

【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】	2025年3月10日提出
【計算期間】	第22期(自 2023年12月12日至 2024年12月10日)
【ファンド名】	D C 日本株式インデックスファンドA
【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)...「MRF及びMMF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)...「MRF及びMMFの運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3)ETF...投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

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

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

< ファンドの特色 >

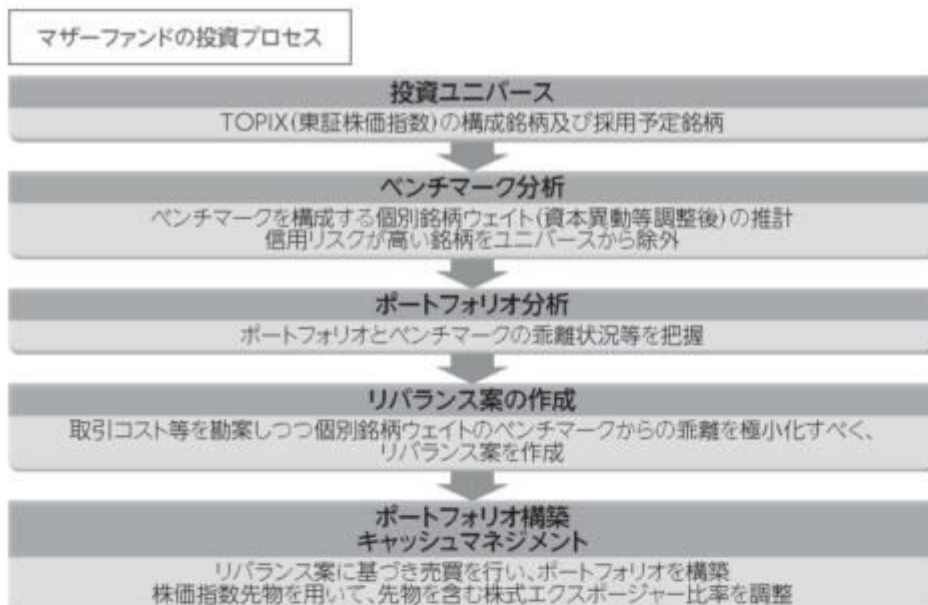
わが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

TOPIX（東証株価指数）（配当込み）^(注)とは

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

(注) TOPIX（東証株価指数）（配当込み）の著作権等について

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



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

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



分配方針

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

主な投資制限

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

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

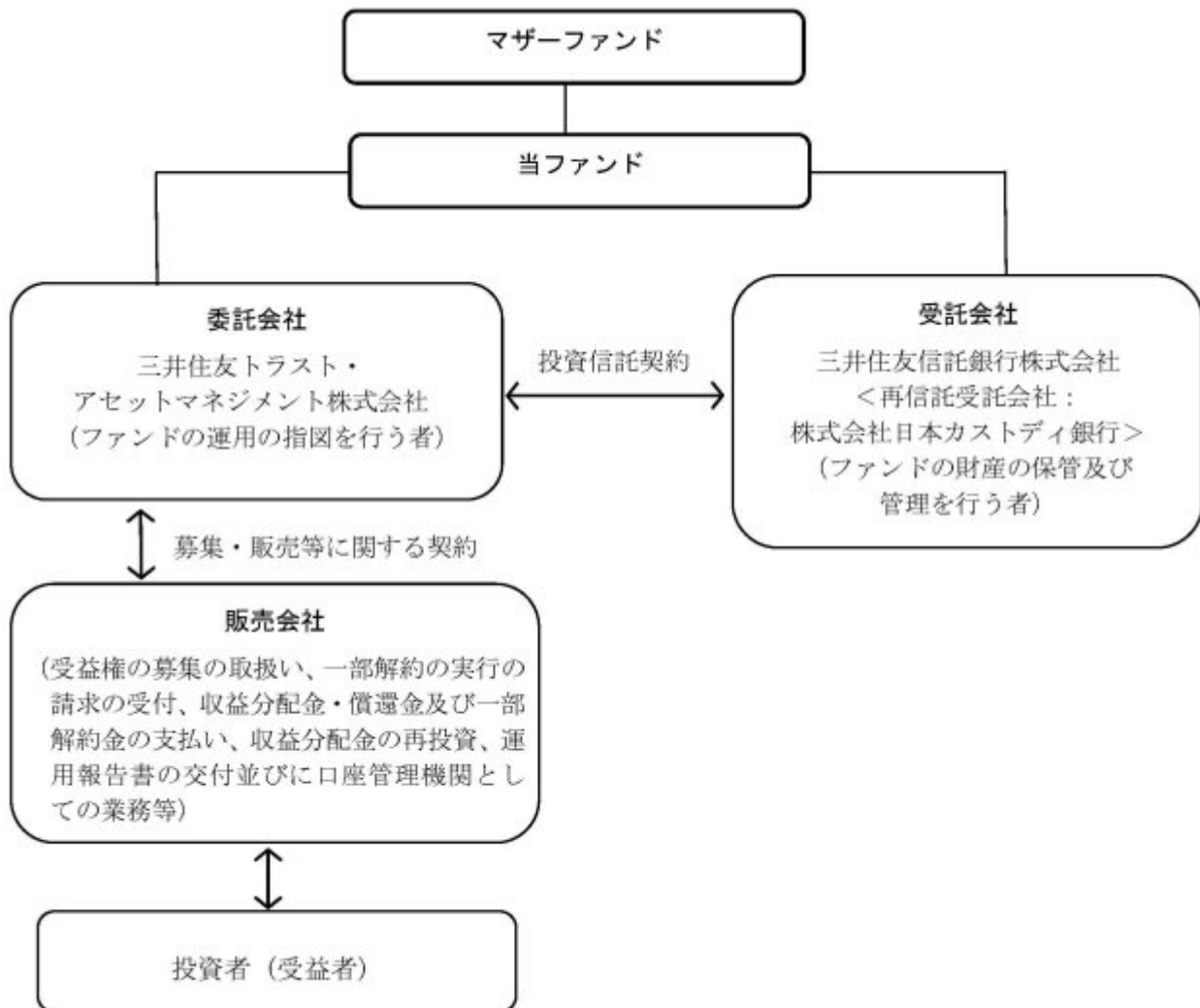
(2) 【ファンドの沿革】

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

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

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2024年12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
三井住友トラストグループ株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

運用方針

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

投資態度

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

（2）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

A．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

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

A．株券又は新株引受権証書

B．国債証券

C．地方債証券

D．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

J．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

Q．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

R．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

T．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

V．外国の者に対する権利で上記U．の有価証券の性質を有するもの

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

運用指図できる金融商品

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

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

B．金融商品による運用の特例

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

(参考)マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2．運用方法

(1) 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

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

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

3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

（3）【運用体制】

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



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

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

(4) 【分配方針】

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

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

A．株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

C．新株引受権証券等への投資割合

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

D．投資信託証券への投資割合

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

E．同一銘柄の株式への投資割合

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

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

G．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

H．投資する株式等の範囲

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、わが国の金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、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、

I．信用取引の運用指図

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

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

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

- ニ．上記ロ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- Ｊ．先物取引等の運用指図
- イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- ロ．委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- Ｋ．スワップ取引の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- Ｌ．金利先渡取引の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- Ｍ．有価証券の貸付の指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
- a．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- b．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．a．及びb．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社はすみやかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付にあたり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- Ｎ．公社債の空売りの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有していない公社債又は、下記〇．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をする

ことができるものとします。

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

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

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

信用リスク

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

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が、ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。

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

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

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

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

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

ファンドは、大量の換金申込が発生し短期間で換金代金を手当てする必要が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。

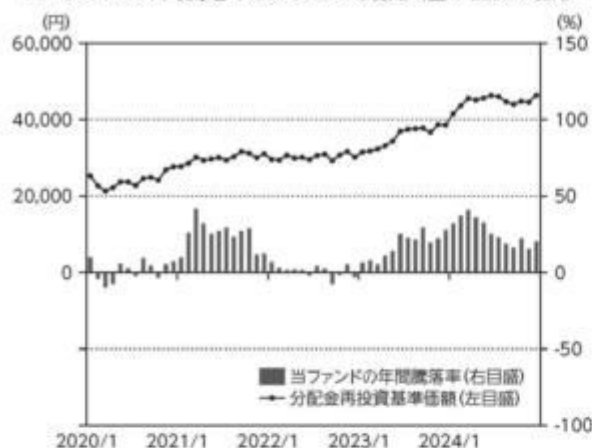
（２）リスクの管理体制

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】

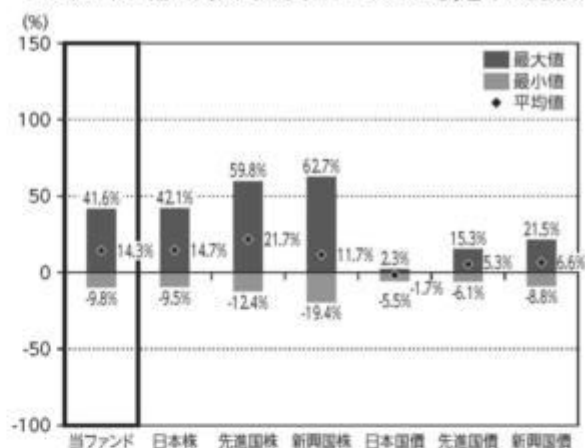
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



*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



*2020年1月～2024年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数) (配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX協研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の数値及び同指数に係る権限又は商標は、株式会社JPX協研又は株式会社JPX協研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利ノウハウ及び同指数に係る権限又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の数値の算出又は公表の誤差、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募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、本ファンドのスポンサーではなく、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、またデータの誤差、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 J.P. Morgan Global Bond Index - Emerging Markets (除く日本、円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

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

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、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

2025年3月10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12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12月12日～2024年12月10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12月30日現在の状況について記載してあります。

【DC日本株式インデックスファンドA】

（１）【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,138,910,248	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,076,453	0.05
合計(純資産総額)		2,139,986,701	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	629,591,219	3.3397	2,102,645,795	3.3973	2,138,910,248	99.95

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□ 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第13期計算期間末	(2015年12月10日)	1,988,050,902	1,988,050,902	21,457	21,457
第14期計算期間末	(2016年12月12日)	2,061,339,551	2,061,339,551	21,720	21,720
第15期計算期間末	(2017年12月11日)	2,209,160,180	2,209,160,180	26,176	26,176
第16期計算期間末	(2018年12月10日)	1,975,360,863	1,975,360,863	23,361	23,361
第17期計算期間末	(2019年12月10日)	2,105,502,404	2,105,502,404	25,822	25,822
第18期計算期間末	(2020年12月10日)	1,905,184,214	1,905,184,214	27,212	27,212
第19期計算期間末	(2021年12月10日)	1,498,036,766	1,498,036,766	30,784	30,784
第20期計算期間末	(2022年12月12日)	1,490,944,258	1,490,944,258	31,186	31,186
第21期計算期間末	(2023年12月11日)	1,834,822,533	1,834,822,533	38,408	38,408
第22期計算期間末	(2024年12月10日)	2,099,404,439	2,099,404,439	45,610	45,610
	2023年12月末日	1,843,509,702		38,586	
	2024年 1月末日	1,972,814,773		41,592	
	2月末日	2,057,432,096		43,634	
	3月末日	2,158,849,913		45,560	
	4月末日	2,150,472,951		45,147	
	5月末日	2,160,650,834		45,654	
	6月末日	2,158,460,598		46,310	
	7月末日	2,136,531,098		46,052	
	8月末日	2,094,677,880		44,709	
	9月末日	2,063,751,419		44,016	
	10月末日	2,087,548,842		44,839	
	11月末日	2,071,009,306		44,602	

12月末日	2,139,986,701		46,389
-------	---------------	--	--------

【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12月11日～2015年12月10日	0
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	0
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	0
第16期計算期間	2017年12月12日～2018年12月10日	0
第17期計算期間	2018年12月11日～2019年12月10日	0
第18期計算期間	2019年12月11日～2020年12月10日	0
第19期計算期間	2020年12月11日～2021年12月10日	0
第20期計算期間	2021年12月11日～2022年12月12日	0
第21期計算期間	2022年12月13日～2023年12月11日	0
第22期計算期間	2023年12月12日～2024年12月10日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第13期計算期間	2014年12月11日～2015年12月10日	11.2
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	1.2
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	20.5
第16期計算期間	2017年12月12日～2018年12月10日	10.8
第17期計算期間	2018年12月11日～2019年12月10日	10.5
第18期計算期間	2019年12月11日～2020年12月10日	5.4
第19期計算期間	2020年12月11日～2021年12月10日	13.1
第20期計算期間	2021年12月11日～2022年12月12日	1.3
第21期計算期間	2022年12月13日～2023年12月11日	23.2
第22期計算期間	2023年12月12日～2024年12月10日	18.8

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第13期計算期間	2014年12月11日～2015年12月10日	334,502,702	381,040,919	926,517,389
第14期計算期間	2015年12月11日～2016年12月12日	221,175,855	198,632,883	949,060,361
第15期計算期間	2016年12月13日～2017年12月11日	199,865,073	304,958,532	843,966,902
第16期計算期間	2017年12月12日～2018年12月10日	159,092,319	157,488,542	845,570,679
第17期計算期間	2018年12月11日～2019年12月10日	109,110,724	139,292,136	815,389,267
第18期計算期間	2019年12月11日～2020年12月10日	181,680,786	296,943,765	700,126,288
第19期計算期間	2020年12月11日～2021年12月10日	96,749,997	310,248,007	486,628,278
第20期計算期間	2021年12月11日～2022年12月12日	73,704,889	82,251,802	478,081,365
第21期計算期間	2022年12月13日～2023年12月11日	88,784,575	89,151,844	477,714,096
第22期計算期間	2023年12月12日～2024年12月10日	90,866,693	108,281,005	460,299,784

(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	427,255,190,940	98.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,162,605,878	1.42
合計(純資産総額)		433,417,796,818	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建/売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	5,851,650,000	1.35

(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	5,710,100	2,967.35	16,943,865,235	3,146.00	17,963,974,600	4.14
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	3,761,600	2,938.59	11,053,800,144	3,369.00	12,672,830,400	2.92
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,789,000	1,330.67	9,033,918,630	1,846.00	12,532,494,000	2.89
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,793,700	2,424.08	6,772,152,296	3,937.00	10,998,796,900	2.54
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	861,500	6,427.82	5,537,566,930	11,145.00	9,601,417,500	2.22
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2,207,000	2,477.50	5,467,842,500	3,764.00	8,307,148,000	1.92
日本	株式	キーエンス	電気機器	107,500	66,596.38	7,159,110,850	64,630.00	6,947,725,000	1.60
日本	株式	任天堂	その他製品	678,200	8,087.50	5,484,942,500	9,264.00	6,282,844,800	1.45
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	764,000	6,651.62	5,081,837,680	7,832.00	5,983,648,000	1.38
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,032,900	3,892.18	4,020,232,722	5,728.00	5,916,451,200	1.37
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,428,000	2,597.13	3,708,701,640	3,873.00	5,530,644,000	1.28
日本	株式	三井物産	卸売業	1,668,800	2,985.21	4,981,718,448	3,311.00	5,525,396,800	1.27
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	227,300	28,647.23	6,511,515,379	24,185.00	5,497,250,500	1.27
日本	株式	三菱商事	卸売業	2,099,200	2,612.71	5,484,600,832	2,604.00	5,466,316,800	1.26
日本	株式	信越化学工業	化学	964,900	5,880.04	5,673,650,596	5,296.00	5,110,110,400	1.18
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	32,045,200	189.02	6,057,183,704	158.00	5,063,141,600	1.17
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	531,400	6,780.95	3,603,396,830	9,185.00	4,880,909,000	1.13

日本	株式	第一三共	医薬品	1,016,700	4,480.69	4,555,517,523	4,352.00	4,424,678,400	1.02
日本	株式	三菱重工業	機械	1,897,200	983.64	1,866,161,808	2,223.00	4,217,475,600	0.97
日本	株式	HOYA	精密機器	209,700	18,605.47	3,901,567,059	19,815.00	4,155,205,500	0.96
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	958,600	4,360.78	4,180,243,708	4,181.00	4,007,906,600	0.92
日本	株式	KDDI	情報・通信業	792,400	5,034.07	3,988,997,068	5,042.00	3,995,280,800	0.92
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,545,100	1,604.36	4,083,256,636	1,535.00	3,906,728,500	0.90
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	63,900	39,954.66	2,553,102,774	53,820.00	3,439,098,000	0.79
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	17,236,900	198.25	3,417,215,425	198.90	3,428,419,410	0.79
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	1,255,500	1,942.00	2,438,181,000	2,487.00	3,122,428,500	0.72
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	338,500	6,195.90	2,097,312,150	9,198.00	3,113,523,000	0.72
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,103,500	2,208.73	2,437,333,555	2,687.00	2,965,104,500	0.68
日本	株式	富士通	電気機器	998,300	2,072.29	2,068,767,107	2,799.50	2,794,740,850	0.64
日本	株式	キヤノン	電気機器	535,800	3,787.04	2,029,096,032	5,161.00	2,765,263,800	0.64

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.24
		建設業	2.12
		食料品	3.01
		繊維製品	0.40
		パルプ・紙	0.13
		化学	5.07
		医薬品	4.28
		石油・石炭製品	0.54
		ゴム製品	0.56
		ガラス・土石製品	0.65
		鉄鋼	0.81
		非鉄金属	0.82
		金属製品	0.48
		機械	5.47
		電気機器	17.36
		輸送用機器	7.78
		精密機器	2.37
		その他製品	2.62
		電気・ガス業	1.23
陸運業	2.21		
海運業	0.68		
空運業	0.33		
倉庫・運輸関連業	0.14		

	情報・通信業	7.39
	卸売業	6.71
	小売業	4.53
	銀行業	8.43
	証券、商品先物取引業	0.87
	保険業	3.24
	その他金融業	1.19
	不動産業	1.76
	サービス業	5.07
	小計	98.58
合計		98.58

(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	210円		5,787,315,500	5,851,650,000	1.35

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2002年12月11日
作成基準日：2024年12月30日

基準価額・純資産の推移

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	46,389円
純資産総額	21.40億円

分配の推移

（1万口当たり、税引前）

決算期	分配金
2020年12月	0円
2021年12月	0円
2022年12月	0円
2023年12月	0円
2024年12月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	4.1%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.9%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	2.9%
日立製作所	日本	株式	電気機器	2.5%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	2.2%
三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.9%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.6%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.4%
伊藤忠商事	日本	株式	卸売業	1.4%
東京海上ホールディングス	日本	株式	保険業	1.4%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移（暦年ベース）

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

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

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

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

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

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として、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の受付を取り消すことができます。

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として、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基づき、振り込まれることとなります。

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

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

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド）

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ： <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2002年12月11日設定）

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

（4）【計算期間】

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

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

（5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

（1）投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第22期計算期間(2023年12月12日から2024年12月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DC日本株式インデックスファンドA】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第21期 (2023年12月11日現在)	第22期 (2024年12月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,874,307	3,441,896
親投資信託受益証券	1,833,918,388	2,098,357,324
未収入金	7,482,863	6,973,979
未収利息	-	20
流動資産合計	1,845,275,558	2,108,773,219
資産合計	1,845,275,558	2,108,773,219
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,631,657	7,264,878
未払受託者報酬	392,650	341,184
未払委託者報酬	2,428,717	1,762,718
未払利息	1	-
流動負債合計	10,453,025	9,368,780
負債合計	10,453,025	9,368,780
純資産の部		
元本等		
元本	477,714,096	460,299,784
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,357,108,437	1,639,104,655
(分配準備積立金)	623,327,636	785,116,445
元本等合計	1,834,822,533	2,099,404,439
純資産合計	1,834,822,533	2,099,404,439
負債純資産合計	1,845,275,558	2,108,773,219

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第21期		第22期	
	自	2022年12月13日 至 2023年12月11日	自	2023年12月12日 至 2024年12月10日
営業収益				
受取利息		10		2,901
有価証券売買等損益		353,264,611		345,502,490
営業収益合計		353,264,621		345,505,391
営業費用				
支払利息		1,200		61
受託者報酬		816,039		676,482
委託者報酬		5,307,697		3,495,012
営業費用合計		6,124,936		4,171,555
営業利益又は営業損失（ ）		347,139,685		341,333,836
経常利益又は経常損失（ ）		347,139,685		341,333,836
当期純利益又は当期純損失（ ）		347,139,685		341,333,836
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（ ）		34,675,256		51,695,772
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,012,862,893		1,357,108,437
剰余金増加額又は欠損金減少額		222,197,713		303,949,847
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		222,197,713		303,949,847
剰余金減少額又は欠損金増加額		190,416,598		311,591,693
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		190,416,598		311,591,693
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,357,108,437		1,639,104,655

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年12月11日から翌年12月10日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第22期計算期間は2023年12月12日から2024年12月10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12月11日現在)	第22期 (2024年12月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	477,714,096口	460,299,784口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 3.8408円 (38,408円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 4.5610円 (45,610円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第21期 自 2022年12月13日 至 2023年12月11日			第22期 自 2023年12月12日 至 2024年12月10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	40,596,131円	費用控除後の配当等収益額	A	47,077,045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	265,341,576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	242,561,019円
収益調整金額	C	942,291,049円	収益調整金額	C	1,014,528,734円
分配準備積立金額	D	317,389,929円	分配準備積立金額	D	495,478,381円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,565,618,685円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,799,645,179円
当ファンドの期末残存口数	F	477,714,096口	当ファンドの期末残存口数	F	460,299,784口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	32,773円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	39,097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12月12日 至 2024年12月10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12月10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12月10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12月13日 至 2023年12月11日	第22期 自 2023年12月12日 至 2024年12月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	478,081,365円	477,714,096円
期中追加設定元本額	88,784,575円	90,866,693円
期中一部解約元本額	89,151,844円	108,281,005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12月11日現在)	第22期 (2024年12月10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	323,753,450	302,895,591
合計	323,753,450	302,895,591

（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	628,288,318	2,098,357,324	
合計		628,288,318	2,098,357,324	

(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12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,593,026,904
株式	421,499,801,922
未収入金	144,075,000
未収配当金	267,648,147
未収利息	33,161
前払金	4,925,000
差入委託証拠金	176,081,901
流動資産合計	427,685,592,035
資産合計	427,685,592,035
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,033,350
未払金	325,900
未払解約金	406,457,371
流動負債合計	411,816,621
負債合計	411,816,621
純資産の部	
元本等	
元本	127,932,502,280
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	299,341,273,134
元本等合計	427,273,775,414
純資産合計	427,273,775,414
負債純資産合計	427,685,592,035

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年12月10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12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	127,932,502,280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 3.3398円 (1万口当たり純資産額) (33,398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12月10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12月10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12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年12月12日
期首元本額	131,981,508,398円
期中追加設定元本額	13,454,226,955円
期中一部解約元本額	17,503,233,073円
期末元本額	127,932,502,280円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	567,949,866円
D C日本株式インデックスファンド	266,775,192円
D C日本株式インデックスファンドL	52,481,243,558円
D C日本株式インデックスファンドA	628,288,318円
D Cバランスファンド3 0	1,897,299,070円

区分	2024年12月10日現在
DCバランスファンド50	3,308,931,173円
DCバランスファンド70	2,369,663,059円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	487,914,067円
日本株式インデックスe	1,279,369,794円
インデックスコレクション（国内株式）	24,066,129,000円
インデックスコレクション（バランス株式30）	10,335,179,497円
インデックスコレクション（バランス株式50）	3,622,953,735円
インデックスコレクション（バランス株式70）	3,846,258,741円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	8,250,143,343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）	2,612,286,743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）	531,356,240円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	18,079,325円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	272,851,795円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	37,511,206円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	95,323,298円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	25,492,763円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	293,269,839円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	266,190,925円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	4,763,536,225円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	515,367,163円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	30,654,811円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	743,915,762円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	11,661,187円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	91,993,231円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,234,851,244円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	28,967,538円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	33,544,522円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	5,244,668円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	305,648,937円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	151,439,744円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	2,316,921,432円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	50,482,562円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	15,230,717円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	5,026,066円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	65,501,520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）	2,054,404円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年12月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	29,866,242,550
合計	29,866,242,550

(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12月10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	5,404,695,000	-	5,399,770,000
合計		5,404,695,000	-	5,399,770,000

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	6,300	4,060.00	25,578,000	
ニッスイ	150,600	913.10	137,512,860	
マルハニチロ	22,300	2,957.00	65,941,100	
雪国まいたけ	12,800	1,033.00	13,222,400	
カネコ種苗	4,300	1,417.00	6,093,100	
サカタのタネ	16,800	3,490.00	58,632,000	
ホクト	12,300	1,746.00	21,475,800	
ホクリヨウ	300	1,125.00	337,500	
住石ホールディングス	16,600	824.00	13,678,400	
日鉄鉱業	6,000	4,105.00	24,630,000	
I N P E X	455,200	1,982.00	902,206,400	
石油資源開発	82,600	1,096.00	90,529,600	
K & O エナジーグループ	6,800	3,150.00	21,420,000	
ショーボンドホールディングス	19,800	5,273.00	104,405,400	
ミライト・ワン	49,300	2,185.00	107,720,500	
タマホーム	9,500	3,620.00	34,390,000	
サンヨーホームズ	300	712.00	213,600	
日本アクア	800	797.00	637,600	
ファーストコーポレーション	500	800.00	400,000	
ベステラ	400	999.00	399,600	
キャンディル	300	556.00	166,800	
ダイセキ環境ソリューション	400	1,280.00	512,000	
第一カッター興業	4,300	1,470.00	6,321,000	
安藤・間	87,300	1,189.00	103,799,700	
東急建設	47,200	697.00	32,898,400	
コムシスホールディングス	53,400	3,280.00	175,152,000	
ビーアールホールディングス	22,100	336.00	7,425,600	
高松コンストラクショングループ	11,200	2,638.00	29,545,600	
東建コーポレーション	3,800	11,000.00	41,800,000	
ソネック	200	842.00	168,400	
ヤマウラ	7,600	1,174.00	8,922,400	
オリエンタル白石	55,800	383.00	21,371,400	
大成建設	95,600	6,584.00	629,430,400	

大林組	347,800	2,070.00	719,946,000
清水建設	298,700	1,183.50	353,511,450
長谷工コーポレーション	96,700	2,026.50	195,962,550
松井建設	9,800	897.00	8,790,600
銭高組	100	3,750.00	375,000
鹿島建設	233,600	2,708.00	632,588,800
不動テトラ	6,600	2,034.00	13,424,400
大末建設	500	1,582.00	791,000
鉄建建設	6,900	2,262.00	15,607,800
西松建設	16,800	5,056.00	84,940,800
三井住友建設	80,200	412.00	33,042,400
大豊建設	2,900	3,395.00	9,845,500
佐田建設	700	998.00	698,600
ナカノフドー建設	1,000	665.00	665,000
奥村組	18,600	3,830.00	71,238,000
東鉄工業	11,600	3,220.00	37,352,000
イチケン	300	2,528.00	758,400
富士ピー・エス	600	401.00	240,600
浅沼組	39,800	640.00	25,472,000
戸田建設	129,600	917.50	118,908,000
熊谷組	17,400	4,015.00	69,861,000
北野建設	200	4,230.00	846,000
植木組	400	1,547.00	618,800
矢作建設工業	14,300	1,533.00	21,921,900
ピーエス・コンストラクション	7,600	1,094.00	8,314,400
日本ハウスホールディングス	22,500	337.00	7,582,500
新日本建設	14,800	1,478.00	21,874,400
東亜道路工業	18,200	1,284.00	23,368,800
日本道路	10,600	1,763.00	18,687,800
東亜建設工業	31,800	1,179.00	37,492,200
日本国土開発	30,000	510.00	15,300,000
若築建設	3,200	3,825.00	12,240,000
東洋建設	30,300	1,288.00	39,026,400
五洋建設	137,900	634.90	87,552,710
世紀東急工業	13,800	1,505.00	20,769,000
福田組	4,000	5,250.00	21,000,000
住友林業	91,100	5,901.00	537,581,100
日本基礎技術	800	600.00	480,000
巴コーポレーション	1,300	980.00	1,274,000
大和ハウス工業	317,900	4,726.00	1,502,395,400
ライト工業	19,900	2,191.00	43,600,900
積水ハウス	319,600	3,628.00	1,159,508,800

日特建設	10,100	981.00	9,908,100
北陸電気工事	7,200	1,143.00	8,229,600
ユアテック	20,300	1,400.00	28,420,000
日本リーテック	8,200	1,127.00	9,241,400
四電工	13,200	1,468.00	19,377,600
中電工	16,300	3,360.00	54,768,000
関電工	57,700	2,217.00	127,920,900
きんでん	73,300	3,050.00	223,565,000
東京エネシス	10,100	1,040.00	10,504,000
トーエネック	17,500	952.00	16,660,000
住友電設	8,600	4,795.00	41,237,000
日本電設工業	19,800	1,974.00	39,085,200
エクシオグループ	111,600	1,731.50	193,235,400
新日本空調	6,800	3,875.00	26,350,000
九電工	22,800	5,217.00	118,947,600
三機工業	22,000	2,915.00	64,130,000
日揮ホールディングス	104,300	1,298.50	135,433,550
中外炉工業	3,400	3,360.00	11,424,000
ヤマト	1,100	1,263.00	1,389,300
太平電業	6,700	5,020.00	33,634,000
高砂熱学工業	25,400	6,060.00	153,924,000
三晃金属工業	200	4,320.00	864,000
朝日工業社	9,800	2,022.00	19,815,600
明星工業	18,100	1,392.00	25,195,200
大気社	13,500	4,680.00	63,180,000
ダイダン	13,800	3,625.00	50,025,000
日比谷総合設備	7,800	3,905.00	30,459,000
飛島ホールディングス	10,800	1,543.00	16,664,400
フィル・カンパニー	2,100	912.00	1,915,200
テスホールディングス	22,700	283.00	6,424,100
インフロニア・ホールディングス	110,400	1,189.50	131,320,800
東洋エンジニアリング	15,500	698.00	10,819,000
レイズネクスト	15,200	1,610.00	24,472,000
ニッポン	34,800	2,131.00	74,158,800
日清製粉グループ本社	110,000	1,824.00	200,640,000
日東富士製粉	1,900	6,690.00	12,711,000
昭和産業	8,900	2,810.00	25,009,000
鳥越製粉	1,000	699.00	699,000
中部飼料	14,600	1,306.00	19,067,600
フィード・ワン	15,500	798.00	12,369,000
東洋精糖	200	1,463.00	292,600
日本甜菜製糖	5,500	2,387.00	13,128,500

DM三井製糖ホールディングス	10,500	3,330.00	34,965,000
塩水港精糖	1,500	311.00	466,500
ウェルネオシュガー	5,400	2,161.00	11,669,400
森永製菓	44,200	2,772.50	122,544,500
中村屋	2,700	3,180.00	8,586,000
江崎グリコ	30,300	4,598.00	139,319,400
名糖産業	4,300	1,961.00	8,432,300
井村屋グループ	6,100	2,445.00	14,914,500
不二家	7,300	2,639.00	19,264,700
山崎製パン	70,800	2,820.00	199,656,000
第一屋製パン	300	571.00	171,300
モロゾフ	3,400	4,550.00	15,470,000
亀田製菓	6,200	4,135.00	25,637,000
寿スピリッツ	62,500	2,141.50	133,843,750
カルビー	48,400	3,252.00	157,396,800
森永乳業	40,600	2,968.50	120,521,100
六甲バター	7,800	1,384.00	10,795,200
ヤクルト本社	151,200	3,240.00	489,888,000
明治ホールディングス	141,500	3,166.00	447,989,000
雪印メグミルク	28,400	2,718.00	77,191,200
プリマハム	14,200	2,208.00	31,353,600
日本ハム	45,500	5,081.00	231,185,500
林兼産業	500	463.00	231,500
丸大食品	10,600	1,707.00	18,094,200
S Foods	11,700	2,725.00	31,882,500
柿安本店	4,100	2,792.00	11,447,200
伊藤ハム米久ホールディングス	16,200	3,855.00	62,451,000
サッポロホールディングス	34,800	9,142.00	318,141,600
アサヒグループホールディングス	794,300	1,623.50	1,289,546,050
キリンホールディングス	440,600	2,101.00	925,700,600
シマダヤ	3,100	1,401.00	4,343,100
宝ホールディングス	71,300	1,284.50	91,584,850
オエノンホールディングス	34,200	418.00	14,295,600
養命酒製造	3,500	2,521.00	8,823,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	74,600	2,454.50	183,105,700
ライフドリンク カンパニー	23,100	2,335.00	53,938,500
サントリー食品インターナショナル	74,500	4,955.00	369,147,500
ダイドーグループホールディングス	12,000	3,465.00	41,580,000
伊藤園	35,400	3,671.00	129,953,400
キーコーヒー	11,800	2,040.00	24,072,000
ユニカフェ	600	946.00	567,600
日清オイリオグループ	14,900	4,975.00	74,127,500

不二製油グループ本社	21,100	3,511.00	74,082,100
かどや製油	200	3,590.00	718,000
J・オイルミルズ	12,100	2,127.00	25,736,700
キッコーマン	350,500	1,686.00	590,943,000
味の素	244,900	6,520.00	1,596,748,000
ブルドックソース	5,600	1,892.00	10,595,200
キューピー	56,800	3,414.00	193,915,200
ハウス食品グループ本社	35,600	2,906.00	103,453,600
カゴメ	45,300	2,995.50	135,696,150
アリアケジャパン	10,500	5,690.00	59,745,000
ピエトロ	300	1,741.00	522,300
エバラ食品工業	2,600	2,859.00	7,433,400
やまみ	200	4,000.00	800,000
ニチレイ	43,100	4,239.00	182,700,900
東洋水産	49,000	10,550.00	516,950,000
イトアンドホールディングス	5,100	2,164.00	11,036,400
大冷	300	1,902.00	570,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,900	1,335.00	6,541,500
日清食品ホールディングス	136,300	4,016.00	547,380,800
一正蒲鉾	700	742.00	519,400
フジッコ	10,900	1,712.00	18,660,800
ロック・フィールド	12,900	1,522.00	19,633,800
日本たばこ産業	642,700	4,195.00	2,696,126,500
ケンコーマヨネーズ	6,600	2,166.00	14,295,600
わらべや日洋ホールディングス	7,100	1,978.00	14,043,800
なとり	6,600	2,139.00	14,117,400
イフジ産業	200	1,630.00	326,000
ファーマフーズ	14,000	954.00	13,356,000
ユーグレナ	65,700	415.00	27,265,500
紀文食品	9,200	1,080.00	9,936,000
ピクルスホールディングス	6,200	1,025.00	6,355,000
ミヨシ油脂	500	1,596.00	798,000
理研ビタミン	9,100	2,491.00	22,668,100
片倉工業	9,900	1,943.00	19,235,700
ゲンゼ	7,700	5,170.00	39,809,000
東洋紡	46,600	949.00	44,223,400
ユニチカ	35,200	165.00	5,808,000
富士紡ホールディングス	4,300	5,420.00	23,306,000
倉敷紡績	7,600	5,550.00	42,180,000
シキボウ	6,600	994.00	6,560,400
日本毛織	27,600	1,273.00	35,134,800
トーア紡コーポレーション	500	418.00	209,000

帝国繊維	12,200	2,424.00	29,572,800
帝人	103,400	1,306.50	135,092,100
東レ	786,500	964.70	758,736,550
SUMINOE	300	2,007.00	602,100
日本フェルト	1,200	486.00	583,200
イチカワ	300	1,545.00	463,500
日東製網	200	1,489.00	297,800
アツギ	900	980.00	882,000
ダイニック	400	738.00	295,200
セーレン	20,800	2,829.00	58,843,200
ソトー	400	669.00	267,600
東海染工	100	697.00	69,700
小松マテーレ	15,600	790.00	12,324,000
ワコールホールディングス	22,300	5,196.00	115,870,800
ホギメディカル	14,500	4,805.00	69,672,500
T S Iホールディングス	33,000	976.00	32,208,000
マツオカコーポレーション	300	1,818.00	545,400
ワールド	15,600	2,470.00	38,532,000
三陽商会	5,200	2,821.00	14,669,200
ナイガイ	600	237.00	142,200
オンワードホールディングス	64,900	557.00	36,149,300
ルックホールディングス	3,400	2,530.00	8,602,000
ゴールドウイン	19,100	8,835.00	168,748,500
キング	600	762.00	457,200
ヤマトインターナショナル	1,000	333.00	333,000
特種東海製紙	5,200	3,575.00	18,590,000
王子ホールディングス	407,500	551.50	224,736,250
日本製紙	56,000	876.00	49,056,000
三菱製紙	1,600	476.00	761,600
北越コーポレーション	60,400	1,545.00	93,318,000
中越パルプ工業	500	1,486.00	743,000
大王製紙	54,300	837.00	45,449,100
阿波製紙	300	464.00	139,200
レンゴー	98,000	863.80	84,652,400
トーモク	6,200	2,198.00	13,627,600
ザ・パック	8,000	3,530.00	28,240,000
北の達人コーポレーション	45,300	145.00	6,568,500
クラレ	156,800	2,231.50	349,899,200
旭化成	727,900	1,070.50	779,216,950
共和レザー	800	658.00	526,400
巴川コーポレーション	400	705.00	282,000
レゾナック・ホールディングス	96,600	4,057.00	391,906,200

住友化学	865,400	360.80	312,236,320
住友精化	5,100	4,730.00	24,123,000
日産化学	55,400	5,088.00	281,875,200
ラサ工業	3,800	2,703.00	10,271,400
クレハ	22,300	2,805.00	62,551,500
多木化学	4,200	3,510.00	14,742,000
テイカ	7,800	1,573.00	12,269,400
石原産業	17,800	1,513.00	26,931,400
片倉コープアグリ	500	959.00	479,500
日本曹達	22,800	2,722.00	62,061,600
東ソー	143,600	2,074.00	297,826,400
トクヤマ	34,700	2,658.00	92,232,600
セントラル硝子	13,600	3,260.00	44,336,000
東亜合成	51,700	1,506.50	77,886,050
大阪ソーダ	37,600	1,794.00	67,454,400
関東電化工業	21,300	1,044.00	22,237,200
デンカ	39,100	2,179.00	85,198,900
信越化学工業	964,900	5,524.00	5,330,107,600
日本カーバイド工業	5,200	1,643.00	8,543,600
堺化学工業	7,500	2,618.00	19,635,000
第一稀元素化学工業	11,800	700.00	8,260,000
エア・ウォーター	101,500	1,860.50	188,840,750
日本酸素ホールディングス	104,400	4,380.00	457,272,000
日本化学工業	3,900	2,347.00	9,153,300
東邦アセチレン	1,300	365.00	474,500
日本パーカラライジング	47,900	1,264.00	60,545,600
高压ガス工業	15,600	836.00	13,041,600
チタン工業	200	843.00	168,600
四国化成ホールディングス	12,200	2,158.00	26,327,600
戸田工業	2,400	1,312.00	3,148,800
ステラ ケミファ	5,800	3,950.00	22,910,000
保土谷化学工業	3,400	3,760.00	12,784,000
日本触媒	68,900	1,852.00	127,602,800
大日精化工業	7,500	3,015.00	22,612,500
カネカ	26,500	3,627.00	96,115,500
三菱瓦斯化学	87,300	2,677.50	233,745,750
三井化学	96,800	3,461.00	335,024,800
東京応化工業	51,300	3,561.00	182,679,300
大阪有機化学工業	9,000	2,750.00	24,750,000
三菱ケミカルグループ	786,600	793.20	623,931,120
KHネオケム	19,400	2,097.00	40,681,800
ダイセル	122,400	1,381.50	169,095,600

住友ベークライト	33,900	3,730.00	126,447,000
積水化学工業	214,300	2,389.00	511,962,700
日本ゼオン	83,000	1,401.00	116,283,000
アイカ工業	27,200	3,276.00	89,107,200
U B E	55,500	2,380.00	132,090,000
積水樹脂	14,800	2,115.00	31,302,000
旭有機材	7,200	4,455.00	32,076,000
ニチバン	6,000	1,985.00	11,910,000
リケンテクノス	20,200	1,057.00	21,351,400
大倉工業	5,000	3,030.00	15,150,000
積水化成成品工業	15,100	361.00	5,451,100
群栄化学工業	2,500	2,701.00	6,752,500
タイガースポリマー	600	683.00	409,800
ミライアル	400	1,373.00	549,200
ダイキアクシス	500	719.00	359,500
ダイキョーニシカワ	23,700	611.00	14,480,700
竹本容器	500	858.00	429,000
森六ホールディングス	5,500	2,001.00	11,005,500
恵和	7,000	1,017.00	7,119,000
日本化薬	75,300	1,302.00	98,040,600
カーリット	10,600	1,280.00	13,568,000
日本精化	7,100	2,485.00	17,643,500
扶桑化学工業	10,000	3,435.00	34,350,000
トリケミカル研究所	11,700	2,771.00	32,420,700
A D E K A	37,500	2,776.50	104,118,750
日油	126,600	2,223.50	281,495,100
新日本理化	1,800	200.00	360,000
ハリマ化成グループ	7,700	867.00	6,675,900
花王	262,000	6,571.00	1,721,602,000
第一工業製薬	3,900	3,955.00	15,424,500
石原ケミカル	4,700	2,460.00	11,562,000
日華化学	500	1,157.00	578,500
ニイタカ	200	1,955.00	391,000
三洋化成工業	6,600	4,110.00	27,126,000
有機合成薬品工業	1,000	263.00	263,000
大日本塗料	11,900	1,133.00	13,482,700
日本ペイントホールディングス	476,100	1,095.00	521,329,500
関西ペイント	90,100	2,155.00	194,165,500
神東塗料	1,000	130.00	130,000
中国塗料	22,600	2,336.00	52,793,600
日本特殊塗料	900	1,255.00	1,129,500
藤倉化成	12,700	524.00	6,654,800

太陽ホールディングス	18,800	4,035.00	75,858,000
D I C	38,200	3,438.00	131,331,600
サカティンクス	23,900	1,667.00	39,841,300
a r t i e n c e	19,300	3,150.00	60,795,000
富士フィルムホールディングス	649,500	3,391.00	2,202,454,500
資生堂	224,900	2,813.50	632,756,150
ライオン	137,100	1,834.50	251,509,950
高砂香料工業	7,300	5,720.00	41,756,000
マンダム	21,300	1,291.00	27,498,300
ミルボン	17,300	3,585.00	62,020,500
コーセー	21,900	7,071.00	154,854,900
コタ	10,900	1,602.00	17,461,800
シーボン	200	1,067.00	213,400
ポーラ・オルビスホールディングス	55,200	1,443.50	79,681,200
ノエビアホールディングス	9,600	4,990.00	47,904,000
アジュバンホールディングス	400	824.00	329,600
新日本製薬	6,100	1,923.00	11,730,300
I - n e	3,600	1,998.00	7,192,800
アクシージア	7,100	539.00	3,826,900
エステー	8,500	1,522.00	12,937,000
アグロ カネショウ	3,800	1,896.00	7,204,800
コニシ	31,800	1,332.00	42,357,600
長谷川香料	20,600	3,290.00	67,774,000
小林製薬	28,200	6,014.00	169,594,800
荒川化学工業	9,300	1,135.00	10,555,500
メック	8,900	3,415.00	30,393,500
日本高純度化学	2,500	3,220.00	8,050,000
タカラバイオ	33,900	1,031.00	34,950,900
J C U	11,900	3,920.00	46,648,000
新田ゼラチン	800	751.00	600,800
O A T アグリオ	4,400	1,987.00	8,742,800
デクセリアルズ	94,300	2,517.00	237,353,100
アース製薬	9,800	5,490.00	53,802,000
北興化学工業	9,600	1,327.00	12,739,200
大成ラミック	3,100	2,519.00	7,808,900
クミアイ化学工業	42,800	805.00	34,454,000
日本農薬	16,500	699.00	11,533,500
アキレス	6,400	1,463.00	9,363,200
有沢製作所	16,200	1,438.00	23,295,600
日東電工	340,700	2,473.00	842,551,100
レック	13,800	1,281.00	17,677,800
三光合成	13,600	585.00	7,956,000

きもと	2,000	280.00	560,000
ZACROS	8,500	4,125.00	35,062,500
前澤化成工業	7,100	1,762.00	12,510,200
未来工業	3,900	3,870.00	15,093,000
ウェブロックホールディングス	500	650.00	325,000
JSP	7,700	2,123.00	16,347,100
エフピコ	23,800	2,829.00	67,330,200
天馬	9,000	3,000.00	27,000,000
信越ポリマー	23,200	1,613.00	37,421,600
東リ	3,100	459.00	1,422,900
ニフコ	40,300	3,652.00	147,175,600
バルカー	8,300	3,330.00	27,639,000
ユニ・チャーム	224,400	3,850.00	863,940,000
ショーエイコーポレーション	400	573.00	229,200
協和キリン	126,600	2,483.00	314,347,800
武田薬品工業	958,600	4,114.00	3,943,680,400
アステラス製薬	945,000	1,580.50	1,493,572,500
住友ファーマ	95,900	612.00	58,690,800
塩野義製薬	357,400	2,182.50	780,025,500
わかもと製薬	1,400	235.00	329,000
日本新薬	28,200	4,224.00	119,116,800
中外製薬	337,200	6,737.00	2,271,716,400
科研製薬	18,500	4,336.00	80,216,000
エーザイ	143,000	4,418.00	631,774,000
ロート製薬	113,800	2,807.50	319,493,500
小野薬品工業	220,300	1,720.50	379,026,150
久光製薬	23,900	4,216.00	100,762,400
持田製薬	13,500	3,530.00	47,655,000
参天製薬	204,700	1,708.00	349,627,600
扶桑薬品工業	3,900	2,482.00	9,679,800
日本ケミファ	300	1,515.00	454,500
ツムラ	37,000	4,804.00	177,748,000
キッセイ薬品工業	17,800	3,570.00	63,546,000
生化学工業	18,700	808.00	15,109,600
栄研化学	17,000	2,199.00	37,383,000
鳥居薬品	5,800	4,575.00	26,535,000
JCRファーマ	36,500	686.00	25,039,000
東和薬品	14,500	2,832.00	41,064,000
富士製薬工業	8,000	1,525.00	12,200,000
ゼリア新薬工業	17,100	2,424.00	41,450,400
ネクセラファーマ	50,600	1,120.00	56,672,000
第一三共	1,016,700	4,502.00	4,577,183,400

杏林製薬	23,400	1,480.00	34,632,000
大幸薬品	24,400	335.00	8,174,000
ダイト	8,000	2,112.00	16,896,000
大塚ホールディングス	268,900	8,798.00	2,365,782,200
ペプチドリーム	52,200	2,809.50	146,655,900
セルソース	7,200	1,024.00	7,372,800
あすか製薬ホールディングス	9,800	2,070.00	20,286,000
サワイグループホールディングス	63,400	2,021.00	128,131,400
日本コークス工業	109,300	97.00	10,602,100
ニチレキグループ	11,500	2,488.00	28,612,000
ユシロ化学工業	5,600	2,150.00	12,040,000
ピーピー・カストロール	600	897.00	538,200
富士石油	28,300	285.00	8,065,500
MORESCO	600	1,288.00	772,800
出光興産	503,500	1,015.50	511,304,250
ENEOSホールディングス	1,827,400	805.50	1,471,970,700
コスモエネルギーホールディングス	35,500	6,821.00	242,145,500
横浜ゴム	54,500	3,142.00	171,239,000
TOYO TIRE	61,900	2,406.00	148,931,400
ブリヂストン	315,400	5,327.00	1,680,135,800
住友ゴム工業	105,700	1,719.00	181,698,300
藤倉コンポジット	10,400	1,518.00	15,787,200
オカモト	5,100	5,760.00	29,376,000
フコク	5,800	1,727.00	10,016,600
ニッタ	10,600	3,570.00	37,842,000
住友理工	20,900	1,576.00	32,938,400
三ツ星ベルト	15,000	4,100.00	61,500,000
バンドー化学	16,000	1,876.00	30,016,000
日東紡績	12,100	5,930.00	71,753,000
AGC	104,800	4,681.00	490,568,800
日本板硝子	52,600	343.00	18,041,800
石塚硝子	200	2,326.00	465,200
日本山村硝子	500	1,610.00	805,000
日本電気硝子	40,000	3,415.00	136,600,000
オハラ	5,100	1,213.00	6,186,300
住友大阪セメント	18,300	3,350.00	61,305,000
太平洋セメント	66,500	3,685.00	245,052,500
日本ヒューム	9,400	1,284.00	12,069,600
日本コンクリート工業	20,900	374.00	7,816,600
三谷セキサン	4,500	6,090.00	27,405,000
アジアパイルホールディングス	15,300	797.00	12,194,100
東海カーボン	99,400	922.00	91,646,800

日本カーボン	6,200	4,510.00	27,962,000
東洋炭素	7,600	4,400.00	33,440,000
ノリタケ	11,900	3,755.00	44,684,500
TOTO	78,200	4,214.00	329,534,800
日本碍子	125,300	1,988.00	249,096,400
日本特殊陶業	88,000	4,670.00	410,960,000
MARUWA	4,500	46,230.00	208,035,000
品川リフラクトリーズ	13,300	1,669.00	22,197,700
黒崎播磨	7,300	2,397.00	17,498,100
ヨータイ	5,500	1,556.00	8,558,000
東京窯業	1,500	416.00	624,000
ニッカトー	600	514.00	308,400
フジインコーポレーテッド	29,000	2,454.00	71,166,000
クニミネ工業	400	1,040.00	416,000
エーアンドエーマテリアル	300	1,238.00	371,400
ニチアス	27,200	5,867.00	159,582,400
ニチハ	13,500	2,889.00	39,001,500
日本製鉄	561,200	3,067.00	1,721,200,400
神戸製鋼所	222,900	1,526.50	340,256,850
中山製鋼所	22,800	731.00	16,666,800
合同製鐵	6,200	3,885.00	24,087,000
JFEホールディングス	333,900	1,743.00	581,987,700
東京製鐵	31,000	1,461.00	45,291,000
共英製鋼	10,800	1,805.00	19,494,000
大和工業	20,900	7,558.00	157,962,200
東京鐵鋼	4,900	6,330.00	31,017,000
大阪製鐵	5,100	3,140.00	16,014,000
淀川製鋼所	10,200	5,220.00	53,244,000
中部鋼鈹	7,300	2,241.00	16,359,300
丸一鋼管	33,700	3,590.00	120,983,000
モリ工業	2,200	4,725.00	10,395,000
大同特殊鋼	69,800	1,151.50	80,374,700
日本高周波鋼業	500	362.00	181,000
日本冶金工業	7,500	3,880.00	29,100,000
山陽特殊製鋼	11,000	1,805.00	19,855,000
愛知製鋼	6,400	4,990.00	31,936,000
日本金属	300	642.00	192,600
大平洋金属	9,700	1,439.00	13,958,300
新日本電工	66,200	290.00	19,198,000
栗本鐵工所	5,100	4,030.00	20,553,000
虹技	200	1,200.00	240,000
三菱製鋼	8,200	1,380.00	11,316,000

日亜銅業	1,300	304.00	395,200
日本精線	8,800	1,262.00	11,105,600
エンビプロ・ホールディングス	10,900	406.00	4,425,400
シンニッタン	1,600	202.00	323,200
新家工業	200	4,855.00	971,000
大紀アルミニウム工業所	14,700	1,065.00	15,655,500
日本軽金属ホールディングス	32,700	1,515.00	49,540,500
三井金属鉱業	27,800	4,753.00	132,133,400
三菱マテリアル	79,400	2,432.50	193,140,500
住友金属鉱山	140,300	3,764.00	528,089,200
DOWAホールディングス	30,000	4,533.00	135,990,000
古河機械金属	14,900	1,570.00	23,393,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	19,500	1,801.00	35,119,500
東邦チタニウム	23,400	1,015.00	23,751,000
UACJ	15,600	5,250.00	81,900,000
CKサンエツ	2,800	3,745.00	10,486,000
古河電気工業	37,000	6,415.00	237,355,000
住友電気工業	382,900	2,924.50	1,119,791,050
フジクラ	118,900	5,851.00	695,683,900
SWCC	14,900	7,780.00	115,922,000
カナレ電気	500	1,426.00	713,000
平河ヒューテック	7,400	1,499.00	11,092,600
リョービ	12,000	2,136.00	25,632,000
アーレスティ	2,100	519.00	1,089,900
AREホールディングス	45,100	1,708.00	77,030,800
稲葉製作所	6,200	1,785.00	11,067,000
宮地エンジニアリンググループ	11,400	1,935.00	22,059,000
トーカロ	32,000	1,846.00	59,072,000
アルファC o	500	1,064.00	532,000
SUMCO	211,000	1,234.00	260,374,000
川田テクノロジーズ	7,100	2,678.00	19,013,800
RS Technologies	8,500	3,280.00	27,880,000
ジェイテックコーポレーション	200	1,276.00	255,200
信和	800	744.00	595,200
東洋製罐グループホールディングス	70,600	2,482.00	175,229,200
ホッカンホールディングス	5,500	1,656.00	9,108,000
コロナ	6,200	981.00	6,082,200
横河ブリッジホールディングス	17,700	2,830.00	50,091,000
駒井ハルテック	200	1,535.00	307,000
高田機工	300	1,014.00	304,200
三和ホールディングス	110,400	4,502.00	497,020,800
文化シャッター	29,000	1,856.00	53,824,000

三協立山	13,900	669.00	9,299,100
アルインコ	8,500	1,016.00	8,636,000
東洋シャッター	300	777.00	233,100
L I X I L	161,600	1,723.00	278,436,800
日本フィルコン	800	502.00	401,600
ノーリツ	15,600	1,699.00	26,504,400
長府製作所	12,400	1,888.00	23,411,200
リンナイ	58,900	3,256.00	191,778,400
ダイニチ工業	600	624.00	374,400
日東精工	16,100	630.00	10,143,000
三洋工業	100	2,958.00	295,800
岡部	19,800	781.00	15,463,800
ジーテクト	12,400	1,601.00	19,852,400
東プレ	19,500	1,953.00	38,083,500
高周波熱錬	16,400	972.00	15,940,800
東京製綱	6,500	1,235.00	8,027,500
サンコール	10,400	286.00	2,974,400
モリテック スチール	1,100	166.00	182,600
パイオラックス	13,700	2,484.00	34,030,800
エイチワン	11,400	1,008.00	11,491,200
日本発條	98,000	1,793.00	175,714,000
中央発條	7,200	1,321.00	9,511,200
アドバネクス	200	936.00	187,200
立川ブラインド工業	5,000	1,357.00	6,785,000
日本ドライケミカル	300	3,910.00	1,173,000
日本製鋼所	32,900	6,041.00	198,748,900
三浦工業	50,300	3,840.00	193,152,000
タクマ	36,700	1,619.00	59,417,300
ツガミ	23,100	1,410.00	32,571,000
オークマ	19,000	3,250.00	61,750,000
芝浦機械	14,300	3,560.00	50,908,000
アマダ	150,700	1,489.00	224,392,300
アイダエンジニアリング	24,300	795.00	19,318,500
F U J I	47,200	2,216.50	104,618,800
牧野フライス製作所	12,000	7,170.00	86,040,000
オーエスジー	47,800	1,744.00	83,363,200
ダイジェット工業	300	695.00	208,500
旭ダイヤモンド工業	25,600	814.00	20,838,400
D M G 森精機	68,400	2,577.50	176,301,000
ソディック	28,600	733.00	20,963,800
ディスコ	52,200	41,940.00	2,189,268,000
日東工器	4,400	2,586.00	11,378,400

日進工具	9,100	738.00	6,715,800
パンチ工業	1,300	404.00	525,200
富士ダイス	7,300	775.00	5,657,500
豊和工業	700	1,244.00	870,800
リケンNPR	12,000	2,599.00	31,188,000
東洋機械金属	1,100	636.00	699,600
エンシュウ	400	570.00	228,000
島精機製作所	17,300	1,041.00	18,009,300
オプトラン	17,800	1,849.00	32,912,200
イワキポンプ	7,200	2,561.00	18,439,200
フリュー	10,200	1,108.00	11,301,600
ヤマシンフィルタ	22,900	635.00	14,541,500
日阪製作所	12,100	1,059.00	12,813,900
やまびこ	17,700	2,564.00	45,382,800
野村マイクロ・サイエンス	17,900	1,649.00	29,517,100
平田機工	5,200	5,460.00	28,392,000
P E G A S U S	12,000	434.00	5,208,000
マルマエ	4,700	1,516.00	7,125,200
タツモ	7,800	2,453.00	19,133,400
ナブテスコ	68,100	2,509.50	170,896,950
三井海洋開発	13,700	3,145.00	43,086,500
レオン自動機	11,400	1,451.00	16,541,400
S M C	32,500	63,180.00	2,053,350,000
ホソカワミクロン	7,600	4,205.00	31,958,000
ユニオンツール	4,800	4,930.00	23,664,000
瑞光	7,000	1,257.00	8,799,000
オイレス工業	14,700	2,442.00	35,897,400
日精エー・エス・ビー機械	3,700	5,040.00	18,648,000
サトーホールディングス	13,500	2,291.00	30,928,500
技研製作所	10,200	1,738.00	17,727,600
日本エアーテック	5,100	1,213.00	6,186,300
カワタ	400	799.00	319,600
日精樹脂工業	7,700	923.00	7,107,100
オカダアイヨン	400	1,875.00	750,000
ワイエイシイホールディングス	5,200	1,883.00	9,791,600
小松製作所	534,500	4,216.00	2,253,452,000
住友重機械工業	64,200	3,279.00	210,511,800
日立建機	43,200	3,584.00	154,828,800
日工	16,100	710.00	11,431,000
巴工業	4,200	3,930.00	16,506,000
井関農機	10,200	950.00	9,690,000
T O W A	33,200	1,534.00	50,928,800

丸山製作所	200	2,024.00	404,800
北川鉄工所	4,300	1,210.00	5,203,000
ローツェ	56,700	1,585.50	89,897,850
タカキタ	500	388.00	194,000
クボタ	567,200	1,865.00	1,057,828,000
荏原実業	5,200	4,280.00	22,256,000
三菱化工機	3,800	3,375.00	12,825,000
月島ホールディングス	14,700	1,430.00	21,021,000
帝国電機製作所	7,400	2,730.00	20,202,000
新東工業	22,400	920.00	20,608,000
澁谷工業	10,200	3,755.00	38,301,000
アイチ コーポレーション	15,300	1,392.00	21,297,600
小森コーポレーション	26,700	1,140.00	30,438,000
鶴見製作所	8,300	3,360.00	27,888,000
日本ギア工業	500	468.00	234,000
酒井重工業	3,800	2,332.00	8,861,600
荏原製作所	222,700	2,456.00	546,951,200
西島製作所	9,300	2,341.00	21,771,300
北越工業	10,900	1,783.00	19,434,700
ダイキン工業	141,300	18,460.00	2,608,398,000
オルガノ	16,800	8,320.00	139,776,000
トーヨーカネツ	3,800	4,080.00	15,504,000
栗田工業	60,700	5,655.00	343,258,500
椿本チエイン	49,200	1,855.00	91,266,000
大同工業	500	751.00	375,500
木村化工機	8,300	883.00	7,328,900
アネスト岩田	17,200	1,446.00	24,871,200
ダイフク	183,100	3,430.00	628,033,000
サムコ	2,600	2,630.00	6,838,000
加藤製作所	700	1,398.00	978,600
油研工業	200	2,550.00	510,000
タダノ	62,400	1,161.50	72,477,600
フジテック	34,900	6,062.00	211,563,800
C K D	30,000	2,493.00	74,790,000
平和	36,100	2,101.00	75,846,100
理想科学工業	8,700	3,320.00	28,884,000
S A N K Y O	125,300	2,046.50	256,426,450
日本金銭機械	13,100	1,020.00	13,362,000
マースグループホールディングス	7,300	3,165.00	23,104,500
フクシマガリレイ	7,300	5,260.00	38,398,000
オーイズミ	500	337.00	168,500
ダイコク電機	4,800	3,015.00	14,472,000

竹内製作所	19,700	5,010.00	98,697,000
アマノ	30,800	4,335.00	133,518,000
JUKI	16,800	382.00	6,417,600
ジャノメ	9,400	1,007.00	9,465,800
マックス	13,400	3,350.00	44,890,000
グローリー	28,400	2,570.00	72,988,000
新晃工業	32,700	1,237.00	40,449,900
大和冷機工業	16,600	1,494.00	24,800,400
セガサミーホールディングス	96,900	2,596.00	251,552,400
T P R	13,800	2,321.00	32,029,800
ツバキ・ナカシマ	26,700	507.00	13,536,900
ホシザキ	69,800	6,386.00	445,742,800
大豊工業	9,400	610.00	5,734,000
日本精工	200,900	677.60	136,129,840
N T N	256,700	245.00	62,891,500
ジェイテクト	96,500	1,105.00	106,632,500
不二越	8,000	3,115.00	24,920,000
日本トムソン	29,500	503.00	14,838,500
T H K	62,600	3,579.00	224,045,400
ユーシン精機	8,800	680.00	5,984,000
前澤給装工業	7,800	1,341.00	10,459,800
イーグル工業	12,000	1,932.00	23,184,000
前澤工業	800	1,170.00	936,000
P I L L A R	10,100	4,380.00	44,238,000
キッツ	36,300	1,131.00	41,055,300
マキタ	135,000	4,920.00	664,200,000
三井E & S	55,100	1,532.00	84,413,200
カナデビア	88,900	944.00	83,921,600
三菱重工業	1,897,200	2,256.50	4,281,031,800
I H I	87,000	8,225.00	715,575,000
スター精密	18,300	1,885.00	34,495,500
日清紡ホールディングス	81,600	878.00	71,644,800
イビデン	62,300	4,119.00	256,613,700
コニカミノルタ	242,500	660.10	160,074,250
ブラザー工業	145,000	2,718.00	394,110,000
ミネベアミツミ	188,800	2,569.50	485,121,600
日立製作所	2,793,700	3,973.00	11,099,370,100
三菱電機	1,103,500	2,612.00	2,882,342,000
富士電機	66,000	8,839.00	583,374,000
東洋電機製造	400	1,125.00	450,000
安川電機	117,800	4,125.00	485,925,000
シンフォニアテクノロジー	10,800	5,440.00	58,752,000

明電舎	18,300	3,940.00	72,102,000
オリジン	300	1,142.00	342,600
山洋電気	4,700	8,470.00	39,809,000
デンヨー	8,300	2,816.00	23,372,800
PHCホールディングス	20,400	933.00	19,033,200
KOKUSAI ELECTRIC	75,900	2,309.00	175,253,100
ソシオネクスト	108,100	2,520.00	272,412,000
東芝テック	16,200	3,615.00	58,563,000
芝浦メカトロニクス	7,900	8,150.00	64,385,000
マブチモーター	47,700	2,222.00	105,989,400
ニデック	479,100	2,836.50	1,358,967,150
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,200	300.00	2,160,000
トレックス・セミコンダクター	5,200	1,253.00	6,515,600
東光高岳	6,000	2,069.00	12,414,000
ダブル・スコープ	31,800	277.00	8,808,600
ダイヘン	10,300	7,320.00	75,396,000
ヤーマン	21,300	763.00	16,251,900
JVCケンウッド	85,700	1,601.50	137,248,550
ミマキエンジニアリング	9,100	1,438.00	13,085,800
I-PEX	6,100	2,944.00	17,958,400
大崎電気工業	23,300	822.00	19,152,600
オムロン	99,400	5,164.00	513,301,600
日東工業	14,600	2,887.00	42,150,200
IDEC	16,000	2,420.00	38,720,000
正興電機製作所	500	1,197.00	598,500
不二電機工業	400	1,107.00	442,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	48,500	2,536.50	123,020,250
サクサ	300	2,796.00	838,800
メルコホールディングス	2,500	2,100.00	5,250,000
テクノメディカ	2,700	1,814.00	4,897,800
日本電気	153,400	12,765.00	1,958,151,000
富士通	998,300	2,800.00	2,795,240,000
沖電気工業	50,200	968.00	48,593,600
電気興業	4,400	1,666.00	7,330,400
サンケン電気	11,100	6,163.00	68,409,300
ナカヨ	400	1,115.00	446,000
アイホン	6,000	2,771.00	16,626,000
ルネサスエレクトロニクス	826,600	2,045.00	1,690,397,000
セイコーエプソン	139,200	2,802.50	390,108,000
ワコム	76,400	733.00	56,001,200
アルバック	23,800	6,385.00	151,963,000
アクセル	5,500	1,251.00	6,880,500

E I Z O	14,100	2,267.00	31,964,700
日本信号	24,700	920.00	22,724,000
京三製作所	23,200	536.00	12,435,200
能美防災	14,700	3,135.00	46,084,500
ホーチキ	7,000	2,479.00	17,353,000
星和電機	800	542.00	433,600
エレコム	26,000	1,453.00	37,778,000
パナソニック ホールディングス	1,281,700	1,507.00	1,931,521,900
シャープ	156,800	951.80	149,242,240
アンリツ	76,400	1,194.50	91,259,800
富士通ゼネラル	30,800	2,121.00	65,326,800
ソニーグループ	3,761,600	3,338.00	12,556,220,800
T D K	937,100	2,012.50	1,885,913,750
帝国通信工業	4,800	2,696.00	12,940,800
タムラ製作所	43,200	499.00	21,556,800
アルプスアルパイン	88,200	1,603.50	141,428,700
池上通信機	400	632.00	252,800
日本電波工業	10,400	902.00	9,380,800
鈴木	5,900	1,825.00	10,767,500
メイコー	10,800	8,940.00	96,552,000
日本トリム	2,500	3,620.00	9,050,000
フォスター電機	11,000	1,458.00	16,038,000
S M K	2,600	2,432.00	6,323,200
ヨコオ	9,700	1,728.00	16,761,600
ホシデン	27,200	2,234.00	60,764,800
ヒロセ電機	15,800	18,490.00	292,142,000
日本航空電子工業	28,200	2,653.00	74,814,600
T O A	11,000	920.00	10,120,000
マクセル	22,000	1,708.00	37,576,000
古野電気	12,900	2,637.00	34,017,300
スミダコーポレーション	14,800	972.00	14,385,600
アイコム	4,200	2,761.00	11,596,200
リオン	4,500	2,676.00	12,042,000
横河電機	118,700	3,529.00	418,892,300
新電元工業	4,200	2,350.00	9,870,000
アズビル	295,600	1,213.00	358,562,800
東亜ディーケーケー	800	732.00	585,600
日本光電工業	96,200	2,106.50	202,645,300
チノー	4,500	2,144.00	9,648,000
共和電業	1,200	430.00	516,000
日本電子材料	6,600	2,101.00	13,866,600
堀場製作所	20,400	9,135.00	186,354,000

アドバンテスト	338,500	8,478.00	2,869,803,000
小野測器	800	581.00	464,800
エスベック	8,800	2,697.00	23,733,600
キーエンス	107,500	65,600.00	7,052,000,000
日置電機	5,700	7,450.00	42,465,000
シスメックス	278,100	3,092.00	859,885,200
日本マイクロニクス	17,700	3,610.00	63,897,000
メガチップス	8,300	6,140.00	50,962,000
O B A R A G R O U P	6,700	4,175.00	27,972,500
澤藤電機	300	905.00	271,500
原田工業	900	527.00	474,300
コーセル	11,600	1,202.00	13,943,200
イリソ電子工業	10,200	2,745.00	27,999,000
オブテックスグループ	19,800	1,751.00	34,669,800
千代田インテグレ	3,800	3,685.00	14,003,000
レーザーテック	49,200	15,825.00	778,590,000
スタンレー電気	67,300	2,567.50	172,792,750
ウシオ電機	47,600	2,017.00	96,009,200
岡谷電機産業	1,600	224.00	358,400
ヘリオス テクノ ホールディング	1,400	951.00	1,331,400
エノモト	500	1,445.00	722,500
日本セラミック	9,900	2,648.00	26,215,200
遠藤照明	700	1,492.00	1,044,400
古河電池	8,000	1,372.00	10,976,000
山一電機	8,800	2,324.00	20,451,200
図研	9,200	4,300.00	39,560,000
日本電子	24,900	5,473.00	136,277,700
カシオ計算機	85,900	1,255.50	107,847,450
ファナック	519,800	4,130.00	2,146,774,000
日本シイエムケイ	26,100	411.00	10,727,100
エンプラス	3,200	5,130.00	16,416,000
大真空	13,400	544.00	7,289,600
ローム	194,700	1,460.00	284,262,000
浜松ホトニクス	172,500	1,858.50	320,591,250
三井ハイテック	47,700	780.00	37,206,000
新光電気工業	38,000	5,481.00	208,278,000
京セラ	667,500	1,552.00	1,035,960,000
太陽誘電	47,100	2,227.00	104,891,700
村田製作所	959,600	2,529.00	2,426,828,400
双葉電子工業	20,800	473.00	9,838,400
北陸電気工業	500	1,560.00	780,000
ニチコン	28,300	1,041.00	29,460,300

日本ケミコン	11,800	1,006.00	11,870,800
K O A	16,800	1,000.00	16,800,000
市光工業	19,700	402.00	7,919,400
小糸製作所	111,400	1,987.00	221,351,800
ミツバ	20,100	889.00	17,868,900
S C R E E Nホールディングス	44,900	9,685.00	434,856,500
キャノン電子	10,200	2,545.00	25,959,000
キャノン	535,800	5,019.00	2,689,180,200
リコー	282,900	1,771.50	501,157,350
象印マホービン	32,200	1,599.00	51,487,800
M U T O Hホールディングス	200	2,467.00	493,400
東京エレクトロン	227,300	24,600.00	5,591,580,000
イノテック	7,400	1,389.00	10,278,600
トヨタ紡織	45,200	1,998.50	90,332,200
芦森工業	200	2,516.00	503,200
ユニプレス	19,300	1,017.00	19,628,100
豊田自動織機	91,600	11,170.00	1,023,172,000
モリタホールディングス	17,000	2,107.00	35,819,000
三櫻工業	14,900	728.00	10,847,200
デンソー	1,139,400	2,163.00	2,464,522,200
東海理化電機製作所	30,300	2,195.00	66,508,500
川崎重工業	80,900	6,097.00	493,247,300
名村造船所	30,700	1,515.00	46,510,500
日本車輛製造	3,600	2,285.00	8,226,000
三菱ロジスネクスト	17,200	1,875.00	32,250,000
近畿車輛	200	1,396.00	279,200
日産自動車	1,341,900	366.00	491,135,400
いすゞ自動車	331,800	2,101.00	697,111,800
トヨタ自動車	5,710,100	2,679.50	15,300,212,950
日野自動車	161,600	436.30	70,506,080
三菱自動車工業	419,000	417.50	174,932,500
エフテック	900	484.00	435,600
レシップホールディングス	700	493.00	345,100
G M B	300	1,004.00	301,200
ファルテック	200	421.00	84,200
武蔵精密工業	26,300	3,930.00	103,359,000
日産車体	16,300	1,038.00	16,919,400
新明和工業	30,900	1,319.00	40,757,100
極東開発工業	14,500	2,312.00	33,524,000
トピー工業	8,700	1,923.00	16,730,100
ティラド	2,400	3,515.00	8,436,000
曙ブレーキ工業	65,600	116.00	7,609,600

タチエス	19,800	1,732.00	34,293,600
NOK	41,700	2,320.00	96,744,000
フタバ産業	29,500	688.00	20,296,000
カヤバ	18,200	2,660.00	48,412,000
大同メタル工業	21,000	478.00	10,038,000
プレス工業	42,000	545.00	22,890,000
ミクニ	1,500	317.00	475,500
太平洋工業	24,600	1,355.00	33,333,000
アイシン	227,500	1,713.00	389,707,500
マツダ	329,900	983.50	324,456,650
今仙電機製作所	800	498.00	398,400
本田技研工業	2,545,100	1,314.50	3,345,533,950
スズキ	868,100	1,696.50	1,472,731,650
S U B A R U	323,700	2,487.00	805,041,900
安永	600	480.00	288,000
ヤマハ発動機	453,500	1,354.50	614,265,750
T B K	1,400	263.00	368,200
エクセディ	17,600	4,575.00	80,520,000
豊田合成	30,800	2,601.00	80,110,800
愛三工業	18,200	1,541.00	28,046,200
盟和産業	200	1,276.00	255,200
日本プラスト	1,000	342.00	342,000
ヨロズ	10,300	1,178.00	12,133,400
エフ・シー・シー	18,800	3,110.00	58,468,000
シマノ	46,700	21,285.00	994,009,500
テイ・エス テック	43,700	1,687.00	73,721,900
ジャムコ	6,500	1,475.00	9,587,500
リガク・ホールディングス	54,300	967.00	52,508,100
テルモ	718,500	3,026.00	2,174,181,000
クリエートメディック	400	914.00	365,600
日機装	27,800	947.00	26,326,600
日本エム・ディ・エム	8,500	606.00	5,151,000
島津製作所	154,600	4,412.00	682,095,200
J M S	9,900	433.00	4,286,700
長野計器	7,000	2,450.00	17,150,000
ブイ・テクノロジー	5,300	2,239.00	11,866,700
東京計器	7,500	3,285.00	24,637,500
愛知時計電機	4,800	1,994.00	9,571,200
インターアクション	6,500	996.00	6,474,000
オーバル	1,200	367.00	440,400
東京精密	22,000	7,387.00	162,514,000
マニー	43,000	1,799.50	77,378,500

ニコン	169,400	1,656.50	280,611,100
トプコン	61,000	2,156.50	131,546,500
オリンパス	615,000	2,371.50	1,458,472,500
理研計器	15,200	3,825.00	58,140,000
タムロン	14,800	4,150.00	61,420,000
H O Y A	209,700	20,385.00	4,274,734,500
シード	1,000	468.00	468,000
ノーリツ鋼機	10,200	4,650.00	47,430,000
A & Dホロンホールディングス	13,400	2,038.00	27,309,200
朝日インテック	130,900	2,618.50	342,761,650
シチズン時計	98,800	904.00	89,315,200
リズム	300	3,790.00	1,137,000
大研医器	1,200	514.00	616,800
メニコン	37,800	1,524.00	57,607,200
シンシア	100	527.00	52,700
松風	9,900	2,103.00	20,819,700
セイコーグループ	16,600	4,365.00	72,459,000
ニプロ	89,500	1,393.00	124,673,500
三井松島ホールディングス	7,300	3,485.00	25,440,500
K Y O R I T S U	1,800	160.00	288,000
中本パックス	500	1,810.00	905,000
パラマウントベッドホールディングス	24,800	2,599.00	64,455,200
トランザクション	7,100	2,250.00	15,975,000
粧美堂	300	513.00	153,900
ニホンフラッシュ	9,100	821.00	7,471,100
前田工織	19,100	1,777.00	33,940,700
永大産業	1,800	210.00	378,000
アートネイチャー	9,900	815.00	8,068,500
フルヤ金属	10,200	3,585.00	36,567,000
バンダイナムコホールディングス	291,600	3,299.00	961,988,400
アイフィスジャパン	300	566.00	169,800
S H O E I	30,200	2,342.00	70,728,400
フランスベッドホールディングス	14,200	1,254.00	17,806,800
パイロットコーポレーション	16,800	4,793.00	80,522,400
萩原工業	7,200	1,427.00	10,274,400
フジシールインターナショナル	24,200	2,523.00	61,056,600
タカラトミー	45,100	4,350.00	196,185,000
広済堂ホールディングス	35,500	550.00	19,525,000
エステールホールディングス	400	600.00	240,000
タカノ	400	698.00	279,200
プロネクサス	10,700	1,285.00	13,749,500
ホクシン	900	101.00	90,900

ウッドワン	400	871.00	348,400
TOPPANホールディングス	140,800	4,066.00	572,492,800
大日本印刷	222,700	2,239.00	498,625,300
共同印刷	3,000	3,985.00	11,955,000
NISSHA	18,400	1,587.00	29,200,800
光村印刷	200	1,434.00	286,800
TAKARA & COMPANY	6,300	2,951.00	18,591,300
アシックス	396,600	3,037.00	1,204,474,200
ツツミ	2,100	2,100.00	4,410,000
ローランド	7,900	4,095.00	32,350,500
小松ウオール工業	7,900	1,532.00	12,102,800
ヤマハ	196,300	1,105.50	217,009,650
河合楽器製作所	3,300	3,030.00	9,999,000
クリナップ	10,500	673.00	7,066,500
ピジョン	68,400	1,519.50	103,933,800
キングジム	9,500	860.00	8,170,000
リンテック	21,600	3,060.00	66,096,000
イトーキ	21,400	1,615.00	34,561,000
任天堂	678,200	9,037.00	6,128,893,400
三菱鉛筆	14,900	2,388.00	35,581,200
タカラスタANDARD	22,500	1,657.00	37,282,500
コクヨ	53,700	2,861.00	153,635,700
ナカバヤシ	11,600	507.00	5,881,200
グローブライド	9,900	1,905.00	18,859,500
オカムラ	32,300	2,014.00	65,052,200
美津濃	10,700	8,680.00	92,876,000
グリムス	4,800	2,615.00	12,552,000
東京電力ホールディングス	903,700	506.50	457,724,050
中部電力	395,800	1,577.50	624,374,500
関西電力	523,200	1,794.00	938,620,800
中国電力	186,600	894.00	166,820,400
北陸電力	109,800	865.50	95,031,900
東北電力	282,800	1,201.50	339,784,200
四国電力	100,000	1,216.50	121,650,000
九州電力	247,600	1,428.50	353,696,600
北海道電力	112,400	814.60	91,561,040
沖縄電力	27,400	954.00	26,139,600
電源開発	80,900	2,459.00	198,933,100
エフオン	7,800	405.00	3,159,000
イーレックス	19,600	629.00	12,328,400
レノバ	29,300	753.00	22,062,900
東京瓦斯	203,000	4,445.00	902,335,000

大阪瓦斯	210,900	3,163.00	667,076,700
東邦瓦斯	42,300	3,852.00	162,939,600
北海道瓦斯	32,100	537.00	17,237,700
広島ガス	22,700	375.00	8,512,500
西部ガスホールディングス	11,200	1,703.00	19,073,600
静岡ガス	24,500	1,004.00	24,598,000
メタウォーター	13,200	1,800.00	23,760,000
SBSホールディングス	9,600	2,380.00	22,848,000
東武鉄道	113,200	2,520.00	285,264,000
相鉄ホールディングス	35,500	2,454.50	87,134,750
東急	301,200	1,693.50	510,082,200
京浜急行電鉄	132,900	1,279.50	170,045,550
小田急電鉄	177,600	1,492.00	264,979,200
京王電鉄	56,800	4,013.00	227,938,400
京成電鉄	62,300	4,255.00	265,086,500
富士急行	13,200	2,338.00	30,861,600
東日本旅客鉄道	592,400	2,793.00	1,654,573,200
西日本旅客鉄道	274,400	2,793.50	766,536,400
東海旅客鉄道	413,700	2,989.50	1,236,756,150
東京地下鉄	179,500	1,623.00	291,328,500
西武ホールディングス	116,900	3,033.00	354,557,700
鴻池運輸	18,300	3,005.00	54,991,500
西日本鉄道	31,100	2,224.00	69,166,400
ハマキョウレックス	36,700	1,288.00	47,269,600
サカイ引越センター	12,200	2,469.00	30,121,800
近鉄グループホールディングス	114,900	3,213.00	369,173,700
阪急阪神ホールディングス	143,000	4,134.00	591,162,000
南海電気鉄道	47,800	2,458.00	117,492,400
京阪ホールディングス	59,100	3,397.00	200,762,700
神戸電鉄	2,900	2,315.00	6,713,500
名古屋鉄道	118,500	1,729.50	204,945,750
山陽電気鉄道	8,100	2,027.00	16,418,700
ヤマトホールディングス	130,300	1,805.00	235,191,500
山九	25,900	5,194.00	134,524,600
丸運	700	451.00	315,700
丸全昭和運輸	6,600	5,960.00	39,336,000
センコーグループホールディングス	63,100	1,486.00	93,766,600
トナミホールディングス	2,400	5,840.00	14,016,000
ニッコンホールディングス	61,000	2,025.50	123,555,500
日本石油輸送	200	2,840.00	568,000
福山通運	11,500	3,705.00	42,607,500
セイノーホールディングス	52,800	2,444.00	129,043,200

神奈川中央交通	3,000	3,800.00	11,400,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	33,300	1,097.00	36,530,100
九州旅客鉄道	82,100	3,922.00	321,996,200
S Gホールディングス	180,100	1,494.00	269,069,400
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	38,400	7,737.00	297,100,800
日本郵船	222,200	4,928.00	1,095,001,600
商船三井	203,900	5,168.00	1,053,755,200
川崎汽船	244,100	2,087.50	509,558,750
N Sユナイテッド海運	6,000	4,025.00	24,150,000
飯野海運	39,500	1,136.00	44,872,000
共栄タンカー	300	1,080.00	324,000
乾汽船	13,100	1,548.00	20,278,800
日本航空	245,800	2,571.50	632,074,700
A N Aホールディングス	291,800	2,959.50	863,582,100
日新	7,300	4,290.00	31,317,000
三菱倉庫	111,900	1,172.50	131,202,750
三井倉庫ホールディングス	11,000	7,370.00	81,070,000
住友倉庫	31,800	2,766.00	87,958,800
澁澤倉庫	4,900	3,115.00	15,263,500
東陽倉庫	300	1,442.00	432,600
日本トランスシティ	21,600	1,053.00	22,744,800
ケイヒン	200	1,995.00	399,000
中央倉庫	5,900	1,552.00	9,156,800
川西倉庫	400	1,056.00	422,400
安田倉庫	7,300	1,748.00	12,760,400
ファイズホールディングス	200	908.00	181,600
東洋埠頭	300	1,266.00	379,800
上組	49,500	3,466.00	171,567,000
サンリツ	300	788.00	236,400
キムラユニティー	600	1,465.00	879,000
キューソー流通システム	7,100	2,292.00	16,273,200
東海運	700	331.00	231,700
エーアイティー	6,700	1,765.00	11,825,500
内外トランスライン	4,300	2,820.00	12,126,000
日本コンセプト	3,900	1,881.00	7,335,900
N E C ネットエスアイ	42,900	3,250.00	139,425,000
クロスキャット	6,200	1,084.00	6,720,800
システナ	154,000	356.00	54,824,000
デジタルアーツ	6,800	6,210.00	42,228,000
日鉄ソリューションズ	36,800	4,119.00	151,579,200
キューブシステム	5,700	1,066.00	6,076,200
コア	4,800	1,797.00	8,625,600

手間いらず	1,800	3,540.00	6,372,000
ラクーンホールディングス	8,000	727.00	5,816,000
ソリトンシステムズ	5,600	1,178.00	6,596,800
ソフトクリエイティブホールディングス	7,700	2,240.00	17,248,000
T I S	113,900	3,904.00	444,665,600
テクミラホールディングス	600	320.00	192,000
グリー	36,100	458.00	16,533,800
G M O ペパボ	1,300	1,589.00	2,065,700
コーエーテクモホールディングス	81,000	1,764.00	142,884,000
三菱総合研究所	5,300	4,390.00	23,267,000
電算	100	1,432.00	143,200
A G S	500	801.00	400,500
ファインデックス	8,600	840.00	7,224,000
ブレインパッド	9,000	1,176.00	10,584,000
K L a b	26,500	169.00	4,478,500
ポルトゥウィンホールディングス	15,300	496.00	7,588,800
ネクソン	236,700	2,194.50	519,438,150
アイスタイル	36,000	448.00	16,128,000
エムアップホールディングス	13,200	1,609.00	21,238,800
エイチーム	7,200	955.00	6,876,000
セルシス	15,300	1,411.00	21,588,300
エニグモ	12,000	296.00	3,552,000
テクノスジャパン	1,100	782.00	860,200
コロプラ	36,600	475.00	17,385,000
ブロードリーフ	43,300	679.00	29,400,700
クロス・マーケティンググループ	600	717.00	430,200
デジタルハーツホールディングス	6,900	797.00	5,499,300
メディアドゥ	4,900	1,355.00	6,639,500
じげん	26,900	504.00	13,557,600
ブイキューブ	14,800	225.00	3,330,000
エンカレッジ・テクノロジー	300	579.00	173,700
サイバーリンクス	500	757.00	378,500
フィックスターズ	10,800	1,732.00	18,705,600
C A R T A H O L D I N G S	6,100	1,466.00	8,942,600
オブティム	11,100	727.00	8,069,700
セレス	4,900	3,255.00	15,949,500
S H I F T	7,200	17,705.00	127,476,000
セック	1,700	4,030.00	6,851,000
テクマトリックス	23,200	2,488.00	57,721,600
プロシップ	4,700	1,567.00	7,364,900
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	26,700	3,056.00	81,595,200
G M O ペイメントゲートウェイ	24,600	8,539.00	210,059,400

ザッパラス	300	419.00	125,700
システムリサーチ	7,400	1,419.00	10,500,600
インターネットイニシアティブ	58,900	3,100.00	182,590,000
さくらインターネット	16,800	4,740.00	79,632,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,300	2,529.00	8,345,700
SRAホールディングス	5,600	4,360.00	24,416,000
システムインテグレータ	400	303.00	121,200
朝日ネット	11,600	647.00	7,505,200
eBASE	15,200	655.00	9,956,000
アバントグループ	13,600	1,971.00	26,805,600
アドソル日進	4,500	2,154.00	9,693,000
ODKソリューションズ	400	557.00	222,800
フリービット	4,700	1,391.00	6,537,700
コムチュア	14,200	2,173.00	30,856,600
アステリア	8,400	485.00	4,074,000
アイル	6,000	2,889.00	17,334,000
マークラインズ	6,400	2,214.00	14,169,600
メディカル・データ・ビジョン	12,900	405.00	5,224,500
gumi	17,500	383.00	6,702,500
ショーケース	300	347.00	104,100
モバイルファクトリー	300	948.00	284,400
テラスカイ	4,200	2,012.00	8,450,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,600	2,212.00	12,387,200
PCIホールディングス	100	937.00	93,700
アイビーシー	200	682.00	136,400
ネオジャパン	2,800	1,929.00	5,401,200
PR TIMES	2,200	1,569.00	3,451,800
ラクス	51,000	1,998.00	101,898,000
ランドコンピュータ	600	666.00	399,600
ダブルスタンダード	3,400	1,634.00	5,555,600
オープンドア	6,400	672.00	4,300,800
アカツキ	5,200	2,555.00	13,286,000
ベネフィットジャパン	200	1,069.00	213,800
Ubicomホールディングス	3,400	1,285.00	4,369,000
カナミックネットワーク	13,500	491.00	6,628,500
ノムラシステムコーポレーション	1,300	125.00	162,500
チェンジホールディングス	24,300	1,287.00	31,274,100
シンクロ・フード	800	418.00	334,400
オークネット	5,000	2,619.00	13,095,000
キャピタル・アセット・プランニング	200	748.00	149,600
セグエグループ	1,100	640.00	704,000
エイトレッド	300	1,554.00	466,200

マクロミル	21,100	1,180.00	24,898,000
ビーグリー	200	1,609.00	321,800
オロ	4,500	2,528.00	11,376,000
ユーザーローカル	4,600	1,928.00	8,868,800
テモナ	300	189.00	56,700
ニーズウェル	1,300	294.00	382,200
PKSHA Technology	8,700	3,965.00	34,495,500
マネーフォワード	26,400	5,008.00	132,211,200
サインポスト	600	448.00	268,800
Sun Asterisk	7,700	719.00	5,536,300
プラスアルファ・コンサルティング	13,700	1,832.00	25,098,400
電算システムホールディングス	4,800	2,446.00	11,740,800
Appier Group	32,800	1,334.00	43,755,200
ビジョナル	12,800	8,501.00	108,812,800
ソルクシーズ	1,000	338.00	338,000
フェイス	500	1,216.00	608,000
ハイマックス	3,500	1,365.00	4,777,500
野村総合研究所	233,500	4,642.00	1,083,907,000
CEホールディングス	600	567.00	340,200
日本システム技術	9,000	1,970.00	17,730,000
インテージホールディングス	12,200	1,636.00	19,959,200
東邦システムサイエンス	4,300	1,378.00	5,925,400
ソースネクスト	50,400	186.00	9,374,400
シンプレクス・ホールディングス	21,100	2,552.00	53,847,200
HEROZ	4,200	971.00	4,078,200
ラクスル	26,100	1,132.00	29,545,200
メルカリ	52,600	1,882.50	99,019,500
I P S	3,100	2,545.00	7,889,500
F I G	1,400	304.00	425,600
システムサポート	4,200	1,841.00	7,732,200
イーソル	7,200	609.00	4,384,800
東海ソフト	200	1,368.00	273,600
ウイングアーク1st	11,200	3,490.00	39,088,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,600	839.00	3,020,400
サーバーワークス	1,900	2,318.00	4,404,200
東名	200	2,270.00	454,000
ヴィッツ	200	960.00	192,000
トビラシステムズ	300	845.00	253,500
Sansan	35,500	2,289.00	81,259,500
Link-Uグループ	300	459.00	137,700
ギフトィ	9,500	1,315.00	12,492,500
メドレー	11,800	4,005.00	47,259,000

ベース	5,300	3,160.00	16,748,000
JMDC	13,100	4,060.00	53,186,000
フォーカスシステムズ	7,200	1,110.00	7,992,000
クレスコ	17,700	1,215.00	21,505,500
フジ・メディア・ホールディングス	103,500	1,734.00	179,469,000
オービック	200,000	4,956.00	991,200,000
ジャストシステム	15,500	3,595.00	55,722,500
TDCソフト	18,200	1,381.00	25,134,200
LINEヤフー	1,723,100	433.60	747,136,160
トレンドマイクロ	56,600	8,478.00	479,854,800
IDホールディングス	7,300	1,620.00	11,826,000
日本オラクル	20,600	14,710.00	303,026,000
アルファシステムズ	2,900	3,440.00	9,976,000
フューチャー	26,800	1,897.00	50,839,600
CAC Holdings	6,600	1,714.00	11,312,400
トーセ	500	612.00	306,000
オービックビジネスコンサルタント	18,200	7,253.00	132,004,600
アイティフォー	12,600	1,443.00	18,181,800
東計電算	3,000	4,410.00	13,230,000
エクスネット	200	1,494.00	298,800
大塚商会	122,100	3,674.00	448,595,400
サイボウズ	14,800	2,063.00	30,532,400
電通総研	10,500	5,760.00	60,480,000
ACCESS	11,200	895.00	10,024,000
デジタルガレージ	17,200	3,755.00	64,586,000
EMシステムズ	18,000	794.00	14,292,000
ウェザーニューズ	6,600	3,130.00	20,658,000
CIJ	26,800	457.00	12,247,600
ビジネスエンジニアリング	2,500	3,950.00	9,875,000
日本エンタープライズ	1,300	124.00	161,200
WOWOW	8,100	1,004.00	8,132,400
スカラ	10,000	428.00	4,280,000
インテリジェント ウェイブ	600	1,064.00	638,400
ANYCOLOR	14,600	2,270.00	33,142,000
IMAGICA GROUP	10,800	519.00	5,605,200
ネットワンシステムズ	45,300	4,478.00	202,853,400
システムソフト	37,500	59.00	2,212,500
アルゴグラフィックス	9,900	5,010.00	49,599,000
マーベラス	17,900	577.00	10,328,300
エイベックス	18,800	1,516.00	28,500,800
BIPROGY	36,400	4,617.00	168,058,800
都築電気	5,800	2,662.00	15,439,600

TBSホールディングス	54,200	3,872.00	209,862,400
日本テレビホールディングス	95,400	2,579.50	246,084,300
朝日放送グループホールディングス	10,100	624.00	6,302,400
テレビ朝日ホールディングス	26,200	2,229.00	58,399,800
スカパーJ S A Tホールディングス	83,700	890.00	74,493,000
テレビ東京ホールディングス	6,600	3,020.00	19,932,000
日本BS放送	400	889.00	355,600
ビジョン	16,100	1,356.00	21,831,600
スマートバリュー	400	302.00	120,800
U-NEXT HOLDINGS	36,300	1,679.00	60,947,700
ワイヤレスゲート	600	218.00	130,800
日本通信	86,700	138.00	11,964,600
クロップス	300	1,014.00	304,200
日本電信電話	32,045,200	155.00	4,967,006,000
KDDI	792,400	4,948.00	3,920,795,200
ソフトバンク	17,236,900	198.10	3,414,629,890
光通信	12,400	33,940.00	420,856,000
エムティーアイ	7,400	1,247.00	9,227,800
GMOインターネットグループ	35,100	2,734.50	95,980,950
ファイバーゲート	5,800	938.00	5,440,400
アйдママーケティングコミュニケーション	300	224.00	67,200
KADOKAWA	57,000	4,404.00	251,028,000
学研ホールディングス	19,700	1,014.00	19,975,800
ゼンリン	18,400	815.00	14,996,000
昭文社ホールディングス	500	391.00	195,500
インプレスホールディングス	1,200	145.00	174,000
アイネット	6,500	1,644.00	10,686,000
松竹	6,200	11,120.00	68,944,000
東宝	67,400	6,492.00	437,560,800
東映	17,800	5,990.00	106,622,000
NTTデータグループ	281,700	2,989.00	842,001,300
ピー・シー・エー	6,300	2,210.00	13,923,000
ビジネスブレイン太田昭和	4,300	2,143.00	9,214,900
DTS	19,500	4,220.00	82,290,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	54,100	6,198.00	335,311,800
シーイーシー	13,600	1,967.00	26,751,200
カブコン	214,100	3,535.00	756,843,500
アイ・エス・ビー	5,100	1,408.00	7,180,800
SCSK	88,000	3,115.00	274,120,000
NSW	4,800	3,075.00	14,760,000
アイネス	8,400	1,782.00	14,968,800
TKC	19,200	4,060.00	77,952,000

富士ソフト	29,900	9,530.00	284,947,000
N S D	41,500	3,512.00	145,748,000
コナミグループ	40,300	15,170.00	611,351,000
福井コンピュータホールディングス	6,800	3,085.00	20,978,000
J B C Cホールディングス	7,100	4,625.00	32,837,500
ミロク情報サービス	9,800	1,955.00	19,159,000
ソフトバンクグループ	531,400	9,269.00	4,925,546,600
リョーサン菱洋ホールディングス	19,200	2,282.00	43,814,400
高千穂交易	4,000	3,765.00	15,060,000
オルパヘルスケアホールディングス	200	2,024.00	404,800
伊藤忠食品	2,600	6,890.00	17,914,000
エレマテック	10,200	2,386.00	24,337,200
あらた	17,400	3,045.00	52,983,000
トーメンデバイス	1,600	6,680.00	10,688,000
東京エレクトロン デバイス	11,300	2,974.00	33,606,200
円谷フィールズホールディングス	18,400	1,975.00	36,340,000
双日	126,500	3,150.00	398,475,000
アルフレッサ ホールディングス	105,900	2,202.00	233,191,800
横浜冷凍	28,600	820.00	23,452,000
ラサ商事	5,100	1,356.00	6,915,600
アルコニックス	15,300	1,476.00	22,582,800
神戸物産	87,900	3,637.00	319,692,300
ハイパー	300	285.00	85,500
あい ホールディングス	18,200	2,134.00	38,838,800
ディーブイエックス	300	899.00	269,700
ダイワボウホールディングス	50,300	3,115.00	156,684,500
マクニカホールディングス	88,000	1,748.00	153,824,000
ラクト・ジャパン	4,800	2,770.00	13,296,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	15,600	1,196.00	18,657,600
八洲電機	9,200	1,566.00	14,407,200
メディアスホールディングス	6,600	846.00	5,583,600
レスター	9,700	2,450.00	23,765,000
ジオリーブグループ	300	1,071.00	321,300
大光	700	592.00	414,400
O C H Iホールディングス	300	1,320.00	396,000
T O K A Iホールディングス	61,700	941.00	58,059,700
黒谷	400	560.00	224,000
C o m i n i x	300	901.00	270,300
三洋貿易	11,700	1,571.00	18,380,700
ビューティガレージ	3,600	1,297.00	4,669,200
ウイン・パートナーズ	7,500	1,247.00	9,352,500
ミタチ産業	400	1,201.00	480,400

シップヘルスケアホールディングス	44,900	2,205.50	99,026,950
明治電機工業	4,200	1,369.00	5,749,800
デリカフーズホールディングス	600	497.00	298,200
スターティアホールディングス	400	2,152.00	860,800
コメダホールディングス	28,500	2,877.00	81,994,500
ピーバンドットコム	200	365.00	73,000
アセンテック	4,400	866.00	3,810,400
富士興産	400	1,405.00	562,000
協栄産業	100	2,304.00	230,400
フルサト・マルカホールディングス	9,100	2,267.00	20,629,700
ヤマエグループホールディングス	10,200	1,968.00	20,073,600
小野建	11,700	1,492.00	17,456,400
南陽	500	1,103.00	551,500
佐島電機	7,900	1,780.00	14,062,000
エコートレーディング	300	938.00	281,400
伯東	6,500	4,260.00	27,690,000
コンドーテック	8,700	1,330.00	11,571,000
中山福	1,000	362.00	362,000
ナガイレーベン	14,400	2,200.00	31,680,000
三菱食品	10,500	4,930.00	51,765,000
松田産業	8,600	3,045.00	26,187,000
第一興商	44,000	1,915.00	84,260,000
メディバルホールディングス	123,300	2,376.50	293,022,450
S P K	4,700	2,054.00	9,653,800
萩原電気ホールディングス	4,900	3,140.00	15,386,000
アズワン	35,200	2,801.50	98,612,800
スズデン	4,100	1,830.00	7,503,000
尾家産業	300	2,000.00	600,000
シモジマ	7,600	1,282.00	9,743,200
ドウシシャ	10,500	2,087.00	21,913,500
小津産業	400	1,649.00	659,600
高速	6,700	2,353.00	15,765,100
たけびし	4,400	2,049.00	9,015,600
リックス	2,100	2,773.00	5,823,300
丸文	10,100	1,047.00	10,574,700
ハピネット	8,700	4,385.00	38,149,500
橋本総業ホールディングス	4,500	1,305.00	5,872,500
日本ライフライン	30,400	1,321.00	40,158,400
タカショー	9,200	453.00	4,167,600
I D O M	38,600	1,113.00	42,961,800
進和	6,900	2,870.00	19,803,000
エスケイジャパン	300	701.00	210,300

ダイترون	4,900	2,788.00	13,661,200
シークス	16,200	1,159.00	18,775,800
田中商事	400	680.00	272,000
オーハシテクニカ	5,400	2,014.00	10,875,600
白銅	3,200	2,354.00	7,532,800
ダイコー通産	100	1,220.00	122,000
伊藤忠商事	764,000	7,705.00	5,886,620,000
丸紅	933,400	2,297.50	2,144,486,500
高島	900	1,253.00	1,127,700
長瀬産業	50,800	3,119.00	158,445,200
蝶理	6,100	3,960.00	24,156,000
豊田通商	341,300	2,606.50	889,598,450
三共生興	14,800	593.00	8,776,400
兼松	47,500	2,538.50	120,578,750
ツカモトコーポレーション	400	1,074.00	429,600
三井物産	1,668,800	3,232.00	5,393,561,600
日本紙パルプ商事	54,300	692.00	37,575,600
カメイ	12,100	1,918.00	23,207,800
東都水産	300	5,500.00	1,650,000
OUGホールディングス	300	2,624.00	787,200
スターゼン	7,800	2,917.00	22,752,600
山善	38,300	1,325.00	50,747,500
椿本興業	6,300	1,982.00	12,486,600
住友商事	681,100	3,357.00	2,286,452,700
内田洋行	4,600	6,690.00	30,774,000
三菱商事	2,099,200	2,592.50	5,442,176,000
第一実業	10,700	2,726.00	29,168,200
キャノンマーケティングジャパン	22,300	4,903.00	109,336,900
西華産業	4,600	4,445.00	20,447,000
佐藤商事	7,900	1,384.00	10,933,600
東京産業	10,600	705.00	7,473,000
ユアサ商事	9,100	4,495.00	40,904,500
神鋼商事	2,500	6,100.00	15,250,000
トルク	900	211.00	189,900
阪和興業	18,700	4,840.00	90,508,000
正栄食品工業	7,600	4,350.00	33,060,000
カナデン	8,500	1,444.00	12,274,000
R Y O D E N	9,200	2,414.00	22,208,800
岩谷産業	112,900	1,847.50	208,582,750
ナイス	500	1,609.00	804,500
ニチモウ	400	1,940.00	776,000
極東貿易	6,800	1,594.00	10,839,200

アステナホールディングス	21,400	483.00	10,336,200
三愛オブリ	26,500	1,870.00	49,555,000
稲畑産業	30,800	3,250.00	100,100,000
G S Iクレオス	6,100	2,113.00	12,889,300
明和産業	13,700	634.00	8,685,800
クワザワホールディングス	500	682.00	341,000
ワキタ	16,700	1,592.00	26,586,400
東邦ホールディングス	30,700	4,288.00	131,641,600
サンゲツ	28,500	2,801.00	79,828,500
ミツウロコグループホールディングス	14,500	1,758.00	25,491,000
シナネンホールディングス	3,100	6,230.00	19,313,000
伊藤忠エネクス	28,200	1,606.00	45,289,200
サンリオ	92,300	4,681.00	432,056,300
サンワテクノス	5,200	2,170.00	11,284,000
新光商事	15,300	990.00	15,147,000
トーヨー	4,500	2,795.00	12,577,500
三信電気	4,600	1,875.00	8,625,000
東陽テクニカ	10,500	1,412.00	14,826,000
モスフードサービス	16,700	3,735.00	62,374,500
加賀電子	23,100	2,793.00	64,518,300
ソーダニッカ	8,100	1,130.00	9,153,000
立花エレテック	6,800	2,666.00	18,128,800
フォーバル	4,500	1,329.00	5,980,500
P A L T A C	17,700	4,322.00	76,499,400
三谷産業	19,900	319.00	6,348,100
西本Wismettacホールディングス	6,900	1,927.00	13,296,300
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	2,264.00	452,800
コア商事ホールディングス	8,400	604.00	5,073,600
K P Pグループホールディングス	23,500	666.00	15,651,000
ヤマタネ	4,600	3,805.00	17,503,000
丸紅建材リース	100	2,940.00	294,000
泉州電業	7,800	5,380.00	41,964,000
トラスコ中山	23,900	2,200.00	52,580,000
オートバックスセブン	39,600	1,435.00	56,826,000
モリト	9,000	1,487.00	13,383,000
加藤産業	14,100	4,565.00	64,366,500
北恵	300	802.00	240,600
イエローハット	18,500	2,579.00	47,711,500
J Kホールディングス	8,700	1,088.00	9,465,600
日伝	6,600	3,065.00	20,229,000
北沢産業	900	352.00	316,800
杉本商事	10,100	1,368.00	13,816,800

因幡電機産業	31,700	3,840.00	121,728,000
東テク	11,400	2,551.00	29,081,400
ミスミグループ本社	171,700	2,509.00	430,795,300
アルテック	700	210.00	147,000
タキヒヨー	400	1,254.00	501,600
蔵王産業	400	2,454.00	981,600
スズケン	37,500	4,723.00	177,112,500
ジェコス	6,800	997.00	6,779,600
インターメスティック	6,500	2,667.00	17,335,500
サンエー	19,300	2,764.00	53,345,200
カワチ薬品	9,000	2,582.00	23,238,000
エービーシー・マート	49,800	3,238.00	161,252,400
ハードオフコーポレーション	4,600	1,803.00	8,293,800
アスクル	27,000	1,883.00	50,841,000
ゲオホールディングス	12,900	1,677.00	21,633,300
アダストリア	15,700	3,675.00	57,697,500
くら寿司	13,400	3,850.00	51,590,000
キャンドウ	4,100	3,460.00	14,186,000
I Kホールディングス	1,000	387.00	387,000
パルグループホールディングス	26,100	3,255.00	84,955,500
エディオン	49,600	1,782.00	88,387,200
サーラコーポレーション	24,100	844.00	20,340,400
ワッツ	900	698.00	628,200
ハローズ	4,600	4,040.00	18,584,000
あみやき亭	8,400	1,652.00	13,876,800
大黒天物産	3,500	9,800.00	34,300,000
ハニーズホールディングス	10,200	1,654.00	16,870,800
ファーマライズホールディングス	600	594.00	356,400
アルペン	9,500	1,998.00	18,981,000
ハブ	800	739.00	591,200
クオールホールディングス	14,200	1,469.00	20,859,800
ジーンズホールディングス	8,700	6,280.00	54,636,000
ビックカメラ	68,100	1,770.50	120,571,050
D C Mホールディングス	59,000	1,420.00	83,780,000
MonotaRO	161,200	2,674.00	431,048,800
東京一番フーズ	1,000	500.00	500,000
きちりホールディングス	400	894.00	357,600
J.フロント リテイリング	130,500	1,893.50	247,101,750
ドトール・日レスホールディングス	20,200	2,286.00	46,177,200
マツキヨココカラ&カンパニー	200,500	2,254.00	451,927,000
ブロンコビリー	6,700	3,930.00	26,331,000
ZOZO	84,500	4,737.00	400,276,500

トレジャー・ファクトリー	8,000	1,419.00	11,352,000
物語コーポレーション	19,600	3,680.00	72,128,000
三越伊勢丹ホールディングス	172,600	2,272.50	392,233,500
H a m e e	4,800	1,060.00	5,088,000
マーケットエンタープライズ	300	805.00	241,500
ウエルシアホールディングス	59,100	1,940.00	114,654,000
クリエイティブSDホールディングス	16,200	2,887.00	46,769,400
丸善C H Iホールディングス	2,600	321.00	834,600
ミサワ	600	691.00	414,600
ティーライフ	300	1,158.00	347,400
チムニー	500	1,245.00	622,500
シュッピン	10,700	996.00	10,657,200
オイシックス・ラ・大地	15,800	1,511.00	23,873,800
ネクステージ	26,100	1,404.00	36,644,400
ジョイフル本田	31,600	1,836.00	58,017,600
エターナルホスピタリティグループ	4,300	3,070.00	13,201,000
ホットランド	8,800	2,233.00	19,650,400
すかいらーくホールディングス	155,400	2,442.00	379,486,800
S F Pホールディングス	5,600	1,976.00	11,065,600
綿半ホールディングス	9,000	1,520.00	13,680,000
ヨシックスホールディングス	3,100	3,285.00	10,183,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	48,734	783.00	38,158,722
B E E N O S	7,000	3,370.00	23,590,000
あさひ	9,600	1,531.00	14,697,600
日本調剤	7,600	1,422.00	10,807,200
コスモス薬品	19,300	7,053.00	136,122,900
トーエル	1,100	759.00	834,900
セブン&アイ・ホールディングス	1,255,500	2,545.50	3,195,875,250
クリエイティブ・レストラン・ホールディングス	85,500	1,185.00	101,317,500
ツルハホールディングス	23,900	8,420.00	201,238,000
サンマルクホールディングス	9,200	2,601.00	23,929,200
フェリシモ	600	829.00	497,400
トリドールホールディングス	32,000	3,890.00	124,480,000
T O K Y O B A S E	12,900	325.00	4,192,500
ウイルプラスホールディングス	500	968.00	484,000
J Mホールディングス	8,600	2,697.00	23,194,200
サツドラホールディングス	800	785.00	628,000
アレンザホールディングス	8,700	1,075.00	9,352,500
串カツ田中ホールディングス	3,500	1,463.00	5,120,500
パロックジャパンリミテッド	9,400	788.00	7,407,200
クスリのアオキホールディングス	38,100	3,289.00	125,310,900

力の源ホールディングス	7,500	981.00	7,357,500	
FOOD & LIFE COMPANIES	60,700	3,575.00	217,002,500	
メディカルシステムネットワーク	11,600	430.00	4,988,000	
はるやまホールディングス	1,200	631.00	757,200	
ノジマ	37,200	2,335.00	86,862,000	
カップ・クリエイト	17,900	1,632.00	29,212,800	
良品計画	135,400	3,295.00	446,143,000	
パリミキホールディングス	2,500	292.00	730,000	
アドヴァングループ	9,900	983.00	9,731,700	
アルビス	3,800	2,604.00	9,895,200	
コナカ	1,500	228.00	342,000	
ハウス オブ ローゼ	400	1,442.00	576,800	
G - 7ホールディングス	12,500	1,395.00	17,437,500	
イオン北海道	28,000	875.00	24,500,000	
コジマ	22,100	1,089.00	24,066,900	
ヒマラヤ	700	845.00	591,500	
コーナン商事	12,600	3,620.00	45,612,000	
エコス	4,300	2,011.00	8,647,300	
ワタミ	12,300	994.00	12,226,200	
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	229,600	3,988.00	915,644,800	
西松屋チェーン	25,300	2,341.00	59,227,300	
ゼンショーホールディングス	64,600	9,560.00	617,576,000	
幸楽苑	8,400	1,141.00	9,584,400	
ハークスレイ	800	700.00	560,000	
サイゼリヤ	16,800	5,810.00	97,608,000	
V Tホールディングス	44,800	483.00	21,638,400	
魚力	4,100	2,416.00	9,905,600	
フジ・コーポレーション	5,300	2,037.00	10,796,100	
ユナイテッドアローズ	12,200	2,679.00	32,683,800	
ハイデイ日高	17,300	2,815.00	48,699,500	
京都きもの友禅ホールディングス	3,100	74.00	229,400	
コロワイド	64,100	1,750.00	112,175,000	
壱番屋	45,100	1,024.00	46,182,400	
PLANT	400	1,585.00	634,000	
スギホールディングス	61,100	2,523.00	154,155,300	
薬王堂ホールディングス	5,700	2,062.00	11,753,400	
スクロール	17,100	1,068.00	18,262,800	
ヨンドシーホールディングス	10,900	1,855.00	20,219,500	
木曽路	17,300	2,096.00	36,260,800	
SRSホールディングス	18,900	1,161.00	21,942,900	
千趣会	23,000	301.00	6,923,000	

リテールパートナーズ	17,000	1,288.00	21,896,000
上新電機	11,300	2,289.00	25,865,700
日本瓦斯	54,500	2,042.50	111,316,250
ロイヤルホールディングス	20,000	2,435.00	48,700,000
チヨダ	11,000	1,399.00	15,389,000
ライフコーポレーション	11,900	3,460.00	41,174,000
リンガーハット	14,700	2,219.00	32,619,300
MrMaxHD	14,600	672.00	9,811,200
AOKIホールディングス	24,500	1,280.00	31,360,000
オークワ	16,800	925.00	15,540,000
コメリ	15,400	3,255.00	50,127,000
青山商事	24,400	2,240.00	54,656,000
しまむら	26,700	8,538.00	227,964,600
はせがわ	1,400	304.00	425,600
高島屋	158,000	1,227.00	193,866,000
松屋	19,300	905.00	17,466,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	55,300	2,175.50	120,305,150
近鉄百貨店	5,100	2,126.00	10,842,600
丸井グループ	75,400	2,525.00	190,385,000
アクシアル リテイリング	31,200	914.00	28,516,800
イオン	420,300	3,696.00	1,553,428,800
イズミ	17,300	3,166.00	54,771,800
平和堂	19,000	2,284.00	43,396,000
フジ	20,900	2,050.00	42,845,000
ヤオコー	13,500	9,223.00	124,510,500
ゼビオホールディングス	15,600	1,130.00	17,628,000
ケーズホールディングス	76,500	1,413.50	108,132,750
Olympicグループ	1,200	464.00	556,800
日産東京販売ホールディングス	2,400	432.00	1,036,800
シルバーライフ	3,300	774.00	2,554,200
Genky DrugStores	10,000	3,090.00	30,900,000
ナルミヤ・インターナショナル	400	1,283.00	513,200
ブックオフグループホールディングス	8,400	1,481.00	12,440,400
ギフトホールディングス	5,700	3,370.00	19,209,000
アインホールディングス	15,700	4,590.00	72,063,000
Genki Global Dining	6,500	3,605.00	23,432,500
ヤマダホールディングス	350,000	445.20	155,820,000
アーケランズ	33,900	1,686.00	57,155,400
ニトリホールディングス	41,400	19,850.00	821,790,000
グルメ杵屋	9,400	1,048.00	9,851,200
愛眼	900	144.00	129,600
ケーユーホールディングス	5,700	1,119.00	6,378,300

吉野家ホールディングス	44,500	3,270.00	145,515,000
松屋フーズホールディングス	5,400	6,680.00	36,072,000
サガミホールディングス	17,600	1,782.00	31,363,200
王将フードサービス	22,500	3,060.00	68,850,000
ミニストップ	8,500	1,724.00	14,654,000
アークス	19,200	2,597.00	49,862,400
パローホールディングス	21,800	2,142.00	46,695,600
ベルク	5,700	6,500.00	37,050,000
大庄	6,600	1,043.00	6,883,800
ファーストリテイリング	63,900	53,800.00	3,437,820,000
サンドラッグ	38,400	3,946.00	151,526,400
サクスパー ホールディングス	10,100	988.00	9,978,800
ヤマザワ	500	1,182.00	591,000
やまや	300	2,875.00	862,500
ペルーナ	27,600	780.00	21,528,000
いよぎんホールディングス	138,500	1,544.50	213,913,250
しずおかフィナンシャルグループ	233,000	1,346.00	313,618,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	89,100	1,653.00	147,282,300
楽天銀行	49,100	4,195.00	205,974,500
京都フィナンシャルグループ	133,200	2,328.00	310,089,600
島根銀行	300	513.00	153,900
じもとホールディングス	1,100	302.00	332,200
めぶきフィナンシャルグループ	531,100	674.10	358,014,510
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,500	4,375.00	59,062,500
九州フィナンシャルグループ	186,100	729.70	135,797,170
ゆうちょ銀行	871,900	1,514.50	1,320,492,550
富山第一銀行	33,600	1,118.00	37,564,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	562,800	905.30	509,502,840
西日本フィナンシャルホールディングス	65,100	2,077.00	135,212,700
三十三フィナンシャルグループ	9,500	2,170.00	20,615,000
第四北越フィナンシャルグループ	33,200	2,886.00	95,815,200
ひろぎんホールディングス	148,800	1,162.50	172,980,000
おきなわフィナンシャルグループ	8,300	2,645.00	21,953,500
十六フィナンシャルグループ	14,000	4,475.00	62,650,000
北國フィナンシャルホールディングス	10,300	5,340.00	55,002,000
プロクレアホールディングス	12,100	1,763.00	21,332,300
あいちフィナンシャルグループ	19,700	2,459.00	48,442,300
あおぞら銀行	73,000	2,463.50	179,835,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,938,200	1,806.00	12,530,389,200
りそなホールディングス	1,306,600	1,205.50	1,575,106,300
三井住友トラストグループ	376,300	3,791.00	1,426,553,300
三井住友フィナンシャルグループ	2,207,000	3,791.00	8,366,737,000

千葉銀行	327,600	1,262.00	413,431,200
群馬銀行	188,200	1,122.50	211,254,500
武蔵野銀行	15,100	3,045.00	45,979,500
千葉興業銀行	25,000	1,381.00	34,525,000
筑波銀行	46,400	256.00	11,878,400
七十七銀行	33,900	4,630.00	156,957,000
秋田銀行	7,100	2,286.00	16,230,600
山形銀行	11,700	989.00	11,571,300
岩手銀行	6,700	2,789.00	18,686,300
東邦銀行	85,600	288.00	24,652,800
東北銀行	600	1,143.00	685,800
ふくおかフィナンシャルグループ	92,100	4,235.00	390,043,500
スルガ銀行	71,300	1,065.00	75,934,500
八十二銀行	247,600	1,033.00	255,770,800
山梨中央銀行	11,900	1,900.00	22,610,000
大垣共立銀行	20,200	1,928.00	38,945,600
福井銀行	9,500	1,901.00	18,059,500
清水銀行	4,200	1,466.00	6,157,200
富山銀行	200	1,531.00	306,200
滋賀銀行	16,000	3,885.00	62,160,000
南都銀行	15,900	3,250.00	51,675,000
百五銀行	99,500	631.00	62,784,500
紀陽銀行	37,800	2,112.00	79,833,600
ほくほくフィナンシャルグループ	59,500	1,905.50	113,377,250
山陰合同銀行	66,200	1,261.00	83,478,200
鳥取銀行	400	1,235.00	494,000
百十四銀行	10,400	3,335.00	34,684,000
四国銀行	15,500	1,137.00	17,623,500
阿波銀行	14,800	2,834.00	41,943,200
大分銀行	6,400	3,285.00	21,024,000
宮崎銀行	6,500	3,120.00	20,280,000
佐賀銀行	6,200	2,197.00	13,621,400
琉球銀行	23,000	1,052.00	24,196,000
セブン銀行	379,000	327.10	123,970,900
みずほフィナンシャルグループ	1,428,000	3,812.00	5,443,536,000
高知銀行	400	862.00	344,800
山口フィナンシャルグループ	103,700	1,619.50	167,942,150
名古屋銀行	6,600	6,560.00	43,296,000
北洋銀行	144,300	463.00	66,810,900
大光銀行	400	1,457.00	582,800
愛媛銀行	14,600	1,073.00	15,665,800
トマト銀行	500	1,167.00	583,500

京葉銀行	44,500	827.00	36,801,500
栃木銀行	48,400	292.00	14,132,800
北日本銀行	3,500	2,908.00	10,178,000
東和銀行	19,400	657.00	12,745,800
福島銀行	1,300	226.00	293,800
大東銀行	600	726.00	435,600
トモニホールディングス	101,100	454.00	45,899,400
フィデアホールディングス	10,900	1,406.00	15,325,400
池田泉州ホールディングス	146,700	404.00	59,266,800
F P G	37,700	2,780.00	104,806,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	17,200	1,038.00	17,853,600
マーキュリアホールディングス	500	891.00	445,500
S B Iホールディングス	170,300	3,970.00	676,091,000
ジャフコ グループ	31,500	2,201.00	69,331,500
大和証券グループ本社	756,500	1,042.00	788,273,000
野村ホールディングス	1,779,100	923.00	1,642,109,300
岡三証券グループ	83,600	646.00	54,005,600
丸三証券	35,200	993.00	34,953,600
東洋証券	28,800	613.00	17,654,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	125,600	490.00	61,544,000
光世証券	300	426.00	127,800
水戸証券	29,100	579.00	16,848,900
いちよし証券	20,300	1,021.00	20,726,300
松井証券	72,900	828.00	60,361,200
マネックスグループ	103,600	1,121.00	116,135,600
極東証券	13,200	1,482.00	19,562,400
岩井コスモホールディングス	12,100	2,306.00	27,902,600
アイザワ証券グループ	15,300	1,801.00	27,555,300
マネーパートナーズグループ	1,300	474.00	616,200
スパークス・グループ	11,800	1,503.00	17,735,400
かんぼ生命保険	123,100	3,070.00	377,917,000
F P パートナー	4,600	2,329.00	10,713,400
S O M P Oホールディングス	517,200	4,112.00	2,126,726,400
アニコム ホールディングス	35,900	656.00	23,550,400
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	775,300	3,394.00	2,631,368,200
第一生命ホールディングス	497,500	4,267.00	2,122,832,500
東京海上ホールディングス	1,032,900	5,623.00	5,807,996,700
T & Dホールディングス	284,100	2,739.00	778,149,900
アドバンスクリエイト	7,700	540.00	4,158,000
N E X Y Z . G r o u p	900	803.00	722,700
全国保証	27,700	5,388.00	149,247,600
あんしん保証	2,700	161.00	434,700

イントラスト	900	807.00	726,300
日本モーゲージサービス	1,600	426.00	681,600
C a s a	900	850.00	765,000
S B I アルヒ	10,900	826.00	9,003,400
プレミアムグループ	18,000	2,536.00	45,648,000
ネットプロテクションズホールディングス	36,300	488.00	17,714,400
クレディセゾン	67,100	3,579.00	240,150,900
芙蓉総合リース	9,800	11,165.00	109,417,000
みずほリース	79,800	1,001.00	79,879,800
東京センチュリー	79,300	1,515.50	120,179,150
日本証券金融	39,100	2,050.00	80,155,000
アイフル	176,400	334.00	58,917,600
リコーリース	10,100	5,180.00	52,318,000
イオンフィナンシャルサービス	61,000	1,290.00	78,690,000
アコム	252,700	395.00	99,816,500
ジャックス	12,800	3,730.00	47,744,000
オリエントコーポレーション	35,000	829.00	29,015,000
オリックス	634,600	3,377.00	2,143,044,200
三菱HCキャピタル	530,700	1,013.50	537,864,450
九州リースサービス	800	1,032.00	825,600
日本取引所グループ	629,600	1,886.50	1,187,740,400
イー・ギャランティ	17,500	1,772.00	31,010,000
アサックス	1,000	710.00	710,000
NECキャピタルソリューション	5,300	3,740.00	19,822,000
r o b o t h o m e	31,400	136.00	4,270,400
大東建託	36,000	17,555.00	631,980,000
いちご	90,200	370.00	33,374,000
日本駐車場開発	127,300	206.00	26,223,800
スター・マイカ・ホールディングス	11,400	738.00	8,413,200
S R E ホールディングス	4,000	3,225.00	12,900,000
A D ワークスグループ	3,000	204.00	612,000
ヒューリック	247,000	1,379.00	340,613,000
野村不動産ホールディングス	66,400	3,716.00	246,742,400
三重交通グループホールディングス	23,200	493.00	11,437,600
ディア・ライフ	18,400	1,059.00	19,485,600
地主	9,500	2,115.00	20,092,500
プレサンスコーポレーション	14,200	1,920.00	27,264,000
ハウスコム	400	1,388.00	555,200
J P M C	6,400	1,143.00	7,315,200
サンセイランディック	700	967.00	676,900
フージャースホールディングス	16,300	1,008.00	16,430,400
オープンハウスグループ	38,800	5,796.00	224,884,800

東急不動産ホールディングス	318,400	965.50	307,415,200
飯田グループホールディングス	101,500	2,317.50	235,226,250
イーランド	400	1,385.00	554,000
ムゲンエステート	1,000	2,007.00	2,007,000
And Doホールディングス	6,400	983.00	6,291,200
シーアールイー	5,000	1,205.00	6,025,000
ケイアイスター不動産	5,300	4,170.00	22,101,000
グッドコムアセット	8,900	902.00	8,027,800
ジェイ・エス・ビー	4,500	2,742.00	12,339,000
ロードスターキャピタル	6,200	2,417.00	14,985,400
イノベーションホールディングス	800	919.00	735,200
フェイスネットワーク	500	1,611.00	805,500
霞ヶ関キャピタル	4,400	11,820.00	52,008,000
パーク24	82,600	1,798.00	148,514,800
パラカ	3,500	1,790.00	6,265,000
三井不動産	1,468,500	1,220.00	1,791,570,000
三菱地所	612,900	2,124.00	1,301,799,600
平和不動産	17,200	4,170.00	71,724,000
東京建物	92,500	2,581.50	238,788,750
京阪神ビルディング	18,000	1,577.00	28,386,000
住友不動産	172,200	4,616.00	794,875,200
テーオーシー	19,300	669.00	12,911,700
レオパレス21	92,600	560.00	51,856,000
スターツコーポレーション	17,400	3,640.00	63,336,000
フジ住宅	13,700	781.00	10,699,700
空港施設	15,400	573.00	8,824,200
明和地所	8,000	1,010.00	8,080,000
ゴールドクレスト	7,300	3,200.00	23,360,000
エスリード	5,000	4,410.00	22,050,000
日神グループホールディングス	17,600	523.00	9,204,800
日本エスコン	27,700	970.00	26,869,000
MIRARTHホールディングス	56,300	497.00	27,981,100
AVANTIA	1,000	774.00	774,000
イオンモール	64,100	2,002.00	128,328,200
毎日コムネット	1,000	720.00	720,000
ファースト住建	800	976.00	780,800
カチタス	28,600	2,218.00	63,434,800
トーセイ	17,700	2,586.00	45,772,200
穴吹興産	500	2,002.00	1,001,000
サンフロンティア不動産	16,200	1,865.00	30,213,000
FJネクストホールディングス	11,400	1,183.00	13,486,200
インテリックス	300	799.00	239,700

ランドビジネス	400	202.00	80,800
サンネクスタグループ	900	1,012.00	910,800
グランディハウス	10,400	562.00	5,844,800
日本空港ビルディング	37,500	5,085.00	190,687,500
明豊ファシリティワークス	800	865.00	692,000
L I F U L L	27,600	198.00	5,464,800
M I X I	20,800	2,807.00	58,385,600
ジェイエイシーリクルートメント	40,000	728.00	29,120,000
日本M&Aセンターホールディングス	162,600	648.80	105,494,880
メンバーズ	4,000	1,030.00	4,120,000
中広	400	430.00	172,000
UTグループ	14,400	2,208.00	31,795,200
アイティメディア	4,400	1,511.00	6,648,400
ケアネット	22,700	591.00	13,415,700
E・Jホールディングス	6,500	1,662.00	10,803,000
オープンアップグループ	33,200	1,838.00	61,021,600
コシダカホールディングス	33,100	1,166.00	38,594,600
アルトナー	600	1,952.00	1,171,200
パソナグループ	13,400	2,012.00	26,960,800
C D S	600	1,840.00	1,104,000
リンクアンドモチベーション	27,300	579.00	15,806,700
エス・エム・エス	42,300	1,693.50	71,635,050
サニーサイドアップグループ	600	569.00	341,400
パーソルホールディングス	1,030,800	239.10	246,464,280
リニカル	1,200	340.00	408,000
クックパッド	30,800	162.00	4,989,600
アイ・ケイ・ケイホールディングス	1,000	741.00	741,000
学情	5,700	2,041.00	11,633,700
スタジオアリス	5,600	2,109.00	11,810,400
エブコ	500	784.00	392,000
N J S	2,800	3,525.00	9,870,000
総合警備保障	184,500	1,132.50	208,946,250
カカクコム	79,700	2,486.00	198,134,200
アイロムグループ	4,500	2,599.00	11,695,500
セントケア・ホールディング	7,200	746.00	5,371,200
サイネックス	400	777.00	310,800
ルネサンス	8,700	1,026.00	8,926,200
ディップ	19,400	2,517.00	48,829,800
デジタルホールディングス	5,700	1,260.00	7,182,000
新日本科学	10,400	1,579.00	16,421,600
キャリアデザインセンター	300	1,828.00	548,400
エムスリー	218,300	1,450.00	316,535,000

ツカダ・グローバルホールディング	1,000	435.00	435,000
ウェルネット	1,200	839.00	1,006,800
ワールドホールディングス	4,400	1,973.00	8,681,200
ディー・エヌ・エー	44,200	2,449.00	108,245,800
博報堂D Yホールディングス	125,300	1,217.50	152,552,750
ぐるなび	20,900	296.00	6,186,400
タカミヤ	15,200	408.00	6,201,600
ファンコミュニケーションズ	15,700	420.00	6,594,000
ライク	4,200	1,386.00	5,821,200
A o b a - B B T	800	322.00	257,600
エスプール	35,200	310.00	10,912,000
W D Bホールディングス	5,700	1,699.00	9,684,300
ティア	1,000	431.00	431,000
アドウェイズ	13,800	309.00	4,264,200
バリューコマース	9,800	1,168.00	11,446,400
インフォマート	104,500	275.00	28,737,500
J Pホールディングス	28,400	677.00	19,226,800
エコナックホールディングス	2,000	115.00	230,000
C Lホールディングス	2,700	850.00	2,295,000
プレステージ・インターナショナル	51,800	692.00	35,845,600
プロトコーポレーション	11,900	1,300.00	15,470,000
アミューズ	6,800	1,394.00	9,479,200
ドリームインキュベータ	2,700	3,335.00	9,004,500
クイック	7,700	2,090.00	16,093,000
T A C	1,000	202.00	202,000
電通グループ	119,400	4,023.00	480,346,200
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,400	894.00	4,827,600
イオンファンタジー	4,100	3,070.00	12,587,000
シーティーエス	13,900	911.00	12,662,900
H . U . グループホールディングス	32,400	2,550.00	82,620,000
アルプス技研	9,600	2,630.00	25,248,000
日本空調サービス	12,000	1,019.00	12,228,000
オリエンタルランド	657,400	3,404.00	2,237,789,600
ダスキン	24,100	3,706.00	89,314,600
明光ネットワークジャパン	13,500	723.00	9,760,500
ファルコホールディングス	4,600	2,302.00	10,589,200
ラウンドワン	104,300	1,247.00	130,062,100
リゾートトラスト	43,600	3,056.00	133,241,600
ビー・エム・エル	13,600	2,915.00	39,644,000
リソー教育	58,000	300.00	17,400,000
早稲田アカデミー	6,200	1,770.00	10,974,000
ユー・エス・エス	227,200	1,371.50	311,604,800

東京個別指導学院	13,300	385.00	5,120,500
サイバーエージェント	244,200	1,084.50	264,834,900
楽天グループ	777,900	930.40	723,758,160
クリーク・アンド・リバー社	5,600	1,563.00	8,752,800
SBIグローバルアセットマネジメント	21,800	672.00	14,649,600
テー・オー・ダブリュー	21,900	316.00	6,920,400
山田コンサルティンググループ	5,000	1,941.00	9,705,000
セントラルスポーツ	4,200	2,407.00	10,109,400
フルキャストホールディングス	9,100	1,462.00	13,304,200
エン・ジャパン	18,000	2,219.00	39,942,000
リソルホールディングス	200	5,030.00	1,006,000
テクノプロ・ホールディングス	64,100	2,942.00	188,582,200
アトラグループ	600	130.00	78,000
アイ・アールジャパンホールディングス	5,800	764.00	4,431,200
Keeper 技研	6,800	4,775.00	32,470,000
楽待	500	708.00	354,000
三機サービス	300	937.00	281,100
Gunosy	8,900	703.00	6,256,700
デザインワン・ジャパン	1,200	115.00	138,000
イー・ガーディアン	5,300	1,860.00	9,858,000
リブセンス	1,300	151.00	196,300
ジャパンマテリアル	33,800	1,660.00	56,108,000
ベクトル	13,600	1,015.00	13,804,000
ウチヤマホールディングス	900	313.00	281,700
チャーム・ケア・コーポレーション	9,300	1,293.00	12,024,900
キャリアリンク	4,100	2,452.00	10,053,200
I B J	8,600	621.00	5,340,600
アサンテ	5,500	1,656.00	9,108,000
バリューHR	10,000	1,924.00	19,240,000
M&Aキャピタルパートナーズ	9,000	2,695.00	24,255,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,500	1,000.00	4,500,000
E R Iホールディングス	400	2,116.00	846,400
アビスト	200	3,020.00	604,000
シグマクシス・ホールディングス	29,400	901.00	26,489,400
ウィルグループ	9,300	969.00	9,011,700
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,200	142.00	312,400
メドピア	9,000	503.00	4,527,000
レアジョブ	500	386.00	193,000
リクルートホールディングス	861,500	11,350.00	9,778,025,000
エラン	14,700	747.00	10,980,900
土木管理総合試験所	900	307.00	276,300
日本郵政	1,236,800	1,534.00	1,897,251,200

ベルシステム24ホールディングス	11,900	1,260.00	14,994,000
鎌倉新書	9,600	531.00	5,097,600
S MN	600	409.00	245,400
グローバルキッズCOMPANY	400	694.00	277,600
エアトリ	8,200	1,152.00	9,446,400
アトラエ	7,800	813.00	6,341,400
ストライク	5,500	3,850.00	21,175,000
ソラスト	30,600	480.00	14,688,000
セラク	3,400	1,260.00	4,284,000
インソース	24,100	1,179.00	28,413,900
ベikalent	81,200	5,580.00	453,096,000
Orchestra Holdings	2,500	816.00	2,040,000
アイモバイル	14,200	499.00	7,085,800
ディスラプターズ	1,100	189.00	207,900
MS - Japan	5,200	1,060.00	5,512,000
船場	300	1,415.00	424,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	43,000	2,878.00	123,754,000
フルテック	500	1,188.00	594,000
GameWith	900	222.00	199,800
MS&Consulting	300	450.00	135,000
エル・ティー・エス	1,500	2,367.00	3,550,500
ミダックホールディングス	6,700	1,606.00	10,760,200
キュービーネットホールディングス	6,400	1,023.00	6,547,200
オープングループ	15,900	195.00	3,100,500
スプリックス	500	865.00	432,500
マネジメントソリューションズ	5,500	1,717.00	9,443,500
プロレド・パートナーズ	2,900	532.00	1,542,800
テノ・ホールディングス	300	484.00	145,200
フロンティア・マネジメント	3,400	774.00	2,631,600
コプロ・ホールディングス	500	1,731.00	865,500
ギークス	500	405.00	202,500
アンビスホールディングス	23,800	819.00	19,492,200
カーブスホールディングス	30,300	816.00	24,724,800
フォーラムエンジニアリング	13,000	954.00	12,402,000
Fast Fitness Japan	3,800	1,398.00	5,312,400
Macbee Planet	3,100	2,765.00	8,571,500
ダイレクトマーケティングミックス	13,800	267.00	3,684,600
ポピンズ	2,100	1,230.00	2,583,000
LITALICO	8,900	916.00	8,152,400
コンフィデンス・インターワークス	200	1,583.00	316,600
アドバンテッジリスクマネジメント	800	658.00	526,400
リログループ	61,500	1,880.50	115,650,750

東祥	8,000	646.00	5,168,000
I D & Eホールディングス	6,700	6,480.00	43,416,000
ビーウィズ	2,300	1,527.00	3,512,100
サンウェルズ	4,300	847.00	3,642,100
T R Eホールディングス	25,400	1,553.00	39,446,200
人・夢・技術グループ	4,600	1,399.00	6,435,400
N I S S Oホールディングス	9,700	763.00	7,401,100
大栄環境	24,100	3,020.00	72,782,000
G E N O V A	3,800	1,360.00	5,168,000
日本管財ホールディングス	11,600	2,588.00	30,020,800
M & A総研ホールディングス	12,000	1,931.00	23,172,000
エイチ・アイ・エス	35,300	1,715.00	60,539,500
ラックランド	4,600	1,821.00	8,376,600
共立メンテナンス	34,700	2,762.50	95,858,750
イチネンホールディングス	10,800	1,860.00	20,088,000
建設技術研究所	5,700	5,050.00	28,785,000
スペース	8,100	1,142.00	9,250,200
燦ホールディングス	9,300	1,194.00	11,104,200
スバル興業	4,000	3,230.00	12,920,000
東京テアトル	500	1,084.00	542,000
タナベコンサルティンググループ	3,900	1,200.00	4,680,000
ナガワ	3,000	6,320.00	18,960,000
東京都競馬	8,100	4,320.00	34,992,000
カナモト	17,200	3,255.00	55,986,000
ニシオホールディングス	9,200	3,925.00	36,110,000
トランス・コスモス	14,100	3,410.00	48,081,000
乃村工藝社	48,300	809.00	39,074,700
藤田観光	4,900	8,440.00	41,356,000
K N T - C Tホールディングス	6,600	1,205.00	7,953,000
トーカイ	9,800	2,256.00	22,108,800
セコム	224,900	5,337.00	1,200,291,300
セントラル警備保障	6,000	2,828.00	16,968,000
丹青社	22,000	808.00	17,776,000
メイテックグループホールディングス	40,800	2,889.00	117,871,200
応用地質	10,300	2,361.00	24,318,300
船井総研ホールディングス	22,100	2,490.00	55,029,000
進学会ホールディングス	900	201.00	180,900
オオバ	900	992.00	892,800
いであ	400	2,491.00	996,400
学究社	4,500	1,989.00	8,950,500
イオンディライト	11,900	4,365.00	51,943,500
ナック	9,800	575.00	5,635,000

ダイセキ	26,700	3,870.00	103,329,000	
ステップ	4,100	2,089.00	8,564,900	
合 計	201,746,734		421,499,801,922	

(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A】

【純資産額計算書】

(2024年12月30日現在)

資産総額	2,143,064,422円
負債総額	3,077,721円
純資産総額（ - ）	2,139,986,701円
発行済口数	461,311,115口
1口当たり純資産額（ / ）	4.6389円
（1万口当たり純資産額）	（46,389円）

(参考)

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

(2024年12月30日現在)

資産総額	433,809,282,826円
負債総額	391,486,008円
純資産総額（ - ）	433,417,796,818円
発行済口数	127,577,350,904口
1口当たり純資産額（ / ）	3.3973円
（1万口当たり純資産額）	（33,973円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

受益権の譲渡

イ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載又は記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少及び譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿

に記載又は記録するものとし、ただし、上記イ.の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載又は記録が行われるよう通知するものとし、

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【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12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、監査等委員以外の取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[DO（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。

このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

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

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

委託会社の機構は2025年 3月10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12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	525	15,838,205
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	57	202,229
単位型公社債投資信託	52	171,026
合計	634	16,211,460

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財務諸表等規則並びに同規則第2条、第282条及び第306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38期事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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39期事業年度の中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,067	14,909
金銭の信託	14,693	18,596
前払費用	198	429
未収委託者報酬	9,147	10,943
未収運用受託報酬	5,815	5,967
未収収益	176	185
短期差入証拠金	3,541	3,660
その他	1,566	4,074
流動資産合計	58,207	58,767
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 255	1 219
器具備品	1 560	1 436
有形固定資産合計	816	655
無形固定資産		
ソフトウェア	7,203	7,463
その他	40	61
無形固定資産合計	7,244	7,524
投資その他の資産		
投資有価証券	4,063	5,753
関係会社株式	5,636	6,077
繰延税金資産	1,181	1,196
その他	31	31
投資その他の資産合計	10,911	13,058
固定資産合計	18,972	21,238
資産合計	77,179	80,005

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	49	86
未払金	7,174	8,475
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,586	5,524
その他未払金	2,588	2,951
未払費用	1,089	797
未払法人税等	726	694
賞与引当金	613	719
その他	303	957
流動負債合計	9,958	11,730
固定負債		
退職給付引当金	904	975
資産除去債務	153	154
その他	27	42
固定負債合計	1,086	1,171
負債合計	11,044	12,902
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	44,755	45,974
利益剰余金合計	47,355	48,574
株主資本合計	66,595	67,813
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	49	360
繰延ヘッジ損益	510	1,071
評価・換算差額等合計	460	710
純資産合計	66,134	67,103
負債・純資産合計	77,179	80,005

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

前事業年度

当事業年度

（自 2022年4月1日
至 2023年3月31日）（自 2023年4月1日
至 2024年3月31日）

営業収益		
委託者報酬	40,724	44,551
運用受託報酬	10,918	11,077
その他営業収益	351	356
営業収益合計	51,993	55,985
営業費用		
支払手数料	20,123	22,341
広告宣伝費	307	342
公告費	2	0
調査費	5,309	5,796
調査費	1,104	1,172
委託調査費	4,191	4,610
図書費	13	14
営業雑経費	5,842	5,887
通信費	77	78
印刷費	419	439
協会費	58	56
諸会費	38	29
情報機器関連費	5,153	5,193
その他営業雑経費	94	89
営業費用合計	31,585	34,369
一般管理費		
給料	6,451	6,981
役員報酬	318	385
給料・手当	5,144	5,432
賞与	987	1,163
退職給付費用	252	278
福利費	671	747
交際費	7	13
旅費交通費	122	191
租税公課	289	276
不動産賃借料	327	328
寄付金	-	0
減価償却費	1,698	2,239
業務委託費	1,277	1,544
諸経費	1,454	1,637
一般管理費合計	12,553	14,239
営業利益	7,854	7,376

（単位：百万円）

	前事業年度 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	当事業年度 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
営業外収益		
受取利息	57	138
収益分配金	4	0

金銭の信託運用益	-	4,007
投資有価証券売却益	738	1
投資有価証券償還益	121	1
デリバティブ利益	565	-
その他	11	12
営業外収益合計	1,499	4,162
営業外費用		
金銭の信託運用損	158	-
投資有価証券売却損	16	33
投資有価証券償還損	-	1
為替差損	1,227	1,273
デリバティブ費用	-	3,613
その他	32	3
営業外費用合計	1,435	4,925
経常利益	7,918	6,613
税引前当期純利益	7,918	6,613
法人税、住民税及び事業税	2,350	1,931
法人税等調整額	119	95
法人税等合計	2,470	2,027
当期純利益	5,448	4,585

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	44,755	47,355	66,595
当期変動額					
剰余金の配当			3,367	3,367	3,367
当期純利益			4,585	4,585	4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	1,218	1,218	1,218
当期末残高	500	2,100	45,974	48,574	67,813

	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
当期変動額				
剰余金の配当				3,367
当期純利益				4,585
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	310	560	250	250
当期変動額合計	310	560	250	968
当期末残高	360	1,071	710	67,103

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。

（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 (2023年3月31日)		当事業年度 (2024年3月31日)	
建物	184	百万円	220	百万円
器具備品	681	"	823	"
計	866	"	1,044	"

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

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23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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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
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
2024年6月20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
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	利益剰余金	981,032	2024年3月31日	2024年6月21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、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、デリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため金銭の信託及び投資有価証券の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。
これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。
デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

- レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価
 レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
 レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価
 時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債
 前事業年度（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)				
株式関連取引	(10)	-	-	(10)
通貨関連取引	-	(136)	-	(136)
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。

当事業年度（2024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)	1,530	16,048	-	17,579
投資有価証券(*3)				
其他有価証券	-	4,517	-	4,517
資産計	1,530	20,565	-	22,096
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	(268)	(262)	-	(530)
通貨関連取引	-	21	-	21
デリバティブ取引計	(268)	(241)	-	(509)

(*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1,017百万円）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18,596百万円であります。

(*3) 投資有価証券のうち、非上場株式（貸借対照表計上額876百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額359百万円）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、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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
投資有価証券	0	876
関係会社株式	5,636	6,077

(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(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

当事業年度(2024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	14,909	-	-	-
未収委託者報酬	10,943	-	-	-
未収運用受託報酬	5,967	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	1,829	807	-

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
子会社株式	5,636	6,077

2. その他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(2024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	3,394	2,593	800
小計	3,394	2,593	800

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,123	1,410	287
小計	1,123	1,410	287
合計	4,517	4,004	513

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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非上場株式	0	876
組合出資金等	218	359

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	185	1	33

(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（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)
店頭	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。

当事業年度（2024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)
店頭	為替予約取引 売建				
	米ドル	6,735	-	4	4
	英ポンド	288	-	0	0
	カナダドル	145	-	0	0
	スイスフラン	180	-	0	0
	香港ドル	217	-	0	0
	ユーロ	664	-	3	3
合計	8,231	-	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）株式関連

前事業年度（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。

当事業年度（2024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	10,306	-	268	268
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	4,184	-	262	262
合計		14,490	-	530	530

（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（2023年3月31日）

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		1,729	-	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

当事業年度（2024年3月31日）

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		2,126	-	1
	英ポンド		4,586	-	7
	スイスフラン		28	-	0
	香港ドル		83	-	0
	ユーロ		63	-	0
	シンガポールドル		448	-	1
合計			7,337	-	10

（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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	820	911
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理計算上の差異の発生額	6	11
退職給付の支払額	57	85
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
退職給付債務の期末残高	911	993

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	911	993
未認識数理計算上の差異	6	17
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975
退職給付引当金	904	975
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	904	975

(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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	133	149
利息費用	3	3
数理差異償却	-	0
簡便法で計算した退職給付費用	6	1
確定給付制度に係る退職給付費用	142	155

(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 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024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109百万円、当事業年度122百万円であります。

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
繰延税金資産		

	58	百万円	63	百万円
未払事業税	58	百万円	63	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	187	"	220	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	277	"	298	"
税務上の費用認識差額	412	"	256	"
繰延ヘッジ損益	225	"	472	"
その他	75	"	78	"
繰延税金資産 合計	1,236	"	1,390	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	21	"	159	"
その他	32	"	35	"
繰延税金負債 合計	54	"	194	"
繰延税金資産の純額	1,181	"	1,196	"

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、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 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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	10,223百万円

[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 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。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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	9,926	未収運用受託報酬	5,520
							投信販売代行手数料等	10,187	未払手数料	2,482

（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（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）

当事業年度（2024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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	当事業年度 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
1株当たり純資産額	22,044,962円63銭	22,367,677円92銭

1株当たり当期純利益金額	1,816,227円49銭	1,528,527円02銭
--------------	---------------	---------------

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,448百万円	4,585百万円
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39期中間会計期間末

(2024年9月30日)

資産の部

流動資産

現金及び預金		15,957
金銭の信託		18,219
未収委託者報酬		11,990
未収運用受託報酬		6,429
短期差入証拠金		2,431
その他		4,238
流動資産合計		59,268

固定資産

有形固定資産	1	592
無形固定資産		
ソフトウェア		6,988
その他		59
無形固定資産合計		7,047

投資その他の資産

投資有価証券		6,615
関係会社株式		6,077
繰延税金資産		1,127
その他		30
投資その他の資産合計		13,850

固定資産合計

固定資産合計		21,491
--------	--	--------

資産合計

80,759

負債の部

流動負債

未払金		8,431
未払法人税等		1,202
賞与引当金		424
その他	2	2,306
流動負債合計		12,364

固定負債

退職給付引当金		1,035
資産除去債務		154

その他	53
固定負債合計	1,244
負債合計	13,608

(単位：百万円)

第39期中間会計期間末

(2024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	45,816
利益剰余金合計	48,416
株主資本合計	67,655
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	453
繰延ヘッジ損益	958
評価・換算差額等合計	504
純資産合計	67,150
負債・純資産合計	80,759

中間損益計算書

(単位：百万円)

第39期中間会計期間

(自 2024年4月1日

至 2024年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		24,956
運用受託報酬		6,026
その他営業収益		187
営業収益合計		31,169
営業費用		18,985
一般管理費	1	7,504
営業利益		4,678
営業外収益	2	193
営業外費用	3	976
経常利益		3,896
特別損失		61
税引前中間純利益		3,835
法人税、住民税及び事業税		1,202
法人税等還付税額		129
法人税等調整額		22
法人税等合計		1,050
中間純利益		2,785

中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益準備金	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	45,974	48,574	67,813
当中間期変動額					
剰余金の配当			2,943	2,943	2,943
中間純利益			2,785	2,785	2,785
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	-	-	157	157	157
当中間期末残高	500	2,100	45,816	48,416	67,655

	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	360	1,071	710	67,103
当中間期変動額				
剰余金の配当				2,943
中間純利益				2,785
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	92	112	205	205
当中間期変動額合計	92	112	205	47
当中間期末残高	453	958	504	67,150

注記事項

（重要な会計方針）

第39期中間会計期間
（自 2024年4月1日
至 2024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。

(中間貸借対照表関係)

第39期中間会計期間末 (2024年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 1,128百万円
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39期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 83百万円
	無形固定資産 1,211百万円

2	営業外収益の主要項目 投資有価証券売却益	149百万円
3	営業外費用の主要項目 金銭の信託運用損 投資有価証券償還損 為替差損 デリバティブ費用	263百万円 239百万円 146百万円 138百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）
第39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024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
2024年6月20日 定時株主総会	普通株式	2,943	981,032	2024年3月31日	2024年6月21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39期中間会計期間末（2024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、市場価格のない株式等、「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、「時価算定適用指針」という。）第24-3項を適用した投資信託及び第24-16項を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）*2及び（注2）、（注3）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	2,561	15,657	-	18,219
投資有価証券(*2)				
其他有価証券	-	3,269	-	3,269
資産計	2,561	18,927	-	21,488
デリバティブ取引(*3)				
株式関連取引	(281)	(230)	-	(511)
通貨関連取引	-	(286)	-	(286)
デリバティブ取引計	(281)	(517)	-	(798)

(*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、非上場株式（中間貸借対照表計上額876百万円）、時価算定適用指針第24-3項の基準価額を時価とみなす取扱いを適用した投資信託（中間貸借対照表計上額1,991百万円）及び第24-16項を適用した組合出資金等（中間貸借対照表計上額478百万円）は上記に含めておりません。

(*3)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。時価算定適用指針第24-3項の取り扱いを適用し、基準価額を時価とみなした投資信託はレベルを付していません。

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	876
関係会社株式	6,077

(注3) 時価算定適用指針第24-3項の取扱いを適用した投資信託に関する情報

第24-3項の取扱いを適用した投資信託の期首残高から期末残高への調整表

(単位：百万円)

区分	期首残高	当期の損益に計上した額	その他有価証券評価差額金に計上した額	購入、売却及び償還による変動額	基準価額を時価とみなすこととした額	基準価額を時価とみなさないこととした額	期末残高	当期の損益に計上した額のうち貸借対照表日において保有する投資信託の評価損益
投資有価証券(その他有価証券)	-	-	8	2,000	1,991	-	1,991	-

(注) 決算日における解約等に関する制限の主な内容は、一定期間の解約制限があるものが1,991百万円であります。

(有価証券関係)

第39期中間会計期間末（2024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	6,077

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	3,010	2,306	704
小計	3,010	2,306	704
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,249	2,306	57
小計	2,249	2,306	57
合計	5,260	4,613	647

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額876百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額478百万円）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39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024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	5,053	-	83	83
	英ポンド	173	-	5	5
	カナダドル	130	-	2	2
	スイスフラン	74	-	1	1
	香港ドル	120	-	1	1
	ユーロ	461	-	9	9
	買建				
	米ドル	42	-	0	0
	ユーロ	11	-	0	0
合計		6,068	-	104	104

(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	10,399	-	281	281
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	5,524	-	230	230
合計		15,923	-	511	511

(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		1,833	-	30
	英ポンド		4,463	-	137
	スイスフラン		49	-	0
	香港ドル		95	-	1
	ユーロ		31	-	0
	シンガポールドル		433	-	11
	合計			6,906	-

(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39期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024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39期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024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39期中間会計期間(自 2024年4月1日 至 2024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	5,620百万円

[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39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024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39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024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39期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）
該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第39期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
1株当たり純資産額	22,383,579円15銭
1株当たり中間純利益	928,397円37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39期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)	
中間純利益	2,785百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	2,785百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

4 【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

と。

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2025年3月10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（2024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） （2024年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2024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
2024年 3月11日	有価証券届出書
2024年 3月11日	有価証券報告書
2024年 9月11日	有価証券届出書
2024年 9月11日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2024年6月3日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 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**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2024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

2025年2月18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Aの2023年12月12日から2024年12月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC日本株式インデックスファンドAの2024年12月10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

2024年12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

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2024年4月1日から2025年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間（2024年4月1日から2024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2024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（2024年4月1日から2024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。