41
		パルプ・紙	0.17
		化学	5.93
		医薬品	5.10
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.68
		ガラス・土石製品	0.68
		鉄鋼	0.98
		非鉄金属	0.66
		金属製品	0.51
		機械	5.47
		電気機器	17.19
		輸送用機器	8.30
		精密機器	2.38
		その他製品	2.27
		電気・ガス業	1.37
		陸運業	2.95
		海運業	0.66
		空運業	0.49
		倉庫・運輸関連業	0.14
		情報・通信業	8.05
		卸売業	6.79
		小売業	4.36
銀行業	6.53		
証券、商品先物取引業	0.73		
保険業	2.24		

	その他金融業	1.15
	不動産業	1.88
	サービス業	4.88
	小計	99.33
合計		99.33

(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	87円		1,971,389,350	2,027,535,000	0.56

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

 当初設定日：2002年1月25日
 作成基準日：2023年8月31日
基準価額・純資産の推移

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	31,745円
------	---------

純資産総額	7.62億円
-------	--------

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

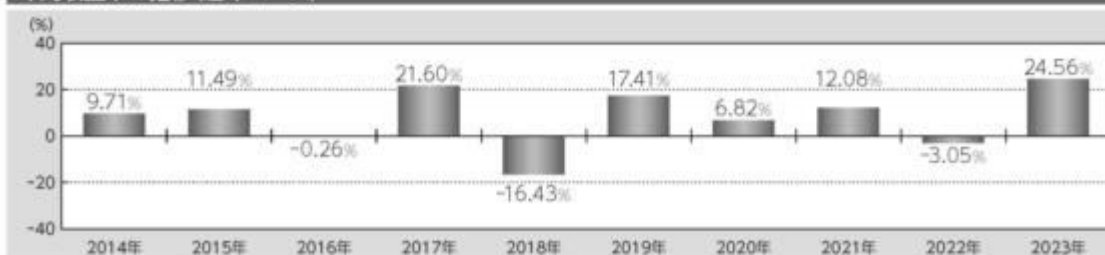
決算期	分配金
2019年1月	0円
2020年1月	0円
2021年1月	0円
2022年1月	0円
2023年1月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	4.1%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.6%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	2.1%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.8%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.6%
日立製作所	日本	株式	電気機器	1.4%
三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.4%
三菱商事	日本	株式	卸売業	1.4%
東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	1.4%
三井物産	日本	株式	卸売業	1.2%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※2023年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

第2【管理及び運営】**1【申込（販売）手続等】**

< 申込手続 >

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

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< 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 1月25日設定）

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

（４）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年1月23日から翌年1月22日までとすることを原則とします。

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

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

（５）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうち、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5億口を下回ることとなった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

す。

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1) 投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務

に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き＞に従い、新受託会社を選任します。

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3) 換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4) 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第21期計算期間(2022年1月25日から2023年1月23日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DC日本株式インデックスファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第20期 (2022年 1月24日現在)	第21期 (2023年 1月23日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,680,594	2,193,717
親投資信託受益証券	664,537,394	642,160,853
未収入金	1,580,194	56,657
流動資産合計	668,798,182	644,411,227
資産合計	668,798,182	644,411,227
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,786,112	-
未払受託者報酬	272,718	245,921
未払委託者報酬	1,869,999	1,686,272
未払利息	3	-
流動負債合計	3,928,832	1,932,193
負債合計	3,928,832	1,932,193
純資産の部		
元本等		
元本	261,214,283	245,244,724
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	403,655,067	397,234,310
(分配準備積立金)	187,375,572	176,696,676
元本等合計	664,869,350	642,479,034
純資産合計	664,869,350	642,479,034
負債純資産合計	668,798,182	644,411,227

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第20期		第21期	
	自 2021年 1月23日	至 2022年 1月24日	自 2022年 1月25日	至 2023年 1月23日
営業収益				
受取利息		6		4
有価証券売買等損益		39,733,154		21,706,587
営業収益合計		39,733,160		21,706,591
営業費用				
支払利息		567		508
受託者報酬		530,055		493,588
委託者報酬		3,634,515		3,384,475
営業費用合計		4,165,137		3,878,571
営業利益又は営業損失（ ）		35,568,023		17,828,020
経常利益又は経常損失（ ）		35,568,023		17,828,020
当期純利益又は当期純損失（ ）		35,568,023		17,828,020
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（ ）		6,293,950		103,354
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		378,505,761		403,655,067
剰余金増加額又は欠損金減少額		57,839,846		40,735,964
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		57,839,846		40,735,964
剰余金減少額又は欠損金増加額		61,964,613		65,088,095
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		61,964,613		65,088,095
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		403,655,067		397,234,310

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年1月23日から翌年1月22日までとなっておりますが、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、第21期計算期間は2022年 1月25日から2023年 1月23日までとなっております。

（ 貸借対照表に関する注記 ）

	第20期 (2022年 1月24日現在)	第21期 (2023年 1月23日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	261,214,283口	245,244,724口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.5453円 (25,453円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.6197円 (26,197円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第20期 自 2021年 1月23日 至 2022年 1月24日			第21期 自 2022年 1月25日 至 2023年 1月23日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	12,611,113円	費用控除後の配当等収益額	A	13,764,513円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	16,662,960円	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	4,166,861円
収益調整金額	C	401,583,080円	収益調整金額	C	394,540,553円
分配準備積立金額	D	158,101,499円	分配準備積立金額	D	158,765,302円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	588,958,652円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	571,237,229円
当ファンドの期末残存口数	F	261,214,283口	当ファンドの期末残存口数	F	245,244,724口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	22,546円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	23,292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21期 自 2022年 1月25日 至 2023年 1月23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21期 (2023年 1月23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20期	第21期
	自 2021年 1月23日 至 2022年 1月24日	自 2022年 1月25日 至 2023年 1月23日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	268,078,999円	261,214,283円
期中追加設定元本額	36,855,417円	26,291,817円
期中一部解約元本額	43,720,133円	42,261,376円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第20期 (2022年 1月24日現在)	第21期 (2023年 1月23日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
親投資信託受益証券	34,794,604	22,272,787
合計	34,794,604	22,272,787

（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	284,091,689	642,160,853	
合計		284,091,689	642,160,853	

(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

	2023年 1月23日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,280,066,123
株式	302,759,682,290
派生商品評価勘定	59,887,350
未収入金	2,035,600
未収配当金	516,459,916
差入委託証拠金	126,975,000
流動資産合計	305,745,106,279
資産合計	305,745,106,279
負債の部	
流動負債	
前受金	59,902,200
未払解約金	290,897,071
未払利息	845
流動負債合計	350,800,116
負債合計	350,800,116
純資産の部	
元本等	
元本	135,107,273,836
剰余金	
剰余金又は欠損金()	170,287,032,327
元本等合計	305,394,306,163
純資産合計	305,394,306,163
負債純資産合計	305,745,106,279

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 1月23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)

	2023年 1月23日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	135,107,273,836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 2.2604円 (1万口当たり純資産額) (22,604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

	2023年 1月23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。

2023年 1月23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

2023年 1月23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	2023年 1月23日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 1月25日
期首元本額	133,845,048,512円
期中追加設定元本額	9,941,173,868円
期中一部解約元本額	8,678,948,544円
期末元本額	135,107,273,836円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	610,646,177円
D C日本株式インデックスファンド	284,091,689円
D C日本株式インデックスファンドL	54,143,939,097円
D C日本株式インデックスファンドA	658,843,338円
D Cバランスファンド30	2,421,760,029円
D Cバランスファンド50	3,824,113,974円
D Cバランスファンド70	2,362,067,509円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	575,537,191円
日本株式インデックスe	1,437,330,316円
インデックスコレクション（国内株式）	22,012,555,234円
インデックスコレクション（バランス株式30）	12,418,852,545円
インデックスコレクション（バランス株式50）	3,082,381,621円
インデックスコレクション（バランス株式70）	2,874,933,582円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,732,702,429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）	2,714,422,579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）	771,490,895円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	39,581,554円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	458,903,752円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	56,117,818円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	122,832,479円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	48,280,192円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	605,500,729円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	391,462,303円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	6,774,451,519円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	635,032,221円

区分	2023年 1月23日現在
V Aバランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	58,808,954円
V Aポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	1,088,438,604円
V Aポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	21,963,797円
バランスV A 4 0（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）	1,759,716,272円
V Aバランスファンド 2（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	47,683,872円
V Aバランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	50,941,360円
V Aファンド 2 5（適格機関投資家専用）	15,642,450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 2 5 L（適格機関投資家専用）	238,276,490円
バランスファンドV A 3（適格機関投資家専用）	3,887,567,319円
世界バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	78,327,454円
国内バランスV A 3 0（適格機関投資家専用）	31,569,934円
国内バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	7,677,578円
V Aバランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	107,049,305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）	2,267,237円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 1月23日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	2,812,292,619
合計	2,812,292,619

(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

（2023年 1月23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	2,409,612,800	-	2,469,515,000	59,902,200
	合計	2,409,612,800	-	2,469,515,000	59,902,200

(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	3,785.00	21,574,500	
ニッスイ	151,400	526.00	79,636,400	
マルハニチロ	23,300	2,425.00	56,502,500	
雪国まいたけ	12,900	1,013.00	13,067,700	
カネコ種苗	5,000	1,549.00	7,745,000	
サカタのタネ	19,200	4,000.00	76,800,000	
ホクト	13,500	1,884.00	25,434,000	
ホクリヨウ	2,200	812.00	1,786,400	
住石ホールディングス	23,600	445.00	10,502,000	
日鉄鉱業	6,100	3,505.00	21,380,500	
三井松島ホールディングス	6,900	3,365.00	23,218,500	
I N P E X	560,100	1,454.00	814,385,400	
石油資源開発	17,500	4,225.00	73,937,500	
K & O エナジーグループ	6,900	1,990.00	13,731,000	
ショーボンドホールディングス	20,600	5,410.00	111,446,000	
ミライト・ワン	52,500	1,559.00	81,847,500	
タマホーム	10,700	3,030.00	32,421,000	
サンヨーホームズ	1,800	712.00	1,281,600	
日本アクア	6,300	803.00	5,058,900	
ファーストコーポレーション	3,900	707.00	2,757,300	
ベステラ	3,300	965.00	3,184,500	
R o b o t H o m e	25,800	167.00	4,308,600	
キャンディル	2,300	503.00	1,156,900	
ダイセキ環境ソリューション	3,100	984.00	3,050,400	
第一カッター興業	3,900	1,050.00	4,095,000	
安藤・間	87,700	857.00	75,158,900	
東急建設	43,100	654.00	28,187,400	
コムシスホールディングス	51,300	2,390.00	122,607,000	
ピーアールホールディングス	24,000	334.00	8,016,000	
高松コンストラクショングループ	9,800	1,952.00	19,129,600	
東建コーポレーション	4,900	7,730.00	37,877,000	
ソネック	1,600	949.00	1,518,400	
ヤマウラ	7,700	1,050.00	8,085,000	
オリエンタル白石	54,400	312.00	16,972,800	

大成建設	105,400	4,365.00	460,071,000
大林組	378,900	977.00	370,185,300
清水建設	318,500	705.00	224,542,500
飛島建設	11,700	1,028.00	12,027,600
長谷工コーポレーション	109,400	1,471.00	160,927,400
松井建設	9,900	565.00	5,593,500
銭高組	1,300	2,693.00	3,500,900
鹿島建設	234,900	1,530.00	359,397,000
不動テトラ	7,300	1,528.00	11,154,400
大末建設	3,900	1,159.00	4,520,100
鉄建建設	7,600	1,789.00	13,596,400
西松建設	18,000	3,995.00	71,910,000
三井住友建設	85,400	418.00	35,697,200
大豊建設	4,400	3,525.00	15,510,000
佐田建設	6,800	452.00	3,073,600
ナカノフドー建設	7,500	327.00	2,452,500
奥村組	17,200	3,010.00	51,772,000
東鉄工業	14,600	2,648.00	38,660,800
イチケン	2,400	1,800.00	4,320,000
富士ピー・エス	4,700	435.00	2,044,500
浅沼組	8,500	3,200.00	27,200,000
戸田建設	130,300	695.00	90,558,500
熊谷組	18,300	2,623.00	48,000,900
北野建設	2,000	2,578.00	5,156,000
植木組	3,000	1,309.00	3,927,000
矢作建設工業	14,400	794.00	11,433,600
ピーエス三菱	13,400	623.00	8,348,200
日本ハウスホールディングス	21,000	380.00	7,980,000
新日本建設	14,900	773.00	11,517,700
東亜道路工業	2,100	6,050.00	12,705,000
日本道路	2,100	6,150.00	12,915,000
東亜建設工業	9,100	2,437.00	22,176,700
日本国土開発	31,800	540.00	17,172,000
若築建設	4,700	2,860.00	13,442,000
東洋建設	34,300	891.00	30,561,300
五洋建設	150,200	644.00	96,728,800
世紀東急工業	14,000	799.00	11,186,000
福田組	4,000	4,525.00	18,100,000
住友林業	81,300	2,378.00	193,331,400
日本基礎技術	6,700	521.00	3,490,700
巴コーポレーション	11,900	402.00	4,783,800
大和ハウス工業	296,100	3,072.00	909,619,200

ライト工業	20,200	1,879.00	37,955,800
積水ハウス	331,900	2,456.00	815,146,400
日特建設	10,100	925.00	9,342,500
北陸電気工事	7,300	689.00	5,029,700
ユアテック	23,300	749.00	17,451,700
日本リーテック	7,000	892.00	6,244,000
四電工	4,400	1,780.00	7,832,000
中電工	16,400	2,095.00	34,358,000
関電工	58,000	853.00	49,474,000
きんでん	74,600	1,408.00	105,036,800
東京エネシス	10,500	939.00	9,859,500
トーエネック	3,500	3,505.00	12,267,500
住友電設	10,100	2,338.00	23,613,800
日本電設工業	17,400	1,591.00	27,683,400
エクシオグループ	48,800	2,292.00	111,849,600
新日本空調	5,900	1,904.00	11,233,600
九電工	25,800	3,305.00	85,269,000
三機工業	23,500	1,523.00	35,790,500
日揮ホールディングス	104,800	1,679.00	175,959,200
中外炉工業	3,500	1,697.00	5,939,500
ヤマト	8,800	686.00	6,036,800
太平電業	6,600	3,310.00	21,846,000
高砂熱学工業	25,500	1,783.00	45,466,500
三晃金属工業	1,300	3,550.00	4,615,000
朝日工業社	4,400	1,977.00	8,698,800
明星工業	18,200	811.00	14,760,200
大気社	12,800	3,435.00	43,968,000
ダイダン	7,000	2,181.00	15,267,000
日比谷総合設備	9,100	1,925.00	17,517,500
フィル・カンパニー	1,900	1,012.00	1,922,800
テスホールディングス	11,400	1,141.00	13,007,400
インフロニア・ホールディングス	111,000	1,025.00	113,775,000
東洋エンジニアリング	14,000	598.00	8,372,000
レイズネクスト	15,300	1,296.00	19,828,800
ニッポン	28,700	1,598.00	45,862,600
日清製粉グループ本社	98,400	1,611.00	158,522,400
日東富士製粉	1,900	4,350.00	8,265,000
昭和産業	9,300	2,460.00	22,878,000
鳥越製粉	8,500	582.00	4,947,000
中部飼料	14,700	1,039.00	15,273,300
フィード・ワン	15,500	708.00	10,974,000
東洋精糖	2,000	875.00	1,750,000

日本甜菜製糖	6,200	1,649.00	10,223,800
D M三井製糖ホールディングス	10,500	2,000.00	21,000,000
塩水港精糖	12,700	194.00	2,463,800
ウェルネオシュガー	5,500	1,677.00	9,223,500
森永製菓	19,700	3,725.00	73,382,500
中村屋	2,700	3,085.00	8,329,500
江崎グリコ	30,400	3,545.00	107,768,000
名糖産業	4,200	1,668.00	7,005,600
井村屋グループ	5,800	2,238.00	12,980,400
不二家	7,300	2,507.00	18,301,100
山崎製パン	71,200	1,508.00	107,369,600
第一屋製パン	2,000	378.00	756,000
モロゾフ	3,400	3,355.00	11,407,000
亀田製菓	6,800	4,350.00	29,580,000
寿スピリッツ	11,300	8,450.00	95,485,000
カルビー	48,700	2,890.00	140,743,000
森永乳業	19,300	4,775.00	92,157,500
六甲バター	7,800	1,303.00	10,163,400
ヤクルト本社	76,000	9,110.00	692,360,000
明治ホールディングス	65,900	6,620.00	436,258,000
雪印メグミルク	25,700	1,754.00	45,077,800
プリマハム	14,300	2,124.00	30,373,200
日本ハム	41,600	3,670.00	152,672,000
林兼産業	3,200	468.00	1,497,600
丸大食品	10,700	1,446.00	15,472,200
S Foods	11,700	2,854.00	33,391,800
柿安本店	4,100	2,029.00	8,318,900
伊藤ハム米久ホールディングス	82,700	699.00	57,807,300
サッポロホールディングス	35,000	2,957.00	103,495,000
アサヒグループホールディングス	245,800	4,154.00	1,021,053,200
キリンホールディングス	480,000	1,965.00	943,200,000
宝ホールディングス	72,600	1,035.00	75,141,000
オエノンホールディングス	31,800	252.00	8,013,600
養命酒製造	3,500	1,808.00	6,328,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	83,300	1,334.00	111,122,200
サントリー食品インターナショナル	74,900	4,305.00	322,444,500
ダイドーグループホールディングス	6,000	4,655.00	27,930,000
伊藤園	39,600	4,165.00	164,934,000
キーコーヒー	11,900	2,076.00	24,704,400
ユニカフェ	3,500	896.00	3,136,000
ジャパンフーズ	1,700	1,074.00	1,825,800
日清オイリオグループ	15,000	3,130.00	46,950,000

不二製油グループ本社	24,800	2,013.00	49,922,400
かどや製油	1,300	3,510.00	4,563,000
J・オイルミルズ	10,800	1,551.00	16,750,800
キッコーマン	70,500	6,720.00	473,760,000
味の素	260,300	4,145.00	1,078,943,500
ブルドックソース	4,200	1,835.00	7,707,000
キューピー	57,200	2,174.00	124,352,800
ハウス食品グループ本社	32,600	2,717.00	88,574,200
カゴメ	49,600	3,030.00	150,288,000
焼津水産化学工業	4,700	797.00	3,745,900
アリアケジャパン	9,300	4,220.00	39,246,000
ピエトロ	1,500	1,825.00	2,737,500
エバラ食品工業	2,900	3,050.00	8,845,000
やまみ	1,000	1,399.00	1,399,000
ニチレイ	48,700	2,686.00	130,808,200
東洋水産	53,700	4,980.00	267,426,000
イトアンドホールディングス	4,500	2,334.00	10,503,000
大冷	1,300	1,902.00	2,472,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,700	808.00	5,413,600
日清食品ホールディングス	37,700	9,960.00	375,492,000
永谷園ホールディングス	5,200	2,027.00	10,540,400
一正蒲鉾	4,600	701.00	3,224,600
フジッコ	10,900	1,896.00	20,666,400
ロック・フィールド	13,000	1,542.00	20,046,000
日本たばこ産業	700,200	2,649.00	1,854,829,800
ケンコーマヨネーズ	7,300	1,346.00	9,825,800
わらべや日洋ホールディングス	7,800	1,891.00	14,749,800
なとり	6,700	2,069.00	13,862,300
イフジ産業	1,800	909.00	1,636,200
ファーマフーズ	16,400	1,323.00	21,697,200
ユーグレナ	68,500	989.00	67,746,500
紀文食品	8,300	940.00	7,802,000
ピクルスホールディングス	6,200	1,240.00	7,688,000
ミヨシ油脂	3,700	920.00	3,404,000
理研ビタミン	9,200	1,849.00	17,010,800
片倉工業	10,200	1,734.00	17,686,800
ゲンゼ	8,200	4,140.00	33,948,000
東洋紡	47,200	1,009.00	47,624,800
ユニチカ	34,500	239.00	8,245,500
富士紡ホールディングス	4,400	3,225.00	14,190,000
倉敷紡績	8,300	2,154.00	17,878,200
シキボウ	6,000	966.00	5,796,000

日本毛織	31,000	944.00	29,264,000
トーア紡コーポレーション	4,200	349.00	1,465,800
帝国繊維	12,500	1,519.00	18,987,500
帝人	104,300	1,295.00	135,068,500
東レ	725,600	761.30	552,399,280
住江織物	2,000	1,843.00	3,686,000
日本フェルト	7,100	401.00	2,847,100
イチカワ	1,700	1,312.00	2,230,400
日東製網	1,200	1,486.00	1,783,200
アツギ	6,600	400.00	2,640,000
ダイニック	2,800	624.00	1,747,200
セーレン	21,100	2,327.00	49,099,700
ソトー	3,600	806.00	2,901,600
東海染工	1,200	1,104.00	1,324,800
小松マテーレ	15,800	755.00	11,929,000
ワコールホールディングス	20,900	2,396.00	50,076,400
ホギメディカル	14,600	3,535.00	51,611,000
T S Iホールディングス	39,000	477.00	18,603,000
マツオカコーポレーション	3,100	1,109.00	3,437,900
ワールド	14,000	1,306.00	18,284,000
三陽商会	4,100	1,318.00	5,403,800
ナイガイ	4,100	259.00	1,061,900
オンワードホールディングス	70,600	319.00	22,521,400
ルックホールディングス	3,100	2,478.00	7,681,800
ゴールドウイン	19,200	9,510.00	182,592,000
デサント	18,700	3,165.00	59,185,500
キング	5,000	498.00	2,490,000
ヤマトインターナショナル	9,000	243.00	2,187,000
特種東海製紙	5,300	2,837.00	15,036,100
王子ホールディングス	450,700	523.00	235,716,100
日本製紙	56,400	931.00	52,508,400
三菱製紙	13,000	275.00	3,575,000
北越コーポレーション	68,400	822.00	56,224,800
中越パルプ工業	4,400	972.00	4,276,800
巴川製紙所	3,400	679.00	2,308,600
大王製紙	47,800	986.00	47,130,800
阿波製紙	2,600	593.00	1,541,800
レンゴー	98,500	901.00	88,748,500
トーモク	6,300	1,676.00	10,558,800
ザ・パック	8,000	2,538.00	20,304,000
北の達人コーポレーション	45,600	324.00	14,774,400
クラレ	172,000	1,039.00	178,708,000

旭化成	675,700	953.90	644,550,230
共和レザー	6,200	505.00	3,131,000
レゾナック・ホールディングス	104,600	2,164.00	226,354,400
住友化学	802,700	484.00	388,506,800
住友精化	4,500	4,060.00	18,270,000
日産化学	51,400	5,910.00	303,774,000
ラサ工業	4,200	1,910.00	8,022,000
クレハ	9,200	8,270.00	76,084,000
多木化学	4,200	4,625.00	19,425,000
テイカ	7,300	1,190.00	8,687,000
石原産業	19,600	1,088.00	21,324,800
片倉コープアグリ	2,200	1,642.00	3,612,400
日本曹達	11,600	4,050.00	46,980,000
東ソー	144,400	1,581.00	228,296,400
トクヤマ	34,900	1,817.00	63,413,300
セントラル硝子	17,400	2,735.00	47,589,000
東亜合成	55,600	1,152.00	64,051,200
大阪ソーダ	6,500	4,110.00	26,715,000
関東電化工業	20,900	940.00	19,646,000
デンカ	39,300	2,647.00	104,027,100
信越化学工業	182,600	17,140.00	3,129,764,000
日本カーバイド工業	4,100	1,306.00	5,354,600
堺化学工業	8,200	1,810.00	14,842,000
第一稀元素化学工業	9,900	1,073.00	10,622,700
エア・ウォーター	102,100	1,535.00	156,723,500
日本酸素ホールディングス	105,000	2,062.00	216,510,000
日本化学工業	3,600	1,829.00	6,584,400
東邦アセチレン	2,300	1,129.00	2,596,700
日本パーカライズニング	53,600	947.00	50,759,200
高压ガス工業	15,700	660.00	10,362,000
チタン工業	1,300	1,479.00	1,922,700
四国化成ホールディングス	12,800	1,349.00	17,267,200
戸田工業	2,500	2,494.00	6,235,000
ステラ ケミファ	6,400	2,542.00	16,268,800
保土谷化学工業	3,100	3,220.00	9,982,000
日本触媒	16,500	5,280.00	87,120,000
大日精化工業	7,500	1,748.00	13,110,000
カネカ	24,700	3,295.00	81,386,500
三菱瓦斯化学	80,800	1,821.00	147,136,800
三井化学	91,000	2,974.00	270,634,000
J S R	101,000	2,905.00	293,405,000
東京応化工業	18,900	6,300.00	119,070,000

大阪有機化学工業	8,100	2,028.00	16,426,800
三菱ケミカルグループ	730,200	708.60	517,419,720
KHネオケム	18,000	2,765.00	49,770,000
ダイセル	159,100	934.00	148,599,400
住友ベークライト	16,000	4,070.00	65,120,000
積水化学工業	223,600	1,889.00	422,380,400
日本ゼオン	64,900	1,302.00	84,499,800
アイカ工業	27,300	3,065.00	83,674,500
UBE	55,800	1,965.00	109,647,000
積水樹脂	15,700	1,908.00	29,955,600
タキロンシーアイ	23,600	513.00	12,106,800
旭有機材	7,200	2,860.00	20,592,000
ニチバン	6,700	1,830.00	12,261,000
リケンテクノス	23,300	507.00	11,813,100
大倉工業	5,000	1,880.00	9,400,000
積水化成成品工業	15,200	380.00	5,776,000
群栄化学工業	2,500	2,442.00	6,105,000
タイガースポリマー	4,900	405.00	1,984,500
ミライアル	3,300	1,520.00	5,016,000
ダイキアクシス	4,000	686.00	2,744,000
ダイキョーニシカワ	23,900	578.00	13,814,200
竹本容器	3,600	746.00	2,685,600
森六ホールディングス	5,500	1,767.00	9,718,500
恵和	7,000	1,574.00	11,018,000
日本化薬	82,700	1,156.00	95,601,200
カーリットホールディングス	9,700	744.00	7,216,800
日本精化	6,100	2,480.00	15,128,000
扶桑化学工業	10,000	3,525.00	35,250,000
トリケミカル研究所	14,400	2,286.00	32,918,400
ADEKA	37,700	2,136.00	80,527,200
日油	33,500	5,440.00	182,240,000
新日本理化	14,900	230.00	3,427,000
ハリマ化成グループ	7,600	832.00	6,323,200
花王	263,500	5,246.00	1,382,321,000
第一工業製薬	3,900	1,962.00	7,651,800
石原ケミカル	4,900	1,265.00	6,198,500
日華化学	4,300	806.00	3,465,800
ニイタカ	2,200	1,988.00	4,373,600
三洋化成工業	6,700	4,120.00	27,604,000
有機合成薬品工業	8,000	297.00	2,376,000
大日本塗料	13,200	779.00	10,282,800
日本ペイントホールディングス	478,800	1,162.00	556,365,600

関西ペイント	99,100	1,685.00	166,983,500
神東塗料	9,000	129.00	1,161,000
中国塗料	19,900	991.00	19,720,900
日本特殊塗料	6,900	862.00	5,947,800
藤倉化成	14,500	435.00	6,307,500
太陽ホールディングス	16,500	2,316.00	38,214,000
D I C	42,300	2,362.00	99,912,600
サカタインクス	24,100	1,038.00	25,015,800
東洋インキS Cホールディングス	21,200	1,808.00	38,329,600
T & K T O K A	9,600	1,254.00	12,038,400
富士フィルムホールディングス	207,900	6,753.00	1,403,948,700
資生堂	226,200	6,500.00	1,470,300,000
ライオン	130,000	1,416.00	184,080,000
高砂香料工業	7,300	2,528.00	18,454,400
マンダム	23,400	1,402.00	32,806,800
ミルボン	16,100	5,600.00	90,160,000
ファンケル	47,400	2,644.00	125,325,600
コーセー	22,000	13,780.00	303,160,000
コタ	9,100	1,709.00	15,551,900
シーボン	1,400	1,611.00	2,255,400
ポーラ・オルビスホールディングス	55,500	1,780.00	98,790,000
ノエビアホールディングス	9,700	5,600.00	54,320,000
アジュバンホールディングス	2,600	972.00	2,527,200
新日本製薬	6,200	1,386.00	8,593,200
エステー	8,400	1,566.00	13,154,400
アグロ カネショウ	4,300	1,540.00	6,622,000
コニシ	18,100	1,815.00	32,851,500
長谷川香料	22,400	3,020.00	67,648,000
星光P M C	5,500	546.00	3,003,000
小林製薬	31,500	9,130.00	287,595,000
荒川化学工業	9,200	1,005.00	9,246,000
メック	8,900	2,454.00	21,840,600
日本高純度化学	2,800	2,359.00	6,605,200
タカラバイオ	29,200	1,714.00	50,048,800
J C U	12,200	3,150.00	38,430,000
新田ゼラチン	6,700	843.00	5,648,100
O A T アグリオ	4,400	1,462.00	6,432,800
デクセリアルズ	31,300	2,751.00	86,106,300
アース製薬	9,800	4,970.00	48,706,000
北興化学工業	10,900	814.00	8,872,600
大成ラミック	3,400	2,968.00	10,091,200
クミアイ化学工業	43,000	851.00	36,593,000

日本農薬	19,900	695.00	13,830,500
アキレス	7,000	1,246.00	8,722,000
有沢製作所	17,700	1,347.00	23,841,900
日東電工	78,600	7,960.00	625,656,000
レック	15,400	967.00	14,891,800
三光合成	14,900	483.00	7,196,700
きもと	15,900	226.00	3,593,400
藤森工業	8,600	3,245.00	27,907,000
前澤化成工業	7,000	1,367.00	9,569,000
未来工業	3,900	1,472.00	5,740,800
ウェーブロックホールディングス	3,200	615.00	1,968,000
J S P	7,600	1,533.00	11,650,800
エフピコ	20,500	3,495.00	71,647,500
天馬	9,200	2,145.00	19,734,000
信越ポリマー	20,000	1,189.00	23,780,000
東リ	24,300	228.00	5,540,400
ニフコ	39,100	3,300.00	129,030,000
バルカー	9,100	2,707.00	24,633,700
ユニ・チャーム	225,700	4,912.00	1,108,638,400
ショーエイコーポレーション	3,100	588.00	1,822,800
協和キリン	130,900	2,876.00	376,468,400
武田薬品工業	958,800	4,199.00	4,026,001,200
アステラス製薬	1,038,300	1,952.50	2,027,280,750
住友ファーマ	80,400	897.00	72,118,800
塩野義製薬	138,500	6,200.00	858,700,000
わかもと製薬	10,700	220.00	2,354,000
日本新薬	25,600	6,720.00	172,032,000
中外製薬	339,200	3,392.00	1,150,566,400
科研製薬	18,600	3,825.00	71,145,000
エーザイ	131,800	8,277.00	1,090,908,600
ロート製薬	105,000	2,290.00	240,450,000
小野薬品工業	209,000	2,903.00	606,727,000
久光製薬	24,100	3,920.00	94,472,000
持田製薬	13,000	3,370.00	43,810,000
参天製薬	203,900	1,031.00	210,220,900
扶桑薬品工業	3,500	1,940.00	6,790,000
日本ケミファ	1,200	1,714.00	2,056,800
ツムラ	34,100	2,728.00	93,024,800
キッセイ薬品工業	16,800	2,542.00	42,705,600
生化学工業	20,700	835.00	17,284,500
栄研化学	17,600	1,624.00	28,582,400
鳥居薬品	5,800	3,190.00	18,502,000

JCRファーマ	36,700	1,608.00	59,013,600
東和薬品	16,700	2,044.00	34,134,800
富士製薬工業	7,100	1,044.00	7,412,400
ゼリア新薬工業	15,100	2,152.00	32,495,200
第一三共	943,800	4,270.00	4,030,026,000
キョーリン製薬ホールディングス	23,500	1,694.00	39,809,000
大幸薬品	19,800	380.00	7,524,000
ダイト	8,200	2,598.00	21,303,600
大塚ホールディングス	247,900	4,165.00	1,032,503,500
大正製薬ホールディングス	24,100	5,450.00	131,345,000
ペプチドリーム	52,600	2,032.00	106,883,200
あすか製薬ホールディングス	11,200	1,264.00	14,156,800
サワイグループホールディングス	24,800	3,925.00	97,340,000
日本コークス工業	97,700	93.00	9,086,100
ニチレキ	12,800	1,328.00	16,998,400
ユシロ化学工業	5,600	785.00	4,396,000
ビーピー・カストロール	4,200	879.00	3,691,800
富士石油	22,100	264.00	5,834,400
MORESCO	3,500	1,169.00	4,091,500
出光興産	120,300	3,275.00	393,982,500
ENEOSホールディングス	1,957,300	471.10	922,084,030
コスモエネルギーホールディングス	42,800	3,705.00	158,574,000
横浜ゴム	61,600	2,060.00	126,896,000
TOYO TIRE	62,300	1,500.00	93,450,000
ブリヂストン	346,000	4,771.00	1,650,766,000
住友ゴム工業	106,300	1,136.00	120,756,800
藤倉コンポジット	7,700	871.00	6,706,700
オカモト	6,000	3,790.00	22,740,000
フコク	5,700	1,039.00	5,922,300
ニッタ	11,000	2,806.00	30,866,000
住友理工	21,000	662.00	13,902,000
三ツ星ベルト	15,800	3,645.00	57,591,000
バンドー化学	17,200	996.00	17,131,200
日東紡績	12,900	1,999.00	25,787,100
AGC	110,300	4,615.00	509,034,500
日本板硝子	55,200	596.00	32,899,200
石塚硝子	1,700	1,425.00	2,422,500
日本山村硝子	4,200	528.00	2,217,600
日本電気硝子	44,200	2,382.00	105,284,400
オハラ	5,200	1,169.00	6,078,800
住友大阪セメント	15,300	3,240.00	49,572,000
太平洋セメント	69,000	2,114.00	145,866,000

日本ヒューム	9,600	657.00	6,307,200
日本コンクリート工業	21,300	223.00	4,749,900
三谷セキサン	4,600	3,925.00	18,055,000
アジアパイルホールディングス	17,000	593.00	10,081,000
東海カーボン	90,900	1,097.00	99,717,300
日本カーボン	6,200	4,380.00	27,156,000
東洋炭素	6,800	3,890.00	26,452,000
ノリタケカンパニーリミテド	5,400	4,015.00	21,681,000
TOTO	71,500	4,945.00	353,567,500
日本碍子	128,200	1,729.00	221,657,800
日本特殊陶業	82,500	2,498.00	206,085,000
MARUWA	4,000	17,120.00	68,480,000
品川リフラクトリーズ	3,100	4,195.00	13,004,500
黒崎播磨	2,200	5,870.00	12,914,000
ヨータイ	7,300	1,512.00	11,037,600
東京窯業	10,100	274.00	2,767,400
ニッカトー	5,000	531.00	2,655,000
フジインコーポレーテッド	8,600	6,580.00	56,588,000
クニミネ工業	3,200	840.00	2,688,000
エーアンドエーマテリアル	2,000	889.00	1,778,000
ニチアス	27,400	2,400.00	65,760,000
ニチハ	13,600	2,684.00	36,502,400
日本製鉄	499,100	2,690.00	1,342,579,000
神戸製鋼所	224,200	680.00	152,456,000
中山製鋼所	23,000	978.00	22,494,000
合同製鐵	5,600	2,509.00	14,050,400
JFEホールディングス	297,900	1,668.00	496,897,200
東京製鐵	31,300	1,301.00	40,721,300
共英製鋼	12,700	1,376.00	17,475,200
大和工業	18,400	5,020.00	92,368,000
東京鐵鋼	5,300	1,622.00	8,596,600
大阪製鐵	5,200	1,278.00	6,645,600
淀川製鋼所	12,700	2,680.00	34,036,000
丸一鋼管	33,900	2,790.00	94,581,000
モリ工業	2,600	2,881.00	7,490,600
大同特殊鋼	14,000	4,625.00	64,750,000
日本高周波鋼業	3,900	318.00	1,240,200
日本冶金工業	8,100	4,520.00	36,612,000
山陽特殊製鋼	11,000	2,320.00	25,520,000
愛知製鋼	6,400	2,292.00	14,668,800
日本金属	2,400	917.00	2,200,800
大平洋金属	7,900	2,023.00	15,981,700

新日本電工	71,300	387.00	27,593,100
栗本鐵工所	5,300	1,790.00	9,487,000
虹技	1,400	920.00	1,288,000
三菱製鋼	7,000	1,126.00	7,882,000
日亜鋼業	11,400	252.00	2,872,800
日本精線	1,500	4,435.00	6,652,500
エンビプロ・ホールディングス	7,700	739.00	5,690,300
シンニッタン	12,200	234.00	2,854,800
新家工業	2,400	2,365.00	5,676,000
大紀アルミニウム工業所	15,900	1,410.00	22,419,000
日本軽金属ホールディングス	30,100	1,584.00	47,678,400
三井金属鉱業	32,400	3,350.00	108,540,000
東邦亜鉛	6,600	2,167.00	14,302,200
三菱マテリアル	74,400	2,204.00	163,977,600
住友金属鉱山	129,200	5,224.00	674,940,800
D O W Aホールディングス	25,100	4,410.00	110,691,000
古河機械金属	16,400	1,292.00	21,188,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	16,400	3,895.00	63,878,000
東邦チタニウム	20,200	2,761.00	55,772,200
U A C J	15,700	2,474.00	38,841,800
C Kサンエツ	2,700	4,210.00	11,367,000
古河電気工業	37,100	2,412.00	89,485,200
住友電気工業	384,900	1,500.00	577,350,000
フジクラ	119,600	966.00	115,533,600
昭和電線ホールディングス	12,500	1,757.00	21,962,500
タツタ電線	22,800	714.00	16,279,200
カナレ電気	1,800	1,399.00	2,518,200
平河ヒューテック	6,500	1,149.00	7,468,500
リョービ	11,900	1,177.00	14,006,300
アーレスティ	12,500	438.00	5,475,000
アサヒホールディングス	45,100	2,020.00	91,102,000
稲葉製作所	6,500	1,384.00	8,996,000
宮地エンジニアリンググループ	3,100	3,625.00	11,237,500
トーカロ	30,600	1,192.00	36,475,200
アルファC o	4,100	919.00	3,767,900
S U M C O	212,200	1,904.00	404,028,800
川田テクノロジーズ	2,600	3,370.00	8,762,000
R S Technologies	7,300	3,915.00	28,579,500
ジェイテックコーポレーション	1,500	2,911.00	4,366,500
信和	6,200	799.00	4,953,800
東洋製罐グループホールディングス	73,800	1,626.00	119,998,800
ホッカンホールディングス	6,000	1,370.00	8,220,000

コロナ	6,200	900.00	5,580,000
横河ブリッジホールディングス	14,700	1,886.00	27,724,200
駒井ハルテック	1,800	1,535.00	2,763,000
高田機工	900	2,503.00	2,252,700
三和ホールディングス	102,600	1,242.00	127,429,200
文化シャッター	32,100	1,138.00	36,529,800
三協立山	15,300	656.00	10,036,800
アルインコ	8,500	1,017.00	8,644,500
東洋シャッター	2,600	498.00	1,294,800
LIXIL	162,400	2,088.00	339,091,200
日本フィルコン	7,300	445.00	3,248,500
ノーリツ	16,400	1,442.00	23,648,800
長府製作所	11,200	2,012.00	22,534,400
リンナイ	20,200	9,850.00	198,970,000
ダイニチ工業	5,500	687.00	3,778,500
日東精工	16,200	505.00	8,181,000
三洋工業	1,300	1,860.00	2,418,000
岡部	17,900	723.00	12,941,700
ジーテクト	12,400	1,460.00	18,104,000
東プレ	19,600	1,198.00	23,480,800
高周波熱錬	18,200	671.00	12,212,200
東京製綱	6,600	989.00	6,527,400
サンコール	9,900	648.00	6,415,200
モリテック スチール	8,200	276.00	2,263,200
パイオラックス	15,400	1,747.00	26,903,800
エイチワン	11,500	638.00	7,337,000
日本発條	98,600	873.00	86,077,800
中央発條	6,200	730.00	4,526,000
アドバネクス	1,400	1,064.00	1,489,600
立川ブラインド工業	5,000	1,200.00	6,000,000
三益半導体工業	10,000	2,505.00	25,050,000
日本ドライケミカル	2,700	1,410.00	3,807,000
日本製鋼所	30,100	2,634.00	79,283,400
三浦工業	45,600	3,215.00	146,604,000
タクマ	33,600	1,244.00	41,798,400
ツガミ	24,300	1,290.00	31,347,000
オークマ	10,900	4,855.00	52,919,500
芝浦機械	12,100	2,770.00	33,517,000
アマダ	174,200	1,126.00	196,149,200
アイダエンジニアリング	22,600	790.00	17,854,000
TAKISAWA	2,900	1,117.00	3,239,300
FUJI	47,500	2,074.00	98,515,000

牧野フライス製作所	12,100	4,405.00	53,300,500
オーエスジー	52,100	1,952.00	101,699,200
ダイジェット工業	1,200	839.00	1,006,800
旭ダイヤモンド工業	31,500	722.00	22,743,000
D M G 森精機	66,200	1,910.00	126,442,000
ソディック	30,200	738.00	22,287,600
ディスコ	17,500	39,900.00	698,250,000
日東工器	5,300	1,527.00	8,093,100
日進工具	9,200	1,017.00	9,356,400
パンチ工業	9,600	456.00	4,377,600
富士ダイス	5,200	579.00	3,010,800
豊和工業	6,000	932.00	5,592,000
ニデックオーケーケー	4,400	974.00	4,285,600
東洋機械金属	7,600	554.00	4,210,400
津田駒工業	2,000	538.00	1,076,000
エンシュウ	2,500	679.00	1,697,500
島精機製作所	17,400	1,923.00	33,460,200
オプトラン	16,200	2,530.00	40,986,000
N C ホールディングス	2,200	2,020.00	4,444,000
イワキポンプ	7,300	1,276.00	9,314,800
フリー	11,500	1,084.00	12,466,000
ヤマシンフィルタ	26,100	544.00	14,198,400
日阪製作所	10,700	833.00	8,913,100
やまびこ	17,900	1,094.00	19,582,600
野村マイクロ・サイエンス	3,700	4,470.00	16,539,000
平田機工	5,200	6,110.00	31,772,000
ペガサスミシン製造	12,100	810.00	9,801,000
マルマエ	5,300	1,693.00	8,972,900
タツモ	6,000	1,866.00	11,196,000
ナプテスコ	68,500	3,585.00	245,572,500
三井海洋開発	13,700	1,390.00	19,043,000
レオン自動機	11,500	1,048.00	12,052,000
S M C	35,400	62,700.00	2,219,580,000
ホソカワミクロン	8,400	2,691.00	22,604,400
ユニオンツール	4,800	3,315.00	15,912,000
オイレス工業	15,300	1,486.00	22,735,800
日精エー・エス・ビー機械	5,000	4,670.00	23,350,000
サトーホールディングス	15,500	1,987.00	30,798,500
技研製作所	11,400	2,792.00	31,828,800
日本エアーテック	5,600	1,067.00	5,975,200
カワタ	3,200	816.00	2,611,200
日精樹脂工業	8,200	966.00	7,921,200

オカダアイヨン	3,400	1,565.00	5,321,000
ワイエイシイホールディングス	4,600	1,991.00	9,158,600
小松製作所	511,200	3,019.00	1,543,312,800
住友重機械工業	64,600	2,725.00	176,035,000
日立建機	43,500	3,005.00	130,717,500
日工	16,300	623.00	10,154,900
巴工業	4,700	2,340.00	10,998,000
井関農機	10,300	1,203.00	12,390,900
TOWA	11,200	1,944.00	21,772,800
丸山製作所	1,900	1,558.00	2,960,200
北川鉄工所	4,400	1,176.00	5,174,400
ローツェ	5,700	10,070.00	57,399,000
タカキタ	3,200	438.00	1,401,600
クボタ	577,400	1,881.50	1,086,378,100
荏原実業	5,400	2,381.00	12,857,400
三菱化工機	3,600	2,141.00	7,707,600
月島機械	14,900	995.00	14,825,500
帝国電機製作所	8,200	2,390.00	19,598,000
新東工業	22,200	708.00	15,717,600
澁谷工業	10,300	2,347.00	24,174,100
アイチ コーポレーション	15,600	768.00	11,980,800
小森コーポレーション	25,400	853.00	21,666,200
鶴見製作所	8,400	1,973.00	16,573,200
日本ギア工業	3,800	347.00	1,318,600
酒井重工業	1,800	3,485.00	6,273,000
荏原製作所	44,700	5,070.00	226,629,000
石井鐵工所	1,300	2,301.00	2,991,300
西島製作所	9,500	1,505.00	14,297,500
北越工業	11,000	1,315.00	14,465,000
ダイキン工業	130,200	22,205.00	2,891,091,000
オルガノ	15,000	3,120.00	46,800,000
トーヨーカネツ	4,200	2,655.00	11,151,000
栗田工業	61,000	5,690.00	347,090,000
椿本チエイン	15,500	3,040.00	47,120,000
大同工業	4,500	742.00	3,339,000
木村化工機	8,500	705.00	5,992,500
アネスト岩田	18,600	856.00	15,921,600
ダイフク	56,300	6,790.00	382,277,000
サムコ	3,600	3,460.00	12,456,000
加藤製作所	5,300	703.00	3,725,900
油研工業	1,700	1,820.00	3,094,000
タダノ	57,700	926.00	53,430,200

フジテック	40,000	3,125.00	125,000,000
C K D	30,200	1,961.00	59,222,200
平和	36,300	2,321.00	84,252,300
理想科学工業	9,700	2,095.00	20,321,500
S A N K Y O	21,400	5,140.00	109,996,000
日本金銭機械	12,000	1,139.00	13,668,000
マースグループホールディングス	6,400	2,261.00	14,470,400
フクシマガリレイ	8,000	4,270.00	34,160,000
オーイズミ	4,200	495.00	2,079,000
ダイコク電機	6,000	1,960.00	11,760,000
竹内製作所	19,800	2,745.00	54,351,000
アマノ	31,000	2,365.00	73,315,000
J U K I	17,000	617.00	10,489,000
ジャノメ	11,100	591.00	6,560,100
マックス	13,500	1,946.00	26,271,000
グローリー	28,300	2,202.00	62,316,600
新晃工業	11,000	1,519.00	16,709,000
大和冷機工業	16,800	1,176.00	19,756,800
セガサミーホールディングス	87,700	1,997.00	175,136,900
日本ピストンリング	3,700	1,230.00	4,551,000
リケン	4,300	2,298.00	9,881,400
T P R	12,800	1,253.00	16,038,400
ツバキ・ナカシマ	26,900	1,100.00	29,590,000
ホシザキ	70,200	4,550.00	319,410,000
大豊工業	9,500	631.00	5,994,500
日本精工	200,500	708.00	141,954,000
N T N	215,100	262.00	56,356,200
ジェイテクト	97,100	911.00	88,458,100
不二越	8,100	3,655.00	29,605,500
日本トムソン	26,800	568.00	15,222,400
T H K	63,000	2,674.00	168,462,000
ユーシン精機	8,700	686.00	5,968,200
前澤給装工業	7,700	925.00	7,122,500
イーグル工業	12,100	1,096.00	13,261,600
前澤工業	7,100	596.00	4,231,600
日本ピラー工業	10,100	3,050.00	30,805,000
キッツ	40,200	804.00	32,320,800
マキタ	135,800	3,420.00	464,436,000
三井E & Sホールディングス	49,600	388.00	19,244,800
日立造船	89,500	807.00	72,226,500
三菱重工業	190,800	4,920.00	938,736,000
I H I	68,800	3,765.00	259,032,000

スター精密	20,600	1,650.00	33,990,000
日清紡ホールディングス	88,800	950.00	84,360,000
イビデン	62,600	5,070.00	317,382,000
コニカミノルタ	244,100	525.00	128,152,500
ブラザー工業	145,900	1,963.00	286,401,700
ミネベアミツミ	189,900	2,152.00	408,664,800
日立製作所	547,800	6,717.00	3,679,572,600
東芝	210,000	4,485.00	941,850,000
三菱電機	1,127,600	1,340.00	1,510,984,000
富士電機	66,300	5,190.00	344,097,000
東洋電機製造	3,900	844.00	3,291,600
安川電機	129,300	4,830.00	624,519,000
シンフォニアテクノロジー	12,000	1,540.00	18,480,000
明電舎	16,600	1,875.00	31,125,000
オリジン	2,400	1,272.00	3,052,800
山洋電気	4,800	6,010.00	28,848,000
デンヨー	8,300	1,526.00	12,665,800
PHCホールディングス	15,300	1,564.00	23,929,200
ソシオネクスト	11,300	7,510.00	84,863,000
東芝テック	16,300	3,640.00	59,332,000
芝浦メカトロニクス	2,100	10,910.00	22,911,000
マブチモーター	27,200	3,675.00	99,960,000
日本電産	265,000	7,336.00	1,944,040,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	8,500	483.00	4,105,500
トレックス・セミコンダクター	5,200	2,705.00	14,066,000
東光高岳	6,700	2,191.00	14,679,700
ダブル・スコープ	35,700	1,364.00	48,694,800
ダイヘン	9,900	4,040.00	39,996,000
ヤーマン	21,400	1,349.00	28,868,600
JVCケンウッド	100,000	364.00	36,400,000
ミマキエンジニアリング	10,800	609.00	6,577,200
IPEX	6,300	1,161.00	7,314,300
日新電機	26,100	1,302.00	33,982,200
大崎電気工業	25,900	542.00	14,037,800
オムロン	100,000	6,928.00	692,800,000
日東工業	14,700	2,388.00	35,103,600
IDEC	16,100	3,015.00	48,541,500
正興電機製作所	4,400	928.00	4,083,200
不二電機工業	2,400	1,130.00	2,712,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	35,900	2,173.00	78,010,700
サクサホールディングス	2,300	1,218.00	2,801,400
メルコホールディングス	3,000	3,125.00	9,375,000

テクノメディカ	2,800	1,756.00	4,916,800
日本電気	154,300	4,455.00	687,406,500
富士通	108,700	18,545.00	2,015,841,500
沖電気工業	49,300	718.00	35,397,400
岩崎通信機	4,800	758.00	3,638,400
電気興業	5,100	1,935.00	9,868,500
サンケン電気	10,100	7,030.00	71,003,000
ナカヨ	1,700	1,056.00	1,795,200
アイホン	6,600	1,847.00	12,190,200
ルネサスエレクトロニクス	712,100	1,308.50	931,782,850
セイコーエプソン	145,300	1,921.00	279,121,300
ワコム	86,800	626.00	54,336,800
アルバック	25,900	5,940.00	153,846,000
アクセル	4,200	1,628.00	6,837,600
E I Z O	8,000	3,545.00	28,360,000
日本信号	24,800	1,050.00	26,040,000
京三製作所	22,800	402.00	9,165,600
能美防災	14,900	1,647.00	24,540,300
ホーチキ	8,300	1,440.00	11,952,000
星和電機	4,900	434.00	2,126,600
エレコム	26,300	1,335.00	35,110,500
パナソニック ホールディングス	1,288,700	1,137.50	1,465,896,250
シャープ	131,400	1,036.00	136,130,400
アンリツ	76,800	1,258.00	96,614,400
富士通ゼネラル	30,900	3,640.00	112,476,000
ソニーグループ	764,100	11,450.00	8,748,945,000
T D K	172,800	4,520.00	781,056,000
帝国通信工業	5,100	1,431.00	7,298,100
タムラ製作所	46,800	741.00	34,678,800
アルプスアルパイン	97,600	1,262.00	123,171,200
池上通信機	3,400	574.00	1,951,600
日本電波工業	13,200	1,499.00	19,786,800
鈴木	6,700	972.00	6,512,400
メイコー	12,000	2,805.00	33,660,000
日本トリム	2,500	2,914.00	7,285,000
ローランド ディー・ジー	6,200	2,853.00	17,688,600
フォスター電機	10,100	944.00	9,534,400
S M K	2,600	2,385.00	6,201,000
ヨコオ	8,800	2,174.00	19,131,200
ホシデン	26,300	1,550.00	40,765,000
ヒロセ電機	18,000	16,390.00	295,020,000
日本航空電子工業	22,400	2,214.00	49,593,600

TOA	12,500	779.00	9,737,500
マクセル	23,900	1,429.00	34,153,100
古野電気	14,400	926.00	13,334,400
スミダコーポレーション	10,200	1,373.00	14,004,600
アイコム	4,200	2,525.00	10,605,000
リオン	4,600	1,810.00	8,326,000
横河電機	119,400	2,187.00	261,127,800
新電元工業	4,200	3,265.00	13,713,000
アズビル	75,500	3,505.00	264,627,500
東亜ディーケーケー	5,400	759.00	4,098,600
日本光電工業	50,000	3,320.00	166,000,000
チノー	4,500	1,866.00	8,397,000
共和電業	10,200	335.00	3,417,000
日本電子材料	7,100	1,441.00	10,231,100
堀場製作所	24,100	5,830.00	140,503,000
アドバンテスト	85,100	9,650.00	821,215,000
小野測器	4,700	389.00	1,828,300
エスペック	8,800	1,918.00	16,878,400
キーエンス	108,100	58,380.00	6,310,878,000
日置電機	5,700	6,450.00	36,765,000
シスメックス	93,200	8,398.00	782,693,600
日本マイクロニクス	18,000	1,388.00	24,984,000
メガチップス	9,000	2,620.00	23,580,000
OBARA GROUP	5,100	3,685.00	18,793,500
澤藤電機	1,500	1,140.00	1,710,000
原田工業	5,100	830.00	4,233,000
コーセル	14,700	1,074.00	15,787,800
イリソ電子工業	10,000	4,255.00	42,550,000
オブテックスグループ	20,000	2,002.00	40,040,000
千代田インテグレ	4,500	2,231.00	10,039,500
レーザーテック	53,300	25,955.00	1,383,401,500
スタンレー電気	77,000	2,622.00	201,894,000
岩崎電気	3,600	2,338.00	8,416,800
ウシオ電機	56,600	1,709.00	96,729,400
岡谷電機産業	9,300	248.00	2,306,400
ヘリオス テクノ ホールディング	10,600	477.00	5,056,200
エノモト	2,900	1,795.00	5,205,500
日本セラミック	11,100	2,370.00	26,307,000
遠藤照明	5,200	754.00	3,920,800
古河電池	8,200	1,090.00	8,938,000
双信電機	5,000	371.00	1,855,000
山一電機	9,600	1,795.00	17,232,000

図研	9,500	2,993.00	28,433,500
日本電子	27,100	3,785.00	102,573,500
カシオ計算機	80,500	1,332.00	107,226,000
ファナック	106,000	21,955.00	2,327,230,000
日本シイエムケイ	23,500	489.00	11,491,500
エンプラス	3,200	3,640.00	11,648,000
大真空	13,500	751.00	10,138,500
ローム	50,000	10,140.00	507,000,000
浜松ホトニクス	86,700	6,830.00	592,161,000
三井ハイテック	11,200	6,820.00	76,384,000
新光電気工業	38,300	3,725.00	142,667,500
京セラ	167,800	6,561.00	1,100,935,800
太陽誘電	52,700	4,490.00	236,623,000
村田製作所	327,600	7,462.00	2,444,551,200
双葉電子工業	21,000	551.00	11,571,000
北陸電気工業	4,200	1,282.00	5,384,400
ニチコン	22,300	1,235.00	27,540,500
日本ケミコン	10,800	1,618.00	17,474,400
K O A	16,500	1,920.00	31,680,000
市光工業	16,200	372.00	6,026,400
小糸製作所	130,000	2,062.00	268,060,000
ミツバ	20,300	467.00	9,480,100
S C R E E Nホールディングス	18,500	9,450.00	174,825,000
キャノン電子	12,100	1,542.00	18,658,200
キャノン	592,700	2,868.00	1,699,863,600
リコー	270,800	979.00	265,113,200
象印マホービン	32,400	1,538.00	49,831,200
M U T O Hホールディングス	1,600	1,607.00	2,571,200
東京エレクトロン	76,200	45,570.00	3,472,434,000
イノテック	7,400	1,329.00	9,834,600
トヨタ紡織	45,500	1,861.00	84,675,500
芦森工業	2,000	1,396.00	2,792,000
ユニプレス	19,400	774.00	15,015,600
豊田自動織機	79,000	7,710.00	609,090,000
モリタホールディングス	19,000	1,157.00	21,983,000
三櫻工業	16,500	643.00	10,609,500
デンソー	222,800	6,754.00	1,504,791,200
東海理化電機製作所	30,500	1,432.00	43,676,000
川崎重工業	81,400	2,851.00	232,071,400
名村造船所	27,700	365.00	10,110,500
日本車輛製造	4,100	1,968.00	8,068,800
三菱ロジスネクスト	17,200	663.00	11,403,600

近畿車輛	1,500	1,084.00	1,626,000
日産自動車	1,534,500	434.10	666,126,450
いすゞ自動車	314,000	1,538.00	482,932,000
トヨタ自動車	5,931,400	1,889.00	11,204,414,600
日野自動車	139,300	513.00	71,460,900
三菱自動車工業	421,400	489.00	206,064,600
エフテック	7,500	512.00	3,840,000
レシップホールディングス	4,300	458.00	1,969,400
G M B	2,100	711.00	1,493,100
ファルテック	1,700	614.00	1,043,800
武蔵精密工業	26,400	1,674.00	44,193,600
日産車体	19,100	855.00	16,330,500
新明和工業	33,900	1,033.00	35,018,700
極東開発工業	19,000	1,444.00	27,436,000
トピー工業	8,800	1,643.00	14,458,400
ティラド	2,700	2,666.00	7,198,200
曙ブレーキ工業	65,900	149.00	9,819,100
タチエス	17,100	1,166.00	19,938,600
N O K	42,000	1,185.00	49,770,000
フタバ産業	28,900	366.00	10,577,400
K Y B	10,400	3,560.00	37,024,000
大同メタル工業	21,100	485.00	10,233,500
プレス工業	48,300	425.00	20,527,500
ミクニ	12,400	323.00	4,005,200
太平洋工業	24,800	1,044.00	25,891,200
河西工業	14,400	150.00	2,160,000
アイシン	83,300	3,615.00	301,129,500
マツダ	357,300	969.00	346,223,700
今仙電機製作所	6,800	700.00	4,760,000
本田技研工業	878,100	3,093.00	2,715,963,300
スズキ	198,400	4,405.00	873,952,000
S U B A R U	341,800	2,035.00	695,563,000
安永	4,700	658.00	3,092,600
ヤマハ発動機	169,800	3,120.00	529,776,000
T B K	10,700	242.00	2,589,400
エクセディ	17,700	1,644.00	29,098,800
豊田合成	31,500	2,075.00	65,362,500
愛三工業	17,800	713.00	12,691,400
盟和産業	1,500	929.00	1,393,500
日本プラスト	8,500	406.00	3,451,000
ヨロズ	10,100	708.00	7,150,800
エフ・シー・シー	19,100	1,387.00	26,491,700

シマノ	44,200	21,955.00	970,411,000
テイ・エス テック	49,400	1,535.00	75,829,000
ジャムコ	5,900	1,406.00	8,295,400
テルモ	337,500	3,765.00	1,270,687,500
クリエートメディック	3,500	881.00	3,083,500
日機装	27,000	968.00	26,136,000
日本エム・ディ・エム	6,400	843.00	5,395,200
島津製作所	131,600	3,855.00	507,318,000
JMS	10,000	498.00	4,980,000
長野計器	7,900	1,133.00	8,950,700
ブイ・テクノロジー	5,300	2,689.00	14,251,700
東京計器	8,300	1,312.00	10,889,600
愛知時計電機	4,200	1,366.00	5,737,200
インターアクション	6,500	1,538.00	9,997,000
オーバル	9,600	439.00	4,214,400
東京精密	23,700	4,465.00	105,820,500
マニー	47,500	1,878.00	89,205,000
ニコン	167,900	1,234.00	207,188,600
トプコン	56,900	1,574.00	89,560,600
オリンパス	675,300	2,377.00	1,605,188,100
理研計器	6,700	4,555.00	30,518,500
タムロン	8,100	3,120.00	25,272,000
HOYA	230,700	13,680.00	3,155,976,000
シード	5,500	507.00	2,788,500
ノーリツ鋼機	10,200	2,336.00	23,827,200
A & Dホロンホールディングス	15,800	1,040.00	16,432,000
朝日インテック	142,700	2,228.00	317,935,600
シチズン時計	118,800	591.00	70,210,800
リズム	3,400	1,585.00	5,389,000
大研医器	8,100	453.00	3,669,300
メニコン	37,100	2,701.00	100,207,100
シンシア	1,000	503.00	503,000
松風	4,900	2,322.00	11,377,800
セイコーグループ	16,700	2,840.00	47,428,000
ニプロ	90,100	1,032.00	92,983,200
KYORITSU	16,000	121.00	1,936,000
中本パックス	3,300	1,565.00	5,164,500
スノーピーク	18,500	2,192.00	40,552,000
パラマウントベッドホールディングス	24,900	2,480.00	61,752,000
トランザクション	8,300	1,457.00	12,093,100
粧美堂	2,900	350.00	1,015,000
ニホンフラッシュ	10,100	908.00	9,170,800

前田工織	11,700	3,300.00	38,610,000
永大産業	11,500	222.00	2,553,000
アートネイチャー	11,100	754.00	8,369,400
バンダイナムコホールディングス	98,600	8,414.00	829,620,400
アイフィスジャパン	3,000	590.00	1,770,000
SHOEI	11,400	5,140.00	58,596,000
フランスベッドホールディングス	13,400	973.00	13,038,200
パイロットコーポレーション	16,900	4,560.00	77,064,000
萩原工業	7,200	1,174.00	8,452,800
フジシールインターナショナル	21,900	1,630.00	35,697,000
タカラトミー	49,900	1,240.00	61,876,000
広済堂ホールディングス	7,300	1,851.00	13,512,300
エステールホールディングス	2,500	629.00	1,572,500
タカノ	4,000	668.00	2,672,000
プロネクサス	9,000	974.00	8,766,000
ホクシン	8,300	154.00	1,278,200
ウッドワン	3,600	906.00	3,261,600
大建工業	6,600	2,143.00	14,143,800
凸版印刷	141,300	1,945.00	274,828,500
大日本印刷	128,100	2,598.00	332,803,800
共同印刷	3,000	2,765.00	8,295,000
NISSHA	20,500	1,838.00	37,679,000
光村印刷	900	1,166.00	1,049,400
TAKARA & COMPANY	7,400	2,093.00	15,488,200
アシックス	99,700	2,933.00	292,420,100
ツツミ	2,400	1,918.00	4,603,200
ローランド	7,900	3,555.00	28,084,500
小松ウオール工業	4,000	1,849.00	7,396,000
ヤマハ	68,100	4,815.00	327,901,500
河合楽器製作所	2,900	2,557.00	7,415,300
クリナップ	12,100	648.00	7,840,800
ピジョン	68,800	2,015.00	138,632,000
兼松サステック	800	1,591.00	1,272,800
キングジム	9,500	891.00	8,464,500
リンテック	21,700	2,174.00	47,175,800
イトーキ	22,100	686.00	15,160,600
任天堂	682,000	5,535.00	3,774,870,000
三菱鉛筆	15,300	1,395.00	21,343,500
タカラスタンダード	20,900	1,358.00	28,382,200
コクヨ	52,000	1,801.00	93,652,000
ナカバヤシ	11,600	479.00	5,556,400
グローブライド	8,700	2,613.00	22,733,100

オカムラ	32,500	1,412.00	45,890,000
美津濃	10,700	2,768.00	29,617,600
東京電力ホールディングス	973,700	445.00	433,296,500
中部電力	398,100	1,263.00	502,800,300
関西電力	417,100	1,198.00	499,685,800
中国電力	172,000	663.00	114,036,000
北陸電力	102,000	506.00	51,612,000
東北電力	264,100	660.00	174,306,000
四国電力	92,200	718.00	66,199,600
九州電力	249,000	708.00	176,292,000
北海道電力	104,400	444.00	46,353,600
沖縄電力	25,300	1,022.00	25,856,600
電源開発	81,300	2,042.00	166,014,600
エフオン	7,900	512.00	4,044,800
イーレックス	19,200	2,372.00	45,542,400
レノバ	28,700	2,412.00	69,224,400
東京瓦斯	228,400	2,507.00	572,598,800
大阪瓦斯	218,800	2,026.00	443,288,800
東邦瓦斯	42,500	2,360.00	100,300,000
北海道瓦斯	6,400	1,679.00	10,745,600
広島ガス	22,800	342.00	7,797,600
西部ガスホールディングス	10,100	1,727.00	17,442,700
静岡ガス	24,600	1,046.00	25,731,600
メタウォーター	13,500	1,637.00	22,099,500
SBSホールディングス	9,600	2,863.00	27,484,800
東武鉄道	118,700	3,000.00	356,100,000
相鉄ホールディングス	35,700	2,182.00	77,897,400
東急	302,900	1,633.00	494,635,700
京浜急行電鉄	122,500	1,345.00	164,762,500
小田急電鉄	163,700	1,652.00	270,432,400
京王電鉄	57,100	4,575.00	261,232,500
京成電鉄	69,600	3,640.00	253,344,000
富士急行	13,300	4,600.00	61,180,000
東日本旅客鉄道	183,200	7,334.00	1,343,588,800
西日本旅客鉄道	138,000	5,526.00	762,588,000
東海旅客鉄道	83,200	15,950.00	1,327,040,000
西武ホールディングス	130,700	1,476.00	192,913,200
鴻池運輸	18,400	1,490.00	27,416,000
西日本鉄道	28,900	2,376.00	68,666,400
ハマキョウレックス	8,400	3,075.00	25,830,000
サカイ引越センター	5,100	4,310.00	21,981,000
近鉄グループホールディングス	107,800	4,175.00	450,065,000

阪急阪神ホールディングス	143,800	3,825.00	550,035,000
南海電気鉄道	51,500	2,807.00	144,560,500
京阪ホールディングス	44,600	3,510.00	156,546,000
神戸電鉄	2,900	3,185.00	9,236,500
名古屋鉄道	119,200	2,124.00	253,180,800
山陽電気鉄道	8,100	2,182.00	17,674,200
アルプス物流	8,600	1,165.00	10,019,000
ヤマトホールディングス	138,100	2,050.00	283,105,000
山九	27,400	4,720.00	129,328,000
丸運	5,300	218.00	1,155,400
丸全昭和運輸	6,700	2,987.00	20,012,900
センコーグループホールディングス	57,100	976.00	55,729,600
トナミホールディングス	2,400	3,605.00	8,652,000
ニッコンホールディングス	34,500	2,373.00	81,868,500
日本石油輸送	1,100	2,174.00	2,391,400
福山通運	9,000	3,035.00	27,315,000
セイノーホールディングス	67,100	1,170.00	78,507,000
エスライン	3,000	795.00	2,385,000
神奈川中央交通	3,100	3,310.00	10,261,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	26,000	1,611.00	41,886,000
C & F ロジホールディングス	10,400	1,183.00	12,303,200
九州旅客鉄道	76,300	2,880.00	219,744,000
S Gホールディングス	207,000	1,850.00	382,950,000
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	40,300	7,230.00	291,369,000
日本郵船	288,800	3,198.00	923,582,400
商船三井	190,400	3,375.00	642,600,000
川崎汽船	92,200	2,808.00	258,897,600
N Sユナイテッド海運	6,100	3,945.00	24,064,500
飯野海運	40,700	906.00	36,874,200
共栄タンカー	3,100	931.00	2,886,100
乾汽船	14,200	1,982.00	28,144,400
日本航空	264,900	2,720.00	720,528,000
A N Aホールディングス	293,400	2,872.00	842,644,800
パスコ	2,100	1,410.00	2,961,000
トランコム	3,100	7,480.00	23,188,000
日新	8,200	2,131.00	17,474,200
三菱倉庫	23,200	2,908.00	67,465,600
三井倉庫ホールディングス	10,100	3,650.00	36,865,000
住友倉庫	29,600	1,944.00	57,542,400
澁澤倉庫	4,300	2,077.00	8,931,100
東陽倉庫	14,300	267.00	3,818,100
日本トランスシティ	21,700	514.00	11,153,800

ケイヒン	1,900	1,472.00	2,796,800
中央倉庫	5,200	953.00	4,955,600
川西倉庫	1,800	985.00	1,773,000
安田倉庫	7,400	932.00	6,896,800
ファイズホールディングス	2,000	899.00	1,798,000
東洋埠頭	3,100	1,267.00	3,927,700
上組	53,400	2,614.00	139,587,600
サンリツ	2,400	721.00	1,730,400
キムラユニティ	5,100	784.00	3,998,400
キューソー流通システム	6,500	905.00	5,882,500
東海運	6,300	281.00	1,770,300
エーアイティー	6,800	1,435.00	9,758,000
内外トランスライン	3,900	2,130.00	8,307,000
日本コンセプト	3,400	1,502.00	5,106,800
NEC ネットエスアイ	36,300	1,742.00	63,234,600
クロスキャット	6,300	1,493.00	9,405,900
システナ	182,400	404.00	73,689,600
デジタルアーツ	6,900	5,600.00	38,640,000
日鉄ソリューションズ	18,500	3,300.00	61,050,000
キューブシステム	6,600	1,064.00	7,022,400
コア	4,900	1,498.00	7,340,200
手間いらず	1,900	5,120.00	9,728,000
ラクーンホールディングス	10,900	1,162.00	12,665,800
ソリトンシステムズ	5,700	1,159.00	6,606,300
ソフトクリエイトホールディングス	4,500	3,295.00	14,827,500
T I S	121,800	3,620.00	440,916,000
J N S ホールディングス	5,300	310.00	1,643,000
グリー	58,300	696.00	40,576,800
G M O ペパボ	1,600	1,917.00	3,067,200
コーエーテクモホールディングス	67,900	2,369.00	160,855,100
三菱総合研究所	5,300	4,890.00	25,917,000
電算	1,400	1,578.00	2,209,200
A G S	4,700	698.00	3,280,600
ファインデックス	8,900	525.00	4,672,500
ブレインパッド	11,000	741.00	8,151,000
K L a b	21,300	446.00	9,499,800
ポールトゥウィンホールディングス	18,700	861.00	16,100,700
ネクソン	280,100	3,010.00	843,101,000
アイスタイル	34,900	502.00	17,519,800
エムアップホールディングス	13,400	1,305.00	17,487,000
エイチーム	8,200	771.00	6,322,200
エニグモ	14,000	635.00	8,890,000

テクノスジャパン	9,200	465.00	4,278,000
コロプラ	42,200	660.00	27,852,000
ブロードリーフ	63,600	446.00	28,365,600
クロス・マーケティンググループ	4,500	753.00	3,388,500
デジタルハーツホールディングス	6,800	1,774.00	12,063,200
システム情報	9,700	825.00	8,002,500
メディアドゥ	4,400	1,700.00	7,480,000
じげん	31,900	377.00	12,026,300
ブイキューブ	13,200	739.00	9,754,800
エンカレッジ・テクノロジー	2,800	496.00	1,388,800
サイバーリンクス	3,600	1,005.00	3,618,000
フィックスターズ	12,300	1,183.00	14,550,900
CARTA HOLDINGS	5,300	1,675.00	8,877,500
オブティム	9,000	1,130.00	10,170,000
セレス	4,500	995.00	4,477,500
SHIFT	7,900	25,070.00	198,053,000
ティーガイア	11,400	1,639.00	18,684,600
セック	1,500	3,010.00	4,515,000
テクマトリックス	19,900	1,772.00	35,262,800
プロシップ	4,800	1,530.00	7,344,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	33,200	2,156.00	71,579,200
GMOペイメントゲートウェイ	24,800	12,080.00	299,584,000
ザッパラス	4,300	334.00	1,436,200
システムリサーチ	3,400	2,234.00	7,595,600
インターネットイニシアティブ	60,500	2,359.00	142,719,500
さくらインターネット	12,400	501.00	6,212,400
ヴィンクス	3,300	1,470.00	4,851,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,300	4,255.00	14,041,500
SRAホールディングス	5,600	3,060.00	17,136,000
システムインテグレータ	3,500	420.00	1,470,000
朝日ネット	11,900	589.00	7,009,100
eBASE	15,500	577.00	8,943,500
アバントグループ	13,800	1,422.00	19,623,600
アドソル日進	4,600	1,349.00	6,205,400
ODKソリューションズ	2,600	607.00	1,578,200
フリービット	6,800	1,100.00	7,480,000
コムチュア	14,400	2,414.00	34,761,600
サイバーコム	1,800	1,439.00	2,590,200
アステリア	8,700	775.00	6,742,500
アイル	6,100	1,875.00	11,437,500
マークライnz	5,900	2,629.00	15,511,100
メディカル・データ・ビジョン	16,300	938.00	15,289,400

g u m i	17,800	839.00	14,934,200
ショーケース	2,900	312.00	904,800
モバイルファクトリー	2,400	904.00	2,169,600
テラスカイ	4,700	1,884.00	8,854,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,700	1,783.00	10,163,100
P C Iホールディングス	4,600	1,016.00	4,673,600
アイビーシー	2,000	396.00	792,000
ネオジャパン	3,700	1,008.00	3,729,600
P R T I M E S	2,800	1,845.00	5,166,000
ラクス	51,300	1,824.00	93,571,200
ランドコンピュータ	2,800	940.00	2,632,000
ダブルスタンダード	4,400	2,206.00	9,706,400
オープンドア	7,600	1,823.00	13,854,800
マイネット	3,800	365.00	1,387,000
アカツキ	5,200	2,244.00	11,668,800
ベネフィットジャパン	800	1,229.00	983,200
U b i c o mホールディングス	3,400	2,281.00	7,755,400
カナミックネットワーク	15,800	569.00	8,990,200
ノムラシステムコーポレーション	11,200	116.00	1,299,200
チェンジ	26,600	2,373.00	63,121,800
シンクロ・フード	7,100	456.00	3,237,600
オークネット	5,700	1,785.00	10,174,500
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	594.00	1,366,200
セグエグループ	3,100	873.00	2,706,300
エイトレッド	1,700	1,448.00	2,461,600
マクロミル	24,700	1,078.00	26,626,600
ビーグリー	1,900	1,155.00	2,194,500
オロ	3,300	1,882.00	6,210,600
ユーザーローカル	4,000	1,255.00	5,020,000
テモナ	2,600	282.00	733,200
ニーズウェル	3,500	790.00	2,765,000
マネーフォワード	26,100	4,800.00	125,280,000
サインポスト	4,200	590.00	2,478,000
電算システムホールディングス	5,300	2,150.00	11,395,000
ソルクシーズ	9,100	349.00	3,175,900
フェイス	3,300	497.00	1,640,100
プロトコーポレーション	13,700	1,191.00	16,316,700
ハイマックス	3,500	1,470.00	5,145,000
野村総合研究所	222,300	3,235.00	719,140,500
サイバネットシステム	9,200	981.00	9,025,200
C Eホールディングス	5,800	501.00	2,905,800
日本システム技術	4,600	1,680.00	7,728,000

インテージホールディングス	14,800	1,519.00	22,481,200
東邦システムサイエンス	3,200	995.00	3,184,000
ソースネクスト	55,500	305.00	16,927,500
インフォコム	14,000	2,157.00	30,198,000
シンプレクス・ホールディングス	18,200	2,221.00	40,422,200
HEROZ	3,800	1,026.00	3,898,800
ラクスル	15,300	2,961.00	45,303,300
メルカリ	48,800	2,716.00	132,540,800
I P S	3,600	2,837.00	10,213,200
F I G	12,800	375.00	4,800,000
システムサポート	4,700	1,520.00	7,144,000
イーソル	7,100	760.00	5,396,000
アルテリア・ネットワークス	10,200	1,245.00	12,699,000
東海ソフト	1,900	940.00	1,786,000
ウイングアーク1st	11,200	1,911.00	21,403,200
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,000	1,634.00	4,902,000
サーバーワークス	2,200	2,554.00	5,618,800
東名	900	2,064.00	1,857,600
ヴィッツ	1,200	955.00	1,146,000
トピラシステムズ	2,900	813.00	2,357,700
S a n s a n	40,600	1,632.00	66,259,200
L i n k - U	2,200	979.00	2,153,800
ギフトィ	11,700	2,032.00	23,774,400
メドレー	10,900	4,650.00	50,685,000
ベース	3,700	4,140.00	15,318,000
J M D C	17,800	4,205.00	74,849,000
フォーカスシステムズ	8,000	1,074.00	8,592,000
クレスコ	8,400	1,834.00	15,405,600
フジ・メディア・ホールディングス	104,200	1,052.00	109,618,400
オービック	36,200	20,300.00	734,860,000
ジャストシステム	15,600	3,140.00	48,984,000
T D C ソフト	9,200	1,512.00	13,910,400
Zホールディングス	1,542,100	372.10	573,815,410
トレンドマイクロ	62,600	6,220.00	389,372,000
I Dホールディングス	7,400	940.00	6,956,000
日本オラクル	20,700	8,660.00	179,262,000
アルファシステムズ	3,400	4,080.00	13,872,000
フューチャー	27,000	1,664.00	44,928,000
C A C H o l d i n g s	6,700	1,457.00	9,761,900
S Bテクノロジー	4,700	1,909.00	8,972,300
トーセ	3,000	741.00	2,223,000
オービックビジネスコンサルタント	21,400	4,675.00	100,045,000

伊藤忠テクノソリューションズ	58,200	3,070.00	178,674,000
アイティフォー	14,400	843.00	12,139,200
東計電算	1,500	5,240.00	7,860,000
エクスネット	1,600	1,005.00	1,608,000
大塚商会	61,400	4,165.00	255,731,000
サイボウズ	15,000	2,538.00	38,070,000
電通国際情報サービス	13,200	4,135.00	54,582,000
A C C E S S	13,000	954.00	12,402,000
デジタルガレージ	19,300	4,535.00	87,525,500
E Mシステムズ	18,200	870.00	15,834,000
ウェザーニューズ	3,800	7,070.00	26,866,000
C I J	10,000	904.00	9,040,000
ビジネスエンジニアリング	2,300	2,380.00	5,474,000
日本エンタープライズ	12,200	127.00	1,549,400
WOWOW	6,200	1,262.00	7,824,400
スカラ	10,900	724.00	7,891,600
インテリジェント ウェイブ	5,900	730.00	4,307,000
WOW WORLD GROUP	2,000	1,099.00	2,198,000
I M A G I C A GROUP	9,200	668.00	6,145,600
ネットワンシステムズ	40,400	3,465.00	139,986,000
システムソフト	39,100	89.00	3,479,900
アルゴグラフィックス	10,000	3,745.00	37,450,000
マーベラス	17,800	688.00	12,246,400
エイベックス	18,500	1,720.00	31,820,000
B I P R O G Y	39,900	3,335.00	133,066,500
兼松エレクトロニクス	7,000	4,610.00	32,270,000
都築電気	5,800	1,341.00	7,777,800
T B Sホールディングス	55,500	1,485.00	82,417,500
日本テレビホールディングス	96,000	1,019.00	97,824,000
朝日放送グループホールディングス	10,300	643.00	6,622,900
テレビ朝日ホールディングス	26,400	1,300.00	34,320,000
スカパーJ S A Tホールディングス	96,400	496.00	47,814,400
テレビ東京ホールディングス	7,900	1,898.00	14,994,200
日本BS放送	4,000	915.00	3,660,000
ビジョン	14,300	1,437.00	20,549,100
スマートバリュー	2,900	422.00	1,223,800
U S E N - N E X T HOLDINGS	9,800	2,126.00	20,834,800
ワイヤレスゲート	5,200	253.00	1,315,600
コネクシオ	7,300	1,909.00	13,935,700
クロップス	1,900	993.00	1,886,700
日本電信電話	1,388,200	3,830.00	5,316,806,000
K D D I	837,200	4,021.00	3,366,381,200

ソフトバンク	1,740,500	1,479.00	2,574,199,500
光通信	12,700	18,290.00	232,283,000
エムティーアイ	10,100	510.00	5,151,000
GMOインターネットグループ	40,300	2,550.00	102,765,000
ファイバーゲート	6,000	928.00	5,568,000
アイドママーケティングコミュニケーション	2,900	275.00	797,500
KADOKAWA	57,300	2,433.00	139,410,900
学研ホールディングス	18,200	958.00	17,435,600
ゼンリン	18,700	797.00	14,903,900
昭文社ホールディングス	5,100	286.00	1,458,600
インプレスホールディングス	10,100	203.00	2,050,300
アイネット	6,700	1,335.00	8,944,500
松竹	6,200	10,570.00	65,534,000
東宝	67,800	4,650.00	315,270,000
東映	3,000	17,070.00	51,210,000
エヌ・ティ・ティ・データ	340,000	1,954.00	664,360,000
ピー・シー・エー	6,600	1,339.00	8,837,400
ビジネスブレイン太田昭和	4,700	1,990.00	9,353,000
D T S	23,500	2,969.00	69,771,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	54,500	6,190.00	337,355,000
シーイーシー	15,300	1,491.00	22,812,300
カブコン	107,700	4,115.00	443,185,500
アイ・エス・ビー	5,600	1,206.00	6,753,600
ジャステック	6,800	1,211.00	8,234,800
S C S K	88,500	2,031.00	179,743,500
N S W	4,300	2,060.00	8,858,000
アイネス	7,700	1,344.00	10,348,800
T K C	19,500	3,495.00	68,152,500
富士ソフト	12,300	7,680.00	94,464,000
N S D	38,700	2,288.00	88,545,600
コナミグループ	46,400	6,210.00	288,144,000
福井コンピュータホールディングス	7,600	2,824.00	21,462,400
J B C Cホールディングス	8,000	1,848.00	14,784,000
ミロク情報サービス	9,900	1,522.00	15,067,800
ソフトバンクグループ	626,400	5,984.00	3,748,377,600
高千穂交易	4,100	2,264.00	9,282,400
オルバヘルスケアホールディングス	1,900	1,521.00	2,889,900
伊藤忠食品	2,600	4,925.00	12,805,000
エレマテック	10,300	1,664.00	17,139,200
あらた	8,700	4,110.00	35,757,000
トーメンデバイス	1,700	5,840.00	9,928,000
東京エレクトロン デバイス	4,200	7,610.00	31,962,000

円谷フィールズホールディングス	9,800	2,323.00	22,765,400
双日	121,300	2,539.00	307,980,700
アルフレッサ ホールディングス	114,700	1,609.00	184,552,300
横浜冷凍	31,100	1,068.00	33,214,800
ラサ商事	5,300	1,210.00	6,413,000
アルコニックス	15,100	1,363.00	20,581,300
神戸物産	88,400	3,885.00	343,434,000
ハイパー	2,200	446.00	981,200
あい ホールディングス	18,300	2,123.00	38,850,900
ディーブイエックス	3,200	1,051.00	3,363,200
ダイワボウホールディングス	46,700	1,931.00	90,177,700
マクニカホールディングス	28,000	3,285.00	91,980,000
ラクト・ジャパン	4,400	1,989.00	8,751,600
グリムス	4,800	2,100.00	10,080,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	16,700	832.00	13,894,400
八洲電機	9,300	1,086.00	10,099,800
メディアスホールディングス	7,300	734.00	5,358,200
レスターホールディングス	10,900	2,149.00	23,424,100
ジューテックホールディングス	2,700	1,227.00	3,312,900
大光	4,900	633.00	3,101,700
O C H Iホールディングス	2,600	1,302.00	3,385,200
T O K A Iホールディングス	56,500	845.00	47,742,500
黒谷	3,200	612.00	1,958,400
C o m i n i x	2,300	741.00	1,704,300
三洋貿易	11,700	1,133.00	13,256,100
ビューティガレージ	2,100	3,510.00	7,371,000
ウイン・パートナーズ	8,300	997.00	8,275,100
ミタチ産業	2,900	1,127.00	3,268,300
シップヘルスケアホールディングス	41,100	2,545.00	104,599,500
明治電機工業	4,300	1,115.00	4,794,500
デリカフーズホールディングス	4,500	511.00	2,299,500
スターティアホールディングス	2,300	1,042.00	2,396,600
コメダホールディングス	28,000	2,393.00	67,004,000
ピーバンドットコム	1,700	518.00	880,600
アセンテック	3,900	485.00	1,891,500
富士興産	2,600	1,244.00	3,234,400
協栄産業	1,100	1,766.00	1,942,600
フルサト・マルカホールディングス	11,400	3,305.00	37,677,000
ヤマエグループホールディングス	6,500	1,395.00	9,067,500
小野建	10,500	1,521.00	15,970,500
南陽	2,200	1,979.00	4,353,800
佐島電機	7,200	1,418.00	10,209,600

エコトレーディング	2,200	728.00	1,601,600	
伯東	6,500	4,365.00	28,372,500	
コンドーテック	8,800	1,005.00	8,844,000	
中山福	6,100	324.00	1,976,400	
ナガイレーベン	14,400	1,926.00	27,734,400	
三菱食品	10,600	3,070.00	32,542,000	
松田産業	8,700	2,314.00	20,131,800	
第一興商	22,100	3,930.00	86,853,000	
メディカルホールディングス	118,500	1,704.00	201,924,000	
S P K	5,100	1,475.00	7,522,500	
萩原電気ホールディングス	4,400	2,601.00	11,444,400	
アズワン	16,700	5,680.00	94,856,000	
スズデン	4,000	2,340.00	9,360,000	
尾家産業	2,700	908.00	2,451,600	
シモジマ	7,900	932.00	7,362,800	
ドウシシャ	12,100	1,616.00	19,553,600	
小津産業	2,500	1,548.00	3,870,000	
高速	5,900	1,818.00	10,726,200	
たけびし	4,400	1,562.00	6,872,800	
リックス	2,400	2,196.00	5,270,400	
丸文	10,200	1,034.00	10,546,800	
ハピネット	9,700	2,011.00	19,506,700	
橋本総業ホールディングス	4,500	1,054.00	4,743,000	
日本ライフライン	33,500	945.00	31,657,500	
タカショー	10,000	668.00	6,680,000	
I D O M	34,600	796.00	27,541,600	
進和	7,600	2,108.00	16,020,800	
エスケイジャパン	2,800	547.00	1,531,600	
ダイトロン	4,500	2,396.00	10,782,000	
シークス	16,300	1,333.00	21,727,900	
田中商事	3,300	569.00	1,877,700	
オーハシテクニカ	5,700	1,512.00	8,618,400	
白銅	4,100	2,628.00	10,774,800	
ダイコー通産	1,400	1,080.00	1,512,000	
伊藤忠商事	704,200	4,128.00	2,906,937,600	
丸紅	902,300	1,564.00	1,411,197,200	
高島	1,800	2,937.00	5,286,600	
長瀬産業	53,700	2,023.00	108,635,100	
蝶理	6,100	2,265.00	13,816,500	
豊田通商	100,100	5,220.00	522,522,000	
三共生興	16,500	482.00	7,953,000	
兼松	44,400	1,498.00	66,511,200	

ツカモトコーポレーション	1,600	1,401.00	2,241,600
三井物産	836,300	3,857.00	3,225,609,100
日本紙パルプ商事	6,100	4,825.00	29,432,500
カメイ	12,200	1,311.00	15,994,200
東都水産	600	5,190.00	3,114,000
OUGホールディングス	1,700	2,361.00	4,013,700
スターゼン	8,700	2,089.00	18,174,300
山善	30,800	1,029.00	31,693,200
椿本興業	1,800	4,060.00	7,308,000
住友商事	707,800	2,280.50	1,614,137,900
内田洋行	5,100	4,650.00	23,715,000
三菱商事	714,600	4,358.00	3,114,226,800
第一実業	4,000	4,445.00	17,780,000
キャノンマーケティングジャパン	26,500	2,959.00	78,413,500
西華産業	4,500	1,624.00	7,308,000
佐藤商事	7,900	1,318.00	10,412,200
菱洋エレクトロ	9,800	2,381.00	23,333,800
東京産業	10,500	756.00	7,938,000
ユアサ商事	10,300	3,565.00	36,719,500
神鋼商事	2,900	5,590.00	16,211,000
トルク	6,200	206.00	1,277,200
阪和興業	20,500	3,975.00	81,487,500
正栄食品工業	7,600	4,065.00	30,894,000
カナデン	9,300	1,117.00	10,388,100
菱電商事	9,200	1,736.00	15,971,200
岩谷産業	26,000	5,560.00	144,560,000
ナイス	3,100	1,260.00	3,906,000
ニチモウ	1,300	2,903.00	3,773,900
極東貿易	6,800	1,430.00	9,724,000
アステナホールディングス	19,800	408.00	8,078,400
三愛オブリ	31,600	1,294.00	40,890,400
稲畑産業	23,100	2,469.00	57,033,900
G S Iクレオス	6,700	1,498.00	10,036,600
明和産業	15,200	666.00	10,123,200
クワザワホールディングス	3,700	431.00	1,594,700
ワキタ	21,000	1,177.00	24,717,000
東邦ホールディングス	28,500	2,081.00	59,308,500
サンゲツ	28,700	2,227.00	63,914,900
ミツウロコグループホールディングス	14,700	1,118.00	16,434,600
シナネンホールディングス	3,700	3,855.00	14,263,500
伊藤忠エネクス	28,400	1,084.00	30,785,600
サンリオ	32,400	4,535.00	146,934,000

サンワテクノス	5,800	1,665.00	9,657,000
リョーサン	12,100	3,045.00	36,844,500
新光商事	15,400	1,281.00	19,727,400
トーホー	4,900	1,569.00	7,688,100
三信電気	4,600	2,446.00	11,251,600
東陽テクニカ	12,700	1,362.00	17,297,400
モスフードサービス	16,800	3,050.00	51,240,000
加賀電子	9,300	4,220.00	39,246,000
ソーダニッカ	8,400	724.00	6,081,600
立花エレテック	8,400	1,790.00	15,036,000
フォーバル	4,500	1,030.00	4,635,000
PALTAC	18,000	4,660.00	83,880,000
三谷産業	20,000	317.00	6,340,000
西本Wismettacホールディングス	2,900	3,495.00	10,135,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,654.00	1,654,000
コア商事ホールディングス	8,000	644.00	5,152,000
KPPグループホールディングス	26,700	784.00	20,932,800
ヤマタネ	5,100	1,677.00	8,552,700
丸紅建材リース	1,000	1,726.00	1,726,000
日鉄物産	7,800	9,250.00	72,150,000
泉州電業	5,700	3,185.00	18,154,500
トラスコ中山	24,000	2,023.00	48,552,000
オートバックスセブン	39,800	1,415.00	56,317,000
モリト	8,200	950.00	7,790,000
加藤産業	13,900	3,560.00	49,484,000
北恵	2,600	674.00	1,752,400
イエローハット	20,200	1,719.00	34,723,800
JKホールディングス	9,000	1,041.00	9,369,000
日伝	6,800	1,770.00	12,036,000
北沢産業	6,200	222.00	1,376,400
杉本商事	5,100	2,000.00	10,200,000
因幡電機産業	29,600	2,699.00	79,890,400
東テク	3,800	3,555.00	13,509,000
ミスミグループ本社	172,500	3,180.00	548,550,000
アルテック	6,400	264.00	1,689,600
タキヒヨー	2,800	893.00	2,500,400
蔵王産業	1,900	1,790.00	3,401,000
スズケン	36,200	3,340.00	120,908,000
ジェコス	7,400	889.00	6,578,600
グローセル	12,600	412.00	5,191,200
ローソン	28,400	5,090.00	144,556,000
サンエー	8,800	4,110.00	36,168,000

カワチ薬品	9,000	2,246.00	20,214,000
エービーシー・マート	16,700	6,900.00	115,230,000
ハードオフコーポレーション	4,700	1,226.00	5,762,200
アスクル	27,700	1,738.00	48,142,600
ゲオホールディングス	12,100	1,847.00	22,348,700
アダストリア	13,900	2,169.00	30,149,100
くら寿司	13,400	3,070.00	41,138,000
キャンドウ	4,200	2,279.00	9,571,800
I Kホールディングス	4,100	385.00	1,578,500
パルグループホールディングス	11,300	2,674.00	30,216,200
エディオン	45,400	1,281.00	58,157,400
サーラコーポレーション	24,300	742.00	18,030,600
ワッツ	5,800	680.00	3,944,000
ハローズ	5,300	3,075.00	16,297,500
フジオフードグループ本社	9,500	1,423.00	13,518,500
あみやき亭	2,800	2,898.00	8,114,400
大黒天物産	4,100	4,910.00	20,131,000
ハニーズホールディングス	10,300	1,421.00	14,636,300
ファーマライズホールディングス	2,800	614.00	1,719,200
アルペン	9,500	1,910.00	18,145,000
ハブ	4,000	660.00	2,640,000
クオールホールディングス	15,900	1,163.00	18,491,700
ジinzホールディングス	6,800	4,060.00	27,608,000
ビックカメラ	76,200	1,193.00	90,906,600
D C Mホールディングス	69,900	1,174.00	82,062,600
Monotaro	162,100	1,988.00	322,254,800
東京一番フーズ	3,000	482.00	1,446,000
きちりホールディングス	3,100	572.00	1,773,200
アーランドサービスホールディングス	9,400	2,161.00	20,313,400
J.フロント リテイリング	142,200	1,194.00	169,786,800
ドトール・日レスホールディングス	20,400	1,766.00	36,026,400
マツキヨココカラ&カンパニー	69,300	6,470.00	448,371,000
broncoビリー	6,200	2,434.00	15,090,800
Z O Z O	75,600	3,225.00	243,810,000
トレジャー・ファクトリー	3,500	2,230.00	7,805,000
物語コーポレーション	6,400	6,640.00	42,496,000
三越伊勢丹ホールディングス	192,500	1,391.00	267,767,500
Hamee	4,900	735.00	3,601,500
マーケットエンタープライズ	1,400	991.00	1,387,400
ウエルシアホールディングス	59,300	2,914.00	172,800,200
クリエイティブSDホールディングス	19,000	3,405.00	64,695,000
丸善CHIホールディングス	14,100	325.00	4,582,500

ミサワ	2,400	675.00	1,620,000
ティーライフ	1,700	1,283.00	2,181,100
チムニー	3,500	1,115.00	3,902,500
シュッピン	8,700	1,134.00	9,865,800
オイシックス・ラ・大地	15,400	2,208.00	34,003,200
ネクステージ	26,200	2,651.00	69,456,200
ジョイフル本田	36,900	1,920.00	70,848,000
鳥貴族ホールディングス	4,300	2,099.00	9,025,700
ホットランド	8,900	1,415.00	12,593,500
すかいらーくホールディングス	156,400	1,520.00	237,728,000
SFPホールディングス	6,300	1,743.00	10,980,900
綿半ホールディングス	9,000	1,370.00	12,330,000
ヨシックスホールディングス	2,300	2,144.00	4,931,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	37,400	1,111.00	41,551,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,300	1,561.00	8,273,300
B E E N O S	6,600	1,960.00	12,936,000
あさひ	9,700	1,401.00	13,589,700
日本調剤	7,900	1,170.00	9,243,000
コスモス薬品	12,900	13,000.00	167,700,000
トーエル	5,300	736.00	3,900,800
セブン&アイ・ホールディングス	393,900	6,047.00	2,381,913,300
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	86,000	962.00	82,732,000
ツルハホールディングス	28,000	9,570.00	267,960,000
サンマルクホールディングス	9,300	1,715.00	15,949,500
フェリシモ	2,700	994.00	2,683,800
トリドールホールディングス	28,500	2,775.00	79,087,500
T O K Y O B A S E	12,500	354.00	4,425,000
ウイルプラスホールディングス	2,400	1,097.00	2,632,800
J Mホールディングス	9,800	1,767.00	17,316,600
サツドラホールディングス	5,400	762.00	4,114,800
アレンザホールディングス	8,700	1,030.00	8,961,000
串カツ田中ホールディングス	3,200	1,658.00	5,305,600
パロックジャパンリミテッド	7,600	839.00	6,376,400
クスリのアオキホールディングス	11,500	7,460.00	85,790,000
力の源ホールディングス	6,600	996.00	6,573,600
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	65,700	3,020.00	198,414,000
メディカルシステムネットワーク	10,400	405.00	4,212,000
はるやまホールディングス	5,200	431.00	2,241,200
ノジマ	37,400	1,368.00	51,163,200
カッパ・クリエイト	18,000	1,428.00	25,704,000

ライトオン	8,600	562.00	4,833,200
良品計画	147,600	1,398.00	206,344,800
パリティホールディングス	15,000	263.00	3,945,000
アドヴァングループ	11,100	874.00	9,701,400
アルビス	3,800	2,395.00	9,101,000
コナカ	12,500	337.00	4,212,500
ハウス オブ ローゼ	1,500	1,623.00	2,434,500
G - 7ホールディングス	14,400	1,579.00	22,737,600
イオン北海道	17,000	955.00	16,235,000
コジマ	22,400	563.00	12,611,200
ヒマラヤ	3,800	928.00	3,526,400
コーナン商事	15,500	3,275.00	50,762,500
エコス	4,300	1,843.00	7,924,900
ワタミ	13,800	972.00	13,413,600
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	256,400	2,319.00	594,591,600
西松屋チェーン	25,400	1,524.00	38,709,600
ゼンショーホールディングス	62,600	3,315.00	207,519,000
幸楽苑ホールディングス	7,500	1,073.00	8,047,500
ハークスレイ	4,300	817.00	3,513,100
サイゼリヤ	19,100	3,210.00	61,311,000
V Tホールディングス	43,800	490.00	21,462,000
魚力	3,600	2,164.00	7,790,400
フジ・コーポレーション	6,600	1,321.00	8,718,600
ユナイテッドアローズ	12,300	1,729.00	21,266,700
ハイデイ日高	17,100	2,021.00	34,559,100
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	7,800	199.00	1,552,200
コロワイド	52,700	1,803.00	95,018,100
ピーシーデボコーポレーション	13,500	281.00	3,793,500
壱番屋	9,100	4,670.00	42,497,000
P L A N T	2,900	662.00	1,919,800
スギホールディングス	23,100	5,780.00	133,518,000
薬王堂ホールディングス	6,400	2,646.00	16,934,400
スクロール	17,200	724.00	12,452,800
ヨンドシーホールディングス	9,900	1,766.00	17,483,400
木曽路	17,400	2,119.00	36,870,600
S R Sホールディングス	19,100	890.00	16,999,000
千趣会	21,500	392.00	8,428,000
リテールパートナーズ	17,100	1,317.00	22,520,700
ケーヨー	18,600	891.00	16,572,600
上新電機	10,300	1,945.00	20,033,500
日本瓦斯	61,300	2,058.00	126,155,400

ロイヤルホールディングス	22,200	2,415.00	53,613,000
いなげや	11,200	1,294.00	14,492,800
チヨダ	11,200	789.00	8,836,800
ライフコーポレーション	10,000	2,750.00	27,500,000
リンガーハット	14,700	2,261.00	33,236,700
MrMaxHD	16,300	659.00	10,741,700
AOKIホールディングス	21,500	673.00	14,469,500
オークワ	18,400	905.00	16,652,000
コメリ	17,700	2,637.00	46,674,900
青山商事	24,600	864.00	21,254,400
しまむら	13,400	12,600.00	168,840,000
はせがわ	6,000	331.00	1,986,000
高島屋	86,200	1,762.00	151,884,400
松屋	19,500	1,104.00	21,528,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	55,700	1,254.00	69,847,800
近鉄百貨店	3,800	2,578.00	9,796,400
丸井グループ	84,400	2,175.00	183,570,000
アクシアル リテイリング	7,900	3,380.00	26,702,000
イオン	387,500	2,570.00	995,875,000
イズミ	17,400	2,883.00	50,164,200
平和堂	19,200	2,093.00	40,185,600
フジ	17,600	1,845.00	32,472,000
ヤオコー	13,000	6,680.00	86,840,000
ゼビオホールディングス	15,700	917.00	14,396,900
ケーズホールディングス	91,100	1,132.00	103,125,200
Olympicグループ	4,600	507.00	2,332,200
日産東京販売ホールディングス	15,200	292.00	4,438,400
シルバーライフ	2,700	1,705.00	4,603,500
Genky DrugStores	5,700	3,690.00	21,033,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,100	914.00	1,919,400
ブックオフグループホールディングス	6,900	1,154.00	7,962,600
ギフトホールディングス	2,500	4,380.00	10,950,000
アインホールディングス	15,800	5,750.00	90,850,000
元気寿司	3,700	2,997.00	11,088,900
ヤマダホールディングス	469,000	463.00	217,147,000
アーケランズ	16,800	1,440.00	24,192,000
ニトリホールディングス	46,200	16,610.00	767,382,000
グルメ杵屋	9,500	1,009.00	9,585,500
愛眼	8,400	166.00	1,394,400
ケーユーホールディングス	6,800	1,391.00	9,458,800
吉野家ホールディングス	44,800	2,324.00	104,115,200
松屋フーズホールディングス	5,400	3,990.00	21,546,000

サガミホールディングス	18,500	1,224.00	22,644,000
関西フードマーケット	10,500	1,305.00	13,702,500
王将フードサービス	7,600	5,930.00	45,068,000
ミニストップ	8,400	1,413.00	11,869,200
アークス	21,000	2,132.00	44,772,000
パローホールディングス	21,900	1,839.00	40,274,100
ベルク	5,700	5,430.00	30,951,000
大庄	6,400	1,033.00	6,611,200
ファーストリテイリング	17,100	77,450.00	1,324,395,000
サンドラッグ	43,400	3,620.00	157,108,000
サックスパー ホールディングス	11,100	774.00	8,591,400
ヤマザワ	2,200	1,297.00	2,853,400
やまや	2,400	2,517.00	6,040,800
ベルーナ	27,800	683.00	18,987,400
いよぎんホールディングス	126,600	724.00	91,658,400
しずおかフィナンシャルグループ	240,400	1,067.00	256,506,800
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	89,600	939.00	84,134,400
島根銀行	3,700	487.00	1,801,900
じもとホールディングス	7,000	436.00	3,052,000
めぶきフィナンシャルグループ	527,900	326.00	172,095,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,600	2,780.00	37,808,000
九州フィナンシャルグループ	187,200	459.00	85,924,800
ゆうちょ銀行	302,900	1,130.00	342,277,000
富山第一銀行	26,500	631.00	16,721,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	586,400	564.00	330,729,600
西日本フィナンシャルホールディングス	67,400	1,044.00	70,365,600
三十三フィナンシャルグループ	9,500	1,632.00	15,504,000
第四北越フィナンシャルグループ	16,700	2,872.00	47,962,400
ひろぎんホールディングス	138,800	651.00	90,358,800
おきなわフィナンシャルグループ	10,100	2,326.00	23,492,600
十六フィナンシャルグループ	13,800	2,967.00	40,944,600
北國フィナンシャルホールディングス	9,000	4,325.00	38,925,000
プロクレアホールディングス	13,000	2,230.00	28,990,000
あいちフィナンシャルグループ	14,900	2,309.00	34,404,100
S B I 新生銀行	31,400	2,285.00	71,749,000
あおぞら銀行	66,900	2,634.00	176,214,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,754,900	936.80	6,327,990,320
りそなホールディングス	1,357,800	716.80	973,271,040
三井住友トラスト・ホールディングス	193,300	4,675.00	903,677,500
三井住友フィナンシャルグループ	777,400	5,519.00	4,290,470,600
千葉銀行	296,500	956.00	283,454,000
群馬銀行	206,400	492.00	101,548,800

武蔵野銀行	13,700	2,172.00	29,756,400
千葉興業銀行	24,900	463.00	11,528,700
筑波銀行	46,700	236.00	11,021,200
七十七銀行	34,100	2,169.00	73,962,900
秋田銀行	7,100	1,791.00	12,716,100
山形銀行	11,800	1,251.00	14,761,800
岩手銀行	7,300	2,032.00	14,833,600
東邦銀行	84,100	232.00	19,511,200
東北銀行	5,200	1,017.00	5,288,400
ふくおかフィナンシャルグループ	84,900	2,975.00	252,577,500
スルガ銀行	93,800	414.00	38,833,200
八十二銀行	218,200	554.00	120,882,800
山梨中央銀行	10,900	1,156.00	12,600,400
大垣共立銀行	20,300	1,884.00	38,245,200
福井銀行	9,500	1,581.00	15,019,500
清水銀行	4,200	1,530.00	6,426,000
富山銀行	1,600	1,806.00	2,889,600
滋賀銀行	17,700	2,807.00	49,683,900
南都銀行	16,000	2,585.00	41,360,000
百五銀行	100,100	400.00	40,040,000
京都銀行	33,700	5,960.00	200,852,000
紀陽銀行	38,100	1,582.00	60,274,200
ほくほくフィナンシャルグループ	67,600	988.00	66,788,800
山陰合同銀行	66,600	780.00	51,948,000
鳥取銀行	3,400	1,149.00	3,906,600
百十四銀行	9,700	1,990.00	19,303,000
四国銀行	16,900	977.00	16,511,300
阿波銀行	15,700	2,102.00	33,001,400
大分銀行	6,400	2,097.00	13,420,800
宮崎銀行	6,900	2,573.00	17,753,700
佐賀銀行	6,200	1,765.00	10,943,000
琉球銀行	24,400	920.00	22,448,000
セブン銀行	381,100	262.00	99,848,200
みずほフィナンシャルグループ	1,538,600	1,993.00	3,066,429,800
高知銀行	3,600	717.00	2,581,200
山口フィナンシャルグループ	117,500	871.00	102,342,500
長野銀行	3,300	1,398.00	4,613,400
名古屋銀行	7,000	3,440.00	24,080,000
北洋銀行	161,200	268.00	43,201,600
大光銀行	3,200	1,224.00	3,916,800
愛媛銀行	14,300	889.00	12,712,700
トマト銀行	3,500	1,037.00	3,629,500

京葉銀行	49,400	594.00	29,343,600
栃木銀行	48,700	303.00	14,756,100
北日本銀行	3,700	2,194.00	8,117,800
東和銀行	19,500	600.00	11,700,000
福島銀行	11,200	250.00	2,800,000
大東銀行	4,200	723.00	3,036,600
トモニホールディングス	86,000	384.00	33,024,000
フィデアホールディングス	11,000	1,452.00	15,972,000
池田泉州ホールディングス	136,200	250.00	34,050,000
F P G	43,300	1,057.00	45,768,100
ジャパンインベストメントアドバイザー	8,800	1,188.00	10,454,400
マーキュリアホールディングス	6,500	593.00	3,854,500
S B Iホールディングス	154,000	2,694.00	414,876,000
ジャフコ グループ	35,600	2,376.00	84,585,600
大和証券グループ本社	761,000	602.00	458,122,000
野村ホールディングス	1,959,600	511.10	1,001,551,560
岡三証券グループ	93,800	415.00	38,927,000
丸三証券	35,700	422.00	15,065,400
東洋証券	35,800	281.00	10,059,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	116,200	377.00	43,807,400
光世証券	2,800	365.00	1,022,000
水戸証券	29,200	293.00	8,555,600
いちよし証券	19,800	624.00	12,355,200
松井証券	63,000	773.00	48,699,000
マネックスグループ	119,200	487.00	58,050,400
極東証券	13,500	600.00	8,100,000
岩井コスモホールディングス	12,200	1,350.00	16,470,000
アイザワ証券グループ	15,600	713.00	11,122,800
マネーパートナーズグループ	11,500	261.00	3,001,500
スパークス・グループ	11,900	1,749.00	20,813,100
かんぽ生命保険	129,200	2,314.00	298,968,800
S O M P Oホールディングス	182,600	5,667.00	1,034,794,200
アニコム ホールディングス	36,100	605.00	21,840,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	216,500	4,166.00	901,939,000
第一生命ホールディングス	541,600	2,984.00	1,616,134,400
東京海上ホールディングス	1,071,300	2,720.00	2,913,936,000
T & Dホールディングス	285,500	1,987.00	567,288,500
アドバンスクリエイト	6,200	1,139.00	7,061,800
全国保証	27,900	4,820.00	134,478,000
あんしん保証	6,800	257.00	1,747,600
イントラスト	4,600	857.00	3,942,200
日本モーゲージサービス	6,300	869.00	5,474,700

C a s a	4,500	873.00	3,928,500
アルヒ	14,400	1,012.00	14,572,800
プレミアグループ	18,100	1,606.00	29,068,600
ネットプロテクションズホールディングス	36,000	546.00	19,656,000
クレディセゾン	67,700	1,651.00	111,772,700
芙蓉総合リース	9,800	8,680.00	85,064,000
みずほリース	16,000	3,415.00	54,640,000
東京センチュリー	20,000	4,480.00	89,600,000
日本証券金融	43,000	1,147.00	49,321,000
アイフル	177,200	380.00	67,336,000
リコーリース	10,200	3,765.00	38,403,000
イオンフィナンシャルサービス	61,400	1,282.00	78,714,800
アコム	191,100	310.00	59,241,000
ジャックス	11,400	4,070.00	46,398,000
オリエントコーポレーション	28,100	1,149.00	32,286,900
オリックス	711,800	2,214.00	1,575,925,200
三菱HCキャピタル	415,400	656.00	272,502,400
九州リースサービス	5,500	787.00	4,328,500
日本取引所グループ	299,100	1,893.00	566,196,300
イー・ギャランティ	17,300	2,407.00	41,641,100
アサックス	5,500	594.00	3,267,000
NECキャピタルソリューション	5,400	2,235.00	12,069,000
大東建託	39,100	14,000.00	547,400,000
いちご	126,300	295.00	37,258,500
日本駐車場開発	130,700	259.00	33,851,300
スター・マイカ・ホールディングス	11,100	653.00	7,248,300
SREホールディングス	5,500	3,925.00	21,587,500
ADワークスグループ	26,800	143.00	3,832,400
ヒューリック	249,200	1,040.00	259,168,000
三栄建築設計	5,900	1,453.00	8,572,700
野村不動産ホールディングス	66,900	2,810.00	187,989,000
三重交通グループホールディングス	25,000	489.00	12,225,000
サムティ	17,400	2,026.00	35,252,400
ディア・ライフ	18,100	619.00	11,203,900
地主	8,700	1,868.00	16,251,600
プレサンスコーポレーション	14,700	1,592.00	23,402,400
ハウスコム	2,700	1,100.00	2,970,000
JPMC	6,500	1,011.00	6,571,500
サンセイランディック	4,400	812.00	3,572,800
フージャースホールディングス	16,400	774.00	12,693,600
オープンハウスグループ	39,200	4,885.00	191,492,000
東急不動産ホールディングス	321,600	626.00	201,321,600

飯田グループホールディングス	93,700	2,105.00	197,238,500
イーランド	2,300	1,526.00	3,509,800
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	820.00	5,166,000
シーアールイー	5,800	1,130.00	6,554,000
ケイアイスター不動産	5,400	4,865.00	26,271,000
グッドコムアセット	11,300	783.00	8,847,900
ジェイ・エス・ビー	2,900	4,355.00	12,629,500
ロードスターキャピタル	5,200	1,608.00	8,361,600
テンポイノベーション	4,300	1,044.00	4,489,200
フェイスネットワーク	2,300	1,381.00	3,176,300
パーク24	83,400	2,221.00	185,231,400
パラカ	4,300	1,921.00	8,260,300
三井不動産	462,800	2,367.00	1,095,447,600
三菱地所	642,600	1,657.00	1,064,788,200
平和不動産	17,600	3,650.00	64,240,000
東京建物	102,100	1,573.00	160,603,300
京阪神ビルディング	14,300	1,348.00	19,276,400
住友不動産	192,700	3,094.00	596,213,800
テオオーシー	20,800	663.00	13,790,400
東京楽天地	2,100	4,295.00	9,019,500
スターツコーポレーション	15,700	2,486.00	39,030,200
フジ住宅	16,500	671.00	11,071,500
空港施設	14,900	521.00	7,762,900
明和地所	7,200	831.00	5,983,200
ゴールドクレスト	10,800	1,678.00	18,122,400
エスリード	5,600	1,923.00	10,768,800
日神グループホールディングス	19,600	451.00	8,839,600
日本エスコン	23,900	776.00	18,546,400
MIRARTHホールディングス	53,800	379.00	20,390,200
AVANTIA	6,800	787.00	5,351,600
イオンモール	55,800	1,835.00	102,393,000
毎日コムネット	5,500	674.00	3,707,000
ファースト住建	5,400	1,021.00	5,513,400
カチタス	29,000	3,020.00	87,580,000
トーセイ	18,500	1,457.00	26,954,500
穴吹興産	3,100	1,971.00	6,110,100
サンフロンティア不動産	18,700	1,101.00	20,588,700
FJネクストホールディングス	12,300	993.00	12,213,900
インテリックス	2,600	511.00	1,328,600
ランドビジネス	3,900	221.00	861,900
サンネクスタグループ	4,600	901.00	4,144,600

グランディハウス	10,900	568.00	6,191,200
日本空港ビルディング	37,800	6,840.00	258,552,000
明豊ファシリティワークス	5,900	711.00	4,194,900
日本工営	8,000	3,440.00	27,520,000
L I F U L L	38,900	215.00	8,363,500
M I X I	25,400	2,496.00	63,398,400
ジェイエイシーリクルートメント	10,100	2,328.00	23,512,800
日本M&Aセンターホールディングス	190,700	1,749.00	333,534,300
メンバーズ	3,300	1,961.00	6,471,300
中広	2,100	375.00	787,500
UTグループ	16,400	2,565.00	42,066,000
アイティメディア	4,300	1,588.00	6,828,400
E・Jホールディングス	7,300	1,314.00	9,592,200
オープンアップグループ	40,700	1,892.00	77,004,400
コシダカホールディングス	33,500	873.00	29,245,500
アルトナー	2,900	1,028.00	2,981,200
パソナグループ	13,600	2,091.00	28,437,600
C D S	2,900	1,745.00	5,060,500
リンクアンドモチベーション	32,000	645.00	20,640,000
エス・エム・エス	42,300	3,395.00	143,608,500
サニーサイドアップグループ	4,200	545.00	2,289,000
パーソルホールディングス	124,400	2,767.00	344,214,800
リニカル	6,600	684.00	4,514,400
クックパッド	31,400	220.00	6,908,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	5,700	626.00	3,568,200
学情	5,200	1,396.00	7,259,200
スタジオアリス	5,700	2,186.00	12,460,200
シミックホールディングス	6,200	1,784.00	11,060,800
エプコ	2,700	731.00	1,973,700
N J S	2,500	2,097.00	5,242,500
総合警備保障	41,300	3,490.00	144,137,000
カカクコム	83,000	2,149.00	178,367,000
アイロムグループ	4,100	2,383.00	9,770,300
セントケア・ホールディング	7,300	819.00	5,978,700
サイネックス	2,200	563.00	1,238,600
ルネサンス	8,000	904.00	7,232,000
ディップ	19,500	4,000.00	78,000,000
デジタルホールディングス	8,800	1,267.00	11,149,600
新日本科学	11,900	2,310.00	27,489,000
キャリアデザインセンター	2,400	1,430.00	3,432,000
ベネフィット・ワン	51,600	2,075.00	107,070,000
エムスリー	219,500	3,659.00	803,150,500

ツカダ・グローバルホールディング	7,100	383.00	2,719,300
アウトソーシング	66,400	983.00	65,271,200
ウェルネット	10,200	585.00	5,967,000
ワールドホールディングス	5,100	2,562.00	13,066,200
ディー・エヌ・エー	47,500	1,783.00	84,692,500
博報堂D Yホールディングス	141,800	1,383.00	196,109,400
ぐるなび	20,900	391.00	8,171,900
タカミヤ	15,600	385.00	6,006,000
ジャパンベストレスキューシステム	6,900	836.00	5,768,400
ファンコミュニケーションズ	22,300	417.00	9,299,100
ライク	4,200	2,216.00	9,307,200
ビジネス・ブレークスルー	4,700	368.00	1,729,600
エスプール	32,200	758.00	24,407,600
WDBホールディングス	5,800	2,073.00	12,023,400
ティア	7,000	423.00	2,961,000
C D G	1,400	1,105.00	1,547,000
アドウェイズ	15,700	500.00	7,850,000
バリューコマース	8,500	1,963.00	16,685,500
インフォマート	115,900	401.00	46,475,900
J Pホールディングス	32,600	369.00	12,029,400
エコナックホールディングス	21,600	88.00	1,900,800
C Lホールディングス	3,300	818.00	2,699,400
プレステージ・インターナショナル	47,000	740.00	34,780,000
アミューズ	6,100	1,710.00	10,431,000
ドリームインキュベータ	3,500	2,659.00	9,306,500
クイック	8,600	2,032.00	17,475,200
T A C	6,400	203.00	1,299,200
電通グループ	109,200	4,250.00	464,100,000
イオンファンタジー	4,900	2,792.00	13,680,800
シーティーエス	12,500	816.00	10,200,000
ネクシィーズグループ	3,700	639.00	2,364,300
H . U . グループホールディングス	32,600	2,802.00	91,345,200
アルプス技研	9,800	2,196.00	21,520,800
日本空調サービス	12,200	704.00	8,588,800
オリエンタルランド	117,500	20,420.00	2,399,350,000
ダスキン	24,800	2,994.00	74,251,200
明光ネットワークジャパン	14,900	607.00	9,044,300
ファルコホールディングス	5,100	1,858.00	9,475,800
ラウンドワン	93,300	458.00	42,731,400
リゾートトラスト	43,900	2,303.00	101,101,700
ビー・エム・エル	13,800	3,265.00	45,057,000
りらいあコミュニケーションズ	18,500	1,458.00	26,973,000

リソー教育	51,000	360.00	18,360,000
早稲田アカデミー	6,300	1,147.00	7,226,100
ユー・エス・エス	114,300	2,087.00	238,544,100
東京個別指導学院	13,500	539.00	7,276,500
サイバーエージェント	265,900	1,224.00	325,461,600
楽天グループ	514,200	655.00	336,801,000
クリーク・アンド・リバー社	6,600	2,135.00	14,091,000
モーニングスター	18,600	460.00	8,556,000
テー・オー・ダブリュー	24,400	289.00	7,051,600
山田コンサルティンググループ	5,800	1,174.00	6,809,200
セントラルスポーツ	4,300	2,447.00	10,522,100
フルキャストホールディングス	10,700	2,756.00	29,489,200
エン・ジャパン	20,200	2,408.00	48,641,600
リソルホールディングス	1,100	4,605.00	5,065,500
テクノプロ・ホールディングス	74,500	3,905.00	290,922,500
アトラグループ	2,500	186.00	465,000
インターワークス	3,400	355.00	1,207,000
アイ・アールジャパンホールディングス	5,900	1,855.00	10,944,500
Keeper 技研	8,100	3,465.00	28,066,500
ファーストロジック	2,000	852.00	1,704,000
三機サービス	2,200	888.00	1,953,600
Gunosy	7,200	596.00	4,291,200
デザインワン・ジャパン	4,300	202.00	868,600
イー・ガーディアン	4,300	2,648.00	11,386,400
リブセンス	5,900	305.00	1,799,500
ジャパンマテリアル	34,100	2,369.00	80,782,900
ベクトル	17,600	1,296.00	22,809,600
ウチヤマホールディングス	5,500	264.00	1,452,000
チャーム・ケア・コーポレーション	9,400	1,190.00	11,186,000
キャリアリンク	4,100	2,647.00	10,852,700
I B J	7,000	1,010.00	7,070,000
アサンテ	5,600	1,639.00	9,178,400
バリューHR	9,800	1,686.00	16,522,800
M&Aキャピタルパートナーズ	10,300	5,040.00	51,912,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,100	1,110.00	4,551,000
E R Iホールディングス	3,300	1,307.00	4,313,100
アビスト	1,800	2,937.00	5,286,600
シグマクシス・ホールディングス	17,000	1,311.00	22,287,000
ウィルグループ	9,400	1,230.00	11,562,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	13,100	144.00	1,886,400
メドピア	8,900	1,474.00	13,118,600
レアジョブ	2,400	970.00	2,328,000

リクルートホールディングス	822,200	4,206.00	3,458,173,200
エラン	14,900	989.00	14,736,100
土木管理総合試験所	5,300	306.00	1,621,800
日本郵政	1,455,500	1,086.00	1,580,673,000
ベルシステム24ホールディングス	15,000	1,441.00	21,615,000
鎌倉新書	12,800	1,015.00	12,992,000
S MN	3,100	465.00	1,441,500
グローバルキッズCOMPANY	2,100	774.00	1,625,400
エアトリ	7,200	2,625.00	18,900,000
アトラエ	8,900	1,238.00	11,018,200
ストライク	5,500	4,720.00	25,960,000
ソラスト	30,900	661.00	20,424,900
セラク	4,100	1,428.00	5,854,800
インソース	27,700	1,565.00	43,350,500
ペイカレント・コンサルティング	87,900	5,720.00	502,788,000
Orchestra Holdings	2,500	2,090.00	5,225,000
アイモバイル	5,900	1,207.00	7,121,300
キャリアインデックス	4,500	320.00	1,440,000
MS - Japan	3,800	1,076.00	4,088,800
船場	2,200	712.00	1,566,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	39,700	1,749.00	69,435,300
フルテック	1,700	1,063.00	1,807,100
GameWith	4,000	341.00	1,364,000
MS&Consulting	1,600	596.00	953,600
ウェルビー	8,400	741.00	6,224,400
エル・ティー・エス	1,500	2,781.00	4,171,500
ミダックホールディングス	6,800	2,838.00	19,298,400
日総工産	8,700	597.00	5,193,900
キュービーネットホールディングス	5,900	1,496.00	8,826,400
RPAホールディングス	15,800	294.00	4,645,200
スプリックス	4,100	869.00	3,562,900
マネジメントソリューションズ	6,200	3,700.00	22,940,000
プロレド・パートナーズ	3,100	509.00	1,577,900
テノ・ホールディングス	1,800	654.00	1,177,200
フロンティア・マネジメント	3,900	1,455.00	5,674,500
ピアラ	2,200	548.00	1,205,600
コプロ・ホールディングス	2,000	1,129.00	2,258,000
ギークス	1,800	914.00	1,645,200
カーブスホールディングス	34,400	798.00	27,451,200
フォーラムエンジニアリング	6,700	875.00	5,862,500
Fast Fitness Japan	4,000	1,162.00	4,648,000
ダイレクトマーケティングミックス	12,900	1,650.00	21,285,000

ポピンズ	1,800	1,975.00	3,555,000
LITALICO	8,700	2,452.00	21,332,400
アドバンテッジリスクマネジメント	5,600	390.00	2,184,000
リログループ	61,900	2,180.00	134,942,000
東祥	7,900	1,132.00	8,942,800
ビーウィズ	3,500	1,332.00	4,662,000
TREホールディングス	23,500	1,495.00	35,132,500
人・夢・技術グループ	5,100	1,464.00	7,466,400
エイチ・アイ・エス	29,100	2,098.00	61,051,800
ラックランド	3,500	2,931.00	10,258,500
共立メンテナンス	19,000	5,750.00	109,250,000
イチネンホールディングス	11,900	1,266.00	15,065,400
建設技術研究所	5,800	3,320.00	19,256,000
スペース	8,300	930.00	7,719,000
燦ホールディングス	5,000	1,821.00	9,105,000
スバル興業	700	9,260.00	6,482,000
東京テアトル	4,100	1,116.00	4,575,600
タナベコンサルティンググループ	4,600	655.00	3,013,000
ナガワ	3,000	7,690.00	23,070,000
東京都競馬	9,400	3,865.00	36,331,000
カナモト	20,400	2,257.00	46,042,800
西尾レントオール	10,400	3,055.00	31,772,000
トランス・コスモス	13,900	3,340.00	46,426,000
乃村工藝社	48,600	903.00	43,885,800
藤田観光	4,900	3,260.00	15,974,000
KNT-CTホールディングス	6,600	1,674.00	11,048,400
日本管財	11,700	2,516.00	29,437,200
トーカイ	9,900	1,905.00	18,859,500
セコム	113,100	7,644.00	864,536,400
セントラル警備保障	6,100	2,462.00	15,018,200
丹青社	21,800	715.00	15,587,000
メイテック	44,400	2,477.00	109,978,800
応用地質	10,800	2,136.00	23,068,800
船井総研ホールディングス	23,400	2,746.00	64,256,400
進学会ホールディングス	4,300	296.00	1,272,800
オオバ	7,300	710.00	5,183,000
いであ	2,600	1,693.00	4,401,800
学究社	4,500	1,927.00	8,671,500
ベネッセホールディングス	41,600	1,979.00	82,326,400
イオンディライト	12,300	3,065.00	37,699,500
ナック	5,100	959.00	4,890,900
ダイセキ	22,700	4,480.00	101,696,000

ステップ	4,700	1,782.00	8,375,400	
合計	125,212,600		302,759,682,290	

(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22期中間計算期間(2023年1月24日から2023年7月23日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【DC日本株式インデックスファンド】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第21期 (2023年 1月23日現在)	第22期中間計算期間 (2023年 7月23日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,193,717	2,392,651
親投資信託受益証券	642,160,853	741,013,245
未収入金	56,657	262,057
流動資産合計	644,411,227	743,667,953
資産合計	644,411,227	743,667,953
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	245,921	264,340
未払委託者報酬	1,686,272	1,812,563
未払利息	-	16
流動負債合計	1,932,193	2,076,919
負債合計	1,932,193	2,076,919
純資産の部		
元本等		
元本	245,244,724	240,736,962
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	397,234,310	500,854,072
(分配準備積立金)	176,696,676	162,554,743
元本等合計	642,479,034	741,591,034
純資産合計	642,479,034	741,591,034
負債純資産合計	644,411,227	743,667,953

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第21期中間計算期間 自 2022年 1月25日 至 2022年 7月24日	第22期中間計算期間 自 2023年 1月24日 至 2023年 7月23日
営業収益		
受取利息	3	-
有価証券売買等損益	16,970,399	115,113,945
営業収益合計	16,970,402	115,113,945
営業費用		
支払利息	138	314
受託者報酬	247,667	264,340
委託者報酬	1,698,203	1,812,563
営業費用合計	1,946,008	2,077,217
営業利益又は営業損失（ ）	15,024,394	113,036,728
経常利益又は経常損失（ ）	15,024,394	113,036,728
中間純利益又は中間純損失（ ）	15,024,394	113,036,728
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（ ）	672,180	5,763,271
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	403,655,067	397,234,310
剰余金増加額又は欠損金減少額	22,906,760	29,509,620
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	22,906,760	29,509,620
剰余金減少額又は欠損金増加額	42,323,540	33,163,315
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	42,323,540	33,163,315
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	399,934,861	500,854,072

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年1月23日から翌年1月22日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第22期中間計算期間は2023年 1月24日から2023年 7月23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21期 (2023年 1月23日現在)	第22期中間計算期間 (2023年 7月23日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	245,244,724口	240,736,962口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.6197円 (26,197円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.0805円 (30,805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22期中間計算期間 (2023年 7月23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22期中間計算期間 (2023年 7月23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21期 自 2022年 1月25日 至 2023年 1月23日	第22期中間計算期間 自 2023年 1月24日 至 2023年 7月23日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	261,214,283円	245,244,724円
期中追加設定元本額	26,291,817円	15,954,020円
期中一部解約元本額	42,261,376円	20,461,782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 7月23日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	

	2023年 7月23日現在
項目	金額（円）
コール・ローン	1,821,325,093
株式	350,766,395,340
派生商品評価勘定	32,765,300
未収配当金	468,211,638
差入委託証拠金	83,700,000
流動資産合計	353,172,397,371
資産合計	353,172,397,371
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	58,850
前受金	32,713,600
未払金	1,364,400
未払解約金	168,602,200
未払利息	4,363
流動負債合計	202,743,413
負債合計	202,743,413
純資産の部	
元本等	
元本	132,391,382,953
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	220,578,271,005
元本等合計	352,969,653,958
純資産合計	352,969,653,958
負債純資産合計	353,172,397,371

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2023年 7月23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

	2023年 7月23日現在
	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）

	2023年 7月23日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	132,391,382,953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 2.6661円 (1万口当たり純資産額) (26,661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 7月23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 7月23日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月24日
期首元本額	135,107,273,836円
期中追加設定元本額	5,525,128,420円
期中一部解約元本額	8,241,019,303円
期末元本額	132,391,382,953円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	594,118,654円
D C 日本株式インデックスファンド	277,939,029円
D C 日本株式インデックスファンド L	53,995,263,662円
D C 日本株式インデックスファンド A	658,149,737円
D C バランスファンド 3 0	2,159,019,547円
D C バランスファンド 5 0	3,576,848,132円
D C バランスファンド 7 0	2,362,962,240円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	526,551,007円
日本株式インデックス e	1,414,995,734円
インデックスコレクション（国内株式）	22,695,848,688円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	11,471,490,694円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	3,414,060,565円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	3,363,834,997円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,889,538,869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）	2,677,888,193円
日本株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	663,355,139円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	28,430,225円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	362,777,825円
V A バランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	48,069,154円
V A バランスファンド（株 5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	113,973,982円
V A バランスファンド（株 6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	35,828,951円
バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	493,074,431円
バランス V A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	321,697,576円
バランス V A 5 0 L（適格機関投資家専用）	5,737,837,247円
バランス V A 7 5（適格機関投資家専用）	594,978,112円
V A バランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	47,446,177円
V A ポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	939,210,978円
V A ポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	18,075,313円
バランス V A 4 0（適格機関投資家専用）	120,084,536円
バランスファンド V A（適格機関投資家専用）	1,535,025,393円

区分	2023年 7月23日現在
V A バランスファンド 2 (株 4 0 / 1 0 0) (適格機関投資家専用)	39,312,421円
V A バランス 5 0 - 5 0 (適格機関投資家専用)	41,825,645円
V A ファンド 2 5 (適格機関投資家専用)	13,099,965円
バランスファンド V A 2 (適格機関投資家専用)	446,986,164円
バランス V A 2 5 L (適格機関投資家専用)	206,661,291円
バランスファンド V A 3 (適格機関投資家専用)	3,319,529,355円
世界バランス V A 2 5 (適格機関投資家専用)	66,932,363円
国内バランス V A 3 0 (適格機関投資家専用)	24,177,839円
国内バランス V A 2 5 (適格機関投資家専用)	6,735,611円
V A バランス 2 0 - 8 0 (適格機関投資家専用)	84,668,238円
私募日本株式インデックスファンド A L (適格機関投資家専用)	3,079,274円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2023年 7月23日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,999,936,400	-	2,032,650,000	32,713,600
合計		1,999,936,400	-	2,032,650,000	32,713,600

(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ではありません。

2【ファンドの現況】

【DC日本株式インデックスファンド】

【純資産額計算書】

（2023年 8月31日現在）

資産総額	762,763,570円
負債総額	909,812円
純資産総額（ - ）	761,853,758円
発行済口数	239,988,308口
1口当たり純資産額（ / ）	3.1745円
（1万口当たり純資産額）	（31,745円）

（参考）

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

（2023年 8月31日現在）

資産総額	364,344,548,792円
負債総額	311,490,507円
純資産総額（ - ）	364,033,058,285円
発行済口数	132,407,661,053口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7493円
（1万口当たり純資産額）	（27,493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 8月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減：該当事項はありません。

(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、監査等委員以外の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、各取締役に對して会日の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10月23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8月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	531	14,695,810
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	67	204,896
単位型公社債投資信託	50	169,396
合計	648	15,070,102

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、金額の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・カテゴリー毎に管理しております。

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払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10月23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4月4日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 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の2022年1月25日から2023年1月23日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC日本株式インデックスファンドの2023年1月23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10月3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の2023年1月24日から2023年7月23日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DC日本株式インデックスファンドの2023年7月23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（2023年1月24日から2023年7月23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。