

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年12月28日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	D C 日本株式インデックス・オープン
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

**第一部【証券情報】****（１）【ファンドの名称】**

DC日本株式インデックス・オープン

**（２）【内国投資信託受益証券の形態等】**

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

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

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

**（３）【発行（売出）価額の総額】**

10兆円を上限とします。

**（４）【発行（売出）価格】**

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

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

**（５）【申込手数料】**

ありません。

**（６）【申込単位】**

1円以上1円単位とします。

**（７）【申込期間】**

2022年12月29日から2023年 6月30日までとします。

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

**（ 8 ） 【 申込取扱場所 】**

下記の照会先にお問い合わせください。

（ 照会先 ）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（ 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 ）

**（ 9 ） 【 払込期日 】**

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

**（ 10 ） 【 払込取扱場所 】**

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

**（ 11 ） 【 振替機関に関する事項 】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**（ 12 ） 【 その他 】**

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

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

< 申込みコース >

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

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所及び金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場並びに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）

における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付を中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

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

## &lt;信託金限度額&gt;

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。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

## [ 投資対象地域による区分 ]

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

## [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

## [ 独立した区分 ]

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

## [ 補足分類 ]

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

## &lt; 属性区分表定義 &gt;

## [ 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 ]

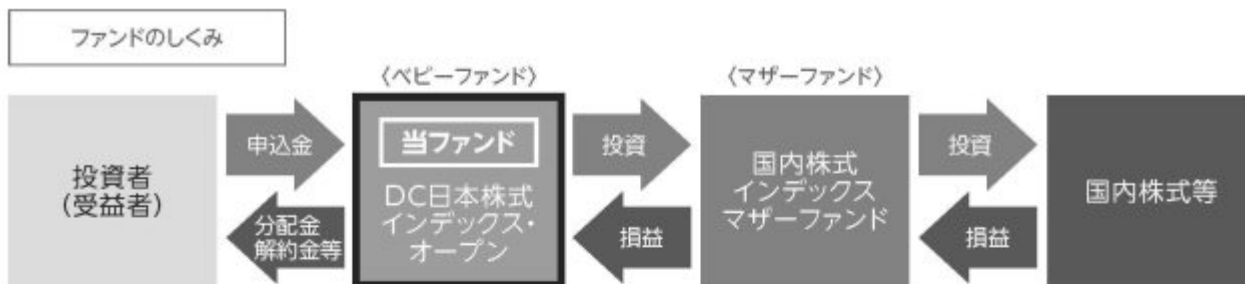
- (1)日経225
- (2)TOPIX
- (3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

#### [ 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。

#### < ファンドの特色 >

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



## ? ファミリーファンド方式とは

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

### 〈マザーファンドの概要〉

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

### マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

# 2. TOPIX(東証株価指数)に連動する投資成果を目指します。

## ? TOPIX(東証株価指数)とは

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

同指数の指数値及び同指数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、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、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。

1. T O P I X（東証株価指数）の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「 J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X が有しています。
2. J P X は、同指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は同指数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ます。
3. J P X は、同指数の指数値及び同指数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同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
4. J P X は、同指数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ありません。また、 J P X は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
5. 本件商品は、 J P X により提供、保証又は販売されるものではありません。
6. J P X 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いません。
7. J P X は、当社又は本件商品の購入者のニーズを同指数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ありません。
8. 以上の項目に限らず、 J P X 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ません。

#### 分配方針

- 原則として、毎年9月30日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。
  - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。
  - 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### 主な投資制限

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

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2001年10月1日

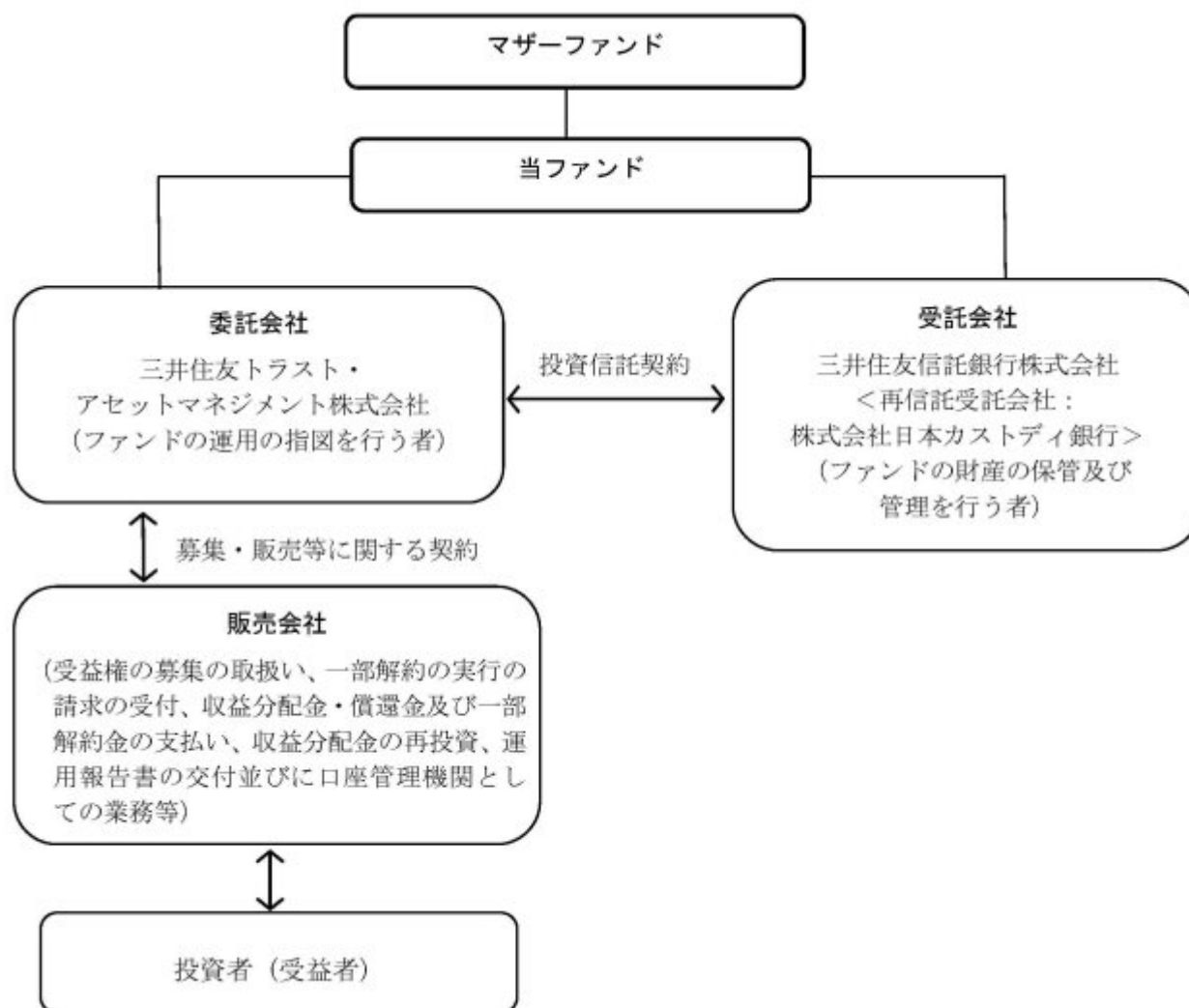
本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

2012年4月 1日

本ファンドの名称を「すみしん DC日本株式インデックス・オープン」から「DC日本株式インデックス・オープン」に変更  
 本ファンドの主要投資対象である「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の名称を「国内株式インデックス マザーファンド」に変更

### （3）【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2022年10月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

1986年11月1日：	住信キャピタルマネジメント株式会社設立
1987年2月20日：	投資顧問業の登録
1987年9月9日：	投資一任契約に係る業務の認可
1990年10月1日：	住信投資顧問株式会社に商号変更
1999年2月15日：	住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
1999年3月25日：	証券投資信託委託業の認可
2007年9月30日：	金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）

2012年4月1日： 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更

2018年10月1日： 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

#### 八．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### (イ)基本方針

当ファンドは、確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。

#### (ロ)運用方法

##### 投資対象

国内株式インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下「マザーファンド受益証券」ということがあります。）を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。

##### 投資態度

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

### (2)【投資対象】

(イ)本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。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条に定めるものに限りません。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

- 2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

(ロ)委託者は、信託金を主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三

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

1. 株券または新株引受権証書
  2. 国債証券
  3. 地方債証券
  4. 特別の法律により法人の発行する債券
  5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
  6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
  8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
  9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
  10. コマーシャル・ペーパー
  11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
  12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
  13. 証券投資信託または外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
  14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
  15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
  17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
  21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  22. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

（八）委託者は、信託金を、前記（ロ）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前号の権利の性質を有するもの

(二) 前記(ロ)の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前記(八)第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

### (参考) マザーファンドの概要

#### 「国内株式インデックス マザーファンド」の概要

##### 1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

##### 2. 運用方法

###### (1) 投資対象

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

###### (2) 投資態度

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）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

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

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

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

##### 3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財

産の純資産総額の5%以下とします。

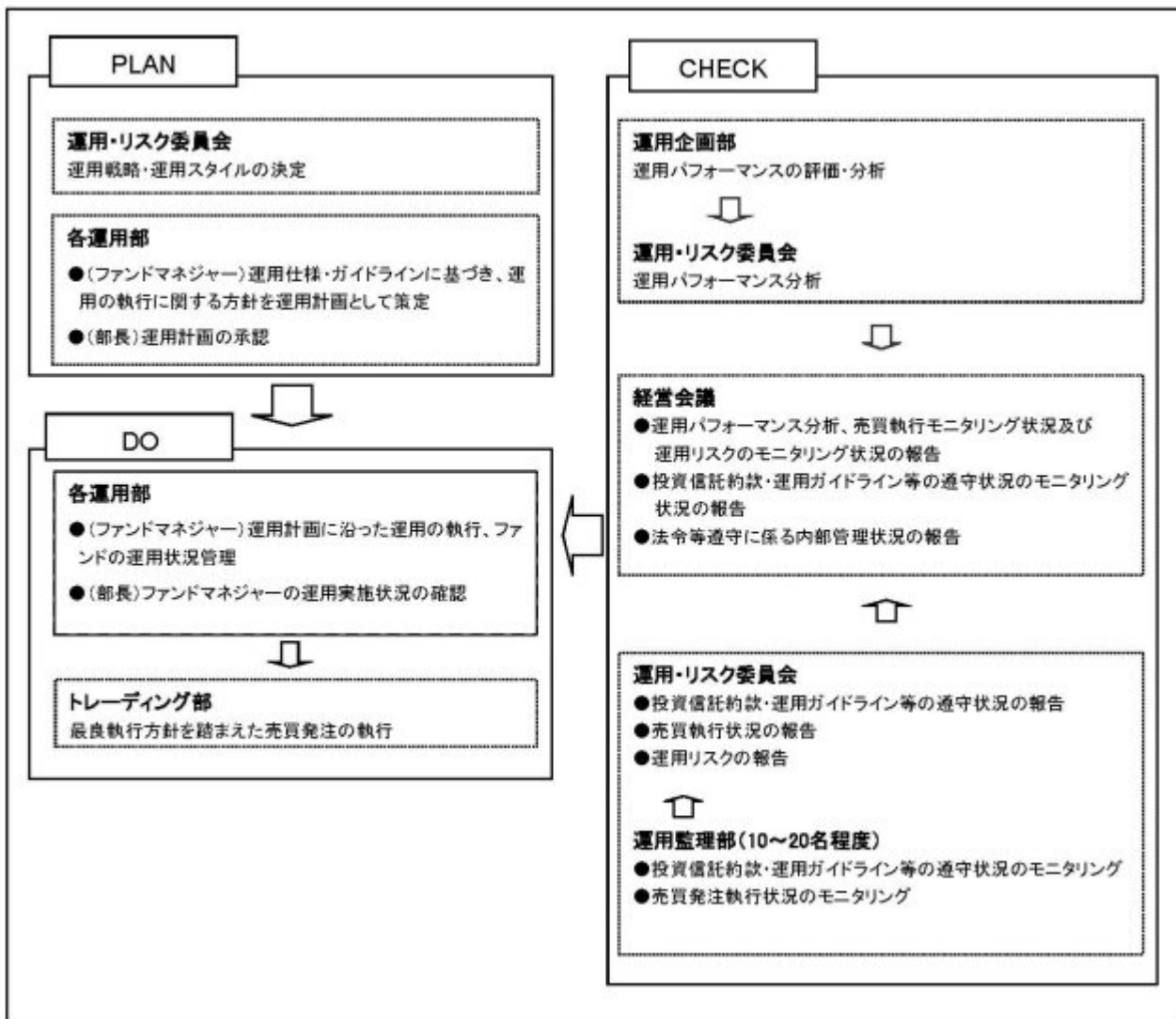
投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

### （3）【運用体制】

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



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行う



に当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

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

#### （４）【分配方針】

毎決算時に、原則として、以下の方針にもとづき収益分配を行います。

- ・ 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

- ・ 分配対象額についての分配方針

委託会社が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

- ・ 留保益の運用方針

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

##### < 約款に定める投資制限 >

株式への実質投資割合には制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

外貨建資産への投資は、行いません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、わが国の取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。前文の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。（投資信託約款第19条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売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、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。（投資信託約款第22条）

1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。（投資信託約款第23条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。（投資信託約款第24条）

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

委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第32条）

前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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

前記 および から における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対する、本ファンドの投資信託財産に属する前記 および から に掲げる当該各資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該各資産の時価総額のうち本ファンドの投資信

託財産に属するとみなした額の合計額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### < 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

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

##### 信用リスク

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

##### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### < その他の留意点 >

ファンドは、TOPIX（東証株価指数）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が小さかった場合も同様です。

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

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

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

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

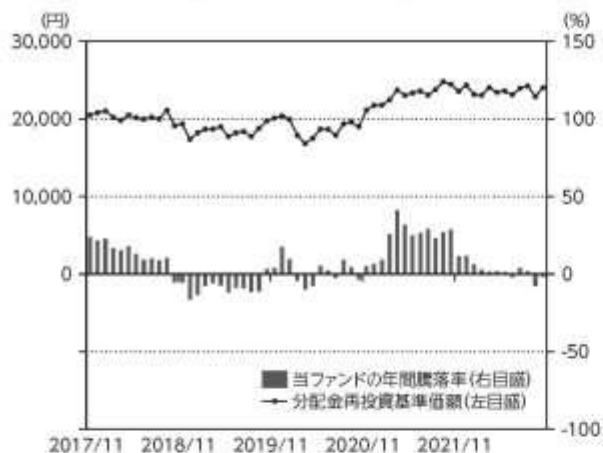
## (2) リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

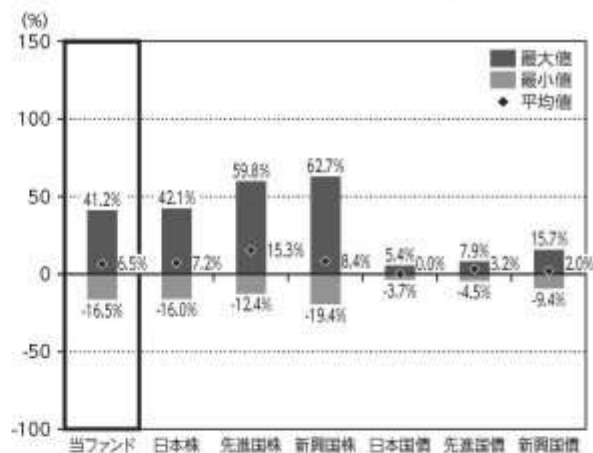
## 【参考情報】

### 当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

### 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- \*2017年11月～2022年10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

<b>日本株</b> TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての可能性を有するマーケットパンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る権利又は無償は、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。）の専断財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利ノウハウ及び同指数に係る権利又は無償に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、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。
<b>先進国株</b> MSCIロコサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIロコサイ・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。
<b>新興国株</b> MSCI Emerging Market インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Emerging Market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。
<b>日本国債</b> NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券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證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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。
<b>先進国債</b> 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、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、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。
<b>新興国債</b> J.P. Morgan Global Bond Index インデックス(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】

## &lt; 解約手数料 &gt;

ありません。

## &lt; 信託財産留保額 &gt;

ご解約時に、信託財産留保額（ ）の控除はありません。

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

## (3) 【信託報酬等】

## 信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率 0.66%（税抜 0.6%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.231% （税抜 0.21%）	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 0.374% （税抜 0.34%）	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 0.055% （税抜 0.05%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

## (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2022年10月31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。

#### 5【運用状況】

以下は、2022年10月31日現在の状況について記載してあります。

#### 【DC日本株式インデックス・オープン】

##### （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	12,087,294,648	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,950,719	0.05
合計(純資産総額)		12,093,245,367	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

##### （２）【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	6,265,768,829	1.8357	11,502,071,840	1.9291	12,087,294,648	99.95

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第12期計算期間末 (2013年 9月30日)	3,797,442,442	3,797,442,442	12,935	12,935
第13期計算期間末 (2014年 9月30日)	4,477,408,779	4,477,408,779	14,558	14,558
第14期計算期間末 (2015年 9月30日)	5,422,952,362	5,422,952,362	15,686	15,686
第15期計算期間末 (2016年 9月30日)	5,729,227,131	5,729,227,131	14,927	14,927
第16期計算期間末 (2017年10月 2日)	7,330,898,749	7,330,898,749	19,167	19,167
第17期計算期間末 (2018年10月 1日)	8,669,330,919	8,669,330,919	21,134	21,134
第18期計算期間末 (2019年 9月30日)	8,364,659,058	8,364,659,058	18,809	18,809
第19期計算期間末 (2020年 9月30日)	9,080,247,496	9,080,247,496	19,598	19,598
第20期計算期間末 (2021年 9月30日)	11,675,630,077	11,675,630,077	24,826	24,826
第21期計算期間末 (2022年 9月30日)	11,452,235,853	11,452,235,853	22,902	22,902
2021年10月末日	11,662,842,745		24,462	
11月末日	11,259,929,308		23,561	
12月末日	11,687,314,764		24,368	
2022年 1月末日	11,218,465,445		23,179	
2月末日	11,160,039,104		23,066	
3月末日	11,757,618,814		24,042	
4月末日	11,584,019,789		23,455	
5月末日	11,714,694,830		23,620	
6月末日	11,502,456,241		23,119	
7月末日	11,900,511,336		23,970	



8月末日	12,031,415,816		24,243	
9月末日	11,452,235,853		22,902	
10月末日	12,093,245,367		24,056	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	0
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	0
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	0
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	0
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	0
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	0
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	0
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	0
第20期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	0
第21期計算期間	2021年10月 1日～2022年 9月30日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	65.2
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	12.5
第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	7.7
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	4.8
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	28.4
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	10.3
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	11.0
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	4.2
第20期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	26.7
第21期計算期間	2021年10月 1日～2022年 9月30日	7.7

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第12期計算期間	2012年10月 2日～2013年 9月30日	1,221,033,540	966,324,863	2,935,771,322
第13期計算期間	2013年10月 1日～2014年 9月30日	1,073,391,560	933,574,251	3,075,588,631

第14期計算期間	2014年10月 1日～2015年 9月30日	1,497,444,507	1,115,886,709	3,457,146,429
第15期計算期間	2015年10月 1日～2016年 9月30日	1,215,333,947	834,369,525	3,838,110,851
第16期計算期間	2016年10月 1日～2017年10月 2日	1,128,218,267	1,141,666,812	3,824,662,306
第17期計算期間	2017年10月 3日～2018年10月 1日	1,122,120,183	844,769,825	4,102,012,664
第18期計算期間	2018年10月 2日～2019年 9月30日	1,105,861,467	760,666,529	4,447,207,602
第19期計算期間	2019年10月 1日～2020年 9月30日	1,310,633,921	1,124,605,757	4,633,235,766
第20期計算期間	2020年10月 1日～2021年 9月30日	1,083,018,794	1,013,364,344	4,702,890,216
第21期計算期間	2021年10月 1日～2022年 9月30日	1,020,279,867	722,712,080	5,000,458,003

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

(参考)

## 国内株式インデックス マザーファンド

### 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	496,006,051,520	98.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,464,981,971	1.48
合計(純資産総額)		503,471,033,491	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	6,991,380,000	1.39

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

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

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	9,773,400	2,119.42	20,714,029,739	2,059.50	20,128,317,300	4.00

日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,259,100	11,951.98	15,048,741,249	9,988.00	12,575,890,800	2.50
日本	株式	キーエンス	電気機器	178,100	51,490.71	9,170,496,483	56,320.00	10,030,592,000	1.99
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,287,400	3,986.39	9,118,487,346	4,094.00	9,364,615,600	1.86
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,492,700	737.76	8,478,941,030	699.50	8,039,143,650	1.60
日本	株式	第一三共	医薬品	1,555,100	3,542.34	5,508,705,526	4,767.00	7,413,161,700	1.47
日本	株式	任天堂	その他製品	1,123,700	5,834.75	6,556,515,973	6,070.00	6,820,859,000	1.35
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,032,200	5,360.67	5,533,287,039	6,400.00	6,606,080,000	1.31
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,354,700	4,683.47	6,344,699,164	4,590.00	6,218,073,000	1.24
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,579,800	3,747.25	5,919,908,224	3,918.00	6,189,656,400	1.23
日本	株式	日立製作所	電気機器	902,600	6,769.40	6,110,066,757	6,760.00	6,101,576,000	1.21
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,379,500	4,538.69	6,261,130,333	4,395.00	6,062,902,500	1.20
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,281,000	3,983.90	5,103,387,041	4,173.00	5,345,613,000	1.06
日本	株式	HOYA	精密機器	384,500	13,946.61	5,362,473,820	13,875.00	5,334,937,500	1.06
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	125,600	58,968.27	7,406,415,211	39,490.00	4,959,944,000	0.99
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,446,800	3,189.02	4,613,883,002	3,373.00	4,880,056,400	0.97
日本	株式	ダイキン工業	機械	214,600	20,695.00	4,441,148,434	22,385.00	4,803,821,000	0.95
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,765,200	2,471.41	4,362,541,747	2,691.00	4,750,153,200	0.94
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,177,400	4,484.81	5,280,424,928	4,031.00	4,746,099,400	0.94
日本	株式	信越化学工業	化学	305,100	18,182.69	5,547,539,439	15,540.00	4,741,254,000	0.94
日本	株式	三井物産	卸売業	1,377,900	3,183.26	4,386,218,689	3,293.00	4,537,424,700	0.90
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,160,400	3,722.16	4,319,202,325	3,849.00	4,466,379,600	0.89
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,867,900	1,492.31	4,279,811,119	1,465.50	4,202,907,450	0.83
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,535,200	1,535.35	3,892,430,499	1,606.00	4,071,531,200	0.81
日本	株式	村田製作所	電気機器	539,900	8,224.49	4,440,406,768	7,300.00	3,941,270,000	0.78
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	193,700	19,685.82	3,813,144,038	19,950.00	3,864,315,000	0.77
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	649,100	5,411.47	3,512,586,591	5,554.00	3,605,101,400	0.72
日本	株式	日本電産	電気機器	436,600	8,640.55	3,772,466,679	8,238.00	3,596,710,800	0.71
日本	株式	S M C	機械	58,300	66,196.12	3,859,234,367	60,120.00	3,504,996,000	0.70
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,710,700	2,044.82	3,498,080,453	2,046.50	3,500,947,550	0.70

(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	0.10
		鉱業	0.32
		建設業	1.92
		食料品	3.38
		繊維製品	0.44

パルプ・紙	0.17
化学	5.87
医薬品	5.83
石油・石炭製品	0.51
ゴム製品	0.78
ガラス・土石製品	0.69
鉄鋼	0.67
非鉄金属	0.68
金属製品	0.57
機械	5.02
電気機器	16.68
輸送用機器	7.87
精密機器	2.90
その他製品	2.45
電気・ガス業	1.21
陸運業	3.25
海運業	0.53
空運業	0.52
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	9.21
卸売業	5.38
小売業	4.50
銀行業	5.20
証券、商品先物取引業	0.73
保険業	2.28
その他金融業	1.12
不動産業	2.11
サービス業	5.49
小計	98.52
合計	98.52

(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	TOPIX先物	買建	363円		6,715,578,050	6,991,380,000	1.39

(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：2001年10月1日

作成基準日：2022年10月31日

**基準価額・純資産の推移**

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額 24,056円

純資産総額 120.93億円

**分配の推移**

(1万円当たり、税引前)

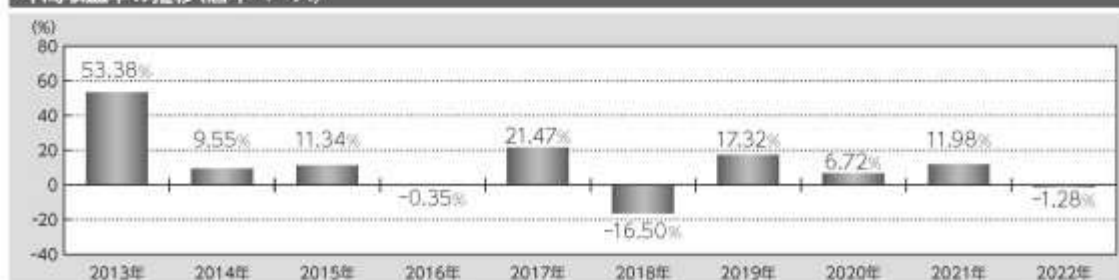
決算期	分配金
2018年10月	0円
2019年9月	0円
2020年9月	0円
2021年9月	0円
2022年9月	0円
設定来 分配金合計額	0円

※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	4.0%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.5%
キーエンス	日本	株式	電気機器	2.0%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.9%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.6%
第一三共	日本	株式	医薬品	1.5%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.4%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1.3%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	1.2%
武田薬品工業	日本	株式	医薬品	1.2%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移（暦年ベース）**

※2022年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

**第2【管理及び運営】****1【申込（販売）手続等】**

## &lt; 申込手続 &gt;

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

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

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

#### < 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

#### < 申込みの受付 >

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

#### < 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

ありません。

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

ありません。

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

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

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

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

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

#### < 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

#### < 解約価額 >

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

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

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

#### < 受付不可日 >

ありません。

#### < 一部解約受付の中止等 >

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



ができます。

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

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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

##### <基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### <主要な投資対象資産の評価方法>

本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象であるわが国の取引所に上場されている株式の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の当該取引所における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。（2001年10月1日設定）

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

### （4）【計算期間】

原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとします。

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

### （5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

#### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・受益権の口数が5億口を下回るようになった場合
- ・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。受託会社がその任務

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

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

#### < 反対者の買取請求権 >

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

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

#### 4【受益者の権利等】

##### (1)収益分配金に対する請求権

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

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

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

##### (2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

##### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第21期計算期間(2021年10月1日から2022年9月30日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【DC日本株式インデックス・オープン】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第20期 (2021年 9月30日現在)	第21期 (2022年 9月30日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	60,493,010	51,222,679
親投資信託受益証券	11,669,768,792	11,446,407,900
未収入金	1,397,659	-
流動資産合計	11,731,659,461	11,497,630,579
資産合計	11,731,659,461	11,497,630,579
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	19,118,994	6,008,020
未払受託者報酬	3,027,863	3,229,018
未払委託者報酬	33,306,403	35,519,104
未払利息	146	124
その他未払費用	575,978	638,460
流動負債合計	56,029,384	45,394,726
負債合計	56,029,384	45,394,726
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,702,890,216	5,000,458,003
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	6,972,739,861	6,451,777,850
(分配準備積立金)	3,053,315,770	2,632,489,571
元本等合計	11,675,630,077	11,452,235,853
純資産合計	11,675,630,077	11,452,235,853
負債純資産合計	11,731,659,461	11,497,630,579

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第20期		第21期	
	自	2020年10月1日	自	2021年10月1日
	至	2021年9月30日	至	2022年9月30日
営業収益				
受取利息		181		158
有価証券売買等損益		2,489,166,848		845,818,476
営業収益合計		2,489,167,029		845,818,318
営業費用				
支払利息		12,857		12,989
受託者報酬		5,761,013		6,385,786
委託者報酬		63,371,014		70,243,474
その他費用		575,978		638,460
営業費用合計		69,720,862		77,280,709
営業利益又は営業損失（ ）		2,419,446,167		923,099,027
経常利益又は経常損失（ ）		2,419,446,167		923,099,027
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,419,446,167		923,099,027
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（ ）		285,755,531		66,007,355
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		4,447,011,730		6,972,739,861
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,388,090,447		1,400,328,344
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,388,090,447		1,400,328,344
剰余金減少額又は欠損金増加額		996,052,952		1,064,198,683
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		996,052,952		1,064,198,683
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,972,739,861		6,451,777,850



## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

## ( 貸借対照表に関する注記 )

	第20期 (2021年 9月30日現在)	第21期 (2022年 9月30日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	4,702,890,216口	5,000,458,003口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.4826円 (24,826円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.2902円 (22,902円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第20期 自 2020年10月 1日 至 2021年 9月30日			第21期 自 2021年10月 1日 至 2022年 9月30日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	- 円	費用控除後の配当等収益額	A	- 円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,980,088,050円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円
収益調整金額	C	5,610,688,897円	収益調整金額	C	6,579,713,050円
分配準備積立金額	D	1,073,227,720円	分配準備積立金額	D	2,632,489,571円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,664,004,667円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,212,202,621円
当ファンドの期末残存口数	F	4,702,890,216口	当ファンドの期末残存口数	F	5,000,458,003口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	18,422円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	18,422円
1万口当たり分配金額	H	- 円	1万口当たり分配金額	H	- 円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円

## ( 金融商品に関する注記 )

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第21期 自 2021年10月 1日 至 2022年 9月30日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	第21期 (2022年 9月30日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第20期	第21期
	自 2020年10月 1日 至 2021年 9月30日	自 2021年10月 1日 至 2022年 9月30日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	4,633,235,766円	4,702,890,216円
期中追加設定元本額	1,083,018,794円	1,020,279,867円
期中一部解約元本額	1,013,364,344円	722,712,080円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第20期	第21期
	(2021年 9月30日現在)	(2022年 9月30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	2,384,019,344	805,388,492
合計	2,384,019,344	805,388,492

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス マザーファンド	6,236,125,252	11,446,407,900	
	合計	6,236,125,252	11,446,407,900	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

項目	2022年 9月30日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,171,036,896
株式	472,582,867,680
派生商品評価勘定	1,672,250
未収入金	377,809,000
未収配当金	5,187,664,901
前払金	81,868,300
差入委託証拠金	236,785,000
流動資産合計	482,639,704,027
資産合計	482,639,704,027
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	83,571,900
未払解約金	1,774,427,746
未払利息	10,106
流動負債合計	1,858,009,752
負債合計	1,858,009,752
純資産の部	
元本等	
元本	261,939,828,601
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	218,841,865,674
元本等合計	480,781,694,275
純資産合計	480,781,694,275
負債純資産合計	482,639,704,027

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

2022年 9月30日現在	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1)受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2)派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2022年 9月30日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	261,939,828,601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 1.8355円 (1万口当たり純資産額) (18,355円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

2022年 9月30日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2022年 9月30日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年 9月30日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2022年 9月30日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年10月 1日
期首元本額	249,768,323,924円
期中追加設定元本額	34,563,381,853円
期中一部解約元本額	22,391,877,176円
期末元本額	261,939,828,601円
期末元本額の内訳	
グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	393,459,282円
S B I 資産設計オープン（資産成長型）	4,048,136,311円
S B I 資産設計オープン（分配型）	14,636,639円
S M T T O P I X インデックス・オープン	11,753,805,963円
世界経済インデックスファンド	4,218,744,097円
日本株式インデックス・オープン	3,260,655,237円
D C マイセレクション 2 5	6,247,488,292円
D C マイセレクション 5 0	19,109,060,935円
D C マイセレクション 7 5	19,289,607,721円
D C 日本株式インデックス・オープン	6,236,125,252円
D C マイセレクション S 2 5	3,238,741,988円
D C マイセレクション S 5 0	9,521,473,020円
D C マイセレクション S 7 5	7,344,942,227円
D C 日本株式インデックス・オープン S	8,579,127,325円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 2 5	162,544,332円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 3 5	689,032,770円
D C ターゲット・イヤール ファンド 2 0 4 5	514,365,927円
D C 世界経済インデックスファンド	3,777,512,201円
日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,588,169,573円
国内バランス 6 0 V A 1（適格機関投資家専用）	3,234,332円
マイセレクション 5 0 V A 1（適格機関投資家専用）	17,671,882円
マイセレクション 7 5 V A 1（適格機関投資家専用）	21,109,086円
日本株式インデックス・オープン V A 1（適格機関投資家専用）	171,066,479円
国内バランス 6 0 V A 2（適格機関投資家専用）	2,280,372円
バランス 3 0 V A 1（適格機関投資家専用）	26,948,769円

区分	2022年 9月30日現在
バランス50VA1（適格機関投資家専用）	101,866,544円
バランス25VA2（適格機関投資家専用）	24,370,437円
バランス50VA2（適格機関投資家専用）	66,216,476円
バランスA（25）VA1（適格機関投資家専用）	832,256,984円
バランスB（37.5）VA1（適格機関投資家専用）	425,508,995円
バランスC（50）VA1（適格機関投資家専用）	2,740,745,587円
世界バランスVA1（適格機関投資家専用）	43,855,538円
世界バランスVA2（適格機関投資家専用）	17,474,015円
バランスD（35）VA1（適格機関投資家専用）	462,992,567円
バランスE（25）VA1（適格機関投資家専用）	262,157,365円
バランスF（25）VA1（適格機関投資家専用）	338,158,139円
国内バランス25VA1（適格機関投資家専用）	34,347,126円
FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）	585,254,482円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,322,989,958円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,897,837,857円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,926,951,857円
コア投資戦略ファンド（成長型）	4,283,750,971円
分散投資コア戦略ファンドA	1,440,100,504円
分散投資コア戦略ファンドS	6,193,390,222円
DC世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	517,536,877円
DC世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	443,179,359円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,880,527,274円
世界経済インデックスファンド（株式シフト型）	222,293,744円
世界経済インデックスファンド（債券シフト型）	10,836,028円
SMT インデックスバランス・オープン	58,193,129円
国内株式SMTBセレクション（SMA専用）	28,258,205,889円
サテライト投資戦略ファンド（株式型）	546,528,890円
SMT 世界経済インデックス・オープン	51,405,671円
SMT 世界経済インデックス・オープン（株式シフト型）	195,696,875円
SMT 世界経済インデックス・オープン（債券シフト型）	34,706,559円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,440,154円
グローバル経済コア	221,515,214円
SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	29,361,443円
My SMT TOPIXインデックス（ノーロード）	331,076,220円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	25,044,603円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	1,309,165,117円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	241,126,994円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2030	19,649,919円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2040	16,952,214円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2050	6,723,002円
DCターゲット・イヤーファンド（6資産・運用継続型）2060	8,379,599円
10資産分散投資ファンド	32,436円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	44,778,574,932円



区分	2022年 9月30日現在
F O F s 用 国内株式インデックス・ファンドS（適格機関投資家専用）	889,895,902円
世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	320,959,866円
F O F s 用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	54,212,426円
S M T A M 9 資産アロケーションファンド（適格機関投資家専用）	273,843,062円
S M T A M 日本株式インデックスファンドV L - P（適格機関投資家専用）	45,734,154,592円
私募世界経済パッシブファンド（適格機関投資家専用）	17,368,519円
ファンドラップ運用戦略F（中庸型）（適格機関投資家専用）	203,076,456円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2022年 9月30日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		22,159,707,299
合計		22,159,707,299

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2022年 9月30日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	8,435,668,300	-	8,353,800,000	81,868,300
	合計	8,435,668,300	-	8,353,800,000	81,868,300

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 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	8,900	3,620.00	32,218,000
日本水産	254,000	545.00	138,430,000
マルハニチロ	36,200	2,460.00	89,052,000
雪国まいたけ	20,000	998.00	19,960,000
カネコ種苗	7,700	1,464.00	11,272,800
サカタのタネ	29,600	4,810.00	142,376,000
ホクト	20,900	1,894.00	39,584,600
ホクリヨウ	3,700	602.00	2,227,400
住石ホールディングス	47,900	208.00	9,963,200
日鉄鉱業	10,400	2,748.00	28,579,200
三井松島ホールディングス	11,400	3,035.00	34,599,000
I N P E X	867,100	1,359.00	1,178,388,900
石油資源開発	32,200	3,465.00	111,573,000
K & O エナジーグループ	10,600	1,623.00	17,203,800
ショーボンドホールディングス	31,900	6,260.00	199,694,000
ミライト・ワン	88,100	1,467.00	129,242,700
タマホーム	16,600	2,350.00	39,010,000
サンヨーホームズ	3,200	690.00	2,208,000
日本アクア	10,900	729.00	7,946,100
ファーストコーポレーション	6,700	726.00	4,864,200
ベステラ	5,600	935.00	5,236,000
R o b o t H o m e	39,900	170.00	6,783,000
キャンディル	4,000	515.00	2,060,000
ダイセキ環境ソリューション	5,300	865.00	4,584,500
第一カッター興業	6,000	1,239.00	7,434,000
安藤・間	124,500	837.00	104,206,500
東急建設	73,400	631.00	46,315,400
コムシスホールディングス	88,200	2,462.00	217,148,400
ビーアールホールディングス	34,400	319.00	10,973,600
高松コンストラクショングループ	17,400	1,881.00	32,729,400
東建コーポレーション	7,600	8,010.00	60,876,000
ソネック	2,800	970.00	2,716,000
ヤマウラ	11,900	955.00	11,364,500
オリエンタル白石	91,900	246.00	22,607,400
大成建設	175,800	4,020.00	706,716,000
大林組	586,600	928.00	544,364,800
清水建設	542,400	709.00	384,561,600
飛島建設	16,900	1,042.00	17,609,800
長谷工コーポレーション	169,300	1,571.00	265,970,300
松井建設	21,000	563.00	11,823,000
銭高組	2,300	3,080.00	7,084,000
鹿島建設	429,800	1,373.00	590,115,400

不動テトラ	13,400	1,473.00	19,738,200
大末建設	6,600	1,421.00	9,378,600
鉄建建設	12,700	1,774.00	22,529,800
西松建設	38,200	3,795.00	144,969,000
三井住友建設	142,400	445.00	63,368,000
大豊建設	9,200	4,155.00	38,226,000
佐田建設	13,600	403.00	5,480,800
ナカノフドー建設	15,100	302.00	4,560,200
奥村組	31,400	2,846.00	89,364,400
東鉄工業	24,800	2,317.00	57,461,600
イチケン	4,600	1,781.00	8,192,600
富士ピー・エス	8,100	449.00	3,636,900
浅沼組	14,100	2,676.00	37,731,600
戸田建設	242,100	744.00	180,122,400
熊谷組	31,200	2,522.00	78,686,400
北野建設	3,800	2,334.00	8,869,200
植木組	5,200	1,238.00	6,437,600
矢作建設工業	25,100	736.00	18,473,600
ピーエス三菱	20,800	614.00	12,771,200
日本ハウスホールディングス	32,500	456.00	14,820,000
大東建託	64,600	13,570.00	876,622,000
新日本建設	26,900	707.00	19,018,300
東亜道路工業	3,300	5,840.00	19,272,000
日本道路	5,500	5,740.00	31,570,000
東亜建設工業	14,100	2,489.00	35,094,900
日本国土開発	49,200	627.00	30,848,400
若築建設	9,700	2,251.00	21,834,700
東洋建設	70,800	851.00	60,250,800
五洋建設	232,500	727.00	169,027,500
世紀東急工業	28,800	755.00	21,744,000
福田組	6,200	4,825.00	29,915,000
住友林業	125,800	2,205.00	277,389,000
日本基礎技術	15,400	458.00	7,053,200
巴コーポレーション	22,900	405.00	9,274,500
大和ハウス工業	499,900	2,943.50	1,471,455,650
ライト工業	34,700	1,904.00	66,068,800
積水ハウス	599,400	2,401.00	1,439,159,400
日特建設	13,000	894.00	11,622,000
北陸電気工事	11,200	706.00	7,907,200
ユアテック	36,100	705.00	25,450,500
日本リーテック	12,000	781.00	9,372,000
四電工	6,100	1,759.00	10,729,900

中電工	25,400	2,091.00	53,111,400
関電工	102,700	832.00	85,446,400
きんでん	128,300	1,528.00	196,042,400
東京エネシス	18,600	969.00	18,023,400
トーエネック	6,300	3,405.00	21,451,500
住友電設	15,600	2,593.00	40,450,800
日本電設工業	26,900	1,836.00	49,388,400
エクシオグループ	87,700	2,091.00	183,380,700
新日本空調	13,700	1,801.00	24,673,700
九電工	39,900	2,750.00	109,725,000
三機工業	41,000	1,585.00	64,985,000
日揮ホールディングス	178,400	1,809.00	322,725,600
中外炉工業	5,900	1,546.00	9,121,400
ヤマト	15,200	779.00	11,840,800
太平電業	11,400	3,340.00	38,076,000
高砂熱学工業	48,300	1,701.00	82,158,300
三晃金属工業	2,500	2,636.00	6,590,000
朝日工業社	7,700	1,768.00	13,613,600
明星工業	31,700	702.00	22,253,400
大気社	26,300	3,220.00	84,686,000
ダイダン	11,900	2,141.00	25,477,900
日比谷総合設備	17,200	1,862.00	32,026,400
フィル・カンパニー	2,900	1,179.00	3,419,100
テスホールディングス	17,600	945.00	16,632,000
インフロニア・ホールディングス	219,900	984.00	216,381,600
東洋エンジニアリング	26,500	560.00	14,840,000
レイズネクスト	27,100	1,176.00	31,869,600
ニッポン	49,300	1,554.00	76,612,200
日清製粉グループ本社	190,300	1,468.00	279,360,400
日東富士製粉	2,900	4,795.00	13,905,500
昭和産業	15,900	2,478.00	39,400,200
鳥越製粉	14,700	661.00	9,716,700
中部飼料	20,900	1,042.00	21,777,800
フィード・ワン	24,100	666.00	16,050,600
東洋精糖	3,400	844.00	2,869,600
日本甜菜製糖	10,500	1,617.00	16,978,500
D M三井製糖ホールディングス	16,300	1,893.00	30,855,900
塩水港精糖	24,100	199.00	4,795,900
日新製糖	9,600	1,728.00	16,588,800
森永製菓	40,700	3,975.00	161,782,500
中村屋	4,100	3,110.00	12,751,000
江崎グリコ	47,100	3,565.00	167,911,500

名糖産業	7,300	1,600.00	11,680,000
井村屋グループ	9,800	2,187.00	21,432,600
不二家	11,300	2,444.00	27,617,200
山崎製パン	110,200	1,663.00	183,262,600
第一屋製パン	3,500	410.00	1,435,000
モロゾフ	6,000	3,710.00	22,260,000
亀田製菓	10,500	4,590.00	48,195,000
寿スピリッツ	17,500	8,350.00	146,125,000
カルビー	92,100	3,100.00	285,510,000
森永乳業	34,300	4,255.00	145,946,500
六甲バター	12,100	1,391.00	16,831,100
ヤクルト本社	128,400	8,410.00	1,079,844,000
明治ホールディングス	111,300	6,430.00	715,659,000
雪印メグミルク	44,200	1,713.00	75,714,600
プリマハム	25,300	2,090.00	52,877,000
日本ハム	70,800	3,810.00	269,748,000
林兼産業	6,100	444.00	2,708,400
丸大食品	18,200	1,427.00	25,971,400
S Foods	18,200	3,035.00	55,237,000
柿安本店	7,000	2,259.00	15,813,000
伊藤ハム米久ホールディングス	128,000	666.00	85,248,000
サッポロホールディングス	54,200	3,180.00	172,356,000
アサヒグループホールディングス	380,500	4,484.00	1,706,162,000
キリンホールディングス	743,000	2,227.00	1,654,661,000
宝ホールディングス	112,400	1,057.00	118,806,800
オエノンホールディングス	49,200	274.00	13,480,800
養命酒製造	5,400	1,783.00	9,628,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	129,000	1,404.00	181,116,000
サントリー食品インターナショナル	115,900	5,130.00	594,567,000
ダイトーグループホールディングス	10,400	4,815.00	50,076,000
伊藤園	61,400	5,860.00	359,804,000
キーコーヒー	18,400	2,089.00	38,437,600
ユニカフェ	6,100	927.00	5,654,700
ジャパンフーズ	2,900	1,088.00	3,155,200
日清オイリオグループ	23,200	3,195.00	74,124,000
不二製油グループ本社	43,800	2,406.00	105,382,800
かどや製油	1,800	3,560.00	6,408,000
J - オイルミルズ	18,900	1,554.00	29,370,600
キッコーマン	121,200	8,200.00	993,840,000
味の素	403,000	3,962.00	1,596,686,000
ブルドックソース	7,200	1,820.00	13,104,000
キューピー	88,500	2,380.00	210,630,000

ハウス食品グループ本社	63,000	2,887.00	181,881,000
カゴメ	76,700	3,015.00	231,250,500
焼津水産化学工業	8,200	867.00	7,109,400
アリアケジャパン	18,500	5,020.00	92,870,000
ピエトロ	2,600	1,765.00	4,589,000
エバラ食品工業	4,400	3,020.00	13,288,000
やまみ	1,700	1,314.00	2,233,800
ニチレイ	75,400	2,385.00	179,829,000
東洋水産	90,100	5,960.00	536,996,000
イトアンドホールディングス	7,600	2,183.00	16,590,800
大冷	2,300	1,860.00	4,278,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,400	487.00	5,064,800
日清食品ホールディングス	65,200	10,070.00	656,564,000
永谷園ホールディングス	9,000	1,993.00	17,937,000
一正蒲鉾	7,800	770.00	6,006,000
フジッコ	18,800	1,911.00	35,926,800
ロック・フィールド	20,100	1,459.00	29,325,900
日本たばこ産業	1,083,900	2,374.00	2,573,178,600
ケンコーマヨネーズ	10,300	1,555.00	16,016,500
わらべや日洋ホールディングス	12,100	2,216.00	26,813,600
なとり	11,300	1,991.00	22,498,300
イフジ産業	3,500	893.00	3,125,500
ファーマフーズ	25,500	1,232.00	31,416,000
ユーグレナ	106,000	856.00	90,736,000
紀文食品	15,700	912.00	14,318,400
ピクルスホールディングス	9,600	977.00	9,379,200
ミヨシ油脂	6,400	994.00	6,361,600
理研ビタミン	14,200	1,757.00	24,949,400
片倉工業	15,700	2,041.00	32,043,700
ゲンゼ	11,600	3,865.00	44,834,000
東洋紡	78,500	1,035.00	81,247,500
ユニチカ	56,100	298.00	16,717,800
富士紡ホールディングス	8,200	3,285.00	26,937,000
倉敷紡績	14,000	1,973.00	27,622,000
シキボウ	10,300	880.00	9,064,000
日本毛織	49,200	1,065.00	52,398,000
トーア紡コーポレーション	7,300	335.00	2,445,500
帝国繊維	19,200	1,548.00	29,721,600
帝人	173,700	1,402.00	243,527,400
東レ	1,225,000	711.80	871,955,000
住江織物	3,400	1,715.00	5,831,000
日本フェルト	12,400	407.00	5,046,800

イチカワ	2,700	1,345.00	3,631,500
日東製網	2,100	1,295.00	2,719,500
アツギ	14,700	370.00	5,439,000
ダイニック	6,400	589.00	3,769,600
セーレン	36,600	2,104.00	77,006,400
ソトー	7,500	692.00	5,190,000
東海染工	2,500	1,126.00	2,815,000
小松マテーレ	30,000	776.00	23,280,000
ワコールホールディングス	40,400	2,145.00	86,658,000
ホギメディカル	24,600	3,550.00	87,330,000
T S Iホールディングス	60,500	395.00	23,897,500
マツオカコーポレーション	5,900	941.00	5,551,900
ワールド	26,000	1,390.00	36,140,000
三陽商会	8,700	943.00	8,204,100
ナイガイ	7,600	253.00	1,922,800
オンワードホールディングス	109,400	292.00	31,944,800
ルックホールディングス	5,400	2,133.00	11,518,200
ゴールドウイン	32,700	7,660.00	250,482,000
デサント	33,700	3,325.00	112,052,500
キング	9,800	415.00	4,067,000
ヤマトインターナショナル	15,500	257.00	3,983,500
特種東海製紙	10,200	2,956.00	30,151,200
王子ホールディングス	761,200	538.00	409,525,600
日本製紙	80,000	941.00	75,280,000
三菱製紙	25,200	283.00	7,131,600
北越コーポレーション	117,600	755.00	88,788,000
中越パルプ工業	7,500	916.00	6,870,000
巴川製紙所	5,800	765.00	4,437,000
大王製紙	84,600	1,160.00	98,136,000
阿波製紙	4,500	298.00	1,341,000
レンゴー	152,600	840.00	128,184,000
トモク	9,700	1,423.00	13,803,100
ザ・パック	12,400	2,216.00	27,478,400
北の達人コーポレーション	70,600	257.00	18,144,200
クラレ	266,300	1,011.00	269,229,300
旭化成	1,220,400	955.50	1,166,092,200
共和レザー	10,700	509.00	5,446,300
昭和電工	161,900	2,054.00	332,542,600
住友化学	1,345,700	497.00	668,812,900
住友精化	7,900	2,996.00	23,668,400
日産化学	88,800	6,450.00	572,760,000
ラサ工業	7,000	2,233.00	15,631,000

クレハ	14,300	8,880.00	126,984,000
多木化学	6,500	4,850.00	31,525,000
テイカ	11,300	1,234.00	13,944,200
石原産業	35,400	1,019.00	36,072,600
片倉コープアグリ	4,400	1,163.00	5,117,200
日本曹達	21,600	4,405.00	95,148,000
東ソー	243,900	1,610.00	392,679,000
トクヤマ	58,600	1,741.00	102,022,600
セントラル硝子	29,600	3,325.00	98,420,000
東亜合成	86,100	1,079.00	92,901,900
大阪ソーダ	15,000	3,800.00	57,000,000
関東電化工業	36,000	922.00	33,192,000
デンカ	66,500	3,175.00	211,137,500
信越化学工業	312,700	14,330.00	4,480,991,000
日本カーバイド工業	7,000	1,240.00	8,680,000
堺化学工業	12,800	1,874.00	23,987,200
第一稀元素化学工業	16,800	1,222.00	20,529,600
エア・ウォーター	158,000	1,708.00	269,864,000
日本酸素ホールディングス	162,500	2,281.00	370,662,500
日本化学工業	5,600	1,871.00	10,477,600
東邦アセチレン	3,900	1,075.00	4,192,500
日本パーカラライジング	82,900	931.00	77,179,900
高压ガス工業	27,800	623.00	17,319,400
チタン工業	2,300	1,580.00	3,634,000
四国化成工業	22,800	1,226.00	27,952,800
戸田工業	4,200	2,624.00	11,020,800
ステラ ケミファ	9,900	2,508.00	24,829,200
保土谷化学工業	5,300	2,904.00	15,391,200
日本触媒	28,100	5,400.00	151,740,000
大日精化工業	14,000	1,695.00	23,730,000
カネカ	42,500	3,610.00	153,425,000
三菱瓦斯化学	152,900	1,896.00	289,898,400
三井化学	153,600	2,819.00	432,998,400
J S R	169,400	2,750.00	465,850,000
東京応化工業	29,300	6,040.00	176,972,000
大阪有機化学工業	12,600	2,036.00	25,653,600
三菱ケミカルグループ	1,224,500	661.60	810,129,200
K Hネオケム	27,900	2,636.00	73,544,400
ダイセル	265,200	851.00	225,685,200
住友ベークライト	27,900	3,965.00	110,623,500
積水化学工業	376,800	1,768.00	666,182,400
日本ゼオン	143,500	1,278.00	183,393,000



アイカ工業	46,500	3,130.00	145,545,000
UBE	93,000	1,932.00	179,676,000
積水樹脂	27,100	1,647.00	44,633,700
タキロンシーアイ	42,700	522.00	22,289,400
旭有機材	11,100	2,197.00	24,386,700
ニチバン	10,400	1,614.00	16,785,600
リケンテクノス	40,100	502.00	20,130,200
大倉工業	7,800	1,782.00	13,899,600
積水化成成品工業	23,500	398.00	9,353,000
群栄化学工業	3,900	2,328.00	9,079,200
タイガースポリマー	9,400	403.00	3,788,200
ミライアル	6,300	1,603.00	10,098,900
ダイキアクシス	6,800	636.00	4,324,800
ダイキョーニシカワ	41,600	532.00	22,131,200
竹本容器	6,300	752.00	4,737,600
森六ホールディングス	9,500	1,686.00	16,017,000
恵和	5,400	3,470.00	18,738,000
日本化薬	138,600	1,158.00	160,498,800
カーリットホールディングス	16,500	656.00	10,824,000
日本精化	12,700	1,896.00	24,079,200
扶桑化学工業	15,500	3,110.00	48,205,000
トリケミカル研究所	20,300	1,776.00	36,052,800
ADEKA	77,900	2,161.00	168,341,900
日油	57,000	5,220.00	297,540,000
新日本理化	28,000	251.00	7,028,000
ハリマ化成グループ	13,000	856.00	11,128,000
花王	415,900	5,898.00	2,452,978,200
第一工業製薬	6,700	1,911.00	12,803,700
石原ケミカル	9,200	1,241.00	11,417,200
日華化学	7,500	843.00	6,322,500
ニイタカ	3,700	2,250.00	8,325,000
三洋化成工業	11,800	4,380.00	51,684,000
有機合成薬品工業	13,700	287.00	3,931,900
大日本塗料	22,300	715.00	15,944,500
日本ペイントホールディングス	741,200	979.00	725,634,800
関西ペイント	170,500	2,047.00	349,013,500
神東塗料	15,500	133.00	2,061,500
中国塗料	42,600	889.00	37,871,400
日本特殊塗料	11,800	908.00	10,714,400
藤倉化成	24,600	410.00	10,086,000
太陽ホールディングス	29,100	2,403.00	69,927,300
DIC	65,500	2,407.00	157,658,500

サカティンクス	37,300	977.00	36,442,100
東洋インキSCホールディングス	32,800	1,900.00	62,320,000
T&K TOKA	15,900	881.00	14,007,900
富士フィルムホールディングス	354,000	6,609.00	2,339,586,000
資生堂	350,200	5,056.00	1,770,611,200
ライオン	201,200	1,636.00	329,163,200
高砂香料工業	11,300	2,647.00	29,911,100
マンダム	39,200	1,520.00	59,584,000
ミルボン	24,900	6,370.00	158,613,000
ファンケル	81,500	2,876.00	234,394,000
コーセー	34,100	14,900.00	508,090,000
コタ	14,000	1,535.00	21,490,000
シーボン	2,600	1,644.00	4,274,400
ポーラ・オルビスホールディングス	86,000	1,635.00	140,610,000
ノエビアホールディングス	15,000	5,680.00	85,200,000
アジュバンホールディングス	4,500	940.00	4,230,000
新日本製薬	9,600	1,502.00	14,419,200
エステー	12,900	1,501.00	19,362,900
アグロ カネショウ	6,700	1,307.00	8,756,900
コニシ	30,500	1,553.00	47,366,500
長谷川香料	34,700	3,000.00	104,100,000
星光PMC	9,500	525.00	4,987,500
小林製薬	51,300	8,480.00	435,024,000
荒川化学工業	14,200	981.00	13,930,200
メック	13,800	2,232.00	30,801,600
日本高純度化学	4,700	2,318.00	10,894,600
タカラバイオ	52,700	1,701.00	89,642,700
JCU	20,700	2,921.00	60,464,700
新田ゼラチン	11,500	899.00	10,338,500
OATアグリオ	7,600	1,786.00	13,573,600
デクセリアルズ	52,500	3,250.00	170,625,000
アース製薬	15,200	5,190.00	78,888,000
北興化学工業	16,900	904.00	15,277,600
大成ラミック	5,300	2,741.00	14,527,300
クミアイ化学工業	66,600	1,018.00	67,798,800
日本農薬	35,900	846.00	30,371,400
アキレス	12,900	1,301.00	16,782,900
有沢製作所	27,400	1,228.00	33,647,200
日東電工	121,700	7,830.00	952,911,000
レック	23,900	824.00	19,693,600
三光合成	23,000	467.00	10,741,000
きもと	30,800	228.00	7,022,400

藤森工業	15,700	3,215.00	50,475,500
前澤化成工業	11,800	1,293.00	15,257,400
未来工業	7,200	1,495.00	10,764,000
ウェーブロックホールディングス	7,600	587.00	4,461,200
J S P	11,800	1,395.00	16,461,000
エフピコ	37,000	3,555.00	131,535,000
天馬	15,800	1,911.00	30,193,800
信越ポリマー	36,200	1,197.00	43,331,400
東リ	46,000	200.00	9,200,000
ニフコ	67,200	3,005.00	201,936,000
バルカー	16,400	2,508.00	41,131,200
ユニ・チャーム	349,400	4,750.00	1,659,650,000
ショーエイコーポレーション	5,400	557.00	3,007,800
協和キリン	202,600	3,315.00	671,619,000
武田薬品工業	1,583,100	3,767.00	5,963,537,700
アステラス製薬	1,722,100	1,917.00	3,301,265,700
住友ファーマ	124,400	1,031.00	128,256,400
塩野義製薬	233,800	6,989.00	1,634,028,200
わかもと製薬	19,600	238.00	4,664,800
日本新薬	43,900	7,400.00	324,860,000
中外製薬	525,000	3,626.00	1,903,650,000
科研製薬	28,700	3,815.00	109,490,500
エーザイ	222,500	7,749.00	1,724,152,500
ロート製薬	96,000	4,635.00	444,960,000
小野薬品工業	388,300	3,381.00	1,312,842,300
久光製薬	42,600	3,395.00	144,627,000
持田製薬	22,600	3,375.00	76,275,000
参天製薬	350,800	975.00	342,030,000
扶桑薬品工業	6,500	1,967.00	12,785,500
日本ケミファ	2,100	1,771.00	3,719,100
ツムラ	57,600	3,085.00	177,696,000
日医工	57,200	436.00	24,939,200
キッセイ薬品工業	29,200	2,573.00	75,131,600
生化学工業	35,500	831.00	29,500,500
栄研化学	30,000	1,796.00	53,880,000
鳥居薬品	9,000	2,884.00	25,956,000
J C R ファーマ	56,800	2,165.00	122,972,000
東和薬品	29,000	2,123.00	61,567,000
富士製薬工業	10,800	1,034.00	11,167,200
ゼリア新薬工業	29,900	2,072.00	61,952,800
第一三共	1,461,100	4,042.00	5,905,766,200
キョーリン製薬ホールディングス	36,400	1,770.00	64,428,000

大幸薬品	30,400	561.00	17,054,400
ダイト	12,600	2,462.00	31,021,200
大塚ホールディングス	383,700	4,584.00	1,758,880,800
大正製薬ホールディングス	37,300	5,300.00	197,690,000
ペプチドリーム	81,300	1,615.00	131,299,500
あすか製薬ホールディングス	19,100	1,113.00	21,258,300
サワイグループホールディングス	38,600	4,060.00	156,716,000
日本コークス工業	170,200	91.00	15,488,200
ニチレキ	21,800	1,283.00	27,969,400
ユシロ化学工業	9,600	826.00	7,929,600
ビーピー・カストロール	7,200	1,076.00	7,747,200
富士石油	44,000	290.00	12,760,000
MORESCO	6,700	1,080.00	7,236,000
出光興産	204,900	3,135.00	642,361,500
ENEOSホールディングス	3,030,100	465.10	1,409,299,510
コスモエネルギーホールディングス	79,500	3,710.00	294,945,000
横浜ゴム	95,400	2,216.00	211,406,400
TOYO TIRE	96,400	1,570.00	151,348,000
ブリヂストン	535,600	4,669.00	2,500,716,400
住友ゴム工業	164,500	1,151.00	189,339,500
藤倉コンポジット	16,100	884.00	14,232,400
オカモト	9,300	3,550.00	33,015,000
フコク	8,800	969.00	8,527,200
ニッタ	18,900	2,780.00	52,542,000
住友理工	39,000	563.00	21,957,000
三ツ星ベルト	24,500	3,010.00	73,745,000
バンドー化学	32,500	1,026.00	33,345,000
日東紡績	25,000	2,305.00	57,625,000
AGC	170,700	4,490.00	766,443,000
日本板硝子	91,100	511.00	46,552,100
石塚硝子	3,300	1,502.00	4,956,600
日本山村硝子	7,200	572.00	4,118,400
日本電気硝子	68,500	2,493.00	170,770,500
オハラ	8,100	1,250.00	10,125,000
住友大阪セメント	30,100	3,260.00	98,126,000
太平洋セメント	114,500	2,038.00	233,351,000
日本ヒューム	16,700	629.00	10,504,300
日本コンクリート工業	36,700	245.00	8,991,500
三谷セキサン	8,200	3,465.00	28,413,000
アジアパイルホールディングス	28,900	482.00	13,929,800
東海カーボン	140,800	979.00	137,843,200
日本カーボン	9,700	3,970.00	38,509,000

東洋炭素	10,500	3,285.00	34,492,500
ノリタケカンパニーリミテド	10,200	4,015.00	40,953,000
TOTO	121,800	4,820.00	587,076,000
日本碍子	198,400	1,800.00	357,120,000
日本特殊陶業	140,500	2,562.00	359,961,000
MARUWA	7,000	15,460.00	108,220,000
品川リフラクトリーズ	4,800	3,750.00	18,000,000
黒崎播磨	3,400	4,630.00	15,742,000
ヨータイ	12,900	1,397.00	18,021,300
東京窯業	20,400	257.00	5,242,800
ニッカトー	8,700	429.00	3,732,300
フジミインコーポレーテッド	16,200	6,050.00	98,010,000
クニミネ工業	6,500	799.00	5,193,500
エーアンドエーマテリアル	3,600	853.00	3,070,800
ニチアス	42,500	2,245.00	95,412,500
ニチハ	25,700	2,746.00	70,572,200
日本製鉄	832,000	2,006.50	1,669,408,000
神戸製鋼所	347,100	580.00	201,318,000
中山製鋼所	27,700	562.00	15,567,400
合同製鐵	9,700	1,682.00	16,315,400
JFEホールディングス	461,100	1,341.00	618,335,100
東京製鐵	58,200	1,261.00	73,390,200
共英製鋼	19,700	1,387.00	27,323,900
大和工業	32,500	4,380.00	142,350,000
東京鐵鋼	8,300	1,304.00	10,823,200
大阪製鐵	10,600	1,136.00	12,041,600
淀川製鋼所	21,800	2,374.00	51,753,200
丸一鋼管	57,800	2,959.00	171,030,200
モリ工業	4,900	2,616.00	12,818,400
大同特殊鋼	27,200	3,520.00	95,744,000
日本高周波鋼業	7,600	305.00	2,318,000
日本冶金工業	13,600	2,612.00	35,523,200
山陽特殊製鋼	17,100	1,870.00	31,977,000
愛知製鋼	11,200	2,062.00	23,094,400
日立金属	214,600	2,175.00	466,755,000
日本金属	5,000	970.00	4,850,000
大平洋金属	12,300	2,187.00	26,900,100
新日本電工	110,500	334.00	36,907,000
栗本鐵工所	8,200	1,605.00	13,161,000
虹技	2,600	900.00	2,340,000
三菱製鋼	12,800	907.00	11,609,600
日亜鋼業	22,900	230.00	5,267,000

日本精線	3,100	4,370.00	13,547,000	
エンビプロ・ホールディングス	13,300	786.00	10,453,800	
シンニッタン	24,400	213.00	5,197,200	
新家工業	4,200	1,667.00	7,001,400	
大紀アルミニウム工業所	24,600	1,179.00	29,003,400	
日本軽金属ホールディングス	50,500	1,448.00	73,124,000	
三井金属鉱業	53,800	3,040.00	163,552,000	
東邦亜鉛	10,200	2,173.00	22,164,600	
三菱マテリアル	115,200	1,989.00	229,132,800	
住友金属鉱山	218,300	4,160.00	908,128,000	
D O W Aホールディングス	46,500	5,190.00	241,335,000	
古河機械金属	30,400	1,213.00	36,875,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	23,000	2,959.00	68,057,000	
東邦チタニウム	35,700	2,362.00	84,323,400	
U A C J	27,200	2,003.00	54,481,600	
C Kサンエツ	3,800	3,890.00	14,782,000	
古河電気工業	57,500	2,293.00	131,847,500	
住友電気工業	695,100	1,464.00	1,017,626,400	
フジクラ	222,100	862.00	191,450,200	
昭和電線ホールディングス	17,400	1,750.00	30,450,000	
東京特殊電線	2,600	2,121.00	5,514,600	
タツタ電線	35,300	436.00	15,390,800	
カナレ電気	3,000	1,410.00	4,230,000	
平河ヒューテック	11,100	1,033.00	11,466,300	
リョービ	18,500	1,243.00	22,995,500	
アーレスティ	21,500	361.00	7,761,500	
アサヒホールディングス	79,800	2,030.00	161,994,000	
稲葉製作所	10,100	1,350.00	13,635,000	
宮地エンジニアリンググループ	5,600	3,240.00	18,144,000	
トーカロ	51,400	1,171.00	60,189,400	
アルファC o	7,000	903.00	6,321,000	
S U M C O	328,500	1,688.00	554,508,000	
川田テクノロジーズ	3,700	3,690.00	13,653,000	
R S Technologies	5,700	6,360.00	36,252,000	
ジェイテックコーポレーション	2,600	1,415.00	3,679,000	
信和	12,300	790.00	9,717,000	
東洋製罐グループホールディングス	101,500	1,744.00	177,016,000	
ホッカンホールディングス	9,300	1,264.00	11,755,200	
コロナ	9,600	830.00	7,968,000	
横河ブリッジホールディングス	28,500	1,903.00	54,235,500	
駒井ハルテック	3,100	1,612.00	4,997,200	
高田機工	1,700	2,386.00	4,056,200	

三和ホールディングス	187,800	1,244.00	233,623,200
文化シャッター	58,700	1,024.00	60,108,800
三協立山	23,700	591.00	14,006,700
アルインコ	13,200	900.00	11,880,000
東洋シャッター	4,400	530.00	2,332,000
LIXIL	287,300	2,119.00	608,788,700
日本フィルコン	12,500	458.00	5,725,000
ノーリツ	25,400	1,540.00	39,116,000
長府製作所	18,000	2,041.00	36,738,000
リンナイ	34,400	10,390.00	357,416,000
ダイニチ工業	9,500	625.00	5,937,500
日東精工	25,000	514.00	12,850,000
三洋工業	2,400	1,628.00	3,907,200
岡部	27,700	647.00	17,921,900
ジーテクト	22,000	1,265.00	27,830,000
東プレ	30,400	1,109.00	33,713,600
高周波熱錬	30,700	642.00	19,709,400
東京製綱	12,200	854.00	10,418,800
サンコール	17,000	654.00	11,118,000
モリテック スチール	15,500	351.00	5,440,500
パイオラックス	26,200	1,771.00	46,400,200
エイチワン	17,800	569.00	10,128,200
日本発條	167,900	851.00	142,882,900
中央発條	9,600	666.00	6,393,600
アドバネクス	2,600	1,115.00	2,899,000
立川ブラインド工業	7,800	1,041.00	8,119,800
三益半導体工業	15,500	1,922.00	29,791,000
日本ドライケミカル	4,600	1,452.00	6,679,200
日本製鋼所	51,200	2,846.00	145,715,200
三浦工業	78,400	2,946.00	230,966,400
タクマ	57,300	1,240.00	71,052,000
ツガミ	40,900	1,170.00	47,853,000
オークマ	19,000	4,950.00	94,050,000
芝浦機械	22,600	2,880.00	65,088,000
アマダ	314,600	981.00	308,622,600
アイダエンジニアリング	43,700	819.00	35,790,300
滝澤鉄工所	5,900	1,059.00	6,248,100
F U J I	79,600	1,892.00	150,603,200
牧野フライス製作所	20,300	4,435.00	90,030,500
オーエスジー	80,800	1,786.00	144,308,800
ダイジェット工業	2,400	801.00	1,922,400
旭ダイヤモンド工業	49,100	718.00	35,253,800

DMG森精機	102,500	1,650.00	169,125,000	
ソディック	47,100	758.00	35,701,800	
ディスコ	29,400	32,000.00	940,800,000	
日東工器	9,600	1,563.00	15,004,800	
日進工具	15,800	1,137.00	17,964,600	
パンチ工業	17,300	415.00	7,179,500	
富士ダイス	10,200	569.00	5,803,800	
豊和工業	10,500	810.00	8,505,000	
ニデックオーケーケー	7,500	1,110.00	8,325,000	
東洋機械金属	13,100	561.00	7,349,100	
津田駒工業	3,400	468.00	1,591,200	
エンシュウ	4,700	757.00	3,557,900	
島精機製作所	29,200	2,009.00	58,662,800	
オプトラン	25,000	2,092.00	52,300,000	
NCホールディングス	5,600	1,982.00	11,099,200	
イワキポンプ	12,700	1,265.00	16,065,500	
フリー	17,800	1,009.00	17,960,200	
ヤマシンフィルタ	31,600	365.00	11,534,000	
日阪製作所	20,600	815.00	16,789,000	
やまびこ	27,700	1,105.00	30,608,500	
野村マイクロ・サイエンス	6,400	3,355.00	21,472,000	
平田機工	8,800	4,120.00	36,256,000	
ペガサスミシン製造	20,300	862.00	17,498,600	
マルマエ	8,200	1,752.00	14,366,400	
タツモ	9,300	1,300.00	12,090,000	
ナブテスコ	106,100	2,955.00	313,525,500	
三井海洋開発	21,200	1,479.00	31,354,800	
レオン自動機	21,400	1,144.00	24,481,600	
S M C	59,000	58,220.00	3,434,980,000	
ホソカワミクロン	13,000	2,457.00	31,941,000	
ユニオンツール	7,500	3,320.00	24,900,000	
オイレス工業	25,800	1,475.00	38,055,000	
日精エー・エス・ビー機械	7,700	3,580.00	27,566,000	
サトーホールディングス	26,300	1,798.00	47,287,400	
技研製作所	17,700	3,125.00	55,312,500	
日本エアーテック	8,600	1,064.00	9,150,400	
カワタ	6,000	847.00	5,082,000	
日精樹脂工業	12,800	889.00	11,379,200	
オカダアイヨン	6,400	1,448.00	9,267,200	
ワイエイシイホールディングス	8,000	1,204.00	9,632,000	
小松製作所	913,000	2,611.00	2,383,843,000	
住友重機械工業	107,700	2,673.00	287,882,100	



日立建機	80,800	2,676.00	216,220,800
日工	25,400	605.00	15,367,000
巴工業	7,300	2,457.00	17,936,100
井関農機	16,000	1,170.00	18,720,000
TOWA	17,300	1,602.00	27,714,600
丸山製作所	3,300	1,451.00	4,788,300
北川鉄工所	8,000	1,254.00	10,032,000
ローツェ	9,900	6,970.00	69,003,000
タカキタ	6,300	500.00	3,150,000
クボタ	900,800	2,004.00	1,805,203,200
荏原実業	8,500	2,167.00	18,419,500
三菱化工機	6,100	2,071.00	12,633,100
月島機械	31,700	879.00	27,864,300
帝国電機製作所	12,800	1,836.00	23,500,800
新東工業	37,900	684.00	25,923,600
澁谷工業	15,900	2,420.00	38,478,000
アイチ コーポレーション	29,000	785.00	22,765,000
小森コーポレーション	46,600	705.00	32,853,000
鶴見製作所	14,300	2,291.00	32,761,300
住友精密工業	3,000	2,505.00	7,515,000
日本ギア工業	7,500	355.00	2,662,500
酒井重工業	3,400	2,916.00	9,914,400
荏原製作所	69,100	4,735.00	327,188,500
石井鐵工所	2,500	2,799.00	6,997,500
西島製作所	16,600	1,334.00	22,144,400
北越工業	17,100	962.00	16,450,200
ダイキン工業	220,000	22,295.00	4,904,900,000
オルガノ	23,200	2,051.00	47,583,200
トーヨーカネツ	7,100	2,456.00	17,437,600
栗田工業	101,800	5,160.00	525,288,000
椿本チエイン	26,400	3,055.00	80,652,000
大同工業	8,500	699.00	5,941,500
木村化工機	15,800	675.00	10,665,000
アネスト岩田	31,500	855.00	26,932,500
ダイフク	95,000	6,810.00	646,950,000
サムコ	5,600	2,830.00	15,848,000
加藤製作所	9,900	744.00	7,365,600
油研工業	3,200	1,754.00	5,612,800
タダノ	97,500	842.00	82,095,000
フジテック	61,900	2,919.00	180,686,100
C K D	51,000	1,718.00	87,618,000
キトー	15,800	2,718.00	42,944,400

平和	56,200	2,238.00	125,775,600
理想科学工業	16,900	2,338.00	39,512,200
SANKYO	41,500	4,385.00	181,977,500
日本金銭機械	20,600	651.00	13,410,600
マースグループホールディングス	12,900	1,617.00	20,859,300
フクシマガリレイ	12,500	3,580.00	44,750,000
オーイズミ	7,300	400.00	2,920,000
ダイコク電機	9,300	1,301.00	12,099,300
竹内製作所	30,700	2,661.00	81,692,700
アマノ	52,800	2,430.00	128,304,000
JUKI	26,300	690.00	18,147,000
ジャノメ	17,300	646.00	11,175,800
マックス	23,800	1,989.00	47,338,200
グローリー	47,800	2,123.00	101,479,400
新晃工業	18,800	1,484.00	27,899,200
大和冷機工業	26,000	1,146.00	29,796,000
セガサミーホールディングス	181,100	1,969.00	356,585,900
日本ピストンリング	7,400	1,215.00	8,991,000
リケン	7,400	2,284.00	16,901,600
TPR	22,000	1,189.00	26,158,000
ツバキ・ナカシマ	41,700	1,128.00	47,037,600
ホシザキ	108,700	4,035.00	438,604,500
大豊工業	16,600	674.00	11,188,400
日本精工	344,900	707.00	243,844,300
NTN	366,300	254.00	93,040,200
ジェイテクト	171,900	916.00	157,460,400
不二越	12,500	3,525.00	44,062,500
日本トムソン	46,200	533.00	24,624,600
THK	97,500	2,496.00	243,360,000
ユーシン精機	15,800	705.00	11,139,000
前澤給装工業	13,100	895.00	11,724,500
イーグル工業	21,900	1,084.00	23,739,600
前澤工業	12,200	624.00	7,612,800
日本ピラー工業	17,300	2,287.00	39,565,100
キッツ	62,300	802.00	49,964,600
マキタ	227,700	2,799.00	637,332,300
三井E&Sホールディングス	76,200	403.00	30,708,600
日立造船	159,900	857.00	137,034,300
三菱重工業	295,400	4,806.00	1,419,692,400
IHI	125,800	3,100.00	389,980,000
スター精密	32,700	1,629.00	53,268,300
日清紡ホールディングス	137,500	1,050.00	144,375,000

イビデン	97,000	3,960.00	384,120,000
コニカミノルタ	409,600	446.00	182,681,600
ブラザー工業	229,800	2,491.00	572,431,800
ミネベアミツミ	320,700	2,139.00	685,977,300
日立製作所	968,700	6,114.00	5,922,631,800
東芝	352,100	5,148.00	1,812,610,800
三菱電機	1,879,800	1,304.50	2,452,199,100
富士電機	112,000	5,290.00	592,480,000
東洋電機製造	6,700	863.00	5,782,100
安川電機	200,100	4,165.00	833,416,500
シンフォニアテクノロジー	20,500	1,342.00	27,511,000
明電舎	28,500	1,971.00	56,173,500
オリジン	4,600	1,246.00	5,731,600
山洋電気	7,400	4,935.00	36,519,000
デンヨー	14,300	1,377.00	19,691,100
PHCホールディングス	31,400	1,430.00	44,902,000
東芝テック	21,600	3,740.00	80,784,000
芝浦メカトロニクス	3,600	9,350.00	33,660,000
マブチモーター	42,100	3,930.00	165,453,000
日本電産	447,500	8,130.00	3,638,175,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	8,000	472.00	3,776,000
トレックス・セミコンダクター	8,800	2,516.00	22,140,800
東光高岳	11,400	1,768.00	20,155,200
ダブル・スコープ	55,200	1,322.00	72,974,400
ダイヘン	18,600	3,715.00	69,099,000
ヤーマン	33,200	1,167.00	38,744,400
JVCケンウッド	166,400	197.00	32,780,800
ミマキエンジニアリング	18,700	666.00	12,454,200
I - P E X	9,700	1,239.00	12,018,300
日新電機	47,200	1,328.00	62,681,600
大崎電気工業	33,900	500.00	16,950,000
オムロン	167,700	6,616.00	1,109,503,200
日東工業	25,300	2,374.00	60,062,200
I D E C	24,900	2,944.00	73,305,600
正興電機製作所	7,500	1,021.00	7,657,500
不二電機工業	4,200	1,080.00	4,536,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	60,700	2,258.00	137,060,600
サクサホールディングス	4,700	1,242.00	5,837,400
メルコホールディングス	5,800	3,110.00	18,038,000
テクノメディカ	4,800	1,597.00	7,665,600
日本電気	238,900	4,625.00	1,104,912,500
富士通	181,200	15,785.00	2,860,242,000

沖電気工業	76,400	718.00	54,855,200
岩崎通信機	8,200	765.00	6,273,000
電気興業	9,700	2,164.00	20,990,800
サンケン電気	17,300	4,425.00	76,552,500
ナカヨ	3,300	1,036.00	3,418,800
アイホン	9,100	1,894.00	17,235,400
ルネサスエレクトロニクス	1,099,900	1,202.00	1,322,079,800
セイコーエプソン	224,900	1,970.00	443,053,000
ワコム	155,000	711.00	110,205,000
アルバック	40,100	5,130.00	205,713,000
アクセル	8,100	1,157.00	9,371,700
E I Z O	13,700	3,630.00	49,731,000
日本信号	42,700	946.00	40,394,200
京三製作所	39,300	415.00	16,309,500
能美防災	23,100	1,620.00	37,422,000
ホーチキ	13,000	1,287.00	16,731,000
星和電機	8,500	430.00	3,655,000
エレコム	46,400	1,444.00	67,001,600
パナソニック ホールディングス	2,148,200	1,014.50	2,179,348,900
シャープ	191,300	863.00	165,091,900
アンリツ	127,400	1,579.00	201,164,600
富士通ゼネラル	54,700	3,005.00	164,373,500
ソニーグループ	1,261,800	9,286.00	11,717,074,800
T D K	291,800	4,455.00	1,299,969,000
帝国通信工業	9,200	1,423.00	13,091,600
タムラ製作所	72,500	683.00	49,517,500
アルプスアルパイン	165,000	1,046.00	172,590,000
池上通信機	5,900	550.00	3,245,000
日本電波工業	20,500	1,427.00	29,253,500
鈴木	10,400	848.00	8,819,200
メイコー	22,000	2,496.00	54,912,000
日本トリム	4,000	2,329.00	9,316,000
ローランド ディー . ジー .	9,600	2,974.00	28,550,400
フォスター電機	18,800	742.00	13,949,600
S M K	4,500	2,330.00	10,485,000
ヨコオ	13,700	1,895.00	25,961,500
ホシデン	44,800	1,479.00	66,259,200
ヒロセ電機	27,900	18,980.00	529,542,000
日本航空電子工業	40,400	2,120.00	85,648,000
T O A	21,600	764.00	16,502,400
マクセル	37,000	1,371.00	50,727,000
古野電気	24,300	1,098.00	26,681,400

ユニデンホールディングス	1,800	4,090.00	7,362,000	
スミダコーポレーション	15,900	1,011.00	16,074,900	
アイコム	6,500	2,616.00	17,004,000	
リオン	7,200	1,984.00	14,284,800	
横河電機	184,800	2,275.00	420,420,000	
新電元工業	7,100	3,490.00	24,779,000	
アズビル	116,800	3,770.00	440,336,000	
東亜ディーケーケー	10,500	850.00	8,925,000	
日本光電工業	77,400	3,080.00	238,392,000	
チノー	6,400	1,626.00	10,406,400	
共和電業	17,500	335.00	5,862,500	
日本電子材料	9,500	1,307.00	12,416,500	
堀場製作所	37,200	5,610.00	208,692,000	
アドバンテスト	149,700	6,700.00	1,002,990,000	
小野測器	8,000	399.00	3,192,000	
エスベック	15,100	1,711.00	25,836,100	
キーエンス	182,500	47,900.00	8,741,750,000	
日置電機	8,800	6,280.00	55,264,000	
シスメックス	144,300	7,768.00	1,120,922,400	
日本マイクロニクス	27,900	1,183.00	33,005,700	
メガチップス	18,000	2,523.00	45,414,000	
O B A R A G R O U P	8,000	3,210.00	25,680,000	
澤藤電機	2,800	1,107.00	3,099,600	
原田工業	10,100	785.00	7,928,500	
コーセル	22,900	820.00	18,778,000	
イリソ電子工業	17,000	3,965.00	67,405,000	
オブテックスグループ	30,900	2,123.00	65,600,700	
千代田インテグレ	7,000	2,142.00	14,994,000	
レーザーテック	82,600	14,695.00	1,213,807,000	
スタンレー電気	130,000	2,264.00	294,320,000	
岩崎電気	6,500	2,531.00	16,451,500	
ウシオ電機	95,600	1,502.00	143,591,200	
岡谷電機産業	16,200	242.00	3,920,400	
ヘリオス テクノ ホールディング	18,300	405.00	7,411,500	
エノモト	5,900	1,338.00	7,894,200	
日本セラミック	17,200	2,441.00	41,985,200	
遠藤照明	9,900	721.00	7,137,900	
古河電池	14,800	1,123.00	16,620,400	
双信電機	10,700	410.00	4,387,000	
山一電機	13,400	1,788.00	23,959,200	
図研	13,200	3,495.00	46,134,000	
日本電子	38,800	4,755.00	184,494,000	

カシオ計算機	124,600	1,269.00	158,117,400
ファナック	176,800	20,260.00	3,581,968,000
日本シイエムケイ	36,500	435.00	15,877,500
エンプラス	5,100	4,070.00	20,757,000
大真空	25,400	867.00	22,021,800
ローム	83,800	9,460.00	792,748,000
浜松ホトニクス	134,300	6,200.00	832,660,000
三井ハイテック	17,300	6,810.00	117,813,000
新光電気工業	59,300	3,115.00	184,719,500
京セラ	283,400	7,300.00	2,068,820,000
太陽誘電	89,700	3,725.00	334,132,500
村田製作所	549,500	6,632.00	3,644,284,000
双葉電子工業	35,200	611.00	21,507,200
北陸電気工業	8,000	1,018.00	8,144,000
ニチコン	54,000	1,388.00	74,952,000
日本ケミコン	19,300	1,864.00	35,975,200
K O A	28,000	2,205.00	61,740,000
市光工業	25,300	382.00	9,664,600
小糸製作所	201,400	1,971.00	396,959,400
ミツバ	31,400	386.00	12,120,400
S C R E E Nホールディングス	31,800	7,880.00	250,584,000
キャノン電子	18,800	1,585.00	29,798,000
キャノン	917,500	3,172.00	2,910,310,000
リコー	479,200	1,056.00	506,035,200
象印マホービン	50,200	1,559.00	78,261,800
M U T O Hホールディングス	2,800	1,910.00	5,348,000
東京エレクトロン	127,800	35,700.00	4,562,460,000
トヨタ紡織	70,400	1,772.00	124,748,800
芦森工業	3,800	1,034.00	3,929,200
ユニプレス	33,000	887.00	29,271,000
豊田自動織機	142,600	6,880.00	981,088,000
モリタホールディングス	32,300	1,282.00	41,408,600
三櫻工業	27,800	665.00	18,487,000
デンソー	394,200	6,586.00	2,596,201,200
東海理化電機製作所	53,000	1,376.00	72,928,000
川崎重工業	136,500	2,187.00	298,525,500
名村造船所	52,000	608.00	31,616,000
日本車輛製造	6,400	2,032.00	13,004,800
三菱ロジスネクスト	26,700	738.00	19,704,600
近畿車輛	3,000	980.00	2,940,000
日産自動車	2,375,500	460.20	1,093,205,100
いすゞ自動車	583,400	1,597.00	931,689,800

トヨタ自動車	9,182,300	1,876.00	17,225,994,800
日野自動車	251,500	596.00	149,894,000
三菱自動車工業	745,600	518.00	386,220,800
エフテック	12,900	492.00	6,346,800
レシップホールディングス	8,000	457.00	3,656,000
G M B	3,600	679.00	2,444,400
ファルテック	3,500	591.00	2,068,500
武蔵精密工業	44,900	1,556.00	69,864,400
日産車体	29,500	811.00	23,924,500
新明和工業	52,500	971.00	50,977,500
極東開発工業	32,100	1,323.00	42,468,300
トピー工業	15,100	1,448.00	21,864,800
ティラド	5,500	2,490.00	13,695,000
曙ブレーキ工業	110,600	159.00	17,585,400
タチエス	33,100	1,071.00	35,450,100
N O K	75,800	1,127.00	85,426,600
フタバ産業	44,800	324.00	14,515,200
K Y B	17,700	3,095.00	54,781,500
大同メタル工業	38,600	481.00	18,566,600
プレス工業	90,200	394.00	35,538,800
ミクニ	23,400	298.00	6,973,200
太平洋工業	38,300	1,018.00	38,989,400
河西工業	24,700	188.00	4,643,600
アイシン	147,400	3,710.00	546,854,000
マツダ	592,600	956.00	566,525,600
今仙電機製作所	13,200	562.00	7,418,400
本田技研工業	1,472,600	3,137.00	4,619,546,200
スズキ	399,300	4,481.00	1,789,263,300
S U B A R U	529,100	2,167.00	1,146,559,700
安永	8,100	654.00	5,297,400
ヤマハ発動機	262,800	2,707.00	711,399,600
T B K	20,200	292.00	5,898,400
エクセディ	30,400	1,642.00	49,916,800
豊田合成	56,900	2,185.00	124,326,500
愛三工業	31,600	683.00	21,582,800
盟和産業	2,800	978.00	2,738,400
日本プラスト	14,600	435.00	6,351,000
ヨロズ	15,700	800.00	12,560,000
エフ・シー・シー	32,900	1,321.00	43,460,900
シマノ	68,400	22,740.00	1,555,416,000
テイ・エス テック	85,000	1,419.00	120,615,000
ジャムコ	11,800	1,330.00	15,694,000

テルモ	570,000	4,074.00	2,322,180,000
クリエートメディック	6,100	888.00	5,416,800
日機装	41,800	909.00	37,996,200
日本エム・ディ・エム	11,600	1,251.00	14,511,600
島津製作所	240,700	3,795.00	913,456,500
JMS	15,500	533.00	8,261,500
長野計器	13,400	1,017.00	13,627,800
ブイ・テクノロジー	8,800	2,558.00	22,510,400
東京計器	12,800	1,210.00	15,488,000
愛知時計電機	7,300	1,390.00	10,147,000
インターアクション	10,100	1,521.00	15,362,100
オーバル	18,100	431.00	7,801,100
東京精密	31,400	4,260.00	133,764,000
マニー	73,600	1,758.00	129,388,800
ニコン	283,900	1,367.00	388,091,300
トプコン	94,700	1,613.00	152,751,100
オリンパス	965,000	2,778.50	2,681,252,500
理研計器	13,300	3,900.00	51,870,000
タムロン	12,500	2,901.00	36,262,500
HOYA	383,900	13,880.00	5,328,532,000
シード	9,400	534.00	5,019,600
ノーリツ鋼機	15,900	2,442.00	38,827,800
A & Dホロンホールディングス	22,700	816.00	18,523,200
朝日インテック	220,800	2,317.00	511,593,600
シチズン時計	183,900	604.00	111,075,600
リズム	6,300	1,504.00	9,475,200
大研医器	16,000	466.00	7,456,000
メニコン	62,200	2,973.00	184,920,600
シンシア	1,800	439.00	790,200
松風	6,700	2,345.00	15,711,500
セイコーホールディングス	28,500	3,015.00	85,927,500
ニプロ	139,400	1,088.00	151,667,200
中本パックス	5,600	1,544.00	8,646,400
スノーピーク	28,600	2,195.00	62,777,000
パラマウントベッドホールディングス	38,600	2,581.00	99,626,600
トランザクション	12,900	1,065.00	13,738,500
粧美堂	5,000	404.00	2,020,000
ニホンフラッシュ	15,700	933.00	14,648,100
前田工織	18,200	3,160.00	57,512,000
永大産業	21,900	230.00	5,037,000
アートネイチャー	17,200	722.00	12,418,400
バンダイナムコホールディングス	166,600	9,433.00	1,571,537,800



アイフィスジャパン	5,100	591.00	3,014,100
共立印刷	27,700	127.00	3,517,900
S H O E I	17,600	5,230.00	92,048,000
フランスベッドホールディングス	25,900	903.00	23,387,700
パイロットコーポレーション	26,100	5,490.00	143,289,000
萩原工業	11,200	1,046.00	11,715,200
フジシールインターナショナル	41,400	1,530.00	63,342,000
タカラトミー	83,200	1,239.00	103,084,800
広済堂ホールディングス	12,500	1,407.00	17,587,500
エステールホールディングス	4,300	614.00	2,640,200
タカノ	6,900	671.00	4,629,900
プロネクサス	15,600	955.00	14,898,000
ホクシン	14,200	145.00	2,059,000
ウッドワン	6,200	1,041.00	6,454,200
大建工業	10,200	1,824.00	18,604,800
凸版印刷	262,400	2,154.00	565,209,600
大日本印刷	218,200	2,900.00	632,780,000
共同印刷	5,200	2,454.00	12,760,800
N I S S H A	31,800	1,709.00	54,346,200
光村印刷	1,600	1,219.00	1,950,400
T A K A R A & C O M P A N Y	11,500	2,134.00	24,541,000
アシックス	154,400	2,300.00	355,120,000
ツツミ	5,000	2,016.00	10,080,000
ローランド	12,300	4,440.00	54,612,000
小松ウオール工業	6,100	1,841.00	11,230,100
ヤマハ	117,100	5,140.00	601,894,000
河合楽器製作所	5,100	2,531.00	12,908,100
クリナップ	18,700	563.00	10,528,100
ビジョン	106,500	2,114.00	225,141,000
兼松サステック	1,300	1,585.00	2,060,500
キングジム	14,800	912.00	13,497,600
リンテック	38,300	2,221.00	85,064,300
イトーキ	34,300	401.00	13,754,300
任天堂	1,137,000	5,854.00	6,655,998,000
三菱鉛筆	24,100	1,411.00	34,005,100
タカラスタンダード	32,400	1,295.00	41,958,000
コクヨ	80,500	1,836.00	147,798,000
ナカバヤシ	16,200	499.00	8,083,800
グローブライド	15,000	2,158.00	32,370,000
オカムラ	56,600	1,380.00	78,108,000
美津濃	16,600	2,573.00	42,711,800
東京電力ホールディングス	1,507,400	462.00	696,418,800

中部電力	568,800	1,304.00	741,715,200
関西電力	704,400	1,212.00	853,732,800
中国電力	290,500	734.00	213,227,000
北陸電力	171,000	486.00	83,106,000
東北電力	440,300	681.00	299,844,300
四国電力	167,400	723.00	121,030,200
九州電力	385,500	772.00	297,606,000
北海道電力	175,000	453.00	79,275,000
沖縄電力	42,700	1,058.00	45,176,600
電源開発	148,800	2,048.00	304,742,400
エフオン	12,200	639.00	7,795,800
イーレックス	25,900	2,788.00	72,209,200
レノバ	39,500	3,405.00	134,497,500
東京瓦斯	353,500	2,451.00	866,428,500
大阪瓦斯	338,700	2,186.00	740,398,200
東邦瓦斯	79,000	2,883.00	227,757,000
北海道瓦斯	10,000	1,587.00	15,870,000
広島ガス	35,200	329.00	11,580,800
西部ガスホールディングス	19,200	1,727.00	33,158,400
静岡ガス	38,100	990.00	37,719,000
メタウォーター	20,900	1,897.00	39,647,300
SBSホールディングス	14,900	2,789.00	41,556,100
東武鉄道	183,700	3,410.00	626,417,000
相鉄ホールディングス	59,800	2,397.00	143,340,600
東急	468,900	1,647.00	772,278,300
京浜急行電鉄	224,200	1,466.00	328,677,200
小田急電鉄	253,500	1,864.00	472,524,000
京王電鉄	88,400	5,270.00	465,868,000
京成電鉄	122,400	3,940.00	482,256,000
富士急行	20,600	4,280.00	88,168,000
東日本旅客鉄道	307,200	7,421.00	2,279,731,200
西日本旅客鉄道	213,600	5,540.00	1,183,344,000
東海旅客鉄道	141,700	16,935.00	2,399,689,500
西武ホールディングス	242,700	1,446.00	350,944,200
鴻池運輸	28,500	1,425.00	40,612,500
西日本鉄道	48,400	2,884.00	139,585,600
ハマキョウレックス	13,100	3,140.00	41,134,000
サカイ引越センター	9,300	4,685.00	43,570,500
近鉄グループホールディングス	178,800	4,820.00	861,816,000
阪急阪神ホールディングス	222,600	4,350.00	968,310,000
南海電気鉄道	79,800	2,956.00	235,888,800
京阪ホールディングス	74,300	3,755.00	278,996,500

神戸電鉄	4,500	3,280.00	14,760,000
名古屋鉄道	184,500	2,224.00	410,328,000
山陽電気鉄道	13,600	2,199.00	29,906,400
アルプス物流	13,300	1,035.00	13,765,500
ヤマトホールディングス	261,300	2,177.00	568,850,100
山九	46,300	4,200.00	194,460,000
丸運	9,100	213.00	1,938,300
丸全昭和運輸	12,900	3,065.00	39,538,500
センコーグループホールディングス	88,400	959.00	84,775,600
トナミホールディングス	3,700	3,515.00	13,005,500
ニッコンホールディングス	57,600	2,258.00	130,060,800
日本石油輸送	2,100	2,293.00	4,815,300
福山通運	24,400	3,265.00	79,666,000
セイノーホールディングス	103,900	1,160.00	120,524,000
エスライン	5,200	758.00	3,941,600
神奈川中央交通	4,700	3,385.00	15,909,500
日立物流	36,800	8,660.00	318,688,000
丸和運輸機関	32,200	1,451.00	46,722,200
C & F ロジホールディングス	16,100	1,105.00	17,790,500
九州旅客鉄道	127,900	3,125.00	399,687,500
S Gホールディングス	320,400	1,980.00	634,392,000
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	62,300	7,360.00	458,528,000
日本郵船	479,100	2,467.00	1,181,939,700
商船三井	294,700	2,602.00	766,809,400
川崎汽船	177,000	2,032.00	359,664,000
N S ユナイテッド海運	9,400	3,775.00	35,485,000
飯野海運	77,500	651.00	50,452,500
共栄タンカー	5,400	836.00	4,514,400
乾汽船	12,400	1,637.00	20,298,800
日本航空	410,000	2,582.00	1,058,620,000
A N Aホールディングス	454,300	2,718.00	1,234,787,400
パスコ	3,600	1,280.00	4,608,000
トランコム	5,300	7,620.00	40,386,000
日新	13,900	1,735.00	24,116,500
三菱倉庫	46,100	3,410.00	157,201,000
三井倉庫ホールディングス	18,700	3,075.00	57,502,500
住友倉庫	56,000	1,970.00	110,320,000
澁澤倉庫	9,500	2,020.00	19,190,000
東陽倉庫	27,100	263.00	7,127,300
日本トランスシティ	33,600	478.00	16,060,800
ケイヒン	3,300	1,402.00	4,626,600
中央倉庫	9,800	913.00	8,947,400

川西倉庫	3,500	995.00	3,482,500
安田倉庫	12,800	906.00	11,596,800
ファイズホールディングス	4,100	898.00	3,681,800
東洋埠頭	5,300	1,157.00	6,132,100
上組	90,600	2,674.00	242,264,400
サンリツ	4,900	668.00	3,273,200
キムラユニティー	9,900	760.00	7,524,000
キューソー流通システム	11,100	1,279.00	14,196,900
東海運	10,900	266.00	2,899,400
エーアイティー	12,000	1,450.00	17,400,000
内外トランスライン	6,000	2,039.00	12,234,000
日本コンセプト	5,200	1,556.00	8,091,200
NEC ネットズエスアイ	65,500	1,573.00	103,031,500
クロスキャット	10,800	1,321.00	14,266,800
システナ	282,500	403.00	113,847,500
デジタルアーツ	10,600	6,290.00	66,674,000
日鉄ソリューションズ	34,400	3,495.00	120,228,000
キューブシステム	10,200	949.00	9,679,800
WOW WORLD	3,000	880.00	2,640,000
コア	8,500	1,370.00	11,645,000
手間いらず	2,900	5,240.00	15,196,000
ラクーンホールディングス	17,000	1,023.00	17,391,000
ソリトンシステムズ	8,900	1,020.00	9,078,000
ソフトクリエイティブホールディングス	8,700	3,080.00	26,796,000
T I S	172,800	3,835.00	662,688,000
J N Sホールディングス	9,700	367.00	3,559,900
グリー	90,200	881.00	79,466,200
G M Oペパボ	2,500	1,759.00	4,397,500
コーエーテクモホールディングス	126,200	2,375.00	299,725,000
三菱総合研究所	8,300	4,455.00	36,976,500
電算	2,300	1,745.00	4,013,500
A G S	8,200	646.00	5,297,200
ファインデックス	13,700	571.00	7,822,700
ブレインパッド	17,000	874.00	14,858,000
K L a b	31,500	502.00	15,813,000
ポールトゥウィンホールディングス	28,900	926.00	26,761,400
ネクソン	433,300	2,552.00	1,105,781,600
アイスタイル	51,400	490.00	25,186,000
エムアップホールディングス	23,000	1,528.00	35,144,000
エイチーム	12,700	794.00	10,083,800
エニグモ	21,800	498.00	10,856,400
テクノスジャパン	15,800	438.00	6,920,400

コロプラ	65,400	680.00	44,472,000
ブロードリーフ	98,400	504.00	49,593,600
クロス・マーケティンググループ	7,800	852.00	6,645,600
デジタルハーツホールディングス	9,100	1,892.00	17,217,200
システム情報	15,000	907.00	13,605,000
メディアドゥ	6,900	1,814.00	12,516,600
じげん	56,600	342.00	19,357,200
ブイキューブ	20,300	918.00	18,635,400
エンカレッジ・テクノロジー	4,800	503.00	2,414,400
サイバーリンクス	6,100	1,133.00	6,911,300
フィックスターズ	19,100	1,052.00	20,093,200
CARTA HOLDINGS	8,200	1,669.00	13,685,800
オブティム	14,100	805.00	11,350,500
セレス	6,900	909.00	6,272,100
SHIFT	12,300	18,890.00	232,347,000
ティーガイア	17,700	1,639.00	29,010,300
セック	3,000	2,145.00	6,435,000
テクマトリックス	33,500	1,674.00	56,079,000
プロシップ	6,700	1,441.00	9,654,700
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	51,400	2,225.00	114,365,000
GMOペイメントゲートウェイ	38,300	9,950.00	381,085,000
ザッパラス	7,500	330.00	2,475,000
システムリサーチ	5,900	1,806.00	10,655,400
インターネットイニシアティブ	105,400	2,221.00	234,093,400
さくらインターネット	21,600	529.00	11,426,400
ヴィンクス	5,700	1,452.00	8,276,400
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5,200	4,420.00	22,984,000
SRAホールディングス	9,600	2,975.00	28,560,000
システムインテグレータ	6,800	424.00	2,883,200
朝日ネット	18,400	586.00	10,782,400
eBASE	24,000	514.00	12,336,000
アバント	21,300	1,450.00	30,885,000
アドソル日進	7,200	1,467.00	10,562,400
ODKソリューションズ	4,500	586.00	2,637,000
フリービット	10,500	916.00	9,618,000
コムチュア	22,300	2,285.00	50,955,500
サイバーコム	3,200	1,324.00	4,236,800
アステリア	14,500	794.00	11,513,000
アイル	9,500	1,750.00	16,625,000
マークライنز	9,200	2,342.00	21,546,400
メディカル・データ・ビジョン	25,300	1,056.00	26,716,800
gumi	27,600	950.00	26,220,000

ショーケース	4,900	365.00	1,788,500
モバイルファクトリー	4,200	907.00	3,809,400
テラスカイ	7,300	1,884.00	13,753,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,900	1,481.00	13,180,900
P C Iホールディングス	8,000	925.00	7,400,000
アイビーシー	3,300	465.00	1,534,500
ネオジャパン	5,800	956.00	5,544,800
P R T I M E S	4,300	2,150.00	9,245,000
ラクス	90,800	1,368.00	124,214,400
ランドコンピュータ	4,800	812.00	3,897,600
ダブルスタンダード	6,000	2,351.00	14,106,000
オープンドア	11,800	2,006.00	23,670,800
マイネット	6,500	468.00	3,042,000
アカツキ	8,900	2,082.00	18,529,800
ベネフィットジャパン	1,600	1,515.00	2,424,000
U b i c o mホールディングス	5,300	2,183.00	11,569,900
カナミックネットワーク	24,500	508.00	12,446,000
ノムラシステムコーポレーション	19,200	122.00	2,342,400
チェンジ	41,200	1,959.00	80,710,800
シンクロ・フード	10,600	501.00	5,310,600
オークネット	8,800	2,231.00	19,632,800
キャピタル・アセット・プランニング	3,900	623.00	2,429,700
セグエグループ	5,500	667.00	3,668,500
エイトレッド	2,900	1,682.00	4,877,800
マクロミル	38,200	1,083.00	41,370,600
ビーグリー	3,300	1,298.00	4,283,400
オロ	5,200	1,456.00	7,571,200
ユーザーローカル	6,200	1,620.00	10,044,000
テモナ	4,300	296.00	1,272,800
ニーズウェル	6,100	615.00	3,751,500
マネーフォワード	40,400	3,080.00	124,432,000
サインポスト	6,400	788.00	5,043,200
電算システムホールディングス	8,200	2,153.00	17,654,600
ソルクシーズ	15,700	355.00	5,573,500
フェイス	5,600	533.00	2,984,800
プロトコーポレーション	21,200	1,030.00	21,836,000
ハイマックス	5,400	1,335.00	7,209,000
野村総合研究所	343,800	3,550.00	1,220,490,000
サイバネットシステム	14,300	904.00	12,927,200
C Eホールディングス	10,000	463.00	4,630,000
日本システム技術	7,200	1,205.00	8,676,000
インテージホールディングス	22,900	1,517.00	34,739,300

東邦システムサイエンス	5,400	977.00	5,275,800
ソースネクスト	86,100	265.00	22,816,500
インフォコム	21,700	1,905.00	41,338,500
シンプレクス・ホールディングス	31,500	1,858.00	58,527,000
HEROZ	5,800	1,069.00	6,200,200
ラクスル	23,700	2,484.00	58,870,800
メルカリ	75,500	1,934.00	146,017,000
I P S	5,500	2,971.00	16,340,500
F I G	22,100	366.00	8,088,600
システムサポート	7,300	1,390.00	10,147,000
イーソル	11,200	545.00	6,104,000
アルテリア・ネットワークス	18,900	1,191.00	22,509,900
東海ソフト	3,300	917.00	3,026,100
ウイングアーク1st	15,200	1,839.00	27,952,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,600	1,653.00	7,603,800
サーバーワークス	3,500	2,275.00	7,962,500
東名	1,600	1,136.00	1,817,600
ヴィッツ	2,100	995.00	2,089,500
トピラシステムズ	4,900	908.00	4,449,200
S a n s a n	62,700	1,267.00	79,440,900
L i n k - U	3,900	690.00	2,691,000
ギフトィ	18,100	1,998.00	36,163,800
ベース	5,800	3,460.00	20,068,000
J M D C	26,700	4,765.00	127,225,500
フォーカスシステムズ	12,500	956.00	11,950,000
クレスコ	14,500	1,640.00	23,780,000
フジ・メディア・ホールディングス	176,000	1,062.00	186,912,000
オービック	62,300	19,390.00	1,207,997,000
ジャストシステム	28,200	3,345.00	94,329,000
T D C ソフト	15,900	1,238.00	19,684,200
Zホールディングス	2,851,000	380.20	1,083,950,200
トレンドマイクロ	96,900	7,820.00	757,758,000
I Dホールディングス	12,700	865.00	10,985,500
日本オラクル	32,100	7,700.00	247,170,000
アルファシステムズ	5,300	4,090.00	21,677,000
フューチャー	41,900	1,583.00	66,327,700
C A C H o l d i n g s	10,400	1,422.00	14,788,800
S Bテクノロジー	8,600	2,191.00	18,842,600
トーセ	5,200	786.00	4,087,200
オービックビジネスコンサルタント	18,900	4,480.00	84,672,000
伊藤忠テクノソリューションズ	90,100	3,390.00	305,439,000
アイティフォー	24,200	762.00	18,440,400

東計電算	2,400	6,080.00	14,592,000
エクスネット	3,300	1,000.00	3,300,000
大塚商会	95,100	4,525.00	430,327,500
サイボウズ	23,300	1,500.00	34,950,000
電通国際情報サービス	20,400	4,430.00	90,372,000
A C C E S S	22,600	743.00	16,791,800
デジタルガレージ	32,800	3,470.00	113,816,000
E Mシステムズ	28,200	858.00	24,195,600
ウェザーニューズ	6,000	7,460.00	44,760,000
C I J	15,600	777.00	12,121,200
ビジネスエンジニアリング	4,600	2,095.00	9,637,000
日本エンタープライズ	20,800	146.00	3,036,800
WOWOW	8,300	1,330.00	11,039,000
スカラ	16,900	669.00	11,306,100
インテリジェント ウェイブ	10,200	736.00	7,507,200
I M A G I C A G R O U P	14,200	947.00	13,447,400
ネットワンシステムズ	73,000	2,818.00	205,714,000
システムソフト	60,700	98.00	5,948,600
アルゴグラフィックス	15,400	3,615.00	55,671,000
マーベラス	31,500	666.00	20,979,000
エイベックス	34,200	1,541.00	52,702,200
B I P R O G Y	61,800	3,140.00	194,052,000
兼松エレクトロニクス	10,800	3,985.00	43,038,000
都築電気	9,000	1,243.00	11,187,000
T B Sホールディングス	96,700	1,583.00	153,076,100
日本テレビホールディングス	165,200	1,157.00	191,136,400
朝日放送グループホールディングス	16,100	628.00	10,110,800
テレビ朝日ホールディングス	47,700	1,401.00	66,827,700
スカパーJ S A Tホールディングス	167,800	517.00	86,752,600
テレビ東京ホールディングス	12,200	1,899.00	23,167,800
日本BS放送	6,900	947.00	6,534,300
ビジョン	22,200	1,370.00	30,414,000
スマートバリュー	5,000	425.00	2,125,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	15,100	1,974.00	29,807,400
ワイヤレスゲート	8,900	280.00	2,492,000
コネクシオ	14,200	1,188.00	16,869,600
クロップス	3,900	886.00	3,455,400
日本電信電話	2,215,400	3,906.00	8,653,352,400
K D D I	1,441,000	4,243.00	6,114,163,000
ソフトバンク	2,993,800	1,446.50	4,330,531,700
光通信	22,800	17,040.00	388,512,000
エムティーアイ	15,800	499.00	7,884,200



GMOインターネットグループ	62,400	2,548.00	158,995,200
ファイバーゲート	9,300	880.00	8,184,000
アйдママーケティングコミュニケーション	5,000	276.00	1,380,000
KADOKAWA	106,500	2,662.00	283,503,000
学研ホールディングス	28,200	965.00	27,213,000
ゼンリン	32,500	891.00	28,957,500
昭文社ホールディングス	8,700	296.00	2,575,200
インプレスホールディングス	17,500	203.00	3,552,500
アイネット	9,300	1,257.00	11,690,100
松竹	11,300	11,900.00	134,470,000
東宝	116,700	5,250.00	612,675,000
東映	5,600	17,330.00	97,048,000
エヌ・ティ・ティ・データ	526,400	1,866.00	982,262,400
ピー・シー・エー	11,800	1,022.00	12,059,600
ビジネスブレイン太田昭和	6,700	1,397.00	9,359,900
D T S	36,900	3,435.00	126,751,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	92,000	6,230.00	573,160,000
シーイーシー	21,300	1,471.00	31,332,300
カブコン	183,400	3,640.00	667,576,000
アイ・エス・ビー	8,700	1,225.00	10,657,500
ジャステック	10,500	1,253.00	13,156,500
S C S K	136,900	2,190.00	299,811,000
N S W	7,600	2,122.00	16,127,200
アイネス	17,200	1,460.00	25,112,000
T K C	30,200	3,430.00	103,586,000
富士ソフト	19,000	8,180.00	155,420,000
N S D	62,000	2,461.00	152,582,000
コナミグループ	71,800	6,680.00	479,624,000
福井コンピュータホールディングス	9,100	3,385.00	30,803,500
J B C Cホールディングス	13,500	1,767.00	23,854,500
ミロク情報サービス	17,600	1,442.00	25,379,200
ソフトバンクグループ	1,185,200	4,900.00	5,807,480,000
高千穂交易	7,000	2,008.00	14,056,000
オルバヘルスケアホールディングス	3,300	1,405.00	4,636,500
伊藤忠食品	4,000	4,850.00	19,400,000
エレマテック	15,900	1,253.00	19,922,700
あらた	14,700	4,105.00	60,343,500
トーマンデバイス	3,000	5,280.00	15,840,000
東京エレクトロン デバイス	5,900	5,300.00	31,270,000
フィールズ	17,400	1,599.00	27,822,600
双日	203,500	2,124.00	432,234,000
アルフレッサ ホールディングス	205,800	1,690.00	347,802,000

横浜冷凍	48,200	881.00	42,464,200
ラサ商事	9,000	1,000.00	9,000,000
アルコニックス	25,200	1,316.00	33,163,200
神戸物産	136,900	3,495.00	478,465,500
ハイパー	3,800	449.00	1,706,200
あい ホールディングス	28,300	2,064.00	58,411,200
ディーブイエックス	6,800	857.00	5,827,600
ダイワボウホールディングス	84,400	1,863.00	157,237,200
マクニカホールディングス	47,300	2,714.00	128,372,200
ラクト・ジャパン	6,800	2,142.00	14,565,600
グリムス	8,800	1,552.00	13,657,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	31,700	649.00	20,573,300
八洲電機	14,300	953.00	13,627,900
メディアスホールディングス	11,400	698.00	7,957,200
レスターホールディングス	18,800	1,931.00	36,302,800
ジューテックホールディングス	3,900	1,030.00	4,017,000
大光	8,500	668.00	5,678,000
OCHIホールディングス	4,500	1,215.00	5,467,500
TOKAIホールディングス	96,100	871.00	83,703,100
黒谷	5,500	557.00	3,063,500
Cominix	3,500	718.00	2,513,000
三洋貿易	18,200	1,034.00	18,818,800
ビューティガレージ	3,200	2,612.00	8,358,400
ウイン・パートナーズ	14,400	947.00	13,636,800
ミタチ産業	5,000	855.00	4,275,000
シップヘルスケアホールディングス	57,200	2,719.00	155,526,800
明治電機工業	6,000	1,020.00	6,120,000
デリカフーズホールディングス	7,800	505.00	3,939,000
スターティアホールディングス	4,500	924.00	4,158,000
コメダホールディングス	43,300	2,329.00	100,845,700
ピーバンドットコム	2,900	495.00	1,435,500
アセンテック	6,800	531.00	3,610,800
富士興産	5,000	1,144.00	5,720,000
協栄産業	2,000	1,442.00	2,884,000
フルサト・マルカホールディングス	17,600	3,100.00	54,560,000
ヤマエグループホールディングス	11,100	1,586.00	17,604,600
小野建	17,800	1,414.00	25,169,200
南陽	3,700	1,854.00	6,859,800
佐島電機	12,400	1,230.00	15,252,000
エコートレーディング	4,200	513.00	2,154,600
伯東	11,600	3,190.00	37,004,000
コンドーテック	14,900	1,000.00	14,900,000

中山福	10,600	308.00	3,264,800
ナガイレーベン	23,900	1,945.00	46,485,500
三菱食品	19,100	3,270.00	62,457,000
松田産業	14,500	2,176.00	31,552,000
第一興商	37,700	4,070.00	153,439,000
メディカルホールディングス	183,500	1,843.00	338,190,500
S P K	7,900	1,380.00	10,902,000
萩原電気ホールディングス	6,800	2,102.00	14,293,600
アズワン	28,500	5,990.00	170,715,000
スズデン	6,200	2,050.00	12,710,000
尾家産業	4,700	835.00	3,924,500
シモジマ	12,200	1,010.00	12,322,000
ドウシシャ	18,700	1,442.00	26,965,400
小津産業	4,400	1,758.00	7,735,200
高速	10,500	1,538.00	16,149,000
たけびし	6,800	1,454.00	9,887,200
リックス	4,100	1,967.00	8,064,700
丸文	15,800	775.00	12,245,000
ハピネット	15,100	1,848.00	27,904,800
橋本総業ホールディングス	7,000	966.00	6,762,000
日本ライフライン	57,100	967.00	55,215,700
タカショー	15,500	674.00	10,447,000
I D O M	60,200	869.00	52,313,800
進和	11,700	2,188.00	25,599,600
エスケイジャパン	4,900	568.00	2,783,200
ダイトロン	7,000	2,001.00	14,007,000
シークス	25,300	1,086.00	27,475,800
田中商事	6,200	555.00	3,441,000
オーハシテクニカ	9,800	1,331.00	13,043,800
白銅	6,400	2,306.00	14,758,400
ダイコー通産	2,400	1,097.00	2,632,800
伊藤忠商事	1,189,300	3,501.00	4,163,739,300
丸紅	1,718,500	1,268.00	2,179,058,000
高島	2,800	2,449.00	6,857,200
長瀬産業	90,800	1,971.00	178,966,800
蝶理	11,100	1,919.00	21,300,900
豊田通商	177,100	4,480.00	793,408,000
三共生興	25,500	445.00	11,347,500
兼松	68,700	1,427.00	98,034,900
ツカモトコーポレーション	3,300	1,085.00	3,580,500
三井物産	1,394,200	3,089.00	4,306,683,800
日本紙パルプ商事	9,400	4,360.00	40,984,000

カメイ	21,200	1,067.00	22,620,400
東都水産	1,000	4,485.00	4,485,000
OUGホールディングス	2,900	2,705.00	7,844,500
スターゼン	13,500	2,028.00	27,378,000
山善	71,600	910.00	65,156,000
椿本興業	3,300	3,645.00	12,028,500
住友商事	1,173,800	1,802.50	2,115,774,500
内田洋行	7,800	4,385.00	34,203,000
三菱商事	1,300,700	3,968.00	5,161,177,600
第一実業	7,600	3,845.00	29,222,000
キャノンマーケティングジャパン	41,000	3,200.00	131,200,000
西華産業	8,500	1,584.00	13,464,000
佐藤商事	13,700	1,132.00	15,508,400
菱洋エレクトロ	11,800	2,116.00	24,968,800
東京産業	16,200	755.00	12,231,000
ユアサ商事	15,900	3,505.00	55,729,500
神鋼商事	4,400	3,690.00	16,236,000
トルク	10,700	212.00	2,268,400
阪和興業	34,400	3,435.00	118,164,000
正栄食品工業	11,800	4,150.00	48,970,000
カナデン	16,100	1,022.00	16,454,200
菱電商事	15,700	1,561.00	24,507,700
岩谷産業	44,000	5,450.00	239,800,000
ナイス	6,100	1,542.00	9,406,200
ニチモウ	2,400	2,678.00	6,427,200
極東貿易	11,400	1,233.00	14,056,200
アステナホールディングス	30,700	427.00	13,108,900
三愛オブリ	44,400	1,117.00	49,594,800
稲畑産業	39,700	2,334.00	92,659,800
G S Iクレオス	9,500	1,421.00	13,499,500
明和産業	18,300	749.00	13,706,700
クワザワホールディングス	7,200	400.00	2,880,000
ワキタ	35,800	1,161.00	41,563,800
東邦ホールディングス	53,900	1,938.00	104,458,200
サンゲツ	48,200	1,601.00	77,168,200
ミツウロコグループホールディングス	22,800	967.00	22,047,600
シナネンホールディングス	6,500	3,885.00	25,252,500
伊藤忠エネクス	43,900	1,022.00	44,865,800
サンリオ	55,700	3,720.00	207,204,000
サンワテクノス	10,100	1,274.00	12,867,400
リョーサン	20,300	2,239.00	45,451,700
新光商事	26,200	881.00	23,082,200

トーホー	7,600	1,600.00	12,160,000
三信電気	8,200	1,677.00	13,751,400
東陽テクニカ	19,600	1,208.00	23,676,800
モスフードサービス	26,000	3,110.00	80,860,000
加賀電子	16,200	4,040.00	65,448,000
ソーダニッカ	15,900	590.00	9,381,000
立花エレテック	12,900	1,566.00	20,201,400
フォーバル	7,000	932.00	6,524,000
PALTA C	27,800	4,455.00	123,849,000
三谷産業	31,000	302.00	9,362,000
西本Wismettacホールディングス	4,500	3,860.00	17,370,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,800	1,508.00	2,714,400
コア商事ホールディングス	12,500	631.00	7,887,500
国際紙パルプ商事	36,700	718.00	26,350,600
ヤマタネ	8,500	1,588.00	13,498,000
丸紅建材リース	1,700	1,713.00	2,912,100
日鉄物産	12,100	5,030.00	60,863,000
泉州電業	4,400	5,200.00	22,880,000
トラスコ中山	37,200	1,992.00	74,102,400
オートバックスセブン	61,600	1,402.00	86,363,200
モリト	13,100	705.00	9,235,500
加藤産業	21,500	3,340.00	71,810,000
北恵	4,400	695.00	3,058,000
イノテック	12,000	1,258.00	15,096,000
イエローハット	31,200	1,794.00	55,972,800
J Kホールディングス	14,000	988.00	13,832,000
日伝	13,500	1,733.00	23,395,500
北沢産業	10,600	200.00	2,120,000
杉本商事	9,300	1,818.00	16,907,400
因幡電機産業	49,400	2,727.00	134,713,800
東テク	5,900	3,305.00	19,499,500
ミスミグループ本社	249,100	3,120.00	777,192,000
アルテック	11,000	327.00	3,597,000
タキヒヨー	5,400	764.00	4,125,600
蔵王産業	3,800	1,772.00	6,733,600
スズケン	71,100	3,305.00	234,985,500
ジェコス	13,700	786.00	10,768,200
グローセル	21,600	404.00	8,726,400
ローソン	44,000	4,740.00	208,560,000
サンエー	13,600	4,365.00	59,364,000
カワチ薬品	15,500	2,131.00	33,030,500
エービーシー・マート	31,000	6,230.00	193,130,000

ハードオフコーポレーション	9,000	1,254.00	11,286,000
アスクル	42,900	1,494.00	64,092,600
ゲオホールディングス	24,100	1,772.00	42,705,200
アダストリア	21,500	2,142.00	46,053,000
くら寿司	20,800	3,060.00	63,648,000
キャンドウ	6,400	2,197.00	14,060,800
アイケイ	7,100	404.00	2,868,400
パルグループホールディングス	17,500	2,349.00	41,107,500
エディオン	91,300	1,178.00	107,551,400
サーラコーポレーション	37,600	760.00	28,576,000
ワッツ	10,100	680.00	6,868,000
ハローズ	9,200	2,898.00	26,661,600
フジオフードグループ本社	14,700	1,358.00	19,962,600
あみやき亭	4,800	2,912.00	13,977,600
大黒天物産	6,400	5,260.00	33,664,000
ハニーズホールディングス	16,000	1,216.00	19,456,000
ファーマライズホールディングス	4,800	637.00	3,057,600
アルペン	14,800	2,066.00	30,576,800
ハブ	7,000	618.00	4,326,000
クオールホールディングス	24,600	1,210.00	29,766,000
ジinzホールディングス	10,600	4,280.00	45,368,000
ビックカメラ	117,900	1,237.00	145,842,300
D C Mホールディングス	118,100	1,177.00	139,003,700
Monotaro	251,000	2,222.00	557,722,000
東京一番フーズ	5,100	579.00	2,952,900
きちりホールディングス	5,300	311.00	1,648,300
アークランドサービスホールディングス	14,700	2,137.00	31,413,900
J.フロント リテイリング	220,200	1,176.00	258,955,200
ドトール・日レスホールディングス	31,600	1,738.00	54,920,800
マツキヨココカラ&カンパニー	116,300	6,230.00	724,549,000
ブロンコビリー	9,600	2,447.00	23,491,200
Z O Z O	136,500	2,894.00	395,031,000
トレジャー・ファクトリー	6,000	1,788.00	10,728,000
物語コーポレーション	9,900	6,940.00	68,706,000
三越伊勢丹ホールディングス	298,000	1,227.00	365,646,000
Hamee	7,500	860.00	6,450,000
マーケットエンタープライズ	2,400	897.00	2,152,800
ウエルシアホールディングス	105,000	3,055.00	320,775,000
クリエイティブSDホールディングス	29,400	3,135.00	92,169,000
丸善CHIホールディングス	24,200	326.00	7,889,200
ミサワ	4,600	575.00	2,645,000
ティーライフ	2,900	1,199.00	3,477,100

チムニー	6,000	1,171.00	7,026,000	
シュッピン	16,600	1,268.00	21,048,800	
オイシックス・ラ・大地	28,700	1,645.00	47,211,500	
ネクステージ	40,400	3,140.00	126,856,000	
ジョイフル本田	57,100	1,784.00	101,866,400	
鳥貴族ホールディングス	6,700	2,400.00	16,080,000	
ホットランド	13,800	1,356.00	18,712,800	
すかいらーくホールディングス	242,100	1,543.00	373,560,300	
SFPホールディングス	9,700	1,695.00	16,441,500	
綿半ホールディングス	13,900	1,379.00	19,168,100	
ヨシックスホールディングス	4,000	2,023.00	8,092,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	58,000	1,054.00	61,132,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,200	1,515.00	12,423,000	
B E E N O S	10,200	2,332.00	23,786,400	
あさひ	16,700	1,306.00	21,810,200	
日本調剤	12,300	1,265.00	15,559,500	
コスモス薬品	20,000	14,350.00	287,000,000	
トーエル	9,100	744.00	6,770,400	
セブン&アイ・ホールディングス	665,200	5,806.00	3,862,151,200	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	133,100	976.00	129,905,600	
ツルハホールディングス	43,300	8,490.00	367,617,000	
サンマルクホールディングス	15,900	1,604.00	25,503,600	
フェリシモ	4,700	1,015.00	4,770,500	
トリドールホールディングス	49,500	2,992.00	148,104,000	
T O K Y O B A S E	19,200	314.00	6,028,800	
ウイルプラスホールディングス	4,000	1,117.00	4,468,000	
J Mホールディングス	15,200	1,683.00	25,581,600	
サツドラホールディングス	9,400	672.00	6,316,800	
アレンザホールディングス	13,600	982.00	13,355,200	
串カツ田中ホールディングス	4,900	1,706.00	8,359,400	
パロックジャパンリミテッド	14,200	786.00	11,161,200	
クスリのアオキホールディングス	17,800	6,810.00	121,218,000	
力の源ホールディングス	10,500	765.00	8,032,500	
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	101,800	2,224.00	226,403,200	
メディカルシステムネットワーク	18,100	395.00	7,149,500	
はるやまホールディングス	10,100	400.00	4,040,000	
ノジマ	64,400	1,348.00	86,811,200	
カップ・クリエイト	27,800	1,362.00	37,863,600	
ライトオン	14,800	672.00	9,945,600	
良品計画	228,500	1,209.00	276,256,500	

パリミキホールディングス	26,000	235.00	6,110,000
アドヴァングループ	17,200	815.00	14,018,000
アルビス	5,900	2,331.00	13,752,900
コナカ	21,400	331.00	7,083,400
ハウス オブ ローゼ	2,600	1,600.00	4,160,000
G - 7ホールディングス	22,300	1,431.00	31,911,300
イオン北海道	26,400	1,130.00	29,832,000
コジマ	34,700	630.00	21,861,000
ヒマラヤ	6,500	913.00	5,934,500
コーナン商事	28,300	3,380.00	95,654,000
エコス	6,700	1,807.00	12,106,900
ワタミ	24,000	903.00	21,672,000
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	396,800	2,560.00	1,015,808,000
西松屋チェーン	39,400	1,344.00	52,953,600
ゼンショーホールディングス	96,900	3,585.00	347,386,500
幸楽苑ホールディングス	11,500	1,078.00	12,397,000
ハークスレイ	9,000	468.00	4,212,000
サイゼリヤ	29,500	2,670.00	78,765,000
V Tホールディングス	75,400	476.00	35,890,400
魚力	5,600	2,005.00	11,228,000
フジ・コーポレーション	10,300	1,229.00	12,658,700
ユナイテッドアローズ	21,000	1,821.00	38,241,000
ハイデイ日高	28,800	2,156.00	62,092,800
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	13,300	205.00	2,726,500
コロナイド	81,500	1,859.00	151,508,500
ピーシーデボコーポレーション	24,300	268.00	6,512,400
壱番屋	14,100	4,440.00	62,604,000
P L A N T	5,100	635.00	3,238,500
スギホールディングス	39,700	5,810.00	230,657,000
薬王堂ホールディングス	10,000	2,331.00	23,310,000
スクロール	31,000	701.00	21,731,000
ヨンドシーホールディングス	16,900	1,718.00	29,034,200
木曽路	26,900	2,072.00	55,736,800
S R Sホールディングス	29,400	842.00	24,754,800
千趣会	33,400	392.00	13,092,800
リテールパートナーズ	26,600	1,112.00	29,579,200
ケーヨー	36,900	910.00	33,579,000
上新電機	19,400	1,896.00	36,782,400
日本瓦斯	95,000	2,055.00	195,225,000
ロイヤルホールディングス	33,700	2,186.00	73,668,200
いなげや	19,800	1,146.00	22,690,800



チヨダ	17,300	785.00	13,580,500
ライフコーポレーション	15,500	2,686.00	41,633,000
リンガーハット	22,800	2,196.00	50,068,800
MrMaxHD	25,300	623.00	15,761,900
AOKIホールディングス	38,800	707.00	27,431,600
オークワ	28,500	905.00	25,792,500
コメリ	30,800	2,764.00	85,131,200
青山商事	38,200	912.00	34,838,400
しまむら	23,100	12,230.00	282,513,000
はせがわ	11,500	365.00	4,197,500
高島屋	133,500	1,711.00	228,418,500
松屋	33,500	1,037.00	34,739,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	86,300	1,107.00	95,534,100
近鉄百貨店	5,800	2,398.00	13,908,400
丸井グループ	143,600	2,398.00	344,352,800
アクシアル リテイリング	13,300	3,255.00	43,291,500
イオン	654,400	2,703.50	1,769,170,400
イズミ	31,400	3,105.00	97,497,000
平和堂	29,700	1,998.00	59,340,600
フジ	43,600	1,884.00	82,142,400
ヤオコー	22,600	6,560.00	148,256,000
ゼビオホールディングス	27,300	964.00	26,317,200
ケーズホールディングス	169,100	1,195.00	202,074,500
Olympicグループ	9,400	563.00	5,292,200
日産東京販売ホールディングス	30,400	267.00	8,116,800
シルバーライフ	4,300	1,319.00	5,671,700
Genky DrugStores	8,800	3,595.00	31,636,000
ナルミヤ・インターナショナル	4,800	831.00	3,988,800
ブックオフグループホールディングス	11,900	1,117.00	13,292,300
ギフトホールディングス	3,800	3,265.00	12,407,000
アインホールディングス	24,400	6,250.00	152,500,000
元気寿司	5,700	3,040.00	17,328,000
ヤマダホールディングス	702,500	476.00	334,390,000
アーケランズ	31,300	1,449.00	45,353,700
ニトリホールディングス	78,800	12,190.00	960,572,000
グルメ杵屋	16,100	996.00	16,035,600
愛眼	14,500	175.00	2,537,500
ケーユーホールディングス	10,600	1,094.00	11,596,400
吉野家ホールディングス	69,400	2,347.00	162,881,800
松屋フーズホールディングス	9,600	3,815.00	36,624,000
サガミホールディングス	28,700	1,156.00	33,177,200
関西フードマーケット	16,300	1,117.00	18,207,100

王将フードサービス	13,200	6,400.00	84,480,000
プレナス	22,400	1,926.00	43,142,400
ミニストップ	14,900	1,420.00	21,158,000
アークス	35,300	2,060.00	72,718,000
パローホールディングス	40,700	1,779.00	72,405,300
ベルク	8,900	5,390.00	47,971,000
大庄	10,900	1,129.00	12,306,100
ファーストリテイリング	26,500	76,710.00	2,032,815,000
サンドラッグ	74,700	3,515.00	262,570,500
サックスパー ホールディングス	19,200	710.00	13,632,000
ヤマザワ	4,400	1,233.00	5,425,200
やまや	4,200	2,475.00	10,395,000
ベルーナ	43,100	698.00	30,083,800
島根銀行	6,300	435.00	2,740,500
じもとホールディングス	13,100	466.00	6,104,600
めぶきフィナンシャルグループ	817,200	282.00	230,450,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	23,000	2,122.00	48,806,000
九州フィナンシャルグループ	347,700	382.00	132,821,400
ゆうちょ銀行	469,000	1,009.00	473,221,000
富山第一銀行	44,200	405.00	17,901,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	983,400	447.00	439,579,800
西日本フィナンシャルホールディングス	104,300	750.00	78,225,000
三十三フィナンシャルグループ	16,000	1,411.00	22,576,000
第四北越フィナンシャルグループ	28,000	2,682.00	75,096,000
ひろぎんホールディングス	253,900	608.00	154,371,200
おきなわフィナンシャルグループ	16,800	2,097.00	35,229,600
十六フィナンシャルグループ	23,100	2,439.00	56,340,900
北國フィナンシャルホールディングス	16,400	4,720.00	77,408,000
プロクレアホールディングス	20,200	2,124.00	42,904,800
新生銀行	129,600	2,075.00	268,920,000
あおぞら銀行	111,000	2,582.00	286,602,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,628,200	651.50	7,575,772,300
りそなホールディングス	2,102,000	528.00	1,109,856,000
三井住友トラスト・ホールディングス	328,600	4,099.00	1,346,931,400
三井住友フィナンシャルグループ	1,289,100	4,024.00	5,187,338,400
千葉銀行	561,000	779.00	437,019,000
群馬銀行	319,600	392.00	125,283,200
武蔵野銀行	25,400	1,704.00	43,281,600
千葉興業銀行	42,800	282.00	12,069,600
筑波銀行	77,400	185.00	14,319,000
七十七銀行	52,700	1,782.00	93,911,400
秋田銀行	11,900	1,612.00	19,182,800

山形銀行	18,300	999.00	18,281,700
岩手銀行	12,100	1,792.00	21,683,200
東邦銀行	142,100	203.00	28,846,300
東北銀行	8,900	949.00	8,446,100
ふくおかフィナンシャルグループ	143,400	2,566.00	367,964,400
静岡銀行	409,400	875.00	358,225,000
スルガ銀行	174,200	372.00	64,802,400
八十二銀行	368,500	479.00	176,511,500
山梨中央銀行	20,000	1,158.00	23,160,000
大垣共立銀行	34,000	1,713.00	58,242,000
福井銀行	15,900	1,367.00	21,735,300
清水銀行	7,100	1,450.00	10,295,000
富山銀行	3,100	1,736.00	5,381,600
滋賀銀行	32,400	2,614.00	84,693,600
南都銀行	26,800	2,100.00	56,280,000
百五銀行	166,900	317.00	52,907,300
京都銀行	61,700	5,290.00	326,393,000
紀陽銀行	58,900	1,388.00	81,753,200
ほくほくフィナンシャルグループ	112,700	854.00	96,245,800
山陰合同銀行	110,400	700.00	77,280,000
中国銀行	139,800	899.00	125,680,200
鳥取銀行	6,300	1,089.00	6,860,700
伊予銀行	222,700	699.00	155,667,300
百十四銀行	18,300	1,667.00	30,506,100
四国銀行	26,200	853.00	22,348,600
阿波銀行	26,400	1,889.00	49,869,600
大分銀行	10,700	1,815.00	19,420,500
宮崎銀行	10,800	2,148.00	23,198,400
佐賀銀行	10,400	1,521.00	15,818,400
琉球銀行	43,100	765.00	32,971,500
セブン銀行	590,000	259.00	152,810,000
みずほフィナンシャルグループ	2,381,900	1,562.50	3,721,718,750
高知銀行	6,200	637.00	3,949,400
山口フィナンシャルグループ	198,400	768.00	152,371,200
長野銀行	6,100	1,366.00	8,332,600
名古屋銀行	12,100	3,000.00	36,300,000
北洋銀行	249,600	227.00	56,659,200
愛知銀行	6,200	5,500.00	34,100,000
中京銀行	6,100	1,710.00	10,431,000
大光銀行	5,900	1,297.00	7,652,300
愛媛銀行	25,900	861.00	22,299,900
トマト銀行	6,000	1,011.00	6,066,000

京葉銀行	82,900	472.00	39,128,800
栃木銀行	89,100	274.00	24,413,400
北日本銀行	5,800	1,760.00	10,208,000
東和銀行	32,600	513.00	16,723,800
福島銀行	21,000	207.00	4,347,000
大東銀行	8,700	608.00	5,289,600
トモニホールディングス	143,300	310.00	44,423,000
フィデアホールディングス	18,200	1,261.00	22,950,200
池田泉州ホールディングス	210,900	209.00	44,078,100
F P G	67,000	1,132.00	75,844,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	13,600	1,322.00	17,979,200
マーキュリアホールディングス	11,100	609.00	6,759,900
S B Iホールディングス	245,500	2,596.00	637,318,000
ジャフコ グループ	68,800	2,129.00	146,475,200
大和証券グループ本社	1,276,200	566.40	722,839,680
野村ホールディングス	3,033,600	478.40	1,451,274,240
岡三証券グループ	144,000	326.00	46,944,000
丸三証券	59,500	433.00	25,763,500
東洋証券	61,000	261.00	15,921,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	196,200	353.00	69,258,600
光世証券	4,700	402.00	1,889,400
水戸証券	49,600	237.00	11,755,200
いちよし証券	33,200	594.00	19,720,800
松井証券	97,600	780.00	76,128,000
マネックスグループ	167,800	452.00	75,845,600
極東証券	22,900	665.00	15,228,500
岩井コスモホールディングス	19,000	1,210.00	22,990,000
アイザワ証券グループ	27,100	643.00	17,425,300
マネーパートナーズグループ	22,000	263.00	5,786,000
スパークス・グループ	18,520	1,334.00	24,705,680
かんぽ生命保険	200,000	2,026.00	405,200,000
S O M P Oホールディングス	282,700	5,762.00	1,628,917,400
アニコム ホールディングス	61,000	567.00	34,587,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	408,400	3,836.00	1,566,622,400
第一生命ホールディングス	967,400	2,292.00	2,217,280,800
東京海上ホールディングス	1,658,400	2,565.00	4,253,796,000
T & Dホールディングス	442,000	1,367.00	604,214,000
アドバンスクリエイト	9,500	963.00	9,148,500
全国保証	47,500	4,815.00	228,712,500
あんしん保証	10,300	253.00	2,605,900
イントラスト	9,400	593.00	5,574,200
日本モーゲージサービス	11,700	840.00	9,828,000

C a s a	7,800	801.00	6,247,800
アルヒ	29,800	1,375.00	40,975,000
プレミアグループ	30,500	1,777.00	54,198,500
ネットプロテクションズホールディングス	61,800	379.00	23,422,200
クレディセゾン	116,300	1,692.00	196,779,600
芙蓉総合リース	17,100	7,890.00	134,919,000
みずほリース	24,700	3,115.00	76,940,500
東京センチュリー	30,900	4,610.00	142,449,000
日本証券金融	78,800	820.00	64,616,000
アイフル	335,000	377.00	126,295,000
リコーリース	17,800	3,530.00	62,834,000
イオンフィナンシャルサービス	108,500	1,432.00	155,372,000
アコム	393,800	311.00	122,471,800
ジャックス	19,900	3,590.00	71,441,000
オリエントコーポレーション	54,280	1,146.00	62,204,880
オリックス	1,180,600	2,028.50	2,394,847,100
三菱HCキャピタル	643,100	622.00	400,008,200
九州リースサービス	9,600	589.00	5,654,400
日本取引所グループ	463,100	1,952.50	904,202,750
イー・ギャランティ	29,800	2,495.00	74,351,000
アサックス	11,400	578.00	6,589,200
NECキャピタルソリューション	8,400	2,065.00	17,346,000
いちご	228,000	298.00	67,944,000
日本駐車場開発	206,200	201.00	41,446,200
スター・マイカ・ホールディングス	9,700	1,569.00	15,219,300
SREホールディングス	5,700	3,175.00	18,097,500
ADワークスグループ	44,300	152.00	6,733,600
ヒューリック	386,100	1,063.00	410,424,300
三栄建築設計	9,200	1,616.00	14,867,200
野村不動産ホールディングス	103,500	3,275.00	338,962,500
三重交通グループホールディングス	44,400	499.00	22,155,600
サムティ	27,100	2,249.00	60,947,900
ディア・ライフ	28,000	554.00	15,512,000
地主	13,600	1,987.00	27,023,200
プレサンスコーポレーション	23,000	1,463.00	33,649,000
ハウスコム	5,600	904.00	5,062,400
JPMC	10,400	1,008.00	10,483,200
サンセイランディック	7,800	821.00	6,403,800
フージャースホールディングス	25,400	775.00	19,685,000
オープンハウスグループ	60,700	4,895.00	297,126,500
東急不動産ホールディングス	542,800	751.00	407,642,800
飯田グループホールディングス	163,300	1,963.00	320,557,900

イーランド	4,100	1,521.00	6,236,100
ムゲンエステート	16,500	456.00	7,524,000
And Doホールディングス	9,800	860.00	8,428,000
シーアールイー	8,700	1,460.00	12,702,000
ケイアイスター不動産	9,400	4,370.00	41,078,000
グッドコムアセット	9,000	1,517.00	13,653,000
ジェイ・エス・ビー	4,600	3,750.00	17,250,000
ロードスターキャピタル	8,300	1,574.00	13,064,200
テンポイノベーション	7,700	898.00	6,914,600
フェイスネットワーク	4,000	1,308.00	5,232,000
パーク24	129,400	1,869.00	241,848,600
パラカ	6,900	1,816.00	12,530,400
三井不動産	775,900	2,754.50	2,137,216,550
三菱地所	1,132,300	1,896.50	2,147,406,950
平和不動産	32,100	3,970.00	127,437,000
東京建物	158,000	2,058.00	325,164,000
京阪神ビルディング	27,600	1,223.00	33,754,800
住友不動産	357,900	3,288.00	1,176,775,200
テーオーシー	32,700	706.00	23,086,200
東京楽天地	3,400	3,940.00	13,396,000
スターツコーポレーション	27,800	2,631.00	73,141,800
フジ住宅	26,300	621.00	16,332,300
空港施設	23,700	520.00	12,324,000
明和地所	12,600	603.00	7,597,800
ゴールドクレスト	16,800	1,667.00	28,005,600
エスリード	8,900	1,686.00	15,005,400
日神グループホールディングス	37,000	429.00	15,873,000
日本エスコン	37,000	818.00	30,266,000
タカラレーベン	83,200	385.00	32,032,000
AVANTIA	11,800	793.00	9,357,400
イオンモール	100,900	1,610.00	162,449,000
毎日コムネット	10,000	622.00	6,220,000
ファースト住建	9,200	1,099.00	10,110,800
カチタス	49,800	3,215.00	160,107,000
トーセイ	28,800	1,387.00	39,945,600
穴吹興産	5,300	2,001.00	10,605,300
サンフロンティア不動産	29,200	1,120.00	32,704,000
FJネクストホールディングス	21,400	1,008.00	21,571,200
インテリックス	4,500	551.00	2,479,500
ランドビジネス	6,700	222.00	1,487,400
サンネクスタグループ	8,200	913.00	7,486,600
グランディハウス	17,100	543.00	9,285,300

日本空港ビルデング	64,400	6,050.00	389,620,000
明豊ファシリティワークス	9,400	656.00	6,166,400
日本工営	12,300	3,570.00	43,911,000
L I F U L L	61,100	161.00	9,837,100
ミクシィ	44,200	2,293.00	101,350,600
ジェイエイシーリクルートメント	15,700	2,216.00	34,791,200
日本M&Aセンターホールディングス	315,900	1,663.00	525,341,700
メンバーズ	5,200	2,578.00	13,405,600
中広	4,000	396.00	1,584,000
UTグループ	27,900	2,382.00	66,457,800
アイティメディア	9,400	1,615.00	15,181,000
E・Jホールディングス	11,300	1,298.00	14,667,400
夢真ビーネックスグループ	63,000	1,607.00	101,241,000
コシダカホールディングス	51,900	905.00	46,969,500
アルトナー	5,000	982.00	4,910,000
パソナグループ	21,000	2,000.00	42,000,000
C D S	5,000	1,651.00	8,255,000
リンクアンドモチベーション	49,500	769.00	38,065,500
エス・エム・エス	65,500	2,929.00	191,849,500
サニーサイドアップグループ	7,300	594.00	4,336,200
パーソルホールディングス	192,600	2,675.00	515,205,000
リニカル	11,400	742.00	8,458,800
クックパッド	48,900	200.00	9,780,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	10,000	619.00	6,190,000
学情	8,000	1,424.00	11,392,000
スタジオアリス	8,800	2,146.00	18,884,800
シミックホールディングス	9,700	1,528.00	14,821,600
エプコ	4,700	635.00	2,984,500
N J S	4,000	1,969.00	7,876,000
総合警備保障	70,300	3,640.00	255,892,000
カカクコム	141,400	2,462.00	348,126,800
アイロムグループ	7,100	2,363.00	16,777,300
セントケア・ホールディング	13,000	814.00	10,582,000
サイネックス	3,900	591.00	2,304,900
ルネサンス	13,800	931.00	12,847,800
ディップ	33,900	3,675.00	124,582,500
デジタルホールディングス	13,700	1,168.00	16,001,600
新日本科学	23,600	2,696.00	63,625,600
キャリアデザインセンター	4,200	1,397.00	5,867,400
ベネフィット・ワン	69,900	2,033.00	142,106,700
エムスリー	339,700	4,051.00	1,376,124,700
ツカダ・グローバルホールディング	12,200	354.00	4,318,800

アウトソーシング	102,700	1,097.00	112,661,900
ウェルネット	17,600	591.00	10,401,600
ワールドホールディングス	7,800	2,631.00	20,521,800
ディー・エヌ・エー	73,500	1,829.00	134,431,500
博報堂DYホールディングス	244,000	1,018.00	248,392,000
ぐるなび	28,900	433.00	12,513,700
タカミヤ	24,200	386.00	9,341,200
ジャパンベストレスキューシステム	10,800	743.00	8,024,400
ファンコミュニケーションズ	34,600	409.00	14,151,400
ライク	6,600	2,157.00	14,236,200
ビジネス・ブレークスルー	8,100	392.00	3,175,200
エスプール	49,800	1,043.00	51,941,400
WDBホールディングス	8,900	2,398.00	21,342,200
ティア	12,100	422.00	5,106,200
CDG	2,300	1,229.00	2,826,700
アドウェイズ	24,200	741.00	17,932,200
バリューコマース	13,100	2,214.00	29,003,400
インフォマート	179,300	441.00	79,071,300
J Pホールディングス	50,800	271.00	13,766,800
エコナックホールディングス	37,400	88.00	3,291,200
CLホールディングス	5,200	860.00	4,472,000
プレステージ・インターナショナル	72,700	634.00	46,091,800
アミューズ	10,700	1,695.00	18,136,500
ドリームインキュベータ	6,100	1,802.00	10,992,200
クイック	12,200	1,818.00	22,179,600
TAC	12,300	202.00	2,484,600
電通グループ	180,400	4,110.00	741,444,000
イオンファンタジー	7,500	3,465.00	25,987,500
シーティーエス	22,200	729.00	16,183,800
ネクシィーズグループ	6,400	652.00	4,172,800
H.U.グループホールディングス	50,400	2,640.00	133,056,000
アルプス技研	15,200	1,848.00	28,089,600
ダイオーズ	4,000	1,497.00	5,988,000
日本空調サービス	20,600	737.00	15,182,200
オリエンタルランド	204,700	19,705.00	4,033,613,500
ダスキン	41,600	2,840.00	118,144,000
明光ネットワークジャパン	23,200	604.00	14,012,800
ファルコホールディングス	8,700	1,746.00	15,190,200
ラウンドワン	161,700	628.00	101,547,600
リゾートトラスト	81,600	2,322.00	189,475,200
ビー・エム・エル	24,600	3,260.00	80,196,000
りらいあコミュニケーションズ	28,800	965.00	27,792,000



リソー教育	89,100	320.00	28,512,000
早稲田アカデミー	11,100	1,036.00	11,499,600
ユー・エス・エス	215,600	2,237.00	482,297,200
東京個別指導学院	17,700	550.00	9,735,000
サイバーエージェント	411,600	1,218.00	501,328,800
楽天グループ	794,900	621.00	493,632,900
クリーク・アンド・リバー社	10,200	2,475.00	25,245,000
モーニングスター	34,500	464.00	16,008,000
テー・オー・ダブリュー	38,000	304.00	11,552,000
山田コンサルティンググループ	10,300	1,199.00	12,349,700
セントラルスポーツ	7,300	2,444.00	17,841,200
フルキャストホールディングス	16,600	2,560.00	42,496,000
エン・ジャパン	34,400	2,231.00	76,746,400
リソルホールディングス	2,200	4,520.00	9,944,000
テクノプロ・ホールディングス	115,400	3,085.00	356,009,000
アトラグループ	4,300	183.00	786,900
インターワークス	6,500	365.00	2,372,500
アイ・アールジャパンホールディングス	9,100	2,050.00	18,655,000
Keeper 技研	12,500	3,720.00	46,500,000
ファーストロジック	3,400	836.00	2,842,400
三機サービス	3,800	874.00	3,321,200
Gunosy	11,100	766.00	8,502,600
デザインワン・ジャパン	7,800	168.00	1,310,400
イー・ガーディアン	6,600	2,864.00	18,902,400
リブセンス	10,200	248.00	2,529,600
ジャパンマテリアル	59,400	1,848.00	109,771,200
ベクトル	27,300	1,098.00	29,975,400
ウチヤマホールディングス	10,700	287.00	3,070,900
チャーム・ケア・コーポレーション	14,700	1,045.00	15,361,500
キャリアリンク	7,300	2,219.00	16,198,700
I B J	10,900	884.00	9,635,600
アサンテ	8,700	1,513.00	13,163,100
バリューHR	15,200	1,472.00	22,374,400
M&Aキャピタルパートナーズ	16,000	3,710.00	59,360,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,800	1,055.00	8,229,000
E R Iホールディングス	5,700	1,086.00	6,190,200
アピスト	3,100	2,765.00	8,571,500
シグマクシス・ホールディングス	23,500	1,132.00	26,602,000
ウィルグループ	14,600	1,368.00	19,972,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	22,300	158.00	3,523,400
メドピア	13,800	1,293.00	17,843,400
レアジョブ	4,100	710.00	2,911,000

リクルートホールディングス	1,378,800	4,161.00	5,737,186,800
エラン	23,100	1,073.00	24,786,300
土木管理総合試験所	9,200	303.00	2,787,600
日本郵政	2,103,200	957.70	2,014,234,640
ベルシステム24ホールディングス	27,900	1,380.00	38,502,000
鎌倉新書	22,300	847.00	18,888,100
S MN	5,100	511.00	2,606,100
グローバルキッズCOMPANY	3,500	615.00	2,152,500
エアトリ	11,200	2,849.00	31,908,800
アトラエ	13,700	1,624.00	22,248,800
ストライク	8,600	3,860.00	33,196,000
ソラスト	47,800	863.00	41,251,400
セラク	6,500	984.00	6,396,000
インソース	21,500	2,625.00	56,437,500
ペイカレント・コンサルティング	13,600	37,650.00	512,040,000
Orchestra Holdings	3,800	2,427.00	9,222,600
アイモバイル	9,200	1,171.00	10,773,200
キャリアインデックス	7,500	364.00	2,730,000
MS - Japan	8,300	840.00	6,972,000
船場	3,700	725.00	2,682,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	61,300	1,895.00	116,163,500
フルテック	3,000	1,145.00	3,435,000
GameWith	6,700	363.00	2,432,100
MS&Consulting	3,400	605.00	2,057,000
ウェルビー	13,100	785.00	10,283,500
エル・ティー・エス	2,300	3,115.00	7,164,500
ミダックホールディングス	8,800	3,350.00	29,480,000
日総工産	15,700	556.00	8,729,200
キュービーネットホールディングス	9,200	1,360.00	12,512,000
RPAホールディングス	28,400	290.00	8,236,000
スプリックス	7,000	950.00	6,650,000
マネジメントソリューションズ	9,600	2,940.00	28,224,000
プロレド・パートナーズ	4,900	496.00	2,430,400
テノ・ホールディングス	3,000	556.00	1,668,000
フロンティア・マネジメント	6,000	1,164.00	6,984,000
ピアラ	3,600	691.00	2,487,600
コプロ・ホールディングス	4,200	878.00	3,687,600
ギークス	3,700	815.00	3,015,500
カーブスホールディングス	53,300	819.00	43,652,700
フォーラムエンジニアリング	12,100	912.00	11,035,200
Fast Fitness Japan	3,800	1,345.00	5,111,000
ダイレクトマーケティングミックス	19,800	1,629.00	32,254,200

ポピンズ	2,800	1,689.00	4,729,200
LITALICO	15,700	2,769.00	43,473,300
アドバンテッジリスクマネジメント	10,600	424.00	4,494,400
リログループ	105,400	2,202.00	232,090,800
東祥	14,700	1,214.00	17,845,800
ビーウィズ	5,400	1,361.00	7,349,400
TREホールディングス	36,400	1,700.00	61,880,000
人・夢・技術グループ	7,800	2,535.00	19,773,000
エイチ・アイ・エス	45,100	2,087.00	94,123,700
ラックランド	5,500	2,768.00	15,224,000
共立メンテナンス	34,400	5,980.00	205,712,000
イチネンホールディングス	20,000	1,216.00	24,320,000
建設技術研究所	9,000	2,836.00	25,524,000
スペース	12,900	852.00	10,990,800
燦ホールディングス	8,600	1,687.00	14,508,200
スバル興業	1,200	8,920.00	10,704,000
東京テアトル	7,000	1,163.00	8,141,000
タナベ経営	8,000	618.00	4,944,000
ナガワ	5,400	7,420.00	40,068,000
東京都競馬	14,500	4,130.00	59,885,000
カナモト	31,700	2,064.00	65,428,800
西尾レントオール	16,100	2,854.00	45,949,400
トランス・コスモス	24,500	3,735.00	91,507,500
乃村工藝社	82,900	905.00	75,024,500
藤田観光	7,600	2,891.00	21,971,600
KNT-CTホールディングス	12,000	1,789.00	21,468,000
日本管財	20,700	2,534.00	52,453,800
トーカイ	15,400	1,793.00	27,612,200
セコム	189,700	8,276.00	1,569,957,200
セントラル警備保障	9,400	2,381.00	22,381,400
丹青社	36,800	760.00	27,968,000
メイテック	68,700	2,294.00	157,597,800
応用地質	16,900	1,868.00	31,569,200
船井総研ホールディングス	36,300	2,455.00	89,116,500
進学会ホールディングス	7,500	300.00	2,250,000
オオバ	12,600	691.00	8,706,600
いであ	4,400	1,639.00	7,211,600
学究社	6,400	1,616.00	10,342,400
ベネッセホールディングス	64,300	2,155.00	138,566,500
イオンディライト	22,300	2,836.00	63,242,800
ナック	9,500	918.00	8,721,000
ダイセキ	35,200	4,460.00	156,992,000

ステップ	7,300	1,778.00	12,979,400	
合計	206,248,400		472,582,867,680	

## (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・オープン】

## 【純資産額計算書】

(2022年10月31日現在)

資産総額	12,116,049,894円
負債総額	22,804,527円
純資産総額（ - ）	12,093,245,367円
発行済口数	5,027,104,789口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4056円
（1万口当たり純資産額）	（24,056円）

(参考)

## 国内株式インデックス マザーファンド

## 純資産額計算書

(2022年10月31日現在)

資産総額	517,141,623,583円
負債総額	13,670,590,092円
純資産総額（ - ）	503,471,033,491円
発行済口数	260,990,508,716口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9291円
（1万口当たり純資産額）	（19,291円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

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

ません。

#### 受益権の譲渡

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

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2022年10月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ D0（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 - D0 - 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2022年12月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年10月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	535	13,948,677
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	69	220,432
単位型公社債投資信託	51	184,667
合計	655	14,353,777

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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



- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

	(単位: 百万円)	
	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	21,589	21,675
金銭の信託	10,857	14,913
前払費用	397	166
未収委託者報酬	8,471	9,067
未収運用受託報酬	6,151	6,252
未収収益	177	179
その他	3,428	4,891
流動資産合計	51,072	57,146
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 301	1 289
器具備品	1 692	1 687
その他	1 0	1 -
有形固定資産合計	993	976
無形固定資産		
ソフトウェア	4,104	6,292
その他	41	31
無形固定資産合計	4,145	6,324
投資その他の資産		
投資有価証券	9,950	6,607
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	311	907
その他	39	31
投資その他の資産合計	15,937	13,182
固定資産合計	21,077	20,482
資産合計	72,149	77,629

(単位: 百万円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	44	47
未払金	7,572	8,285
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,154	4,561
その他未払金	3,417	3,723
未払費用	1,046	1,049
未払法人税等	517	504
賞与引当金	556	578
その他	818	1,958
流動負債合計	10,555	12,423
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	626	820
資産除去債務	133	153
その他	8	12
固定負債合計	768	986
負債合計	11,324	13,410
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
<b>資本剰余金</b>		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	500	500
<b>その他利益剰余金</b>		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	38,258	41,948
利益剰余金合計	40,858	44,548
株主資本合計	60,098	63,788
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	791	941
繰延ヘッジ損益	65	509
評価・換算差額等合計	726	431
純資産合計	60,824	64,219
負債・純資産合計	72,149	77,629

## (2) 【損益計算書】

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	37,224	41,730
運用受託報酬	10,982	11,883
その他営業収益	403	390
営業収益合計	48,611	54,004
営業費用		
支払手数料	17,936	20,567
広告宣伝費	203	286
調査費	5,064	5,567
調査費	898	1,062
委託調査費	4,154	4,487
図書費	11	17
営業雑経費	4,492	5,201
通信費	56	68
印刷費	449	454
協会費	58	55
諸会費	18	35
情報機器関連費	3,815	4,473
その他営業雑経費	93	112
営業費用合計	27,696	31,622
一般管理費		
給料	5,976	6,295
役員報酬	214	249
給料・手当	4,861	5,072
賞与	901	972
退職給付費用	170	254
福利費	608	632
交際費	1	3
旅費交通費	13	20
租税公課	315	327
不動産賃借料	276	323
寄付金	3	5
減価償却費	748	989
業務委託費	966	1,081
諸経費	848	1,301
一般管理費合計	9,929	11,234
営業利益	10,984	11,147

（単位：百万円）

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

営業外収益		
受取利息	2	2
収益分配金	101	16
金銭の信託運用益	3,038	-
投資有価証券売却益	1	0
投資有価証券償還益	54	219
その他	45	8
営業外収益合計	3,243	247
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	332
投資有価証券売却損	0	0
投資有価証券償還損	0	-
為替差損	158	291
デリバティブ費用	3,782	1,191
その他	5	33
営業外費用合計	3,946	1,848
経常利益	10,281	9,545
特別損失		
退職給付費用	-	120
システム統合費用	110	-
特別損失合計	110	120
税引前当期純利益	10,170	9,425
法人税、住民税及び事業税	3,242	3,403
法人税等調整額	65	465
法人税等合計	3,177	2,937
当期純利益	6,993	6,487

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		

当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	-	3,136	3,330	3,330
当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098

	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	587	284	302	56,464
当期変動額				
剰余金の配当				3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,379	349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	349	1,029	4,360
当期末残高	791	65	726	60,824

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			2,797	2,797	2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	

当期首残高	791	65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	149	444	295	295
当期変動額合計	149	444	295	3,394
当期末残高	941	509	431	64,219

## 注記事項

### （重要な会計方針）

#### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

##### （1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

##### （2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

#### 2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

#### 3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

#### 4．固定資産の減価償却の方法

##### （1）有形固定資産

定額法によっております。

##### （2）無形固定資産

定額法によっております。

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

#### 5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

#### 6．引当金の計上基準

##### （1）賞与引当金

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

##### （2）退職給付引当金

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

過去勤務費用           ：発生事業年度に損益処理

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

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

#### 7．収益及び費用の計上基準

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

##### （1）投資信託委託業務

当社は、投資信託契約に基づき投資信託委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」という。）に応

じて手数料を受領しております。当該収益は、日次等契約で定められた時期に各ファンドのAUMに固定料率を乗じて計算され、契約期間にわたり認識されます。

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

8. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、翌事業年度より、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「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21日）を適用する予定であります。

(会計方針の変更)

1. 「収益認識に関する会計基準」等の適用

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

2. 「時価の算定に関する会計基準」等の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日）第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載していません。

（未適用の会計基準等）

「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）

（1）概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

（2）適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であり、

（追加情報）

退職給付債務及び費用の算定方法の変更

従来、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る事業年度末の自己都合要支給額を退職給付とする方法を用いた簡便法を適用しておりましたが、対象となる従業員数の増加に伴い、当事業年度より原則法による計算を併用しております。これにより、退職給付引当金が120百万円増加し、同額を退職給付費用として特別損失に計上しております。

なお、退職給付見込額の各期間への帰属方法などについては、「重要な会計方針6．引当金の計上基準（2）退職給付引当金」をご参照ください。

（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 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
建 物	106	百万円	146	百万円
器具備品	391	〃	535	〃
そ の 他	4	〃	-	〃
計	503	〃	681	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3．剰余金の配当に関する事項

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
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

4．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
2021年6月23日 定時株主総会	普通 株式	2,797	利益剰余金	932,488	2021年3月31日	2021年6月24日

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

#### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

#### 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

#### 3. 剰余金の配当に関する事項

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

#### 4. 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

2022年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

#### 1. 金融商品の状況に関する事項

##### （1）金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

##### （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。

これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針8．ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

#### 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

#### 資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払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。

## 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 2019年7月4日。以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した投資信託、市場価格のない株式等及び、時価算定適用指針第27項に従い経過措置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、\*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度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（2021年3月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）（*1）
金銭の信託	10,857
投資有価証券 その他有価証券	9,950
デリバティブ取引（*2）	
ヘッジ会計が適用されていないもの	(357)
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)
デリバティブ取引計	(431)

(\*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) 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（2022年3月31日）

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

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

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

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

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

#### 金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、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。

#### デリバティブ取引

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
投資有価証券	0	0
関係会社株式	5,636	5,636

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2021年3月31日）

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,589	-	-	-
未収委託者報酬	8,471	-	-	-
未収運用受託報酬	6,151	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	10	5,751	0

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

（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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
子会社株式	5,636	5,636

## 2．その他有価証券

前事業年度（2021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	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9	10	1
小計	9	10	1
合計	9,950	8,809	1,141

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
非上場株式	0	0
組合出資金等		133

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	109	1	0

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2021年3月31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)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	2,889	-	41	41
	英ポンド	128	-	0	0
	カナダドル	21	-	0	0
	スイスフラン	51	-	0	0
	香港ドル	128	-	1	1
	ユーロ	246	-	0	0
	買建				
	米ドル	99	-	1	1
	香港ドル	2	-	0	0
合計		3,567	-	41	41

（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

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	13,711	-	315	315
合計		13,711	-	315	315

（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

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式				
	米ドル		3,993	-	57	
	英ポンド		3,108	-	15	
	カナダドル		3	-	0	
	スイスフラン		57	-	0	
	香港ドル		110	-	1	
	ユーロ		108	-	0	
	人民元		6	-	0	
	買建					
	米ドル		38	-	0	
	香港ドル		3	-	0	
	人民元		1	-	0	
	合計		7,431	-	73	

当事業年度（2022年3月31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)	
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,498	-	54	
	英ポンド	277	-	1	
	カナダドル	111	-	1	
	スイスフラン	139	-	2	
	香港ドル	190	-	1	
	ユーロ	676	-	18	
	買建				
	ユーロ	21	-	0	
	合計	6,915	-	80	80

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(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	17,197	-	1,333
合計	17,197	-	1,333	1,333

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

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	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
--------------	----	---------	---------------	-------------------------	-------------

原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 関係会社株式			
	米ドル		4,422	-	43
	英ポンド		3,297	-	21
	スイスフラン		79	-	1
	香港ドル		119	-	1
	ユーロ		125	-	3
	人民元		13	-	0
合計			8,057	-	71

## (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。当社が有する退職一時金制度は従来簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しておりましたが、当事業年度より原則法と簡便法の併用により、これら計算を行っておりません。

## 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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
退職給付債務の期首残高	600		626	
勤務費用	-		124	
利息費用	-		2	
転籍者受入	18		-	
退職給付の支払額	69		81	
簡便法で計算した退職給付費用	77		8	
簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-		120	
その他	-		18	
退職給付債務の期末残高	626		820	

## (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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
非積立型制度の退職給付債務	626		820	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626		820	
退職給付引当金	626		820	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	626		820	

## (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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
勤務費用	-		124	
利息費用	-		2	
簡便法で計算した退職給付費用	77		8	

簡便法から原則法への変更に伴う振替額	-	120
その他	-	18
確定給付制度に係る退職給付費用	77	274

## (5) 年金資産に関する事項

該当事項はありません。

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
割引率	-		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92百万円、当事業年度100百万円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度		当事業年度	
	(2021年3月31日)		(2022年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	107	百万円	112	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	170	"	177	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	191	"	251	"
税務上の収益認識差額	71	"	74	"
税務上の費用認識差額	-		439	
繰延ヘッジ損益	28	"	224	"
その他	123	"	76	"
繰延税金資産 合計	693	"	1,357	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	349	"	415	"
その他	32	"	34	"
繰延税金負債 合計	382	"	450	"
繰延税金資産の純額	311	"	907	"

## 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。

## (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 2020年4月1日 至 2021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	9,649百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,372百万円

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

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

## 〔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 2020年4月1日 至 2021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	9,365	未収運用受託報酬	5,402
							投信販売代行手数料等	9,124	未払手数料	1,888

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

(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（2021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（2022年3月31日）

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

### (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1株当たり純資産額	20,274,967円09銭	21,406,512円22銭
1株当たり当期純利益金額	2,331,221円85銭	2,162,405円20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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 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

2022年12月28日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2022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） （2022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（2022年3月末日現在）

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

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

### 第3【その他】

- (1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。
- (2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。
- (3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。
- (6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

2022年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 藤 澤 孝

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第36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2022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

2022年12月9日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 松崎雅則  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDC日本株式インデックス・オープンの2021年10月1日から2022年9月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DC日本株式インデックス・オープンの2022年9月30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。