

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年6月28日提出
【計算期間】	第22期(自 2023年4月1日至 2024年4月1日)
【ファンド名】	D C日本株式インデックスファンドL
【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】	北添 道生
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

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

<信託金限度額>

上限 3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グロ ー バ ル 日本	ファミリー ファンド ファンド・ オブ・ファ ンズ	あり () なし	日経225 TOPIX その他 ()	ブル・ベア型 条件付運用型 ロ ン グ ・ シ ョ ー ト 型 / 絶 対 収 益 追 求 型 その他 ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年6回 (隔 月) 年12回 (毎 月) 日々	北米 欧州 アジア オセアニア				
不動産投信	その他 ()	中南米				
その他資産 (投資信託証券 (株 式 一 般))		アフリカ 中近東 (中 東)				
資産複合 () 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

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

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

< ファンドの特色 >

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

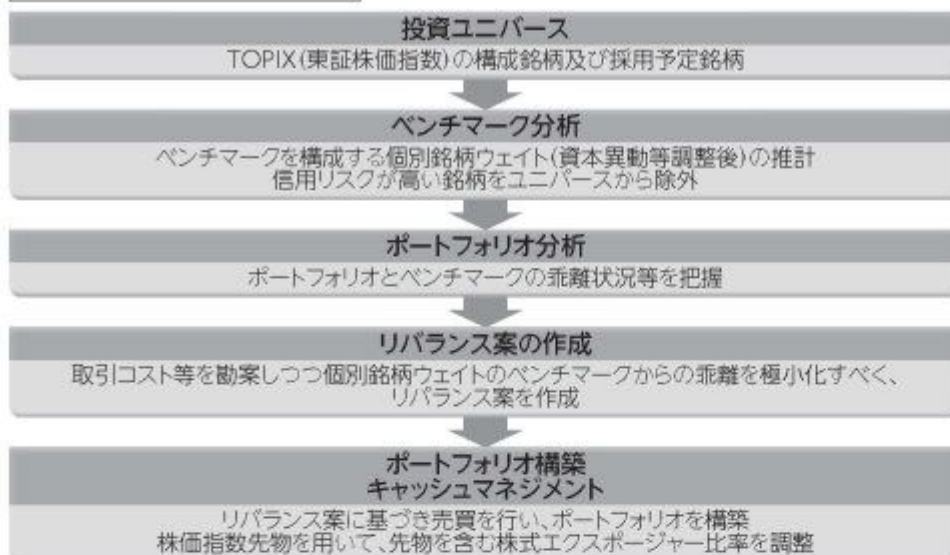
TOPIX(東証株価指数)とは

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

(注)TOPIX(東証株価指数)(配当込み)の著作権等について

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

マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

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



分配方針

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

主な投資制限

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

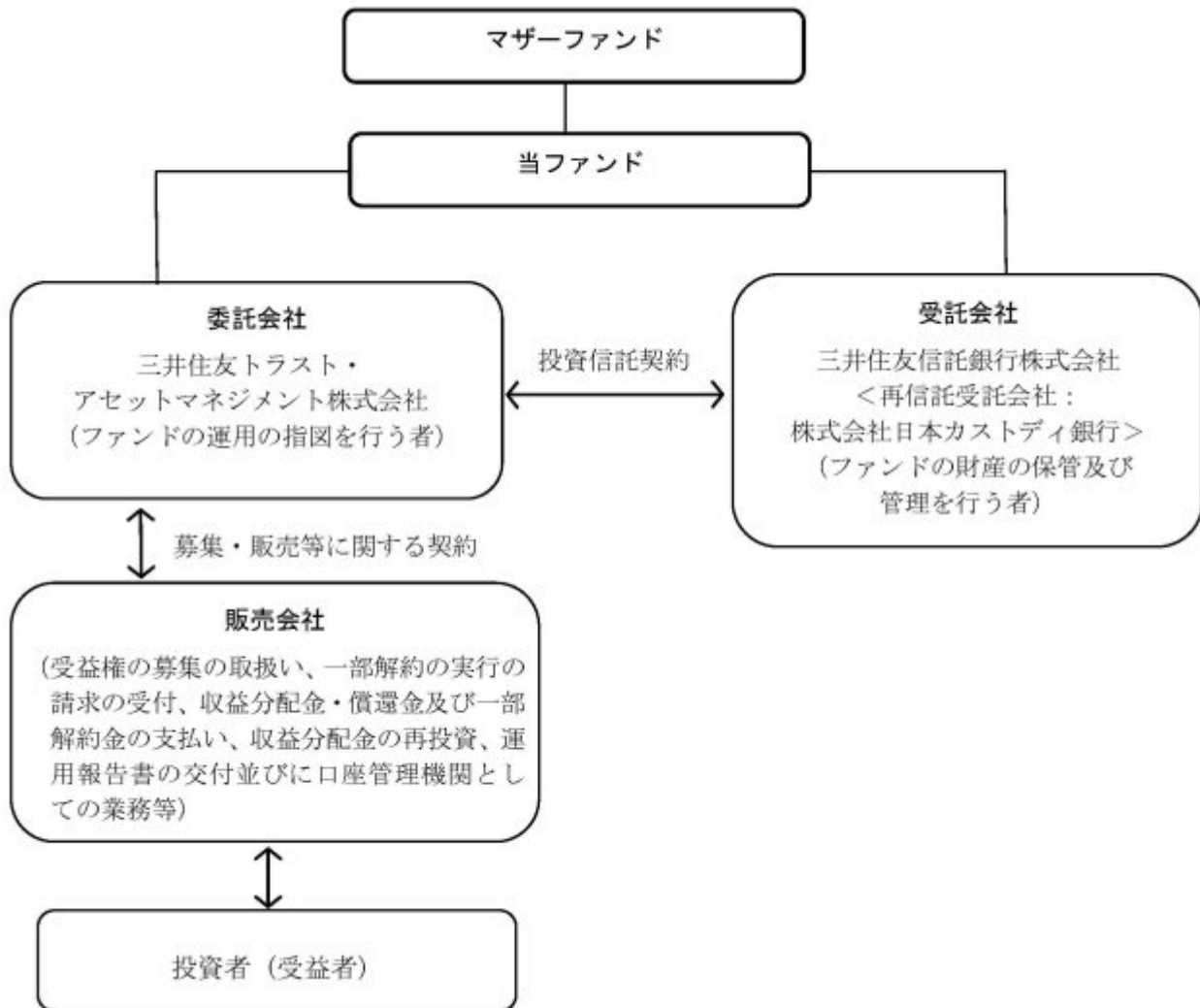
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2024年 4月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

運用方針

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

投資態度

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

（2）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- A．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - 1．有価証券
 - 2．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記（5）＜約款に定める投資制限＞J．、K．及びL．に定めるものに限りません。）
 - 3．金銭債権（上記1．、2．及び下記4．に掲げるものに該当するものを除きます。）
 - 4．約束手形（上記1．に掲げるものに該当するものを除きます。）
- B．次に掲げる特定資産以外の資産
 - 1．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三井住友信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託「日本株式マザーファンド」（以下「マザーファンド」という場合があります。）の受益証券及び次に掲げる有価証券（金融商品

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

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

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

運用指図できる金融商品

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きま

す。）

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で上記5．の権利の性質を有するもの

B．金融商品による運用の特例

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

（参考）マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2．運用方法

（1）投資対象

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

（2）投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

3．投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の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、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

(3)【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

年1回の毎決算時（決算日は3月31日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

A．株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

C．新株引受権証券等への投資割合

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

D．投資信託証券への投資割合

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

E．同一銘柄の株式への投資割合

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

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

G．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

H．投資する株式等の範囲

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

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

I．信用取引の指図範囲

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

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

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

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

J．先物取引等の運用指図

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

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

K．スワップ取引の運用指図

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

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

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

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

L．金利先渡取引の運用指図

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

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

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

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

M．有価証券の貸付の指図及び範囲

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

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

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

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

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

N．公社債の空売りの指図及び範囲

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

ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- 〇．公社債の借入れの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- Ｐ．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図
- 委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。
- Ｑ．再投資の指図
- 委託会社は、上記Ｐ．の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。
- Ｒ．資金の借入れ
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券の売却代金、有価証券等の解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- ハ．収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。
- Ｓ．受託会社による資金の立替え
- イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。
- ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。
- Ｔ．一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エク

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ. 同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

信用リスク

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

有価証券の貸付等に係るリスク

有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産などにより決済が不履行となるリスクがあります。貸付契約が不履行となった場合、担保金による有価証券の買戻しの際、時価変動の影響から損失を被り、基準価額の下落要因となる可能性があります。

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

< その他の留意点 >

ファンドは、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。

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

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

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

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

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

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

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

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

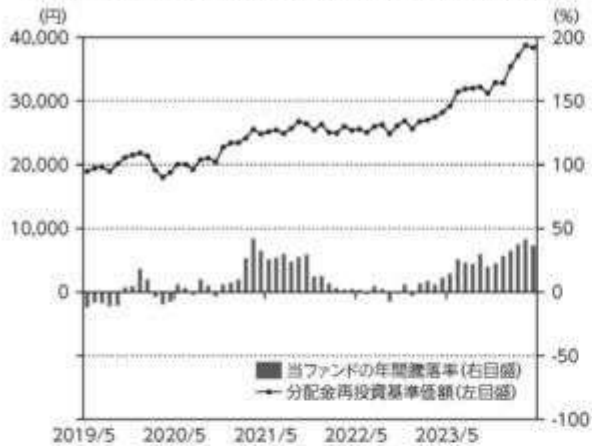
（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

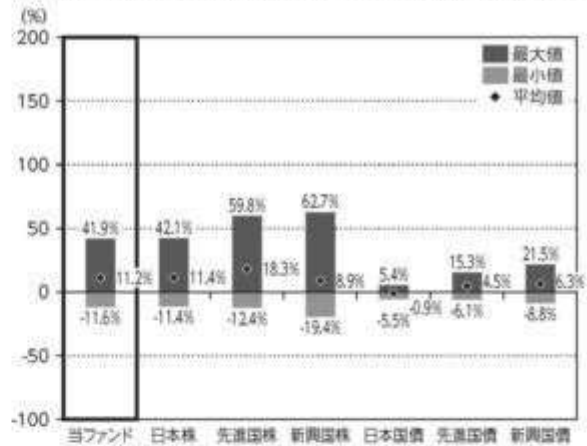
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2019年5月～2024年4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JPMリサーチが算出、公表する指数で、日本の株式市場を広くに観測するとともに、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)商標は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の増減及び同指数に係る権利行使等は、株式会社JPMリサーチ又は株式会社JPMリサーチの関連会社(以下「JPM」という。)の知財財産であり、指数の算出、指数の公表、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意又は商標に関するすべての権利はJPMが有します。JPMは、同指数の増減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、JPM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JPM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衆を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージングマーケットインデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージングマーケットインデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公衆を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ・コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ・コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ・コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのアドバイザーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガン・グローバル・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス(配当込み、円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承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 >

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

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。

イ．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（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。

ロ．有価証券の貸付の指図を行った場合は、ファンドの品貸料及びマザーファンドの品貸料のうちファンドに属するとみなした額に50%未満の率（ ）を乗じて得た額

2024年6月29日現在、合計で49.5%（税抜45%）以内とし、その配分は委託会社29.7%（税抜27%）、受託会社19.8%（税抜18%）です。（品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。）

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2024年4月30日現在のものですので、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
0.20%	0.20%	0.00%

※対象期間は2023年4月1日～2024年4月1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、2024年4月30日現在の状況について記載してあります。

【DC日本株式インデックスファンドL】

（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	180,842,370,617	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		88,584,734	0.05
合計(純資産総額)		180,930,955,351	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受 益証券	日本株式マザーファンド	54,767,525,929	3.2741	179,317,593,078	3.3020	180,842,370,617	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13期計算期間末	(2015年 3月31日)	73,026,107,098	73,026,107,098	17,815	17,815
第14期計算期間末	(2016年 3月31日)	69,315,595,697	69,315,595,697	15,862	15,862
第15期計算期間末	(2017年 3月31日)	79,513,820,774	79,513,820,774	18,169	18,169
第16期計算期間末	(2018年 4月 2日)	94,197,935,571	94,197,935,571	20,938	20,938
第17期計算期間末	(2019年 4月 1日)	93,580,494,253	93,580,494,253	20,237	20,237
第18期計算期間末	(2020年 3月31日)	82,302,972,845	82,302,972,845	18,017	18,017
第19期計算期間末	(2021年 3月31日)	117,130,660,109	117,130,660,109	25,563	25,563
第20期計算期間末	(2022年 3月31日)	119,653,547,033	119,653,547,033	26,026	26,026
第21期計算期間末	(2023年 3月31日)	127,887,544,804	127,887,544,804	27,484	27,484
第22期計算期間末	(2024年 4月 1日)	179,153,680,600	179,153,680,600	38,115	38,115
	2023年 4月末日	130,876,238,210		28,221	
	5月末日	135,102,594,446		29,236	
	6月末日	145,950,243,541		31,440	
	7月末日	148,327,360,461		31,906	
	8月末日	148,958,043,729		32,037	
	9月末日	150,278,454,520		32,200	
	10月末日	146,510,693,173		31,234	
	11月末日	154,100,244,450		32,917	
	12月末日	153,700,371,663		32,841	

2024年 1月末日	165,976,716,177		35,400
2月末日	174,775,633,306		37,138
3月末日	182,209,892,625		38,778
4月末日	180,930,955,351		38,427

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第13期計算期間	2014年 4月 1日～2015年 3月31日	0
第14期計算期間	2015年 4月 1日～2016年 3月31日	0
第15期計算期間	2016年 4月 1日～2017年 3月31日	0
第16期計算期間	2017年 4月 1日～2018年 4月 2日	0
第17期計算期間	2018年 4月 3日～2019年 4月 1日	0
第18期計算期間	2019年 4月 2日～2020年 3月31日	0
第19期計算期間	2020年 4月 1日～2021年 3月31日	0
第20期計算期間	2021年 4月 1日～2022年 3月31日	0
第21期計算期間	2022年 4月 1日～2023年 3月31日	0
第22期計算期間	2023年 4月 1日～2024年 4月 1日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第13期計算期間	2014年 4月 1日～2015年 3月31日	30.5
第14期計算期間	2015年 4月 1日～2016年 3月31日	11.0
第15期計算期間	2016年 4月 1日～2017年 3月31日	14.5
第16期計算期間	2017年 4月 1日～2018年 4月 2日	15.2
第17期計算期間	2018年 4月 3日～2019年 4月 1日	3.3
第18期計算期間	2019年 4月 2日～2020年 3月31日	11.0
第19期計算期間	2020年 4月 1日～2021年 3月31日	41.9
第20期計算期間	2021年 4月 1日～2022年 3月31日	1.8
第21期計算期間	2022年 4月 1日～2023年 3月31日	5.6
第22期計算期間	2023年 4月 1日～2024年 4月 1日	38.7

(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13期計算期間	2014年 4月 1日～2015年 3月31日	9,661,910,614	10,162,747,005	40,990,628,260
第14期計算期間	2015年 4月 1日～2016年 3月31日	12,364,658,702	9,655,862,890	43,699,424,072
第15期計算期間	2016年 4月 1日～2017年 3月31日	8,332,373,769	8,267,206,141	43,764,591,700
第16期計算期間	2017年 4月 1日～2018年 4月 2日	9,068,541,994	7,843,419,871	44,989,713,823
第17期計算期間	2018年 4月 3日～2019年 4月 1日	7,404,869,734	6,151,695,641	46,242,887,916
第18期計算期間	2019年 4月 2日～2020年 3月31日	7,667,675,777	8,228,600,168	45,681,963,525
第19期計算期間	2020年 4月 1日～2021年 3月31日	7,900,549,624	7,762,885,703	45,819,627,446
第20期計算期間	2021年 4月 1日～2022年 3月31日	8,057,883,165	7,902,852,295	45,974,658,316

第21期計算期間	2022年 4月 1日～2023年 3月31日	6,699,246,631	6,142,308,596	46,531,596,351
第22期計算期間	2023年 4月 1日～2024年 4月 1日	8,031,898,429	7,559,999,060	47,003,495,720

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

(参考)

日本株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	420,876,189,820	97.72
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,810,088,083	2.28
合計(純資産総額)		430,686,277,903	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	9,504,620,000	2.21

(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	5,970,300	2,982.00	17,803,434,600	3,638.00	21,719,951,400	5.04
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,521,500	1,308.00	8,530,122,000	1,579.50	10,300,709,250	2.39
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	769,100	14,800.00	11,382,680,000	13,085.00	10,063,673,500	2.34
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	230,100	28,700.00	6,603,870,000	35,120.00	8,081,112,000	1.88
日本	株式	三菱商事	卸売業	2,208,900	2,602.50	5,748,662,250	3,620.00	7,996,218,000	1.86
日本	株式	日立製作所	電気機器	527,800	11,425.00	6,030,115,000	14,620.00	7,716,436,000	1.79
日本	株式	キーエンス	電気機器	108,800	66,720.00	7,259,136,000	70,300.00	7,648,640,000	1.78
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	761,400	7,373.00	5,613,802,200	8,980.00	6,837,372,000	1.59
日本	株式	三井物産	卸売業	862,200	5,978.00	5,154,231,600	7,639.00	6,586,345,800	1.53
日本	株式	信越化学工業	化学	976,700	5,872.00	5,735,182,400	6,195.00	6,050,656,500	1.40
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	803,700	6,149.00	4,941,951,300	6,902.00	5,547,137,400	1.29
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	32,437,300	191.20	6,202,011,760	170.80	5,540,290,840	1.29
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	773,300	6,647.00	5,140,125,100	7,136.00	5,518,268,800	1.28
日本	株式	任天堂	その他製品	686,500	8,103.00	5,562,709,500	7,720.00	5,299,780,000	1.23

日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,043,800	3,831.00	3,998,797,800	4,991.00	5,209,605,800	1.21
日本	株式	第一三共	医薬品	950,000	4,392.00	4,172,400,000	5,364.00	5,095,800,000	1.18
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,577,900	1,610.00	4,150,419,000	1,812.00	4,671,154,800	1.08
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,445,400	2,587.50	3,739,972,500	3,052.00	4,411,360,800	1.02
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	537,900	6,723.00	3,616,301,700	7,915.00	4,257,478,500	0.99
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	965,100	4,381.00	4,228,103,100	4,153.00	4,008,060,300	0.93
日本	株式	HOYA	精密機器	214,000	18,590.00	3,978,260,000	18,470.00	3,952,580,000	0.92
日本	株式	KDDI	情報・通信業	842,700	5,070.00	4,272,489,000	4,400.00	3,707,880,000	0.86
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,222,300	2,208.50	2,699,449,550	2,773.00	3,389,437,900	0.79
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,737,700	1,990.50	3,458,891,850	1,911.00	3,320,744,700	0.77
日本	株式	住友商事	卸売業	696,200	3,384.00	2,355,940,800	4,155.00	2,892,711,000	0.67
日本	株式	村田製作所	電気機器	989,300	3,051.00	3,018,354,300	2,903.50	2,872,432,550	0.67
日本	株式	ダイキン工業	機械	131,100	24,560.00	3,219,816,000	21,745.00	2,850,769,500	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	650,600	3,801.00	2,472,930,600	4,245.00	2,761,797,000	0.64
日本	株式	S M C	機械	32,900	85,390.00	2,809,331,000	83,520.00	2,747,808,000	0.64
日本	株式	三菱重工業	機械	1,920,000	949.30	1,822,656,000	1,417.50	2,721,600,000	0.63

(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	2.05
		食料品	3.09
		繊維製品	0.35
		パルプ・紙	0.15
		化学	5.47
		医薬品	4.26
		石油・石炭製品	0.51
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.70
		鉄鋼	0.89
		非鉄金属	0.76
		金属製品	0.50
		機械	5.44
		電気機器	16.96
		輸送用機器	9.10
		精密機器	2.15
		その他製品	2.16
		電気・ガス業	1.43
陸運業	2.37		

	海運業	0.75
	空運業	0.38
	倉庫・運輸関連業	0.13
	情報・通信業	6.79
	卸売業	7.74
	小売業	3.98
	銀行業	7.42
	証券、商品先物取引業	0.90
	保険業	2.72
	その他金融業	1.13
	不動産業	2.08
	サービス業	4.23
	小計	97.72
合計		97.72

(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	346円		9,491,692,100	9,504,620,000	2.21

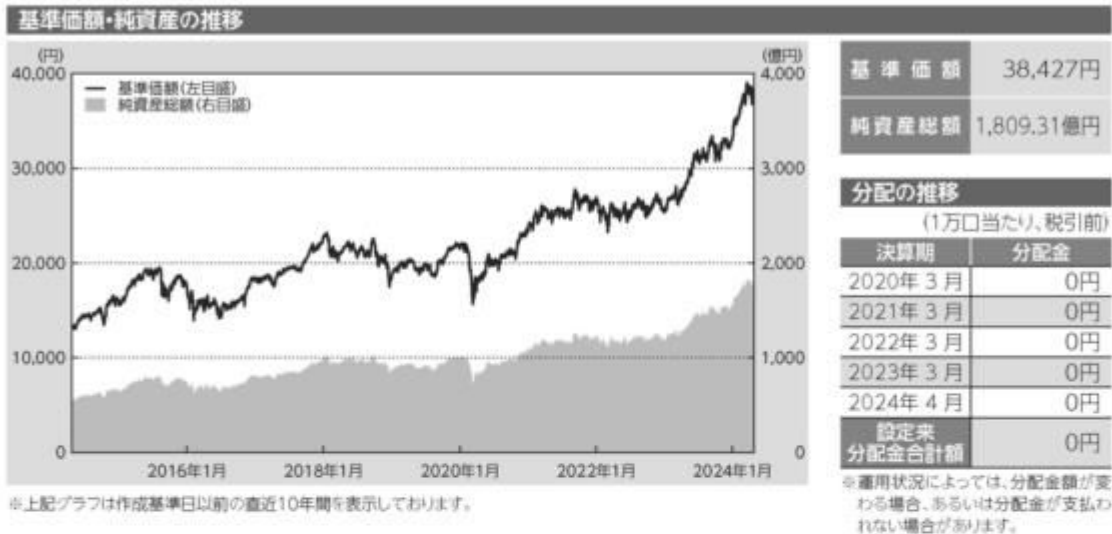
(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

(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

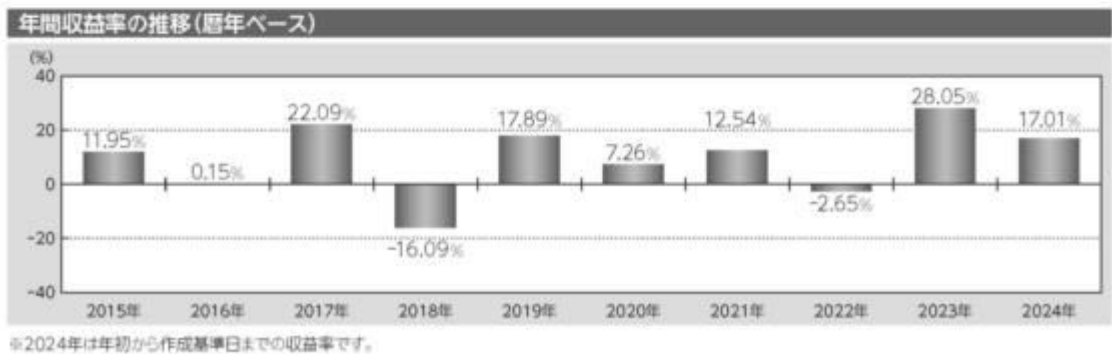

運用実績

 当初設定日：2002年4月1日
 作成基準日：2024年4月30日


主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	5.0%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	2.4%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.3%
東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	1.9%
三菱商事	日本	株式	卸売業	1.9%
日立製作所	日本	株式	電気機器	1.8%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.8%
三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.6%
三井物産	日本	株式	卸売業	1.5%
信越化学工業	日本	株式	化学	1.4%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。



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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

< 申込手続 >

当ファンドは確定拠出年金制度のための専用ファンドです。従って、確定拠出年金法第8条第1項に規定する事業主による資産管理契約の相手方及び同法第55条に規定する個人型年金に係る規約を作

成した国民年金基金連合会（同法第61条に基づいて事務を委託された者を含みます。）による取得の申込みのみの取扱いとなります。

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

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

2024年11月5日受付分からは、お申込みの受付は、原則として、営業日の午後3時半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受付分とします。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。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委

託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載又は記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載又は記録を行います。受託会社は、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

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

2024年11月5日受付分からは、一部解約の実行の請求の受付は、原則として、営業日の午後3時半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。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。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

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

なお、確定拠出年金制度の加入者等が一部解約金の支払を受ける日は確定拠出年金制度の定めに拠

ることとなります。

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。

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

< 一部解約の制限 >

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

< その他 >

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3 【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

< 基準価額の算出方法 >

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

< 基準価額の算出頻度 >

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

< 主要な投資対象資産の評価方法 >

親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2002年 4月 1日設定）

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

（4）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年4月1日から翌年3月31日までとすることを原則とします。

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

（5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、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30億口を下回るようになった場合
- ・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、販売会社を経由して受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

別して管理することがあります。

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第22期計算期間(2023年4月1日から2024年4月1日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DC日本株式インデックスファンドL】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第21期 (2023年 3月31日現在)	第22期 (2024年 4月 1日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	1,299,572
コール・ローン	303,645,319	512,771,777
親投資信託受益証券	127,824,244,236	179,062,547,177
未収入金	39,052,833	-
未収利息	-	925
流動資産合計	128,166,942,388	179,576,619,451
資産合計	128,166,942,388	179,576,619,451
負債の部		
流動負債		
未払解約金	152,260,384	259,400,288
未払受託者報酬	20,074,231	26,519,781
未払委託者報酬	107,062,509	137,018,782
未払利息	460	-
流動負債合計	279,397,584	422,938,851
負債合計	279,397,584	422,938,851
純資産の部		
元本等		
元本	46,531,596,351	47,003,495,720
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	81,355,948,453	132,150,184,880
(分配準備積立金)	36,052,091,550	76,773,572,033
元本等合計	127,887,544,804	179,153,680,600
純資産合計	127,887,544,804	179,153,680,600
負債純資産合計	128,166,942,388	179,576,619,451

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第21期		第22期	
	自	2022年 4月 1日	自	2023年 4月 1日
	至	2023年 3月31日	至	2024年 4月 1日
営業収益				
受取利息		1,007		12,233
有価証券売買等損益		7,093,029,887		49,812,310,230
営業収益合計		7,093,030,894		49,812,322,463
営業費用				
支払利息		98,377		137,499
受託者報酬		39,623,686		49,800,329
委託者報酬		211,326,210		259,146,506
その他費用		-		8
営業費用合計		251,048,273		309,084,342
営業利益又は営業損失（ ）		6,841,982,621		49,503,238,121
経常利益又は経常損失（ ）		6,841,982,621		49,503,238,121
当期純利益又は当期純損失（ ）		6,841,982,621		49,503,238,121
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（ ）		32,534,723		3,401,774,419
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		73,678,888,717		81,355,948,453
剰余金増加額又は欠損金減少額		10,666,299,827		18,089,302,285
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		10,666,299,827		18,089,302,285
剰余金減少額又は欠損金増加額		9,798,687,989		13,396,529,560
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		9,798,687,989		13,396,529,560
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		81,355,948,453		132,150,184,880

(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4月1日から翌年3月31日までとなっておりますが、当計算期間末日が休業日のため、第22期計算期間は2023年4月1日から2024年4月1日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第21期 (2023年3月31日現在)	第22期 (2024年4月1日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	46,531,596,351口	47,003,495,720口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.7484円 (27,484円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.8115円 (38,115円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第21期 自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日			第22期 自 2023年 4月 1日 至 2024年 4月 1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	3,169,452,338円	費用控除後の配当等収益額	A	3,633,803,219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	3,080,443,379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	42,467,660,483円
収益調整金額	C	75,497,658,316円	収益調整金額	C	82,084,229,175円
分配準備積立金額	D	29,802,195,833円	分配準備積立金額	D	30,672,108,331円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	111,549,749,866円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	158,857,801,208円
当ファンドの期末残存口数	F	46,531,596,351口	当ファンドの期末残存口数	F	47,003,495,720口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	23,972円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	33,797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22期 自 2023年 4月 1日 至 2024年 4月 1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22期 (2024年4月1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22期 (2024年 4月 1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21期 自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日	第22期 自 2023年 4月 1日 至 2024年 4月 1日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	45,974,658,316円	46,531,596,351円
期中追加設定元本額	6,699,246,631円	8,031,898,429円
期中一部解約元本額	6,142,308,596円	7,559,999,060円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第21期 (2023年 3月31日現在)	第22期 (2024年 4月 1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	7,127,262,026	48,824,625,899
合計	7,127,262,026	48,824,625,899

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	54,680,595,834	179,062,547,177	
合計		54,680,595,834	179,062,547,177	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2024年 4月 1日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	11,043,677
コール・ローン	4,357,499,467
株式	418,075,149,440
派生商品評価勘定	23,477,150
未収入金	132,851,700
未収配当金	4,168,647,566
未収利息	7,864
前払金	73,393,300
差入委託証拠金	302,541,311
流動資産合計	427,144,611,475
資産合計	427,144,611,475
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	97,046,450
未払解約金	95,918,697
流動負債合計	192,965,147
負債合計	192,965,147
純資産の部	
元本等	
元本	130,378,713,604
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	296,572,932,724
元本等合計	426,951,646,328
純資産合計	426,951,646,328
負債純資産合計	427,144,611,475

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 4月 1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）

	2024年 4月 1日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	130,378,713,604口
2. 1口当たり純資産額	3.2747円

	2024年 4月 1日現在	
計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	(1万口当たり純資産額)	(32,747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

	2024年 4月 1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、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、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。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

	2024年 4月 1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	2024年 4月 1日現在
投資信託財産に係る元本の状況		
期首		2023年 4月 1日
期首元本額		135,863,616,097円
期中追加設定元本額		8,502,256,997円
期中一部解約元本額		13,987,159,490円
期末元本額		130,378,713,604円
期末元本額の内訳		
日本株式インデックスファンド		565,767,608円
DC日本株式インデックスファンド		270,170,036円
DC日本株式インデックスファンドL		54,680,595,834円

区分	2024年 4月 1日現在
DC日本株式インデックスファンドA	649,915,555円
DCバランスファンド30	1,916,033,174円
DCバランスファンド50	3,290,087,412円
DCバランスファンド70	2,213,502,283円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	478,376,444円
日本株式インデックスe	1,327,816,226円
インデックスコレクション（国内株式）	24,023,707,927円
インデックスコレクション（バランス株式30）	10,493,809,112円
インデックスコレクション（バランス株式50）	3,429,966,618円
インデックスコレクション（バランス株式70）	3,634,500,713円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,990,191,526円
日本株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	2,645,941,354円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	578,647,315円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	20,764,411円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	293,205,975円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	40,302,763円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	97,260,772円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	25,421,283円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	361,591,155円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	280,177,221円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	5,037,060,641円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	518,037,294円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	35,315,314円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	768,099,952円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	13,039,193円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	101,322,535円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,317,339,274円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	30,750,992円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	34,512,045円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	10,542,127円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	321,483,261円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	168,016,288円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	2,569,573,710円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	53,414,181円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	17,763,685円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	5,660,620円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	66,370,496円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	2,659,279円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 4月 1日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	27,108,984,596
合計	27,108,984,596

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

(2024年 4月 1日現在)

区分	種類	契約額等(円)	時価	評価損益 (円)
			(円)	
市場取引	株価指数先物取引 買建	8,791,793,300	うち1年超	73,393,300
			-	
合計		8,791,793,300	-	73,393,300

(注)1. 時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,800	3,670.00	21,286,000	
ニッスイ	152,400	941.60	143,499,840	
マルハニチロ	22,600	2,989.50	67,562,700	
雪国まいたけ	13,000	1,026.00	13,338,000	
カネコ種苗	4,600	1,425.00	6,555,000	
サカタのタネ	17,300	3,730.00	64,529,000	
ホクト	12,200	1,857.00	22,655,400	
ホクリヨウ	1,100	1,038.00	1,141,800	
住石ホールディングス	15,100	1,341.00	20,249,100	
日鉄鉱業	6,100	4,815.00	29,371,500	
三井松島ホールディングス	9,000	2,915.00	26,235,000	
I N P E X	512,000	2,279.00	1,166,848,000	
石油資源開発	17,700	6,660.00	117,882,000	
K & O エナジーグループ	6,900	3,105.00	21,424,500	
ショーボンドホールディングス	20,800	6,444.00	134,035,200	
ミライト・ワン	46,100	1,908.50	87,981,850	
タマホーム	9,600	4,550.00	43,680,000	
サンヨーホームズ	800	740.00	592,000	
日本アクア	2,800	1,055.00	2,954,000	
ファーストコーポレーション	2,000	841.00	1,682,000	
ベステラ	1,600	998.00	1,596,800	
キャンディル	1,200	593.00	711,600	
ダイセキ環境ソリューション	1,400	1,005.00	1,407,000	
第一カッター興業	3,900	1,575.00	6,142,500	
安藤・間	88,300	1,182.00	104,370,600	
東急建設	46,300	834.00	38,614,200	
コムシスホールディングス	48,700	3,501.00	170,498,700	
ビーアールホールディングス	22,300	370.00	8,251,000	
高松コンストラクショングループ	11,300	2,771.00	31,312,300	
東建コーポレーション	4,200	10,350.00	43,470,000	
ソネック	700	935.00	654,500	
ヤマウラ	7,700	1,404.00	10,810,800	

オリエンタル白石	56,400	399.00	22,503,600
大成建設	99,800	5,594.00	558,281,200
大林組	381,400	1,792.00	683,468,800
清水建設	302,400	983.20	297,319,680
飛鳥建設	11,000	1,442.00	15,862,000
長谷工コーポレーション	97,800	1,874.00	183,277,200
松井建設	9,900	892.00	8,830,800
銭高組	700	4,170.00	2,919,000
鹿島建設	236,400	3,073.00	726,457,200
不動テトラ	7,400	2,039.00	15,088,600
大末建設	1,900	1,600.00	3,040,000
鉄建建設	7,600	2,643.00	20,086,800
西松建設	20,300	4,414.00	89,604,200
三井住友建設	79,400	420.00	33,348,000
大豊建設	3,700	3,420.00	12,654,000
佐田建設	3,000	754.00	2,262,000
ナカノフドー建設	3,400	603.00	2,050,200
奥村組	17,300	5,040.00	87,192,000
東鉄工業	13,200	3,005.00	39,666,000
イチケン	1,200	2,440.00	2,928,000
富士ピー・エス	2,200	453.00	996,600
浅沼組	7,900	3,850.00	30,415,000
戸田建設	144,300	1,004.00	144,877,200
熊谷組	17,600	4,125.00	72,600,000
北野建設	900	3,600.00	3,240,000
植木組	1,300	1,610.00	2,093,000
矢作建設工業	14,500	1,514.00	21,953,000
ピーエス三菱	13,500	1,023.00	13,810,500
日本ハウスホールディングス	22,800	353.00	8,048,400
新日本建設	15,000	1,566.00	23,490,000
東亜道路工業	21,000	1,251.00	26,271,000
日本道路	11,500	1,898.00	21,827,000
東亜建設工業	32,800	1,173.00	38,474,400
日本国土開発	30,300	537.00	16,271,100
若築建設	3,700	3,555.00	13,153,500
東洋建設	26,900	1,287.00	34,620,300
五洋建設	151,200	775.10	117,195,120
世紀東急工業	13,700	1,809.00	24,783,300
福田組	4,000	5,600.00	22,400,000
住友林業	92,200	4,880.00	449,936,000
日本基礎技術	2,900	489.00	1,418,100
巴コーポレーション	6,000	713.00	4,278,000

大和ハウス工業	294,900	4,424.00	1,304,637,600
ライト工業	21,900	2,053.00	44,960,700
積水ハウス	323,400	3,482.00	1,126,078,800
日特建設	10,200	1,162.00	11,852,400
北陸電気工事	7,300	1,274.00	9,300,200
ユアテック	23,500	1,464.00	34,404,000
日本リーテック	8,300	1,341.00	11,130,300
四電工	4,500	3,930.00	17,685,000
中電工	16,500	3,120.00	51,480,000
関電工	66,800	1,705.00	113,894,000
きんでん	75,100	2,673.50	200,779,850
東京エネシス	10,600	1,213.00	12,857,800
トーエネック	3,500	5,690.00	19,915,000
住友電設	10,100	3,370.00	34,037,000
日本電設工業	20,000	2,093.00	41,860,000
エクシオグループ	104,200	1,618.50	168,647,700
新日本空調	6,400	3,355.00	21,472,000
九電工	23,100	6,182.00	142,804,200
三機工業	23,000	2,111.00	48,553,000
日揮ホールディングス	105,500	1,487.00	156,878,500
中外炉工業	3,500	2,960.00	10,360,000
ヤマト	3,900	1,090.00	4,251,000
太平電業	6,600	4,530.00	29,898,000
高砂熱学工業	28,600	4,685.00	133,991,000
三晃金属工業	600	5,030.00	3,018,000
朝日工業社	9,400	1,611.00	15,143,400
明星工業	19,300	1,285.00	24,800,500
大気社	12,300	4,530.00	55,719,000
ダイダン	14,000	2,423.00	33,922,000
日比谷総合設備	7,700	2,908.00	22,391,600
フィル・カンパニー	1,600	902.00	1,443,200
テスホールディングス	23,000	473.00	10,879,000
インフロニア・ホールディングス	122,900	1,454.00	178,696,600
東洋エンジニアリング	15,700	937.00	14,710,900
レイズネクスト	15,400	2,109.00	32,478,600
ニッポン	32,000	2,400.00	76,800,000
日清製粉グループ本社	99,000	2,095.50	207,454,500
日東富士製粉	1,900	5,260.00	9,994,000
昭和産業	9,800	3,490.00	34,202,000
鳥越製粉	4,200	701.00	2,944,200
中部飼料	14,800	1,152.00	17,049,600
フィード・ワン	15,600	964.00	15,038,400

東洋精糖	900	2,421.00	2,178,900
日本甜菜製糖	6,200	2,041.00	12,654,200
D M三井製糖ホールディングス	10,600	3,110.00	32,966,000
塩水港精糖	6,300	294.00	1,852,200
ウェルネオシュガー	5,300	2,286.00	12,115,800
森永製菓	45,800	2,631.50	120,522,700
中村屋	2,700	3,095.00	8,356,500
江崎グリコ	30,600	4,348.00	133,048,800
名糖産業	4,200	1,775.00	7,455,000
井村屋グループ	6,000	2,501.00	15,006,000
不二家	7,300	2,502.00	18,264,600
山崎製パン	71,700	3,838.00	275,184,600
第一屋製パン	900	665.00	598,500
モロゾフ	3,500	4,140.00	14,490,000
亀田製菓	6,100	4,240.00	25,864,000
寿スピリッツ	50,600	1,912.50	96,772,500
カルビー	49,000	3,446.00	168,854,000
森永乳業	37,400	3,121.00	116,725,400
六甲バター	7,900	1,400.00	11,060,000
ヤクルト本社	153,000	3,106.00	475,218,000
明治ホールディングス	131,300	3,420.00	449,046,000
雪印メグミルク	25,900	2,651.00	68,660,900
プリマハム	14,400	2,298.00	33,091,200
日本ハム	46,000	5,016.00	230,736,000
林兼産業	1,600	570.00	912,000
丸大食品	10,800	1,632.00	17,625,600
S Foods	11,800	3,355.00	39,589,000
柿安本店	4,200	3,185.00	13,377,000
伊藤ハム米久ホールディングス	16,400	4,030.00	66,092,000
サッポロホールディングス	35,200	6,039.00	212,572,800
アサヒグループホールディングス	247,400	5,561.00	1,375,791,400
キリンホールディングス	446,000	2,103.00	937,938,000
宝ホールディングス	73,100	1,058.00	77,339,800
オエノンホールディングス	32,000	355.00	11,360,000
養命酒製造	3,500	1,895.00	6,632,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	83,900	2,180.00	182,902,000
ライフドリンク カンパニー	1,600	5,000.00	8,000,000
サントリー食品インターナショナル	75,400	5,140.00	387,556,000
ダイドーグループホールディングス	12,100	2,710.00	32,791,000
伊藤園	36,300	3,702.00	134,382,600
キーコーヒー	12,000	2,008.00	24,096,000
ユニカフェ	1,600	915.00	1,464,000

ジャパンフーズ	700	1,398.00	978,600
日清オイリオグループ	15,100	5,090.00	76,859,000
不二製油グループ本社	24,900	2,400.00	59,760,000
かどや製油	600	3,770.00	2,262,000
J・オイルミルズ	11,800	1,957.00	23,092,600
キッコーマン	354,500	1,940.00	687,730,000
味の素	254,400	5,632.00	1,432,780,800
ブルドックソース	5,700	2,062.00	11,753,400
キューピー	57,500	2,823.50	162,351,250
ハウス食品グループ本社	36,900	3,117.00	115,017,300
カゴメ	46,000	3,669.00	168,774,000
アリアケジャパン	10,700	5,180.00	55,426,000
ピエトロ	700	1,813.00	1,269,100
エバラ食品工業	2,700	2,866.00	7,738,200
やまみ	600	3,485.00	2,091,000
ニチレイ	49,100	4,070.00	199,837,000
東洋水産	54,100	8,965.00	485,006,500
イトアンドホールディングス	5,000	2,044.00	10,220,000
大冷	700	1,916.00	1,341,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,900	1,351.00	6,619,900
日清食品ホールディングス	112,900	4,201.00	474,292,900
永谷園ホールディングス	5,300	2,243.00	11,887,900
一正蒲鉾	2,000	755.00	1,510,000
フジッコ	11,000	1,911.00	21,021,000
ロック・フィールド	12,000	1,712.00	20,544,000
日本たばこ産業	650,600	4,080.00	2,654,448,000
ケンコーマヨネーズ	7,400	1,962.00	14,518,800
わらべや日洋ホールディングス	7,200	2,742.00	19,742,400
なとり	6,700	2,100.00	14,070,000
イフジ産業	900	1,518.00	1,366,200
ファーマフーズ	15,400	924.00	14,229,600
ユーグレナ	66,600	605.00	40,293,000
紀文食品	8,700	1,238.00	10,770,600
ピククルスホールディングス	6,300	1,163.00	7,326,900
ミヨシ油脂	1,800	1,273.00	2,291,400
理研ビタミン	9,300	2,590.00	24,087,000
片倉工業	10,300	1,858.00	19,137,400
ゲンゼ	7,800	5,410.00	42,198,000
東洋紡	47,500	1,107.00	52,582,500
ユニチカ	37,500	172.00	6,450,000
富士紡ホールディングス	4,600	4,400.00	20,240,000
倉敷紡績	7,800	3,425.00	26,715,000

シキボウ	4,400	1,115.00	4,906,000
日本毛織	28,200	1,452.00	40,946,400
トーア紡コーポレーション	1,900	445.00	845,500
帝国繊維	12,500	2,301.00	28,762,500
帝人	105,000	1,408.50	147,892,500
東レ	730,300	714.90	522,091,470
住江織物	1,000	2,674.00	2,674,000
日本フェルト	3,400	434.00	1,475,600
イチカワ	800	1,882.00	1,505,600
日東製網	500	1,853.00	926,500
アツギ	3,500	559.00	1,956,500
ダイニック	1,500	753.00	1,129,500
セーレン	21,200	2,688.00	56,985,600
ソトー	1,600	710.00	1,136,000
東海染工	600	820.00	492,000
小松マテーレ	15,900	766.00	12,179,400
ワコールホールディングス	22,300	3,667.00	81,774,100
ホギメディカル	14,400	3,725.00	53,640,000
T S Iホールディングス	35,500	790.00	28,045,000
マツオカコーポレーション	1,500	1,561.00	2,341,500
ワールド	15,100	2,134.00	32,223,400
三陽商会	3,600	2,803.00	10,090,800
ナイガイ	1,800	261.00	469,800
オンワードホールディングス	64,300	573.00	36,843,900
ルックホールディングス	2,700	2,680.00	7,236,000
ゴールドウイン	19,300	9,733.00	187,846,900
デサント	18,800	3,425.00	64,390,000
キング	2,300	717.00	1,649,100
ヤマトインターナショナル	4,000	313.00	1,252,000
特種東海製紙	5,900	3,960.00	23,364,000
王子ホールディングス	453,700	636.10	288,598,570
日本製紙	61,400	1,175.00	72,145,000
三菱製紙	6,500	623.00	4,049,500
北越コーポレーション	53,500	1,911.00	102,238,500
中越パルプ工業	2,000	1,894.00	3,788,000
大王製紙	48,100	1,165.00	56,036,500
阿波製紙	1,300	510.00	663,000
レンゴー	99,200	1,142.50	113,336,000
トーモク	6,300	2,585.00	16,285,500
ザ・パック	8,100	3,860.00	31,266,000
北の達人コーポレーション	45,900	202.00	9,271,800
クラレ	158,700	1,607.00	255,030,900

旭化成	736,800	1,078.50	794,638,800
共和レザー	2,800	799.00	2,237,200
巴川コーポレーション	1,400	890.00	1,246,000
レゾナック・ホールディングス	105,300	3,390.00	356,967,000
住友化学	808,200	335.40	271,070,280
住友精化	5,000	5,000.00	25,000,000
日産化学	51,200	5,780.00	295,936,000
ラサ工業	4,200	2,721.00	11,428,200
クレハ	23,800	2,729.00	64,950,200
多木化学	4,200	3,790.00	15,918,000
テイカ	7,800	1,539.00	12,004,200
石原産業	18,100	1,704.00	30,842,400
片倉コープアグリ	1,200	1,084.00	1,300,800
日本曹達	12,900	5,970.00	77,013,000
東ソー	145,400	2,032.00	295,452,800
トクヤマ	35,200	2,670.50	94,001,600
セントラル硝子	11,600	2,843.00	32,978,800
東亜合成	52,400	1,582.00	82,896,800
大阪ソーダ	7,600	9,540.00	72,504,000
関東電化工業	21,100	978.00	20,635,800
デンカ	39,600	2,340.50	92,683,800
信越化学工業	976,700	6,352.00	6,203,998,400
日本カーバイド工業	3,400	1,789.00	6,082,600
堺化学工業	8,300	1,913.00	15,877,900
第一稀元素化学工業	10,600	950.00	10,070,000
エア・ウォーター	102,800	2,309.50	237,416,600
日本酸素ホールディングス	105,700	4,578.00	483,894,600
日本化学工業	3,800	2,400.00	9,120,000
東邦アセチレン	5,100	387.00	1,973,700
日本パーカライズニング	48,500	1,214.00	58,879,000
高压ガス工業	15,800	873.00	13,793,400
チタン工業	600	1,067.00	640,200
四国化成ホールディングス	13,900	1,735.00	24,116,500
戸田工業	2,500	2,250.00	5,625,000
ステラ ケミファ	5,900	3,600.00	21,240,000
保土谷化学工業	3,300	3,580.00	11,814,000
日本触媒	63,600	1,450.00	92,220,000
大日精化工業	7,600	2,882.00	21,903,200
カネカ	27,600	3,787.00	104,521,200
三菱瓦斯化学	79,500	2,534.50	201,492,750
三井化学	89,800	4,152.00	372,849,600
J S R	119,000	4,337.00	516,103,000

東京応化工業	52,000	4,378.00	227,656,000
大阪有機化学工業	9,100	3,130.00	28,483,000
三菱ケミカルグループ	796,200	890.20	708,777,240
KHネオケム	16,600	2,328.00	38,644,800
ダイセル	140,000	1,431.00	200,340,000
住友ベークライト	30,400	4,494.00	136,617,600
積水化学工業	218,800	2,223.50	486,501,800
日本ゼオン	74,700	1,312.00	98,006,400
アイカ工業	27,500	3,704.00	101,860,000
UBE	51,800	2,650.00	137,270,000
積水樹脂	15,700	2,390.00	37,523,000
タキロンシーアイ	25,600	675.00	17,280,000
旭有機材	7,200	5,280.00	38,016,000
ニチバン	5,900	1,975.00	11,652,500
リケンテクノス	23,500	983.00	23,100,500
大倉工業	5,000	3,135.00	15,675,000
積水化成成品工業	15,300	493.00	7,542,900
群栄化学工業	2,600	3,780.00	9,828,000
タイガースポリマー	2,200	1,090.00	2,398,000
ミライアル	1,600	1,508.00	2,412,800
ダイキアクシス	2,000	768.00	1,536,000
ダイキョーニシカワ	24,000	763.00	18,312,000
竹本容器	1,800	810.00	1,458,000
森六ホールディングス	5,700	2,576.00	14,683,200
恵和	7,800	1,138.00	8,876,400
日本化薬	83,200	1,303.50	108,451,200
カーリットホールディングス	10,600	1,120.00	11,872,000
日本精化	6,500	2,517.00	16,360,500
扶桑化学工業	11,600	4,480.00	51,968,000
トリケミカル研究所	13,200	4,525.00	59,730,000
ADEKA	38,000	3,157.00	119,966,000
日油	98,700	2,027.00	200,064,900
新日本理化	6,700	187.00	1,252,900
ハリマ化成グループ	5,800	915.00	5,307,000
花王	246,300	5,763.00	1,419,426,900
第一工業製薬	4,200	3,445.00	14,469,000
石原ケミカル	4,900	1,821.00	8,922,900
日華化学	1,900	947.00	1,799,300
ニイタカ	1,000	2,004.00	2,004,000
三洋化成工業	6,700	4,280.00	28,676,000
有機合成薬品工業	3,900	309.00	1,205,100
大日本塗料	12,100	1,183.00	14,314,300

日本ペイントホールディングス	578,300	1,081.50	625,431,450
関西ペイント	106,700	2,177.50	232,339,250
神東塗料	4,000	130.00	520,000
中国塗料	22,400	2,210.00	49,504,000
日本特殊塗料	3,500	1,465.00	5,127,500
藤倉化成	12,500	475.00	5,937,500
太陽ホールディングス	19,000	3,300.00	62,700,000
D I C	42,600	2,848.50	121,346,100
サカタインクス	24,200	1,525.00	36,905,000
a r t i e n c e	23,700	2,881.00	68,279,700
富士フィルムホールディングス	606,900	3,281.00	1,991,238,900
資生堂	227,700	4,174.00	950,419,800
ライオン	142,700	1,373.50	195,998,450
高砂香料工業	7,700	3,425.00	26,372,500
マンダム	23,600	1,340.00	31,624,000
ミルボン	14,800	3,250.00	48,100,000
ファンケル	47,700	2,028.50	96,759,450
コーセー	22,200	8,155.00	181,041,000
コタ	11,000	1,485.00	16,335,000
シーボン	700	1,464.00	1,024,800
ポーラ・オルビスホールディングス	55,900	1,464.50	81,865,550
ノエビアホールディングス	9,700	5,280.00	51,216,000
アジュバンホールディングス	1,200	902.00	1,082,400
新日本製薬	6,200	1,654.00	10,254,800
I - n e	2,200	1,868.00	4,109,600
アクシージア	5,400	827.00	4,465,800
エステー	8,400	1,542.00	12,952,800
アグロ カネショウ	4,400	1,223.00	5,381,200
コニシ	34,100	1,540.00	52,514,000
長谷川香料	20,800	3,005.00	62,504,000
小林製薬	31,800	4,969.00	158,014,200
荒川化学工業	9,200	1,139.00	10,478,800
メック	9,000	3,930.00	35,370,000
日本高純度化学	2,500	3,030.00	7,575,000
タカラバイオ	29,400	966.00	28,400,400
J C U	12,200	3,870.00	47,214,000
新田ゼラチン	3,300	720.00	2,376,000
O A T アグリオ	3,200	2,041.00	6,531,200
デクセリアルズ	27,400	6,383.00	174,894,200
アース製薬	9,900	4,320.00	42,768,000
北興化学工業	11,000	1,293.00	14,223,000
大成ラミック	3,300	2,979.00	9,830,700

クミアイ化学工業	43,300	830.00	35,939,000
日本農薬	20,000	803.00	16,060,000
アキレス	6,900	1,543.00	10,646,700
有沢製作所	18,500	1,134.00	20,979,000
日東電工	70,000	13,620.00	953,400,000
レック	14,000	1,188.00	16,632,000
三光合成	13,700	755.00	10,343,500
きもと	8,000	227.00	1,816,000
藤森工業	8,600	4,305.00	37,023,000
前澤化成工業	7,000	1,719.00	12,033,000
未来工業	3,900	4,220.00	16,458,000
ウェーブロックホールディングス	1,800	683.00	1,229,400
JSP	7,700	2,249.00	17,317,300
エフピコ	20,600	2,770.50	57,072,300
天馬	7,900	2,230.00	17,617,000
信越ポリマー	23,500	1,516.00	35,626,000
東リ	10,800	402.00	4,341,600
ニフコ	32,600	3,785.00	123,391,000
バルカー	9,100	5,060.00	46,046,000
ユニ・チャーム	227,200	4,852.00	1,102,374,400
ショーエイコーポレーション	1,500	590.00	885,000
協和キリン	131,700	2,633.00	346,766,100
武田薬品工業	965,100	4,159.00	4,013,850,900
アステラス製薬	956,500	1,641.00	1,569,616,500
住友ファーマ	80,900	406.00	32,845,400
塩野義製薬	137,500	7,598.00	1,044,725,000
わかもと製薬	5,100	231.00	1,178,100
日本新薬	28,600	4,417.00	126,326,200
中外製薬	341,400	5,694.00	1,943,931,600
科研製薬	18,700	3,467.00	64,832,900
エーザイ	132,600	6,079.00	806,075,400
ロート製薬	105,600	3,004.00	317,222,400
小野薬品工業	231,400	2,468.50	571,210,900
久光製薬	24,200	3,915.00	94,743,000
持田製薬	12,500	3,200.00	40,000,000
参天製薬	198,700	1,420.00	282,154,000
扶桑薬品工業	3,700	2,164.00	8,006,800
日本ケミファ	600	1,649.00	989,400
ツムラ	34,300	3,834.00	131,506,200
キッセイ薬品工業	18,000	3,465.00	62,370,000
生化学工業	18,500	759.00	14,041,500
栄研化学	20,000	1,984.00	39,680,000

鳥居薬品	5,900	4,110.00	24,249,000
JCRファーマ	36,900	840.00	30,996,000
東和薬品	16,800	2,830.00	47,544,000
富士製薬工業	8,100	1,635.00	13,243,500
ゼリア新薬工業	15,100	2,126.00	32,102,600
ネクセラファーマ	35,400	1,638.00	57,985,200
第一三共	950,000	4,667.00	4,433,650,000
杏林製薬	23,600	1,804.00	42,574,400
大幸薬品	22,600	383.00	8,655,800
ダイト	8,300	2,327.00	19,314,100
大塚ホールディングス	226,800	6,333.00	1,436,324,400
ペプチドリーム	52,900	1,426.00	75,435,400
セルソース	3,000	1,438.00	4,314,000
あすか製薬ホールディングス	11,200	2,160.00	24,192,000
サワイグループホールディングス	24,900	5,836.00	145,316,400
日本コークス工業	110,600	131.00	14,488,600
ニチレキ	13,500	2,432.00	32,832,000
ユシロ化学工業	5,700	2,098.00	11,958,600
ビーピー・カストロール	1,900	992.00	1,884,800
富士石油	29,100	454.00	13,211,400
MORESCO	1,700	1,397.00	2,374,900
出光興産	605,600	1,012.00	612,867,200
ENEOSホールディングス	1,726,400	697.80	1,204,681,920
コスモエネルギーホールディングス	32,300	7,344.00	237,211,200
横浜ゴム	55,200	3,863.00	213,237,600
TOYO TIRE	62,700	2,762.50	173,208,750
ブリヂストン	319,200	6,738.00	2,150,769,600
住友ゴム工業	107,000	1,819.50	194,686,500
藤倉コンポジット	7,400	1,397.00	10,337,800
オカモト	5,200	4,925.00	25,610,000
フコク	5,700	1,806.00	10,294,200
ニッタ	11,100	3,965.00	44,011,500
住友理工	16,900	1,303.00	22,020,700
三ツ星ベルト	13,300	4,575.00	60,847,500
バンドー化学	16,200	1,849.00	29,953,800
日東紡績	13,800	5,730.00	79,074,000
AGC	97,300	5,459.00	531,160,700
日本板硝子	52,000	522.00	27,144,000
石塚硝子	900	2,942.00	2,647,800
日本山村硝子	1,900	1,725.00	3,277,500
日本電気硝子	44,500	3,784.00	168,388,000
オハラ	5,300	1,344.00	7,123,200

住友大阪セメント	18,200	3,812.00	69,378,400
太平洋セメント	64,500	3,437.00	221,686,500
日本ヒューム	9,700	844.00	8,186,800
日本コンクリート工業	21,400	405.00	8,667,000
三谷セキサン	4,600	6,100.00	28,060,000
アジアパイルホールディングス	15,600	828.00	12,916,800
東海カーボン	100,700	988.40	99,531,880
日本カーボン	5,800	5,270.00	30,566,000
東洋炭素	7,700	7,950.00	61,215,000
ノリタケカンパニーリミテド	12,000	4,070.00	48,840,000
TOTO	72,000	4,221.00	303,912,000
日本碍子	126,900	2,008.50	254,878,650
日本特殊陶業	91,300	4,884.00	445,909,200
MARUWA	4,000	32,000.00	128,000,000
品川リフラクトリーズ	13,500	1,877.00	25,339,500
黒崎播磨	8,800	3,380.00	29,744,000
ヨータイ	6,300	1,460.00	9,198,000
東京窯業	5,400	463.00	2,500,200
ニッカトー	2,400	593.00	1,423,200
フジインコーポレーテッド	29,300	3,415.00	100,059,500
クニミネ工業	1,500	1,078.00	1,617,000
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,358.00	1,493,800
ニチアス	27,600	3,995.00	110,262,000
ニチハ	13,700	3,520.00	48,224,000
日本製鉄	502,300	3,614.00	1,815,312,200
神戸製鋼所	225,600	1,986.00	448,041,600
中山製鋼所	25,700	933.00	23,978,100
合同製鐵	6,300	5,590.00	35,217,000
JFEホールディングス	312,000	2,466.50	769,548,000
東京製鐵	31,500	1,627.00	51,250,500
共英製鋼	12,800	2,387.00	30,553,600
大和工業	21,100	8,286.00	174,834,600
東京鐵鋼	5,000	5,080.00	25,400,000
大阪製鐵	5,200	2,196.00	11,419,200
淀川製鋼所	12,800	4,470.00	57,216,000
中部鋼鈹	7,400	2,560.00	18,944,000
丸一鋼管	34,200	3,988.00	136,389,600
モリ工業	1,700	6,380.00	10,846,000
大同特殊鋼	70,700	1,714.00	121,179,800
日本高周波鋼業	1,900	525.00	997,500
日本冶金工業	8,200	4,675.00	38,335,000
山陽特殊製鋼	11,100	2,202.00	24,442,200

愛知製鋼	6,500	3,885.00	25,252,500
日本金属	1,300	852.00	1,107,600
大太平洋金属	9,600	1,335.00	12,816,000
新日本電工	55,900	322.00	17,999,800
栗本鐵工所	5,200	3,975.00	20,670,000
虹技	700	1,401.00	980,700
三菱製鋼	7,900	1,444.00	11,407,600
日亜鋼業	5,100	329.00	1,677,900
日本精線	8,000	1,330.00	10,640,000
エンビプロ・ホールディングス	6,100	537.00	3,275,700
シンニッタン	6,300	277.00	1,745,100
新家工業	1,100	3,660.00	4,026,000
大紀アルミニウム工業所	14,200	1,235.00	17,537,000
日本軽金属ホールディングス	32,800	1,787.00	58,613,600
三井金属鉱業	32,700	4,514.00	147,607,800
東邦亜鉛	7,200	1,143.00	8,229,600
三菱マテリアル	80,200	2,829.00	226,885,800
住友金属鉱山	130,100	4,592.00	597,419,200
D O W Aホールディングス	27,700	5,267.00	145,895,900
古河機械金属	14,800	1,779.00	26,329,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	19,500	2,525.00	49,237,500
東邦チタニウム	23,200	1,560.00	36,192,000
U A C J	15,700	4,185.00	65,704,500
C Kサンエツ	2,700	3,960.00	10,692,000
古河電気工業	37,400	3,067.00	114,705,800
住友電気工業	419,700	2,277.50	955,866,750
フジクラ	132,300	2,179.50	288,347,850
S W C C	12,500	3,765.00	47,062,500
タツタ電線	20,100	712.00	14,311,200
カナレ電気	900	1,734.00	1,560,600
平河ヒューテック	6,800	1,322.00	8,989,600
リョービ	12,000	2,879.00	34,548,000
アーレスティ	5,600	827.00	4,631,200
A R Eホールディングス	42,200	1,928.00	81,361,600
稲葉製作所	5,500	1,789.00	9,839,500
宮地エンジニアリンググループ	5,600	4,220.00	23,632,000
トーカロ	31,000	1,771.00	54,901,000
アルファC o	1,800	1,618.00	2,912,400
S U M C O	199,300	2,363.00	470,945,900
川田テクノロジーズ	7,800	3,340.00	26,052,000
R S Technologies	7,500	3,105.00	23,287,500
ジェイテックコーポレーション	800	2,109.00	1,687,200

信和	3,200	750.00	2,400,000
東洋製罐グループホールディングス	64,400	2,441.00	157,200,400
ホッカンホールディングス	5,500	1,935.00	10,642,500
コロナ	6,300	974.00	6,136,200
横河ブリッジホールディングス	17,600	2,939.00	51,726,400
駒井ハルテック	900	2,090.00	1,881,000
高田機工	400	3,675.00	1,470,000
三和ホールディングス	112,700	2,642.00	297,753,400
文化シャッター	29,400	1,707.00	50,185,800
三協立山	12,900	933.00	12,035,700
アルインコ	8,600	1,030.00	8,858,000
東洋シャッター	1,100	702.00	772,200
L I X I L	175,200	1,853.00	324,645,600
日本フィルコン	3,200	571.00	1,827,200
ノーリツ	18,600	1,740.00	32,364,000
長府製作所	11,100	2,204.00	24,464,400
リンナイ	53,700	3,449.00	185,211,300
ダイニチ工業	2,500	702.00	1,755,000
日東精工	16,300	633.00	10,317,900
三洋工業	600	3,250.00	1,950,000
岡部	20,000	788.00	15,760,000
ジーテクト	13,400	2,075.00	27,805,000
東プレ	19,800	2,540.00	50,292,000
高周波熱錬	17,300	1,078.00	18,649,400
東京製綱	7,300	1,407.00	10,271,100
サンコール	7,500	485.00	3,637,500
モリテック スチール	4,400	255.00	1,122,000
パイオラックス	13,900	2,663.00	37,015,700
エイチワン	11,500	700.00	8,050,000
日本発條	99,200	1,465.00	145,328,000
中央発條	8,300	1,035.00	8,590,500
アドバネクス	600	1,395.00	837,000
立川ブラインド工業	5,100	1,466.00	7,476,600
三益半導体工業	8,700	2,990.00	26,013,000
日本ドライケミカル	1,200	2,656.00	3,187,200
日本製綱所	30,300	3,350.00	101,505,000
三浦工業	45,900	3,009.00	138,113,100
タクマ	37,100	1,887.00	70,007,700
ツガミ	24,400	1,190.00	29,036,000
オークマ	9,600	7,118.00	68,332,800
芝浦機械	11,000	3,595.00	39,545,000
アマダ	175,200	1,688.00	295,737,600

アイダエンジニアリング	24,200	882.00	21,344,400
F U J I	51,700	2,667.50	137,909,750
牧野フライス製作所	12,200	6,190.00	75,518,000
オーエスジー	48,400	2,168.50	104,955,400
ダイジェット工業	600	841.00	504,600
旭ダイヤモンド工業	25,400	957.00	24,307,800
D M G 森精機	66,600	3,967.00	264,202,200
ソディック	26,800	722.00	19,349,600
ディスコ	52,900	55,820.00	2,952,878,000
日東工器	5,300	1,981.00	10,499,300
日進工具	9,600	978.00	9,388,800
パンチ工業	4,900	456.00	2,234,400
富士ダイス	4,300	675.00	2,902,500
豊和工業	2,700	820.00	2,214,000
リケンNPR	11,900	3,020.00	35,938,000
東洋機械金属	4,100	768.00	3,148,800
エンシュウ	1,200	686.00	823,200
島精機製作所	17,500	1,400.00	24,500,000
オプトラン	18,100	2,012.00	36,417,200
NCホールディングス	1,200	1,654.00	1,984,800
イワキポンプ	7,300	2,712.00	19,797,600
フリー	10,400	1,261.00	13,114,400
ヤマシンフィルタ	26,400	470.00	12,408,000
日阪製作所	11,200	1,008.00	11,289,600
やまびこ	18,000	1,951.00	35,118,000
野村マイクロ・サイエンス	14,800	5,750.00	85,100,000
平田機工	5,300	7,650.00	40,545,000
P E G A S U S	12,200	520.00	6,344,000
マルマエ	4,800	1,891.00	9,076,800
タツモ	6,600	3,875.00	25,575,000
ナプテスコ	68,900	2,643.50	182,137,150
三井海洋開発	13,900	2,958.00	41,116,200
レオン自動機	12,300	1,531.00	18,831,300
S M C	32,900	86,770.00	2,854,733,000
ホソカワミクロン	7,000	4,660.00	32,620,000
ユニオンツール	4,800	4,415.00	21,192,000
瑞光	7,900	1,341.00	10,593,900
オイレス工業	14,900	2,253.00	33,569,700
日精エー・エス・ビー機械	4,400	5,100.00	22,440,000
サトーホールディングス	15,600	2,315.00	36,114,000
技研製作所	10,300	2,084.00	21,465,200
日本エアーテック	5,200	1,199.00	6,234,800

カワタ	1,600	1,029.00	1,646,400
日精樹脂工業	8,200	1,155.00	9,471,000
オカダアイヨン	1,600	3,115.00	4,984,000
ワイエイシイホールディングス	3,600	2,483.00	8,938,800
小松製作所	514,700	4,445.00	2,287,841,500
住友重機械工業	65,000	4,606.00	299,390,000
日立建機	43,700	4,587.00	200,451,900
日工	16,300	753.00	12,273,900
巴工業	4,300	4,380.00	18,834,000
井関農機	10,300	1,031.00	10,619,300
TOWA	12,200	10,210.00	124,562,000
丸山製作所	800	2,471.00	1,976,800
北川鉄工所	4,300	1,642.00	7,060,600
ローツェ	5,700	21,100.00	120,270,000
タカキタ	1,700	495.00	841,500
クボタ	574,100	2,385.00	1,369,228,500
荏原実業	5,800	3,475.00	20,155,000
三菱化工機	3,900	4,000.00	15,600,000
月島ホールディングス	14,900	1,408.00	20,979,200
帝国電機製作所	7,700	2,522.00	19,419,400
新東工業	22,200	1,225.00	27,195,000
澁谷工業	10,300	3,540.00	36,462,000
アイチ コーポレーション	15,300	1,077.00	16,478,100
小森コーポレーション	27,100	1,217.00	32,980,700
鶴見製作所	8,400	3,670.00	30,828,000
日本ギア工業	1,900	614.00	1,166,600
酒井重工業	1,400	6,510.00	9,114,000
荏原製作所	45,100	13,395.00	604,114,500
石井鐵工所	600	2,821.00	1,692,600
西島製作所	9,500	2,740.00	26,030,000
北越工業	11,100	1,964.00	21,800,400
ダイキン工業	131,100	21,010.00	2,754,411,000
オルガノ	13,200	7,400.00	97,680,000
トーヨーカネツ	3,700	4,325.00	16,002,500
栗田工業	61,400	6,218.00	381,785,200
楢本チエイン	15,600	5,050.00	78,780,000
大同工業	2,200	770.00	1,694,000
木村化工機	8,400	706.00	5,930,400
アネスト岩田	17,000	1,343.00	22,831,000
ダイフク	185,300	3,508.00	650,032,400
サムコ	2,900	4,805.00	13,934,500
加藤製作所	2,500	1,530.00	3,825,000

油研工業	800	2,250.00	1,800,000
タダノ	63,200	1,288.00	81,401,600
フジテック	25,700	3,787.00	97,325,900
C K D	30,400	3,000.00	91,200,000
平和	32,500	1,999.00	64,967,500
理想科学工業	8,800	3,075.00	27,060,000
S A N K Y O	105,800	1,641.00	173,617,800
日本金銭機械	13,300	1,363.00	18,127,900
マースグループホールディングス	5,600	3,200.00	17,920,000
フクシマガリレイ	7,200	5,970.00	42,984,000
オーイズミ	1,900	414.00	786,600
ダイコク電機	5,400	3,645.00	19,683,000
竹内製作所	19,900	6,010.00	119,599,000
アマノ	31,200	3,802.00	118,622,400
J U K I	17,100	573.00	9,798,300
ジャノメ	11,200	681.00	7,627,200
マックス	15,500	3,185.00	49,367,500
グローリー	26,400	2,869.00	75,741,600
新晃工業	11,100	3,755.00	41,680,500
大和冷機工業	16,800	1,607.00	26,997,600
セガサミーホールディングス	98,100	2,026.50	198,799,650
T P R	13,400	2,376.00	31,838,400
ツバキ・ナカシマ	22,000	853.00	18,766,000
ホシザキ	64,800	5,658.00	366,638,400
大豊工業	9,500	911.00	8,654,500
日本精工	203,300	876.30	178,151,790
N T N	238,200	306.50	73,008,300
ジェイテクト	97,700	1,365.50	133,409,350
不二越	8,100	3,455.00	27,985,500
日本トムソン	29,200	633.00	18,483,600
T H K	63,400	3,613.00	229,064,200
ユーシン精機	8,700	682.00	5,933,400
前澤給装工業	7,900	1,277.00	10,088,300
イーグル工業	12,200	1,782.00	21,740,400
前澤工業	3,100	1,126.00	3,490,600
日本ピラー工業	10,200	6,110.00	62,322,000
キッツ	36,800	1,323.00	48,686,400
マキタ	125,200	4,233.00	529,971,600
三井E & S	54,500	1,951.00	106,329,500
日立造船	96,900	1,281.00	124,128,900
三菱重工業	1,920,000	1,382.00	2,653,440,000
I H I	81,800	4,023.00	329,081,400

スター精密	20,200	1,828.00	36,925,600
日清紡ホールディングス	82,600	1,191.00	98,376,600
イビデン	57,300	6,506.00	372,793,800
コニカミノルタ	245,600	499.60	122,701,760
ブラザー工業	146,800	2,800.50	411,113,400
ミネベアミツミ	191,100	2,933.50	560,591,850
日立製作所	527,800	13,390.00	7,067,242,000
三菱電機	1,222,300	2,470.50	3,019,692,150
富士電機	66,800	10,065.00	672,342,000
東洋電機製造	1,700	1,198.00	2,036,600
安川電機	119,300	6,496.00	774,972,800
シンフォニアテクノロジー	12,100	3,125.00	37,812,500
明電舎	20,400	2,869.00	58,527,600
オリジン	1,100	1,223.00	1,345,300
山洋電気	4,800	6,990.00	33,552,000
デンヨー	8,400	2,294.00	19,269,600
PHCホールディングス	20,600	1,236.00	25,461,600
KOKUSAI ELECTRIC	42,500	4,125.00	175,312,500
ソシオネクスト	79,800	4,092.00	326,541,600
東芝テック	14,100	3,070.00	43,287,000
芝浦メカトロニクス	6,300	6,130.00	38,619,000
マブチモーター	54,100	2,715.50	146,908,550
ニデック	242,500	6,183.00	1,499,377,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,300	368.00	2,686,400
トレックス・セミコンダクター	5,700	1,814.00	10,339,800
東光高岳	6,700	2,527.00	16,930,900
ダブル・スコープ	31,400	564.00	17,709,600
ダイヘン	11,000	9,080.00	99,880,000
ヤーマン	19,200	1,005.00	19,296,000
JVCケンウッド	86,800	926.00	80,376,800
ミマキエンジニアリング	10,600	1,142.00	12,105,200
I-PEX	7,700	1,775.00	13,667,500
大崎電気工業	24,000	672.00	16,128,000
オムロン	83,900	5,618.00	471,350,200
日東工業	14,800	4,040.00	59,792,000
I D E C	16,200	2,687.00	43,529,400
正興電機製作所	1,800	1,290.00	2,322,000
不二電機工業	1,100	1,121.00	1,233,100
ジーエス・ユアサ コーポレーション	42,900	3,054.00	131,016,600
サクサホールディングス	1,100	3,030.00	3,333,000
メルコホールディングス	2,900	3,610.00	10,469,000
テクノメディカ	2,800	1,752.00	4,905,600

日本電気	144,200	10,655.00	1,536,451,000
富士通	1,011,000	2,464.00	2,491,104,000
沖電気工業	49,600	1,117.00	55,403,200
岩崎通信機	2,300	686.00	1,577,800
電気興業	4,700	2,103.00	9,884,100
サンケン電気	10,200	6,711.00	68,452,200
ナカヨ	800	1,154.00	923,200
アイホン	5,900	2,981.00	17,587,900
ルネサスエレクトロニクス	685,000	2,633.50	1,803,947,500
セイコーエプソン	140,900	2,643.50	372,469,150
ワコム	83,700	662.00	55,409,400
アルバック	24,100	9,679.00	233,263,900
アクセル	3,500	1,935.00	6,772,500
E I Z O	8,000	5,240.00	41,920,000
日本信号	25,000	1,024.00	25,600,000
京三製作所	23,000	507.00	11,661,000
能美防災	14,900	2,369.00	35,298,100
ホーチキ	8,300	2,173.00	18,035,900
星和電機	2,400	564.00	1,353,600
エレコム	26,300	1,535.00	40,370,500
パナソニック ホールディングス	1,297,300	1,397.00	1,812,328,100
シャープ	185,100	858.00	158,815,800
アンリツ	77,300	1,233.00	95,310,900
富士通ゼネラル	31,100	1,884.00	58,592,400
ソニーグループ	769,100	13,065.00	10,048,291,500
T D K	173,900	7,417.00	1,289,816,300
帝国通信工業	4,900	1,827.00	8,952,300
タムラ製作所	43,800	605.00	26,499,000
アルプスアルパイン	98,200	1,212.00	119,018,400
池上通信機	1,500	836.00	1,254,000
日本電波工業	13,300	1,307.00	17,383,100
鈴木	6,000	1,291.00	7,746,000
メイコー	10,900	5,240.00	57,116,000
日本トリム	2,500	3,760.00	9,400,000
ローランド ディー . ジー .	6,100	5,380.00	32,818,000
フォスター電機	8,100	1,251.00	10,133,100
S M K	2,600	2,568.00	6,676,800
ヨコオ	9,800	1,572.00	15,405,600
ホシデン	25,000	1,935.00	48,375,000
ヒロセ電機	16,200	15,515.00	251,343,000
日本航空電子工業	26,300	2,447.00	64,356,100
T O A	12,500	1,147.00	14,337,500

マクセル	23,800	1,562.00	37,175,600
古野電気	14,300	2,455.00	35,106,500
スミダコーポレーション	14,800	1,231.00	18,218,800
アイコム	4,200	3,315.00	13,923,000
リオン	4,600	2,989.00	13,749,400
横河電機	120,100	3,462.00	415,786,200
新電元工業	4,200	3,020.00	12,684,000
アズビル	74,800	4,340.00	324,632,000
東亜ディーケーケー	2,400	933.00	2,239,200
日本光電工業	46,700	4,000.00	186,800,000
チノー	4,500	2,567.00	11,551,500
共和電業	4,500	425.00	1,912,500
日本電子材料	6,700	2,642.00	17,701,400
堀場製作所	20,800	15,300.00	318,240,000
アドバンテスト	311,500	6,481.00	2,018,831,500
小野測器	2,200	689.00	1,515,800
エスベック	8,800	2,990.00	26,312,000
キーエンス	108,800	69,950.00	7,610,560,000
日置電機	5,200	7,230.00	37,596,000
シスメックス	281,400	2,688.50	756,543,900
日本マイクロニクス	19,500	8,090.00	157,755,000
メガチップス	8,600	3,835.00	32,981,000
O B A R A G R O U P	6,000	3,855.00	23,130,000
澤藤電機	700	1,241.00	868,700
原田工業	2,300	725.00	1,667,500
コーセル	11,700	1,507.00	17,631,900
イリソ電子工業	10,000	2,986.00	29,860,000
オブテックスグループ	20,000	1,932.00	38,640,000
千代田インテグレ	4,300	2,774.00	11,928,200
レーザーテック	49,800	41,000.00	2,041,800,000
スタンレー電気	69,700	2,772.50	193,243,250
ウシオ電機	55,300	1,912.50	105,761,250
岡谷電機産業	4,200	271.00	1,138,200
ヘリオス テクノ ホールディング	5,100	516.00	2,631,600
エノモト	1,400	1,602.00	2,242,800
日本セラミック	8,900	2,700.00	24,030,000
遠藤照明	2,300	1,487.00	3,420,100
古河電池	8,200	1,021.00	8,372,200
双信電機	2,400	479.00	1,149,600
山一電機	9,800	2,455.00	24,059,000
図研	9,500	4,420.00	41,990,000
日本電子	27,300	6,162.00	168,222,600

カシオ計算機	78,600	1,360.00	106,896,000
ファナック	530,200	4,303.00	2,281,450,600
日本シイエムケイ	23,400	604.00	14,133,600
エンプラス	3,200	7,410.00	23,712,000
大真空	16,400	782.00	12,824,800
ローム	201,100	2,426.00	487,868,600
浜松ホトニクス	87,300	5,371.00	468,888,300
三井ハイテック	9,600	8,474.00	81,350,400
新光電気工業	38,500	5,610.00	215,985,000
京セラ	675,600	2,004.00	1,353,902,400
太陽誘電	53,000	3,653.00	193,609,000
村田製作所	989,300	2,855.50	2,824,946,150
双葉電子工業	21,000	510.00	10,710,000
北陸電気工業	1,900	1,390.00	2,641,000
ニチコン	28,700	1,273.00	36,535,100
日本ケミコン	11,700	1,432.00	16,754,400
K O A	16,600	1,449.00	24,053,400
市光工業	19,900	540.00	10,746,000
小糸製作所	112,700	2,502.00	281,975,400
ミツバ	20,400	1,546.00	31,538,400
S C R E E Nホールディングス	37,200	18,760.00	697,872,000
キャノン電子	12,100	2,350.00	28,435,000
キャノン	542,300	4,487.00	2,433,300,100
リコー	272,600	1,347.00	367,192,200
象印マホービン	29,600	1,470.00	43,512,000
M U T O Hホールディングス	700	2,224.00	1,556,800
東京エレクトロン	230,100	38,300.00	8,812,830,000
イノテック	7,300	1,971.00	14,388,300
トヨタ紡織	45,800	2,449.50	112,187,100
芦森工業	1,000	2,605.00	2,605,000
ユニプレス	19,600	1,126.00	22,069,600
豊田自動織機	92,700	14,120.00	1,308,924,000
モリタホールディングス	19,100	1,635.00	31,228,500
三櫻工業	16,600	1,133.00	18,807,800
デンソー	897,100	2,797.50	2,509,637,250
東海理化電機製作所	30,700	2,526.00	77,548,200
川崎重工業	88,800	4,773.00	423,842,400
名村造船所	23,800	1,940.00	46,172,000
日本車輛製造	3,800	2,361.00	8,971,800
三菱ロジスネクスト	17,400	1,798.00	31,285,200
近畿車輛	700	2,327.00	1,628,900
日産自動車	1,467,300	597.80	877,151,940

いすゞ自動車	316,100	2,048.00	647,372,800
トヨタ自動車	5,970,300	3,639.00	21,725,921,700
日野自動車	163,500	508.50	83,139,750
三菱自動車工業	424,200	494.10	209,597,220
エフテック	3,400	745.00	2,533,000
レシップホールディングス	2,100	619.00	1,299,900
G M B	1,000	1,123.00	1,123,000
ファルテック	1,000	568.00	568,000
武蔵精密工業	26,600	1,645.00	43,757,000
日産車体	11,800	1,025.00	12,095,000
新明和工業	31,300	1,226.00	38,373,800
極東開発工業	18,000	2,588.00	46,584,000
トピー工業	8,800	2,725.00	23,980,000
ティラド	2,400	3,760.00	9,024,000
曙ブレーキ工業	66,400	139.00	9,229,600
タチエス	20,100	1,946.00	39,114,600
N O K	42,300	2,047.50	86,609,250
フタバ産業	29,200	1,112.00	32,470,400
カヤバ	10,500	5,030.00	52,815,000
大同メタル工業	21,300	655.00	13,951,500
プレス工業	43,500	701.00	30,493,500
ミクニ	6,200	471.00	2,920,200
太平洋工業	25,000	1,659.00	41,475,000
アイシン	83,900	5,923.00	496,939,700
マツダ	359,600	1,722.50	619,411,000
今仙電機製作所	3,100	627.00	1,943,700
本田技研工業	2,577,900	1,850.50	4,770,403,950
スズキ	798,800	1,749.50	1,397,500,600
S U B A R U	337,200	3,369.00	1,136,026,800
安永	2,200	700.00	1,540,000
ヤマハ発動機	469,900	1,440.00	676,656,000
T B K	5,400	375.00	2,025,000
エクセディ	17,800	3,010.00	53,578,000
豊田合成	31,100	3,114.00	96,845,400
愛三工業	18,000	1,612.00	29,016,000
盟和産業	700	1,022.00	715,400
日本プラスト	4,200	540.00	2,268,000
ヨロズ	10,200	950.00	9,690,000
エフ・シー・シー	19,300	2,265.00	43,714,500
シマノ	43,900	22,465.00	986,213,500
テイ・エス テック	38,700	1,977.50	76,529,250
ジャムコ	4,600	1,215.00	5,589,000

テルモ	608,000	2,736.50	1,663,792,000
クリエートメディック	1,600	970.00	1,552,000
日機装	25,300	1,276.00	32,282,800
日本エム・ディ・エム	7,300	732.00	5,343,600
島津製作所	144,500	4,206.00	607,767,000
JMS	10,100	529.00	5,342,900
長野計器	7,900	2,321.00	18,335,900
ブイ・テクノロジー	5,700	2,473.00	14,096,100
東京計器	8,300	2,655.00	22,036,500
愛知時計電機	4,500	2,382.00	10,719,000
インターアクション	5,200	1,324.00	6,884,800
オーバル	4,300	560.00	2,408,000
東京精密	22,200	11,415.00	253,413,000
マニー	43,500	2,011.00	87,478,500
ニコン	157,200	1,559.00	245,074,800
トプコン	52,900	1,720.50	91,014,450
オリンパス	642,700	2,185.00	1,404,299,500
理研計器	15,400	3,760.00	57,904,000
タムロン	6,700	6,850.00	45,895,000
HOYA	214,000	18,830.00	4,029,620,000
シード	2,500	641.00	1,602,500
ノーリツ鋼機	10,300	3,220.00	33,166,000
A & Dホロンホールディングス	15,900	2,855.00	45,394,500
朝日インテック	132,500	2,591.00	343,307,500
シチズン時計	100,000	1,041.00	104,100,000
リズム	1,100	3,720.00	4,092,000
大研医器	4,200	555.00	2,331,000
メニコン	37,400	1,565.00	58,531,000
シンシア	600	511.00	306,600
松風	4,900	3,070.00	15,043,000
セイコーグループ	15,200	4,050.00	61,560,000
ニプロ	90,600	1,223.50	110,849,100
KYORITSU	7,200	182.00	1,310,400
中本パックス	1,600	1,660.00	2,656,000
スノーピーク	15,600	1,247.00	19,453,200
パラマウントベッドホールディングス	22,600	2,613.00	59,053,800
トランザクション	7,200	2,224.00	16,012,800
粧美堂	1,300	595.00	773,500
ニホンフラッシュ	10,200	947.00	9,659,400
前田工織	9,200	3,540.00	32,568,000
永大産業	5,700	283.00	1,613,100
アートネイチャー	10,100	770.00	7,777,000

フルヤ金属	2,600	11,290.00	29,354,000
バンダイナムコホールディングス	297,900	2,822.50	840,822,750
アイフィスジャパン	1,300	629.00	817,700
SHOEI	24,600	2,230.00	54,858,000
フランスベッドホールディングス	12,900	1,275.00	16,447,500
パイロットコーポレーション	15,300	3,998.00	61,169,400
萩原工業	7,300	1,641.00	11,979,300
フジシールインターナショナル	22,000	2,102.00	46,244,000
タカラトミー	49,500	2,709.00	134,095,500
広済堂ホールディングス	24,600	645.00	15,867,000
エステールホールディングス	1,100	653.00	718,300
タカノ	1,800	1,047.00	1,884,600
プロネクサス	9,400	1,191.00	11,195,400
ホクシン	3,700	125.00	462,500
ウッドワン	1,800	1,037.00	1,866,600
TOPPANホールディングス	133,700	3,772.00	504,316,400
大日本印刷	118,800	4,578.00	543,866,400
共同印刷	3,100	3,395.00	10,524,500
NISSHA	18,600	1,506.00	28,011,600
光村印刷	400	1,653.00	661,200
TAKARA & COMPANY	6,900	2,716.00	18,740,400
アシックス	92,600	6,985.00	646,811,000
ツツミ	1,900	2,073.00	3,938,700
ローランド	8,000	4,540.00	36,320,000
小松ウオール工業	4,200	3,110.00	13,062,000
ヤマハ	68,500	3,278.00	224,543,000
河合楽器製作所	3,200	3,570.00	11,424,000
クリナップ	10,700	770.00	8,239,000
ビジョン	69,200	1,475.00	102,070,000
キングジム	9,600	893.00	8,572,800
リンテック	21,800	3,070.00	66,926,000
イトーキ	22,300	1,742.00	38,846,600
任天堂	686,500	8,210.00	5,636,165,000
三菱鉛筆	15,400	2,475.00	38,115,000
タカラスタANDARD	22,900	1,915.00	43,853,500
コクヨ	44,500	2,507.00	111,561,500
ナカバヤシ	11,700	528.00	6,177,600
グローブライド	9,800	1,975.00	19,355,000
オカムラ	32,700	2,241.00	73,280,700
美津濃	10,800	6,320.00	68,256,000
東京電力ホールディングス	980,100	901.80	883,854,180
中部電力	400,700	1,944.00	778,960,800

関西電力	419,900	2,120.50	890,397,950
中国電力	188,900	1,120.00	211,568,000
北陸電力	111,200	788.90	87,725,680
東北電力	286,300	1,160.50	332,251,150
四国電力	101,300	1,175.50	119,078,150
九州電力	250,600	1,328.00	332,796,800
北海道電力	105,000	837.40	87,927,000
沖縄電力	27,800	1,148.00	31,914,400
電源開発	89,300	2,449.00	218,695,700
エフオン	7,100	422.00	2,996,200
イーレックス	19,300	734.00	14,166,200
レノバ	29,000	1,238.00	35,902,000
東京瓦斯	211,800	3,413.00	722,873,400
大阪瓦斯	220,200	3,332.00	733,706,400
東邦瓦斯	47,100	3,366.00	158,538,600
北海道瓦斯	6,500	2,513.00	16,334,500
広島ガス	23,000	380.00	8,740,000
西部ガスホールディングス	11,200	1,890.00	21,168,000
静岡ガス	21,700	943.00	20,463,100
メタウォーター	13,000	2,265.00	29,445,000
SBSホールディングス	9,700	2,624.00	25,452,800
東武鉄道	119,400	3,723.00	444,526,200
相鉄ホールディングス	38,900	2,771.50	107,811,350
東急	304,900	1,846.50	562,997,850
京浜急行電鉄	134,500	1,382.50	185,946,250
小田急電鉄	179,800	2,067.50	371,736,500
京王電鉄	52,300	4,156.00	217,358,800
京成電鉄	70,100	6,264.00	439,106,400
富士急行	13,400	3,910.00	52,394,000
東日本旅客鉄道	599,400	2,891.50	1,733,165,100
西日本旅客鉄道	258,000	3,102.00	800,316,000
東海旅客鉄道	418,800	3,685.00	1,543,278,000
西武ホールディングス	131,500	2,373.00	312,049,500
鴻池運輸	18,500	2,155.00	39,867,500
西日本鉄道	29,000	2,503.50	72,601,500
ハマキョウレックス	8,800	3,835.00	33,748,000
サカイ引越センター	12,000	2,544.00	30,528,000
近鉄グループホールディングス	108,500	4,444.00	482,174,000
阪急阪神ホールディングス	144,700	4,368.00	632,049,600
南海電気鉄道	48,400	3,141.00	152,024,400
京阪ホールディングス	59,800	3,389.00	202,662,200
神戸電鉄	3,000	2,733.00	8,199,000

名古屋鉄道	112,000	2,158.50	241,752,000
山陽電気鉄道	8,200	2,092.00	17,154,400
アルプス物流	8,700	2,928.00	25,473,600
ヤマトホールディングス	139,000	2,159.50	300,170,500
山九	27,600	5,148.00	142,084,800
丸運	2,800	283.00	792,400
丸全昭和運輸	6,700	4,690.00	31,423,000
センコーグループホールディングス	57,500	1,155.00	66,412,500
トナミホールディングス	2,400	4,550.00	10,920,000
ニッコンホールディングス	34,700	2,931.00	101,705,700
日本石油輸送	500	2,899.00	1,449,500
福山通運	12,400	3,665.00	45,446,000
セイノーホールディングス	61,000	2,099.50	128,069,500
エスライングループ本社	1,400	884.00	1,237,600
神奈川中央交通	3,100	3,170.00	9,827,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	27,700	1,318.00	36,508,600
C & F ロジホールディングス	10,400	3,065.00	31,876,000
九州旅客鉄道	76,800	3,489.00	267,955,200
S Gホールディングス	182,300	1,897.50	345,914,250
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	36,800	7,699.00	283,323,200
日本郵船	311,300	4,047.00	1,259,831,100
商船三井	235,700	4,520.00	1,065,364,000
川崎汽船	261,900	2,003.00	524,585,700
N S ユナイテッド海運	6,000	4,485.00	26,910,000
飯野海運	40,300	1,176.00	47,392,800
共栄タンカー	1,400	1,073.00	1,502,200
乾汽船	13,300	1,027.00	13,659,100
日本航空	266,600	2,908.00	775,272,800
A N Aホールディングス	295,400	3,182.00	939,962,800
パスコ	900	1,850.00	1,665,000
トランコム	3,100	6,070.00	18,817,000
日新	8,200	2,845.00	23,329,000
三菱倉庫	26,700	4,879.00	130,269,300
三井倉庫ホールディングス	10,100	4,620.00	46,662,000
住友倉庫	29,300	2,543.00	74,509,900
澁澤倉庫	4,600	3,025.00	13,915,000
東陽倉庫	1,300	1,519.00	1,974,700
日本トランスシティ	21,800	669.00	14,584,200
ケイヒン	900	1,950.00	1,755,000
中央倉庫	5,400	1,143.00	6,172,200
川西倉庫	900	1,219.00	1,097,100
安田倉庫	7,400	1,211.00	8,961,400

ファイブホールディングス	700	1,245.00	871,500
東洋埠頭	1,400	1,383.00	1,936,200
上組	50,100	3,332.00	166,933,200
サンリツ	1,200	905.00	1,086,000
キムラユニティ	2,300	1,657.00	3,811,100
キューソー流通システム	4,200	1,157.00	4,859,400
東海運	2,800	292.00	817,600
エーアイティー	6,800	1,793.00	12,192,400
内外トランスライン	4,300	2,483.00	10,676,900
日本コンセプト	3,900	1,838.00	7,168,200
NEC ネットズエスアイ	42,500	2,483.00	105,527,500
クロスキャット	6,400	1,518.00	9,715,200
システナ	165,000	268.00	44,220,000
デジタルアーツ	6,900	4,365.00	30,118,500
日鉄ソリューションズ	18,600	4,990.00	92,814,000
キューブシステム	6,100	1,099.00	6,703,900
コア	4,800	1,871.00	8,980,800
手間いらず	1,800	3,195.00	5,751,000
ラクーンホールディングス	8,200	614.00	5,034,800
ソリトンシステムズ	5,600	1,301.00	7,285,600
ソフトクリエイイトホールディングス	9,000	1,866.00	16,794,000
T I S	119,300	3,271.00	390,230,300
テクミラホールディングス	2,300	469.00	1,078,700
グリー	29,400	482.00	14,170,800
GMOペパボ	1,400	1,323.00	1,852,200
コーエーテクモホールディングス	68,300	1,613.50	110,202,050
三菱総合研究所	5,300	4,940.00	26,182,000
電算	600	1,498.00	898,800
A G S	2,000	862.00	1,724,000
ファインデックス	8,700	1,155.00	10,048,500
ブレインパッド	8,200	1,315.00	10,783,000
K L a b	20,000	333.00	6,660,000
ポールトゥウィンホールディングス	18,600	497.00	9,244,200
ネクソン	239,400	2,520.00	603,288,000
アイスタイル	32,500	513.00	16,672,500
エムアップホールディングス	13,400	1,224.00	16,401,600
エイチーム	6,500	642.00	4,173,000
エニグモ	13,900	384.00	5,337,600
テクノスジャパン	4,300	601.00	2,584,300
コロプラ	42,300	622.00	26,310,600
ブロードリーフ	51,800	511.00	26,469,800
クロス・マーケティンググループ	2,300	551.00	1,267,300

デジタルハーツホールディングス	6,800	969.00	6,589,200
メディアドゥ	4,800	1,471.00	7,060,800
じげん	31,800	623.00	19,811,400
ブイキューブ	13,100	261.00	3,419,100
エンカレッジ・テクノロジー	1,100	643.00	707,300
サイバーリンクス	1,900	864.00	1,641,600
フィックスターズ	12,300	2,211.00	27,195,300
CARTA HOLDINGS	5,100	1,574.00	8,027,400
オブティム	9,900	1,034.00	10,236,600
セレス	4,400	1,779.00	7,827,600
SHIFT	7,200	23,355.00	168,156,000
ティーガイア	11,400	2,074.00	23,643,600
セック	1,200	4,960.00	5,952,000
テクマトリックス	19,900	1,796.00	35,740,400
プロシップ	4,900	1,433.00	7,021,700
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	28,400	2,421.50	68,770,600
GMOペイメントゲートウェイ	21,800	9,562.00	208,451,600
ザッパラス	1,100	493.00	542,300
システムリサーチ	7,000	1,556.00	10,892,000
インターネットイニシアティブ	52,100	2,819.50	146,895,950
さくらインターネット	12,200	5,340.00	65,148,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,300	3,200.00	10,560,000
SRAホールディングス	5,600	3,930.00	22,008,000
システムインテグレータ	1,500	410.00	615,000
朝日ネット	11,700	640.00	7,488,000
eBASE	15,400	722.00	11,118,800
アバントグループ	13,800	1,290.00	17,802,000
アドソル日進	4,600	1,643.00	7,557,800
ODKソリューションズ	1,000	662.00	662,000
フリービット	4,800	1,545.00	7,416,000
コムチュア	15,700	1,960.00	30,772,000
アステリア	8,600	673.00	5,787,800
アイル	5,100	2,990.00	15,249,000
マークライنز	5,900	3,310.00	19,529,000
メディカル・データ・ビジョン	13,000	615.00	7,995,000
gumi	16,200	403.00	6,528,600
ショーケース	1,200	352.00	422,400
モバイルファクトリー	1,000	731.00	731,000
テラスカイ	4,700	1,445.00	6,791,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,100	1,783.00	10,876,300
PCIホールディングス	1,800	951.00	1,711,800
アイビーシー	800	429.00	343,200

ネオジャパン	3,700	1,270.00	4,699,000
P R T I M E S	2,200	2,101.00	4,622,200
ラクス	51,600	2,036.50	105,083,400
ランドコンピュータ	2,400	840.00	2,016,000
ダブルスタンダード	3,300	1,821.00	6,009,300
オープンドア	6,400	790.00	5,056,000
アカツキ	5,200	2,603.00	13,535,600
ベネフィットジャパン	400	1,245.00	498,000
U b i c o mホールディングス	3,400	1,268.00	4,311,200
カナミックネットワーク	11,800	542.00	6,395,600
ノムラシステムコーポレーション	5,400	114.00	615,600
チェンジホールディングス	23,800	1,198.00	28,512,400
シンクロ・フード	3,100	610.00	1,891,000
オークネット	4,000	2,426.00	9,704,000
キャピタル・アセット・プランニング	1,000	785.00	785,000
セグエグループ	4,500	529.00	2,380,500
エイトレッド	700	1,428.00	999,600
マクロミル	21,400	790.00	16,906,000
ビーグリー	1,000	1,120.00	1,120,000
オロ	3,900	2,702.00	10,537,800
ユーザーローカル	4,000	2,247.00	8,988,000
テモナ	1,200	250.00	300,000
ニーズウェル	2,700	955.00	2,578,500
マネーフォワード	24,300	6,574.00	159,748,200
サインポスト	1,900	688.00	1,307,200
S u n A s t e r i s k	7,800	926.00	7,222,800
プラスアルファ・コンサルティング	6,400	2,317.00	14,828,800
電算システムホールディングス	4,800	2,756.00	13,228,800
A p p i e r G r o u p	37,300	1,539.00	57,404,700
ビジョナル	8,400	9,130.00	76,692,000
ソルクシーズ	4,000	340.00	1,360,000
フェイス	1,400	462.00	646,800
プロトコーポレーション	11,900	1,428.00	16,993,200
ハイマックス	3,400	1,410.00	4,794,000
野村総合研究所	241,600	4,206.00	1,016,169,600
C Eホールディングス	2,500	558.00	1,395,000
日本システム技術	6,800	1,813.00	12,328,400
インテージホールディングス	12,300	1,588.00	19,532,400
東邦システムサイエンス	3,300	1,228.00	4,052,400
ソースネクスト	50,000	221.00	11,050,000
インフォコム	14,100	2,741.00	38,648,100
シンプレクス・ホールディングス	16,500	2,781.00	45,886,500

HEROZ	3,700	1,647.00	6,093,900
ラクスル	26,300	1,058.00	27,825,400
メルカリ	53,100	1,915.00	101,686,500
I P S	3,100	2,440.00	7,564,000
F I G	5,700	341.00	1,943,700
システムサポート	4,200	2,037.00	8,555,400
イーソル	7,900	822.00	6,493,800
東海ソフト	800	1,275.00	1,020,000
ウイングアーク1st	11,300	2,978.00	33,651,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,900	1,154.00	3,346,600
サーバーワークス	2,200	3,600.00	7,920,000
東名	400	2,329.00	931,600
ヴィッツ	500	808.00	404,000
トピラシステムズ	1,400	801.00	1,121,400
S a n s a n	35,800	1,728.00	61,862,400
L i n k - Uグループ	1,200	662.00	794,400
ギフトィ	9,600	1,341.00	12,873,600
メドレー	14,600	4,835.00	70,591,000
ベース	3,800	3,605.00	13,699,000
J M D C	18,600	3,580.00	66,588,000
フォーカスシステムズ	7,300	1,276.00	9,314,800
クレスコ	8,700	2,110.00	18,357,000
フジ・メディア・ホールディングス	104,800	1,948.00	204,150,400
オービック	36,400	23,125.00	841,750,000
ジャストシステム	15,700	2,663.00	41,809,100
T D Cソフト	19,200	1,203.00	23,097,600
L I N Eヤフー	1,552,500	389.30	604,388,250
トレンドマイクロ	51,600	7,676.00	396,081,600
I Dホールディングス	7,400	1,529.00	11,314,600
日本オラクル	20,900	11,445.00	239,200,500
アルファシステムズ	2,900	3,220.00	9,338,000
フューチャー	23,300	1,711.00	39,866,300
C A C Holdings	5,900	1,955.00	11,534,500
S Bテクノロジー	4,600	2,100.00	9,660,000
トーセ	1,400	706.00	988,400
オービックビジネスコンサルタント	15,300	7,396.00	113,158,800
アイティフォー	14,000	1,376.00	19,264,000
東計電算	3,000	3,760.00	11,280,000
エクスネット	700	1,250.00	875,000
大塚商会	108,200	3,148.00	340,613,600
サイボウズ	15,000	1,738.00	26,070,000
電通総研	13,300	4,875.00	64,837,500

ACCESS	11,300	1,664.00	18,803,200
デジタルガレージ	17,400	3,215.00	55,941,000
EMシステムズ	18,200	691.00	12,576,200
ウェザーニューズ	3,400	5,130.00	17,442,000
C I J	27,150	584.00	15,855,600
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,665.00	6,597,000
日本エンタープライズ	5,100	132.00	673,200
WOWOW	8,200	1,129.00	9,257,800
スカラ	10,100	741.00	7,484,100
インテリジェント ウェイブ	2,600	1,181.00	3,070,600
ANYCOLOR	11,600	2,510.00	29,116,000
IMAGICA GROUP	10,900	668.00	7,281,200
ネットワンシステムズ	44,000	2,686.00	118,184,000
システムソフト	38,200	57.00	2,177,400
アルゴグラフィックス	10,000	4,280.00	42,800,000
マーベラス	17,700	692.00	12,248,400
エイベックス	18,600	1,250.00	23,250,000
B I P R O G Y	35,700	4,436.00	158,365,200
都築電気	5,700	2,288.00	13,041,600
T B S ホールディングス	54,800	4,331.00	237,338,800
日本テレビホールディングス	96,500	2,302.50	222,191,250
朝日放送グループホールディングス	10,200	650.00	6,630,000
テレビ朝日ホールディングス	26,500	2,140.00	56,710,000
スカパーJ S A Tホールディングス	84,700	1,004.00	85,038,800
テレビ東京ホールディングス	7,900	2,950.00	23,305,000
日本BS放送	1,800	909.00	1,636,200
ビジョン	16,400	1,148.00	18,827,200
スマートバリュー	1,400	413.00	578,200
U - N E X T H O L D I N G S	12,200	5,120.00	62,464,000
ワイヤレスゲート	2,200	211.00	464,200
日本通信	107,400	202.00	21,694,800
クロップス	600	1,122.00	673,200
日本電信電話	32,437,300	176.70	5,731,670,910
K D D I	842,700	4,453.00	3,752,543,100
ソフトバンク	1,755,300	1,931.50	3,390,361,950
光通信	11,000	27,695.00	304,645,000
エムティーアイ	7,500	733.00	5,497,500
G M O インターネットグループ	40,300	2,767.00	111,510,100
ファイバーゲート	5,900	1,141.00	6,731,900
アйдママーケティングコミュニケーション	1,400	234.00	327,600
K A D O K A W A	57,700	2,653.50	153,106,950
学研ホールディングス	18,200	935.00	17,017,000

ゼンリン	18,700	840.00	15,708,000
昭文社ホールディングス	2,100	385.00	808,500
インプレスホールディングス	5,000	172.00	860,000
アイネット	6,600	2,355.00	15,543,000
松竹	5,700	9,816.00	55,951,200
東宝	60,700	4,968.00	301,557,600
東映	18,000	3,715.00	66,870,000
NTTデータグループ	285,100	2,354.50	671,267,950
ピー・シー・エー	6,300	1,714.00	10,798,200
ビジネスブレイン太田昭和	4,300	2,130.00	9,159,000
D T S	23,000	4,045.00	93,035,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	49,800	5,723.00	285,005,400
シーイーシー	13,800	1,563.00	21,569,400
カプコン	195,000	2,800.00	546,000,000
アイ・エス・ビー	5,600	1,362.00	7,627,200
ジャステック	6,700	1,446.00	9,688,200
S C S K	76,300	2,828.00	215,776,400
N S W	4,400	3,080.00	13,552,000
アイネス	8,100	1,518.00	12,295,800
T K C	17,300	3,765.00	65,134,500
富士ソフト	21,900	6,000.00	131,400,000
N S D	38,900	2,970.00	115,533,000
コナミグループ	40,800	10,115.00	412,692,000
福井コンピュータホールディングス	6,700	2,587.00	17,332,900
J B C Cホールディングス	7,200	3,245.00	23,364,000
ミロク情報サービス	9,900	1,774.00	17,562,600
ソフトバンクグループ	537,900	8,830.00	4,749,657,000
リョーサン菱洋ホールディングス	21,592	3,500.00	75,572,000
高千穂交易	3,000	3,735.00	11,205,000
オルバヘルスケアホールディングス	900	2,056.00	1,850,400
伊藤忠食品	2,600	7,180.00	18,668,000
エレマテック	10,300	1,886.00	19,425,800
あらた	17,600	3,255.00	57,288,000
トーメンデバイス	1,700	6,440.00	10,948,000
東京エレクトロン デバイス	11,500	6,620.00	76,130,000
円谷フィールズホールディングス	19,800	1,700.00	33,660,000
双日	128,100	3,901.00	499,718,100
アルフレッサ ホールディングス	115,500	2,223.00	256,756,500
横浜冷凍	31,300	1,029.00	32,207,700
ラサ商事	4,000	1,980.00	7,920,000
アルコニックス	15,200	1,429.00	21,720,800
神戸物産	89,000	3,683.00	327,787,000

ハイパー	1,200	306.00	367,200
あい ホールディングス	18,400	2,442.00	44,932,800
ディーブイエックス	1,400	996.00	1,394,400
ダイワボウホールディングス	50,900	2,533.00	128,929,700
マクニカホールディングス	27,200	7,208.00	196,057,600
ラクト・ジャパン	4,500	2,393.00	10,768,500
グリムス	4,800	2,180.00	10,464,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	15,200	1,238.00	18,817,600
八洲電機	9,300	1,533.00	14,256,900
メディアスホールディングス	7,300	779.00	5,686,700
レスター	9,800	3,005.00	29,449,000
ジオリーブグループ	1,200	1,321.00	1,585,200
大光	2,700	637.00	1,719,900
OCHIホールディングス	1,200	1,649.00	1,978,800
TOKAIホールディングス	62,500	971.00	60,687,500
黒谷	1,400	610.00	854,000
Cominix	1,000	920.00	920,000
三洋貿易	13,000	1,415.00	18,395,000
ビューティガレージ	3,600	2,327.00	8,377,200
ウイン・パートナーズ	7,500	1,208.00	9,060,000
ミタチ産業	1,400	1,143.00	1,600,200
シップヘルスケアホールディングス	41,300	2,074.00	85,656,200
明治電機工業	4,300	1,575.00	6,772,500
デリカフーズホールディングス	2,200	606.00	1,333,200
スターティアホールディングス	1,300	1,494.00	1,942,200
コメダホールディングス	28,200	2,710.00	76,422,000
ピーバンドットコム	700	388.00	271,600
アセンテック	4,400	581.00	2,556,400
富士興産	1,400	1,840.00	2,576,000
協栄産業	500	2,790.00	1,395,000
フルサト・マルカホールディングス	10,200	2,159.00	22,021,800
ヤマエグループホールディングス	6,500	2,788.00	18,122,000
小野建	11,300	1,847.00	20,871,100
南陽	2,200	1,237.00	2,721,400
佐島電機	5,600	2,604.00	14,582,400
エコートレーディング	1,000	1,250.00	1,250,000
伯東	6,600	5,600.00	36,960,000
コンドーテック	8,900	1,280.00	11,392,000
中山福	2,800	365.00	1,022,000
ナガイレーベン	14,500	2,405.00	34,872,500
三菱食品	10,600	5,560.00	58,936,000
松田産業	8,800	2,517.00	22,149,600

第一興商	44,500	1,935.00	86,107,500
メディバルホールディングス	117,000	2,316.00	270,972,000
S P K	5,100	2,052.00	10,465,200
萩原電気ホールディングス	4,900	4,300.00	21,070,000
アズワン	36,000	2,605.00	93,780,000
スズデン	4,000	2,136.00	8,544,000
尾家産業	1,200	1,695.00	2,034,000
シモジマ	7,700	1,359.00	10,464,300
ドウシシャ	10,600	2,088.00	22,132,800
小津産業	1,100	1,805.00	1,985,500
高速	6,100	2,225.00	13,572,500
たけびし	4,400	2,049.00	9,015,600
リックス	1,600	4,170.00	6,672,000
丸文	10,300	1,504.00	15,491,200
ハピネット	9,800	2,900.00	28,420,000
橋本総業ホールディングス	4,600	1,363.00	6,269,800
日本ライフライン	33,700	1,199.00	40,406,300
タカショー	10,000	518.00	5,180,000
I D O M	30,400	1,014.00	30,825,600
進和	7,000	2,660.00	18,620,000
エスケイジャパン	1,300	775.00	1,007,500
ダイトロン	4,500	3,485.00	15,682,500
シークス	16,400	1,672.00	27,420,800
田中商事	1,500	912.00	1,368,000
オーハシテクニカ	5,800	1,617.00	9,378,600
白銅	3,200	2,486.00	7,955,200
ダイコー通産	500	1,365.00	682,500
伊藤忠商事	773,300	6,435.00	4,976,185,500
丸紅	954,800	2,553.50	2,438,081,800
高島	3,500	1,232.00	4,312,000
長瀬産業	52,700	2,542.50	133,989,750
蝶理	6,600	3,370.00	22,242,000
豊田通商	100,800	9,843.00	992,174,400
三共生興	16,000	744.00	11,904,000
兼松	48,100	2,526.00	121,500,600
ツカモトコーポレーション	800	1,271.00	1,016,800
三井物産	862,200	6,924.00	5,969,872,800
日本紙パルプ商事	5,500	5,180.00	28,490,000
カメイ	12,200	2,084.00	25,424,800
東都水産	300	6,530.00	1,959,000
O U Gホールディングス	800	2,530.00	2,024,000
スターゼン	7,900	2,801.00	22,127,900

山善	34,900	1,321.00	46,102,900
椿本興業	5,700	2,205.00	12,568,500
住友商事	696,200	3,559.00	2,477,775,800
内田洋行	4,700	6,940.00	32,618,000
三菱商事	2,208,900	3,422.00	7,558,855,800
第一実業	10,800	2,117.00	22,863,600
キャノンマーケティングジャパン	26,700	4,413.00	117,827,100
西華産業	4,500	3,630.00	16,335,000
佐藤商事	8,000	1,721.00	13,768,000
東京産業	10,500	701.00	7,360,500
ユアサ商事	9,000	5,350.00	48,150,000
神鋼商事	2,900	7,030.00	20,387,000
トルク	2,800	277.00	775,600
阪和興業	20,700	5,800.00	120,060,000
正栄食品工業	7,700	4,720.00	36,344,000
カナデン	8,000	1,487.00	11,896,000
RYODEN	9,300	2,721.00	25,305,300
岩谷産業	26,200	8,336.00	218,403,200
ナイス	1,600	1,785.00	2,856,000
ニチモウ	1,600	2,320.00	3,712,000
極東貿易	6,900	2,028.00	13,993,200
アステナホールディングス	21,600	488.00	10,540,800
三愛オブリ	27,700	2,009.00	55,649,300
稲畑産業	22,700	3,125.00	70,937,500
G S Iクレオス	6,200	2,352.00	14,582,400
明和産業	13,600	649.00	8,826,400
クワザワホールディングス	1,900	872.00	1,656,800
ワキタ	19,000	1,571.00	29,849,000
東邦ホールディングス	31,800	3,677.00	116,928,600
サンゲツ	26,500	3,355.00	88,907,500
ミツウロコグループホールディングス	14,700	1,403.00	20,624,100
シナネンホールディングス	3,200	4,705.00	15,056,000
伊藤忠エネクス	28,500	1,540.00	43,890,000
サンリオ	93,600	3,050.00	285,480,000
サンワテクノス	5,900	2,393.00	14,118,700
新光商事	15,500	1,181.00	18,305,500
トーヨー	4,500	3,075.00	13,837,500
三信電気	4,600	2,120.00	9,752,000
東陽テクニカ	11,700	1,529.00	17,889,300
モスフードサービス	16,900	3,410.00	57,629,000
加賀電子	10,500	6,290.00	66,045,000
ソーダニッカ	6,000	1,120.00	6,720,000

立花エレテック	7,600	3,140.00	23,864,000
フォーバル	4,500	1,265.00	5,692,500
PALTA C	15,500	4,179.00	64,774,500
三谷産業	20,100	403.00	8,100,300
西本Wismettacホールディングス	2,900	6,140.00	17,806,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	400	2,846.00	1,138,400
コア商事ホールディングス	6,500	865.00	5,622,500
KPPグループホールディングス	29,800	728.00	21,694,400
ヤマタネ	5,100	2,817.00	14,366,700
丸紅建材リース	400	2,968.00	1,187,200
泉州電業	5,400	4,900.00	26,460,000
トラスコ中山	24,200	2,509.00	60,717,800
オートバックスセブン	40,000	1,543.00	61,720,000
モリト	8,200	1,550.00	12,710,000
加藤産業	14,200	4,695.00	66,669,000
北恵	1,300	905.00	1,176,500
イエローハット	18,300	1,988.00	36,380,400
JKホールディングス	8,900	1,076.00	9,576,400
日伝	7,100	2,618.00	18,587,800
北沢産業	3,100	349.00	1,081,900
杉本商事	5,200	2,257.00	11,736,400
因幡電機産業	29,800	3,485.00	103,853,000
東テク	11,400	2,990.00	34,086,000
ミスミグループ本社	173,700	2,065.00	358,690,500
アルテック	2,800	305.00	854,000
タキヒヨー	1,200	1,245.00	1,494,000
蔵王産業	900	2,538.00	2,284,200
スズケン	43,800	4,570.00	200,166,000
ジェコス	6,900	1,149.00	7,928,100
ローソン	24,500	10,335.00	253,207,500
サンエー	8,800	4,665.00	41,052,000
カワチ薬品	9,100	2,626.00	23,896,600
エービーシー・マート	50,400	2,893.50	145,832,400
ハードオフコーポレーション	3,600	1,691.00	6,087,600
アスクル	27,900	2,250.00	62,775,000
ゲオホールディングス	13,000	1,895.00	24,635,000
アダストリア	14,000	3,835.00	53,690,000
くら寿司	13,500	4,845.00	65,407,500
キャンドウ	4,200	2,855.00	11,991,000
IKホールディングス	2,400	388.00	931,200
パルグループホールディングス	22,700	2,553.00	57,953,100
エディオン	45,700	1,548.00	70,743,600

サーラコーポレーション	24,500	841.00	20,604,500
ワッツ	2,800	747.00	2,091,600
ハローズ	5,300	4,450.00	23,585,000
あみやき亭	2,800	5,250.00	14,700,000
大黒天物産	3,600	9,280.00	33,408,000
ハニーズホールディングス	9,300	1,846.00	17,167,800
ファーマライズホールディングス	1,600	658.00	1,052,800
アルペン	9,600	2,019.00	19,382,400
ハブ	2,000	769.00	1,538,000
クオールホールディングス	16,000	1,742.00	27,872,000
ジーンズホールディングス	6,900	4,375.00	30,187,500
ビックカメラ	61,400	1,326.00	81,416,400
D C Mホールディングス	61,000	1,499.00	91,439,000
Monotaro	163,200	1,794.50	292,862,400
東京一番フーズ	1,700	512.00	870,400
きちりホールディングス	1,400	964.00	1,349,600
J.フロント リテイリング	132,200	1,646.00	217,601,200
ドトール・日レスホールディングス	20,500	2,065.00	42,332,500
マツキヨココカラ&カンパニー	209,400	2,399.50	502,455,300
ブロンコビリー	6,800	3,700.00	25,160,000
Z O Z O	73,400	3,849.00	282,516,600
トレジャー・ファクトリー	5,800	1,550.00	8,990,000
物語コーポレーション	19,300	4,655.00	89,841,500
三越伊勢丹ホールディングス	193,900	2,426.00	470,401,400
Hamee	4,300	1,316.00	5,658,800
マーケットエンタープライズ	700	739.00	517,300
ウエルシアホールディングス	59,800	2,504.50	149,769,100
クリエイティブSDホールディングス	16,400	3,270.00	53,628,000
丸善C H Iホールディングス	6,800	332.00	2,257,600
ミサワ	1,400	634.00	887,600
ティーライフ	900	1,372.00	1,234,800
チムニー	1,600	1,372.00	2,195,200
シュッピン	10,300	1,222.00	12,586,600
オイシックス・ラ・大地	15,700	1,331.00	20,896,700
ネクステージ	26,400	2,734.00	72,177,600
ジョイフル本田	33,600	2,221.00	74,625,600
鳥貴族ホールディングス	4,300	4,585.00	19,715,500
ホットランド	8,900	2,160.00	19,224,000
すかいらーくホールディングス	157,400	2,451.50	385,866,100
S F Pホールディングス	6,300	1,939.00	12,215,700
綿半ホールディングス	9,100	1,545.00	14,059,500
ヨシックスホールディングス	2,000	2,918.00	5,836,000

ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	32,400	1,000.00	32,400,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,600	623.00	3,488,800	
BEENOS	4,800	2,024.00	9,715,200	
あさひ	10,400	1,340.00	13,936,000	
日本調剤	8,000	1,576.00	12,608,000	
コスモス薬品	9,800	13,900.00	136,220,000	
トーエル	2,600	858.00	2,230,800	
セブン&アイ・ホールディングス	1,178,600	2,143.50	2,526,329,100	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	77,900	1,048.00	81,639,200	
ツルハホールディングス	24,200	10,760.00	260,392,000	
サンマルクホールディングス	9,400	2,134.00	20,059,600	
フェリシモ	1,400	924.00	1,293,600	
トリドールホールディングス	32,300	4,085.00	131,945,500	
TOKYO BASE	13,900	306.00	4,253,400	
ウイルプラスホールディングス	1,300	1,106.00	1,437,800	
JMホールディングス	8,800	2,734.00	24,059,200	
サツドラホールディングス	2,400	903.00	2,167,200	
アレンザホールディングス	8,800	1,031.00	9,072,800	
串カツ田中ホールディングス	3,200	1,711.00	5,475,200	
パロックジャパンリミテッド	9,200	760.00	6,992,000	
クスリのアオキホールディングス	34,700	3,100.00	107,570,000	
力の源ホールディングス	5,200	1,633.00	8,491,600	
FOOD & LIFE COMPANIES	61,400	2,866.50	176,003,100	
メディカルシステムネットワーク	12,200	648.00	7,905,600	
はるやまホールディングス	2,800	613.00	1,716,400	
ノジマ	33,500	1,727.00	57,854,500	
カップ・クリエイト	18,100	1,617.00	29,267,700	
ライトオン	3,900	425.00	1,657,500	
良品計画	125,700	2,464.00	309,724,800	
パリミキホールディングス	6,900	422.00	2,911,800	
アドヴァングループ	11,200	1,137.00	12,734,400	
アルピス	3,900	2,733.00	10,658,700	
コナカ	5,600	404.00	2,262,400	
ハウス オブ ローゼ	800	1,601.00	1,280,800	
G-7ホールディングス	12,700	1,423.00	18,072,100	
イオン北海道	34,100	950.00	32,395,000	
コジマ	19,300	843.00	16,269,900	
ヒマラヤ	1,900	918.00	1,744,200	
コーナン商事	14,200	4,405.00	62,551,000	
エコス	4,400	2,295.00	10,098,000	

ワタミ	12,100	973.00	11,773,300
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	232,300	3,859.00	896,445,700
西松屋チェーン	22,700	2,474.00	56,159,800
ゼンショーホールディングス	58,600	6,673.00	391,037,800
幸楽苑ホールディングス	8,000	1,406.00	11,248,000
ハークスレイ	2,100	930.00	1,953,000
サイゼリヤ	17,100	5,390.00	92,169,000
V Tホールディングス	44,200	526.00	23,249,200
魚力	3,800	2,421.00	9,199,800
フジ・コーポレーション	5,600	1,800.00	10,080,000
ユナイテッドアローズ	13,600	1,971.00	26,805,600
ハイデイ日高	17,200	2,651.00	45,597,200
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	4,300	163.00	700,900
コロワイド	49,500	2,112.00	104,544,000
壱番屋	45,600	1,194.00	54,446,400
P L A N T	1,300	1,783.00	2,317,900
スギホールディングス	69,600	2,588.00	180,124,800
薬王堂ホールディングス	5,700	2,638.00	15,036,600
スクロール	17,400	950.00	16,530,000
ヨンドシーホールディングス	10,600	1,868.00	19,800,800
木曽路	17,500	2,566.00	44,905,000
S R S ホールディングス	19,200	1,123.00	21,561,600
千趣会	21,200	306.00	6,487,200
リテールパートナーズ	17,200	1,804.00	31,028,800
上新電機	10,900	2,321.00	25,298,900
日本瓦斯	61,000	2,579.00	157,319,000
ロイヤルホールディングス	20,300	2,504.00	50,831,200
いなげや	11,200	1,416.00	15,859,200
チヨダ	11,300	888.00	10,034,400
ライフコーポレーション	12,100	3,855.00	46,645,500
リンガーハット	14,800	2,332.00	34,513,600
M r M a x H D	14,900	628.00	9,357,200
A O K I ホールディングス	23,600	1,129.00	26,644,400
オークワ	16,600	982.00	16,301,200
コメリ	17,800	3,545.00	63,101,000
青山商事	24,700	1,705.00	42,113,500
しまむら	27,000	8,600.00	232,200,000
はせがわ	3,200	345.00	1,104,000
高島屋	79,500	2,400.00	190,800,000
松屋	19,600	1,081.00	21,187,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	50,900	1,900.00	96,710,000

近鉄百貨店	5,000	2,367.00	11,835,000
丸井グループ	76,400	2,462.50	188,135,000
アクシアル リテイリング	31,600	1,012.00	31,979,200
イオン	390,000	3,535.00	1,378,650,000
イズミ	20,400	3,525.00	71,910,000
平和堂	19,300	2,013.00	38,850,900
フジ	17,700	1,880.00	33,276,000
ヤオコー	13,100	9,075.00	118,882,500
ゼビオホールディングス	15,800	977.00	15,436,600
ケーズホールディングス	77,400	1,381.50	106,928,100
Olympicグループ	2,800	522.00	1,461,600
日産東京販売ホールディングス	8,000	583.00	4,664,000
シルバーライフ	2,500	935.00	2,337,500
Genky DrugStores	5,100	6,450.00	32,895,000
ナルミヤ・インターナショナル	1,000	1,243.00	1,243,000
ブックオフグループホールディングス	5,800	1,497.00	8,682,600
ギフトホールディングス	4,900	3,560.00	17,444,000
アインホールディングス	15,900	5,565.00	88,483,500
元気寿司	6,600	3,135.00	20,691,000
ヤマダホールディングス	354,400	447.00	158,416,800
アークランズ	34,400	1,770.00	60,888,000
ニトリホールディングス	41,900	23,670.00	991,773,000
グルメ杵屋	9,500	1,096.00	10,412,000
愛眼	3,800	195.00	741,000
ケーユーホールディングス	5,600	1,163.00	6,512,800
吉野家ホールディングス	42,400	3,407.00	144,456,800
松屋フーズホールディングス	5,500	5,550.00	30,525,000
サガミホールディングス	17,400	1,491.00	25,943,400
関西フードマーケット	7,900	1,698.00	13,414,200
王将フードサービス	8,600	7,860.00	67,596,000
ミニストップ	8,400	1,521.00	12,776,400
アークス	21,200	3,105.00	65,826,000
パローホールディングス	22,100	2,480.00	54,808,000
ベルク	5,800	6,920.00	40,136,000
大庄	4,700	1,260.00	5,922,000
ファーストリテイリング	51,800	46,920.00	2,430,456,000
サンドラッグ	38,900	4,655.00	181,079,500
サクスパー ホールディングス	10,000	892.00	8,920,000
ヤマザワ	1,300	1,249.00	1,623,700
やまや	1,100	3,140.00	3,454,000
ベルーナ	28,100	617.00	17,337,700
いよぎんホールディングス	127,400	1,137.00	144,853,800

しずおかフィナンシャルグループ	237,900	1,419.00	337,580,100
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	90,200	1,298.00	117,079,600
楽天銀行	37,200	3,200.00	119,040,000
京都フィナンシャルグループ	135,700	2,733.00	370,868,100
鳥根銀行	1,400	554.00	775,600
じもとホールディングス	4,200	585.00	2,457,000
めぶきフィナンシャルグループ	496,600	498.00	247,306,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,700	4,650.00	63,705,000
九州フィナンシャルグループ	207,200	1,077.50	223,258,000
ゆうちょ銀行	1,176,700	1,586.00	1,866,246,200
富山第一銀行	34,000	915.00	31,110,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	574,600	752.30	432,271,580
西日本フィナンシャルホールディングス	60,400	1,830.00	110,532,000
三十三フィナンシャルグループ	9,600	2,065.00	19,824,000
第四北越フィナンシャルグループ	16,800	4,345.00	72,996,000
ひろぎんホールディングス	152,400	1,057.50	161,163,000
おきなわフィナンシャルグループ	9,100	2,573.00	23,414,300
十六フィナンシャルグループ	13,900	4,640.00	64,496,000
北國フィナンシャルホールディングス	11,300	4,970.00	56,161,000
プロクレアホールディングス	12,200	1,851.00	22,582,200
あいちフィナンシャルグループ	16,500	2,576.00	42,504,000
あおぞら銀行	77,000	2,425.00	186,725,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,521,500	1,495.00	9,749,642,500
りそなホールディングス	1,238,500	924.00	1,144,374,000
三井住友トラスト・ホールディングス	384,500	3,185.00	1,224,632,500
三井住友フィナンシャルグループ	761,400	8,599.00	6,547,278,600
千葉銀行	298,400	1,231.50	367,479,600
群馬銀行	207,800	847.50	176,110,500
武蔵野銀行	14,400	2,896.00	41,702,400
千葉興業銀行	17,800	1,041.00	18,529,800
筑波銀行	47,000	292.00	13,724,000
七十七銀行	31,200	3,990.00	124,488,000
秋田銀行	7,200	2,082.00	14,990,400
山形銀行	11,900	1,168.00	13,899,200
岩手銀行	6,800	2,521.00	17,142,800
東邦銀行	84,700	351.00	29,729,700
東北銀行	2,300	1,225.00	2,817,500
ふくおかフィナンシャルグループ	93,300	3,925.00	366,202,500
スルガ銀行	94,400	864.00	81,561,600
八十二銀行	229,800	1,017.50	233,821,500
山梨中央銀行	12,000	1,816.00	21,792,000
大垣共立銀行	20,400	2,149.00	43,839,600

福井銀行	9,600	1,927.00	18,499,200
清水銀行	4,300	1,565.00	6,729,500
富山銀行	800	1,959.00	1,567,200
滋賀銀行	17,800	4,140.00	73,692,000
南都銀行	16,100	2,991.00	48,155,100
百五銀行	100,700	637.00	64,145,900
紀陽銀行	38,300	1,819.00	69,667,700
ほくほくフィナンシャルグループ	66,300	1,879.50	124,610,850
山陰合同銀行	67,000	1,172.00	78,524,000
鳥取銀行	1,600	1,444.00	2,310,400
百十四銀行	10,500	2,907.00	30,523,500
四国銀行	15,700	1,186.00	18,620,200
阿波銀行	15,000	2,704.00	40,560,000
大分銀行	6,400	3,010.00	19,264,000
宮崎銀行	6,500	2,814.00	18,291,000
佐賀銀行	6,300	2,114.00	13,318,200
琉球銀行	22,800	1,163.00	26,516,400
セブン銀行	335,700	296.00	99,367,200
みずほフィナンシャルグループ	1,445,400	2,937.50	4,245,862,500
高知銀行	1,600	1,011.00	1,617,600
山口フィナンシャルグループ	105,000	1,510.00	158,550,000
名古屋銀行	6,900	6,450.00	44,505,000
北洋銀行	162,300	429.00	69,626,700
大光銀行	1,500	1,470.00	2,205,000
愛媛銀行	14,400	1,107.00	15,940,800
トマト銀行	1,700	1,238.00	2,104,600
京葉銀行	44,100	750.00	33,075,000
栃木銀行	53,500	354.00	18,939,000
北日本銀行	3,500	2,418.00	8,463,000
東和銀行	19,700	701.00	13,809,700
福島銀行	5,000	297.00	1,485,000
大東銀行	2,100	738.00	1,549,800
トモニホールディングス	87,300	413.00	36,054,900
フィデアホールディングス	11,100	1,567.00	17,393,700
池田泉州ホールディングス	148,500	380.00	56,430,000
F P G	36,300	2,154.00	78,190,200
ジャパンインベストメントアドバイザー	17,400	1,053.00	18,322,200
マーキュリアホールディングス	2,500	1,046.00	2,615,000
S B I ホールディングス	157,000	3,800.00	596,600,000
ジャフコ グループ	32,000	1,860.00	59,520,000
大和証券グループ本社	829,600	1,127.50	935,374,000
野村ホールディングス	1,800,900	924.70	1,665,292,230

岡三証券グループ	94,100	779.00	73,303,900
丸三証券	35,700	1,039.00	37,092,300
東洋証券	28,600	374.00	10,696,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	127,300	585.00	74,470,500
光世証券	1,200	812.00	974,400
水戸証券	31,300	473.00	14,804,900
いちよし証券	20,100	817.00	16,421,700
松井証券	52,800	827.00	43,665,600
マネックスグループ	105,000	897.00	94,185,000
極東証券	14,300	1,505.00	21,521,500
岩井コスモホールディングス	12,200	2,180.00	26,596,000
アイザワ証券グループ	15,500	1,149.00	17,809,500
マネーパートナーズグループ	5,200	282.00	1,466,400
スパークス・グループ	12,000	1,824.00	21,888,000
かんぽ生命保険	109,100	2,860.00	312,026,000
F P パートナー	2,100	6,320.00	13,272,000
S O M P O ホールディングス	483,300	3,017.00	1,458,116,100
アニコム ホールディングス	36,400	574.00	20,893,600
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	719,400	2,614.00	1,880,511,600
第一生命ホールディングス	523,200	3,777.00	1,976,126,400
東京海上ホールディングス	1,058,500	4,623.00	4,893,445,500
T & D ホールディングス	287,500	2,562.50	736,718,750
アドバンスクリエイト	6,200	1,031.00	6,392,200
N E X Y Z . G r o u p	1,800	639.00	1,150,200
全国保証	28,100	5,528.00	155,336,800
あんしん保証	3,200	254.00	812,800
イントラスト	2,200	853.00	1,876,600
日本モーゲージサービス	3,200	504.00	1,612,800
C a s a	2,200	833.00	1,832,600
S B I アルヒ	10,600	949.00	10,059,400
プレミアグループ	18,200	2,021.00	36,782,200
ネットプロテクションズホールディングス	36,800	233.00	8,574,400
クレディセゾン	68,000	3,044.00	206,992,000
芙蓉総合リース	9,900	13,540.00	134,046,000
みずほリース	90,000	1,119.00	100,710,000
東京センチュリー	80,200	1,547.00	124,069,400
日本証券金融	39,500	1,625.00	64,187,500
アイフル	158,400	451.00	71,438,400
リコーリース	10,200	5,260.00	53,652,000
イオンフィナンシャルサービス	61,700	1,373.00	84,714,100
アコム	191,900	393.80	75,570,220
ジャックス	11,500	5,450.00	62,675,000

オリエントコーポレーション	35,200	1,059.00	37,276,800
オリックス	642,300	3,160.00	2,029,668,000
三菱HCキャピタル	477,400	1,026.00	489,812,400
九州リースサービス	2,100	1,428.00	2,998,800
日本取引所グループ	276,300	3,970.00	1,096,911,000
イー・ギャランティ	17,600	1,817.00	31,979,200
アサックス	2,500	777.00	1,942,500
NECキャピタルソリューション	5,300	3,745.00	19,848,500
robot home	32,200	161.00	5,184,200
大東建託	39,300	17,065.00	670,654,500
いちご	124,200	439.00	54,523,800
日本駐車場開発	115,400	206.00	23,772,400
スター・マイカ・ホールディングス	13,200	645.00	8,514,000
SREホールディングス	4,700	4,245.00	19,951,500
ADワークスグループ	12,100	259.00	3,133,900
ヒューリック	250,100	1,555.50	389,030,550
野村不動産ホールディングス	59,700	4,264.00	254,560,800
三重交通グループホールディングス	23,600	621.00	14,655,600
サムティ	17,200	2,778.00	47,781,600
ディア・ライフ	18,700	1,051.00	19,653,700
地主	8,400	2,531.00	21,260,400
プレサンスコーポレーション	17,200	1,801.00	30,977,200
ハウスコム	1,200	949.00	1,138,800
JPMC	6,500	1,289.00	8,378,500
サンセイランディック	1,800	1,148.00	2,066,400
フージャースホールディングス	16,500	1,103.00	18,199,500
オープンハウスグループ	39,300	4,949.00	194,495,700
東急不動産ホールディングス	322,300	1,207.50	389,177,250
飯田グループホールディングス	102,800	1,998.50	205,445,800
イーランド	1,000	1,572.00	1,572,000
ムゲンエステート	3,400	1,584.00	5,385,600
And Doホールディングス	6,500	1,251.00	8,131,500
シーアールイー	6,300	1,443.00	9,090,900
ケイアイスター不動産	5,300	3,840.00	20,352,000
グッドコムアセット	10,500	867.00	9,103,500
ジェイ・エス・ビー	5,500	2,799.00	15,394,500
ロードスターキャピタル	7,100	2,917.00	20,710,700
テンポイノベーション	1,800	935.00	1,683,000
フェイスネットワーク	1,500	1,437.00	2,155,500
霞ヶ関キャピタル	2,600	17,640.00	45,864,000
パーク24	69,800	1,788.00	124,802,400
パラカ	4,000	1,993.00	7,972,000

三井不動産	1,485,900	1,593.50	2,367,781,650
三菱地所	700,100	2,723.50	1,906,722,350
平和不動産	17,500	3,995.00	69,912,500
東京建物	93,700	2,543.00	238,279,100
京阪神ビルディング	19,000	1,602.00	30,438,000
住友不動産	154,900	5,587.00	865,426,300
テーオーシー	19,700	729.00	14,361,300
レオパレス21	107,100	506.00	54,192,600
スターツコーポレーション	15,500	3,245.00	50,297,500
フジ住宅	14,100	760.00	10,716,000
空港施設	14,400	606.00	8,726,400
明和地所	5,000	1,043.00	5,215,000
ゴールドクレスト	8,900	2,462.00	21,911,800
エスリード	5,100	3,485.00	17,773,500
日神グループホールディングス	18,000	516.00	9,288,000
日本エスコン	20,000	1,011.00	20,220,000
MIRARTHホールディングス	49,200	508.00	24,993,600
AVANTIA	3,100	868.00	2,690,800
イオンモール	55,800	1,785.50	99,630,900
毎日コムネット	2,300	810.00	1,863,000
ファースト住建	2,300	1,181.00	2,716,300
カチタス	29,000	1,962.00	56,898,000
トーセイ	18,000	2,429.00	43,722,000
穴吹興産	1,300	2,185.00	2,840,500
サンフロンティア不動産	16,100	1,915.00	30,831,500
FJネクストホールディングス	11,600	1,368.00	15,868,800
インテリックス	1,200	626.00	751,200
ランドビジネス	1,700	282.00	479,400
サンネクスタグループ	2,000	1,027.00	2,054,000
グランディハウス	7,300	622.00	4,540,600
日本空港ビルデング	37,900	5,917.00	224,254,300
明豊ファシリティワークス	2,700	875.00	2,362,500
LIFULL	39,300	170.00	6,681,000
MIXI	24,100	2,651.00	63,889,100
ジェイエイシーリクルートメント	40,600	794.00	32,236,400
日本M&Aセンターホールディングス	178,300	972.70	173,432,410
メンバーズ	4,000	895.00	3,580,000
中広	1,200	411.00	493,200
UTグループ	14,400	3,590.00	51,696,000
アイティメディア	4,300	1,817.00	7,813,100
ケアネット	17,400	660.00	11,484,000
E・Jホールディングス	6,600	1,818.00	11,998,800

オープンアップグループ	33,700	2,052.00	69,152,400
コシダカホールディングス	33,700	936.00	31,543,200
アルトナー	1,900	2,347.00	4,459,300
パソナグループ	13,600	2,752.00	37,427,200
C D S	1,300	1,728.00	2,246,400
リンクアンドモチベーション	32,200	528.00	17,001,600
エス・エム・エス	39,200	2,574.50	100,920,400
サニーサイドアップグループ	2,000	753.00	1,506,000
パーソルホールディングス	1,138,700	210.60	239,810,220
リニカル	3,600	387.00	1,393,200
クックパッド	32,000	173.00	5,536,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	2,700	833.00	2,249,100
学情	5,800	1,802.00	10,451,600
スタジオアリス	5,700	2,028.00	11,559,600
エプコ	1,600	868.00	1,388,800
N J S	2,500	3,150.00	7,875,000
総合警備保障	186,900	826.00	154,379,400
カカクコム	73,900	1,860.00	137,454,000
アイロムグループ	4,500	1,843.00	8,293,500
セントケア・ホールディング	7,700	891.00	6,860,700
サイネックス	1,100	800.00	880,000
ルネサンス	8,500	1,020.00	8,670,000
ディップ	17,200	2,761.00	47,489,200
デジタルホールディングス	6,000	1,187.00	7,122,000
新日本科学	10,300	1,503.00	15,480,900
キャリアデザインセンター	1,100	1,788.00	1,966,800
エムスリー	221,000	2,174.50	480,564,500
ツカダ・グローバルホールディング	3,200	445.00	1,424,000
ウェルネット	4,700	571.00	2,683,700
ワールドホールディングス	5,100	2,524.00	12,872,400
ディー・エヌ・エー	39,900	1,553.50	61,984,650
博報堂D Yホールディングス	142,700	1,383.00	197,354,100
ぐるなび	21,400	309.00	6,612,600
タカミヤ	15,500	560.00	8,680,000
ファンコミュニケーションズ	16,100	403.00	6,488,300
ライク	4,300	1,686.00	7,249,800
A o b a - B B T	2,300	386.00	887,800
エスプール	32,700	310.00	10,137,000
W D Bホールディングス	5,800	2,318.00	13,444,400
ティア	3,300	461.00	1,521,300
C D G	700	1,265.00	885,500
アドウェイズ	15,800	428.00	6,762,400

バリューコマース	10,000	1,085.00	10,850,000
インフォーマート	116,500	412.00	47,998,000
J Pホールディングス	28,900	539.00	15,577,100
エコナックホールディングス	5,600	138.00	772,800
C Lホールディングス	2,800	1,336.00	3,740,800
プレステージ・インターナショナル	50,700	694.00	35,185,800
アミューズ	6,400	1,534.00	9,817,600
ドリームインキュベータ	3,800	2,609.00	9,914,200
クイック	7,800	2,356.00	18,376,800
T A C	3,300	195.00	643,500
電通グループ	109,900	4,254.00	467,514,600
イオンファンタジー	4,100	2,411.00	9,885,100
シーティーエス	13,500	796.00	10,746,000
H . U . グループホールディングス	32,800	2,457.50	80,606,000
アルプス技研	10,700	2,785.00	29,799,500
日本空調サービス	12,200	927.00	11,309,400
オリエンタルランド	591,500	4,879.00	2,885,928,500
ダスキン	24,900	3,259.00	81,149,100
明光ネットワークジャパン	13,800	722.00	9,963,600
ファルコホールディングス	5,100	2,300.00	11,730,000
ラウンドワン	105,400	775.00	81,685,000
リゾートトラスト	48,600	2,609.50	126,821,700
ビー・エム・エル	13,800	2,951.00	40,723,800
リソー教育	58,000	222.00	12,876,000
早稲田アカデミー	6,300	1,577.00	9,935,100
ユー・エス・エス	251,000	1,281.50	321,656,500
東京個別指導学院	13,700	430.00	5,891,000
サイバーエージェント	247,200	1,090.50	269,571,600
楽天グループ	958,500	875.60	839,262,600
クリーク・アンド・リバー社	5,700	1,953.00	11,132,100
S B I グローバルアセットマネジメント	21,500	710.00	15,265,000
テー・オー・ダブリュー	22,400	385.00	8,624,000
山田コンサルティンググループ	5,100	1,779.00	9,072,900
セントラルスポーツ	4,300	2,497.00	10,737,100
フルキャストホールディングス	10,800	1,438.00	15,530,400
エン・ジャパン	18,300	2,658.00	48,641,400
リソルホールディングス	500	5,340.00	2,670,000
テクノプロ・ホールディングス	65,500	3,078.00	201,609,000
アトラグループ	1,500	175.00	262,500
アイ・アールジャパンホールディングス	5,900	1,281.00	7,557,900
K e e P e r 技研	6,900	4,780.00	32,982,000
ファーストロジック	1,500	535.00	802,500

三機サービス	1,000	1,588.00	1,588,000
Gunosy	9,100	785.00	7,143,500
デザインワン・ジャパン	2,500	141.00	352,500
イー・ガーディアン	4,400	1,360.00	5,984,000
リブセンス	3,000	230.00	690,000
ジャパンマテリアル	34,300	2,551.00	87,499,300
ベクトル	13,900	1,192.00	16,568,800
ウチヤマホールディングス	2,600	362.00	941,200
チャーム・ケア・コーポレーション	9,400	1,561.00	14,673,400
キャリアリンク	4,200	2,533.00	10,638,600
I B J	8,800	533.00	4,690,400
アサンテ	5,600	1,646.00	9,217,600
バリューHR	9,900	1,359.00	13,454,100
M&Aキャピタルパートナーズ	9,100	2,312.00	21,039,200
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,400	1,046.00	4,602,400
E R Iホールディングス	1,500	1,869.00	2,803,500
アビスト	800	3,185.00	2,548,000
シグマクシス・ホールディングス	15,200	1,721.00	26,159,200
ウィルグループ	9,500	1,073.00	10,193,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	7,200	159.00	1,144,800
メドピア	10,100	712.00	7,191,200
レアジョブ	1,200	757.00	908,400
リクルートホールディングス	827,500	6,627.00	5,483,842,500
エラン	15,000	918.00	13,770,000
土木管理総合試験所	2,900	335.00	971,500
日本郵政	1,313,600	1,472.50	1,934,276,000
ベルシステム24ホールディングス	12,100	1,613.00	19,517,300
鎌倉新書	9,800	692.00	6,781,600
S M N	1,400	392.00	548,800
グローバルキッズCOMPANY	1,200	688.00	825,600
エアトリ	8,300	1,564.00	12,981,200
アトラエ	6,900	442.00	3,049,800
ストライク	4,800	5,010.00	24,048,000
ソラスト	31,100	544.00	16,918,400
セラク	3,600	1,198.00	4,312,800
インソース	24,500	910.00	22,295,000
ベイカレント・コンサルティング	82,200	2,959.00	243,229,800
Orchestra Holdings	2,600	1,086.00	2,823,600
アイモバイル	14,600	407.00	5,942,200
キャリアインデックス	2,600	193.00	501,800
MS - Japan	3,700	1,179.00	4,362,300
船場	1,200	1,281.00	1,537,200

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	36,300	2,402.00	87,192,600
フルテック	900	1,156.00	1,040,400
GameWith	2,400	314.00	753,600
MS&Consulting	1,000	600.00	600,000
エル・ティー・エス	1,400	2,424.00	3,393,600
ミダックホールディングス	6,900	1,535.00	10,591,500
キュービーネットホールディングス	5,500	1,224.00	6,732,000
RPAホールディングス	15,800	280.00	4,424,000
スプリックス	1,700	817.00	1,388,900
マネジメントソリューションズ	4,900	2,012.00	9,858,800
プロレド・パートナーズ	3,100	506.00	1,568,600
テノ・ホールディングス	1,000	466.00	466,000
フロンティア・マネジメント	2,900	1,718.00	4,982,200
コプロ・ホールディングス	1,700	1,749.00	2,973,300
ギークス	1,000	532.00	532,000
アンビスホールディングス	12,000	2,514.00	30,168,000
カーブスホールディングス	30,800	807.00	24,855,600
フォーラムエンジニアリング	14,700	925.00	13,597,500
Fast Fitness Japan	4,000	1,045.00	4,180,000
ダイレクトマーケティングミックス	12,000	313.00	3,756,000
ポピンズ	1,800	1,316.00	2,368,800
LITALICO	8,800	2,057.00	18,101,600
コンフィデンス・インターワークス	500	1,685.00	842,500
アドバンテッジリスクマネジメント	2,900	403.00	1,168,700
リログループ	56,100	1,241.50	69,648,150
東祥	8,000	726.00	5,808,000
ID&Eホールディングス	6,800	4,475.00	30,430,000
ビーウィズ	2,600	2,285.00	5,941,000
TREホールディングス	21,500	1,215.00	26,122,500
人・夢・技術グループ	4,300	1,773.00	7,623,900
NISSOホールディングス	9,900	824.00	8,157,600
大栄環境	20,400	2,424.00	49,449,600
日本管財ホールディングス	11,800	2,543.00	30,007,400
M&A総研ホールディングス	5,400	6,600.00	35,640,000
エイチ・アイ・エス	32,600	1,912.00	62,331,200
ラックランド	5,200	2,185.00	11,362,000
共立メンテナンス	35,200	3,433.00	120,841,600
イチネンホールディングス	11,900	1,714.00	20,396,600
建設技術研究所	5,800	4,910.00	28,478,000
スペース	7,500	1,054.00	7,905,000
燦ホールディングス	10,100	1,054.00	10,645,400
スバル興業	3,000	2,699.00	8,097,000

東京テアトル	1,800	1,114.00	2,005,200	
タナベコンサルティンググループ	3,200	1,011.00	3,235,200	
ナガワ	3,100	7,770.00	24,087,000	
東京都競馬	9,400	4,440.00	41,736,000	
カナモト	17,400	2,670.00	46,458,000	
ニシオホールディングス	10,400	3,695.00	38,428,000	
トランス・コスモス	13,900	3,150.00	43,785,000	
乃村工藝社	48,900	903.00	44,156,700	
藤田観光	4,500	7,370.00	33,165,000	
KNT - CTホールディングス	6,700	1,329.00	8,904,300	
トーカイ	10,000	2,133.00	21,330,000	
セコム	113,800	10,800.00	1,229,040,000	
セントラル警備保障	6,100	2,640.00	16,104,000	
丹青社	21,900	897.00	19,644,300	
メイテックグループホールディングス	40,300	2,961.00	119,328,300	
応用地質	10,500	2,220.00	23,310,000	
船井総研ホールディングス	23,300	2,487.00	57,947,100	
進学会ホールディングス	2,000	256.00	512,000	
オオバ	3,600	1,037.00	3,733,200	
いであ	1,400	2,348.00	3,287,200	
学究社	4,500	2,125.00	9,562,500	
イオンディライト	12,000	3,530.00	42,360,000	
ナック	9,800	533.00	5,223,400	
ダイセキ	22,900	3,605.00	82,554,500	
ステップ	4,200	1,987.00	8,345,400	
合 計	174,813,742		418,075,149,440	

(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。

2【ファンドの現況】

【DC日本株式インデックスファンドL】

【純資産額計算書】

（2024年 4月30日現在）

資産総額	181,139,108,781円
負債総額	208,153,430円
純資産総額（ - ）	180,930,955,351円
発行済口数	47,084,408,432口
1口当たり純資産額（ / ）	3.8427円
（1万口当たり純資産額）	（38,427円）

（参考）

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

（2024年 4月30日現在）

資産総額	431,774,957,946円
負債総額	1,088,680,043円
純資産総額（ - ）	430,686,277,903円
発行済口数	130,433,778,094口
1口当たり純資産額（ / ）	3.3020円
（1万口当たり純資産額）	（33,020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、

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、

- ハ.上記イ.の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

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。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2024年 4月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に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 6月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年 4月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	533	15,018,346
追加型公社債投資信託	0	0
単体型株式投資信託	62	213,458
単体型公社債投資信託	51	170,655
合計	646	15,402,460

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本
--	------

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

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	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 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.4%	0.4%

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	112 百万円	58 百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	177 "	187 "
退職給付引当金損金算入限度超過額	251 "	277 "
税務上の収益認識差額	74 "	- "
税務上の費用認識差額	439 "	412 "
繰延ヘッジ損益	224 "	225 "
その他	76 "	75 "
繰延税金資産 合計	1,357 "	1,236 "
繰延税金負債		
有価証券評価差額	415 "	21 "
その他	34 "	32 "
繰延税金負債 合計	450 "	54 "
繰延税金資産の純額	907 "	1,181 "

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

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

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

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

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,887百万円

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2022年3月31日）

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

当事業年度（2023年3月31日）

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

(1株当たり情報)

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

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

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				
	利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		別途積立金	繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
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、金額的重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。

（中間貸借対照表関係）

第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 6月28日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称： 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（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。
三井住友海上火災保険株式会社	139,595	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2023年 6月30日	有価証券届出書
2023年 6月30日	有価証券報告書
2023年12月28日	有価証券届出書
2023年12月28日	半期報告書

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

2024年6月11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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックスファンドLの2023年4月1日から2024年4月1日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC日本株式インデックスファンドLの2024年4月1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。