

【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】	2024年2月29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】	DC日本株式インデックス・オープンS
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DC日本株式インデックス・オープンS

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

2024年 3月 1日から2024年 8月29日までとします。

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

（８）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（ 9 ）【払込期日】

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

（ 10 ）【払込取扱場所】

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

（ 11 ）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 12 ）【その他】

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

(1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

ないかを明確に記載するものとする。

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

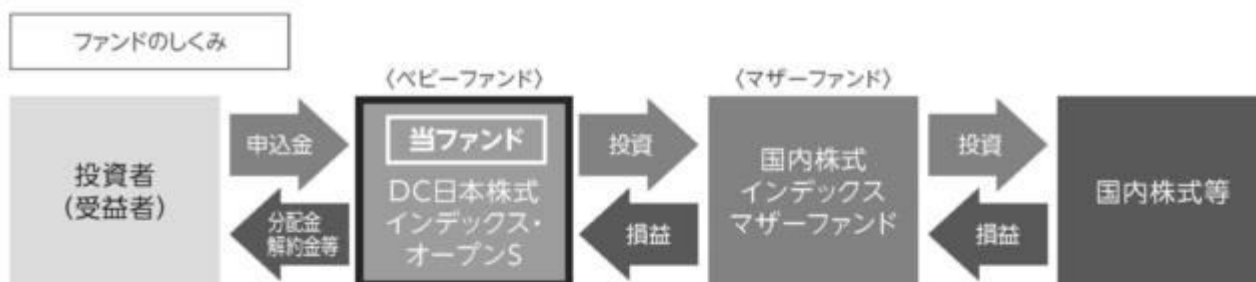
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。

- (3)ロング・ショート型 / 絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

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 >

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



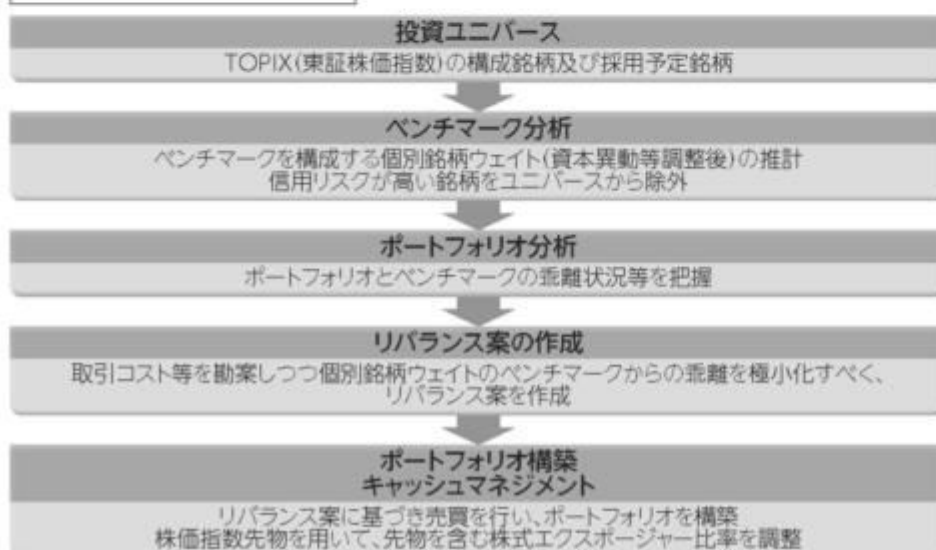
? ファミリーファンド方式とは

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

<マザーファンドの概要>

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

マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

2. TOPIX(東証株価指数)(配当込み)に連動する投資成果を目指します。

? TOPIX(東証株価指数)とは

株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「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)(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が有します。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、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

TOPIX(東証株価指数)(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。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

分配方針

- 原則として、毎年5月29日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。
- 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

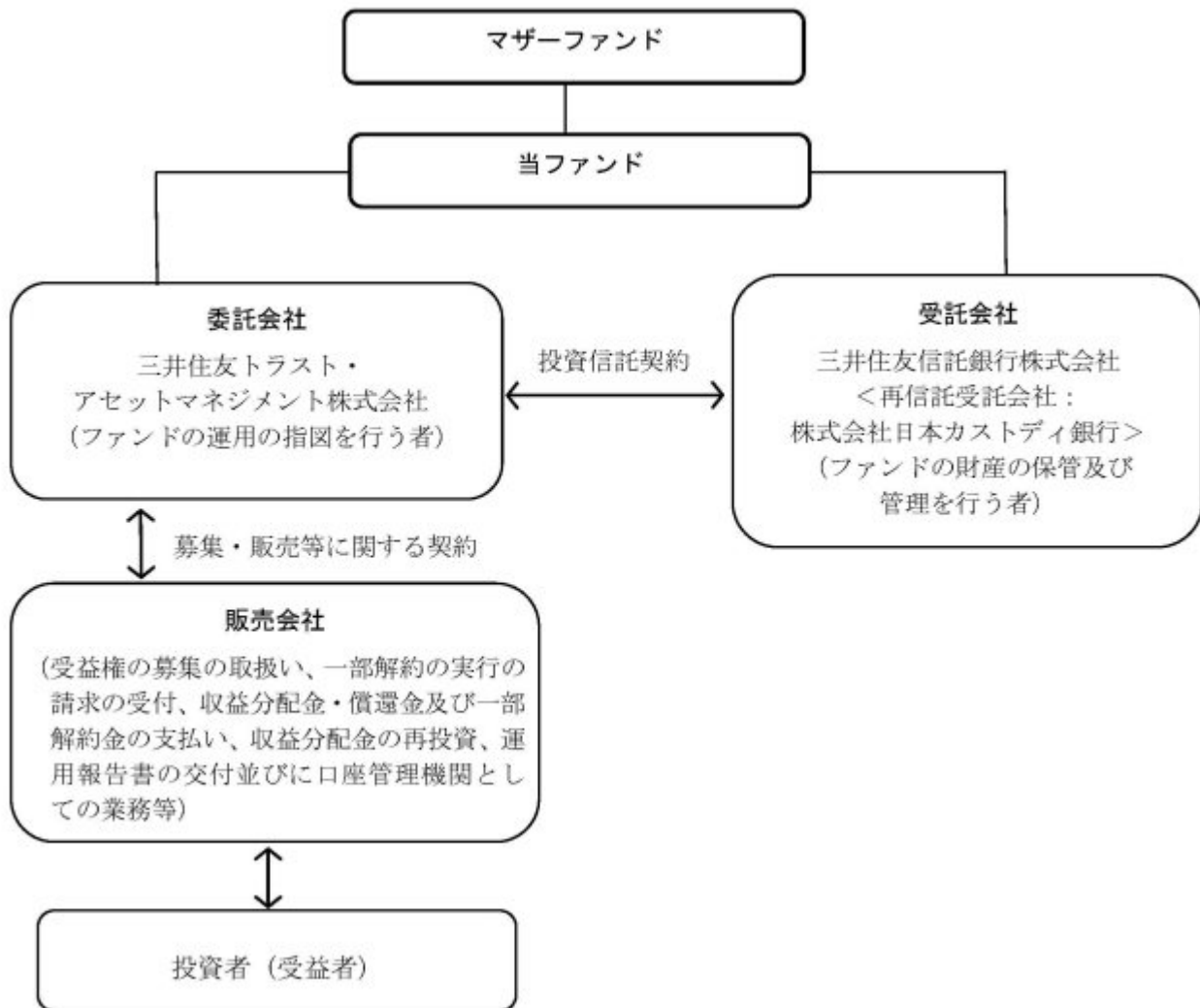
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2023年12月29日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

基本方針

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

投資対象

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

投資態度

- 1)主として、マザーファンド受益証券に投資し、TOPIX（東証株価指数）（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。
- 2)株式の実質組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
- 3)運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の実質組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- 4)ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
- 5)国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1.次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。）
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条に定めるものに限りません。）
 - ハ．金銭債権
 - ニ．約束手形
- 2.次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形

有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除くとともに、本邦通貨表示のものに限りません。）に投資することを指図します。

- 1．株券又は新株引受権証券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）及び新株予約権証券
12. 外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、第1号から第11号の証券又は証書の性質を有するもの
13. 証券投資信託又は外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券もしくは投資法人債券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で第21号の有価証券の性質を有するもの

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

金融商品の指図範囲

- イ. 委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で第5号の権利の性質を有するもの
- ロ. 上記 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、

委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記イ．第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(参考)マザーファンドの概要

「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場している株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

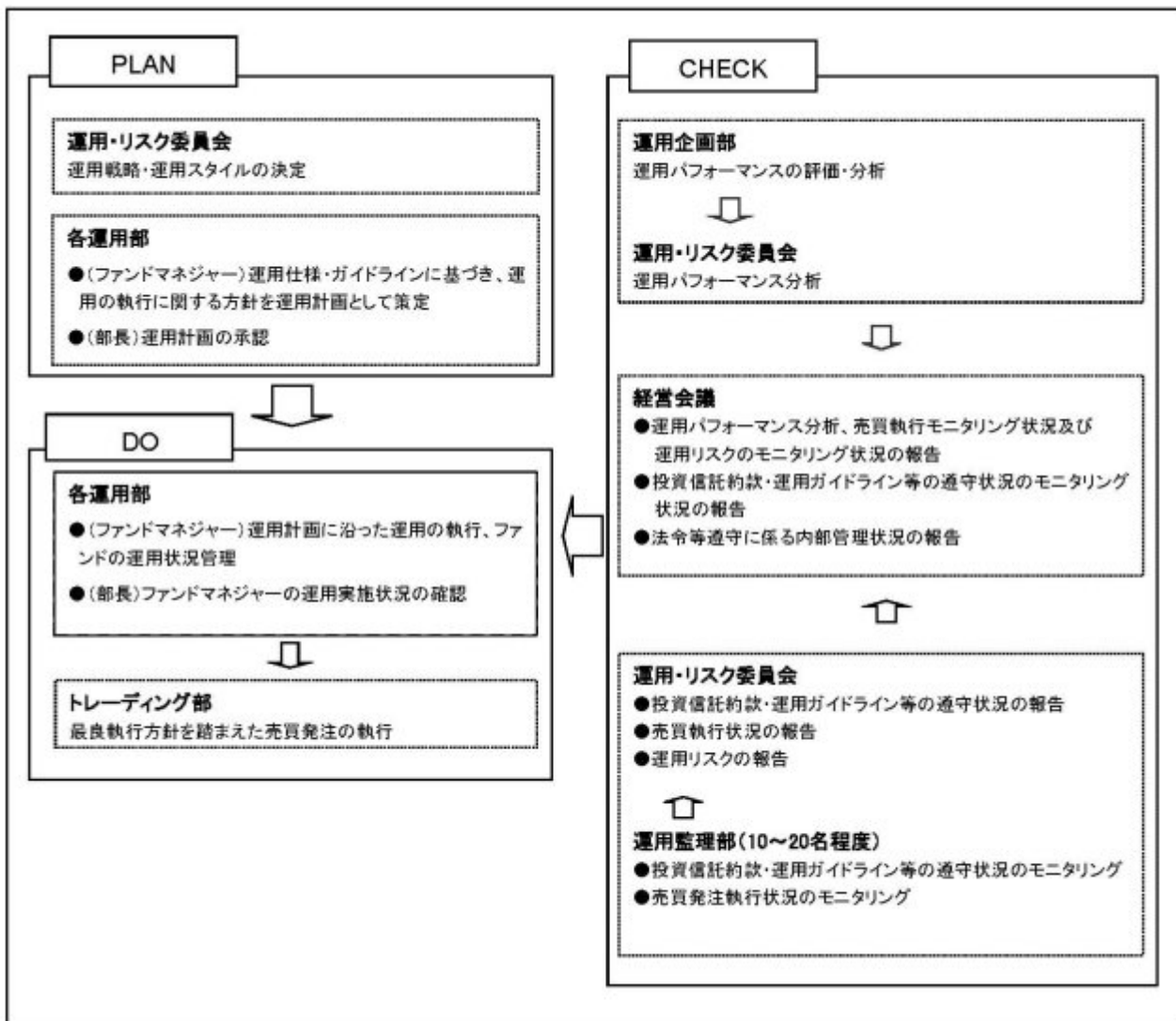
前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、

当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

（3）【運用体制】

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



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

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

（４）【分配方針】

年1回の毎決算時（決算日は毎年5月29日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

- ・分配対象額の範囲

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

- ・分配対象額についての分配方針

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

- ・留保益の運用方針

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は行いません。

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

同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。

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

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

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

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、わが国の取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができます。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 投資信託財産に属する株券及び新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券

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

委託会社は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）及び有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託会社が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。

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

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

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の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投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につ

き、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

(1)ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

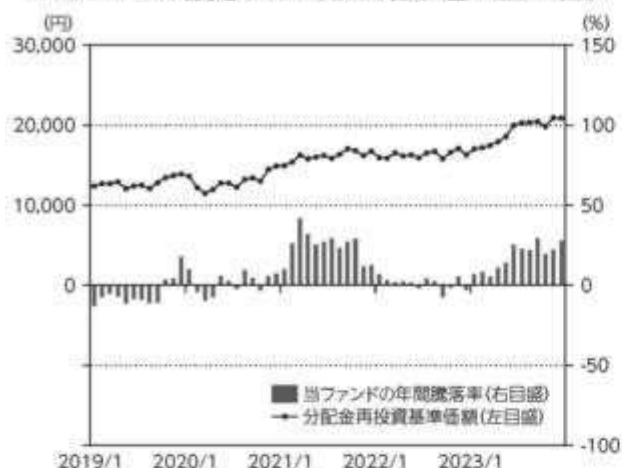
(2) リスクの管理体制

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】

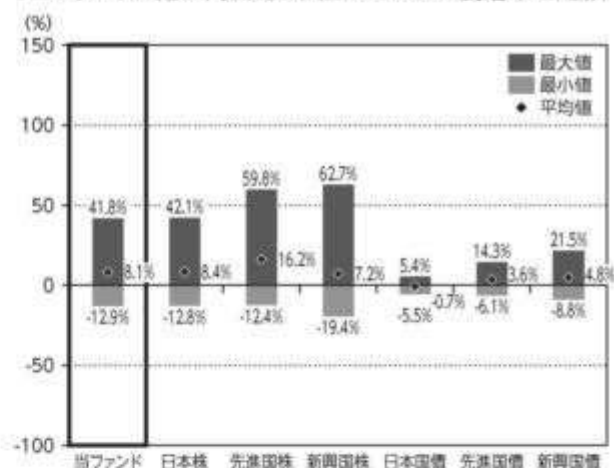
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



*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



*2019年1月～2023年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (東証株価指数) (配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社JPX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、投資対象としての機動性を有するマーケットベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る権利又は商標は、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利又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、取扱い及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、JPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCI Emerging Markets インデックス (配当込み、円ベース)	MSCI Emerging Markets 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ティー・リサーチ&コンサルティング株式会社公表する、国内で発行された公算固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリティー・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ティー・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該の事業活動に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、本ファンドの指商、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 J.P. Morgan Global Bond Index - Emerging Markets (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.2035%（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、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
 財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
 上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2023年12月29日現在のものでありますので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

（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
0.23%	0.22%	0.01%

※対象期間は2022年5月31日～2023年5月29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12月29日現在の状況について記載してあります。

【DC日本株式インデックス・オープンS】

（１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	22,456,142,620	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11,212,338	0.05
合計(純資産総額)		22,467,354,958	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

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

日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	9,237,409,552	2.2026	20,346,318,280	2.4310	22,456,142,620	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7期計算期間末 (2014年 5月29日)	1,866,071,421	1,866,071,421	8,721	8,721
第8期計算期間末 (2015年 5月29日)	3,443,138,694	3,443,138,694	12,356	12,356
第9期計算期間末 (2016年 5月30日)	4,142,221,031	4,142,221,031	10,268	10,268
第10期計算期間末 (2017年 5月29日)	5,687,450,621	5,687,450,621	12,038	12,038
第11期計算期間末 (2018年 5月29日)	8,282,015,684	8,282,015,684	13,768	13,768
第12期計算期間末 (2019年 5月29日)	8,975,168,901	8,975,168,901	12,265	12,265
第13期計算期間末 (2020年 5月29日)	10,382,988,624	10,382,988,624	12,781	12,781
第14期計算期間末 (2021年 5月31日)	13,907,162,032	13,907,162,032	16,022	16,022
第15期計算期間末 (2022年 5月30日)	15,882,560,673	15,882,560,673	16,361	16,361
第16期計算期間末 (2023年 5月29日)	19,260,085,865	19,260,085,865	18,850	18,850
2022年12月末日	16,472,535,607		16,310	
2023年 1月末日	17,265,445,824		17,029	
2月末日	17,406,592,398		17,187	
3月末日	17,801,571,860		17,476	
4月末日	18,255,294,179		17,944	
5月末日	18,997,654,465		18,589	
6月末日	20,845,107,997		19,988	
7月末日	21,355,896,026		20,283	
8月末日	21,522,563,806		20,366	
9月末日	21,749,880,178		20,469	
10月末日	21,283,706,162		19,854	
11月末日	22,373,911,251		20,923	
12月末日	22,467,354,958		20,874	

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第7期計算期間	2013年 5月30日～2014年 5月29日	0
第8期計算期間	2014年 5月30日～2015年 5月29日	0
第9期計算期間	2015年 5月30日～2016年 5月30日	0
第10期計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	0
第11期計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月29日	0
第12期計算期間	2018年 5月30日～2019年 5月29日	0
第13期計算期間	2019年 5月30日～2020年 5月29日	0
第14期計算期間	2020年 5月30日～2021年 5月31日	0
第15期計算期間	2021年 6月 1日～2022年 5月30日	0
第16期計算期間	2022年 5月31日～2023年 5月29日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第7期計算期間	2013年 5月30日～2014年 5月29日	3.7
第8期計算期間	2014年 5月30日～2015年 5月29日	41.7
第9期計算期間	2015年 5月30日～2016年 5月30日	16.9
第10期計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	17.2
第11期計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月29日	14.4
第12期計算期間	2018年 5月30日～2019年 5月29日	10.9
第13期計算期間	2019年 5月30日～2020年 5月29日	4.2
第14期計算期間	2020年 5月30日～2021年 5月31日	25.4
第15期計算期間	2021年 6月 1日～2022年 5月30日	2.1
第16期計算期間	2022年 5月31日～2023年 5月29日	15.2
第17期中間計算期間	2023年 5月30日～2023年11月29日	10.5

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第7期計算期間	2013年 5月30日～2014年 5月29日	1,119,419,055	344,003,784	2,139,659,576
第8期計算期間	2014年 5月30日～2015年 5月29日	1,337,445,052	690,529,107	2,786,575,521
第9期計算期間	2015年 5月30日～2016年 5月30日	2,058,315,332	810,869,903	4,034,020,950
第10期計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	1,869,056,255	1,178,642,386	4,724,434,819
第11期計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月29日	2,181,025,603	889,936,203	6,015,524,219
第12期計算期間	2018年 5月30日～2019年 5月29日	2,438,617,340	1,136,275,137	7,317,866,422
第13期計算期間	2019年 5月30日～2020年 5月29日	2,341,470,930	1,535,472,847	8,123,864,505
第14期計算期間	2020年 5月30日～2021年 5月31日	2,130,677,993	1,574,702,169	8,679,840,329
第15期計算期間	2021年 6月 1日～2022年 5月30日	2,404,330,297	1,376,710,552	9,707,460,074
第16期計算期間	2022年 5月31日～2023年 5月29日	2,222,088,080	1,712,159,839	10,217,388,315
第17期中間計算期間	2023年 5月30日～2023年11月29日	1,309,881,460	837,837,768	10,689,432,007

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

(参考)

国内株式インデックス マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	586,637,466,610	98.78
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,241,509,381	1.22
合計(純資産総額)		593,878,975,991	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	7,168,980,000	1.21

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,585,900	1,944.31	18,637,971,918	2,590.50	24,832,273,950	4.18
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,234,900	13,262.64	16,378,034,785	13,410.00	16,560,009,000	2.79
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,476,900	935.07	9,796,634,883	1,211.50	12,692,764,350	2.14
日本	株式	キーエンス	電気機器	174,700	68,435.49	11,955,681,814	62,120.00	10,852,364,000	1.83
日本	株式	信越化学工業	化学	1,585,700	4,415.41	7,001,522,280	5,917.00	9,382,586,900	1.58
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	369,500	19,749.13	7,297,307,208	25,255.00	9,331,722,500	1.57
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	52,081,600	162.92	8,485,138,853	172.30	8,973,659,680	1.51
日本	株式	日立製作所	電気機器	847,400	8,161.66	6,916,194,878	10,170.00	8,618,058,000	1.45
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,222,500	5,682.91	6,947,368,917	6,880.00	8,410,800,000	1.42
日本	株式	三菱商事	卸売業	3,660,000	2,002.89	7,330,597,902	2,253.50	8,247,810,000	1.39
日本	株式	任天堂	その他製品	1,102,200	5,922.79	6,528,102,549	7,359.00	8,111,089,800	1.37
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,328,700	4,450.16	5,912,928,191	5,963.00	7,923,038,100	1.33
日本	株式	三井物産	卸売業	1,391,700	4,702.71	6,544,769,731	5,298.00	7,373,226,600	1.24
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,241,600	4,993.91	6,200,440,714	5,767.00	7,160,307,200	1.21
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,549,600	4,531.81	7,022,503,107	4,054.00	6,282,078,400	1.06
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,257,300	1,346.23	5,731,320,672	1,466.00	6,241,201,800	1.05

日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,353,000	4,358.82	5,897,485,430	4,486.00	6,069,558,000	1.02
日本	株式	HOYA	精密機器	343,900	17,130.60	5,891,213,340	17,625.00	6,061,237,500	1.02
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,699,500	3,118.90	5,300,580,579	3,529.00	5,997,535,500	1.01
日本	株式	第一三共	医薬品	1,525,300	4,533.12	6,914,370,121	3,872.00	5,905,961,600	0.99
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,320,800	2,084.61	4,837,983,290	2,412.50	5,598,930,000	0.94
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	863,700	5,563.87	4,805,515,260	6,293.00	5,435,264,100	0.92
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	949,800	5,369.03	5,099,512,290	5,251.00	4,987,399,800	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,817,100	1,514.97	4,267,827,507	1,759.50	4,956,687,450	0.83
日本	株式	ダイキン工業	機械	210,500	26,686.15	5,617,435,672	22,985.00	4,838,342,500	0.81
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,588,400	2,751.28	4,370,145,617	2,993.00	4,754,081,200	0.80
日本	株式	S M C	機械	52,800	74,470.94	3,932,065,937	75,760.00	4,000,128,000	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,962,500	1,824.24	3,580,089,531	1,999.00	3,923,037,500	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,044,500	3,091.13	3,228,692,742	3,645.00	3,807,202,500	0.64
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	636,600	6,139.85	3,908,633,900	5,595.00	3,561,777,000	0.60

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.34
		建設業	2.10
		食料品	3.33
		繊維製品	0.40
		パルプ・紙	0.17
		化学	6.12
		医薬品	4.56
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.69
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.95
		非鉄金属	0.67
		金属製品	0.52
		機械	5.27
		電気機器	17.33
		輸送用機器	8.09
		精密機器	2.34
		その他製品	2.35
		電気・ガス業	1.39
陸運業	2.81		
海運業	0.83		
空運業	0.45		

	倉庫・運輸関連業	0.15
	情報・通信業	7.63
	卸売業	6.92
	小売業	4.25
	銀行業	6.79
	証券、商品先物取引業	0.80
	保険業	2.35
	その他金融業	1.14
	不動産業	1.93
	サービス業	4.94
	小計	98.78
合計		98.78

(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	303円		7,109,275,050	7,168,980,000	1.21

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2007年 8月31日

作成基準日：2023年12月29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 20,874円

純資産総額 224.67億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

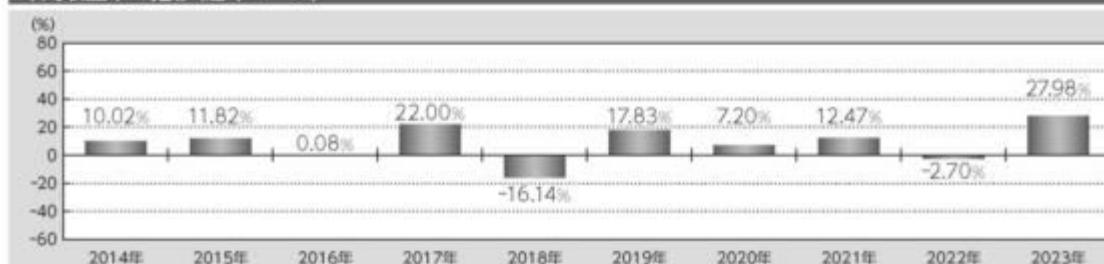
決算期	分配金
2019年 5月	0円
2020年 5月	0円
2021年 5月	0円
2022年 5月	0円
2023年 5月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	4.2%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.8%
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%
信越化学工業	日本	株式	化学	1.6%
東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	1.6%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.5%
日立製作所	日本	株式	電気機器	1.5%
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%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

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

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

第2【管理及び運営】**1【申込（販売）手続等】****< 申込手続 >**

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

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

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の基準価額（以下「解約価額」といいます。）とします。

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

< 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、4営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

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

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、及びすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すこと

ができます。

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

国内上場株式、国内上場投信

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2007年 8月31日設定）

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

（4）【計算期間】

原則として、毎年5月30日から翌年5月29日までとします。ただし、第1計算期間は、2007年8月31日から2008年5月29日までとします。

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

（5）【その他】

< 投資信託契約の終了（償還）と手続き >

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き

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

す。

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

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

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

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

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

< 投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き >

(1) 投資信託約款の変更

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

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

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

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

(2) 重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

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

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

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

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

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

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

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

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

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

< 反対者の買取請求権 >

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4 【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2) 償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、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16期計算期間(2022年5月31日から2023年5月29日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DC日本株式インデックス・オープンS】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第15期 (2022年 5月30日現在)	第16期 (2023年 5月29日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	33,351,418	41,406,541
親投資信託受益証券	15,874,764,923	19,250,522,205
未収入金	-	23,578,295
流動資産合計	15,908,116,341	19,315,507,041
資産合計	15,908,116,341	19,315,507,041
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,115,953	35,590,312
未払受託者報酬	2,492,085	2,836,254
未払委託者報酬	14,121,748	16,072,027
未払利息	29	83
その他未払費用	825,853	922,500
流動負債合計	25,555,668	55,421,176
負債合計	25,555,668	55,421,176
純資産の部		
元本等		
元本	9,707,460,074	10,217,388,315
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	6,175,100,599	9,042,697,550
(分配準備積立金)	2,837,490,337	4,829,268,335
元本等合計	15,882,560,673	19,260,085,865
純資産合計	15,882,560,673	19,260,085,865
負債純資産合計	15,908,116,341	19,315,507,041

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期		第16期	
	自	2021年 6月 1日	自	2022年 5月31日
	至	2022年 5月30日	至	2023年 5月29日
営業収益				
受取利息		163		99
有価証券売買等損益		336,245,642		2,575,838,860
営業収益合計		336,245,805		2,575,838,959
営業費用				
支払利息		11,523		14,373
受託者報酬		4,955,822		5,535,724
委託者報酬		28,082,860		31,368,928
その他費用		825,853		922,500
営業費用合計		33,876,058		37,841,525
営業利益又は営業損失（ ）		302,369,747		2,537,997,434
経常利益又は経常損失（ ）		302,369,747		2,537,997,434
当期純利益又は当期純損失（ ）		302,369,747		2,537,997,434
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（ ）		50,275,906		99,546,076
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		5,227,321,703		6,175,100,599
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,532,077,230		1,521,149,388
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,532,077,230		1,521,149,388
剰余金減少額又は欠損金増加額		836,392,175		1,092,003,795
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		836,392,175		1,092,003,795
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,175,100,599		9,042,697,550

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年5月30日から翌年5月29日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第16期計算期間は2022年5月31日から2023年5月29日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第15期 (2022年5月30日現在)	第16期 (2023年5月29日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	9,707,460,074口	10,217,388,315口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.6361円 (16,361円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8850円 (18,850円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第15期 自 2021年6月1日 至 2022年5月30日			第16期 自 2022年5月31日 至 2023年5月29日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後の配当等収益額	A	- 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	252,097,674円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	2,438,455,631円
収益調整金額	C	7,371,163,886円	収益調整金額	C	8,354,094,778円
分配準備積立金額	D	2,585,392,663円	分配準備積立金額	D	2,390,812,704円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	10,208,654,223円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	13,183,363,113円
当ファンドの期末残存口数	F	9,707,460,074口	当ファンドの期末残存口数	F	10,217,388,315口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	10,516円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	12,902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16期 自 2022年5月31日 至 2023年5月29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16期 (2023年5月29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。

第16期 (2023年 5月29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	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15期 自 2021年 6月 1日 至 2022年 5月30日	第16期 自 2022年 5月31日 至 2023年 5月29日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	8,679,840,329円	9,707,460,074円
期中追加設定元本額	2,404,330,297円	2,222,088,080円
期中一部解約元本額	1,376,710,552円	1,712,159,839円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第15期 (2022年 5月30日現在)	第16期 (2023年 5月29日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	333,325,877	2,537,984,039
合計	333,325,877	2,537,984,039

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	8,780,570,245	19,250,522,205	
	合計	8,780,570,245	19,250,522,205	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年 5月29日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,790,568,685
株式	551,712,588,640
派生商品評価勘定	525,405,750
未収入金	4,413,150
未収配当金	5,907,229,507
差入委託証拠金	384,448,000
流動資産合計	561,324,653,732
資産合計	561,324,653,732
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,499,850
前受金	519,918,000
未払解約金	755,116,994
未払利息	5,648
流動負債合計	1,280,540,492
負債合計	1,280,540,492
純資産の部	
元本等	
元本	255,447,146,244
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	304,596,966,996
元本等合計	560,044,113,240
純資産合計	560,044,113,240
負債純資産合計	561,324,653,732

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年 5月29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 5月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	255,447,146,244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 2.1924円 (1万口当たり純資産額) (21,924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 5月29日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 5月29日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2023年 5月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2022年 5月31日
期首元本額	261,899,870,077円
期中追加設定元本額	21,018,826,197円
期中一部解約元本額	27,471,550,030円
期末元本額	255,447,146,244円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	362,704,238円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	3,959,900,275円
SBI資産設計オープン（分配型）	13,243,995円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,493,697,625円
世界経済インデックスファンド	4,576,726,130円
日本株式インデックス・オープン	3,138,913,501円

区分	2023年 5月29日現在
DCマイセレクション25	6,031,356,474円
DCマイセレクション50	18,775,791,691円
DCマイセレクション75	19,162,340,750円
DC日本株式インデックス・オープン	6,056,317,510円
DCマイセレクションS25	3,251,795,060円
DCマイセレクションS50	9,695,167,195円
DCマイセレクションS75	7,776,031,159円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,780,570,245円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	129,589,313円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	662,965,308円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	505,505,088円
DC世界経済インデックスファンド	3,623,664,654円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,162,389,581円
国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	4,378,127円
マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	10,113,328円
マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	15,125,814円
日本株式インデックス・オープンVA1（適格機関投資家専用）	159,294,728円
国内バランス60VA2（適格機関投資家専用）	2,122,651円
バランス30VA1（適格機関投資家専用）	21,562,672円
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	84,833,818円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	18,447,216円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	52,219,315円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	669,049,530円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	373,721,136円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,464,530,979円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	34,980,647円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	15,436,739円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	392,112,893円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	223,884,037円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	287,247,620円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	27,140,956円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	506,467,134円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,907,960,207円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,800,466,226円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,567,288,518円
コア投資戦略ファンド（成長型）	3,558,869,347円
分散投資コア戦略ファンドA	1,671,155,657円
分散投資コア戦略ファンドS	6,232,800,431円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	529,901,170円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	389,100,858円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,677,177,841円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	206,555,070円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	9,580,250円
SMT インデックスバランス・オープン	51,052,963円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	27,824,772,823円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	421,486,060円
SMT 世界経済インデックス・オープン	47,493,894円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	191,052,428円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	32,894,758円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,008,359円
グローバル経済コア	210,210,812円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	32,488,330円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	563,599,010円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	27,252,430円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,247,297,494円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	260,308,230円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	25,277,923円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	24,008,973円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	11,664,003円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	15,417,057円
10資産分散投資ファンド	94,695,277円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,578,750,664円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	681,289,234円

区分	2023年 5月29日現在
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	301,683,658円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	21,790,354円
S M T A M 9 資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	693,708,422円
S M T A M 日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	44,770,677,888円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,186,387円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	217,884,106円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2023年 5月29日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	60,651,803,997	
合計	60,651,803,997	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2023年 5月29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	7,607,322,000	-	8,127,240,000	519,918,000
合計		7,607,322,000	-	8,127,240,000	519,918,000

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

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	9,500	3,630.00	34,485,000	
ニッセイ	250,300	636.00	159,190,800	
マルハニチロ	37,100	2,505.00	92,935,500	
雪国まいたけ	21,300	971.00	20,682,300	
カネコ種苗	7,700	1,498.00	11,534,600	
サカタのタネ	28,500	4,045.00	115,282,500	
ホクト	22,300	1,851.00	41,277,300	
ホクリヨウ	2,800	893.00	2,500,400	
住石ホールディングス	30,300	340.00	10,302,000	
日鉄鉱業	10,000	3,760.00	37,600,000	
三井松島ホールディングス	11,300	2,815.00	31,809,500	

INPEX	925,600	1,537.00	1,422,647,200
石油資源開発	29,000	4,330.00	125,570,000
K&Oエナジーグループ	11,300	2,327.00	26,295,100
ショーボンドホールディングス	34,100	5,660.00	193,006,000
ミライト・ワン	82,800	1,766.00	146,224,800
タマホーム	15,700	4,120.00	64,684,000
サンヨーホームズ	2,400	705.00	1,692,000
日本アクア	8,100	905.00	7,330,500
ファーストコーポレーション	5,000	894.00	4,470,000
ベストテラ	4,200	930.00	3,906,000
Robot Home	42,600	183.00	7,795,800
キャンディル	3,500	567.00	1,984,500
ダイセキ環境ソリューション	3,900	968.00	3,775,200
第一カッター興業	6,400	1,245.00	7,968,000
安藤・間	145,000	1,031.00	149,495,000
東急建設	71,300	708.00	50,480,400
コムシスホールディングス	84,700	2,759.00	233,687,300
ピーアールホールディングス	39,700	378.00	15,006,600
高松コンストラクショングループ	16,300	2,398.00	39,087,400
東建コーポレーション	7,200	7,480.00	53,856,000
ソネック	2,100	973.00	2,043,300
ヤマウラ	12,700	1,191.00	15,125,700
オリエンタル白石	89,900	304.00	27,329,600
大成建設	163,800	4,620.00	756,756,000
大林組	626,100	1,174.00	735,041,400
清水建設	526,300	867.00	456,302,100
飛鳥建設	19,300	1,206.00	23,275,800
長谷工コーポレーション	180,700	1,627.00	293,998,900
松井建設	16,300	694.00	11,312,200
銭高組	1,700	3,040.00	5,168,000
鹿島建設	388,200	2,061.00	800,080,200
不動テトラ	12,100	1,824.00	22,070,400
大末建設	5,000	1,280.00	6,400,000
鉄建建設	12,600	1,974.00	24,872,400
西松建設	29,700	3,385.00	100,534,500
三井住友建設	141,200	357.00	50,408,400
大豊建設	7,200	3,845.00	27,684,000
佐田建設	8,700	439.00	3,819,300
ナカノフドー建設	9,700	377.00	3,656,900
奥村組	28,400	3,885.00	110,334,000
東鉄工業	24,100	2,641.00	63,648,100
イチケン	3,100	1,887.00	5,849,700

富士ピー・エス	6,100	435.00	2,653,500
浅沼組	14,000	3,135.00	43,890,000
戸田建設	215,400	796.00	171,458,400
熊谷組	29,300	2,909.00	85,233,700
北野建設	2,600	2,980.00	7,748,000
植木組	3,900	1,293.00	5,042,700
矢作建設工業	23,800	1,105.00	26,299,000
ピーエス三菱	22,200	705.00	15,651,000
日本ハウスホールディングス	34,700	383.00	13,290,100
新日本建設	24,600	1,125.00	27,675,000
東亜道路工業	7,000	4,110.00	28,770,000
日本道路	3,500	8,400.00	29,400,000
東亜建設工業	15,000	3,100.00	46,500,000
日本国土開発	52,500	612.00	32,130,000
若築建設	7,800	3,360.00	26,208,000
東洋建設	56,700	989.00	56,076,300
五洋建設	248,200	720.00	178,704,000
世紀東急工業	22,500	1,295.00	29,137,500
福田組	6,600	4,720.00	31,152,000
住友林業	134,300	3,180.00	427,074,000
日本基礎技術	8,200	509.00	4,173,800
巴コーポレーション	15,200	438.00	6,657,600
大和ハウス工業	489,200	3,593.00	1,757,695,600
ライト工業	32,400	1,936.00	62,726,400
積水ハウス	548,400	2,834.00	1,554,165,600
日特建設	16,700	989.00	16,516,300
北陸電気工事	12,000	863.00	10,356,000
ユアテック	38,600	848.00	32,732,800
日本リーテック	15,400	1,486.00	22,884,400
四電工	7,300	2,130.00	15,549,000
中電工	27,200	2,209.00	60,084,800
関電工	95,900	1,069.00	102,517,100
きんでん	123,200	1,859.00	229,028,800
東京エネシス	17,400	945.00	16,443,000
トーエネック	5,800	3,675.00	21,315,000
住友電設	16,700	2,821.00	47,110,700
日本電設工業	28,800	1,869.00	53,827,200
エクシオグループ	80,600	2,657.00	214,154,200
新日本空調	9,700	2,233.00	21,660,100
九電工	42,600	3,780.00	161,028,000
三機工業	38,800	1,486.00	57,656,800
日揮ホールディングス	173,200	1,723.00	298,423,600

中外炉工業	5,700	1,984.00	11,308,800
ヤマト	11,300	943.00	10,655,900
太平電業	10,900	4,105.00	44,744,500
高砂熱学工業	42,200	2,374.00	100,182,800
三晃金属工業	1,700	4,075.00	6,927,500
朝日工業社	7,300	2,437.00	17,790,100
明星工業	30,100	944.00	28,414,400
大気社	20,200	3,755.00	75,851,000
ダイダン	11,500	2,563.00	29,474,500
日比谷総合設備	15,000	2,282.00	34,230,000
フィル・カンパニー	3,100	892.00	2,765,200
テスホールディングス	18,900	1,021.00	19,296,900
インフロニア・ホールディングス	183,500	1,263.00	231,760,500
東洋エンジニアリング	23,200	546.00	12,667,200
レイズネクスト	25,300	1,416.00	35,824,800
ニッポン	47,400	1,799.00	85,272,600
日清製粉グループ本社	162,500	1,771.00	287,787,500
日東富士製粉	3,100	4,625.00	14,337,500
昭和産業	15,300	2,575.00	39,397,500
鳥越製粉	10,900	613.00	6,681,700
中部飼料	24,300	1,098.00	26,681,400
フィード・ワン	25,700	730.00	18,761,000
東洋精糖	2,500	1,391.00	3,477,500
日本甜菜製糖	10,200	1,823.00	18,594,600
D M三井製糖ホールディングス	17,400	2,631.00	45,779,400
塩水港精糖	16,400	198.00	3,247,200
ウェルネオシュガー	9,100	2,062.00	18,764,200
森永製菓	32,100	4,550.00	146,055,000
中村屋	4,400	3,080.00	13,552,000
江崎グリコ	50,300	3,760.00	189,128,000
名糖産業	6,900	1,612.00	11,122,800
井村屋グループ	9,600	2,258.00	21,676,800
不二家	12,000	2,477.00	29,724,000
山崎製パン	117,600	2,033.00	239,080,800
第一屋製パン	2,600	399.00	1,037,400
モロゾフ	5,700	3,700.00	21,090,000
亀田製菓	11,200	4,180.00	46,816,000
寿スピリッツ	18,700	10,320.00	192,984,000
カルビー	80,500	2,764.00	222,502,000
森永乳業	31,900	5,100.00	162,690,000
六甲バター	12,900	1,357.00	17,505,300
ヤクルト本社	125,600	9,110.00	1,144,216,000

明治ホールディングス	217,900	3,190.00	695,101,000
雪印メグミルク	42,500	1,923.00	81,727,500
プリマハム	23,600	2,220.00	52,392,000
日本ハム	68,700	3,830.00	263,121,000
林兼産業	4,200	482.00	2,024,400
丸大食品	17,700	1,479.00	26,178,300
S Foods	19,400	3,145.00	61,013,000
柿安本店	6,900	2,307.00	15,918,300
伊藤ハム米久ホールディングス	134,300	710.00	95,353,000
サッポロホールディングス	57,900	3,830.00	221,757,000
アサヒグループホールディングス	406,100	5,354.00	2,174,259,400
キリンホールディングス	793,100	2,084.50	1,653,216,950
宝ホールディングス	120,000	1,047.00	125,640,000
オエノンホールディングス	52,500	344.00	18,060,000
養命酒製造	5,800	1,823.00	10,573,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	137,700	1,574.00	216,739,800
サントリー食品インターナショナル	123,800	5,360.00	663,568,000
ダイトーグループホールディングス	10,000	4,900.00	49,000,000
伊藤園	59,600	4,205.00	250,618,000
キーコーヒー	19,700	2,040.00	40,188,000
ユニカフェ	4,500	909.00	4,090,500
ジャパンフーズ	2,100	1,109.00	2,328,900
日清オイリオグループ	24,800	3,390.00	84,072,000
不二製油グループ本社	40,900	1,982.00	81,063,800
かどや製油	1,600	3,470.00	5,552,000
J - オイルミルズ	17,900	1,578.00	28,246,200
キッコーマン	116,500	8,350.00	972,775,000
味の素	424,400	5,444.00	2,310,433,600
ブルドックソース	9,300	1,978.00	18,395,400
キューピー	94,500	2,279.00	215,365,500
ハウス食品グループ本社	53,800	3,230.00	173,774,000
カゴメ	81,900	3,355.00	274,774,500
焼津水産化学工業	5,400	802.00	4,330,800
アリアケジャパン	15,300	5,130.00	78,489,000
ピエトロ	2,000	1,806.00	3,612,000
エバラ食品工業	4,700	2,922.00	13,733,400
やまみ	1,300	1,430.00	1,859,000
ニチレイ	80,500	3,005.00	241,902,500
東洋水産	88,800	5,850.00	519,480,000
イトアンドホールディングス	7,500	2,200.00	16,500,000
大冷	1,700	1,911.00	3,248,700
ヨシムラ・フード・ホールディングス	11,100	800.00	8,880,000

日清食品ホールディングス	61,800	11,910.00	736,038,000
永谷園ホールディングス	8,600	2,148.00	18,472,800
一正蒲鉾	5,900	762.00	4,495,800
フジッコ	18,100	1,895.00	34,299,500
ロック・フィールド	19,700	1,460.00	28,762,000
日本たばこ産業	1,157,000	3,083.00	3,567,031,000
ケンコーマヨネーズ	12,100	1,256.00	15,197,600
わらべや日洋ホールディングス	12,900	2,285.00	29,476,500
なとり	11,000	1,925.00	21,175,000
イフジ産業	2,300	1,053.00	2,421,900
ファーマフーズ	25,200	1,811.00	45,637,200
ユーグレナ	113,600	916.00	104,057,600
紀文食品	13,700	995.00	13,631,500
ピクルスホールディングス	10,300	1,216.00	12,524,800
ミヨシ油脂	4,800	985.00	4,728,000
理研ビタミン	15,200	2,035.00	30,932,000
片倉工業	16,800	1,698.00	28,526,400
ゲンゼ	12,800	4,505.00	57,664,000
東洋紡	77,800	1,015.00	78,967,000
ユニチカ	56,500	221.00	12,486,500
富士紡ホールディングス	7,200	3,075.00	22,140,000
倉敷紡績	13,600	2,268.00	30,844,800
シキボウ	7,700	972.00	7,484,400
日本毛織	47,700	997.00	47,556,900
トーア紡コーポレーション	5,400	384.00	2,073,600
帝国繊維	20,500	1,640.00	33,620,000
帝人	172,200	1,375.00	236,775,000
東レ	1,198,700	735.60	881,763,720
住江織物	3,000	2,425.00	7,275,000
日本フェルト	9,000	410.00	3,690,000
イチカワ	2,200	1,344.00	2,956,800
日東製網	1,500	1,385.00	2,077,500
アツギ	8,600	414.00	3,560,400
ダイニック	3,600	740.00	2,664,000
セーレン	34,800	2,269.00	78,961,200
ソトー	4,600	752.00	3,459,200
東海染工	1,500	1,064.00	1,596,000
小松マテーレ	26,200	661.00	17,318,200
ワコールホールディングス	34,500	2,903.00	100,153,500
ホギメディカル	24,100	3,295.00	79,409,500
T S Iホールディングス	60,500	674.00	40,777,000
マツオカコーポレーション	3,900	1,097.00	4,278,300

ワールド	23,100	1,540.00	35,574,000
三陽商会	5,300	1,634.00	8,660,200
ナイガイ	5,300	262.00	1,388,600
オンワードホールディングス	116,500	380.00	44,270,000
ルックホールディングス	4,100	2,279.00	9,343,900
ゴールドウイン	31,700	11,900.00	377,230,000
デサント	30,900	3,850.00	118,965,000
キング	6,400	555.00	3,552,000
ヤマトインターナショナル	11,700	268.00	3,135,600
特種東海製紙	8,000	3,110.00	24,880,000
王子ホールディングス	744,800	549.00	408,895,200
日本製紙	93,100	1,162.00	108,182,200
三菱製紙	16,700	469.00	7,832,300
北越コーポレーション	113,000	907.00	102,491,000
中越パルプ工業	5,600	1,238.00	6,932,800
巴川製紙所	4,400	658.00	2,895,200
大王製紙	79,000	1,054.00	83,266,000
阿波製紙	3,300	544.00	1,795,200
レンゴー	162,800	840.00	136,752,000
トモク	10,300	1,895.00	19,518,500
ザ・パック	13,300	3,055.00	40,631,500
北の達人コーポレーション	75,300	286.00	21,535,800
クラレ	284,200	1,343.00	381,680,600
旭化成	1,116,600	965.50	1,078,077,300
共和レザー	8,000	533.00	4,264,000
レゾナック・ホールディングス	172,800	2,269.00	392,083,200
住友化学	1,326,400	425.00	563,720,000
住友精化	7,500	4,200.00	31,500,000
日産化学	84,900	6,070.00	515,343,000
ラサ工業	6,900	2,089.00	14,414,100
クレハ	15,300	8,170.00	125,001,000
多木化学	6,900	4,320.00	29,808,000
テイカ	12,000	1,290.00	15,480,000
石原産業	32,300	1,273.00	41,117,900
片倉コープアグリ	2,800	1,256.00	3,516,800
日本曹達	19,200	4,705.00	90,336,000
東ソー	238,700	1,645.00	392,661,500
トクヤマ	57,700	2,223.00	128,267,100
セントラル硝子	28,700	2,938.00	84,320,600
東亜合成	89,700	1,238.00	111,048,600
大阪ソーダ	10,700	4,105.00	43,923,500
関東電化工業	34,600	875.00	30,275,000

デンカ	65,000	2,618.00	170,170,000
信越化学工業	1,486,200	4,403.00	6,543,738,600
日本カーバイド工業	5,300	1,293.00	6,852,900
堺化学工業	13,600	1,827.00	24,847,200
第一稀元素化学工業	16,300	905.00	14,751,500
エア・ウォーター	168,700	1,861.00	313,950,700
日本酸素ホールディングス	173,500	2,910.00	504,885,000
日本化学工業	6,000	1,812.00	10,872,000
東邦アセチレン	2,900	1,297.00	3,761,300
日本パーカラライジング	88,500	1,066.00	94,341,000
高压ガス工業	26,000	738.00	19,188,000
チタン工業	1,700	1,389.00	2,361,300
四国化成ホールディングス	21,200	1,447.00	30,676,400
戸田工業	4,100	2,316.00	9,495,600
ステラ ケミファ	10,600	3,035.00	32,171,000
保土谷化学工業	5,100	3,190.00	16,269,000
日本触媒	27,200	5,220.00	141,984,000
大日精化工業	12,400	1,945.00	24,118,000
カネカ	40,900	3,880.00	158,692,000
三菱瓦斯化学	133,500	1,981.00	264,463,500
三井化学	147,400	3,575.00	526,955,000
J S R	166,900	3,400.00	567,460,000
東京応化工業	31,300	8,480.00	265,424,000
大阪有機化学工業	13,500	2,384.00	32,184,000
三菱ケミカルグループ	1,206,600	825.80	996,410,280
K Hネオケム	29,800	2,285.00	68,093,000
ダイセル	262,900	1,201.00	315,742,900
住友ベークライト	26,500	5,560.00	147,340,000
積水化学工業	365,700	1,964.00	718,234,800
日本ゼオン	107,200	1,479.00	158,548,800
アイカ工業	45,100	2,960.00	133,496,000
U B E	92,200	2,225.00	205,145,000
積水樹脂	26,000	2,046.00	53,196,000
タキロンシーアイ	39,100	527.00	20,605,700
旭有機材	11,900	3,725.00	44,327,500
ニチバン	11,100	1,848.00	20,512,800
リケンテクノス	38,500	609.00	23,446,500
大倉工業	8,300	2,085.00	17,305,500
積水化成成品工業	25,100	419.00	10,516,900
群栄化学工業	4,200	2,535.00	10,647,000
タイガースポリマー	6,300	540.00	3,402,000
ミライアル	4,300	1,701.00	7,314,300

ダイキアクシス	5,100	711.00	3,626,100
ダイキョーニシカワ	39,500	750.00	29,625,000
竹本容器	4,700	799.00	3,755,300
森六ホールディングス	9,100	2,006.00	18,254,600
恵和	11,600	1,108.00	12,852,800
日本化薬	136,600	1,212.00	165,559,200
カーリットホールディングス	16,100	718.00	11,559,800
日本精化	10,200	2,549.00	25,999,800
扶桑化学工業	16,600	4,010.00	66,566,000
トリケミカル研究所	23,900	2,566.00	61,327,400
A D E K A	62,300	2,483.00	154,690,900
日油	55,300	5,980.00	330,694,000
新日本理化	19,200	214.00	4,108,800
ハリマ化成グループ	9,700	849.00	8,235,300
花王	435,400	5,080.00	2,211,832,000
第一工業製薬	6,400	1,817.00	11,628,800
石原ケミカル	8,200	1,644.00	13,480,800
日華化学	5,600	835.00	4,676,000
ニイタカ	2,500	2,152.00	5,380,000
三洋化成工業	11,000	4,120.00	45,320,000
有機合成薬品工業	10,300	295.00	3,038,500
大日本塗料	21,800	904.00	19,707,200
日本ペイントホールディングス	791,200	1,100.00	870,320,000
関西ペイント	163,800	2,114.00	346,273,200
神東塗料	11,600	132.00	1,531,200
中国塗料	29,400	1,075.00	31,605,000
日本特殊塗料	8,800	1,004.00	8,835,200
藤倉化成	24,000	423.00	10,152,000
太陽ホールディングス	27,200	2,630.00	71,536,000
D I C	69,900	2,569.00	179,573,100
サカタインクス	39,800	1,159.00	46,128,200
東洋インキS Cホールディングス	35,000	2,192.00	76,720,000
T & K T O K A	15,900	1,187.00	18,873,300
富士フイルムホールディングス	343,500	8,529.00	2,929,711,500
資生堂	373,800	6,503.00	2,430,821,400
ライオン	214,800	1,370.00	294,276,000
高砂香料工業	12,100	2,630.00	31,823,000
マンダム	38,700	1,547.00	59,868,900
ミルボン	26,500	4,830.00	127,995,000
ファンケル	78,300	2,308.00	180,716,400
コーセー	36,400	14,030.00	510,692,000
コタ	16,500	1,579.00	26,053,500

シーボン	1,800	1,555.00	2,799,000
ポーラ・オルビスホールディングス	91,800	1,958.00	179,744,400
ノエビアホールディングス	16,000	5,280.00	84,480,000
アジュバンホールディングス	3,400	919.00	3,124,600
新日本製薬	10,200	1,382.00	14,096,400
アクシージア	9,100	1,207.00	10,983,700
エステー	13,800	1,532.00	21,141,600
アグロ カネショウ	7,200	1,612.00	11,606,400
コニシ	29,900	2,128.00	63,627,200
長谷川香料	34,200	3,105.00	106,191,000
星光PMC	7,100	557.00	3,954,700
小林製薬	52,100	7,920.00	412,632,000
荒川化学工業	15,200	1,000.00	15,200,000
メック	14,700	3,200.00	47,040,000
日本高純度化学	4,500	2,529.00	11,380,500
タカラバイオ	48,200	1,629.00	78,517,800
JCU	20,000	3,525.00	70,500,000
新田ゼラチン	8,600	736.00	6,329,600
OATアグリオ	5,700	1,799.00	10,254,300
デクセリアルズ	51,700	3,050.00	157,685,000
アース製薬	16,200	5,000.00	81,000,000
北興化学工業	18,000	935.00	16,830,000
大成ラミック	5,600	2,923.00	16,368,800
クミアイ化学工業	71,100	914.00	64,985,400
日本農薬	32,800	636.00	20,860,800
アキレス	11,300	1,427.00	16,125,100
有沢製作所	29,100	1,108.00	32,242,800
日東電工	130,000	10,070.00	1,309,100,000
レック	25,500	819.00	20,884,500
三光合成	22,500	548.00	12,330,000
きもと	20,500	182.00	3,731,000
藤森工業	14,100	3,465.00	48,856,500
前澤化成工業	11,600	1,571.00	18,223,600
未来工業	6,400	2,378.00	15,219,200
ウェーブロックホールディングス	4,200	572.00	2,402,400
JSP	12,600	1,664.00	20,966,400
エフピコ	33,900	2,872.00	97,360,800
天馬	15,200	2,467.00	37,498,400
信越ポリマー	33,100	1,416.00	46,869,600
東リ	31,200	307.00	9,578,400
ニフコ	64,600	3,770.00	243,542,000
バルカー	15,000	3,490.00	52,350,000

ユニ・チャーム	373,000	5,177.00	1,931,021,000
ショーエイコーポレーション	4,000	560.00	2,240,000
協和キリン	216,300	2,662.00	575,790,600
武田薬品工業	1,584,300	4,539.00	7,191,137,700
アステラス製薬	1,691,200	2,296.00	3,882,995,200
住友ファーマ	132,800	673.00	89,374,400
塩野義製薬	225,700	6,179.00	1,394,600,300
わかもと製薬	13,000	229.00	2,977,000
日本新薬	42,200	6,420.00	270,924,000
中外製薬	560,400	3,806.00	2,132,882,400
科研製薬	30,700	3,585.00	110,059,500
エーザイ	217,800	8,925.00	1,943,865,000
ロート製薬	173,400	3,015.00	522,801,000
小野薬品工業	345,400	2,600.00	898,040,000
久光製薬	39,800	3,685.00	146,663,000
持田製薬	20,600	3,455.00	71,173,000
参天製薬	326,200	1,291.00	421,124,200
扶桑薬品工業	5,700	2,005.00	11,428,500
日本ケミファ	1,400	1,840.00	2,576,000
ツムラ	56,400	2,853.00	160,909,200
キッセイ薬品工業	27,700	2,891.00	80,080,700
生化学工業	34,100	776.00	26,461,600
栄研化学	29,100	1,537.00	44,726,700
鳥居薬品	9,600	3,345.00	32,112,000
JCRファーマ	60,600	1,377.00	83,446,200
東和薬品	27,500	1,846.00	50,765,000
富士製薬工業	13,200	1,189.00	15,694,800
ゼリア新薬工業	24,800	2,451.00	60,784,800
そーせいグループ	61,500	3,040.00	186,960,000
第一三共	1,559,600	4,544.00	7,086,822,400
杏林製薬	38,800	1,786.00	69,296,800
大幸薬品	32,500	374.00	12,155,000
ダイト	12,500	2,409.00	30,112,500
大塚ホールディングス	409,600	5,228.00	2,141,388,800
大正製薬ホールディングス	39,800	5,380.00	214,124,000
ペプチドリーム	86,800	2,007.00	174,207,600
あすか製薬ホールディングス	18,400	1,266.00	23,294,400
サワイグループホールディングス	40,900	3,525.00	144,172,500
日本コークス工業	161,500	100.00	16,150,000
ニチレキ	21,200	1,730.00	36,676,000
ユシロ化学工業	9,300	978.00	9,095,400
ビーピー・カストロール	5,400	889.00	4,800,600

富士石油	36,500	267.00	9,745,500
MORESCO	4,500	1,132.00	5,094,000
出光興産	198,800	2,793.00	555,248,400
ENEOSホールディングス	3,036,700	476.50	1,446,987,550
コスモエネルギーホールディングス	70,800	4,105.00	290,634,000
横浜ゴム	101,900	3,050.00	310,795,000
TOYO TIRE	102,900	1,748.00	179,869,200
ブリヂストン	571,700	5,763.00	3,294,707,100
住友ゴム工業	175,600	1,285.00	225,646,000
藤倉コンポジット	9,900	929.00	9,197,100
オカモト	9,900	4,015.00	39,748,500
フコク	9,400	1,174.00	11,035,600
ニッタ	18,200	3,025.00	55,055,000
住友理工	34,700	762.00	26,441,400
三ツ星ベルト	26,100	4,035.00	105,313,500
バンドー化学	28,400	1,307.00	37,118,800
日東紡績	20,300	2,169.00	44,030,700
AGC	182,200	5,130.00	934,686,000
日本板硝子	91,300	610.00	55,693,000
石塚硝子	2,300	1,522.00	3,500,600
日本山村硝子	5,400	897.00	4,843,800
日本電気硝子	73,200	2,657.00	194,492,400
オハラ	8,700	1,229.00	10,692,300
住友大阪セメント	25,300	3,525.00	89,182,500
太平洋セメント	114,100	2,426.00	276,806,600
日本ヒューム	16,000	740.00	11,840,000
日本コンクリート工業	35,400	282.00	9,982,800
三谷セキサン	7,500	4,795.00	35,962,500
アジアパイルホールディングス	28,300	605.00	17,121,500
東海カーボン	150,300	1,222.00	183,666,600
日本カーボン	10,300	4,415.00	45,474,500
東洋炭素	11,300	5,080.00	57,404,000
ノリタケカンパニーリミテド	9,000	5,040.00	45,360,000
TOTO	118,200	4,285.00	506,487,000
日本碍子	208,300	1,742.00	362,858,600
日本特殊陶業	136,400	2,618.00	357,095,200
MARUWA	6,600	19,490.00	128,634,000
品川リフラクトリーズ	5,100	4,825.00	24,607,500
黒崎播磨	3,700	6,780.00	25,086,000
ヨータイ	12,100	1,414.00	17,109,400
東京窯業	13,400	327.00	4,381,800
ニッカトー	6,600	601.00	3,966,600

フジインコーポレーテッド	14,300	8,940.00	127,842,000
クニミネ工業	4,300	920.00	3,956,000
エーアンドエーマテリアル	2,700	1,059.00	2,859,300
ニチアス	45,300	2,723.00	123,351,900
ニチハ	22,500	2,936.00	66,060,000
日本製鉄	824,700	2,811.00	2,318,231,700
神戸製鋼所	370,400	1,082.00	400,772,800
中山製鋼所	38,000	770.00	29,260,000
合同製鐵	9,200	3,130.00	28,796,000
J F E ホールディングス	492,200	1,771.00	871,686,200
東京製鐵	51,800	1,352.00	70,033,600
共英製鋼	21,000	1,830.00	38,430,000
大和工業	30,400	5,570.00	169,328,000
東京鐵鋼	8,800	2,571.00	22,624,800
大阪製鐵	8,500	1,338.00	11,373,000
淀川製鋼所	20,900	2,966.00	61,989,400
中部鋼鈹	15,100	1,850.00	27,935,000
丸一鋼管	56,100	3,115.00	174,751,500
モリ工業	3,300	3,245.00	10,708,500
大同特殊鋼	23,200	5,300.00	122,960,000
日本高周波鋼業	5,000	321.00	1,605,000
日本冶金工業	13,500	4,075.00	55,012,500
山陽特殊製鋼	18,200	2,568.00	46,737,600
愛知製鋼	10,600	2,582.00	27,369,200
日本金属	3,100	888.00	2,752,800
大平洋金属	13,100	1,644.00	21,536,400
新日本電工	117,900	274.00	32,304,600
栗本鐵工所	8,800	2,002.00	17,617,600
虹技	1,800	1,180.00	2,124,000
三菱製鋼	11,600	1,197.00	13,885,200
日亜鋼業	14,700	293.00	4,307,100
日本精線	2,500	4,495.00	11,237,500
エンビプロ・ホールディングス	9,900	586.00	5,801,400
シンニッタン	15,600	243.00	3,790,800
新家工業	3,100	2,170.00	6,727,000
大紀アルミニウム工業所	26,300	1,315.00	34,584,500
日本輕金属ホールディングス	49,700	1,366.00	67,890,200
三井金属鈹業	53,600	3,180.00	170,448,000
東邦亜鉛	10,900	1,722.00	18,769,800
三菱マテリアル	122,900	2,385.00	293,116,500
住友金属鈹山	213,600	4,325.00	923,820,000
D O W A ホールディングス	41,400	4,265.00	176,571,000

古河機械金属	27,100	1,388.00	37,614,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	27,100	3,030.00	82,113,000
東邦チタニウム	33,400	1,929.00	64,428,600
U A C J	25,800	2,632.00	67,905,600
C Kサンエツ	4,500	4,170.00	18,765,000
古河電気工業	61,400	2,420.00	148,588,000
住友電気工業	636,000	1,706.00	1,085,016,000
フジクラ	197,600	1,090.00	215,384,000
S W C C	20,600	1,883.00	38,789,800
タツタ電線	37,600	716.00	26,921,600
カナレ電気	2,300	1,324.00	3,045,200
平河ヒューテック	10,700	1,417.00	15,161,900
リョービ	19,700	1,569.00	30,909,300
アーレスティ	16,000	629.00	10,064,000
アサヒホールディングス	74,500	1,930.00	143,785,000
稲葉製作所	9,600	1,453.00	13,948,800
宮地エンジニアリンググループ	5,100	3,960.00	20,196,000
トーカロ	50,600	1,379.00	69,777,400
アルファC o	5,200	1,067.00	5,548,400
S U M C O	350,600	2,099.00	735,909,400
川田テクノロジーズ	4,300	4,890.00	21,027,000
R S Technologies	12,300	3,250.00	39,975,000
ジェイテックコーポレーション	1,900	2,735.00	5,196,500
信和	7,900	732.00	5,782,800
東洋製罐グループホールディングス	121,900	2,090.00	254,771,000
ホッカンホールディングス	9,900	1,358.00	13,444,200
コロナ	10,300	881.00	9,074,300
横河ブリッジホールディングス	23,100	2,268.00	52,390,800
駒井ハルテック	2,300	1,783.00	4,100,900
高田機工	1,200	2,715.00	3,258,000
三和ホールディングス	169,600	1,631.00	276,617,600
文化シャッター	53,000	1,134.00	60,102,000
三協立山	21,100	655.00	13,820,500
アルインコ	14,000	988.00	13,832,000
東洋シャッター	3,300	553.00	1,824,900
L I X I L	268,300	1,879.00	504,135,700
日本フィルコン	9,300	464.00	4,315,200
ノーリツ	27,100	1,751.00	47,452,100
長府製作所	18,600	2,346.00	43,635,600
リンナイ	100,200	3,015.00	302,103,000
ダイニチ工業	7,100	697.00	4,948,700
日東精工	26,700	597.00	15,939,900

三洋工業	1,600	1,916.00	3,065,600
岡部	29,600	784.00	23,206,400
ジーテクト	20,500	1,385.00	28,392,500
東ブレ	32,500	1,467.00	47,677,500
高周波熱錬	28,400	918.00	26,071,200
東京製綱	10,900	1,072.00	11,684,800
サンコール	12,700	499.00	6,337,300
モリテック スチール	10,500	261.00	2,740,500
パイオラックス	25,400	1,956.00	49,682,400
エイチワン	19,000	650.00	12,350,000
日本発條	162,900	975.00	158,827,500
中央発條	13,600	713.00	9,696,800
アドバネクス	1,700	1,005.00	1,708,500
立川ブラインド工業	8,300	1,243.00	10,316,900
三益半導体工業	14,200	3,115.00	44,233,000
日本ドライケミカル	3,400	1,710.00	5,814,000
日本製鋼所	49,700	2,811.00	139,706,700
三浦工業	75,300	3,760.00	283,128,000
タクマ	55,500	1,441.00	79,975,500
ツガミ	40,200	1,324.00	53,224,800
オークマ	18,000	6,710.00	120,780,000
芝浦機械	18,000	4,535.00	81,630,000
アマダ	287,800	1,359.00	391,120,200
アイダエンジニアリング	37,200	916.00	34,075,200
TAKISAWA	3,800	1,229.00	4,670,200
FUJI	78,400	2,319.00	181,809,600
牧野フライス製作所	20,000	5,340.00	106,800,000
オーエスジー	86,100	2,024.00	174,266,400
ダイジェット工業	1,600	862.00	1,379,200
旭ダイヤモンド工業	50,500	860.00	43,430,000
D M G 森精機	109,400	2,377.00	260,043,800
ソディック	49,800	728.00	36,254,400
ディスコ	86,800	20,440.00	1,774,192,000
日東工器	8,800	2,053.00	18,066,400
日進工具	15,100	1,141.00	17,229,100
パンチ工業	12,800	490.00	6,272,000
富士ダイス	6,700	686.00	4,596,200
豊和工業	7,800	780.00	6,084,000
東洋機械金属	9,800	639.00	6,262,200
エンシュウ	3,200	687.00	2,198,400
島精機製作所	28,800	1,750.00	50,400,000
オプトラン	26,700	2,376.00	63,439,200

NCホールディングス	2,900	2,208.00	6,403,200
イワキポンプ	12,100	1,300.00	15,730,000
フリュー	19,000	1,069.00	20,311,000
ヤマシンフィルタ	43,200	319.00	13,780,800
日阪製作所	17,600	878.00	15,452,800
やまびこ	29,500	1,452.00	42,834,000
野村マイクロ・サイエンス	6,100	6,380.00	38,918,000
平田機工	8,600	7,320.00	62,952,000
P E G A S U S	20,000	556.00	11,120,000
マルマエ	7,900	1,809.00	14,291,100
タツモ	9,900	2,055.00	20,344,500
ナプテスコ	113,200	3,100.00	350,920,000
三井海洋開発	22,600	1,364.00	30,826,400
レオン自動機	19,000	1,507.00	28,633,000
S M C	58,500	74,550.00	4,361,175,000
ホソカワミクロン	12,700	2,807.00	35,648,900
ユニオンツール	7,900	3,200.00	25,280,000
オイレス工業	25,200	1,912.00	48,182,400
日精エー・エス・ピー機械	7,200	4,070.00	29,304,000
サトーホールディングス	25,700	1,950.00	50,115,000
技研製作所	17,000	2,016.00	34,272,000
日本エアーテック	9,200	1,140.00	10,488,000
カワタ	4,100	936.00	3,837,600
日精樹脂工業	13,500	953.00	12,865,500
オカダアイヨン	4,300	1,914.00	8,230,200
ワイエイシイホールディングス	6,000	3,525.00	21,150,000
小松製作所	844,800	3,435.00	2,901,888,000
住友重機械工業	106,700	3,195.00	340,906,500
日立建機	71,800	3,530.00	253,454,000
日工	26,900	633.00	17,027,700
巴工業	7,800	2,452.00	19,125,600
井関農機	17,000	1,206.00	20,502,000
T O W A	18,400	2,545.00	46,828,000
丸山製作所	2,400	1,822.00	4,372,800
北川鉄工所	7,200	1,205.00	8,676,000
ローツェ	9,400	11,540.00	108,476,000
タカキタ	4,100	440.00	1,804,000
クボタ	954,100	2,000.00	1,908,200,000
荏原実業	8,700	3,040.00	26,448,000
三菱化工機	5,900	2,457.00	14,496,300
月島ホールディングス	24,500	1,168.00	28,616,000
帝国電機製作所	12,700	2,315.00	29,400,500

新東工業	36,600	1,094.00	40,040,400
澁谷工業	17,000	2,572.00	43,724,000
アイチ コーポレーション	25,300	845.00	21,378,500
小森コーポレーション	41,900	979.00	41,020,100
鶴見製作所	13,800	2,461.00	33,961,800
日本ギア工業	4,900	382.00	1,871,800
酒井重工業	2,300	4,465.00	10,269,500
荏原製作所	73,800	6,300.00	464,940,000
石井鐵工所	1,600	2,848.00	4,556,800
西島製作所	15,600	1,612.00	25,147,200
北越工業	18,200	1,265.00	23,023,000
ダイキン工業	215,200	26,750.00	5,756,600,000
オルガノ	24,800	3,895.00	96,596,000
トーヨーカネツ	6,900	3,455.00	23,839,500
栗田工業	100,900	5,910.00	596,319,000
椿本チエイン	25,600	3,425.00	87,680,000
大同工業	5,800	723.00	4,193,400
木村化工機	14,000	713.00	9,982,000
アネスト岩田	30,700	1,097.00	33,677,900
ダイフク	278,900	2,875.00	801,837,500
サムコ	4,800	5,780.00	27,744,000
加藤製作所	6,700	1,082.00	7,249,400
油研工業	2,200	2,028.00	4,461,600
タダノ	95,200	1,059.00	100,816,800
フジテック	63,200	3,680.00	232,576,000
C K D	49,900	2,156.00	107,584,400
平和	60,000	2,406.00	144,360,000
理想科学工業	16,100	2,265.00	36,466,500
S A N K Y O	35,400	5,570.00	197,178,000
日本金銭機械	19,900	1,137.00	22,626,300
マースグループホールディングス	10,600	3,010.00	31,906,000
フクシマガリレイ	13,300	5,150.00	68,495,000
オーイズミ	5,400	496.00	2,678,400
ダイコク電機	9,900	2,843.00	28,145,700
竹内製作所	32,700	3,875.00	126,712,500
アマノ	51,200	2,966.00	151,859,200
J U K I	28,100	575.00	16,157,500
ジャノメ	18,400	607.00	11,168,800
マックス	22,200	2,337.00	51,881,400
グローリー	43,300	2,695.00	116,693,500
新晃工業	18,200	2,038.00	37,091,600
大和冷機工業	27,700	1,388.00	38,447,600

セガサミーホールディングス	144,900	2,700.00	391,230,000
日本ピストンリング	4,800	1,412.00	6,777,600
リケン	7,100	2,801.00	19,887,100
T P R	20,700	1,486.00	30,760,200
ツバキ・ナカシマ	44,500	889.00	39,560,500
ホシザキ	116,100	5,200.00	603,720,000
大豊工業	15,700	796.00	12,497,200
日本精工	331,300	865.00	286,574,500
N T N	355,400	290.00	103,066,000
ジェイテクト	160,500	1,207.00	193,723,500
不二越	13,300	3,965.00	52,734,500
日本トムソン	44,300	595.00	26,358,500
T H K	104,000	3,095.00	321,880,000
ユーシン精機	14,400	700.00	10,080,000
前澤給装工業	12,700	1,128.00	14,325,600
イーグル工業	20,000	1,499.00	29,980,000
前澤工業	8,100	732.00	5,929,200
日本ピラー工業	16,700	4,070.00	67,969,000
キッツ	66,500	1,040.00	69,160,000
マキタ	224,300	3,835.00	860,190,500
三井E & S	83,900	487.00	40,859,300
日立造船	147,900	840.00	124,236,000
三菱重工業	315,300	6,134.00	1,934,050,200
I H I	113,600	3,380.00	383,968,000
スター精密	34,100	1,869.00	63,732,900
日清紡ホールディングス	146,800	1,068.00	156,782,400
イビデン	103,500	7,580.00	784,530,000
コニカミノルタ	403,500	479.00	193,276,500
ブラザー工業	241,100	2,083.00	502,211,300
ミネベアミツミ	313,700	2,694.00	845,107,800
日立製作所	876,700	8,129.00	7,126,694,300
東芝	346,900	4,488.00	1,556,887,200
三菱電機	1,863,300	1,832.00	3,413,565,600
富士電機	109,600	6,110.00	669,656,000
東洋電機製造	4,500	1,008.00	4,536,000
安川電機	213,600	5,930.00	1,266,648,000
シンフォニアテクノロジー	19,900	1,668.00	33,193,200
明電舎	27,400	1,907.00	52,251,800
オリジン	3,100	1,257.00	3,896,700
山洋電気	7,800	7,490.00	58,422,000
デンヨー	13,700	1,917.00	26,262,900
P H C ホールディングス	25,400	1,627.00	41,325,800

ソシオネクスト	24,700	15,550.00	384,085,000
東芝テック	26,900	4,160.00	111,904,000
芝浦メカトロニクス	3,500	18,100.00	63,350,000
マブチモーター	44,900	3,820.00	171,518,000
ニデック	438,700	7,095.00	3,112,576,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	14,000	493.00	6,902,000
トレックス・セミコンダクター	8,700	2,207.00	19,200,900
東光高岳	11,100	2,029.00	22,521,900
ダブル・スコープ	58,900	1,034.00	60,902,600
ダイヘン	16,300	5,070.00	82,641,000
ヤーマン	31,500	1,144.00	36,036,000
JVCケンウッド	165,000	500.00	82,500,000
ミマキエンジニアリング	17,600	735.00	12,936,000
I - P E X	10,300	1,348.00	13,884,400
大崎電気工業	42,800	547.00	23,411,600
オムロン	165,200	8,521.00	1,407,669,200
日東工業	24,300	3,235.00	78,610,500
I D E C	26,600	3,190.00	84,854,000
正興電機製作所	5,700	991.00	5,648,700
不二電機工業	3,200	1,117.00	3,574,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	59,300	2,470.00	146,471,000
サクサホールディングス	2,900	1,888.00	5,475,200
メルコホールディングス	4,600	3,165.00	14,559,000
テクノメディカ	4,600	1,821.00	8,376,600
日本電気	255,000	6,440.00	1,642,200,000
富士通	179,600	18,010.00	3,234,596,000
沖電気工業	81,500	816.00	66,504,000
岩崎通信機	6,100	828.00	5,050,800
電気興業	7,300	2,232.00	16,293,600
サンケン電気	16,800	11,910.00	200,088,000
ナカヨ	2,200	1,062.00	2,336,400
アイホン	10,900	2,221.00	24,208,900
ルネサスエレクトロニクス	1,176,500	2,240.50	2,635,948,250
セイコーエプソン	231,300	2,156.00	498,682,800
ワコム	137,600	722.00	99,347,200
アルバック	42,800	5,920.00	253,376,000
アクセル	5,500	1,365.00	7,507,500
E I Z O	13,200	4,825.00	63,690,000
日本信号	41,100	1,047.00	43,031,700
京三製作所	37,800	441.00	16,669,800
能美防災	24,600	1,825.00	44,895,000
ホーチキ	13,700	1,627.00	22,289,900

星和電機	6,400	481.00	3,078,400
エレコム	43,400	1,415.00	61,411,000
パナソニック ホールディングス	2,129,500	1,452.50	3,093,098,750
シャープ	217,100	821.00	178,239,100
アンリツ	127,000	1,202.00	152,654,000
富士通ゼネラル	51,100	3,200.00	163,520,000
ソニーグループ	1,262,700	13,275.00	16,762,342,500
T D K	285,500	5,360.00	1,530,280,000
帝国通信工業	8,400	1,538.00	12,919,200
タムラ製作所	77,400	712.00	55,108,800
アルプスアルパイン	161,300	1,250.00	201,625,000
池上通信機	4,400	608.00	2,675,200
日本電波工業	21,900	1,343.00	29,411,700
鈴木	10,100	912.00	9,211,200
メイコー	19,800	2,524.00	49,975,200
日本トリム	4,200	2,861.00	12,016,200
ローランド ディー・ジー・	10,000	3,335.00	33,350,000
フォスター電機	16,700	991.00	16,549,700
S M K	4,300	2,358.00	10,139,400
ヨコオ	14,600	1,770.00	25,842,000
ホシデン	42,300	1,736.00	73,432,800
ヒロセ電機	29,800	19,320.00	575,736,000
日本航空電子工業	37,000	2,593.00	95,941,000
T O A	20,500	850.00	17,425,000
マクセル	36,800	1,473.00	54,206,400
古野電気	23,800	981.00	23,347,800
スミダコーポレーション	16,800	1,280.00	21,504,000
アイコム	6,900	2,895.00	19,975,500
リオン	7,600	1,830.00	13,908,000
横河電機	197,200	2,643.00	521,199,600
新電元工業	6,900	3,425.00	23,632,500
アズビル	124,700	4,425.00	551,797,500
東亜ディーケーケー	7,000	813.00	5,691,000
日本光電工業	82,600	3,735.00	308,511,000
チノー	7,400	2,187.00	16,183,800
共和電業	13,000	352.00	4,576,000
日本電子材料	11,800	1,611.00	19,009,800
堀場製作所	39,700	7,730.00	306,881,000
アドバンテスト	140,600	17,670.00	2,484,402,000
小野測器	6,000	439.00	2,634,000
エスベック	14,500	2,043.00	29,623,500
キーエンス	178,600	68,650.00	12,260,890,000

日置電機	9,400	9,260.00	87,044,000
シスメックス	154,000	9,197.00	1,416,338,000
日本マイクロニクス	29,600	1,743.00	51,592,800
メガチップス	14,800	3,415.00	50,542,000
O B A R A G R O U P	9,800	4,135.00	40,523,000
澤藤電機	2,000	1,122.00	2,244,000
原田工業	6,600	799.00	5,273,400
コーセル	21,800	1,143.00	24,917,400
イリソ電子工業	16,500	4,295.00	70,867,500
オブテックスグループ	32,900	1,965.00	64,648,500
千代田インテグレ	6,400	2,353.00	15,059,200
レーザーテック	81,800	22,415.00	1,833,547,000
スタンレー電気	127,200	2,856.00	363,283,200
ウシオ電機	90,900	1,931.00	175,527,900
岡谷電機産業	12,100	274.00	3,315,400
ヘリオス テクノ ホールディング	13,300	575.00	7,647,500
エノモト	3,800	1,720.00	6,536,000
日本セラミック	18,300	2,587.00	47,342,100
遠藤照明	6,500	1,288.00	8,372,000
古河電池	13,500	1,084.00	14,634,000
双信電機	6,600	365.00	2,409,000
山一電機	15,800	2,081.00	32,879,800
図研	15,600	3,640.00	56,784,000
日本電子	44,800	4,470.00	200,256,000
カシオ計算機	133,000	1,176.00	156,408,000
ファナック	876,000	4,760.00	4,169,760,000
日本シイエムケイ	38,700	470.00	18,189,000
エンプラス	5,300	5,540.00	29,362,000
大真空	22,300	680.00	15,164,000
ローム	82,500	12,170.00	1,004,025,000
浜松ホトニクス	143,300	7,170.00	1,027,461,000
三井ハイテック	18,500	9,330.00	172,605,000
新光電気工業	63,200	5,150.00	325,480,000
京セラ	277,300	7,668.00	2,126,336,400
太陽誘電	87,000	4,430.00	385,410,000
村田製作所	541,400	8,257.00	4,470,339,800
双葉電子工業	34,800	500.00	17,400,000
北陸電気工業	5,500	1,194.00	6,567,000
ニチコン	36,700	1,355.00	49,728,500
日本ケミコン	17,900	1,328.00	23,771,200
K O A	27,200	1,694.00	46,076,800
市光工業	26,500	510.00	13,515,000

小糸製作所	214,800	2,658.00	570,938,400
ミツバ	33,500	698.00	23,383,000
S C R E E Nホールディングス	30,500	14,300.00	436,150,000
キャノン電子	19,900	1,913.00	38,068,700
キャノン	979,300	3,508.00	3,435,384,400
リコー	447,500	1,186.00	530,735,000
象印マホービン	53,500	1,704.00	91,164,000
M U T O Hホールディングス	2,100	1,756.00	3,687,600
東京エレクトロン	377,800	19,720.00	7,450,216,000
イノテック	12,100	1,608.00	19,456,800
トヨタ紡織	75,200	2,293.00	172,433,600
芦森工業	2,600	1,713.00	4,453,800
ユニプレス	32,100	1,012.00	32,485,200
豊田自動織機	130,500	8,460.00	1,104,030,000
モリタホールディングス	31,400	1,501.00	47,131,400
三櫻工業	27,400	739.00	20,248,600
デンソー	368,200	8,778.00	3,232,059,600
東海理化電機製作所	50,400	1,888.00	95,155,200
川崎重工業	134,500	3,135.00	421,657,500
名村造船所	35,600	516.00	18,369,600
日本車輛製造	6,900	2,009.00	13,862,100
三菱ロジスネクスト	28,500	1,169.00	33,316,500
近畿車輛	1,900	1,424.00	2,705,600
日産自動車	2,535,600	524.90	1,330,936,440
いすゞ自動車	518,900	1,632.00	846,844,800
トヨタ自動車	9,801,400	1,928.50	18,901,999,900
日野自動車	230,100	553.00	127,245,300
三菱自動車工業	696,300	461.00	320,994,300
エフテック	9,700	804.00	7,798,800
レシップホールディングス	5,500	492.00	2,706,000
G M B	2,800	1,747.00	4,891,600
ファルテック	2,300	625.00	1,437,500
武蔵精密工業	43,700	1,747.00	76,343,900
日産車体	31,500	890.00	28,035,000
新明和工業	56,100	1,259.00	70,629,900
極東開発工業	29,500	1,670.00	49,265,000
トピー工業	14,500	1,988.00	28,826,000
ティラド	4,500	1,800.00	8,100,000
曙ブレーキ工業	108,900	135.00	14,701,500
タチエス	28,300	1,466.00	41,487,800
N O K	69,400	1,873.00	129,986,200
フタバ産業	48,000	471.00	22,608,000

K Y B	17,200	4,625.00	79,550,000
大同メタル工業	35,100	484.00	16,988,400
プレス工業	79,900	577.00	46,102,300
ミクニ	16,100	399.00	6,423,900
太平洋工業	41,000	1,208.00	49,528,000
アイシン	137,700	4,010.00	552,177,000
マツダ	590,400	1,216.00	717,926,400
今仙電機製作所	8,900	622.00	5,535,800
本田技研工業	1,451,000	4,025.00	5,840,275,000
スズキ	327,800	4,575.00	1,499,685,000
S U B A R U	564,800	2,402.00	1,356,649,600
安永	6,100	902.00	5,502,200
ヤマハ発動機	280,500	3,535.00	991,567,500
T B K	14,000	330.00	4,620,000
エクセディ	29,200	2,158.00	63,013,600
豊田合成	52,100	2,326.00	121,184,600
愛三工業	29,600	1,019.00	30,162,400
盟和産業	2,100	964.00	2,024,400
日本プラスト	11,100	449.00	4,983,900
ヨロズ	16,800	814.00	13,675,200
エフ・シー・シー	31,700	1,718.00	54,460,600
シマノ	73,000	21,750.00	1,587,750,000
テイ・エス テック	81,700	1,816.00	148,367,200
ジャムコ	7,600	1,427.00	10,845,200
テルモ	549,000	4,223.00	2,318,427,000
クリエートメディック	4,500	906.00	4,077,000
日機装	41,600	891.00	37,065,600
日本エム・ディ・エム	10,600	968.00	10,260,800
島津製作所	217,400	4,390.00	954,386,000
J M S	16,500	530.00	8,745,000
長野計器	13,000	1,764.00	22,932,000
ブイ・テクノロジー	8,700	2,693.00	23,429,100
東京計器	13,700	1,255.00	17,193,500
愛知時計電機	7,000	1,564.00	10,948,000
インターアクション	8,500	1,477.00	12,554,500
オーバル	12,300	381.00	4,686,300
東京精密	39,200	6,120.00	239,904,000
マニー	71,400	1,666.00	118,952,400
ニコン	258,100	1,581.00	408,056,100
トプコン	94,000	1,926.00	181,044,000
オリンパス	1,098,800	2,157.00	2,370,111,600
理研計器	11,100	4,890.00	54,279,000

タムロン	13,400	3,535.00	47,369,000
HOYA	381,200	17,165.00	6,543,298,000
シード	7,100	572.00	4,061,200
ノーリツ銅機	16,900	2,226.00	37,619,400
A & Dホロンホールディングス	26,000	1,499.00	38,974,000
朝日インテック	199,500	2,675.00	533,662,500
シチズン時計	196,300	827.00	162,340,100
リズム	4,300	1,698.00	7,301,400
大研医器	10,500	521.00	5,470,500
メニコン	61,300	2,495.00	152,943,500
シンシア	1,300	550.00	715,000
松風	8,100	2,193.00	17,763,300
セイコーグループ	27,600	2,597.00	71,677,200
ニプロ	148,800	1,010.00	150,288,000
KYORITSU	20,600	144.00	2,966,400
中本パックス	4,200	1,621.00	6,808,200
スノーピーク	30,600	1,858.00	56,854,800
パラマウントベッドホールディングス	41,200	2,377.00	97,932,400
トランザクション	11,800	1,663.00	19,623,400
粧美堂	3,800	375.00	1,425,000
ニホンフラッシュ	16,700	1,039.00	17,351,300
前田工織	15,100	2,985.00	45,073,500
永大産業	14,800	215.00	3,182,000
アートネイチャー	18,400	756.00	13,910,400
バンダイナムコホールディングス	489,000	3,307.00	1,617,123,000
アイフィスジャパン	3,800	613.00	2,329,400
SHOEI	40,300	2,641.00	106,432,300
フランスベッドホールディングス	22,100	1,098.00	24,265,800
パイロットコーポレーション	27,900	4,650.00	129,735,000
萩原工業	11,900	1,258.00	14,970,200
フジシールインターナショナル	36,100	1,504.00	54,294,400
タカラトミー	82,400	1,673.00	137,855,200
広済堂ホールディングス	9,300	2,372.00	22,059,600
エステールホールディングス	3,200	609.00	1,948,800
タカノ	5,100	726.00	3,702,600
プロネクサス	14,800	977.00	14,459,600
ホクシン	10,600	134.00	1,420,400
ウッドワン	4,600	1,214.00	5,584,400
大建工業	10,800	2,232.00	24,105,600
凸版印刷	233,400	3,055.00	713,037,000
大日本印刷	195,100	4,040.00	788,204,000
共同印刷	5,000	2,809.00	14,045,000

N I S S H A	33,900	1,626.00	55,121,400
光村印刷	1,200	1,170.00	1,404,000
T A K A R A & C O M P A N Y	11,400	2,344.00	26,721,600
アシックス	164,800	3,725.00	613,880,000
ツツミ	3,100	2,122.00	6,578,200
ローランド	13,100	4,025.00	52,727,500
小松ウオール工業	6,600	2,418.00	15,958,800
ヤマハ	112,500	5,670.00	637,875,000
河合楽器製作所	4,800	3,160.00	15,168,000
クリナップ	20,000	670.00	13,400,000
ピジョン	113,700	2,042.00	232,175,400
キングジム	15,700	916.00	14,381,200
リンテック	35,800	2,275.00	81,445,000
イトーキ	36,600	854.00	31,256,400
任天堂	1,127,000	5,909.00	6,659,443,000
三菱鉛筆	25,300	1,723.00	43,591,900
タカラスタンド	32,900	1,727.00	56,818,300
コクヨ	85,900	1,962.00	168,535,800
ナカバヤシ	19,200	483.00	9,273,600
グローブライド	14,400	2,167.00	31,204,800
オカムラ	53,700	1,767.00	94,887,900
美津濃	17,700	3,660.00	64,782,000
東京電力ホールディングス	1,609,000	480.00	772,320,000
中部電力	657,800	1,665.00	1,095,237,000
関西電力	689,300	1,595.00	1,099,433,500
中国電力	284,300	829.00	235,684,700
北陸電力	168,500	744.00	125,364,000
東北電力	436,400	822.00	358,720,800
四国電力	152,400	951.00	144,932,400
九州電力	411,500	866.00	356,359,000
北海道電力	172,500	571.00	98,497,500
沖縄電力	41,800	1,167.00	48,780,600
電源開発	134,400	2,087.00	280,492,800
エフオン	11,600	558.00	6,472,800
イーレックス	31,700	1,183.00	37,501,100
レノバ	47,500	1,632.00	77,520,000
東京瓦斯	377,400	2,999.00	1,131,822,600
大阪瓦斯	361,600	2,248.00	812,876,800
東邦瓦斯	70,300	2,464.00	173,219,200
北海道瓦斯	10,700	2,071.00	22,159,700
広島ガス	37,700	367.00	13,835,900
西部ガスホールディングス	16,800	2,016.00	33,868,800

静岡ガス	40,700	1,206.00	49,084,200	
メタウォーター	22,300	1,761.00	39,270,300	
SBSホールディングス	15,900	3,120.00	49,608,000	
東武鉄道	196,100	3,655.00	716,745,500	
相鉄ホールディングス	59,000	2,620.00	154,580,000	
東急	500,500	1,882.00	941,941,000	
京浜急行電鉄	202,500	1,329.00	269,122,500	
小田急電鉄	270,600	2,106.00	569,883,600	
京王電鉄	94,400	5,070.00	478,608,000	
京成電鉄	115,100	5,390.00	620,389,000	
富士急行	22,000	5,260.00	115,720,000	
東日本旅客鉄道	302,700	7,866.00	2,381,038,200	
西日本旅客鉄道	228,000	5,960.00	1,358,880,000	
東海旅客鉄道	137,500	17,000.00	2,337,500,000	
西武ホールディングス	215,900	1,490.00	321,691,000	
鴻池運輸	30,400	1,566.00	47,606,400	
西日本鉄道	47,700	2,417.00	115,290,900	
ハマキョウレックス	14,000	3,570.00	49,980,000	
サカイ引越センター	8,500	4,690.00	39,865,000	
近鉄グループホールディングス	178,200	4,710.00	839,322,000	
阪急阪神ホールディングス	237,600	4,480.00	1,064,448,000	
南海電気鉄道	85,200	3,205.00	273,066,000	
京阪ホールディングス	98,200	3,560.00	349,592,000	
神戸電鉄	4,800	3,085.00	14,808,000	
名古屋鉄道	196,900	2,344.00	461,533,600	
山陽電気鉄道	13,400	2,245.00	30,083,000	
アルプス物流	14,200	1,298.00	18,431,600	
ヤマトホールディングス	228,200	2,537.00	578,943,400	
山九	45,300	4,845.00	219,478,500	
丸運	6,800	231.00	1,570,800	
丸全昭和運輸	11,000	3,760.00	41,360,000	
センコーグループホールディングス	94,400	937.00	88,452,800	
トナミホールディングス	3,900	4,365.00	17,023,500	
ニッコンホールディングス	57,000	2,696.00	153,672,000	
日本石油輸送	1,400	2,734.00	3,827,600	
福山通運	13,600	3,360.00	45,696,000	
セイノーホールディングス	110,900	1,604.00	177,883,600	
エスライン	3,900	788.00	3,073,200	
神奈川中央交通	5,000	3,190.00	15,950,000	
AZ-COM丸和ホールディングス	43,000	2,061.00	88,623,000	
C&Fロジホールディングス	17,100	1,253.00	21,426,300	
九州旅客鉄道	126,000	3,025.00	381,150,000	

SGホールディングス	342,000	2,096.00	716,832,000
NIPPON EXPRESSホールディングス	66,500	8,220.00	546,630,000
日本郵船	477,100	3,014.00	1,437,979,400
商船三井	314,500	3,220.00	1,012,690,000
川崎汽船	134,200	3,305.00	443,531,000
NSユニテッド海運	9,900	3,385.00	33,511,500
飯野海運	66,700	824.00	54,960,800
共栄タンカー	3,700	839.00	3,104,300
乾汽船	23,400	1,342.00	31,402,800
日本航空	437,700	2,687.00	1,176,099,900
ANAホールディングス	484,900	3,086.00	1,496,401,400
パスコ	2,700	1,645.00	4,441,500
トランコム	5,200	6,670.00	34,684,000
日新	13,500	2,549.00	34,411,500
三菱倉庫	38,300	3,475.00	133,092,500
三井倉庫ホールディングス	16,600	3,430.00	56,938,000
住友倉庫	48,100	2,253.00	108,369,300
澁澤倉庫	7,100	2,351.00	16,692,100
東陽倉庫	18,400	269.00	4,949,600
日本トランスシティ	35,900	618.00	22,186,200
ケイヒン	2,400	1,722.00	4,132,800
中央倉庫	8,600	1,041.00	8,952,600
川西倉庫	2,300	1,010.00	2,323,000
安田倉庫	12,200	963.00	11,748,600
ファイズホールディングス	2,500	1,165.00	2,912,500
東洋埠頭	4,000	1,323.00	5,292,000
上組	85,500	3,130.00	267,615,000
サンリツ	3,100	710.00	2,201,000
キムラユニティー	6,600	1,123.00	7,411,800
キューソー流通システム	8,300	975.00	8,092,500
東海運	8,100	281.00	2,276,100
エーアイティー	11,200	1,680.00	18,816,000
内外トランスライン	6,400	2,463.00	15,763,200
日本コンセプト	5,600	1,669.00	9,346,400
NEC ネットズエスアイ	59,900	1,901.00	113,869,900
クロスキャット	10,400	1,081.00	11,242,400
システナ	301,800	309.00	93,256,200
デジタルアーツ	11,400	5,660.00	64,524,000
日鉄ソリューションズ	30,600	4,030.00	123,318,000
キューブシステム	10,900	1,144.00	12,469,600
コア	8,100	1,704.00	13,802,400
手間いらず	3,100	4,155.00	12,880,500

ラクーンホールディングス	15,200	724.00	11,004,800	
ソリトンシステムズ	9,400	1,179.00	11,082,600	
ソフトクリエイトホールディングス	14,900	1,614.00	24,048,600	
T I S	195,900	3,950.00	773,805,000	
J N Sホールディングス	7,000	387.00	2,709,000	
グリー	48,400	678.00	32,815,200	
G M Oペパボ	2,700	1,682.00	4,541,400	
コーエーテクモホールディングス	112,300	2,362.00	265,252,600	
三菱総合研究所	8,800	5,220.00	45,936,000	
電算	1,800	1,607.00	2,892,600	
A G S	6,200	692.00	4,290,400	
ファインデックス	14,600	580.00	8,468,000	
ブレインパッド	13,700	733.00	10,042,100	
K L a b	35,700	343.00	12,245,100	
ポールトゥウィンホールディングス	30,800	941.00	28,982,800	
ネクソン	463,700	2,938.00	1,362,350,600	
アイスタイル	52,500	508.00	26,670,000	
エムアップホールディングス	22,100	1,198.00	26,475,800	
エイチーム	10,900	723.00	7,880,700	
エニグモ	23,400	386.00	9,032,400	
テクノスジャパン	11,900	568.00	6,759,200	
コロプラ	69,800	674.00	47,045,200	
ブロードリーフ	105,100	400.00	42,040,000	
クロス・マーケティンググループ	8,800	701.00	6,168,800	
デジタルハーツホールディングス	11,400	1,311.00	14,945,400	
システム情報	14,600	724.00	10,570,400	
メディアドゥ	7,400	1,352.00	10,004,800	
じげん	52,600	657.00	34,558,200	
ブイキューブ	22,000	506.00	11,132,000	
エンカレッジ・テクノロジー	3,700	478.00	1,768,600	
サイバーリンクス	4,800	684.00	3,283,200	
フィックスターズ	20,400	1,390.00	28,356,000	
C A R T A H O L D I N G S	8,600	1,325.00	11,395,000	
オブティム	15,000	1,039.00	15,585,000	
セレス	7,400	1,077.00	7,969,800	
S H I F T	11,900	24,230.00	288,337,000	
ティーガイア	18,900	1,693.00	31,997,700	
セック	2,000	3,100.00	6,200,000	
テクマトリックス	32,800	1,821.00	59,728,800	
プロシップ	8,000	1,402.00	11,216,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	52,500	2,759.00	144,847,500	
G M Oペイメントゲートウェイ	35,800	10,600.00	379,480,000	

ザッパラス	4,500	343.00	1,543,500
システムリサーチ	5,700	2,285.00	13,024,500
インターネットイニシアティブ	100,000	2,730.00	273,000,000
さくらインターネット	20,500	642.00	13,161,000
ヴィンクス	4,300	1,417.00	6,093,100
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,500	3,340.00	18,370,000
SRAホールディングス	9,200	3,075.00	28,290,000
システムインテグレータ	4,700	422.00	1,983,400
朝日ネット	19,600	606.00	11,877,600
eBASE	25,500	768.00	19,584,000
アバントグループ	22,800	1,402.00	31,965,600
アドソル日進	7,700	1,684.00	12,966,800
ODKソリューションズ	3,500	585.00	2,047,500
フリービット	9,500	1,552.00	14,744,000
コムチュア	23,800	2,115.00	50,337,000
サイバーコム	2,400	1,551.00	3,722,400
アステリア	14,400	660.00	9,504,000
アイル	8,400	2,653.00	22,285,200
マークライnz	9,800	2,467.00	24,176,600
メディカル・データ・ビジョン	27,100	706.00	19,132,600
gumi	26,600	708.00	18,832,800
ショーケース	4,000	296.00	1,184,000
モバイルファクトリー	3,200	842.00	2,694,400
テラスカイ	7,800	2,419.00	18,868,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	10,500	1,505.00	15,802,500
PCIホールディングス	5,600	1,023.00	5,728,800
アイビーシー	2,500	621.00	1,552,500
ネオジャパン	6,200	914.00	5,666,800
PR TIMES	4,700	1,387.00	6,518,900
ラクス	84,800	2,223.00	188,510,400
ランドコンピュータ	3,600	1,184.00	4,262,400
ダブルスタンダード	7,400	2,340.00	17,316,000
オープンドア	12,700	1,263.00	16,040,100
アカツキ	8,600	2,180.00	18,748,000
ベネフィットジャパン	1,000	1,183.00	1,183,000
Ubicomホールディングス	5,700	1,866.00	10,636,200
カナミックネットワーク	19,800	444.00	8,791,200
ノムラシステムコーポレーション	15,100	116.00	1,751,600
チェンジホールディングス	44,000	2,008.00	88,352,000
シンクロ・フード	9,200	626.00	5,759,200
オークネット	9,000	1,747.00	15,723,000
キャピタル・アセット・プランニング	3,000	668.00	2,004,000

セグエグループ	4,100	1,057.00	4,333,700
エイトレッド	2,300	1,419.00	3,263,700
マクロミル	35,400	886.00	31,364,400
ビーグリー	2,500	1,127.00	2,817,500
オロ	5,500	2,150.00	11,825,000
ユーザーローカル	6,600	2,150.00	14,190,000
テモナ	4,100	255.00	1,045,500
ニーズウェル	4,000	1,340.00	5,360,000
マネーフォワード	43,200	5,600.00	241,920,000
サインポスト	5,400	497.00	2,683,800
Sun Asterisk	12,900	1,190.00	15,351,000
電算システムホールディングス	8,700	3,245.00	28,231,500
Appier Group	68,000	1,377.00	93,636,000
ソルクシーズ	11,900	412.00	4,902,800
フェイス	4,400	503.00	2,213,200
プロトコーポレーション	22,600	1,111.00	25,108,600
ハイマックス	5,800	1,389.00	8,056,200
野村総合研究所	356,700	3,450.00	1,230,615,000
サイバネットシステム	15,300	852.00	13,035,600
CEホールディングス	7,600	545.00	4,142,000
日本システム技術	5,900	2,031.00	11,982,900
インテージホールディングス	20,400	1,618.00	33,007,200
東邦システムサイエンス	4,100	1,121.00	4,596,100
ソースネクスト	92,300	194.00	17,906,200
インフォコム	23,200	2,224.00	51,596,800
シンプレクス・ホールディングス	30,700	2,400.00	73,680,000
HEROZ	6,200	1,433.00	8,884,600
ラクスル	43,100	1,285.00	55,383,500
メルカリ	107,900	2,797.00	301,796,300
I P S	5,900	2,260.00	13,334,000
F I G	17,000	277.00	4,709,000
システムサポート	7,100	1,834.00	13,021,400
イーソル	11,700	922.00	10,787,400
アルテリア・ネットワークス	16,800	1,964.00	32,995,200
東海ソフト	2,300	1,018.00	2,341,400
ウイングアーク1st	18,600	2,270.00	42,222,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,900	1,489.00	7,296,100
サーバーワークス	3,700	1,989.00	7,359,300
東名	1,200	1,922.00	2,306,400
ヴィッツ	1,600	1,311.00	2,097,600
トビラシステムズ	3,700	971.00	3,592,700
Sansan	58,700	1,629.00	95,622,300

Link-U	3,500	1,032.00	3,612,000
ギフトィ	19,600	2,076.00	40,689,600
メドレー	24,100	4,665.00	112,426,500
ベース	6,100	5,520.00	33,672,000
JMDC	29,400	5,420.00	159,348,000
フォーカスシステムズ	13,300	1,029.00	13,685,700
クレスコ	13,900	1,925.00	26,757,500
フジ・メディア・ホールディングス	172,100	1,355.00	233,195,500
オービック	59,800	22,290.00	1,332,942,000
ジャストシステム	25,800	4,310.00	111,198,000
TDCソフト	15,300	1,471.00	22,506,300
Zホールディングス	2,548,400	349.80	891,430,320
トレンドマイクロ	103,400	6,550.00	677,270,000
IDホールディングス	12,300	1,118.00	13,751,400
日本オラクル	34,300	10,690.00	366,667,000
アルファシステムズ	5,700	3,500.00	19,950,000
フューチャー	44,700	1,739.00	77,733,300
CAC Holdings	11,100	1,698.00	18,847,800
SBテクノロジー	7,700	2,423.00	18,657,100
トーセ	4,300	726.00	3,121,800
オービックビジネスコンサルタント	35,300	5,190.00	183,207,000
伊藤忠テクノソリューションズ	96,200	3,585.00	344,877,000
アイティフォー	23,800	986.00	23,466,800
東計電算	2,500	6,060.00	15,150,000
エクスネット	2,200	1,000.00	2,200,000
大塚商会	101,500	5,180.00	525,770,000
サイボウズ	24,800	2,444.00	60,611,200
電通国際情報サービス	21,800	4,985.00	108,673,000
ACCESS	21,500	872.00	18,748,000
デジタルガレージ	31,800	4,055.00	128,949,000
EMシステムズ	30,200	812.00	24,522,400
ウェザーニューズ	5,600	6,820.00	38,192,000
CIJ	30,200	517.00	15,613,400
ビジネスエンジニアリング	3,000	3,340.00	10,020,000
日本エンタープライズ	16,200	136.00	2,203,200
WOWOW	13,700	1,101.00	15,083,700
スカラ	16,900	763.00	12,894,700
インテリジェント ウェイブ	7,700	754.00	5,805,800
IMAGICA GROUP	15,400	568.00	8,747,200
ネットワンシステムズ	66,800	3,185.00	212,758,000
システムソフト	65,700	75.00	4,927,500
アルゴグラフィックス	16,500	4,005.00	66,082,500

マーベラス	29,400	684.00	20,109,600
エイベックス	30,600	1,451.00	44,400,600
B I P R O G Y	66,000	3,330.00	219,780,000
都築電気	9,600	1,807.00	17,347,200
T B S ホールディングス	91,700	2,234.00	204,857,800
日本テレビホールディングス	158,700	1,273.00	202,025,100
朝日放送グループホールディングス	17,100	647.00	11,063,700
テレビ朝日ホールディングス	43,600	1,530.00	66,708,000
スカパーJ S A Tホールディングス	159,300	532.00	84,747,600
テレビ東京ホールディングス	13,000	2,833.00	36,829,000
日本BS放送	5,300	902.00	4,780,600
ビジョン	23,700	1,678.00	39,768,600
スマートバリュー	4,000	392.00	1,568,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	20,100	3,230.00	64,923,000
ワイヤレスゲート	7,200	224.00	1,612,800
クロップス	2,500	1,005.00	2,512,500
日本電信電話	2,294,000	4,069.00	9,334,286,000
K D D I	1,383,400	4,357.00	6,027,473,800
ソフトバンク	2,876,100	1,510.50	4,344,349,050
光通信	21,100	20,130.00	424,743,000
エムティーアイ	12,700	619.00	7,861,300
G M O インターネットグループ	66,200	2,611.00	172,848,200
ファイバーゲート	9,800	1,362.00	13,347,600
アйдママーケティングコミュニケーション	4,000	274.00	1,096,000
K A D O K A W A	94,700	3,145.00	297,831,500
学研ホールディングス	30,100	886.00	26,668,600
ゼンリン	30,900	895.00	27,655,500
昭文社ホールディングス	6,800	295.00	2,006,000
インプレスホールディングス	13,400	203.00	2,720,200
アイネット	11,000	1,474.00	16,214,000
松竹	10,300	11,990.00	123,497,000
東宝	112,100	5,560.00	623,276,000
東映	4,900	17,590.00	86,191,000
エヌ・ティ・ティ・データ	561,800	2,001.00	1,124,161,800
ピー・シー・エー	10,500	1,252.00	13,146,000
ビジネスブレイン太田昭和	7,800	2,124.00	16,567,200
D T S	38,200	3,525.00	134,655,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	90,000	6,390.00	575,100,000
シーイーシー	25,300	1,467.00	37,115,100
カブコン	177,900	5,430.00	965,997,000
アイ・エス・ビー	9,300	1,513.00	14,070,900
ジャステック	11,200	1,279.00	14,324,800

S C S K	146,200	2,240.00	327,488,000
N S W	7,100	2,416.00	17,153,600
アイネス	12,700	1,481.00	18,808,700
T K C	28,600	3,620.00	103,532,000
富士ソフト	20,300	8,990.00	182,497,000
N S D	64,000	2,691.00	172,224,000
コナミグループ	76,700	7,450.00	571,415,000
福井コンピュータホールディングス	12,500	2,779.00	34,737,500
J B C Cホールディングス	13,200	2,278.00	30,069,600
ミロク情報サービス	16,400	1,503.00	24,649,200
ソフトバンクグループ	883,200	5,542.00	4,894,694,400
高千穂交易	5,200	2,620.00	13,624,000
オルパヘルスケアホールディングス	2,200	1,844.00	4,056,800
伊藤忠食品	4,300	5,180.00	22,274,000
エレマテック	17,000	1,759.00	29,903,000
あらた	14,400	4,655.00	67,032,000
トーメンデバイス	2,700	5,950.00	16,065,000
東京エレクトロン デバイス	7,000	10,300.00	72,100,000
円谷フィールズホールディングス	32,400	2,184.00	70,761,600
双日	200,500	2,931.00	587,665,500
アルフレッサ ホールディングス	189,600	2,149.00	407,450,400
横浜冷凍	51,500	1,089.00	56,083,500
ラサ商事	6,700	1,356.00	9,085,200
アルコニックス	24,900	1,341.00	33,390,900
神戸物産	146,100	3,915.00	571,981,500
ハイパー	2,800	446.00	1,248,800
あい ホールディングス	30,200	2,271.00	68,584,200
ディーブイエックス	4,100	965.00	3,956,500
ダイワボウホールディングス	77,200	2,706.00	208,903,200
マクニカホールディングス	44,700	5,150.00	230,205,000
ラクト・ジャパン	7,300	1,985.00	14,490,500
グリムス	7,900	2,587.00	20,437,300
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,600	949.00	26,192,400
八洲電機	15,300	1,278.00	19,553,400
メディアスホールディングス	12,100	791.00	9,571,100
レスターホールディングス	18,100	2,351.00	42,553,100
ジュテックホールディングス	3,400	1,133.00	3,852,200
大光	6,200	610.00	3,782,000
O C H Iホールディングス	3,400	1,222.00	4,154,800
T O K A Iホールディングス	93,300	871.00	81,264,300
黒谷	4,100	592.00	2,427,200
C o m i n i x	2,900	780.00	2,262,000

三洋貿易	21,300	1,329.00	28,307,700
ビューティガレージ	3,000	3,670.00	11,010,000
ウイン・パートナーズ	13,800	995.00	13,731,000
ミタチ産業	3,700	1,377.00	5,094,900
シップヘルスケアホールディングス	67,900	2,401.00	163,027,900
明治電機工業	7,000	1,316.00	9,212,000
デリカフーズホールディングス	5,800	595.00	3,451,000
スターティアホールディングス	2,900	1,175.00	3,407,500
コメダホールディングス	46,300	2,677.00	123,945,100
ピーバンドットコム	2,100	478.00	1,003,800
アセンテック	6,400	628.00	4,019,200
富士興産	3,300	1,386.00	4,573,800
協栄産業	1,400	2,037.00	2,851,800
フルサト・マルカホールディングス	18,800	2,539.00	47,733,200
ヤマエグループホールディングス	10,700	2,527.00	27,038,900
小野建	18,600	1,529.00	28,439,400
南陽	2,800	2,136.00	5,980,800
佐島電機	9,200	1,691.00	15,557,200
エコートレーディング	2,900	766.00	2,221,400
伯東	10,800	5,130.00	55,404,000
コンドーテック	14,500	1,074.00	15,573,000
中山福	7,900	336.00	2,654,400
ナガイレーベン	23,900	2,131.00	50,930,900
三菱食品	17,400	3,755.00	65,337,000
松田産業	14,400	2,120.00	30,528,000
第一興商	73,100	2,449.00	179,021,900
メディバルホールディングス	180,600	2,239.00	404,363,400
S P K	8,400	1,742.00	14,632,800
萩原電気ホールディングス	7,200	3,225.00	23,220,000
アズワン	26,900	5,360.00	144,184,000
スズデン	6,600	2,212.00	14,599,200
尾家産業	3,500	1,128.00	3,948,000
シモジマ	13,000	1,068.00	13,884,000
ドウシシャ	20,000	2,220.00	44,400,000
小津産業	3,300	1,796.00	5,926,800
高速	9,800	1,959.00	19,198,200
たけびし	7,200	1,647.00	11,858,400
リックス	3,000	2,716.00	8,148,000
丸文	16,900	1,196.00	20,212,400
ハピネット	16,100	1,996.00	32,135,600
橋本総業ホールディングス	7,500	1,109.00	8,317,500
日本ライフライン	55,400	1,050.00	58,170,000

タカショー	16,500	678.00	11,187,000
I D O M	57,100	851.00	48,592,100
進和	11,600	2,133.00	24,742,800
エスケイジャパン	3,600	534.00	1,922,400
ダイترون	7,500	2,934.00	22,005,000
シークス	26,900	1,472.00	39,596,800
田中商事	4,200	632.00	2,654,400
オーハシテクニカ	9,200	1,587.00	14,600,400
白銅	6,800	2,312.00	15,721,600
ダイコー通産	1,500	1,301.00	1,951,500
伊藤忠商事	1,163,700	4,945.00	5,754,496,500
丸紅	1,473,800	2,108.50	3,107,507,300
高島	2,300	3,365.00	7,739,500
長瀬産業	86,600	2,364.00	204,722,400
蝶理	10,100	2,677.00	27,037,700
豊田通商	165,400	6,350.00	1,050,290,000
三共生興	27,200	558.00	15,177,600
兼松	73,300	1,878.00	137,657,400
ツカモトコーポレーション	2,100	1,304.00	2,738,400
三井物産	1,340,300	4,635.00	6,212,290,500
日本紙パルプ商事	10,000	4,945.00	49,450,000
カメイ	20,100	1,438.00	28,903,800
東都水産	800	6,630.00	5,304,000
O U Gホールディングス	2,200	2,432.00	5,350,400
スターゼン	14,400	2,323.00	33,451,200
山善	50,900	1,048.00	53,343,200
椿本興業	3,000	3,955.00	11,865,000
住友商事	1,169,600	2,756.50	3,224,002,400
内田洋行	7,700	5,260.00	40,502,000
三菱商事	1,168,100	5,908.00	6,901,134,800
第一実業	6,700	5,750.00	38,525,000
キャノンマーケティングジャパン	43,800	3,475.00	152,205,000
西華産業	7,400	2,001.00	14,807,400
佐藤商事	13,100	1,414.00	18,523,400
菱洋エレクトロ	16,100	2,707.00	43,582,700
東京産業	17,300	849.00	14,687,700
ユアサ商事	17,000	4,405.00	74,885,000
神鋼商事	4,700	5,460.00	25,662,000
トルク	8,000	213.00	1,704,000
阪和興業	33,900	4,320.00	146,448,000
正栄食品工業	12,600	3,985.00	50,211,000
カナデン	12,600	1,218.00	15,346,800

RYODEN	15,300	1,982.00	30,324,600
岩谷産業	43,000	6,740.00	289,820,000
ナイス	4,000	1,405.00	5,620,000
ニチモウ	1,800	3,515.00	6,327,000
極東貿易	11,300	1,573.00	17,774,900
アステナホールディングス	32,700	454.00	14,845,800
三愛オブリ	50,000	1,460.00	73,000,000
稲畑産業	38,100	2,975.00	113,347,500
G S I クレオス	11,000	1,810.00	19,910,000
明和産業	25,200	668.00	16,833,600
クワザワホールディングス	4,800	443.00	2,126,400
ワキタ	34,800	1,379.00	47,989,200
東邦ホールディングス	47,000	2,630.00	123,610,000
サンゲツ	47,400	2,540.00	120,396,000
ミツウロコグループホールディングス	24,100	1,380.00	33,258,000
シナネンホールディングス	6,100	3,770.00	22,997,000
伊藤忠エネクス	46,800	1,200.00	56,160,000
サンリオ	53,500	5,710.00	305,485,000
サンワテクノス	9,700	2,250.00	21,825,000
リョーサン	20,000	4,030.00	80,600,000
新光商事	25,400	1,124.00	28,549,600
トーホー	8,100	2,437.00	19,739,700
三信電気	7,600	2,084.00	15,838,400
東陽テクニカ	19,200	1,367.00	26,246,400
モスフードサービス	27,800	3,140.00	87,292,000
加賀電子	15,300	5,240.00	80,172,000
ソーダニッカ	10,800	779.00	8,413,200
立花エレテック	13,800	2,217.00	30,594,600
フォーバル	7,400	1,077.00	7,969,800
P A L T A C	29,700	4,890.00	145,233,000
三谷産業	33,100	312.00	10,327,200
西本Wismettacホールディングス	4,800	4,295.00	20,616,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	2,120.00	2,544,000
コア商事ホールディングス	10,600	696.00	7,377,600
K P P グループホールディングス	44,100	585.00	25,798,500
ヤマタネ	8,400	1,637.00	13,750,800
丸紅建材リース	1,300	2,163.00	2,811,900
泉州電業	9,500	3,220.00	30,590,000
トラスコ中山	39,700	2,176.00	86,387,200
オートバックスセブン	65,700	1,517.00	99,666,900
モリト	13,600	1,067.00	14,511,200
加藤産業	23,400	3,860.00	90,324,000

北恵	3,300	740.00	2,442,000
イエローハット	33,300	1,859.00	61,904,700
J Kホールディングス	14,500	986.00	14,297,000
日伝	11,200	2,233.00	25,009,600
北沢産業	7,900	351.00	2,772,900
杉本商事	8,400	2,000.00	16,800,000
因幡電機産業	49,000	3,075.00	150,675,000
東テク	6,300	4,165.00	26,239,500
ミスミグループ本社	285,000	3,160.00	900,600,000
アルテック	8,300	249.00	2,066,700
タキヒヨー	3,600	974.00	3,506,400
蔵王産業	2,400	2,288.00	5,491,200
スズケン	55,300	3,535.00	195,485,500
ジェコス	11,300	847.00	9,571,100
グローセル	17,800	401.00	7,137,800
ローソン	46,900	6,240.00	292,656,000
サンエー	14,500	4,635.00	67,207,500
カワチ薬品	15,000	2,160.00	32,400,000
エービーシー・マート	27,600	7,670.00	211,692,000
ハードオフコーポレーション	6,300	1,336.00	8,416,800
アスクル	39,300	1,817.00	71,408,100
ゲオホールディングス	18,800	1,662.00	31,245,600
アダストリア	23,000	2,766.00	63,618,000
くら寿司	22,300	3,105.00	69,241,500
キャンドウ	6,900	2,410.00	16,629,000
I Kホールディングス	6,000	386.00	2,316,000
パルグループホールディングス	18,700	3,390.00	63,393,000
エディオン	75,100	1,401.00	105,215,100
サーラコーポレーション	40,300	768.00	30,950,400
ワッツ	7,900	703.00	5,553,700
ハローズ	8,700	3,245.00	28,231,500
あみやき亭	4,700	3,435.00	16,144,500
大黒天物産	5,900	5,200.00	30,680,000
ハニーズホールディングス	15,200	1,534.00	23,316,800
ファーマライズホールディングス	4,000	637.00	2,548,000
アルペン	15,800	1,949.00	30,794,200
ハブ	5,500	752.00	4,136,000
クオールホールディングス	26,300	1,598.00	42,027,400
ジズホールディングス	11,400	3,060.00	34,884,000
ビックカメラ	101,000	1,057.00	106,757,000
D C Mホールディングス	115,700	1,267.00	146,591,900
Monotaro	268,000	1,862.00	499,016,000

東京一番フーズ	4,400	497.00	2,186,800	
きちりホールディングス	3,500	845.00	2,957,500	
アークランドサービスホールディングス	15,600	2,915.00	45,474,000	
J.フロント リテイリング	235,200	1,390.00	326,928,000	
ドトール・日レスホールディングス	33,700	2,060.00	69,422,000	
マツキヨココカラ&カンパニー	114,600	7,380.00	845,748,000	
ブロンコピリー	10,300	2,834.00	29,190,200	
Z O Z O	125,000	2,839.00	354,875,000	
トレジャー・ファクトリー	9,400	1,624.00	15,265,600	
物語コーポレーション	31,700	3,145.00	99,696,500	
三越伊勢丹ホールディングス	318,300	1,444.00	459,625,200	
H a m e e	7,100	974.00	6,915,400	
マーケットエンタープライズ	1,900	1,219.00	2,316,100	
ウエルシアホールディングス	98,100	3,005.00	294,790,500	
クリエイティブSDホールディングス	31,400	3,460.00	108,644,000	
丸善C H Iホールディングス	18,800	349.00	6,561,200	
ミサワ	3,500	616.00	2,156,000	
ティーライフ	2,400	1,376.00	3,302,400	
チムニー	4,500	1,243.00	5,593,500	
シュッピン	14,600	975.00	14,235,000	
オイシックス・ラ・大地	25,600	2,278.00	58,316,800	
ネクステージ	43,300	2,430.00	105,219,000	
ジョイフル本田	56,400	1,733.00	97,741,200	
鳥貴族ホールディングス	7,200	2,237.00	16,106,400	
ホットランド	14,800	1,747.00	25,855,600	
すかいらーくホールディングス	258,400	1,871.00	483,466,400	
S F Pホールディングス	10,300	1,900.00	19,570,000	
綿半ホールディングス	15,000	1,348.00	20,220,000	
ヨシックスホールディングス	3,100	2,226.00	6,900,600	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	62,000	1,108.00	68,696,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,200	810.00	7,452,000	
B E E N O S	8,300	1,882.00	15,620,600	
あさひ	16,200	1,266.00	20,509,200	
日本調剤	13,300	1,114.00	14,816,200	
コスモス薬品	18,700	13,490.00	252,263,000	
トーエル	7,200	750.00	5,400,000	
セブン&アイ・ホールディングス	650,900	6,150.00	4,003,035,000	
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	142,100	1,013.00	143,947,300	
ツルハホールディングス	39,700	9,730.00	386,281,000	
サンマルクホールディングス	15,500	1,894.00	29,357,000	
フェリシモ	3,800	1,002.00	3,807,600	

トリドールホールディングス	47,100	3,025.00	142,477,500
TOKYO BASE	20,500	462.00	9,471,000
ウイルプラスホールディングス	2,800	1,128.00	3,158,400
JMホールディングス	14,500	1,989.00	28,840,500
サツドラホールディングス	7,300	777.00	5,672,100
アレンザホールディングス	14,600	992.00	14,483,200
串カツ田中ホールディングス	5,400	1,662.00	8,974,800
パロックジャパンリミテッド	12,900	836.00	10,784,400
クスリのアオキホールディングス	16,900	7,080.00	119,652,000
力の源ホールディングス	8,400	1,582.00	13,288,800
FOOD & LIFE COMPANIES	100,900	3,255.00	328,429,500
メディカルシステムネットワーク	17,700	376.00	6,655,200
はるやまホールディングス	7,200	489.00	3,520,800
ノジマ	62,000	1,413.00	87,606,000
カッパ・クリエイト	29,700	1,501.00	44,579,700
ライトオン	11,100	566.00	6,282,600
良品計画	206,500	1,426.00	294,469,000
パリミキホールディングス	19,900	321.00	6,387,900
アドヴァングループ	18,500	955.00	17,667,500
アルビス	6,400	2,380.00	15,232,000
コナカ	16,000	360.00	5,760,000
ハウス オブ ローゼ	2,100	1,602.00	3,364,200
G-7ホールディングス	23,900	1,326.00	31,691,400
イオン北海道	28,100	822.00	23,098,200
コジマ	32,100	555.00	17,815,500
ヒマラヤ	5,200	938.00	4,877,600
コーナン商事	25,600	3,565.00	91,264,000
エコス	7,300	1,874.00	13,680,200
ワタミ	22,800	902.00	20,565,600
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	381,300	2,463.00	939,141,900
西松屋チェーン	42,100	1,686.00	70,980,600
ゼンショーホールディングス	103,500	5,590.00	578,565,000
幸楽苑ホールディングス	12,300	1,047.00	12,878,100
ハークスレイ	5,900	619.00	3,652,100
サイゼリヤ	28,100	3,480.00	97,788,000
VTホールディングス	72,700	515.00	37,440,500
魚力	6,100	2,143.00	13,072,300
フジ・コーポレーション	11,000	1,339.00	14,729,000
ユナイテッドアローズ	20,400	2,423.00	49,429,200
ハイデイ日高	28,200	2,310.00	65,142,000

YU-WA Creation Holdings	11,400	196.00	2,234,400
コロワイド	87,000	2,031.00	176,697,000
ピーシーデポコーポレーション	22,200	479.00	10,633,800
壱番屋	15,000	5,290.00	79,350,000
PLANT	4,100	707.00	2,898,700
スギホールディングス	38,100	5,910.00	225,171,000
薬王堂ホールディングス	10,700	2,581.00	27,616,700
スクロール	28,600	883.00	25,253,800
ヨンドシーホールディングス	16,500	1,793.00	29,584,500
木曽路	28,800	2,321.00	66,844,800
SRSホールディングス	31,700	951.00	30,146,700
千趣会	36,000	417.00	15,012,000
リテールパートナーズ	28,400	1,574.00	44,701,600
ケーヨー	30,600	800.00	24,480,000
上新電機	17,100	1,916.00	32,763,600
日本瓦斯	101,400	1,942.00	196,918,800
ロイヤルホールディングス	36,600	2,757.00	100,906,200
いなげや	18,500	1,464.00	27,084,000
チヨダ	18,700	845.00	15,801,500
ライフコーポレーション	16,600	2,933.00	48,687,800
リンガーハット	24,400	2,402.00	58,608,800
MrMaxHD	27,300	612.00	16,707,600
AOKIホールディングス	35,700	832.00	29,702,400
オークワ	30,400	884.00	26,873,600
コメリ	29,200	2,996.00	87,483,200
青山商事	40,800	1,223.00	49,898,400
しまむら	22,200	12,620.00	280,164,000
はせがわ	8,400	344.00	2,889,600
高島屋	142,500	1,916.00	273,030,000
松屋	32,200	1,132.00	36,450,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	92,000	1,491.00	137,172,000
近鉄百貨店	8,300	2,494.00	20,700,200
丸井グループ	139,400	2,384.00	332,329,600
アクシアル リテイリング	13,000	3,295.00	42,835,000
イオン	640,300	2,841.00	1,819,092,300
イズミ	28,800	3,305.00	95,184,000
平和堂	31,600	2,105.00	66,518,000
フジ	29,100	1,793.00	52,176,300
ヤオコー	21,400	7,040.00	150,656,000
ゼビオホールディングス	26,000	1,147.00	29,822,000
ケーズホールディングス	133,900	1,236.00	165,500,400
Olympicグループ	6,400	527.00	3,372,800

日産東京販売ホールディングス	20,200	333.00	6,726,600	
シルバーライフ	4,000	1,281.00	5,124,000	
Genky Drug Stores	8,400	4,210.00	35,364,000	
ナルミヤ・インターナショナル	2,900	944.00	2,737,600	
ブックオフグループホールディングス	10,000	1,321.00	13,210,000	
ギフトホールディングス	4,100	5,010.00	20,541,000	
アインホールディングス	26,100	5,860.00	152,946,000	
元気寿司	5,500	3,205.00	17,627,500	
ヤマダホールディングス	775,600	419.00	324,976,400	
アークランズ	28,000	1,556.00	43,568,000	
ニトリホールディングス	76,400	17,480.00	1,335,472,000	
グルメ杵屋	15,800	1,047.00	16,542,600	
愛眼	10,800	174.00	1,879,200	
ケーユーホールディングス	11,400	1,256.00	14,318,400	
吉野家ホールディングス	74,100	2,584.00	191,474,400	
松屋フーズホールディングス	9,000	4,105.00	36,945,000	
サガミホールディングス	30,700	1,278.00	39,234,600	
関西フードマーケット	17,400	1,565.00	27,231,000	
王将フードサービス	12,500	6,290.00	78,625,000	
ミニストップ	13,800	1,424.00	19,651,200	
アークス	34,800	2,446.00	85,120,800	
パローホールディングス	36,300	1,969.00	71,474,700	
ベルク	9,500	5,960.00	56,620,000	
大庄	8,400	1,103.00	9,265,200	
ファーストリテイリング	85,000	33,050.00	2,809,250,000	
サンドラッグ	71,800	4,075.00	292,585,000	
サックスパー ホールディングス	18,500	1,046.00	19,351,000	
ヤマザワ	3,100	1,257.00	3,896,700	
やまや	3,200	2,641.00	8,451,200	
ベルーナ	46,200	701.00	32,386,200	
いよぎんホールディングス	209,200	751.00	157,109,200	
しずおかフィナンシャルグループ	397,300	1,026.00	407,629,800	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	148,000	871.00	128,908,000	
島根銀行	4,700	476.00	2,237,200	
じもとホールディングス	12,100	365.00	4,416,500	
めぶきフィナンシャルグループ	872,300	327.00	285,242,100	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,500	3,025.00	68,062,500	
九州フィナンシャルグループ	309,300	525.00	162,382,500	
ゆうちょ銀行	492,600	1,050.00	517,230,000	
富山第一銀行	58,400	646.00	37,726,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	968,900	546.00	529,019,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	109,100	1,079.00	117,718,900	

三十三フィナンシャルグループ	15,700	1,521.00	23,879,700
第四北越フィナンシャルグループ	27,600	3,105.00	85,698,000
ひろぎんホールディングス	229,400	762.00	174,802,800
おきなわフィナンシャルグループ	16,700	2,166.00	36,172,200
十六フィナンシャルグループ	22,800	3,070.00	69,996,000
北國フィナンシャルホールディングス	19,800	4,775.00	94,545,000
プロクレアホールディングス	21,500	2,081.00	44,741,500
あいちフィナンシャルグループ	24,600	2,099.00	51,635,400
SBI新生銀行	41,100	2,807.00	115,367,700
あおぞら銀行	110,500	2,555.00	282,327,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,009,900	928.00	10,217,187,200
りそなホールディングス	2,222,000	634.90	1,410,747,800
三井住友トラスト・ホールディングス	319,500	5,025.00	1,605,487,500
三井住友フィナンシャルグループ	1,284,700	5,649.00	7,257,270,300
千葉銀行	489,900	885.00	433,561,500
群馬銀行	341,100	509.00	173,619,900
武蔵野銀行	22,600	2,231.00	50,420,600
千葉興業銀行	32,000	480.00	15,360,000
筑波銀行	77,100	194.00	14,957,400
七十七銀行	56,300	2,460.00	138,498,000
秋田銀行	11,800	1,647.00	19,434,600
山形銀行	19,500	1,103.00	21,508,500
岩手銀行	12,000	2,054.00	24,648,000
東邦銀行	139,100	227.00	31,575,700
東北銀行	6,700	995.00	6,666,500
ふくおかフィナンシャルグループ	140,300	2,622.00	367,866,600
スルガ銀行	155,000	515.00	79,825,000
八十二銀行	360,600	589.00	212,393,400
山梨中央銀行	18,100	1,129.00	20,434,900
大垣共立銀行	33,500	1,809.00	60,601,500
福井銀行	15,700	1,419.00	22,278,300
清水銀行	7,000	1,416.00	9,912,000
富山銀行	2,100	1,641.00	3,446,100
滋賀銀行	29,200	2,728.00	79,657,600
南都銀行	26,500	2,381.00	63,096,500
百五銀行	165,400	395.00	65,333,000
京都銀行	55,700	6,610.00	368,177,000
紀陽銀行	62,900	1,513.00	95,167,700
ほくほくフィナンシャルグループ	111,700	1,085.00	121,194,500
山陰合同銀行	110,000	776.00	85,360,000
鳥取銀行	4,400	1,153.00	5,073,200
百十四銀行	16,000	1,785.00	28,560,000

四国銀行	27,900	848.00	23,659,200
阿波銀行	24,700	2,028.00	50,091,600
大分銀行	10,600	2,070.00	21,942,000
宮崎銀行	11,500	2,278.00	26,197,000
佐賀銀行	10,300	1,619.00	16,675,700
琉球銀行	40,300	910.00	36,673,000
セブン銀行	629,800	276.00	173,824,800
みずほフィナンシャルグループ	2,542,500	2,075.00	5,275,687,500
高知銀行	4,700	665.00	3,125,500
山口フィナンシャルグループ	194,100	912.00	177,019,200
長野銀行	4,200	1,543.00	6,480,600
名古屋銀行	11,600	3,475.00	40,310,000
北洋銀行	266,400	265.00	70,596,000
大光銀行	4,100	1,039.00	4,259,900
愛媛銀行	23,700	804.00	19,054,800
トマト銀行	4,500	1,007.00	4,531,500
京葉銀行	80,500	533.00	42,906,500
栃木銀行	80,500	239.00	19,239,500
北日本銀行	6,200	1,953.00	12,108,600
東和銀行	32,300	522.00	16,860,600
福島銀行	14,400	210.00	3,024,000
大東銀行	5,300	621.00	3,291,300
トモニホールディングス	142,100	368.00	52,292,800
フィデアホールディングス	18,200	1,313.00	23,896,600
池田泉州ホールディングス	225,100	229.00	51,547,900
F P G	59,600	1,115.00	66,454,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,500	1,071.00	15,529,500
マーキュリアホールディングス	8,300	689.00	5,718,700
S B I ホールディングス	254,600	2,691.00	685,128,600
ジャフコ グループ	58,800	1,762.00	103,605,600
大和証券グループ本社	1,257,400	635.00	798,449,000
野村ホールディングス	3,238,000	498.90	1,615,438,200
岡三証券グループ	154,700	444.00	68,686,800
丸三証券	58,900	405.00	23,854,500
東洋証券	59,000	268.00	15,812,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	191,900	354.00	67,932,600
光世証券	3,500	417.00	1,459,500
水戸証券	47,800	290.00	13,862,000
いちよし証券	32,700	586.00	19,162,200
松井証券	104,100	789.00	82,134,900
マネックスグループ	189,800	484.00	91,863,200
極東証券	22,200	602.00	13,364,400

岩井コスモホールディングス	20,200	1,344.00	27,148,800
アイザワ証券グループ	25,600	747.00	19,123,200
マネーパートナーズグループ	14,900	255.00	3,799,500
スパークス・グループ	19,700	1,434.00	28,249,800
かんぽ生命保険	213,400	2,148.00	458,383,200
S O M P Oホールディングス	301,700	5,861.00	1,768,263,700
アニコム ホールディングス	59,700	617.00	36,834,900
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	357,800	4,835.00	1,729,963,000
第一生命ホールディングス	858,900	2,449.00	2,103,446,100
東京海上ホールディングス	1,737,700	3,111.00	5,405,984,700
T & Dホールディングス	471,800	1,920.00	905,856,000
アドバンスクリエイト	10,200	1,133.00	11,556,600
全国保証	46,000	5,050.00	232,300,000
あんしん保証	7,900	312.00	2,464,800
イントラスト	5,600	916.00	5,129,600
日本モーゲージサービス	8,200	533.00	4,370,600
C a s a	5,700	869.00	4,953,300
アルヒ	22,000	986.00	21,692,000
プレミアグループ	29,800	1,556.00	46,368,800
ネットプロテクションズホールディングス	59,100	371.00	21,926,100
クレディセゾン	111,600	1,945.00	217,062,000
芙蓉総合リース	16,200	10,130.00	164,106,000
みずほリース	26,300	4,300.00	113,090,000
東京センチュリー	32,900	5,000.00	164,500,000
日本証券金融	70,800	1,104.00	78,163,200
アイフル	292,200	336.00	98,179,200
リコーリース	16,800	3,905.00	65,604,000
イオンフィナンシャルサービス	101,200	1,223.00	123,767,600
アコム	314,800	325.00	102,310,000
ジャックス	18,800	4,620.00	86,856,000
オリエントコーポレーション	46,200	1,080.00	49,896,000
オリックス	1,154,100	2,390.00	2,758,299,000
三菱HCキャピタル	685,900	767.00	526,085,300
九州リースサービス	6,800	791.00	5,378,800
日本取引所グループ	494,100	2,269.00	1,121,112,900
イー・ギャランティ	28,700	2,064.00	59,236,800
アサックス	6,700	618.00	4,140,600
N E Cキャピタルソリューション	8,700	2,833.00	24,647,100
大東建託	64,500	13,490.00	870,105,000
いちご	209,600	250.00	52,400,000
日本駐車場開発	193,500	230.00	44,505,000
スター・マイカ・ホールディングス	18,600	642.00	11,941,200

S R E ホールディングス	9,100	3,720.00	33,852,000
A D ワークスグループ	34,400	185.00	6,364,000
ヒューリック	411,500	1,194.00	491,331,000
三栄建築設計	9,700	1,506.00	14,608,200
野村不動産ホールディングス	110,400	3,410.00	376,464,000
三重交通グループホールディングス	40,800	548.00	22,358,400
サムティ	28,800	2,172.00	62,553,600
ディア・ライフ	32,400	741.00	24,008,400
地主	14,300	1,909.00	27,298,700
プレサンスコーポレーション	28,700	1,860.00	53,382,000
ハウスコム	3,900	938.00	3,658,200
J P M C	10,400	1,142.00	11,876,800
サンセイランディック	6,000	878.00	5,268,000
フージャースホールディングス	27,100	947.00	25,663,700
オープンハウスグループ	64,700	5,310.00	343,557,000
東急不動産ホールディングス	530,900	748.00	397,113,200
飯田グループホールディングス	154,700	2,364.00	365,710,800
イーランド	3,300	1,469.00	4,847,700
ムゲンエステート	11,800	647.00	7,634,600
A n d D o ホールディングス	10,400	1,151.00	11,970,400
シーアールイー	11,100	1,302.00	14,452,200
ケイアイスター不動産	8,900	4,665.00	41,518,500
グッドコムアセット	18,400	841.00	15,474,400
ジェイ・エス・ビー	4,800	4,520.00	21,696,000
ロードスターキャピタル	11,200	1,504.00	16,844,800
テンポイノベーション	5,800	1,061.00	6,153,800
フェイスネットワーク	5,100	1,234.00	6,293,400
パーク24	137,800	2,095.00	288,691,000
パラカ	7,100	1,903.00	13,511,300
三井不動産	760,400	2,707.50	2,058,783,000
三菱地所	1,061,900	1,614.50	1,714,437,550
平和不動産	29,000	3,750.00	108,750,000
東京建物	168,600	1,751.00	295,218,600
京阪神ビルディング	31,100	1,179.00	36,666,900
住友不動産	318,400	3,300.00	1,050,720,000
テーオーシー	34,600	620.00	21,452,000
東京楽天地	3,300	4,255.00	14,041,500
スターツコーポレーション	25,900	2,697.00	69,852,300
フジ住宅	27,200	692.00	18,822,400
空港施設	24,400	549.00	13,395,600
明和地所	8,600	893.00	7,679,800
ゴールドクレスト	17,800	1,716.00	30,544,800

エスリード	9,000	2,451.00	22,059,000
日神グループホールディングス	32,000	463.00	14,816,000
日本エスコン	39,500	796.00	31,442,000
MIRARTHホールディングス	88,800	421.00	37,384,800
A V A N T I A	9,800	825.00	8,085,000
イオンモール	92,100	1,805.00	166,240,500
毎日コムネット	7,300	798.00	5,825,400
ファースト住建	7,200	1,073.00	7,725,600
カチタス	47,900	2,553.00	122,288,700
トーセイ	30,300	1,682.00	50,964,600
穴吹興産	3,500	2,230.00	7,805,000
サンフロンティア不動産	30,600	1,322.00	40,453,200
F Jネクストホールディングス	20,300	1,010.00	20,503,000
インテリックス	3,300	556.00	1,834,800
ランドビジネス	5,000	243.00	1,215,000
サンネクスタグループ	5,800	1,004.00	5,823,200
グランディハウス	14,700	545.00	8,011,500
日本空港ビルデング	62,400	6,640.00	414,336,000
明豊ファシリティワークス	7,600	746.00	5,669,600
日本工営	11,100	3,820.00	42,402,000
L I F U L L	64,100	235.00	15,063,500
M I X I	41,900	2,800.00	117,320,000
ジェイエイシーリクルートメント	16,700	2,228.00	37,207,600
日本M&Aセンターホールディングス	315,200	996.00	313,939,200
メンバーズ	5,600	1,429.00	8,002,400
中広	2,800	402.00	1,125,600
UTグループ	27,100	2,718.00	73,657,800
アイティメディア	7,200	1,254.00	9,028,800
E・Jホールディングス	10,900	1,585.00	17,276,500
オープンアップグループ	55,200	1,948.00	107,529,600
コシダカホールディングス	55,200	1,142.00	63,038,400
アルトナー	3,700	1,492.00	5,520,400
パソナグループ	22,400	1,806.00	40,454,400
C D S	3,700	1,800.00	6,660,000
リンクアンドモチベーション	52,800	422.00	22,281,600
エス・エム・エス	69,900	2,917.00	203,898,300
サニーサイドアップグループ	4,700	664.00	3,120,800
パーソルホールディングス	205,500	2,702.00	555,261,000
リニカル	8,500	827.00	7,029,500
クックパッド	52,000	172.00	8,944,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,500	641.00	4,807,500
学情	8,500	1,673.00	14,220,500

スタジオアリス	9,300	2,160.00	20,088,000
シミックホールディングス	9,000	1,992.00	17,928,000
エプコ	3,500	745.00	2,607,500
N J S	4,200	2,341.00	9,832,200
総合警備保障	68,200	3,915.00	267,003,000
カカクコム	134,800	2,070.00	279,036,000
アイロムグループ	6,800	1,903.00	12,940,400
セントケア・ホールディング	12,100	770.00	9,317,000
サイネックス	3,000	574.00	1,722,000
ルネサンス	13,200	911.00	12,025,200
ディップ	32,200	3,470.00	111,734,000
デジタルホールディングス	14,600	1,070.00	15,622,000
新日本科学	19,600	2,298.00	45,040,800
キャリアデザインセンター	3,200	1,534.00	4,908,800
ベネフィット・ワン	85,200	1,528.00	130,185,600
エムスリー	362,700	3,077.00	1,116,027,900
ツカダ・グローバルホールディング	9,200	419.00	3,854,800
アウトソーシング	109,500	1,240.00	135,780,000
ウェルネット	11,400	612.00	6,976,800
ワールドホールディングス	8,400	2,730.00	22,932,000
ディー・エヌ・エー	73,500	1,866.00	137,151,000
博報堂D Yホールディングス	234,200	1,497.00	350,597,400
ぐるなび	34,600	361.00	12,490,600
タカミヤ	25,500	489.00	12,469,500
ジャパンベストレスキューシステム	9,100	692.00	6,297,200
ファンコミュニケーションズ	36,700	399.00	14,643,300
ライク	7,000	1,870.00	13,090,000
ビジネス・ブレークスルー	6,100	428.00	2,610,800
エスプール	53,300	595.00	31,713,500
W D Bホールディングス	9,500	2,090.00	19,855,000
ティア	9,100	435.00	3,958,500
C D G	1,800	1,360.00	2,448,000
アドウェイズ	25,700	653.00	16,782,100
バリューコマース	14,000	1,419.00	19,866,000
インフォマート	191,600	275.00	52,690,000
J Pホールディングス	53,700	322.00	17,291,400
エコナックホールディングス	27,900	92.00	2,566,800
C Lホールディングス	5,400	893.00	4,822,200
プレステージ・インターナショナル	77,700	630.00	48,951,000
アミューズ	10,100	1,763.00	17,806,300
ドリームインキュベータ	5,700	2,732.00	15,572,400
クイック	14,200	1,984.00	28,172,800

T A C	8,500	201.00	1,708,500	
電通グループ	180,400	4,520.00	815,408,000	
イオンファンタジー	8,000	3,520.00	28,160,000	
シーティーエス	20,700	722.00	14,945,400	
ネクシィーズグループ	4,900	671.00	3,287,900	
H . U . グループホールディングス	53,800	2,689.00	144,668,200	
アルプス技研	16,100	2,862.00	46,078,200	
日本空調サービス	20,100	745.00	14,974,500	
オリエンタルランド	971,100	5,375.00	5,219,662,500	
ダスキン	40,900	3,165.00	129,448,500	
明光ネットワークジャパン	22,800	630.00	14,364,000	
ファルコホールディングス	8,500	1,839.00	15,631,500	
ラウンドワン	154,000	625.00	96,250,000	
リゾートトラスト	72,600	2,122.00	154,057,200	
ビー・エム・エル	22,900	3,025.00	69,272,500	
りらいあコミュニケーションズ	30,500	1,456.00	44,408,000	
リソー教育	84,500	310.00	26,195,000	
早稲田アカデミー	10,400	1,386.00	14,414,400	
ユー・エス・エス	188,800	2,316.00	437,260,800	
東京個別指導学院	22,300	526.00	11,729,800	
サイバーエージェント	405,700	991.00	402,048,700	
楽天グループ	958,600	575.00	551,195,000	
クリーク・アンド・リバー社	10,900	1,989.00	21,680,100	
S B I グローバルアセットマネジメント	30,600	488.00	14,932,800	
テー・オー・ダブリュー	36,900	326.00	12,029,400	
山田コンサルティンググループ	9,500	1,716.00	16,302,000	
セントラルスポーツ	7,000	2,472.00	17,304,000	
フルキャストホールディングス	17,600	2,291.00	40,321,600	
エン・ジャパン	33,300	2,387.00	79,487,100	
リソルホールディングス	1,400	4,705.00	6,587,000	
テクノプロ・ホールディングス	108,700	3,115.00	338,600,500	
アトラグループ	3,200	180.00	576,000	
インターワークス	4,600	347.00	1,596,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	9,700	1,694.00	16,431,800	
K e e P e r 技研	11,400	5,510.00	62,814,000	
ファーストロジック	2,000	900.00	1,800,000	
三機サービス	2,400	1,076.00	2,582,400	
G u n o s y	15,100	602.00	9,090,200	
デザインワン・ジャパン	5,300	172.00	911,600	
イー・ガーディアン	7,100	1,999.00	14,192,900	
リブセンス	7,700	254.00	1,955,800	
ジャパンマテリアル	56,300	2,211.00	124,479,300	

ベクトル	29,000	1,307.00	37,903,000
ウチヤマホールディングス	7,100	299.00	2,122,900
チャーム・ケア・コーポレーション	15,600	1,145.00	17,862,000
キャリアリンク	6,800	2,872.00	19,529,600
I B J	11,700	681.00	7,967,700
アサンテ	9,300	1,608.00	14,954,400
バリューHR	16,200	1,422.00	23,036,400
M & A キャピタルパートナーズ	14,900	3,120.00	46,488,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,800	1,001.00	6,806,800
E R I ホールディングス	3,900	1,350.00	5,265,000
アビスト	2,300	3,060.00	7,038,000
シグマクシス・ホールディングス	28,100	1,145.00	32,174,500
ウィルグループ	15,600	1,027.00	16,021,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	17,200	142.00	2,442,400
メドピア	16,400	1,151.00	18,876,400
レアジョブ	3,000	1,038.00	3,114,000
リクルートホールディングス	1,358,600	4,440.00	6,032,184,000
エラン	24,600	891.00	21,918,600
土木管理総合試験所	6,900	324.00	2,235,600
日本郵政	2,405,200	998.90	2,402,554,280
ベルシステム24ホールディングス	24,800	1,413.00	35,042,400
鎌倉新書	21,200	820.00	17,384,000
S M N	4,100	457.00	1,873,700
グローバルキッズCOMPANY	3,100	682.00	2,114,200
エアトリ	13,500	2,671.00	36,058,500
アトラエ	11,200	779.00	8,724,800
ストライク	7,800	3,590.00	28,002,000
ソラスト	51,100	610.00	31,171,000
セラク	5,800	1,589.00	9,216,200
インソース	40,100	1,212.00	48,601,200
ベイカレント・コンサルティング	145,300	5,120.00	743,936,000
Orchestra Holdings	4,200	1,194.00	5,014,800
アイモバイル	8,400	1,300.00	10,920,000
キャリアインデックス	5,900	302.00	1,781,800
MS - Japan	5,000	1,001.00	5,005,000
船場	2,900	721.00	2,090,900
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	65,600	1,927.00	126,411,200
フルテック	2,300	1,082.00	2,488,600
GameWith	5,100	393.00	2,004,300
MS & Consulting	2,200	600.00	1,320,000
ウェルビー	14,000	510.00	7,140,000
エル・ティー・エス	2,500	3,230.00	8,075,000

ミダックホールディングス	11,300	1,772.00	20,023,600
日総工産	14,100	810.00	11,421,000
キュービーネットホールディングス	8,900	1,514.00	13,474,600
R P Aホールディングス	25,700	375.00	9,637,500
スプリックス	4,500	825.00	3,712,500
マネジメントソリューションズ	10,200	2,937.00	29,957,400
プロレド・パートナーズ	5,100	512.00	2,611,200
テノ・ホールディングス	2,200	679.00	1,493,800
フロンティア・マネジメント	6,400	1,138.00	7,283,200
ピアラ	2,900	510.00	1,479,000
コプロ・ホールディングス	2,500	1,793.00	4,482,500
ギークス	2,300	754.00	1,734,200
アンビスホールディングス	19,700	2,852.00	56,184,400
カーブスホールディングス	50,600	700.00	35,420,000
フォーラムエンジニアリング	11,000	1,175.00	12,925,000
Fast Fitness Japan	6,500	1,262.00	8,203,000
ダイレクトマーケティングミックス	22,200	1,150.00	25,530,000
ポピンズ	2,900	1,600.00	4,640,000
L I T A L I C O	14,400	2,347.00	33,796,800
アドバンテッジリスクマネジメント	7,000	551.00	3,857,000
リログループ	102,300	1,939.00	198,359,700
東祥	13,000	1,167.00	15,171,000
ビーウィズ	4,800	1,750.00	8,400,000
T R Eホールディングス	38,900	1,096.00	42,634,400
人・夢・技術グループ	7,100	1,480.00	10,508,000
大栄環境	46,800	2,036.00	95,284,800
日本管財ホールディングス	19,400	2,635.00	51,119,000
エイチ・アイ・エス	48,100	1,951.00	93,843,100
ラックランド	7,700	3,235.00	24,909,500
共立メンテナンス	31,500	5,100.00	160,650,000
イチネンホールディングス	19,700	1,319.00	25,984,300
建設技術研究所	9,500	3,430.00	32,585,000
スペース	13,600	1,030.00	14,008,000
燦ホールディングス	8,000	2,221.00	17,768,000
スバル興業	900	9,460.00	8,514,000
東京テアトル	5,200	1,125.00	5,850,000
タナベコンサルティンググループ	5,900	873.00	5,150,700
ナガワ	5,000	6,090.00	30,450,000
東京都競馬	15,400	4,015.00	61,831,000
カナモト	33,800	2,266.00	76,590,800
ニシオホールディングス	17,200	3,285.00	56,502,000
トランス・コスモス	22,900	3,305.00	75,684,500

乃村工藝社	80,400	952.00	76,540,800	
藤田観光	8,100	3,640.00	29,484,000	
KNT-CTホールディングス	10,900	1,419.00	15,467,100	
トーカイ	16,400	1,891.00	31,012,400	
セコム	186,900	9,277.00	1,733,871,300	
セントラル警備保障	10,000	2,815.00	28,150,000	
丹青社	35,900	804.00	28,863,600	
メイテック	71,700	2,330.00	167,061,000	
応用地質	17,300	1,908.00	33,008,400	
船井総研ホールディングス	38,300	2,592.00	99,273,600	
進学会ホールディングス	5,700	295.00	1,681,500	
オオバ	9,300	774.00	7,198,200	
いであ	3,300	1,639.00	5,408,700	
学究社	7,500	2,183.00	16,372,500	
ベネッセホールディングス	68,700	1,881.00	129,224,700	
イオンディライト	20,400	3,025.00	61,710,000	
ナック	8,400	956.00	8,030,400	
ダイセキ	37,500	3,760.00	141,000,000	
ステップ	6,800	1,810.00	12,308,000	
合 計	208,833,600		551,712,588,640	

(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17期中間計算期間(2023年5月30日から2023年11月29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せん。

【DC日本株式インデックス・オープンS】

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 (2023年5月29日現在)	第17期中間計算期間 (2023年11月29日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	41,406,541	50,453,488
親投資信託受益証券	19,250,522,205	22,256,607,216
未収入金	23,578,295	-
流動資産合計	19,315,507,041	22,307,060,704
資産合計	19,315,507,041	22,307,060,704
負債の部		
流動負債		
未払解約金	35,590,312	16,150,154
未払受託者報酬	2,836,254	3,514,652
未払委託者報酬	16,072,027	19,012,180
未払利息	83	50
その他未払費用	922,500	585,714
流動負債合計	55,421,176	39,262,750
負債合計	55,421,176	39,262,750
純資産の部		
元本等		
元本	10,217,388,315	10,689,432,007
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	9,042,697,550	11,578,365,947
(分配準備積立金)	4,829,268,335	4,459,528,886
元本等合計	19,260,085,865	22,267,797,954
純資産合計	19,260,085,865	22,267,797,954
負債純資産合計	19,315,507,041	22,307,060,704

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期中間計算期間 自 2022年 5月31日 至 2022年11月30日	第17期中間計算期間 自 2023年 5月30日 至 2023年11月29日
営業収益		
受取利息	33	108
有価証券売買等損益	759,363,652	2,091,533,161
営業収益合計	759,363,685	2,091,533,269
営業費用		
支払利息	8,032	10,896
受託者報酬	2,699,470	3,514,652
委託者報酬	15,296,901	19,012,180
その他費用	449,853	585,715
営業費用合計	18,454,256	23,123,443
営業利益又は営業損失（ ）	740,909,429	2,068,409,826
経常利益又は経常損失（ ）	740,909,429	2,068,409,826
中間純利益又は中間純損失（ ）	740,909,429	2,068,409,826
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（ ）	13,757,786	101,746,640
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	6,175,100,599	9,042,697,550
剰余金増加額又は欠損金減少額	709,464,583	1,316,247,127
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	709,464,583	1,316,247,127
剰余金減少額又は欠損金増加額	495,940,986	747,241,916
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	495,940,986	747,241,916
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	7,115,775,839	11,578,365,947

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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。
-----------------	---------------------------------------

(中間貸借対照表に関する注記)

	第16期 (2023年 5月29日現在)	第17期中間計算期間 (2023年11月29日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	10,217,388,315口	10,689,432,007口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8850円 (18,850円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.0832円 (20,832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17期中間計算期間 (2023年11月29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 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。

(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16期 自 2022年 5月31日 至 2023年 5月29日	第17期中間計算期間 自 2023年 5月30日 至 2023年11月29日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	9,707,460,074円	10,217,388,315円
期中追加設定元本額	2,222,088,080円	1,309,881,460円
期中一部解約元本額	1,712,159,839円	837,837,768円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

国内株式インデックス マザーファンド

貸借対照表

	2023年11月29日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,682,185,042
株式	582,952,731,670
派生商品評価勘定	260,343,500
未収入金	152,454,700
未収配当金	4,579,609,400
差入委託証拠金	319,459,873
流動資産合計	590,946,784,185
資産合計	590,946,784,185
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,409,050
前受金	248,062,600
未払金	270,325,200
未払解約金	208,683,003
未払利息	2,659
流動負債合計	739,482,512
負債合計	739,482,512
純資産の部	
元本等	
元本	243,325,046,303
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	346,882,255,370
元本等合計	590,207,301,673
純資産合計	590,207,301,673
負債純資産合計	590,946,784,185

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2023年11月29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11月29日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	243,325,046,303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 2.4256円 (1万口当たり純資産額) (24,256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11月29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ぬ。
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つた場合、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11月29日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 5月30日
期首元本額	255,447,146,244円
期中追加設定元本額	12,732,415,837円
期中一部解約元本額	24,854,515,778円
期末元本額	243,325,046,303円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	309,855,019円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,443,995,919円
SBI資産設計オープン(分配型)	13,103,178円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,056,332,022円
世界経済インデックスファンド	5,162,659,850円
日本株式インデックス・オープン	2,973,628,924円
DCマイセクション25	5,365,244,134円
DCマイセクション50	17,321,536,555円
DCマイセクション75	18,578,820,549円
DC日本株式インデックス・オープン	6,018,777,010円
DCマイセクションS25	3,178,764,225円
DCマイセクションS50	9,553,926,823円
DCマイセクションS75	8,248,057,255円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,175,712,078円
DCターゲット・イヤーフンド2025	91,415,965円
DCターゲット・イヤーフンド2035	618,297,918円
DCターゲット・イヤーフンド2045	484,910,191円
DC世界経済インデックスファンド	3,786,803,559円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	878,612,571円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	2,789,509円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	9,000,727円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	13,704,323円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	146,057,067円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,043,492円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	17,358,838円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	70,516,841円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	16,387,263円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	46,566,578円

区分	2023年11月29日現在
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	512,019,103円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	321,974,732円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,162,501,963円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	29,983,810円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	12,709,949円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	334,388,323円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	183,474,847円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	250,041,411円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	20,204,568円
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	420,059,521円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,536,242,081円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,922,480,157円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,155,853,727円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,631,424,283円
分散投資コア戦略ファンドA	1,940,288,367円
分散投資コア戦略ファンドS	6,367,530,443円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	597,643,312円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	407,250,988円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,225,158,969円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	200,476,104円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,803,188円
SMT インデックスバランス・オープン	49,216,972円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	19,637,402,945円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	267,816,957円
SMT 世界経済インデックス・オープン	52,208,453円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	215,995,908円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	37,279,332円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,099,311円
グローバル経済コア	217,099,031円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	33,840,643円
My SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	1,224,629,890円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	30,778,837円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	964,175,269円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	242,306,554円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	52,852,742円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	50,554,443円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	21,954,188円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	24,844,510円
10資産分散投資ファンド	92,661,280円
グローバル10資産バランスファンド	3,159,568円
DC世界経済インデックスファンド(株式特化型)	20,340円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	42,035,674,142円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	496,286,750円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	301,279,696円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	21,030,573円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	437,099,410円
SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P(適格機関投資家専用)	46,747,600,533円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	17,833,296円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	210,956,501円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2023年11月29日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,219,017,400	-	7,467,080,000	248,062,600
合計		7,219,017,400	-	7,467,080,000	248,062,600

(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・オープンS】

【純資産額計算書】

（2023年12月29日現在）

資産総額	22,521,148,339円
負債総額	53,793,381円
純資産総額（ - ）	22,467,354,958円
発行済口数	10,763,119,271口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0874円
（1万口当たり純資産額）	（20,874円）

（参考）

国内株式インデックス マザーファンド

純資産額計算書

（2023年12月29日現在）

資産総額	594,166,725,557円
負債総額	287,749,566円
純資産総額（ - ）	593,878,975,991円
発行済口数	244,296,624,247口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4310円
（1万口当たり純資産額）	（24,310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、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、

- 八. 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、

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、）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12月29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年間にお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2024年 2月29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12月29日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	529	14,219,692
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	63	218,373
単体型公社債投資信託	51	177,896
合計	643	14,615,960

3【委託会社等の経理状況】

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

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第37期事業年度（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。
また、第38期事業年度の中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (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	1 255
器具備品	1 687	1 560
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 (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
	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	評価・換算差額等			純資産合計
	其他有価証券 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
	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
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27-21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)				
其他有価証券	-	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)
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				
	米ドル	投資有価証券 関係会社株式	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
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	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)
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		当事業年度	
	(2022年3月31日)		(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あります。

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いません。

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

中間貸借対照表

(単位：百万円)

第38期中間会計期間末

(2023年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		19,075
金銭の信託		16,243
未収委託者報酬		10,120
未収運用受託報酬		5,852
短期差入証拠金		4,241
その他		2,069
流動資産合計		57,601

固定資産

有形固定資産	1	727
無形固定資産		
ソフトウェア		7,456
その他		45
無形固定資産合計		7,502

投資その他の資産

投資有価証券		4,409
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,136
その他		31
投資その他の資産合計		11,213

固定資産合計 19,443

資産合計 77,045

負債の部

流動負債

未払金		8,680
未払法人税等		441
賞与引当金		377
その他	2	1,624

流動負債合計		11,124
--------	--	--------

固定負債

退職給付引当金		932
資産除去債務		154
その他		35

固定負債合計		1,121
--------	--	-------

負債合計		12,246
------	--	--------

(単位：百万円)

第38期中間会計期間末

(2023年9月30日)

純資産の部

株主資本

資本金		2,000
-----	--	-------

資本剰余金

その他資本剰余金		17,239
----------	--	--------

資本剰余金合計		17,239
---------	--	--------

利益剰余金

利益準備金		500
-------	--	-----

その他利益剰余金

別途積立金		2,100
-------	--	-------

繰越利益剰余金		43,700
---------	--	--------

利益剰余金合計		46,300
---------	--	--------

株主資本合計		65,540
--------	--	--------

評価・換算差額等

その他有価証券評価差額金		164
--------------	--	-----

繰延ヘッジ損益		906
---------	--	-----

評価・換算差額等合計		741
------------	--	-----

純資産合計		64,798
-------	--	--------

負債・純資産合計		77,045
----------	--	--------

中間損益計算書

(単位：百万円)

第38期中間会計期間

(自 2023年4月1日

至 2023年9月30日)

営業収益

委託者報酬		21,671
-------	--	--------

運用受託報酬		5,502
--------	--	-------

その他営業収益		178
---------	--	-----

営業収益合計		27,352
--------	--	--------

営業費用		16,664
------	--	--------

一般管理費	1	6,965
-------	---	-------

営業利益		3,722
営業外収益	2	1,680
営業外費用	3	2,074
経常利益		3,327
税引前中間純利益		3,327
法人税、住民税及び事業税		846
法人税等調整額		169
法人税等合計		1,015
中間純利益		2,312

中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				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	44,755	47,355	66,595
当中間期変動額					
剰余金の配当			3,367	3,367	3,367
中間純利益			2,312	2,312	2,312
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	1,055	1,055	1,055
当中間期末残高	500	2,100	43,700	46,300	65,540

	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	49	510	460	66,134
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,367
中間純利益				2,312
株主資本以外の項目 の 当中間期変動額（純額）	114	395	280	280
当中間期変動額合計	114	395	280	1,335
当中間期末残高	164	906	741	64,798

注記事項

（重要な会計方針）

第38期中間会計期間
（自 2023年4月1日
至 2023年9月30日）

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

(2) デリバティブ

時価法によっております。

(3) 金銭の信託

時価法によっております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務費用：発生事業年度に損益処理

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

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

(1) 投資信託委託業務

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

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

7. グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

（表示方法の変更）

第38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
従来「無形固定資産」に含めていた「ソフトウェア」は、金額の重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。

（中間貸借対照表関係）

第38期中間会計期間末 （2023年9月30日）	
1 有形固定資産の減価償却累計額	957百万円
2 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

（中間損益計算書関係）

第38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	91百万円
無形固定資産	972百万円
2 営業外収益の主要項目	
金銭の信託運用益	1,589百万円
3 営業外費用の主要項目	
デリバティブ費用	1,269百万円
為替差損	784百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1. 発行済株式に関する事項

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

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

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

（リース取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

第38期中間会計期間末（2023年9月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）第24-16項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（（1）*2、*3及び（注2）参照）。

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区分	中間貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,206	13,995	-	15,201
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	4,137	-	4,137
資産計	1,206	18,133	-	19,339
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	226	113	-	339
通貨関連取引	-	(134)	-	(134)
デリバティブ取引計	226	(20)	-	205

(*1)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2)金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額1,041百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は16,243百万円であります。

(*3)投資有価証券のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額271百万円）は上記に含めておりません。

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

(2) 時価をもって中間貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

現金及び預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、短期差入証拠金、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。為替予約及びトータルリターンスワップの時価は、為替レートや金利や株価等の観察可能なインプットを用いた割引現在価値法等により取引先金融機関が算定した価格を時価の算定に用いており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
関係会社株式	5,636

(有価証券関係)

第38期中間会計期間末（2023年9月30日）

1. 子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

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

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

2. その他有価証券

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	2,711	2,131	580
小計	2,711	2,131	580
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,426	1,769	343
小計	1,426	1,769	343
合計	4,137	3,900	237

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額0百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額271百万円）は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1)通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,944	-	76	76
	英ポンド	267	-	1	1
	カナダドル	126	-	1	1
	スイスフラン	176	-	0	0
	香港ドル	214	-	2	2
	ユーロ	719	-	3	3
合計		7,449	-	84	84

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

(2)株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	9,373	-	226	226
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	3,866	-	113	113
合計		13,239	-	339	339

(注) 上記取引の評価損益は中間損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1)通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		1,935	-	24
	英ポンド		3,612	-	23
	スイスフラン		22	-	0
	香港ドル		90	-	1
	ユーロ		51	-	0
合計			5,713	-	49

(資産除去債務関係)
重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)
第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

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

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

第38期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,057百万円

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
該当事項はありません。

(1株当たり情報)

	第38期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
1株当たり純資産額	21,599,648円64銭
1株当たり中間純利益	770,782円86銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

(注) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第38期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
中間純利益	2,312百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,312百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

4 【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己又はその役員との取引

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

(2) 運用財産相互間の取引

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

(3) 通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

と。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2024年 2月29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。
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社北海道銀行	93,524	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
アイザワ証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（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8月9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・オープンの2022年5月31日から2023年5月29日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC日本株式インデックス・オープンの2023年5月29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12月1日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

三上和彦

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

田中洋一

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務

諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2024年2月8日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックス・オープンの2023年5月30日から2023年11月29日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DC日本株式インデックス・オープンの2023年11月29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5月30日から2023年11月29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。