

# ステート・ストリート日本株式インデックス・オープン

追加型投信 / 国内 / 株式 / インデックス型

## 投資信託説明書 (請求目論見書)

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。  
課税上は株式投資信託として取扱われます。

2023年12月6日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

1. ステート・ストリート日本株式インデックス・オープンの受益権の募集については、発行者であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（委託会社）は金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第5条の規定により、有価証券届出書を2023年6月5日に関東財務局長に提出しており、2023年6月6日にその効力が発生しております。
2. この投資信託説明書（請求目論見書）は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書のうち、同法第15条第3項の規定に基づき投資者がファンドを取得する時までに投資者から請求があった場合に交付を行う目論見書です。
3. ステート・ストリート日本株式インデックス・オープンの受益権の価額は、同ファンドに組入れられている有価証券の値動きの影響を受けますが、運用による損益はすべて投資者の皆様に帰属します。
4. 当ファンドは元金が保証されているものではありません。

発行者名	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
代表者の役職氏名	代表取締役社長 高村 孝
本店の所在の場所	東京都港区虎ノ門一丁目23番1号
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	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】

ステート・ストリート日本株式インデックス・オープン  
(以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。)

### (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受益権です。

委託会社の依頼により、信用格付業者から提供もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供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、後述の「(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または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載また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。

### (3) 【発行（売出）価額の総額】

3兆円を上限とします。

### (4) 【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額<sup>\*</sup>とします。

収益分配金の再投資を行う場合は、原則として各計算期間終了日の基準価額とします。

※基準価額とは、信託財産の純資産総額を受益権総口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当たりの価額で表示されます。

基準価額は、販売会社（後記「(8) 申込取扱場所」をご参照ください。）にてご確認いただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「MA日本株」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

<照会先>

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03-4530-7333

(受付時間：原則として委託会社の営業日午前9時～午後5時)

ホームページアドレス：www.ssga.com/jp

### (5) 【申込手数料】

申込手数料はありません。

### (6) 【申込単位】

申込単位は、販売会社が定める単位とします。詳細については、販売会社にお問い合わせください。

### (7) 【申込期間】

2023年6月6日から2024年6月5日まで

※当該申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

販売会社の詳細については、前記「(4) 発行(売出) 価格」に記載の<照会先>までお問い合わせください。

(9) 【払込期日】

当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日(詳しくは、販売会社にお問い合わせください。)までに、取得申込代金を販売会社に支払うものとします。

各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込みを受付けた販売会社とします(前記「(8) 申込取扱場所」をご参照ください。)

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権の振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

(12) 【その他】

① 申込証拠金

該当事項はありません。

② 本邦以外の地域での発行

該当事項はありません。

③ 振替受益権について

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かかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(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したがって支払われます。

(参考)

◆投資信託振替制度とは

- ・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。
- ・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行われますので、受益証券は発行されません。

## 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】

- ① 当ファンドは、MA（マルチアセット）ファンドシリーズ<sup>※</sup>の一つであり、日本の取引所に上場されている株式を主要投資対象とした「日本株式インデックス・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券に投資することにより、中長期的にTOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。

※ MA（マルチアセット）ファンドシリーズとは、日本および海外の幅広い資産クラスを投資対象とし、各種指数に連動した投資成果を目指して運用を行う委託会社におけるインデックス型商品等の総称です。

- ② 委託会社は、受託会社と合意のうえ、1兆円を限度として信託金を追加できるものとします。また委託会社は、受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

- ③ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

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)	補足分類
単位型 追加型	国内 海外 内外	株式 債券 不動産投信 その他資産 ( ) 資産複合	インデックス型 特殊型

(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。

#### ■ 当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型	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います。
投資対象地域	国内	目論見書又は信託約款において、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います。
投資対象資産 (収益の源泉)	株式	目論見書又は信託約款において、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います。
補足分類	インデックス型	目論見書又は信託約款において、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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル		
	年2回	日本		
	年4回	北米		日経 225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	欧州	ファミリーファンド	
	年12回 (毎月)	アジア		TOPIX
	日々	オセアニア		
不動産投信		中南米	ファンド・オブ・ファンズ	
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))	その他 ( )	アフリカ		その他
資産複合 資産配分固定型 資産配分変動型		中近東 (中東)		
		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

■ 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産(投資信託証券(株式 一般))	目論見書又は信託約款において、株式、債券、不動産投資以外の資産に投資する旨の記載があるものをいい、括弧内の記載は、組入資産を表します。
決算頻度	年1回	目論見書又は信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	日本	目論見書又は信託約款において、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います。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書又は信託約款において、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います。
対象インデックス	TOPIX	信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。

※商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) をご覧ください。

#### ④ ファンドの特色

- 1 マザーファンドへの投資を通じて、日本の取引所に上場されている株式等に投資します。
- 2 当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。
  - ファミリーファンド方式については、「ファンドの仕組み」をご覧ください。
- 3 TOPIX(東証株価指数、配当込み)に連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
  - TOPIX(東証株価指数、配当込み)は、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、配当を考慮したものであり、当ファンドおよび投資対象とするマザーファンドの投資成果の比較基準となるベンチマークとします。

※資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

### 投資対象とするマザーファンドの概要

#### 日本株式インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	日本の取引所に上場されている株式
投資態度	・ TOPIX(東証株価指数、配当込み)をベンチマークとします。 ・ 株式の組入比率は、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。

※投資成果の比較基準となるベンチマークの騰落率は、オリジナル指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出します。

#### ベンチマーク

##### TOPIX(東証株価指数、配当込み)

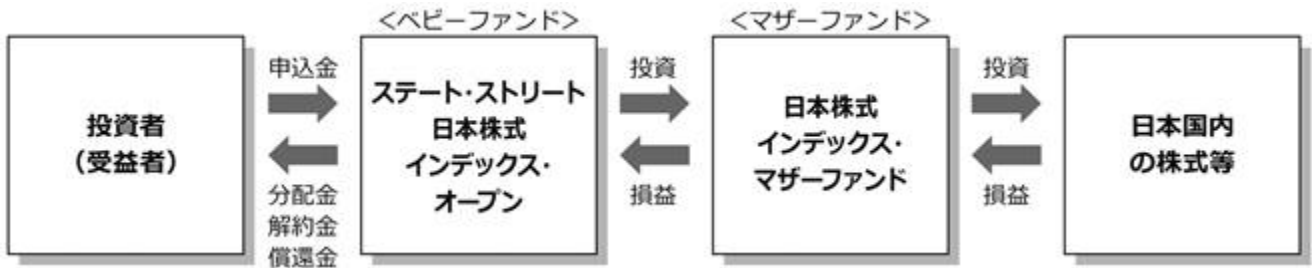
- ① TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」と言います。)の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利はJPXが有します。
- ② JPXは、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- ③ JPXは、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④ JPXは、TOPIXの指数値およ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、JPXは、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤ 当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥ JPXは、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。
- ⑦ JPXは、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社または当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- ⑧ 上記に限らず、JPXは当ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

(2) 【ファンドの沿革】

2016年5月9日 信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

- ① 当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。「ファミリーファンド方式」とは、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金をマザーファンドの受益証券に投資して、その実質的な運用を行う仕組みです。また、マザーファンドの損益はすべてベビーファンドに還元されます。



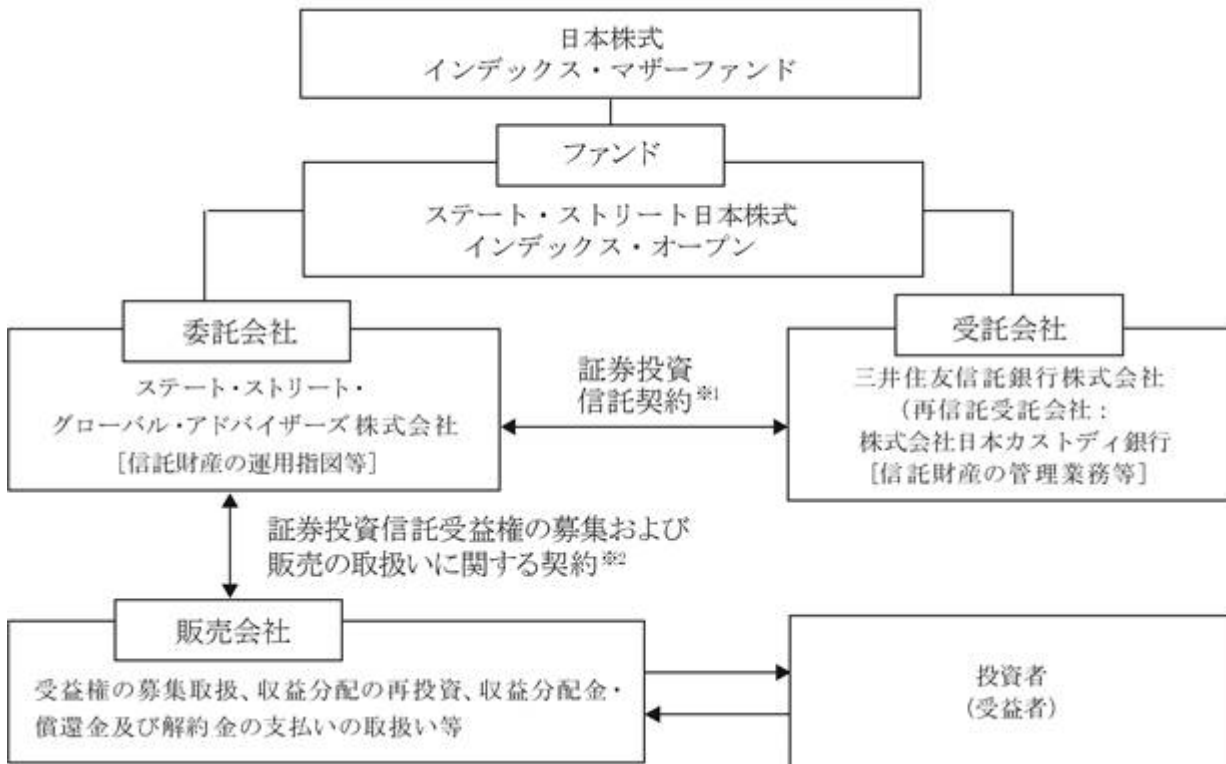
② ファンドの関係法人

ファンドの関係法人は以下のとおりです。

- 1) ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（以下「委託会社」といいます。）  
委託会社は、信託財産の運用指図、目論見書および運用報告書の作成等を行います。
- 2) 三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）  
(再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行)  
受託会社は、信託財産の管理業務、信託財産の計算等を行います。また、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。
- 3) 販売会社  
販売会社は、受益権の募集の取扱い、販売、一部解約の実行の請求の受付けならびに収益分配金、一部解約代金および償還金の支払い等を行います。



## ファンド関係法人



### ※1 証券投資信託契約

委託会社、受託会社および受益者に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益権に関する事項ならびに信託の元本および収益の管理ならび運営に関する事項等が定められます。

なお、ファンドは、委託会社と受託会社とが証券投資信託契約を締結することにより成立します。証券投資信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づき、あらかじめ監督官庁に届け出た信託約款の内容に基づいて締結されます。

### ※2 証券投資信託受益権の募集および販売の取扱いに関する契約

販売会社の募集の取扱い、換金の取扱い、償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められます。

## ③ 委託会社の概況（本書提出日現在）

### 1) 資本金の額

3億1千万円

### 2) 沿革

1998年 2 月25日	ステート・ストリート投資顧問株式会社 設立
1998年 3 月31日	投資顧問業の登録
1998年 8 月28日	ステート・ストリート投信投資顧問株式会社に商号変更
1998年 9 月30日	投資一任契約に係る業務の認可
1998年 9 月30日	証券投資信託の委託会社としての認可取得
2007年 9 月30日	金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第345号）
2008年 7 月 1日	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社に商号変更

### 3) 大株主の状況

氏名又は名称	住所	所有株式数	所有比率
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ジャパン・ホールディングス合同会社	東京都港区虎ノ門一丁目23番1号虎ノ門ヒルズ森タワー	6,200株	100%

## 2 【投資方針】

### (1) 【投資方針】

当ファンドは、マザーファンド受益証券に投資することにより、中長期的にTOPIX（東証株価指数、配当込み）に連動した投資成果を目指して運用を行うことを基本とします。

マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

投資状況に応じ、マザーファンドと同様の運用を直接行うことがあります。

- ①TOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとします。
- ②マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持するものとし、株式への実質的投資割合は、原則として信託財産総額の50%超（非株式割合は50%以下）を基本とします。
- ③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および為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記（5）②の3)4)5)に定めるものに限り、以下同じ。）を行うことができます。
- ④信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。
- ⑤信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。
- ⑥信託財産の効率的な運用に資するため等、運用上必要と認めるときには、委託会社もしくは委託会社の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）が設定または運用する国内投資信託証券等に投資する場合があります。
- ⑦大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が行われない場合や、当ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

### (2) 【投資対象】

#### ① 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1) 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

- (a) 有価証券
- (b) デリバティブ取引に係る権利
- (c) 金銭債権
- (d) 約束手形

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

- (a) 為替手形

#### ② 投資の対象とする有価証券の指図範囲等

委託会社は、信託金を、主としてステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社を委託会社とし、三井住友信託銀行株式会社を受託会社として締結された「日本株式インデックス・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下「マザーファンド受益証券」といいます。）および次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します（信託約款第15条第1項）。

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券

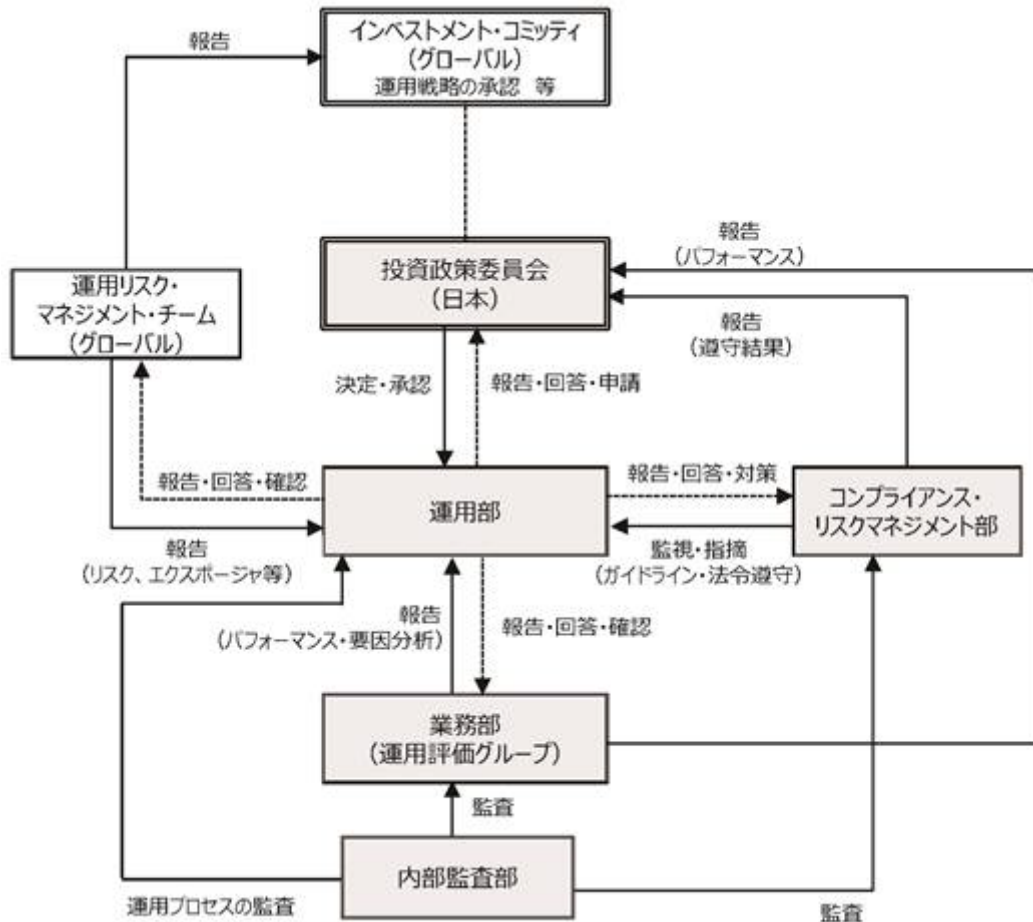
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券(金融商品取引法第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、1)から11)までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 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) 貸付債権信託受益権であつ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
- 20) 外国の者に対する権利で19)の有価証券の性質を有するもの
- 21) 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。)
- 22) 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。)

なお、1)の証券または証書、12)および17)の証券または証書のうち1)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、2)から6)までの証券ならびに12)および17)の証券または証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13)の証券および14)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- ③ 委託会社は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品により運用することを指図することができます(信託約款第15条第2項)。
  - 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
- ④ 上記②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、上記③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(信託約款第15条第3項)。

- ⑤ 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券（取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。以下同じ。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。（信託約款第15条第4項）
- ⑥ 上記⑤において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。（信託約款第15条第5項）

(3) 【運用体制】



委託会社において、運用部の各ファンド担当者がそのポートフォリオ管理・運用を行っています。運用モデル／プロセスは基本的に、グループ会社、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・トラスト・カンパニー（所在地：アメリカ合衆国マサチューセッツ州ボストン市）を中心とした各運用戦略グループ全体で共通のものを使用し、またモデルの改善、運用パフォーマンス、市場環境に関する情報などについて海外運用拠点と十分なコミュニケーションをとることによって、質の高い運用サービスの提供を目指しています。

ファンド担当者は、いずれも国内外の有価証券市場に精通した経験豊富な投資運用の専門家であり、資産クラス・運用戦略ごとの運用チームに配置されています。また、チーム・アプローチによって運用を行うため、特定の担当者に依存することない安定した運用体制となっています。

運用の報告は、投資政策委員会に対してなされます。投資政策委員会は、チーフ・インベストメント・オフィサー、各運用戦略責任者、業務部の代表等により構成されています。投資政策委員会においては、各ファンドのパフォーマンス、ガイドラインに対する適合性、同一戦略のファンド間でのパフォーマンスの乖離状況等の報告を受けます。

グローバルには、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ (SSGA) のグローバル組織である運用リスク・マネジメント・チームが、ポートフォリオの運用リスクモニタリングを定期的に行っています。当チームは運用チームとは独立した組織で、SSGAグローバルのチーフ・リスク・オフィサーに直接報告を行っており、ポートフォリオが顧客のガイドラインや運用戦略に即したリスクをとっているか、また目標リターンに見合ったリスクをとっているか、リスクに対する寄与が意図したエクスポージャーによるものか否か等、運用戦略の中身に実質的にフォーカスしたかたちでモニタリングを行い、その結果は継続的に運用担当チームにフィードバックされています。

当チームが行った戦略代表口座の分析結果は、インベストメント・コミッティ（グローバル）およびグローバルの運用戦略責任者によってレビューされています。

上記運用体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### (4) 【分配方針】

毎決算時（原則として3月5日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

##### ① 分配対象額の範囲

経費控除後の利子・配当収入および売買益（評価益を含みます。）等全額とします。

##### ② 分配対象収益についての分配方針

分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないこともあります。

##### ③ 留保益の運用方針

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。

なお、上記は収益分配方針であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

#### <収益分配金に関する留意事項>

- ・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および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

#### (5) 【投資制限】

##### ① 信託約款の「運用の基本方針」に定める投資制限

- 1) マザーファンド受益証券の投資割合には制限を設けません。
- 2) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）の実質投資割合には制限を設けません。
- 3) 原則として、外貨建資産への実質投資は行いません（外貨建資産割合は0%）。
- 4) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）の実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

- 5) デリバティブ取引は、後記②の3)4)5)の範囲で行います。
- 6) 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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、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従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## ② 信託約款上のその他の投資制限

### 1) 投資する株式等の範囲(信託約款第18条)

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、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、または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（上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものを含みます。）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。

### 2) 信用取引の指図範囲(信託約款第19条)

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができますものとし、
- (b) 上記(a)の信用取引の指図にあたっては、当該売り付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売り付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、
- (c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の売り付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとし、
- (d) 上記(b)においてマザーファンドの信託財産に属する当該売り付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売り付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (e) 委託会社は、上記(a)の取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとし、

### 3) 先物取引等の運用指図(信託約款第20条)

- (a) 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。）を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとし、（以下同じ。）。)
- (b) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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金利に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

### 4) スワップ取引の運用指図(信託約款第21条)

- (a) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

- (b) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
  - (c) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち当該信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとし、なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少してスワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部解約を指図するものとし、
  - (d) 上記(c)においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
  - (e) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとし、
  - (f) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとし、
- 5) 金利先渡取引の運用指図(信託約款第22条)
- (a) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
  - (b) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
  - (c) 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとし、
  - (d) 委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとし、
- 6) デリバティブ取引等にかかる投資制限(信託約款第23条)
- 委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
- 7) 有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款第24条)
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券を貸付けることの指図をすることができます。
  - (b) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとし、
- 8) 公社債の空売りの指図範囲(信託約款第25条)
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）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るものとし、
  - (b) 上記(a)の売り付けの指図にあたっては、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とし、
  - (c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相

当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

9) 公社債の借入れ(信託約款第26条)

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (b) 上記(a)の指図にあたっては、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (d) 上記(a)の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

③ 法令に基づく投資制限

1) 同一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第9条）

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すべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に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、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

2) デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

（参考）「日本株式インデックス・マザーファンド」の概要

当ファンドが主たる投資対象とする「日本株式インデックス・マザーファンド」の概要は、以下の通りです。

(1) 投資方針

この投資信託は、中長期的な観点から、TOPIX（東証株価指数、配当込み）に連動した投資成果を目指して運用を行います。

日本の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

- ① TOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとします。
- ② 株式の組入比率は、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。
- ③ 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、投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）の指図をすることができます。



- ④ 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、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、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- ⑤ 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、投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ⑥ 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。
- ⑦ 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむをえない事情が発生した場合には、上記のような運用が行われない場合や、当ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

## （2）投資対象

### ① 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - (a) 有価証券
  - (b) デリバティブ取引に係る権利
  - (c) 金銭債権
  - (d) 約束手形
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
  - (a) 為替手形

### ② 投資の対象とする有価証券の指図範囲等

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）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券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券（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) 特定目的会社に係る優先出資証券（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) 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。）

- 13) 投資証券もしくは投資法人債券（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。）
- 14) 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せん。）
- 15) 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。）
- 16) 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
- 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
- 18) 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。）

なお、1) の証券または証書、15) の証書のうち1) 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、2) から6) までの証券、15) の証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、12) の証券および13) の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- ③ 委託会社は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）
  - 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
- ④ 上記②の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、上記③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。
- ⑤ 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑥ 委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

### (3) 主な投資制限

- ① 株式への投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資は行いません。
- ③ 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④ 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤ 信用取引の指図は、信託約款第15条の範囲で行います。
- ⑥ 有価証券先物取引等は、信託約款第16条の範囲で行います。
- ⑦ スワップ取引は、信託約款第17条の範囲で行います。
- ⑧ 金利先渡取引は、信託約款第18条の範囲で行います。
- ⑨ 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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、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従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ⑩ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、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、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

### 3 【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク特性

当ファンドは、主にマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本の株式に分散投資を行います。主として以下に掲げる要因等により基準価額が大きく変動する場合があります。その運用成果（損益）はすべて投資者の皆さまに帰属します。

したがって、投資者の皆さまの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。

なお、投資信託は預貯金とは異なります。

当ファンドの主なリスクおよび留意点は以下のとおりですが、当ファンドのリスクおよび留意点を完全に網羅しておりませんのでご注意ください。また、ファンドのリスクは以下に限定されるものではありません。

#### ① 株価変動リスク

株式の価格は、一般に個々の企業の活動および業績、経営方針、ならびに法令順守の状況等に反応して変動するほか、投資対象国の経済情勢および景気見通し、ならびに法令順守の状況等に反応して変動するほか、投資対象国の経済情勢および景気見通し、ならびに金利変動、為替相場およびそれらの見通し等にも反応して変動します。したがって、マザーファンドに組み入れられる株式の価格は短期的または長期的に下落する可能性があります。

#### ② 信用リスク

当ファンドは、日本の株式を実質的な投資対象としていることから、株式の発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ることがあります。したがって、このような状態が生じた場合には、当ファンドが実質的に保有する株式の価格が下落し、基準価額が下落する要因となります。

なお、当ファンドの資産をコール・ローン、譲渡性預金等の短期金融商品で運用する場合（マザーファンドへの投資を通じて実質的に運用する場合を含む）にも、債務不履行などにより損失が発生することがあります。運用資産の規模等によっては、当ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。また、金融商品取引の相手方や受託会社の決済不履行または債務不履行等により損失を被ることがあります。

#### ③ 流動性リスク

投資対象となる有価証券の市場規模や取引量が少ない状況や解約資金を手当てするために実質的に保有する有価証券を大量に売却しなければならない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

また、解約資金の手当てが間に合わず、売却した有価証券等の売却代金回収までの期間、一時的に当ファンドで資金借入を行うことによって解約金の支払いに対応する場合があります。その場合の借入金利は当ファンドが負担することになります。

#### ④ デリバティブ取引のリスク

先物・スワップ取引等のデリバティブ取引を用いた投資手法は運用の効率を高めるため、または証券価格、市場金利、為替等の変動による当ファンドおよびマザーファンドへの影響を低減するために用いられますが、デリバティブ取引は必ず用いられるわけではなく、また用いられたとしても本来の目的を達成できる保証はありません。

⑤ パッシブ運用のリスク

当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドはパッシブ運用を採用しています。パッシブ運用とは、ベンチマークとするインデックスと連動する投資成果を目指す運用手法であり、ファンド・マネージャーが経済情勢、市場分析等に基づき個別銘柄の売買を行うことによりインデックスを上回る投資成果を目指すアクティブ運用とは異なります。

マザーファンドは、投資成果をインデックスにできるだけ連動させるため、原則としてポートフォリオにおける時価構成をインデックスにおける銘柄別時価構成比に近づけるように投資対象銘柄の売買を行います。ただし、インデックス採用銘柄の変更や資本異動等によりポートフォリオの調整が行われる場合等、個別銘柄の売買等にあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があるため、基準価額の変動率がインデックスの変動率に一致せず、ファンドの投資成果がインデックスの投資成果に連動しない場合があります。また、インデックス採用銘柄の売買停止等の理由により当該銘柄に投資できない場合、インデックスの投資成果に連動させるため、インデックス採用銘柄以外の銘柄に投資する場合があります。

⑥ ファミリーファンド方式のリスク

当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のファンド（ベビーファンド）に追加設定・解約等に伴う資金変動等があり、その結果、当該マザーファンドにおいて有価証券の売買等が行われた場合等には、その売買による組入有価証券等の価格の変化や売買手数料等の負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあり、これにより、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

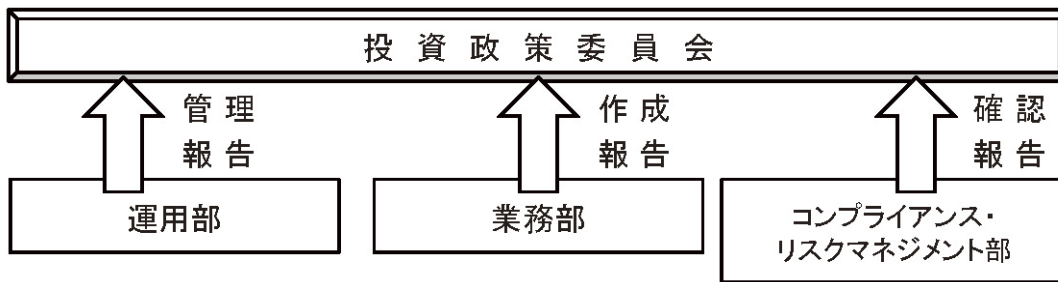
(2) その他の留意点

当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。

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や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、換金の申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

(3) リスク管理体制



運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは信託約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行います。

業務部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率と対ベンチマーク超過リターンの算出と要因分析を行います。

コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しております。

投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をします。

委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行います。

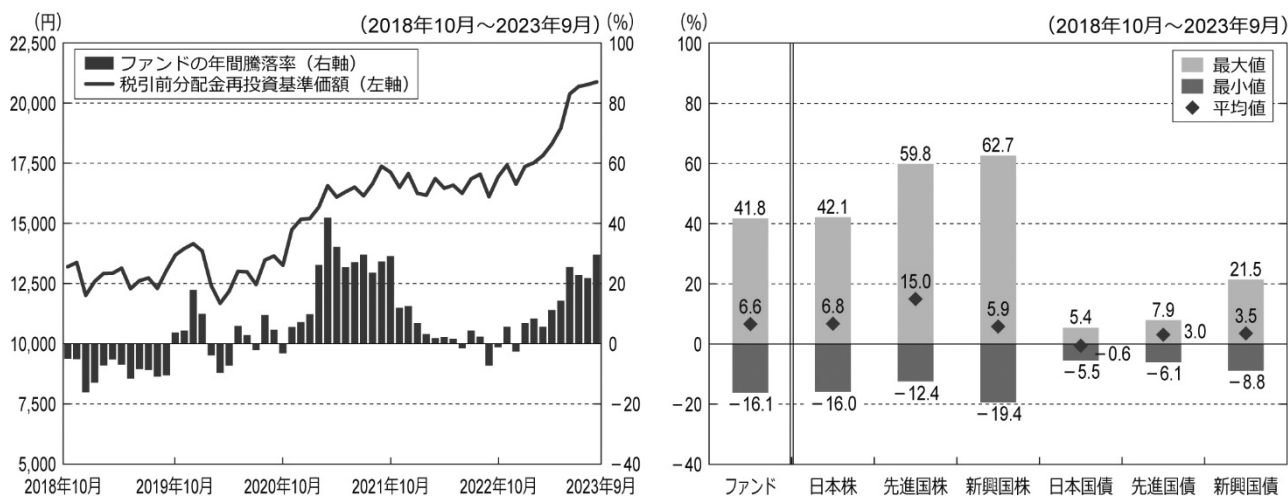
取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

上記リスクに対する管理体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## ＜参考情報＞代表的な資産クラスと騰落率の比較等

投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

＜ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移＞    ＜ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較＞



- ・上記の左グラフは、各月末におけるファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。
  - ・分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算していますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
  - ・年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
  - ・ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を分配時に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。
  - ・上記の右グラフは、ファンドと代表的な資産クラスについて、上記記載の5年間の年間騰落率の平均値・最大値・最小値を表示しています。
  - ・代表的な資産クラスの全てが当ファンドの投資対象とは限りません。また、海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して円換算しています。
- ※上記のグラフは過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

## 「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

### 日本株:TOPIX(東証株価指数、配当込み)

TOPIX(東証株価指数、配当込み)は、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、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。

### 先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

### 新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

### 日本国債:NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、同指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。

### 先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

### 新興国債:JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)は、J.P.Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

#### 4 【手数料等及び税金】

##### (1) 【申込手数料】

申込手数料はありません。

##### (2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

##### (3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、日々のファンドの純資産総額に年率0.088%（税抜0.08%）の信託報酬率を乗じて得た額とします。

ファンドの信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末（当日が休業日の場合は翌営業日とします。）または信託終了のときに信託財産中から支払います。

< 信託報酬率の配分（税抜） >

支払先	信託報酬率（年率）	役務の内容
委託会社	0.04%	委託した資金の運用、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	0.01%	交付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	0.03%	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

※消費税等相当額は、消費税および地方消費税に相当する金額です。

##### (4) 【その他の手数料等】

- ① 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ② 信託財産に係る監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末（ただし、当日が休業日の場合は翌営業日とします。）または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- ③ 上記①に定める信託事務の処理等に要する諸費用は、マザーファンドに関連して生じた諸費用のうちマザーファンドにおいて負担せずかつ委託会社の合理的判断によりこの信託に関連して生じたと認めるものを含みます。
- ④ ファンドの組入れ有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等は、信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料に対する消費税等相当額および先物取引、オプション取引等に要する費用についても信託財産が負担します。  
信託財産において資金借入れを行った場合、当該借入金の利息は、信託財産中より支弁します。

上記のほか、信託約款の規定に基づく運用指図等により生じた費用をご負担いただく場合があります。

その他の手数料等は、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することはできません。

※上記（1）～（4）の当該手数料等の合計額については、投資者の皆さまがファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することはできません。

## (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、日本の居住者（法人を含みます。）である受益者については、以下のような取扱いとなります。なお、税制が改正された場合には、その内容が変更されることがあります。

### ■個人、法人別の課税について■

#### ◆個人の投資者に対する課税

##### <収益分配金に対する課税>

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。

なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税（配当控除の適用は可能です。）のいずれかを選択することもできます。

##### <換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税>

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、確定申告等により、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択した場合に限ります。）との損益通算が可能です。また、換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択した場合に限ります。）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

※税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

#### ※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度です。

NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となりますが、2024年1月1日以降は、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

また、2024年1月1日以降は、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### ◆法人の投資者に対する課税

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%）の税率で源泉徴収※が行われます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

※源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

##### <注1>個別元本について

- ① 投資者ごとの信託時の受益権の価額等が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。
- ② 投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行うつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。  
ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。



③ 投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

<注2>収益分配金の課税について

- ① 追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
- ② 投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※上記は、2023年9月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

※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】

### (1)【投資状況】

(2023年9月29日現在)

種類	国/地域名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	13,550,879,180	100.00
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		603,200	0.00
純資産総額		13,551,482,380	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

#### <参考情報>

親投資信託受益証券 (日本株式インデックス・マザーファンド)

(2023年9月29日現在)

種類	国/地域名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	52,458,819,210	96.32
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		2,002,539,232	3.68
純資産総額		54,461,358,442	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

### (2)【投資資産】

#### ①【投資有価証券の主要銘柄】

(2023年9月29日現在)

順位	国/地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
1	日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックス・マザーファンド	—	3,144,347,313	3.7274	11,720,240,175	4.3096	13,550,879,180	100.00

(注1) 投資有価証券は1銘柄です。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	—	100.00
合計		100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

#### ②【投資不動産物件】

該当する事項はありません。

#### ③【その他投資資産の主要なもの】

該当する事項はありません。

#### <参考情報>

親投資信託受益証券 (日本株式インデックス・マザーファンド)

#### ①投資有価証券の主要銘柄 (上位30銘柄)

(2023年9月29日現在)

順位	国/地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	875,000	1,906.87	1,668,511,250	2,677.50	2,342,812,500	4.30
2	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	112,700	11,844.07	1,334,826,689	12,240.00	1,379,448,000	2.53
3	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	982,900	973.07	956,430,503	1,268.50	1,246,808,650	2.29

4	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	5,119,300	159.16	814,787,788	176.60	904,068,380	1.66
5	日本	株式	キーエンス	電気機器	15,900	60,984.33	969,650,847	55,500.00	882,450,000	1.62
6	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	111,500	6,056.00	675,244,000	7,347.00	819,190,500	1.50
7	日本	株式	三菱商事	卸売業	102,800	5,035.68	517,667,904	7,128.00	732,758,400	1.35
8	日本	株式	日立製作所	電気機器	78,300	7,177.63	562,008,429	9,275.00	726,232,500	1.33
9	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	33,700	16,213.35	546,389,895	20,440.00	688,828,000	1.26
10	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	141,400	4,276.16	604,649,024	4,641.00	656,237,400	1.20
11	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	388,500	1,207.10	468,958,350	1,682.00	653,457,000	1.20
12	日本	株式	三井物産	卸売業	118,000	4,223.78	498,406,040	5,423.00	639,914,000	1.17
13	日本	株式	任天堂	その他製品	100,600	5,182.46	521,355,476	6,230.00	626,738,000	1.15
14	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	226,900	2,153.85	488,708,565	2,541.00	576,552,900	1.06
15	日本	株式	信越化学工業	化学	132,700	4,057.46	538,424,942	4,343.00	576,316,100	1.06
16	日本	株式	第一三共	医薬品	139,200	4,429.91	616,643,472	4,106.00	571,555,200	1.05
17	日本	株式	KDDI	情報・通信業	123,500	4,052.68	500,505,980	4,577.00	565,259,500	1.04
18	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	103,900	4,307.69	447,568,991	5,406.00	561,683,400	1.03
19	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	121,300	3,694.66	448,162,258	4,609.00	559,071,700	1.03
20	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	155,100	2,869.04	444,988,104	3,465.00	537,421,500	0.99
21	日本	株式	HOYA	精密機器	33,800	14,110.27	476,927,126	15,325.00	517,985,000	0.95
22	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	78,800	5,713.05	450,188,340	6,335.00	499,198,000	0.92
23	日本	株式	ダイキン工業	機械	19,200	23,754.06	456,077,952	23,475.00	450,720,000	0.83
24	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	256,800	1,541.07	395,746,776	1,690.50	434,120,400	0.80
25	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	86,700	4,297.86	372,624,462	4,909.00	425,610,300	0.78
26	日本	株式	村田製作所	電気機器	144,900	2,555.34	370,269,732	2,734.00	396,156,600	0.73
27	日本	株式	SMC	機械	5,200	72,775.57	378,432,964	66,980.00	348,296,000	0.64
28	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	58,100	6,268.57	364,203,917	5,855.00	340,175,500	0.62
29	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	95,300	2,758.50	262,885,050	3,440.00	327,832,000	0.60
30	日本	株式	パナソニックホールディングス	電気機器	190,000	1,215.20	230,888,000	1,682.00	319,580,000	0.59

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率 (%)
株式	電気機器	16.00
	輸送用機器	8.53
	情報・通信業	7.75
	銀行業	6.87
	卸売業	6.56
	化学	5.58
	機械	5.15
	医薬品	4.91
	サービス業	4.55
	小売業	4.18
	食料品	3.28
	陸運業	2.81
	保険業	2.34
	精密機器	2.20
	その他製品	2.17
	建設業	2.07
	不動産業	1.87
電気・ガス業	1.34	

その他金融業	1.17
鉄鋼	0.97
証券、商品先物取引業	0.76
ゴム製品	0.69
ガラス・土石製品	0.65
海運業	0.65
非鉄金属	0.63
金属製品	0.49
石油・石炭製品	0.48
空運業	0.46
繊維製品	0.41
鉱業	0.39
パルプ・紙	0.18
倉庫・運輸関連業	0.14
水産・農林業	0.09
合 計	96.32

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

②投資不動産物件

該当する事項はありません。

③その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所等	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	TOPIX (先物) (2023年12月限)	大阪取引所	買建	79	1,857,644,640	1,835,565,000	3.37

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該取引の評価金額の比率です。

(注2) 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

(注3) 先物取引の評価においては、原則として主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

(3) 【運用実績】

①【純資産の推移】

2023年9月29日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

計算期間・月末		純資産総額 (円)		1口当たりの 純資産額 (円)	
第1期	(2017年 3月 6日)	分配付 :	1,118,764,958	分配付 :	1.2006
		分配落 :	1,116,901,209	分配落 :	1.1986
第2期	(2018年 3月 5日)	分配付 :	3,995,344,822	分配付 :	1.3319
		分配落 :	3,995,344,822	分配落 :	1.3319
第3期	(2019年 3月 5日)	分配付 :	5,341,336,327	分配付 :	1.2988
		分配落 :	5,341,336,327	分配落 :	1.2988
第4期	(2020年 3月 5日)	分配付 :	6,210,067,318	分配付 :	1.2444
		分配落 :	6,210,067,318	分配落 :	1.2444
第5期	(2021年 3月 5日)	分配付 :	9,285,116,835	分配付 :	1.5910
		分配落 :	9,285,116,835	分配落 :	1.5910
第6期	(2022年 3月 7日)	分配付 :	12,650,001,548	分配付 :	1.5347
		分配落 :	12,650,001,548	分配落 :	1.5347

第7期	(2023年 3月 6日)	分配付： 12,213,219,047 分配落： 12,213,219,047	分配付： 1.7869 分配落： 1.7869
	2022年 9月末日	12,622,713,395	1.6081
	10月末日	13,179,529,189	1.6897
	11月末日	13,539,349,612	1.7394
	12月末日	11,915,861,727	1.6597
	2023年 1月末日	11,971,796,559	1.7329
	2月末日	11,972,508,300	1.7491
	3月末日	11,938,185,900	1.7786
	4月末日	12,035,039,016	1.8264
	5月末日	12,200,724,327	1.8919
	6月末日	12,557,082,661	2.0346
	7月末日	13,516,462,332	2.0647
	8月末日	13,621,692,232	2.0731
	9月末日	13,551,482,380	2.0837

② 【分配の推移】

	計算期間	一口当たりの分配金
第1期	自2016年 5月 9日 至2017年 3月 6日	0.0020円
第2期	自2017年 3月 7日 至2018年 3月 5日	0.0000円
第3期	自2018年 3月 6日 至2019年 3月 5日	0.0000円
第4期	自2019年 3月 6日 至2020年 3月 5日	0.0000円
第5期	自2020年 3月 6日 至2021年 3月 5日	0.0000円
第6期	自2021年 3月 6日 至2022年 3月 7日	0.0000円
第7期	自2022年 3月 8日 至2023年 3月 6日	0.0000円

③ 【収益率の推移】

	計算期間	収益率
第1期	自2016年 5月 9日 至2017年 3月 6日	20.1%
第2期	自2017年 3月 7日 至2018年 3月 5日	11.1%
第3期	自2018年 3月 6日 至2019年 3月 5日	△2.5%
第4期	自2019年 3月 6日 至2020年 3月 5日	△4.2%
第5期	自2020年 3月 6日 至2021年 3月 5日	27.9%
第6期	自2021年 3月 6日 至2022年 3月 7日	△3.5%
第7期	自2022年 3月 8日 至2023年 3月 6日	16.4%

	自2023年 3月 7日 至2023年 9月 6日	19.0%
--	------------------------------	-------

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末の分配落基準価額（設定時は当初元本額）を控除した額を、前期末の分配落基準価額（同）で除して得た数に100を乗じて得た数です。

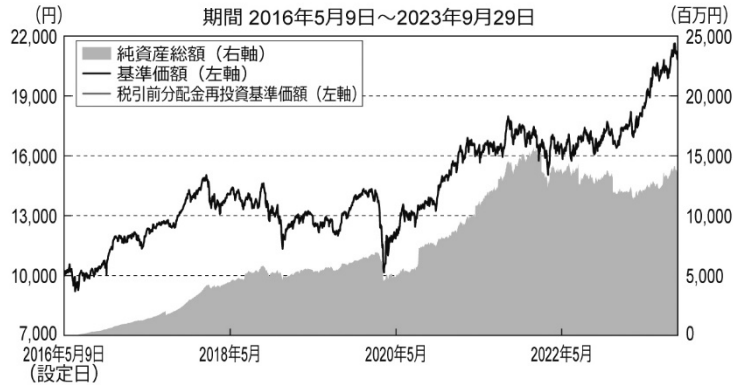
(4) 【設定及び解約の実績】

	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第1期	自2016年 5月 9日 至2017年 3月 6日	1,097,585,702	165,710,844	931,874,858
第2期	自2017年 3月 7日 至2018年 3月 5日	2,989,270,154	921,318,659	2,999,826,353
第3期	自2018年 3月 6日 至2019年 3月 5日	2,748,295,843	1,635,702,002	4,112,420,194
第4期	自2019年 3月 6日 至2020年 3月 5日	2,803,938,166	1,925,883,127	4,990,475,233
第5期	自2020年 3月 6日 至2021年 3月 5日	4,249,133,906	3,403,409,841	5,836,199,298
第6期	自2021年 3月 6日 至2022年 3月 7日	5,432,894,442	3,026,587,716	8,242,506,024
第7期	自2022年 3月 8日 至2023年 3月 6日	2,307,955,686	3,715,667,036	6,834,794,674
	自2023年 3月 7日 至2023年 9月 6日	1,074,617,971	1,360,744,710	6,548,667,935

(注1) 日本国外における設定、解約はありません。

(注2) 第1期の設定口数は、当初募集期間の設定口数を含みます。

## 基準価額・純資産の推移



※基準価額の計算において信託報酬は控除しています。分配金再投資基準価額は税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算したものです。

### <基準価額・純資産総額>

基準価額	20,837円
純資産総額	13,551百万円

### 分配の推移

決算期	分配金
第3期 (2019年3月5日)	0円
第4期 (2020年3月5日)	0円
第5期 (2021年3月5日)	0円
第6期 (2022年3月7日)	0円
第7期 (2023年3月6日)	0円
設定来累計	20円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

## 主要な資産の状況

(マザーファンドのデータを表示しています。)

### <銘柄別投資比率>

	国/地域名	種類	銘柄名	投資比率
1	日本	株式	トヨタ自動車	4.30%
2	日本	株式	ソニーグループ	2.53%
3	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.29%
4	日本	株式	日本電信電話	1.66%
5	日本	株式	キーエンス	1.62%
6	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	1.50%
7	日本	株式	三菱商事	1.35%
8	日本	株式	日立製作所	1.33%
9	日本	株式	東京エレクトロン	1.26%
10	日本	株式	武田薬品工業	1.20%

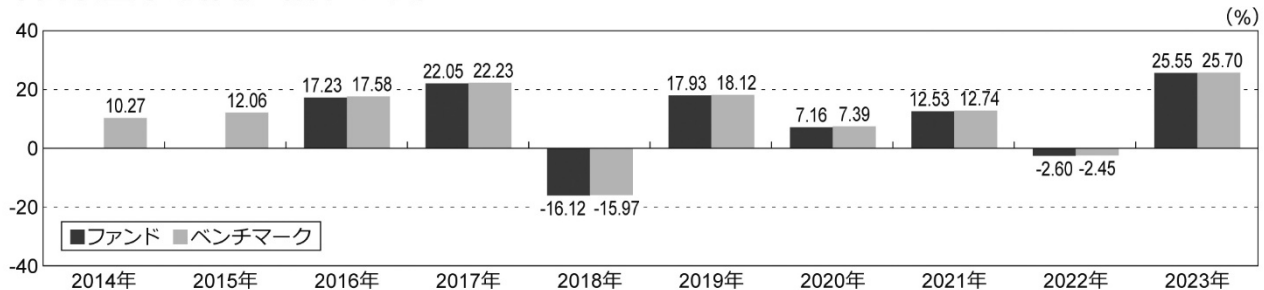
(注) 投資比率は、マザーファンド純資産総額に対する各評価金額の比率で、上位10銘柄について記載しています。

### <業種別投資比率>

	業種	投資比率
1	電気機器	16.00%
2	輸送用機器	8.53%
3	情報・通信業	7.75%
4	銀行業	6.87%
5	卸売業	6.56%
6	化学	5.58%
7	機械	5.15%
8	医薬品	4.91%
9	サービス業	4.55%
10	小売業	4.18%

(注) 投資比率は、マザーファンド純資産総額に対する各評価金額の比率で、上位10業種について記載しています。

## 年間収益率の推移 (暦年ベース)



※2016年のファンドとベンチマークの年間収益率は設定日から年末までで算出しています。

※2023年のファンドとベンチマークの年間収益率は年初から9月末までで算出しています。

※年間収益率の推移は、税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

- 上記の運用実績は、過去の実績であり将来の成果を保証するものではありません。
- 上記のベンチマークの情報は参考情報です。
- 最新の運用実績は委託会社のホームページ、または販売会社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】

- 1) 当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社に所定の方法で取引口座を開設のうえ、当ファンドの取得申込みを行ってください。
- 2) 当ファンドには、「分配金再投資コース」と「分配金受取コース」があります。なお、取扱い可能なコースおよびコース名については異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。その際、「分配金再投資コース」をお申し込みいただく方は、ご購入に際して、当ファンドに係る「自動けいぞく投資契約」（別の名称で同様の内容を有する契約を含みます。）を販売会社との間で結んでいただきます。ただし、「分配金再投資コース」を申し込まれた場合でも、分配金を定期的に受け取る旨の契約を締結することもできます。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- 3) 当ファンドの取得申込みの申込受付締切時間は、原則として販売会社の営業日の午後3時までとし、この受付時刻を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。
- 4) 申込単位（購入単位）は、販売会社が定める単位にて受付けます。
- 5) 取得申込価額（購入価額）は、取得申込受付日の基準価額です。基準価額は、販売会社または委託会社においてご確認いただけます。基準価額の照会方法については、後記「3 資産管理等の概要（1）資産の評価 3）基準価額の公表」をご参照ください。
- 6) 取得申込代金（購入代金）は、購入価額に取得申込の口数を乗じて得た金額に申込手数料（購入時手数料）および当該手数料に係る消費税等相当額を加えた金額です。
- 7) 購入代金は販売会社が定める期日までにお支払いください。
- 8) 購入時手数料は前記「4 手数料等及び税金（1）申込手数料」をご参照ください。
- 9) 購入申込不可日はありません。
- 10) 取引所における取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更、クーデター等政変、テロリズム、戦争、天災地変等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）があるときは、委託会社の判断により、受益権の取得申込の受付を中止することおよび既に受付けた受益権の取得申込の受け取りを取り消すことがあります。
- 11) 当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社に取得申込と同時にまたはあらかじめ、当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。販売会社は、当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

### 2【換金（解約）手続等】

- 1) 受益者（当ファンドの受益権を取得した者）は、自己に帰属する受益権につき、取得申込みを行った販売会社を通じ、委託会社に一部解約の実行の請求を行うことにより、当ファンドを換金することができます。
- 2) 当ファンドの換金申込みの申込受付締切時間は、原則として販売会社の営業日の午後3時までとし、この受付時刻を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。
- 3) 解約単位（換金単位）は、販売会社が定める単位にて受付けます。
- 4) 解約価額（換金価額）は、換金申込受付日の基準価額です。換金価額は、販売会社または委託会社においてご確認いただけます。換金価額の照会方法については、後記「3 資産管理等の概要（1）資産の評価 3）基準価額の公表」をご参照ください。
- 5) 信託財産留保額ははありません。
- 6) 換金代金（換金価額に換金する口数を乗じて得た金額）は、原則として換金申込受付日から起算して5営業日目以降にお支払いします。



- 7) 信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口換金には制限を設ける場合があります。
- 8) 換金申込不可日はありません。
- 9) 取引所における取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更、クーデター等政変、テロリズム、戦争、天災地変等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）があるときは、委託会社の判断により、受益権の換金申込の受付を中止することおよび既に受付けた受益権の換金申込の受け取りを取消すことがあります。
- 10) 換金申込みを行う受益者は、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、社振法の規定にしたが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または記録が行われます。

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

##### 1) 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「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（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

投資対象とするマザーファンド受益証券は、当該マザーファンド受益証券の基準価額で評価します。

なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとします。また、予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

#### <主要投資対象の評価方法>

主要投資対象	有価証券等の評価方法
株式、投資証券等	(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の最終相場で評価します。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 原則として、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価します。
市場デリバティブ取引	原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の発表する清算値段または最終相場で評価します。

※国内で取引される資産については原則として基準価額計算日の値、外国で取引される資産については原則として基準価額計算日に知りうる直近の日の値で評価します。

##### 2) 基準価額の算出頻度

基準価額は原則として委託会社の営業日において日々算出されます。

##### 3) 基準価額の公表

基準価額は、販売会社にてご確認いただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の紙面に、「MA日本株」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

<照会先>

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03-4530-7333

(受付時間：原則として委託会社の営業日午前9時～午後5時)

ホームページアドレス：www.ssga.com/jp

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

当ファンドの信託期間は無期限ですが、後記(5)の1)2)3)5)の事由により信託が終了する場合があります。

(4) 【計算期間】

1) 当ファンドの計算期間は、毎年3月6日から翌年3月5日までとすることを原則とします。

2) 上記1)の規定にかかわらず、上記1)の原則により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、後記(5)の1)2)3)5)に定める信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

1) 信託契約の解約

(a) 委託会社は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することによりこの信託の受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合または下回ることが明らかとなった場合、もしくはこの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とき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

(b) 委託会社は、上記(a)の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドに係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

(c) 上記(b)の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本(c)において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

(d) 上記(b)の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行います。

(e) 上記(b)から上記(d)までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、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(b)から上記(d)までに規定するこの信託契約の解約の手続を行うことが困難な場合には適用しません。

2) 信託契約に関する監督官庁の命令

(a) 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

(b) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後記

6)の規定にしがいます。

3) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

(a) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

(b) 上記(a)の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、後記6)の書面決議が否決となる場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

4) 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

(a) 委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

(b) 委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

5) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

(a) 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違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、後記6)の規定にしが、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

(b) 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

6) 信託約款の変更等

(a) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本6)に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

(b) 委託会社は、上記(a)の事項(信託約款の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドに係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

(c) 上記(b)の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本(c)において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

(d) 上記(b)の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行います。

(e) 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

(f) 上記(b)から上記(e)までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面または電

磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

(g) 上記(a)から上記(f)までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合に係る一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### 7) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

この信託は、受益者が前記「2 換金（解約）手続等」に規定する一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、上記1)に規定する投資信託の解約または上記6)に規定する重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

#### 8) 運用報告書の交付

毎決算時（毎年3月5日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日。）および償還時に、期中の運用経過等を記載した運用報告書を作成します。

(a) 交付運用報告書は、知っている受益者に対して販売会社を通じて交付されます。

(b) 運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページ（[www.ssga.com/jp](http://www.ssga.com/jp)）に掲載されます。

ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、販売会社を通じて交付されます。

#### 9) 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。

#### 10) 関係法人との契約の更改に関する手続き等

委託会社と販売会社との間で締結する「募集・販売等に関する契約」（別の名称で同様の権利義務を規定する契約を含みます。）は、契約期間満了3ヶ月前までに、別段の意思表示のない限り、原則として1年毎に自動的に更新されるものとします。

### 4 【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。受益者の有する主な権利は次の通りです。

#### ① 分配金請求権

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、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託会社の指定する日から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載また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）に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、自動けいぞく投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

#### ② 償還金請求権

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、信託終了後1ヶ月以内の委託会社の指定する日から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載また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かか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また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。）に支払われます。

償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

③ 一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」の記載をご参照ください。

④ 書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの信託契約の解約または重大な約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行行使することができます。

⑤ 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧また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7期計算期間（2022年3月8日から2023年3月6日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

(3) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(4) 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、当中間計算期間（2023年3月7日から2023年9月6日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

# 独立監査人の監査報告書

2023年5月19日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社  
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 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」に掲げられているステート・ストリート日本株式インデックス・オープンの2022年3月8日から2023年3月6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、ステート・ストリート日本株式インデックス・オープンの2023年3月6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、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ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。

## 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、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 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

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ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. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。



1 【財務諸表】

ステート・ストリート日本株式インデックス・オープン

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 (2022年3月7日現在)	第7期 (2023年3月6日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	3,438	147,816
コール・ローン	41,924,648	25,384,408
親投資信託受益証券	12,649,215,703	12,212,521,157
未収入金	—	15,900,000
流動資産合計	12,691,143,789	12,253,953,381
資産合計	12,691,143,789	12,253,953,381
負債の部		
流動負債		
未払解約金	26,731,429	28,351,938
未払受託者報酬	2,401,803	2,063,734
未払委託者報酬	11,208,355	9,630,738
未払利息	113	67
その他未払費用	800,541	687,857
流動負債合計	41,142,241	40,734,334
負債合計	41,142,241	40,734,334
純資産の部		
元本等		
元本	8,242,506,024	6,834,794,674
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	4,407,495,524	5,378,424,373
(分配準備積立金)	1,174,123,675	1,599,149,632
元本等合計	12,650,001,548	12,213,219,047
純資産合計	12,650,001,548	12,213,219,047
負債純資産合計	12,691,143,789	12,253,953,381

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期 自 2021年3月6日 至 2022年3月7日	第7期 自 2022年3月8日 至 2023年3月6日
営業収益		
有価証券売買等損益	△601,619,490	1,988,355,454
営業収益合計	△601,619,490	1,988,355,454
営業費用		
支払利息	43,703	30,350
受託者報酬	4,301,973	4,317,298
委託者報酬	20,075,749	20,147,314
その他費用	1,434,067	1,439,279
営業費用合計	25,855,492	25,934,241
営業利益又は営業損失(△)	△627,474,982	1,962,421,213
経常利益又は経常損失(△)	△627,474,982	1,962,421,213
当期純利益又は当期純損失(△)	△627,474,982	1,962,421,213
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(△)	140,058,469	472,746,055
期首剰余金又は期首欠損金(△)	3,448,917,537	4,407,495,524
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,592,060,032	1,534,357,297
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	3,592,060,032	1,534,357,297
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,865,948,594	2,053,103,606
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	1,865,948,594	2,053,103,606
分配金	—	—
期末剰余金又は期末欠損金(△)	4,407,495,524	5,378,424,373

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間 2023年3月5日が休日のため、当計算期間は2022年3月8日から2023年3月6日までとなっております。

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

第6期 (2022年3月7日現在)	第7期 (2023年3月6日現在)
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	第6期 (2022年3月7日現在)	第7期 (2023年3月6日現在)
1 期首元本額	5,836,199,298円	8,242,506,024円
期中追加設定元本額	5,432,894,442円	2,307,955,686円
期中一部解約元本額	3,026,587,716円	3,715,667,036円
2 受益権の総数	8,242,506,024口	6,834,794,674口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第6期 自 2021年3月6日 至 2022年3月7日	第7期 自 2022年3月8日 至 2023年3月6日
1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(231,431,683円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(3,233,371,849円)及び分配準備積立金(942,691,992円)より分配対象収益は4,407,495,524円(1万口当たり5,347円)ですが、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(307,509,309円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(563,827,927円)、収益調整金(3,779,274,741円)及び分配準備積立金(727,812,396円)より分配対象収益は5,378,424,373円(1万口当たり7,869円)ですが、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

I 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	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(4) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク等の市場リスクに晒されております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。

II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第6期 (2022年3月7日現在)	第7期 (2023年3月6日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（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>(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項につ	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	同左

いての補足説明	め、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。
---------	-----------------------------------

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	第6期 (2022年3月7日現在)	第7期 (2023年3月6日現在)
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額	当計算期間の損益に 含まれた評価差額
親投資信託受益証券	△647,995,247	1,631,556,040
合計	△647,995,247	1,631,556,040

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

該当する事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第6期 (2022年3月7日現在)	第7期 (2023年3月6日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5347円 (15,347円)	1.7869円 (17,869円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

① 株式

該当する事項はありません。

② 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託 受益証券	日本株式インデックス・マザー ファンド	3,308,102,272	12,212,521,157	
合計		3,308,102,272	12,212,521,157	

(注) 親投資信託受益証券における券面総額は、証券数です。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

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

該当する事項はありません。

<参考>

当ファンドは「日本株式インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「日本株式インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2022年3月7日現在)	(2023年3月6日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		153,887	4,098,840
コール・ローン		1,876,520,744	703,891,541
株式		78,002,649,540	53,012,482,760
未収入金		1,554,459	19,104,480
未収配当金		148,429,265	105,426,527
差入委託証拠金		100,890,000	28,620,000
前払金		114,015,500	—
流動資産合計		80,244,213,395	53,873,624,148
資産合計		80,244,213,395	53,873,624,148
負債の部			
流動負債			
前受金		—	12,980,000
派生商品評価勘定		8,875,440	341,120
未払金		173,490,980	—
未払解約金		1,214,000	113,201,000
未払利息		5,068	1,884
その他未払費用		1,047	759
流動負債合計		183,586,535	126,524,763
負債合計		183,586,535	126,524,763
純資産の部			
元本等			
元本	1	25,300,275,343	14,558,908,008
剰余金			
剰余金又は欠損金(△)		54,760,351,517	39,188,191,377
元本等合計		80,060,626,860	53,747,099,385
純資産合計		80,060,626,860	53,747,099,385
負債純資産合計		80,244,213,395	53,873,624,148

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年3月6日から、翌年3月5日までであります。

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、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 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

(2022年3月7日現在)	(2023年3月6日現在)
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	(2022年3月7日現在)	(2023年3月6日現在)
1 期首元本額	30,638,101,356円	25,300,275,343円
期中追加設定元本額	2,908,677,054円	1,657,681,729円
期中一部解約元本額	8,246,503,067円	12,399,049,064円
元本の内訳		
ファンド名		
AMC／ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	68,904,278円	68,981,331円
日本株式インデックス・ファンド（年金1）＜適格機関投資家限定＞	859,436,668円	710,654,042円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	1,114,502円	2,898,566円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	41,611,804円	23,988,398円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	101,750円	95,561円
バランスファンドVA40B＜適格機関投	2,929,213円	2,369,752円

資家限定>		
バランスファンドVA50A<適格機関投資家限定>	9,020,758円	4,168,214円
バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	4,713,456,402円	4,005,086,693円
日本株式インデックス・ファンドVA1<適格機関投資家限定>	328,660,438円	254,435,197円
バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	2,688,492円	2,111,954円
バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	675,167,737円	524,962,098円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	516,333,400円	435,713,404円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	33,212,551円	31,673,865円
日本株式インデックス・ファンドM<適格機関投資家限定>	74,750,335円	73,098,076円
日本株式インデックス・ファンドS<適格機関投資家限定>	8,227,613,661円	76,775,165円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	129,309,579円	94,542,489円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	1,687,205,694円	1,423,723,607円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	255,384,271円	193,801,129円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	1,174,449,027円	942,430,300円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	36,746,420円	31,132,700円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	13,711,613円	9,828,013円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	15,816,264円	14,088,522円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	7,558,463円	5,225,456円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	415,348,450円	339,407,323円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	1,503,156円	1,174,704円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	2,349,417円	2,163,323円
日本株式インデックス・ファンドVA2<適格機関投資家限定>	77,848,054円	41,848,936円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	230,562,712円	200,452,844円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	1,078,407,897円	879,179,744円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド(ステイブル)年金<適格機関投資家限定>	72,763,467円	68,530,913円
フレックス資産配分戦略ファンド<適	83,446,653円	430,650,499円



格機関投資家限定> T a d リスクバジェット型マルチ配分 戦略ファンド（ステイブル）<適格機 関投資家限定>	48,862,230円	45,838,046円
ステート・ストリート日本株式インデ ックス・オープン	3,997,350,431円	3,308,102,272円
世界バランス40VA<適格機関投資 家限定>	4,123,321円	2,753,384円
世界バランス60VA<適格機関投資 家限定>	23,723,340円	3,682,872円
グローバルバランス40VA<適格機 関投資家限定>	212,618円	194,223円
グローバルバランス40VA2<適格 機関投資家限定>	369,908,713円	289,049,365円
グローバルバランス40VA3<適格 機関投資家限定>	13,813,707円	10,430,102円
グローバルバランス50VA<適格機 関投資家限定>	4,867,857円	3,664,926円
計	25,300,275,343円	14,558,908,008円
2 受益権の総数	25,300,275,343口	14,558,908,008口

(金融商品に関する注記)

#### I 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	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<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。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(3) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク等の市場リスクに晒されております。</p> <p>デリバティブ取引には、ファンド資金の流出入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、ファンドの効率的な運用に資することを目的に利用している株価指数先物取引があり、株価変動リスクに晒されております。</p>
3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとと

もに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。

## II 金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2022年3月7日現在)	(2023年3月6日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品</p> <p>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券            売買目的有価証券            「注記表（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>(3)デリバティブ取引            「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品</p> <p>同左</p> <p>(2)有価証券            売買目的有価証券            同左</p> <p>(3)デリバティブ取引            同左</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>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	同左

## (有価証券関係に関する注記)

## 売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	(2022年3月7日現在)	(2023年3月6日現在)
	当期間の損益に 含まれた評価差額	当期間の損益に 含まれた評価差額
株式	△4,392,293,762	6,220,285,630
合計	△4,392,293,762	6,220,285,630

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始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を指しております。

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## 株式関連

(単位：円)

区 分	種 類	(2022年3月7日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX (先物)	1,494,780,000	—	1,485,960,000	△8,820,000
	合 計	1,494,780,000	—	1,485,960,000	△8,820,000

(単位：円)

区 分	種 類	(2023年3月6日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX (先物)	644,000,000	—	643,680,000	△320,000
	合 計	644,000,000	—	643,680,000	△320,000

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又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、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。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約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。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
5. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	(2022年3月7日現在)	(2023年3月6日現在)
1口当たり純資産額	3.1644円	3.6917円
(1万口当たり純資産額)	(31,644円)	(36,917円)

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## ① 株式

銘柄	株数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	1,000	3,650.00	3,650,000	
ニッスイ	25,200	545.00	13,734,000	
マルハニチロ	3,700	2,446.00	9,050,200	
雪国まいたけ	2,100	1,055.00	2,215,500	
カネコ種苗	800	1,668.00	1,334,400	
サカタのタネ	2,900	4,155.00	12,049,500	
ホクト	2,300	1,882.00	4,328,600	
ホクリョウ	200	904.00	180,800	
ショーボンドホールディングス	3,500	5,450.00	19,075,000	
ミライト・ワン	8,900	1,615.00	14,373,500	
タマホーム	1,600	3,470.00	5,552,000	
サンヨーホームズ	600	770.00	462,000	
日本アクア	900	899.00	809,100	
ファーストコーポレーション	900	790.00	711,000	
ベステラ	400	930.00	372,000	
Robot Home	4,600	201.00	924,600	
キャンディル	600	516.00	309,600	
住石ホールディングス	3,300	369.00	1,217,700	
日鉄鉱業	1,000	3,850.00	3,850,000	
三井松島ホールディングス	1,200	3,695.00	4,434,000	
INPEX	93,900	1,495.00	140,380,500	
石油資源開発	2,900	5,140.00	14,906,000	
K&Oエナジーグループ	1,200	2,176.00	2,611,200	
ダイセキ環境ソリューション	700	941.00	658,700	
第一カッター興業	700	1,084.00	758,800	
明豊ファシリティワークス	900	809.00	728,100	
安藤・間	14,600	871.00	12,716,600	
東急建設	7,300	707.00	5,161,100	
コムシスホールディングス	8,700	2,490.00	21,663,000	
ビーアールホールディングス	3,700	354.00	1,309,800	
高松コンストラクショングループ	1,700	2,010.00	3,417,000	
東建コーポレーション	700	7,910.00	5,537,000	
ソネック	200	1,010.00	202,000	
ヤマウラ	1,300	1,111.00	1,444,300	
オリエンタル白石	9,600	321.00	3,081,600	
大成建設	17,700	4,530.00	80,181,000	
大林組	63,400	1,030.00	65,302,000	
清水建設	53,300	748.00	39,868,400	
飛島建設	1,800	1,119.00	2,014,200	
長谷工コーポレーション	18,300	1,581.00	28,932,300	
松井建設	1,400	665.00	931,000	
銭高組	300	2,984.00	895,200	
鹿島建設	39,300	1,651.00	64,884,300	
不動テトラ	1,400	1,674.00	2,343,600	

大末建設	700	1,210.00	847,000	
鉄建建設	1,400	1,874.00	2,623,600	
西松建設	3,000	3,625.00	10,875,000	
三井住友建設	14,100	432.00	6,091,200	
大豊建設	800	3,915.00	3,132,000	
佐田建設	1,300	507.00	659,100	
ナカノフドー建設	800	361.00	288,800	
奥村組	2,800	3,305.00	9,254,000	
東鉄工業	2,400	2,783.00	6,679,200	
イチケン	500	1,860.00	930,000	
富士ピー・エス	1,200	461.00	553,200	
浅沼組	1,400	3,395.00	4,753,000	
戸田建設	22,100	711.00	15,713,100	
熊谷組	3,100	2,826.00	8,760,600	
北野建設	400	3,040.00	1,216,000	
植木組	400	1,409.00	563,600	
矢作建設工業	2,300	860.00	1,978,000	
ピーエス三菱	2,100	678.00	1,423,800	
日本ハウスホールディングス	3,400	382.00	1,298,800	
大東建託	6,500	12,940.00	84,110,000	
新日本建設	2,800	976.00	2,732,800	
東亜道路工業	300	7,130.00	2,139,000	
日本道路	400	7,200.00	2,880,000	
東亜建設工業	1,600	2,710.00	4,336,000	
日本国土開発	5,200	580.00	3,016,000	
若築建設	800	3,370.00	2,696,000	
東洋建設	5,600	902.00	5,051,200	
五洋建設	25,100	661.00	16,591,100	
世紀東急工業	2,300	836.00	1,922,800	
福田組	700	4,550.00	3,185,000	
日本ドライケミカル	500	1,751.00	875,500	
住友林業	13,600	2,654.00	36,094,400	
日本基礎技術	800	552.00	441,600	
巴コーポレーション	1,500	449.00	673,500	
大和ハウス工業	49,600	3,144.00	155,942,400	
ライト工業	3,300	1,963.00	6,477,900	
積水ハウス	55,600	2,625.00	145,950,000	
日特建設	1,300	983.00	1,277,900	
北陸電気工事	1,300	790.00	1,027,000	
ユアテック	3,800	802.00	3,047,600	
日本リーテック	1,300	893.00	1,160,900	
四電工	700	1,938.00	1,356,600	
中電工	2,700	2,191.00	5,915,700	
関電工	10,000	901.00	9,010,000	
きんでん	12,700	1,554.00	19,735,800	
東京エネシス	1,700	913.00	1,552,100	
トーエネック	600	3,485.00	2,091,000	
住友電設	1,600	2,502.00	4,003,200	
日本電設工業	2,900	1,572.00	4,558,800	

エクシオグループ	8,300	2,413.00	20,027,900	
新日本空調	1,000	2,020.00	2,020,000	
日本工営	1,100	3,285.00	3,613,500	
九電工	4,400	3,470.00	15,268,000	
三機工業	3,900	1,537.00	5,994,300	
日揮ホールディングス	17,500	1,806.00	31,605,000	
中外炉工業	600	1,893.00	1,135,800	
ヤマト	1,200	850.00	1,020,000	
太平電業	1,100	4,020.00	4,422,000	
高砂熱学工業	4,200	2,114.00	8,878,800	
三晃金属工業	200	4,090.00	818,000	
NEC ネットエスアイ	6,000	1,660.00	9,960,000	
朝日工業社	800	2,158.00	1,726,400	
明星工業	3,000	809.00	2,427,000	
大気社	2,100	3,635.00	7,633,500	
ダイダン	1,100	2,431.00	2,674,100	
日比谷総合設備	1,600	2,084.00	3,334,400	
ニッポン	4,900	1,653.00	8,099,700	
日清製粉グループ本社	16,400	1,571.00	25,764,400	
日東富士製粉	300	4,575.00	1,372,500	
昭和産業	1,500	2,569.00	3,853,500	
鳥越製粉	1,700	602.00	1,023,400	
中部飼料	2,300	1,049.00	2,412,700	
フィード・ワン	2,700	693.00	1,871,100	
東洋精糖	500	925.00	462,500	
日本甜菜製糖	1,100	1,727.00	1,899,700	
DM三井製糖ホールディングス	1,900	2,116.00	4,020,400	
塩水港精糖	1,400	205.00	287,000	
ウェルネオシュガー	1,000	1,731.00	1,731,000	
L I F U L L	6,000	210.00	1,260,000	
M I X I	4,300	2,681.00	11,528,300	
ジェイエイシーリクルートメント	1,600	2,548.00	4,076,800	
日本M&Aセンターホールディングス	31,900	1,130.00	36,047,000	
メンバーズ	600	1,425.00	855,000	
中広	500	410.00	205,000	
UTグループ	2,700	2,442.00	6,593,400	
アイティメディア	700	1,412.00	988,400	
E・Jホールディングス	1,100	1,477.00	1,624,700	
オープンアップグループ	5,500	1,965.00	10,807,500	
コシダカホールディングス	5,400	959.00	5,178,600	
アルトナー	600	1,085.00	651,000	
パソナグループ	2,200	1,950.00	4,290,000	
CDS	500	1,828.00	914,000	
リンクアンドモチベーション	5,300	547.00	2,899,100	
エス・エム・エス	7,100	3,285.00	23,323,500	
サニーサイドアップグループ	800	612.00	489,600	
パーソルホールディングス	20,800	2,743.00	57,054,400	
リニカル	1,100	737.00	810,700	
クックパッド	6,200	224.00	1,388,800	

エスクリ	1,200	345.00	414,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	900	666.00	599,400	
森永製菓	3,300	3,900.00	12,870,000	
中村屋	500	3,090.00	1,545,000	
江崎グリコ	5,100	3,435.00	17,518,500	
名糖産業	600	1,697.00	1,018,200	
井村屋グループ	1,100	2,225.00	2,447,500	
不二家	1,200	2,442.00	2,930,400	
山崎製パン	11,900	1,566.00	18,635,400	
第一屋製パン	500	401.00	200,500	
モロゾフ	500	3,480.00	1,740,000	
亀田製菓	1,200	4,275.00	5,130,000	
寿スピリッツ	1,900	9,010.00	17,119,000	
カルビー	8,100	2,672.00	21,643,200	
森永乳業	3,300	4,675.00	15,427,500	
六甲バター	1,500	1,384.00	2,076,000	
ヤクルト本社	12,700	9,440.00	119,888,000	
明治ホールディングス	11,000	6,240.00	68,640,000	
雪印メグミルク	4,400	1,823.00	8,021,200	
プリマハム	2,400	2,213.00	5,311,200	
日本ハム	6,900	3,765.00	25,978,500	
林兼産業	300	499.00	149,700	
丸大食品	2,000	1,523.00	3,046,000	
S Foods	1,900	2,817.00	5,352,300	
柿安本店	700	2,068.00	1,447,600	
伊藤ハム米久ホールディングス	13,800	726.00	10,018,800	
学情	1,000	1,471.00	1,471,000	
スタジオアリス	900	2,074.00	1,866,600	
クロスキャット	1,000	1,299.00	1,299,000	
シミックホールディングス	1,100	1,942.00	2,136,200	
エプロ	500	722.00	361,000	
システナ	30,000	322.00	9,660,000	
N J S	400	2,264.00	905,600	
デジタルアーツ	1,100	5,300.00	5,830,000	
日鉄ソリューションズ	3,100	3,560.00	11,036,000	
総合警備保障	6,900	3,570.00	24,633,000	
キューブシステム	1,000	1,188.00	1,188,000	
いちご	20,900	291.00	6,081,900	
日本駐車場開発	22,200	241.00	5,350,200	
コア	900	1,568.00	1,411,200	
カカクコム	13,900	1,957.00	27,202,300	
アイロムグループ	700	1,913.00	1,339,100	
セントケア・ホールディング	1,300	795.00	1,033,500	
サイネックス	400	590.00	236,000	
ルネサンス	1,400	934.00	1,307,600	
ディップ	3,200	3,650.00	11,680,000	
SBSホールディングス	1,600	3,225.00	5,160,000	
デジタルホールディングス	1,400	1,172.00	1,640,800	
新日本科学	2,100	3,190.00	6,699,000	

キャリアデザインセンター	300	2,171.00	651,300	
ベネフィット・ワン	8,700	2,079.00	18,087,300	
エムスリー	36,800	3,271.00	120,372,800	
ツカダ・グローバルホールディング	1,100	422.00	464,200	
プラス	200	1,189.00	237,800	
アウトソーシング	11,000	1,392.00	15,312,000	
ウェルネット	1,100	648.00	712,800	
ワールドホールディングス	800	2,741.00	2,192,800	
ディー・エヌ・エー	8,000	1,745.00	13,960,000	
博報堂DYホールディングス	23,700	1,534.00	36,355,800	
ぐるなび	3,100	356.00	1,103,600	
タカミヤ	2,300	439.00	1,009,700	
ジャパンベストレスキューシステム	1,200	783.00	939,600	
ファンコミュニケーションズ	3,500	413.00	1,445,500	
ライク	700	1,942.00	1,359,400	
ビジネス・ブレークスルー	600	392.00	235,200	
エスプール	5,300	638.00	3,381,400	
WDBホールディングス	900	2,071.00	1,863,900	
手間いらず	300	4,925.00	1,477,500	
ティア	1,100	438.00	481,800	
CDG	400	1,192.00	476,800	
アドウェイズ	3,000	709.00	2,127,000	
バリューコマース	1,400	1,644.00	2,301,600	
インフォマート	19,200	309.00	5,932,800	
サッポロホールディングス	5,800	3,245.00	18,821,000	
アサヒグループホールディングス	41,200	4,862.00	200,314,400	
麒麟ホールディングス	80,400	2,037.00	163,774,800	
宝ホールディングス	12,300	1,077.00	13,247,100	
オエノンホールディングス	5,800	280.00	1,624,000	
養命酒製造	600	1,884.00	1,130,400	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	13,900	1,414.00	19,654,600	
サントリー食品インターナショナル	12,500	4,805.00	60,062,500	
ダイドーグループホールディングス	1,000	4,750.00	4,750,000	
伊藤園	6,000	4,580.00	27,480,000	
キーコーヒー	2,000	2,086.00	4,172,000	
ユニカフェ	400	897.00	358,800	
ジャパンフーズ	400	1,103.00	441,200	
日清オイリオグループ	2,600	3,355.00	8,723,000	
不二製油グループ本社	4,200	1,951.00	8,194,200	
かどや製油	200	3,605.00	721,000	
J-オイルミルズ	2,000	1,574.00	3,148,000	
ローソン	4,800	5,410.00	25,968,000	
サンエー	1,500	4,240.00	6,360,000	
カワチ薬品	1,600	2,325.00	3,720,000	
エービーシー・マート	2,800	7,200.00	20,160,000	
ハードオフコーポレーション	900	1,372.00	1,234,800	
高千穂交易	600	2,555.00	1,533,000	
アスクル	3,900	1,736.00	6,770,400	
ゲオホールディングス	2,100	1,739.00	3,651,900	



アダストリア	2,300	2,328.00	5,354,400	
ジーフット	1,800	283.00	509,400	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	800	420.00	336,000	
オルバヘルスケアホールディングス	200	1,679.00	335,800	
伊藤忠食品	400	5,100.00	2,040,000	
くら寿司	2,200	3,350.00	7,370,000	
キャンドウ	800	2,390.00	1,912,000	
エレマテック	1,700	1,903.00	3,235,100	
I Kホールディングス	800	384.00	307,200	
パルグループホールディングス	1,800	2,856.00	5,140,800	
エディオン	7,500	1,335.00	10,012,500	
あらた	1,500	4,145.00	6,217,500	
サーラコーポレーション	4,200	745.00	3,129,000	
ワッツ	700	695.00	486,500	
トーメンデバイス	300	6,780.00	2,034,000	
ハローズ	900	3,165.00	2,848,500	
J Pホールディングス	5,000	340.00	1,700,000	
フジオフードグループ本社	1,700	1,339.00	2,276,300	
あみやき亭	500	3,065.00	1,532,500	
東京エレクトロン デバイス	600	8,140.00	4,884,000	
ひらまつ	5,200	191.00	993,200	
円谷フィールズホールディングス	1,600	4,245.00	6,792,000	
双日	20,300	2,704.00	54,891,200	
アルフレッサ ホールディングス	19,200	1,695.00	32,544,000	
大黒天物産	600	5,040.00	3,024,000	
ハニーズホールディングス	1,400	1,555.00	2,177,000	
ファーマライズホールディングス	800	622.00	497,600	
キッコーマン	11,800	6,360.00	75,048,000	
味の素	43,600	4,450.00	194,020,000	
ブルドックソース	800	2,010.00	1,608,000	
キューピー	9,700	2,202.00	21,359,400	
ハウス食品グループ本社	5,400	2,736.00	14,774,400	
カゴメ	8,400	3,040.00	25,536,000	
焼津水産化学工業	900	895.00	805,500	
アリアケジャパン	1,600	4,900.00	7,840,000	
ピエトロ	300	1,852.00	555,600	
エバラ食品工業	500	3,160.00	1,580,000	
やまみ	200	1,358.00	271,600	
ニチレイ	8,100	2,686.00	21,756,600	
横浜冷凍	5,100	1,024.00	5,222,400	
東洋水産	9,000	5,610.00	50,490,000	
イトアンドホールディングス	800	2,205.00	1,764,000	
大冷	100	1,919.00	191,900	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,000	1,100.00	1,100,000	
日清食品ホールディングス	6,300	11,320.00	71,316,000	
永谷園ホールディングス	900	2,099.00	1,889,100	
一正蒲鉾	800	724.00	579,200	
フジッコ	1,800	1,872.00	3,369,600	
ロック・フィールド	1,900	1,535.00	2,916,500	

日本たばこ産業	117,400	2,758.50	323,847,900	
ケンコーマヨネーズ	1,100	1,336.00	1,469,600	
わらべや日洋ホールディングス	1,300	1,838.00	2,389,400	
なとり	1,200	2,034.00	2,440,800	
イフジ産業	200	998.00	199,600	
ファーマフーズ	2,700	1,574.00	4,249,800	
北の達人コーポレーション	7,200	355.00	2,556,000	
ユーグレナ	11,000	943.00	10,373,000	
紀文食品	1,300	964.00	1,253,200	
ピクルスホールディングス	1,000	1,200.00	1,200,000	
スター・マイカ・ホールディングス	1,500	686.00	1,029,000	
SREホールディングス	900	3,820.00	3,438,000	
ADワークスグループ	3,800	169.00	642,200	
片倉工業	1,600	1,810.00	2,896,000	
グンゼ	1,300	4,570.00	5,941,000	
ヒューリック	41,500	1,097.00	45,525,500	
神栄	400	911.00	364,400	
ラサ商事	1,000	1,526.00	1,526,000	
アルペン	1,500	1,976.00	2,964,000	
ハブ	400	873.00	349,200	
ラクーンホールディングス	1,400	967.00	1,353,800	
クオールホールディングス	2,600	1,185.00	3,081,000	
アルコニックス	2,600	1,404.00	3,650,400	
神戸物産	14,800	3,650.00	54,020,000	
ソリトンシステムズ	1,000	1,000.00	1,000,000	
ジンズホールディングス	1,100	3,550.00	3,905,000	
ビックカメラ	12,900	1,162.00	14,989,800	
DCMホールディングス	11,800	1,148.00	13,546,400	
ペッパーフードサービス	2,800	170.00	476,000	
ハイパー	600	454.00	272,400	
MonotaRO	27,100	1,856.00	50,297,600	
東京一番フーズ	700	507.00	354,900	
DDホールディングス	1,000	718.00	718,000	
あいホールディングス	3,000	2,303.00	6,909,000	
ディーブイエックス	700	1,075.00	752,500	
きちりホールディングス	300	591.00	177,300	
アークランドサービスホールディングス	1,500	2,219.00	3,328,500	
J. フロント リテイリング	23,700	1,288.00	30,525,600	
ドトール・日レスホールディングス	3,500	1,886.00	6,601,000	
マツキヨココカラ&カンパニー	11,600	6,670.00	77,372,000	
ブロンコビリー	1,000	2,453.00	2,453,000	
ZOZO	12,600	3,085.00	38,871,000	
トレジャー・ファクトリー	1,200	1,180.00	1,416,000	
物語コーポレーション	3,000	2,615.00	7,845,000	
三越伊勢丹ホールディングス	32,200	1,424.00	45,852,800	
東洋紡	7,700	1,079.00	8,308,300	
ユニチカ	5,600	226.00	1,265,600	
富士紡ホールディングス	700	3,135.00	2,194,500	
日清紡ホールディングス	14,800	1,040.00	15,392,000	

倉敷紡績	1,300	2,602.00	3,382,600	
ダイワボウホールディングス	7,800	2,176.00	16,972,800	
シキボウ	1,000	1,057.00	1,057,000	
日東紡績	2,300	2,099.00	4,827,700	
トヨタ紡織	7,700	2,152.00	16,570,400	
マクニカホールディングス	4,700	3,780.00	17,766,000	
H a m e e	900	868.00	781,200	
マーケットエンタープライズ	200	1,164.00	232,800	
ラクト・ジャパン	700	1,930.00	1,351,000	
ウエルシアホールディングス	9,900	2,825.00	27,967,500	
クリエイトSDホールディングス	3,100	3,395.00	10,524,500	
グリムス	900	2,500.00	2,250,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,800	978.00	2,738,400	
八洲電機	1,500	1,161.00	1,741,500	
メディアスホールディングス	1,200	803.00	963,600	
レスターホールディングス	1,800	2,395.00	4,311,000	
ジュテックホールディングス	400	1,261.00	504,400	
丸善CHIホールディングス	2,400	353.00	847,200	
大光	1,100	596.00	655,600	
OCHIホールディングス	400	1,337.00	534,800	
TOKAIホールディングス	9,500	880.00	8,360,000	
黒谷	700	610.00	427,000	
ミサワ	500	610.00	305,000	
ティーライフ	200	1,289.00	257,800	
C o m i n i x	200	801.00	160,200	
エー・ピーホールディングス	800	776.00	620,800	
三洋貿易	2,000	1,182.00	2,364,000	
チムニー	400	1,179.00	471,600	
シュッピン	1,300	900.00	1,170,000	
ビューティガレージ	300	3,670.00	1,101,000	
オイシックス・ラ・大地	2,600	2,273.00	5,909,800	
ウイン・パートナーズ	1,500	1,071.00	1,606,500	
ネクステージ	4,300	2,815.00	12,104,500	
ジョイフル本田	5,600	1,753.00	9,816,800	
鳥貴族ホールディングス	700	2,005.00	1,403,500	
ホットランド	1,500	1,453.00	2,179,500	
すかいらくホールディングス	26,100	1,611.00	42,047,100	
SFPホールディングス	1,000	1,698.00	1,698,000	
綿半ホールディングス	1,500	1,432.00	2,148,000	
日本毛織	4,700	979.00	4,601,300	
ダイトウボウ	5,000	84.00	420,000	
トーア紡コーポレーション	1,400	359.00	502,600	
ダイドーリミテッド	2,700	279.00	753,300	
ヨシックスホールディングス	400	2,151.00	860,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	6,100	1,110.00	6,771,000	
三栄建築設計	800	1,527.00	1,221,600	
野村不動産ホールディングス	11,100	3,020.00	33,522,000	
三重交通グループホールディングス	4,200	528.00	2,217,600	
サムティ	2,800	2,127.00	5,955,600	

ディア・ライフ	2,600	655.00	1,703,000	
コーセーアールイー	500	764.00	382,000	
地主	1,300	1,902.00	2,472,600	
プレサンスコーポレーション	2,300	1,794.00	4,126,200	
フィル・カンパニー	500	1,107.00	553,500	
THEグローバル社	1,700	211.00	358,700	
ハウスコム	400	1,125.00	450,000	
JPMC	1,000	1,014.00	1,014,000	
サンセイランディック	300	836.00	250,800	
エストラスト	600	592.00	355,200	
フージャースホールディングス	2,600	875.00	2,275,000	
オープンハウスグループ	6,500	5,010.00	32,565,000	
東急不動産ホールディングス	53,500	651.00	34,828,500	
飯田グループホールディングス	15,600	2,289.00	35,708,400	
イーグランド	200	1,561.00	312,200	
ムゲンエステート	800	559.00	447,200	
帝国繊維	2,000	1,642.00	3,284,000	
日本コークス工業	17,800	88.00	1,566,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,000	954.00	954,000	
ミタチ産業	400	1,409.00	563,600	
BEENOS	1,000	2,455.00	2,455,000	
あさひ	1,700	1,319.00	2,242,300	
日本調剤	1,200	1,188.00	1,425,600	
コスモス薬品	1,900	12,340.00	23,446,000	
シップヘルスケアホールディングス	7,000	2,444.00	17,108,000	
トーエル	900	827.00	744,300	
ソフトクリエイトホールディングス	700	3,670.00	2,569,000	
セブン&アイ・ホールディングス	66,000	6,270.00	413,820,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	14,600	1,019.00	14,877,400	
明治電機工業	600	1,193.00	715,800	
ソルハホールディングス	4,000	8,850.00	35,400,000	
デリカフーズホールディングス	500	547.00	273,500	
スターティアホールディングス	600	1,390.00	834,000	
サンマルクホールディングス	1,600	1,820.00	2,912,000	
フェリシモ	400	1,004.00	401,600	
トリドールホールディングス	4,700	2,739.00	12,873,300	
帝人	17,400	1,422.00	24,742,800	
東レ	121,400	804.60	97,678,440	
クラレ	28,700	1,257.00	36,075,900	
旭化成	113,200	968.00	109,577,600	
TOKYO BASE	2,700	516.00	1,393,200	
稲葉製作所	1,100	1,525.00	1,677,500	
宮地エンジニアリンググループ	500	3,785.00	1,892,500	
トーカロ	5,100	1,305.00	6,655,500	
アルファC o	700	1,022.00	715,400	
SUMCO	35,500	1,949.00	69,189,500	
川田テクノロジーズ	400	3,790.00	1,516,000	
RS Technologies	1,200	3,520.00	4,224,000	
ジェイテックコーポレーション	300	2,924.00	877,200	

信和	1,200	750.00	900,000	
ビーロット	1,400	577.00	807,800	
ファーストブラザーズ	500	875.00	437,500	
A n d D oホールディングス	1,000	881.00	881,000	
シーアールイー	800	1,162.00	929,600	
プロパティエージェント	200	1,224.00	244,800	
ケイアイスター不動産	900	4,225.00	3,802,500	
アグレ都市デザイン	400	1,670.00	668,000	
グッドコムアセット	1,800	913.00	1,643,400	
ジェイ・エス・ビー	400	4,100.00	1,640,000	
ロードスターキャピタル	700	1,441.00	1,008,700	
テンポイノバージョン	500	1,265.00	632,500	
グローバル・リンク・マネジメント	300	1,334.00	400,200	
フェイスネットワーク	200	1,739.00	347,800	
住江織物	400	1,990.00	796,000	
日本フェルト	600	429.00	257,400	
イチカワ	200	1,370.00	274,000	
エコナックホールディングス	4,500	94.00	423,000	
日東製網	100	1,600.00	160,000	
芦森工業	400	1,532.00	612,800	
アツギ	1,500	397.00	595,500	
ウイルプラスホールディングス	400	1,192.00	476,800	
J Mホールディングス	1,400	1,879.00	2,630,600	
コメダホールディングス	4,600	2,369.00	10,897,400	
サツドラホールディングス	900	836.00	752,400	
アレンザホールディングス	1,500	979.00	1,468,500	
串カツ田中ホールディングス	500	1,587.00	793,500	
バロックジャパンリミテッド	1,400	799.00	1,118,600	
クスリのアオキホールディングス	1,700	6,800.00	11,560,000	
ダイニック	700	803.00	562,100	
共和レザー	700	540.00	378,000	
ピーバンドットコム	400	561.00	224,400	
力の源ホールディングス	900	1,526.00	1,373,400	
FOOD & LIFE COMPANIE	11,000	3,600.00	39,600,000	
アセンテック	1,000	526.00	526,000	
セーレン	3,600	2,398.00	8,632,800	
ソトー	400	807.00	322,800	
東海染工	300	1,125.00	337,500	
小松マテーレ	2,600	719.00	1,869,400	
ワコールホールディングス	3,500	2,506.00	8,771,000	
ホギメディカル	2,500	3,250.00	8,125,000	
クラウディアホールディングス	100	381.00	38,100	
T S Iホールディングス	6,700	666.00	4,462,200	
マツオカコーポレーション	400	1,360.00	544,000	
ワールド	2,300	1,481.00	3,406,300	
T I S	20,400	3,495.00	71,298,000	
J N Sホールディングス	800	346.00	276,800	
グリー	4,700	734.00	3,449,800	
GMOペパボ	300	1,870.00	561,000	

コーエーテクモホールディングス	11,300	2,332.00	26,351,600	
三菱総合研究所	900	5,020.00	4,518,000	
ボルテージ	900	320.00	288,000	
電算	200	1,892.00	378,400	
AGS	900	703.00	632,700	
ファインデックス	1,700	645.00	1,096,500	
ブレインパッド	1,700	696.00	1,183,200	
KL a b	3,700	399.00	1,476,300	
ポールトゥウィンホールディングス	3,000	907.00	2,721,000	
ネクソン	46,900	3,080.00	144,452,000	
アイスタイル	5,200	458.00	2,381,600	
エムアップホールディングス	2,400	1,059.00	2,541,600	
エイチーム	1,300	792.00	1,029,600	
エニグモ	2,200	605.00	1,331,000	
テクノスジャパン	1,500	606.00	909,000	
e n i s h	2,000	386.00	772,000	
コロブラ	6,900	597.00	4,119,300	
オルトプラス	2,400	217.00	520,800	
ブロードリーフ	10,300	462.00	4,758,600	
クロス・マーケティンググループ	1,200	650.00	780,000	
デジタルハーツホールディングス	900	1,565.00	1,408,500	
システム情報	1,500	805.00	1,207,500	
メディアドゥ	700	1,491.00	1,043,700	
じげん	5,800	435.00	2,523,000	
バイキューブ	2,100	564.00	1,184,400	
エンカレッジ・テクノロジー	500	511.00	255,500	
サイバーリンクス	600	857.00	514,200	
ディー・エル・イー	2,200	263.00	578,600	
フィックスターズ	2,100	1,463.00	3,072,300	
CARTA HOLDINGS	800	1,500.00	1,200,000	
オブティム	1,400	938.00	1,313,200	
セレス	800	1,168.00	934,400	
SHIFT	1,300	22,670.00	29,471,000	
特種東海製紙	800	3,055.00	2,444,000	
ティーガイア	1,800	1,651.00	2,971,800	
セック	200	3,665.00	733,000	
テクマトリックス	3,300	1,444.00	4,765,200	
プロシップ	700	1,422.00	995,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	5,500	2,557.00	14,063,500	
GMOペイメントゲートウェイ	4,100	11,480.00	47,068,000	
ザッパラス	200	375.00	75,000	
システムリサーチ	600	2,192.00	1,315,200	
インターネットイニシアティブ	10,100	2,736.00	27,633,600	
さくらインターネット	2,200	618.00	1,359,600	
ヴィンクス	600	1,400.00	840,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	4,320.00	2,160,000	
SRAホールディングス	1,000	3,115.00	3,115,000	
システムインテグレータ	800	434.00	347,200	
朝日ネット	1,800	594.00	1,069,200	

e B A S E	2,400	682.00	1,636,800	
アバントグループ	2,200	1,390.00	3,058,000	
アドソル日進	700	1,525.00	1,067,500	
ODKソリューションズ	600	619.00	371,400	
フリービット	1,000	1,189.00	1,189,000	
コムチュア	2,300	2,179.00	5,011,700	
サイバーコム	200	1,431.00	286,200	
アステリア	1,500	739.00	1,108,500	
アイル	1,100	2,353.00	2,588,300	
王子ホールディングス	75,400	555.00	41,847,000	
日本製紙	9,300	1,063.00	9,885,900	
三菱製紙	2,700	349.00	942,300	
北越コーポレーション	11,700	828.00	9,687,600	
中越パルプ工業	700	1,034.00	723,800	
巴川製紙所	600	689.00	413,400	
大王製紙	7,900	1,062.00	8,389,800	
阿波製紙	300	712.00	213,600	
マークライنز	1,000	2,606.00	2,606,000	
メディカル・データ・ビジョン	2,600	931.00	2,420,600	
g u m i	2,800	821.00	2,298,800	
ショーケース	600	338.00	202,800	
モバイルファクトリー	400	925.00	370,000	
テラスカイ	700	1,922.00	1,345,400	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	900	1,660.00	1,494,000	
P C Iホールディングス	800	1,021.00	816,800	
アイビーシー	800	406.00	324,800	
ネオジャパン	700	961.00	672,700	
P R T I M E S	600	1,868.00	1,120,800	
ラクス	8,500	1,737.00	14,764,500	
ランドコンピュータ	600	1,021.00	612,600	
ダブルスタンダード	800	2,026.00	1,620,800	
オープンドア	1,200	1,644.00	1,972,800	
マイネット	900	362.00	325,800	
アカツキ	900	2,229.00	2,006,100	
ベネフィットジャパン	200	1,203.00	240,600	
U b i c o mホールディングス	500	1,997.00	998,500	
カナミックネットワーク	2,200	511.00	1,124,200	
ノムラシステムコーポレーション	2,400	115.00	276,000	
レンゴー	16,800	867.00	14,565,600	
トーモク	1,200	1,614.00	1,936,800	
ザ・パック	1,300	2,897.00	3,766,100	
チェンジ	4,400	2,530.00	11,132,000	
シンクロ・フード	800	420.00	336,000	
オークネット	900	1,738.00	1,564,200	
キャピタル・アセット・プランニング	500	608.00	304,000	
セグエグループ	600	768.00	460,800	
エイトレッド	400	1,547.00	618,800	
マクロミル	3,500	980.00	3,430,000	
ビーグリー	500	1,243.00	621,500	

オロ	600	2,050.00	1,230,000	
ユーザーローカル	600	1,886.00	1,131,600	
テモナ	500	329.00	164,500	
ニーズウェル	500	947.00	473,500	
マネーフォワード	4,400	4,635.00	20,394,000	
サインポスト	600	556.00	333,600	
レゾナック・ホールディングス	17,500	2,301.00	40,267,500	
住友化学	134,400	479.00	64,377,600	
住友精化	800	4,600.00	3,680,000	
日産化学	8,600	6,060.00	52,116,000	
ラサ工業	700	2,196.00	1,537,200	
クレハ	1,500	8,500.00	12,750,000	
多木化学	700	4,615.00	3,230,500	
テイカ	1,400	1,204.00	1,685,600	
石原産業	3,500	1,132.00	3,962,000	
片倉コープアグリ	300	2,021.00	606,300	
日本曹達	2,000	4,810.00	9,620,000	
東ソー	24,200	1,875.00	45,375,000	
トクヤマ	6,000	2,194.00	13,164,000	
セントラル硝子	3,000	3,215.00	9,645,000	
東亜合成	9,300	1,287.00	11,969,100	
大阪ソーダ	1,100	4,495.00	4,944,500	
関東電化工業	3,800	1,056.00	4,012,800	
Sun Asterisk	900	1,131.00	1,017,900	
デンカ	6,700	2,849.00	19,088,300	
イビデン	10,500	5,070.00	53,235,000	
信越化学工業	30,200	20,280.00	612,456,000	
日本カーバイド工業	500	1,349.00	674,500	
電算システムホールディングス	800	2,527.00	2,021,600	
堺化学工業	1,400	1,842.00	2,578,800	
第一稀元素化学工業	1,900	1,041.00	1,977,900	
エア・ウォーター	17,100	1,692.00	28,933,200	
日本酸素ホールディングス	17,600	2,496.00	43,929,600	
日本化学工業	600	2,051.00	1,230,600	
東邦アセチレン	300	1,312.00	393,600	
日本パーカラライジング	8,900	1,021.00	9,086,900	
高圧ガス工業	2,500	727.00	1,817,500	
チタン工業	200	1,491.00	298,200	
四国化成ホールディングス	2,100	1,323.00	2,778,300	
戸田工業	400	2,537.00	1,014,800	
ステラ ケミファ	1,000	2,665.00	2,665,000	
保土谷化学工業	600	3,185.00	1,911,000	
日本触媒	2,800	5,780.00	16,184,000	
大日精化工業	1,200	1,878.00	2,253,600	
カネカ	4,200	3,525.00	14,805,000	
協和キリン	21,900	2,861.00	62,655,900	
Appier Group	5,100	2,026.00	10,332,600	
三菱瓦斯化学	13,500	2,015.00	27,202,500	
三井化学	14,900	3,365.00	50,138,500	



J S R	16,900	3,120.00	52,728,000	
東京応化工業	3,200	7,590.00	24,288,000	
大阪有機化学工業	1,300	2,098.00	2,727,400	
三菱ケミカルグループ	122,300	818.60	100,114,780	
KHネオケム	3,000	2,550.00	7,650,000	
ダイセル	26,600	1,013.00	26,945,800	
住友ベークライト	2,700	4,920.00	13,284,000	
積水化学工業	37,100	1,891.00	70,156,100	
日本ゼオン	11,000	1,323.00	14,553,000	
アイカ工業	4,500	3,135.00	14,107,500	
U B E	9,500	2,090.00	19,855,000	
積水樹脂	2,700	2,065.00	5,575,500	
タキロンシーアイ	4,500	508.00	2,286,000	
旭有機材	1,200	2,933.00	3,519,600	
ニチバン	1,200	1,841.00	2,209,200	
リケンテクノス	3,700	597.00	2,208,900	
大倉工業	800	1,983.00	1,586,400	
積水化成品工業	2,600	419.00	1,089,400	
群栄化学工業	400	2,595.00	1,038,000	
タイガースポリマー	900	446.00	401,400	
ミライアル	400	1,587.00	634,800	
ダイキアクシス	700	700.00	490,000	
ダイキョーニシカワ	4,300	691.00	2,971,300	
竹本容器	700	837.00	585,900	
森六ホールディングス	900	1,917.00	1,725,300	
恵和	1,200	1,607.00	1,928,400	
日本化薬	13,800	1,215.00	16,767,000	
カーリットホールディングス	1,900	722.00	1,371,800	
ソルクシーズ	1,600	358.00	572,800	
C Lホールディングス	600	830.00	498,000	
プレステージ・インターナショナル	7,600	632.00	4,803,200	
フェイス	900	511.00	459,900	
プロトコーポレーション	2,200	1,177.00	2,589,400	
ハイマックス	500	1,481.00	740,500	
アミューズ	1,100	1,824.00	2,006,400	
野村総合研究所	37,200	3,045.00	113,274,000	
ドリームインキュベータ	600	3,105.00	1,863,000	
サイバネットシステム	1,400	925.00	1,295,000	
クイック	1,300	1,861.00	2,419,300	
T A C	300	205.00	61,500	
C Eホールディングス	1,000	542.00	542,000	
日本システム技術	600	1,660.00	996,000	
電通グループ	18,300	4,465.00	81,709,500	
インテージホールディングス	2,000	1,532.00	3,064,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	1,451.00	725,500	
東邦システムサイエンス	700	1,121.00	784,700	
びあ	700	3,270.00	2,289,000	
イオンファンタジー	800	2,816.00	2,252,800	
ソースネクスト	8,800	233.00	2,050,400	

シーティーエス	2,300	774.00	1,780,200	
ネクシィーズグループ	900	665.00	598,500	
インフォコム	2,300	2,352.00	5,409,600	
メディカルシステムネットワーク	1,400	406.00	568,400	
日本精化	1,000	2,598.00	2,598,000	
扶桑化学工業	1,700	3,800.00	6,460,000	
トリケミカル研究所	2,100	2,523.00	5,298,300	
シンプレクス・ホールディングス	3,000	2,388.00	7,164,000	
HEROZ	500	1,277.00	638,500	
ラクスル	4,800	1,583.00	7,598,400	
メルカリ	8,300	2,554.00	21,198,200	
I P S	600	2,573.00	1,543,800	
F I G	1,600	304.00	486,400	
システムサポート	600	1,806.00	1,083,600	
ADEKA	6,400	2,297.00	14,700,800	
日油	5,600	6,080.00	34,048,000	
ミヨシ油脂	600	973.00	583,800	
新日本理化	2,800	222.00	621,600	
ハリマ化成グループ	1,400	919.00	1,286,600	
イーソル	1,200	805.00	966,000	
アルテリア・ネットワークス	1,600	1,328.00	2,124,800	
東海ソフト	100	913.00	91,300	
ウイングアーク1st	1,800	1,870.00	3,366,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	600	1,579.00	947,400	
サーバーワークス	300	2,642.00	792,600	
東名	200	2,586.00	517,200	
ヴィッツ	200	939.00	187,800	
トビラシステムズ	500	891.00	445,500	
S a n s a n	5,900	1,705.00	10,059,500	
L i n k - U	600	958.00	574,800	
ギフトィ	1,800	2,679.00	4,822,200	
花王	44,200	5,031.00	222,370,200	
第一工業製薬	700	1,968.00	1,377,600	
石原ケミカル	1,000	1,379.00	1,379,000	
日華化学	700	857.00	599,900	
ニイタカ	400	2,107.00	842,800	
三洋化成工業	1,100	4,415.00	4,856,500	
メドレー	1,800	4,165.00	7,497,000	
ベース	600	5,080.00	3,048,000	
J M D C	3,000	4,340.00	13,020,000	
武田薬品工業	160,700	4,276.00	687,153,200	
アステラス製薬	174,000	1,908.50	332,079,000	
住友ファーマ	13,200	822.00	10,850,400	
塩野義製薬	23,200	6,066.00	140,731,200	
わかもと製薬	2,200	232.00	510,400	
日本新薬	4,300	5,940.00	25,542,000	
中外製薬	56,800	3,381.00	192,040,800	
科研製薬	3,100	3,705.00	11,485,500	
エーザイ	22,100	7,425.00	164,092,500	

理研ビタミン	1,500	2,010.00	3,015,000	
ロート製薬	17,600	2,524.00	44,422,400	
小野薬品工業	35,000	2,808.00	98,280,000	
久光製薬	4,000	3,835.00	15,340,000	
有機合成薬品工業	1,300	302.00	392,600	
持田製薬	2,200	3,430.00	7,546,000	
参天製薬	34,100	1,049.00	35,770,900	
扶桑薬品工業	700	2,005.00	1,403,500	
日本ケミファ	100	1,799.00	179,900	
ツムラ	5,700	2,602.00	14,831,400	
日医工	6,400	42.00	268,800	
テルモ	55,700	3,632.00	202,302,400	
H. U. グループホールディングス	5,400	2,718.00	14,677,200	
キッセイ薬品工業	2,900	2,507.00	7,270,300	
生化学工業	3,700	824.00	3,048,800	
栄研化学	2,900	1,605.00	4,654,500	
鳥居薬品	1,000	3,235.00	3,235,000	
JCRファーマ	6,000	1,479.00	8,874,000	
東和薬品	2,800	1,907.00	5,339,600	
富士製薬工業	1,200	1,077.00	1,292,400	
ゼリア新薬工業	2,500	2,193.00	5,482,500	
第一三共	158,200	4,431.00	700,984,200	
キョーリン製薬ホールディングス	4,100	1,692.00	6,937,200	
大幸薬品	3,200	389.00	1,244,800	
ダイト	1,200	2,521.00	3,025,200	
大塚ホールディングス	41,500	3,960.00	164,340,000	
大正製薬ホールディングス	4,000	5,470.00	21,880,000	
ペプチドリーム	8,700	1,805.00	15,703,500	
大日本塗料	2,400	857.00	2,056,800	
日本ペイントホールディングス	80,200	1,198.00	96,079,600	
関西ペイント	16,600	1,776.00	29,481,600	
神東塗料	2,000	131.00	262,000	
中国塗料	2,900	1,118.00	3,242,200	
日本特殊塗料	900	953.00	857,700	
藤倉化成	2,500	460.00	1,150,000	
太陽ホールディングス	2,800	2,484.00	6,955,200	
DIC	7,200	2,445.00	17,604,000	
サカタインクス	3,600	1,058.00	3,808,800	
東洋インキSCホールディングス	3,500	1,965.00	6,877,500	
T&K TOKA	1,600	1,122.00	1,795,200	
アルプス技研	1,600	2,484.00	3,974,400	
サニックス	2,300	295.00	678,500	
日本空調サービス	2,100	735.00	1,543,500	
オリエンタルランド	19,700	21,470.00	422,959,000	
フォーカスシステムズ	1,300	1,035.00	1,345,500	
ダスキン	4,100	3,145.00	12,894,500	
パーク24	13,900	1,966.00	27,327,400	
明光ネットワークジャパン	2,300	619.00	1,423,700	
ファルコホールディングス	900	1,995.00	1,795,500	

クレスコ	1,500	1,766.00	2,649,000	
フジ・メディア・ホールディングス	17,400	1,154.00	20,079,600	
秀英予備校	1,000	427.00	427,000	
田谷	800	533.00	426,400	
ラウンドワン	15,900	533.00	8,474,700	
リゾートトラスト	7,300	2,128.00	15,534,400	
オービック	6,100	20,100.00	122,610,000	
ジャストシステム	2,700	3,380.00	9,126,000	
TDCソフト	1,700	1,507.00	2,561,900	
Zホールディングス	258,300	376.50	97,249,950	
ビー・エム・エル	2,300	3,190.00	7,337,000	
トレンドマイクロ	10,500	6,440.00	67,620,000	
りらいあコミュニケーションズ	3,000	1,456.00	4,368,000	
IDホールディングス	1,300	1,004.00	1,305,200	
リソー教育	9,200	325.00	2,990,000	
日本オラクル	3,500	9,300.00	32,550,000	
早稲田アカデミー	1,200	1,240.00	1,488,000	
アルファシステムズ	500	4,215.00	2,107,500	
フューチャー	4,400	1,745.00	7,678,000	
CAC Holdings	1,200	1,658.00	1,989,600	
SBテクノロジー	900	2,068.00	1,861,200	
トーセ	700	744.00	520,800	
ユー・エス・エス	19,100	2,268.00	43,318,800	
オービックビジネスコンサルタント	3,600	4,730.00	17,028,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	9,700	3,045.00	29,536,500	
アイティフォー	2,500	868.00	2,170,000	
東京個別指導学院	1,700	517.00	878,900	
東計電算	200	6,180.00	1,236,000	
サイバーエージェント	44,500	1,117.00	49,706,500	
楽天グループ	86,000	679.00	58,394,000	
エクスネット	500	1,052.00	526,000	
クリーク・アンド・リバー社	1,000	2,261.00	2,261,000	
モーニングスター	3,500	500.00	1,750,000	
テー・オー・ダブリュー	3,300	309.00	1,019,700	
大塚商会	10,300	4,630.00	47,689,000	
サイボウズ	2,400	3,115.00	7,476,000	
山田コンサルティンググループ	1,000	1,544.00	1,544,000	
セントラルスポーツ	700	2,533.00	1,773,100	
バラカ	600	2,063.00	1,237,800	
電通国際情報サービス	2,200	4,840.00	10,648,000	
ACCESS	2,300	1,005.00	2,311,500	
デジタルガレージ	3,200	4,445.00	14,224,000	
EMシステムズ	3,000	865.00	2,595,000	
ウェザーニューズ	600	6,680.00	4,008,000	
CIJ	1,600	1,127.00	1,803,200	
ビジネスエンジニアリング	300	3,015.00	904,500	
日本エンタープライズ	4,000	134.00	536,000	
WOWOW	900	1,282.00	1,153,800	
スカラ	1,700	726.00	1,234,200	

インテリジェント ウェイブ	1,000	709.00	709,000	
フルキャストホールディングス	1,700	2,581.00	4,387,700	
エン・ジャパン	3,400	2,474.00	8,411,600	
あすか製薬ホールディングス	1,800	1,160.00	2,088,000	
サワイグループホールディングス	4,200	3,740.00	15,708,000	
富士フイルムホールディングス	34,800	6,549.00	227,905,200	
コニカミノルタ	40,700	594.00	24,175,800	
資生堂	37,900	6,389.00	242,143,100	
ライオン	21,700	1,467.00	31,833,900	
高砂香料工業	1,200	2,565.00	3,078,000	
マンダム	4,000	1,464.00	5,856,000	
ミルボン	2,700	5,600.00	15,120,000	
ファンケル	7,900	2,500.00	19,750,000	
コーセー	3,700	15,680.00	58,016,000	
コタ	1,500	1,708.00	2,562,000	
シーボン	100	1,608.00	160,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	9,400	1,736.00	16,318,400	
ノエビアホールディングス	1,600	5,420.00	8,672,000	
アジュバンホールディングス	300	1,048.00	314,400	
新日本製薬	900	1,431.00	1,287,900	
エステー	1,300	1,581.00	2,055,300	
アグロ カネショウ	700	1,613.00	1,129,100	
コニシ	3,100	1,938.00	6,007,800	
長谷川香料	3,700	3,005.00	11,118,500	
星光PMC	1,100	548.00	602,800	
小林製薬	5,300	8,240.00	43,672,000	
荒川化学工業	1,600	1,040.00	1,664,000	
メック	1,500	2,375.00	3,562,500	
日本高純度化学	500	2,529.00	1,264,500	
タカラバイオ	4,800	1,774.00	8,515,200	
JCU	2,100	3,430.00	7,203,000	
新田ゼラチン	1,200	836.00	1,003,200	
OATアグリオ	600	1,489.00	893,400	
デクセリアルズ	5,200	2,822.00	14,674,400	
アース製薬	1,600	4,785.00	7,656,000	
北興化学工業	1,900	861.00	1,635,900	
大成ラミック	600	2,972.00	1,783,200	
クミアイ化学工業	7,100	876.00	6,219,600	
日本農薬	3,200	712.00	2,278,400	
富士興産	500	1,227.00	613,500	
ニチレキ	2,300	1,534.00	3,528,200	
ユシロ化学工業	1,000	865.00	865,000	
ビーピー・カストロール	700	906.00	634,200	
富士石油	3,300	268.00	884,400	
MORESCO	700	1,145.00	801,500	
出光興産	20,100	3,050.00	61,305,000	
ENEOSホールディングス	328,000	477.20	156,521,600	
コスモエネルギーホールディングス	7,100	4,200.00	29,820,000	
テスホールディングス	1,800	1,107.00	1,992,600	

インフロニア・ホールディングス	18,900	1,085.00	20,506,500	
横浜ゴム	10,300	2,635.00	27,140,500	
TOYO TIRE	10,400	1,590.00	16,536,000	
ブリヂストン	58,000	5,271.00	305,718,000	
住友ゴム工業	17,700	1,237.00	21,894,900	
藤倉コンポジット	1,000	1,022.00	1,022,000	
オカモト	1,000	4,005.00	4,005,000	
WOW WORLD GROUP	400	1,497.00	598,800	
アキレス	1,300	1,383.00	1,797,900	
フコク	900	1,066.00	959,400	
ニッタ	1,900	3,060.00	5,814,000	
クリエートメディック	600	899.00	539,400	
住友理工	3,400	705.00	2,397,000	
三ツ星ベルト	2,600	4,030.00	10,478,000	
バンドー化学	2,800	1,072.00	3,001,600	
AGC	18,500	5,100.00	94,350,000	
日本板硝子	9,100	742.00	6,752,200	
石塚硝子	200	1,529.00	305,800	
有沢製作所	3,000	1,407.00	4,221,000	
日本山村硝子	700	747.00	522,900	
日本電気硝子	7,400	2,593.00	19,188,200	
オハラ	800	1,249.00	999,200	
住友大阪セメント	2,500	3,810.00	9,525,000	
太平洋セメント	11,500	2,540.00	29,210,000	
リソルホールディングス	200	4,975.00	995,000	
日本ヒューム	1,900	697.00	1,324,300	
日本コンクリート工業	3,900	246.00	959,400	
三谷セキサン	800	4,765.00	3,812,000	
アジアパイルホールディングス	3,100	740.00	2,294,000	
東海カーボン	15,100	1,368.00	20,656,800	
日本カーボン	1,100	4,145.00	4,559,500	
東洋炭素	1,100	4,295.00	4,724,500	
ノリタケカンパニーリミテド	900	4,575.00	4,117,500	
TOTO	12,000	4,565.00	54,780,000	
日本碍子	21,400	1,843.00	39,440,200	
日本特殊陶業	13,800	2,790.00	38,502,000	
ダントーホールディングス	1,200	438.00	525,600	
MARUWA	700	17,810.00	12,467,000	
品川リフラクトリーズ	500	4,630.00	2,315,000	
黒崎播磨	400	6,970.00	2,788,000	
ヨータイ	1,300	1,582.00	2,056,600	
東京窯業	2,000	343.00	686,000	
ニッカトー	800	605.00	484,000	
フジミインコーポレーテッド	1,400	6,670.00	9,338,000	
クニミネ工業	600	919.00	551,400	
エーアンドエーマテリアル	300	949.00	284,700	
ニチアス	4,600	2,713.00	12,479,800	
日本製鉄	83,600	3,165.00	264,594,000	
神戸製鋼所	37,400	1,016.00	37,998,400	

中山製鋼所	3,100	1,118.00	3,465,800	
合同製鐵	900	3,815.00	3,433,500	
JFEホールディングス	49,900	1,784.00	89,021,600	
東京製鐵	5,200	1,553.00	8,075,600	
共英製鋼	2,300	1,681.00	3,866,300	
大和工業	3,100	5,720.00	17,732,000	
東京鐵鋼	800	1,905.00	1,524,000	
大阪製鐵	800	1,449.00	1,159,200	
淀川製鋼所	2,100	2,744.00	5,762,400	
中部鋼鉄	1,500	2,492.00	3,738,000	
丸一鋼管	5,700	3,000.00	17,100,000	
モリ工業	400	3,255.00	1,302,000	
大同特殊鋼	2,400	5,470.00	13,128,000	
日本高周波鋼業	1,400	352.00	492,800	
日本冶金工業	1,400	4,510.00	6,314,000	
山陽特殊製鋼	1,800	2,687.00	4,836,600	
愛知製鋼	1,200	2,458.00	2,949,600	
日本金属	500	962.00	481,000	
大平洋金属	1,300	2,079.00	2,702,700	
新日本電工	11,800	380.00	4,484,000	
栗本鐵工所	900	2,105.00	1,894,500	
虹技	500	1,075.00	537,500	
日本鑄鉄管	300	1,000.00	300,000	
日本製鋼所	5,100	2,651.00	13,520,100	
三菱製鋼	1,300	1,362.00	1,770,600	
日亜鋼業	2,400	306.00	734,400	
日本精線	300	4,730.00	1,419,000	
エンビプロ・ホールディングス	1,400	736.00	1,030,400	
大紀アルミニウム工業所	2,600	1,531.00	3,980,600	
日本軽金属ホールディングス	5,000	1,518.00	7,590,000	
三井金属鉱業	5,500	3,480.00	19,140,000	
東邦亜鉛	1,100	2,207.00	2,427,700	
三菱マテリアル	12,400	2,248.00	27,875,200	
住友金属鉱山	21,600	5,336.00	115,257,600	
DOWAホールディングス	4,200	4,560.00	19,152,000	
古河機械金属	2,900	1,414.00	4,100,600	
エス・サイエンス	19,300	27.00	521,100	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,800	3,155.00	8,834,000	
東邦チタニウム	3,300	2,081.00	6,867,300	
UACJ	2,600	2,770.00	7,202,000	
CKサンエツ	400	4,300.00	1,720,000	
古河電気工業	6,200	2,448.00	15,177,600	
住友電気工業	64,500	1,712.00	110,424,000	
フジクラ	20,300	973.00	19,751,900	
昭和電線ホールディングス	1,800	1,935.00	3,483,000	
タツタ電線	3,600	711.00	2,559,600	
カナレ電気	400	1,295.00	518,000	
平河ヒューテック	1,100	1,556.00	1,711,600	
いよぎんホールディングス	21,500	812.00	17,458,000	

しずおかフィナンシャルグループ	40,200	1,079.00	43,375,800	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	14,900	951.00	14,169,900	
リョービ	1,900	1,534.00	2,914,600	
アーレスティ	1,800	604.00	1,087,200	
アサヒホールディングス	7,700	2,040.00	15,708,000	
東洋製罐グループホールディングス	12,300	1,816.00	22,336,800	
ホッカインホールディングス	1,100	1,354.00	1,489,400	
コロナ	1,100	915.00	1,006,500	
横河ブリッジホールディングス	2,600	2,097.00	5,452,200	
駒井ハルテック	300	1,749.00	524,700	
高田機工	100	2,754.00	275,400	
三和ホールディングス	17,100	1,450.00	24,795,000	
文化シヤッター	5,300	1,139.00	6,036,700	
三協立山	2,600	752.00	1,955,200	
アルインコ	1,400	1,055.00	1,477,000	
東洋シヤッター	600	531.00	318,600	
L I X I L	27,200	2,255.00	61,336,000	
日本ファイルコン	1,200	465.00	558,000	
ノーリツ	2,700	1,709.00	4,614,300	
長府製作所	1,800	2,146.00	3,862,800	
リンナイ	3,400	9,660.00	32,844,000	
ユニプレス	3,200	906.00	2,899,200	
ダイニチ工業	700	687.00	480,900	
日東精工	2,500	553.00	1,382,500	
三洋工業	100	1,950.00	195,000	
岡部	2,900	769.00	2,230,100	
ジーテクト	2,100	1,468.00	3,082,800	
東プレ	3,200	1,246.00	3,987,200	
高周波熱錬	3,400	699.00	2,376,600	
東京製綱	1,200	1,305.00	1,566,000	
サンコール	1,300	632.00	821,600	
モリテック スチール	900	313.00	281,700	
パイオラックス	2,500	2,031.00	5,077,500	
エイチワン	1,900	660.00	1,254,000	
日本発條	16,400	935.00	15,334,000	
中央発條	1,000	755.00	755,000	
アドバネクス	200	1,170.00	234,000	
三浦工業	7,600	3,280.00	24,928,000	
タクマ	5,600	1,379.00	7,722,400	
テクノプロ・ホールディングス	11,000	3,620.00	39,820,000	
アトラグループ	700	186.00	130,200	
インターワークス	700	376.00	263,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	900	2,302.00	2,071,800	
K e e P e r 技研	1,100	4,795.00	5,274,500	
ファーストロジック	400	906.00	362,400	
三機サービス	300	930.00	279,000	
G u n o s y	1,100	612.00	673,200	
デザインワン・ジャパン	600	192.00	115,200	
イー・ガーディアン	800	2,356.00	1,884,800	



リブセンス	500	262.00	131,000	
ジャパンマテリアル	5,700	2,402.00	13,691,400	
ベクトル	2,800	1,441.00	4,034,800	
ウチヤマホールディングス	1,300	280.00	364,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,500	1,078.00	1,617,000	
キャリアリンク	700	2,308.00	1,615,600	
I B J	1,000	832.00	832,000	
アサンテ	900	1,703.00	1,532,700	
バリューHR	1,600	1,661.00	2,657,600	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,700	3,690.00	6,273,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	800	1,122.00	897,600	
ERIホールディングス	500	1,521.00	760,500	
アビスト	200	3,010.00	602,000	
シグマクシス・ホールディングス	2,400	1,125.00	2,700,000	
ウィルグループ	1,500	1,139.00	1,708,500	
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,800	152.00	273,600	
メドピア	1,500	1,236.00	1,854,000	
レアジョブ	600	1,178.00	706,800	
リクルートホールディングス	137,800	3,691.00	508,619,800	
エラン	2,400	1,029.00	2,469,600	
ツガミ	4,000	1,528.00	6,112,000	
オークマ	1,800	5,870.00	10,566,000	
芝浦機械	1,800	3,165.00	5,697,000	
アマダ	29,100	1,271.00	36,986,100	
アイダエンジニアリング	3,800	829.00	3,150,200	
TAKI SAWA	600	1,174.00	704,400	
FUJ I	7,900	2,149.00	16,977,100	
牧野フライス製作所	2,000	5,000.00	10,000,000	
オーエスジー	8,700	2,020.00	17,574,000	
ダイジェット工業	400	855.00	342,000	
旭ダイヤモンド工業	5,400	866.00	4,676,400	
DMG森精機	11,000	2,268.00	24,948,000	
ソディック	4,600	775.00	3,565,000	
ディスコ	2,900	43,100.00	124,990,000	
日東工器	800	1,879.00	1,503,200	
日進工具	1,600	1,124.00	1,798,400	
パンチ工業	1,700	467.00	793,900	
富士ダイス	1,000	779.00	779,000	
土木管理総合試験所	1,200	319.00	382,800	
日本郵政	244,000	1,220.50	297,802,000	
ベルシステム24ホールディングス	2,400	1,470.00	3,528,000	
鎌倉新書	2,200	1,167.00	2,567,400	
SMN	400	456.00	182,400	
一蔵	400	533.00	213,200	
グローバルキッズCOMPANY	400	812.00	324,800	
エアトリ	1,300	2,607.00	3,389,100	
アトラエ	1,400	934.00	1,307,600	
ストライク	800	3,795.00	3,036,000	
ソラスト	5,000	675.00	3,375,000	

セラク	600	1,477.00	886,200	
インソース	4,600	1,329.00	6,113,400	
豊田自動織機	13,200	8,400.00	110,880,000	
豊和工業	1,000	1,014.00	1,014,000	
石川製作所	500	1,447.00	723,500	
東洋機械金属	900	598.00	538,200	
津田駒工業	800	540.00	432,000	
エンシュウ	400	706.00	282,400	
島精機製作所	2,900	1,924.00	5,579,600	
オプトラン	2,600	2,287.00	5,946,200	
NCホールディングス	300	1,976.00	592,800	
イワキポンプ	1,300	1,331.00	1,730,300	
フリュー	1,800	1,255.00	2,259,000	
ヤマシンフィルタ	3,800	390.00	1,482,000	
日阪製作所	1,700	982.00	1,669,400	
やまびこ	2,900	1,311.00	3,801,900	
野村マイクロ・サイエンス	600	4,450.00	2,670,000	
平田機工	900	6,870.00	6,183,000	
ペガサスミシン製造	2,100	683.00	1,434,300	
マルマエ	800	1,848.00	1,478,400	
タツモ	1,000	2,175.00	2,175,000	
ナブテスコ	11,500	3,560.00	40,940,000	
三井海洋開発	2,200	1,515.00	3,333,000	
レオン自動機	2,200	1,278.00	2,811,600	
SMC	5,900	72,730.00	429,107,000	
ホソカワミクロン	1,400	2,858.00	4,001,200	
ユニオンツール	800	3,340.00	2,672,000	
オイレス工業	2,500	1,690.00	4,225,000	
日精エー・エス・ビー機械	800	4,440.00	3,552,000	
サトーホールディングス	2,600	2,348.00	6,104,800	
技研製作所	1,900	2,799.00	5,318,100	
日本エアテック	900	1,121.00	1,008,900	
カワタ	800	893.00	714,400	
日精樹脂工業	1,400	1,040.00	1,456,000	
オカダアイオン	600	1,738.00	1,042,800	
ワイエイシイホールディングス	800	2,234.00	1,787,200	
小松製作所	85,700	3,426.00	293,608,200	
住友重機械工業	10,800	3,245.00	35,046,000	
日立建機	7,300	3,360.00	24,528,000	
日工	2,800	638.00	1,786,400	
巴工業	800	2,459.00	1,967,200	
井関農機	1,800	1,228.00	2,210,400	
TOWA	1,800	1,968.00	3,542,400	
丸山製作所	400	1,800.00	720,000	
北川鉄工所	900	1,145.00	1,030,500	
シンニッタン	2,400	261.00	626,400	
ローツェ	900	11,340.00	10,206,000	
タカキタ	200	447.00	89,400	
クボタ	96,800	2,114.00	204,635,200	

荏原実業	800	2,749.00	2,199,200	
東洋エンジニアリング	2,700	605.00	1,633,500	
三菱化工機	600	2,329.00	1,397,400	
月島機械	2,600	1,131.00	2,940,600	
帝国電機製作所	1,400	2,841.00	3,977,400	
東京機械製作所	300	563.00	168,900	
新東工業	3,500	829.00	2,901,500	
澁谷工業	1,800	2,488.00	4,478,400	
アイチ コーポレーション	2,500	821.00	2,052,500	
小森コーポレーション	4,300	1,057.00	4,545,100	
鶴見製作所	1,300	2,135.00	2,775,500	
日本ギア工業	1,200	555.00	666,000	
酒井重工業	200	4,100.00	820,000	
荏原製作所	7,500	5,880.00	44,100,000	
石井鐵工所	300	2,320.00	696,000	
西島製作所	1,500	1,580.00	2,370,000	
北越工業	1,900	1,499.00	2,848,100	
ダイキン工業	21,800	23,730.00	517,314,000	
オルガノ	2,400	3,395.00	8,148,000	
トーヨーカネツ	800	2,818.00	2,254,400	
栗田工業	10,200	6,220.00	63,444,000	
椿本チエイン	2,600	3,280.00	8,528,000	
大同工業	900	794.00	714,600	
日機装	4,500	960.00	4,320,000	
木村化工機	1,700	709.00	1,205,300	
レイズネクスト	2,600	1,475.00	3,835,000	
アネスト岩田	3,300	1,015.00	3,349,500	
ダイフク	9,400	7,570.00	71,158,000	
サムコ	500	3,665.00	1,832,500	
加藤製作所	900	1,077.00	969,300	
油研工業	200	2,150.00	430,000	
タダノ	9,700	1,065.00	10,330,500	
フジテック	6,700	3,300.00	22,110,000	
CKD	5,200	2,164.00	11,252,800	
平和	6,000	2,602.00	15,612,000	
理想科学工業	1,600	2,507.00	4,011,200	
SANKYO	3,600	5,530.00	19,908,000	
日本金銭機械	2,100	1,274.00	2,675,400	
マースグループホールディングス	1,000	2,653.00	2,653,000	
フクシマガリレイ	1,400	4,535.00	6,349,000	
オーイズミ	900	524.00	471,600	
ダイコク電機	900	2,957.00	2,661,300	
竹内製作所	3,200	3,065.00	9,808,000	
アマノ	5,300	2,561.00	13,573,300	
JUKI	2,900	661.00	1,916,900	
サンデン	1,900	220.00	418,000	
ジャノメ	1,700	652.00	1,108,400	
ブラザー工業	24,400	2,034.00	49,629,600	
マックス	2,400	2,187.00	5,248,800	

モリタホールディングス	3,400	1,258.00	4,277,200	
グローリー	4,800	2,937.00	14,097,600	
新晃工業	2,000	1,627.00	3,254,000	
大和冷機工業	2,700	1,318.00	3,558,600	
セガサミーホールディングス	14,700	2,454.00	36,073,800	
日本ピストンリング	700	1,383.00	968,100	
リケン	700	2,690.00	1,883,000	
T P R	2,300	1,436.00	3,302,800	
ツバキ・ナカシマ	4,700	1,056.00	4,963,200	
ホシザキ	11,800	4,920.00	58,056,000	
大豊工業	1,700	673.00	1,144,100	
日本精工	33,500	763.00	25,560,500	
N T N	37,000	344.00	12,728,000	
ジェイテクト	16,500	1,035.00	17,077,500	
不二越	1,300	4,000.00	5,200,000	
ミネベアミツミ	31,800	2,478.00	78,800,400	
日本トムソン	4,500	605.00	2,722,500	
THK	10,500	3,240.00	34,020,000	
ユーシン精機	1,600	753.00	1,204,800	
前澤給装工業	1,500	1,007.00	1,510,500	
イーグル工業	1,900	1,229.00	2,335,100	
前澤工業	800	645.00	516,000	
日本ピラー工業	1,700	3,570.00	6,069,000	
キッツ	6,700	898.00	6,016,600	
日立製作所	88,900	7,172.00	637,590,800	
東芝	35,200	4,253.00	149,705,600	
三菱電機	189,000	1,573.50	297,391,500	
富士電機	11,100	5,440.00	60,384,000	
東洋電機製造	700	911.00	637,700	
安川電機	21,700	5,580.00	121,086,000	
シンフォニアテクノロジー	2,000	1,730.00	3,460,000	
明電舎	2,800	2,007.00	5,619,600	
オリジン	300	1,322.00	396,600	
山洋電気	800	5,840.00	4,672,000	
デンヨー	1,300	1,683.00	2,187,900	
PHCホールディングス	2,700	1,469.00	3,966,300	
ソシオネクスト	1,900	9,480.00	18,012,000	
ベイクレント・コンサルティング	14,700	5,540.00	81,438,000	
Orchestra Holdings	400	1,860.00	744,000	
アイモバイル	800	1,256.00	1,004,800	
キャリアインデックス	600	349.00	209,400	
MS-Japan	500	1,081.00	540,500	
船場	500	750.00	375,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディン	6,500	2,000.00	13,000,000	
フルテック	400	1,100.00	440,000	
グリーンズ	700	1,343.00	940,100	
ツナググループ・ホールディングス	400	705.00	282,000	
GameWith	700	337.00	235,900	
MS&Consulting	500	576.00	288,000	

ウェルビー	1,300	689.00	895,700	
エル・ティール・エス	300	2,547.00	764,100	
ミダックホールディングス	900	2,683.00	2,414,700	
日総工産	1,500	703.00	1,054,500	
キュービーネットホールディングス	900	1,386.00	1,247,400	
R P Aホールディングス	3,300	347.00	1,145,100	
三櫻工業	2,900	711.00	2,061,900	
マキタ	22,700	3,260.00	74,002,000	
東芝テック	2,700	3,930.00	10,611,000	
芝浦メカトロニクス	300	15,480.00	4,644,000	
マブチモーター	4,600	3,785.00	17,411,000	
日本電産	44,464	6,965.00	309,691,760	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	600	500.00	300,000	
トレックス・セミコンダクター	800	2,475.00	1,980,000	
東光高岳	1,200	2,335.00	2,802,000	
ダブル・スコープ	6,100	1,336.00	8,149,600	
宮越ホールディングス	800	861.00	688,800	
ダイヘン	1,700	4,410.00	7,497,000	
ヤーマン	3,100	1,551.00	4,808,100	
J V Cケンウッド	17,200	404.00	6,948,800	
ミマキエンジニアリング	1,900	615.00	1,168,500	
I - P E X	1,000	1,359.00	1,359,000	
日新電機	4,500	1,696.00	7,632,000	
大崎電気工業	3,700	538.00	1,990,600	
オムロン	16,800	7,608.00	127,814,400	
日東工業	2,500	2,788.00	6,970,000	
I D E C	2,600	3,445.00	8,957,000	
正興電機製作所	600	979.00	587,400	
不二電機工業	200	1,122.00	224,400	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6,000	2,450.00	14,700,000	
サクサホールディングス	300	1,562.00	468,600	
メルコホールディングス	500	3,385.00	1,692,500	
テクノメディカ	500	1,761.00	880,500	
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	600	893.00	535,800	
日本電気	25,900	4,890.00	126,651,000	
富士通	18,200	18,335.00	333,697,000	
沖電気工業	8,500	723.00	6,145,500	
岩崎通信機	600	788.00	472,800	
電気興業	700	2,290.00	1,603,000	
サンケン電気	1,700	10,070.00	17,119,000	
ナカヨ	300	1,161.00	348,300	
アイホン	1,100	2,027.00	2,229,700	
ルネサスエレクトロニクス	119,300	1,813.00	216,290,900	
セイコーエプソン	24,300	1,887.00	45,854,100	
ワコム	14,300	671.00	9,595,300	
アルバック	4,300	5,300.00	22,790,000	
アクセル	600	1,666.00	999,600	
E I Z O	1,300	3,865.00	5,024,500	
ジャパンディスプレイ	72,600	41.00	2,976,600	

日本信号	4,100	1,059.00	4,341,900	
京三製作所	4,400	422.00	1,856,800	
能美防災	2,400	1,704.00	4,089,600	
ホーチキ	1,400	1,521.00	2,129,400	
星和電機	400	468.00	187,200	
エレコム	4,500	1,307.00	5,881,500	
パナソニック ホールディングス	216,000	1,213.50	262,116,000	
シャープ	21,900	949.00	20,783,100	
アンリツ	12,800	1,262.00	16,153,600	
富士通ゼネラル	5,200	3,850.00	20,020,000	
ソニーグループ	128,100	11,840.00	1,516,704,000	
TDK	28,900	4,830.00	139,587,000	
帝国通信工業	900	1,550.00	1,395,000	
タムラ製作所	8,000	775.00	6,200,000	
アルプスアルパイン	16,300	1,301.00	21,206,300	
池上通信機	600	615.00	369,000	
日本電波工業	2,100	1,433.00	3,009,300	
鈴木	1,000	1,032.00	1,032,000	
メイコー	2,000	3,020.00	6,040,000	
日本トリム	400	3,035.00	1,214,000	
ローランド ディー. ジー.	1,000	3,245.00	3,245,000	
フォスター電機	2,000	1,038.00	2,076,000	
SMK	500	2,589.00	1,294,500	
ヨコオ	1,500	2,011.00	3,016,500	
ティアック	3,000	117.00	351,000	
ホシデン	4,500	1,687.00	7,591,500	
ヒロセ電機	3,000	17,190.00	51,570,000	
日本航空電子工業	3,700	2,277.00	8,424,900	
TOA	2,200	825.00	1,815,000	
マクセル	4,100	1,470.00	6,027,000	
古野電気	2,500	969.00	2,422,500	
スミダコーポレーション	1,600	1,632.00	2,611,200	
アイコム	700	2,568.00	1,797,600	
リオン	800	1,885.00	1,508,000	
横河電機	20,000	2,134.00	42,680,000	
新電元工業	700	3,765.00	2,635,500	
アズビル	12,600	3,640.00	45,864,000	
東亜ディーケーケー	1,000	815.00	815,000	
日本光電工業	8,300	3,520.00	29,216,000	
チノー	600	2,079.00	1,247,400	
共和電業	1,700	351.00	596,700	
日本電子材料	1,000	1,554.00	1,554,000	
堀場製作所	4,000	7,630.00	30,520,000	
アドバンテスト	14,300	11,230.00	160,589,000	
小野測器	600	429.00	257,400	
エスペック	1,400	2,062.00	2,886,800	
キーエンス	18,100	60,950.00	1,103,195,000	
日置電機	900	8,100.00	7,290,000	
シスメックス	15,600	8,489.00	132,428,400	

日本マイクロニクス	2,900	1,352.00	3,920,800	
メガチップス	1,600	2,903.00	4,644,800	
OBARA GROUP	900	3,950.00	3,555,000	
IMAGICA GROUP	1,600	649.00	1,038,400	
澤藤電機	400	1,280.00	512,000	
デンソー	37,300	7,561.00	282,025,300	
原田工業	600	889.00	533,400	
コーセル	2,300	1,136.00	2,612,800	
イリソ電子工業	1,700	4,885.00	8,304,500	
オブテックスグループ	3,300	2,042.00	6,738,600	
千代田インテグレ	600	2,277.00	1,366,200	
レーザーテック	8,300	22,395.00	185,878,500	
スタンレー電気	12,900	2,940.00	37,926,000	
岩崎電気	700	4,450.00	3,115,000	
ウシオ電機	9,400	1,592.00	14,964,800	
岡谷電機産業	1,300	323.00	419,900	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,500	377.00	565,500	
エノモト	400	1,848.00	739,200	
日本セラミック	1,800	2,696.00	4,852,800	
遠藤照明	600	875.00	525,000	
古河電池	1,500	1,169.00	1,753,500	
双信電機	900	397.00	357,300	
山一電機	1,500	1,960.00	2,940,000	
図研	1,400	3,500.00	4,900,000	
日本電子	4,500	4,260.00	19,170,000	
カシオ計算機	13,700	1,313.00	17,988,100	
ファナック	17,800	24,325.00	432,985,000	
日本シイエムケイ	4,000	495.00	1,980,000	
エンブラス	500	4,225.00	2,112,500	
大真空	2,100	752.00	1,579,200	
ローム	8,400	10,650.00	89,460,000	
浜松ホトニクス	14,500	6,830.00	99,035,000	
三井ハイテック	1,900	7,190.00	13,661,000	
新光電気工業	6,400	3,915.00	25,056,000	
京セラ	28,100	6,870.00	193,047,000	
協栄産業	300	2,232.00	669,600	
太陽誘電	8,800	4,260.00	37,488,000	
村田製作所	54,900	7,664.00	420,753,600	
双葉電子工業	3,600	562.00	2,023,200	
日東電工	13,200	8,650.00	114,180,000	
北陸電気工業	600	1,448.00	868,800	
東海理化電機製作所	5,200	1,611.00	8,377,200	
ニチコン	3,900	1,384.00	5,397,600	
日本ケミコン	1,700	2,210.00	3,757,000	
KOA	2,800	1,902.00	5,325,600	
三井E&Sホールディングス	7,600	446.00	3,389,600	
日立造船	14,900	947.00	14,110,300	
三菱重工業	32,000	5,097.00	163,104,000	
川崎重工業	13,600	3,050.00	41,480,000	

I H I	11,500	3,550.00	40,825,000	
名村造船所	4,600	390.00	1,794,000	
サノヤスホールディングス	1,400	137.00	191,800	
スプリックス	800	884.00	707,200	
マネジメンツソリューションズ	1,000	3,490.00	3,490,000	
プロレド・パートナーズ	600	503.00	301,800	
a n d f a c t o r y	300	369.00	110,700	
テノ.ホールディングス	300	845.00	253,500	
フロンティア・マネジメント	600	1,172.00	703,200	
ピアラ	200	538.00	107,600	
コプロ・ホールディングス	200	1,216.00	243,200	
ギークス	400	1,164.00	465,600	
カーブスホールディングス	5,600	782.00	4,379,200	
フォーラムエンジニアリング	1,300	923.00	1,199,900	
F a s t F i t n e s s J a p a n	500	1,512.00	756,000	
日本車輛製造	700	1,996.00	1,397,200	
三菱ロジスネクスト	2,800	849.00	2,377,200	
近畿車輛	100	1,539.00	153,900	
一家ホールディングス	400	600.00	240,000	
フルサト・マルカホールディングス	1,900	2,988.00	5,677,200	
ヤマエグループホールディングス	1,000	1,859.00	1,859,000	
ジャパンプラフトホールディングス	300	586.00	175,800	
F P G	7,100	1,194.00	8,477,400	
島根銀行	700	537.00	375,900	
じもとホールディングス	1,300	438.00	569,400	
全国保証	4,700	5,450.00	25,615,000	
めぶきフィナンシャルグループ	88,200	360.00	31,752,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,600	1,044.00	1,670,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,300	2,851.00	6,557,300	
九州フィナンシャルグループ	31,800	510.00	16,218,000	
かんぽ生命保険	21,600	2,434.00	52,574,400	
ゆうちょ銀行	50,700	1,219.00	61,803,300	
あんしん保証	1,300	263.00	341,900	
富山第一銀行	4,800	684.00	3,283,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	98,100	581.00	56,996,100	
ジェイリース	500	2,272.00	1,136,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	11,200	1,126.00	12,611,200	
イントラスト	800	968.00	774,400	
日本モーゲージサービス	1,100	803.00	883,300	
C a s a	700	832.00	582,400	
アルヒ	2,200	1,118.00	2,459,600	
プレミアグループ	3,000	1,606.00	4,818,000	
日産自動車	257,100	553.60	142,330,560	
いすゞ自動車	52,600	1,676.00	88,157,600	
トヨタ自動車	994,600	1,905.50	1,895,210,300	
日野自動車	23,200	562.00	13,038,400	
三菱自動車工業	70,500	545.00	38,422,500	
エフテック	1,400	680.00	952,000	
レシップホールディングス	1,100	473.00	520,300	



GMB	700	896.00	627,200	
ファルテック	700	606.00	424,200	
武蔵精密工業	4,400	1,766.00	7,770,400	
日産車体	3,000	858.00	2,574,000	
新明和工業	5,900	1,149.00	6,779,100	
極東開発工業	3,100	1,530.00	4,743,000	
トピー工業	1,400	1,960.00	2,744,000	
ティラド	500	2,378.00	1,189,000	
曙ブレーキ工業	11,400	150.00	1,710,000	
タチエス	2,900	1,280.00	3,712,000	
NOK	7,000	1,380.00	9,660,000	
フタバ産業	5,000	444.00	2,220,000	
KYB	1,700	3,890.00	6,613,000	
市光工業	2,500	442.00	1,105,000	
大同メタル工業	4,000	524.00	2,096,000	
プレス工業	8,100	490.00	3,969,000	
ミクニ	2,500	357.00	892,500	
太平洋工業	4,300	1,182.00	5,082,600	
河西工業	2,400	210.00	504,000	
アイシン	13,900	3,795.00	52,750,500	
マツダ	59,800	1,309.00	78,278,200	
今仙電機製作所	1,000	855.00	855,000	
本田技研工業	147,200	3,619.00	532,716,800	
スズキ	33,200	4,939.00	163,974,800	
SUBARU	57,300	2,237.50	128,208,750	
安永	800	1,040.00	832,000	
ヤマハ発動機	28,400	3,615.00	102,666,000	
小糸製作所	21,700	2,360.00	51,212,000	
TBK	2,100	277.00	581,700	
エクセディ	2,900	1,836.00	5,324,400	
ミツバ	3,600	554.00	1,994,400	
豊田合成	5,300	2,298.00	12,179,400	
愛三工業	3,300	947.00	3,125,100	
盟和産業	500	1,002.00	501,000	
日本プラスト	1,500	420.00	630,000	
ヨロズ	1,800	843.00	1,517,400	
エフ・シー・シー	3,100	1,542.00	4,780,200	
新家工業	300	2,401.00	720,300	
シマノ	7,400	21,865.00	161,801,000	
ティ・エス テック	8,200	1,752.00	14,366,400	
三十三フィナンシャルグループ	1,500	1,716.00	2,574,000	
第四北越フィナンシャルグループ	2,800	3,195.00	8,946,000	
ひろぎんホールディングス	23,600	696.00	16,425,600	
マーキュリアホールディングス	900	761.00	684,900	
おきなわフィナンシャルグループ	1,800	2,338.00	4,208,400	
ダイレクトマーケティングミックス	2,100	1,481.00	3,110,100	
ポピンズ	400	1,802.00	720,800	
LITALICO	1,400	2,568.00	3,595,200	
十六フィナンシャルグループ	2,300	3,230.00	7,429,000	

北國フィナンシャルホールディングス	1,500	4,265.00	6,397,500	
ネットプロテクションズホールディングス	6,400	610.00	3,904,000	
プロクレアホールディングス	2,200	2,274.00	5,002,800	
あいちフィナンシャルグループ	2,600	2,535.00	6,591,000	
ジャムコ	800	1,764.00	1,411,200	
小野建	1,700	1,548.00	2,631,600	
はるやまホールディングス	500	476.00	238,000	
南陽	400	2,157.00	862,800	
ノジマ	6,300	1,398.00	8,807,400	
佐島電機	1,000	1,814.00	1,814,000	
カッパ・クリエイト	2,900	1,455.00	4,219,500	
エコートレーディング	100	849.00	84,900	
伯東	1,100	5,400.00	5,940,000	
コンドーテック	1,500	1,095.00	1,642,500	
中山福	1,000	350.00	350,000	
ライトオン	1,500	566.00	849,000	
ナガイレーベン	2,400	2,036.00	4,886,400	
三菱食品	1,800	3,370.00	6,066,000	
良品計画	24,700	1,366.00	33,740,200	
パリミキホールディングス	2,400	289.00	693,600	
松田産業	1,500	2,371.00	3,556,500	
第一興商	3,700	4,310.00	15,947,000	
メディパルホールディングス	19,800	1,838.00	36,392,400	
アドヴァングループ	2,000	956.00	1,912,000	
S P K	800	1,633.00	1,306,400	
萩原電気ホールディングス	700	3,055.00	2,138,500	
アルビス	600	2,460.00	1,476,000	
アズワン	2,800	5,590.00	15,652,000	
スズデン	700	2,782.00	1,947,400	
尾家産業	300	1,070.00	321,000	
シモジマ	1,200	1,023.00	1,227,600	
ドウシシャ	2,000	1,926.00	3,852,000	
小津産業	400	1,780.00	712,000	
コナカ	2,300	357.00	821,100	
高速	900	1,978.00	1,780,200	
ハウス オブ ローゼ	300	1,660.00	498,000	
G-7ホールディングス	2,300	1,471.00	3,383,300	
たけびし	700	1,672.00	1,170,400	
イオン北海道	2,800	832.00	2,329,600	
コジマ	3,600	557.00	2,005,200	
ヒマラヤ	700	929.00	650,300	
コーナン商事	2,600	3,210.00	8,346,000	
ネットワンシステムズ	6,700	3,080.00	20,636,000	
エコス	700	1,831.00	1,281,700	
ワタミ	2,500	909.00	2,272,500	
マルシェ	700	390.00	273,000	
リックス	300	2,580.00	774,000	
システムソフト	6,200	88.00	545,600	
パン・パシフィック・インターナショナルホ	38,600	2,602.00	100,437,200	

丸文	1,700	1,488.00	2,529,600	
西松屋チェーン	4,200	1,606.00	6,745,200	
ゼンショーホールディングス	10,500	3,950.00	41,475,000	
ハピネット	1,700	1,840.00	3,128,000	
幸楽苑ホールディングス	1,300	1,069.00	1,389,700	
ハークスレイ	800	757.00	605,600	
橋本総業ホールディングス	800	1,132.00	905,600	
日本ライフライン	5,600	982.00	5,499,200	
サイゼリヤ	3,100	3,250.00	10,075,000	
タカショー	1,900	696.00	1,322,400	
V Tホールディングス	7,100	521.00	3,699,100	
アルゴグラフィックス	1,600	3,955.00	6,328,000	
魚力	600	2,151.00	1,290,600	
I D O M	5,700	845.00	4,816,500	
日本エム・ディ・エム	1,200	1,043.00	1,251,600	
ポプラ	700	137.00	95,900	
フジ・コーポレーション	1,100	1,291.00	1,420,100	
ユナイテッドアローズ	2,200	1,825.00	4,015,000	
進和	1,200	2,192.00	2,630,400	
エスケイジャパン	900	564.00	507,600	
ダイトロン	800	2,602.00	2,081,600	
ハイデイ日高	2,800	2,061.00	5,770,800	
シークス	2,900	1,475.00	4,277,500	
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i	2,200	204.00	448,800	
コロワイド	8,900	1,915.00	17,043,500	
ピーシーデポコーポレーション	2,300	305.00	701,500	
田中商事	800	624.00	499,200	
オーハシテクニカ	1,100	1,582.00	1,740,200	
壱番屋	1,500	4,840.00	7,260,000	
白銅	700	2,648.00	1,853,600	
トップカルチャー	1,700	200.00	340,000	
P L A N T	700	664.00	464,800	
スギホールディングス	3,800	5,600.00	21,280,000	
ダイコー通産	300	1,168.00	350,400	
薬王堂ホールディングス	1,000	2,434.00	2,434,000	
島津製作所	22,000	3,935.00	86,570,000	
J M S	1,700	534.00	907,800	
クボテック	1,100	225.00	247,500	
長野計器	1,500	1,257.00	1,885,500	
ブイ・テクノロジー	900	2,522.00	2,269,800	
スター精密	3,500	1,777.00	6,219,500	
東京計器	1,300	1,310.00	1,703,000	
愛知時計電機	800	1,484.00	1,187,200	
インターアクション	1,000	1,489.00	1,489,000	
オーバル	1,900	500.00	950,000	
東京精密	4,000	5,070.00	20,280,000	
マニー	7,900	1,908.00	15,073,200	
ニコン	28,100	1,362.00	38,272,200	
トプコン	9,600	1,808.00	17,356,800	

オリンパス	113,200	2,370.00	268,284,000	
理研計器	1,100	5,410.00	5,951,000	
S C R E E Nホールディングス	3,100	11,230.00	34,813,000	
キヤノン電子	1,900	1,836.00	3,488,400	
タムロン	1,300	3,250.00	4,225,000	
HOYA	38,700	14,100.00	545,670,000	
シード	600	575.00	345,000	
ノーリツ鋼機	1,700	2,238.00	3,804,600	
A&Dホロンホールディングス	2,600	1,458.00	3,790,800	
朝日インテック	20,200	2,339.00	47,247,800	
キヤノン	99,300	2,947.00	292,637,100	
リコー	45,300	1,078.00	48,833,400	
シチズン時計	19,900	841.00	16,735,900	
リズム	600	1,655.00	993,000	
大研医器	1,000	494.00	494,000	
メニコン	6,200	2,968.00	18,401,600	
シンシア	400	615.00	246,000	
KYORITSU	2,600	141.00	366,600	
中本ボックス	400	1,581.00	632,400	
スノーピーク	3,100	2,218.00	6,875,800	
パラマウントベッドホールディングス	4,100	2,414.00	9,897,400	
トランザクション	1,200	1,489.00	1,786,800	
粧美堂	400	381.00	152,400	
ニホンフラッシュ	1,700	965.00	1,640,500	
前田工織	1,500	3,325.00	4,987,500	
永大産業	2,200	229.00	503,800	
アートネイチャー	1,800	761.00	1,369,800	
バンダイナムコホールディングス	16,500	8,541.00	140,926,500	
アイフィスジャパン	900	602.00	541,800	
SHOEI	1,900	5,460.00	10,374,000	
フランスベッドホールディングス	2,100	1,017.00	2,135,700	
マーベラス	3,200	719.00	2,300,800	
パイロットコーポレーション	2,800	4,415.00	12,362,000	
萩原工業	1,300	1,220.00	1,586,000	
エイベックス	3,100	1,560.00	4,836,000	
フジシールインターナショナル	3,600	1,609.00	5,792,400	
タカラトミー	8,300	1,382.00	11,470,600	
広済堂ホールディングス	1,000	2,405.00	2,405,000	
エステールホールディングス	400	640.00	256,000	
レック	2,600	915.00	2,379,000	
タカノ	900	716.00	644,400	
三光合成	2,300	582.00	1,338,600	
プロネクサス	1,600	988.00	1,580,800	
ホクシン	3,100	151.00	468,100	
ウッドワン	600	1,264.00	758,400	
大建工業	1,200	2,270.00	2,724,000	
きもと	3,100	205.00	635,500	
凸版印刷	23,600	2,551.00	60,203,600	
大日本印刷	21,500	3,755.00	80,732,500	

共同印刷	600	2,928.00	1,756,800	
N I S S H A	3,400	1,826.00	6,208,400	
光村印刷	300	1,319.00	395,700	
藤森工業	1,500	3,250.00	4,875,000	
ヴィア・ホールディングス	2,400	96.00	230,400	
TAKARA & COMPANY	1,300	2,233.00	2,902,900	
前澤化成工業	1,300	1,441.00	1,873,300	
未来工業	700	1,574.00	1,101,800	
アシックス	16,700	3,695.00	61,706,500	
ツツミ	300	2,260.00	678,000	
ウェーブロックホールディングス	300	628.00	188,400	
J S P	1,200	1,616.00	1,939,200	
ニチハ	2,200	2,700.00	5,940,000	
ローランド	1,300	4,055.00	5,271,500	
エフピコ	3,400	3,410.00	11,594,000	
小松ウオール工業	600	2,023.00	1,213,800	
ヤマハ	11,400	5,280.00	60,192,000	
河合楽器製作所	600	2,735.00	1,641,000	
クリナップ	1,900	719.00	1,366,100	
ピジョン	11,500	2,056.00	23,644,000	
天馬	1,500	2,442.00	3,663,000	
兼松サステック	200	2,245.00	449,000	
キングジム	1,700	896.00	1,523,200	
象印マホービン	5,300	1,677.00	8,888,100	
リンテック	3,700	2,243.00	8,299,100	
信越ポリマー	3,300	1,471.00	4,854,300	
東リ	4,900	293.00	1,435,700	
イトーキ	3,800	762.00	2,895,600	
任天堂	114,300	5,178.00	591,845,400	
三菱鉛筆	2,600	1,523.00	3,959,800	
松風	800	2,090.00	1,672,000	
タカラスタンダード	3,500	1,456.00	5,096,000	
コクヨ	8,700	1,896.00	16,495,200	
ナカバヤシ	1,700	486.00	826,200	
ニフコ	6,500	3,670.00	23,855,000	
立川ブラインド工業	900	1,288.00	1,159,200	
グローブライド	1,400	2,641.00	3,697,400	
オカムラ	5,600	1,370.00	7,672,000	
バルカー	1,500	3,390.00	5,085,000	
MU TO Hホールディングス	200	1,769.00	353,800	
伊藤忠商事	118,100	4,303.00	508,184,300	
丸紅	151,200	1,911.00	288,943,200	
スクロール	3,200	829.00	2,652,800	
高島	200	2,969.00	593,800	
ヨンドシーホールディングス	1,600	1,755.00	2,808,000	
三陽商会	500	1,546.00	773,000	
長瀬産業	9,000	2,114.00	19,026,000	
ナイガイ	1,200	258.00	309,600	
蝶理	1,000	2,627.00	2,627,000	

豊田通商	16,800	5,770.00	96,936,000	
オンワードホールディングス	12,100	341.00	4,126,100	
三共生興	2,600	578.00	1,502,800	
兼松	7,400	1,662.00	12,298,800	
美津濃	1,800	3,295.00	5,931,000	
ツカモトコーポレーション	200	1,418.00	283,600	
ルックホールディングス	400	2,221.00	888,400	
三井物産	140,200	4,220.00	591,644,000	
日本紙パルプ商事	1,000	5,390.00	5,390,000	
東京エレクトロン	12,800	48,600.00	622,080,000	
カメイ	2,000	1,522.00	3,044,000	
東都水産	100	5,890.00	589,000	
OUGホールディングス	200	2,506.00	501,200	
スターゼン	1,500	2,278.00	3,417,000	
セイコーグループ	2,800	2,928.00	8,198,400	
山善	5,400	1,078.00	5,821,200	
椿本興業	300	4,425.00	1,327,500	
住友商事	118,600	2,436.00	288,909,600	
B I P R O G Y	6,700	3,025.00	20,267,500	
内田洋行	900	5,150.00	4,635,000	
三菱商事	119,800	5,030.00	602,594,000	
第一実業	700	5,400.00	3,780,000	
キヤノンマーケティングジャパン	4,400	3,205.00	14,102,000	
西華産業	700	1,770.00	1,239,000	
佐藤商事	1,300	1,460.00	1,898,000	
菱洋エレクトロ	1,700	2,507.00	4,261,900	
東京産業	1,800	806.00	1,450,800	
ユアサ商事	1,700	3,855.00	6,553,500	
神鋼商事	500	6,320.00	3,160,000	
トルク	400	216.00	86,400	
阪和興業	3,500	4,080.00	14,280,000	
正栄食品工業	1,300	4,365.00	5,674,500	
カナデン	1,700	1,241.00	2,109,700	
菱電商事	1,600	1,931.00	3,089,600	
ニプロ	15,000	1,038.00	15,570,000	
岩谷産業	4,300	5,810.00	24,983,000	
ナイス	400	1,399.00	559,600	
ニチモウ	200	3,270.00	654,000	
極東貿易	1,200	1,551.00	1,861,200	
アステナホールディングス	2,800	432.00	1,209,600	
兼松エレクトロニクス	1,100	6,180.00	6,798,000	
三愛オブリ	5,000	1,448.00	7,240,000	
稲畑産業	3,800	2,775.00	10,545,000	
G S I クレオス	1,000	1,739.00	1,739,000	
明和産業	1,900	714.00	1,356,600	
クワザワホールディングス	300	489.00	146,700	
キムラタン	14,500	22.00	319,000	
ゴールドウイン	3,200	11,890.00	38,048,000	
ユニ・チャーム	37,800	5,113.00	193,271,400	

デサント	3,100	3,990.00	12,369,000	
キング	900	515.00	463,500	
ワキタ	3,400	1,155.00	3,927,000	
ヤマトインターナショナル	900	259.00	233,100	
東邦ホールディングス	4,700	2,281.00	10,720,700	
サンゲツ	4,900	2,420.00	11,858,000	
ミツウロコグループホールディングス	2,400	1,370.00	3,288,000	
シナネンホールディングス	600	3,560.00	2,136,000	
伊藤忠エネクス	4,600	1,134.00	5,216,400	
サンリオ	5,400	4,250.00	22,950,000	
サンワテクノス	900	2,050.00	1,845,000	
リョーサン	2,100	3,215.00	6,751,500	
新光商事	2,500	1,344.00	3,360,000	
トーヨー	900	1,784.00	1,605,600	
三信電気	700	2,563.00	1,794,100	
東陽テクニカ	2,000	1,405.00	2,810,000	
モスフードサービス	2,800	3,075.00	8,610,000	
加賀電子	1,600	5,060.00	8,096,000	
三益半導体工業	1,400	2,754.00	3,855,600	
都築電気	900	1,504.00	1,353,600	
ソーダニッカ	1,100	915.00	1,006,500	
立花エレテック	1,500	2,063.00	3,094,500	
木曾路	2,800	2,215.00	6,202,000	
S R Sホールディングス	2,900	922.00	2,673,800	
千趣会	3,700	394.00	1,457,800	
タカキュー	3,300	77.00	254,100	
リテールパートナーズ	2,800	1,335.00	3,738,000	
ケーヨー	3,100	854.00	2,647,400	
上新電機	1,700	2,039.00	3,466,300	
日本瓦斯	10,400	1,925.00	20,020,000	
ロイヤルホールディングス	3,600	2,702.00	9,727,200	
東天紅	300	745.00	223,500	
いなげや	1,800	1,342.00	2,415,600	
チヨダ	1,900	814.00	1,546,600	
ライフコーポレーション	1,700	2,698.00	4,586,600	
リンガーハット	2,500	2,219.00	5,547,500	
MrMaxHD	2,600	673.00	1,749,800	
テンアライド	1,400	287.00	401,800	
AOKIホールディングス	4,000	841.00	3,364,000	
オークワ	3,200	857.00	2,742,400	
コメリ	3,000	2,698.00	8,094,000	
青山商事	4,200	991.00	4,162,200	
しまむら	2,200	13,300.00	29,260,000	
はせがわ	500	368.00	184,000	
高島屋	14,400	1,948.00	28,051,200	
松屋	3,500	1,097.00	3,839,500	
エイチ・ツー・オー リテイリング	9,300	1,435.00	13,345,500	
近鉄百貨店	700	2,435.00	1,704,500	
丸井グループ	14,100	2,064.00	29,102,400	

クレディセゾン	11,200	1,861.00	20,843,200	
アクシアル リテイリング	1,300	3,560.00	4,628,000	
井筒屋	500	343.00	171,500	
イオン	64,900	2,578.50	167,344,650	
イズミ	2,900	3,020.00	8,758,000	
フォーバル	700	1,059.00	741,300	
平和堂	3,300	2,094.00	6,910,200	
フジ	3,100	1,737.00	5,384,700	
ヤオコー	2,200	6,900.00	15,180,000	
ゼビオホールディングス	2,800	1,003.00	2,808,400	
ケーズホールディングス	15,400	1,194.00	18,387,600	
PAL TAC	3,000	5,040.00	15,120,000	
三谷産業	4,200	327.00	1,373,400	
O l y m p i cグループ	1,000	512.00	512,000	
日産東京販売ホールディングス	2,900	353.00	1,023,700	
S B I 新生銀行	5,200	2,458.00	12,781,600	
あおぞら銀行	11,200	2,624.00	29,388,800	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,132,600	972.50	1,101,453,500	
りそなホールディングス	225,600	750.40	169,290,240	
三井住友トラスト・ホールディングス	32,400	5,208.00	168,739,200	
三井住友フィナンシャルグループ	130,300	6,056.00	789,096,800	
千葉銀行	49,600	990.00	49,104,000	
群馬銀行	35,100	501.00	17,585,100	
武蔵野銀行	2,300	2,516.00	5,786,800	
千葉興業銀行	3,500	581.00	2,033,500	
筑波銀行	8,000	235.00	1,880,000	
七十七銀行	5,800	2,344.00	13,595,200	
秋田銀行	1,300	1,952.00	2,537,600	
山形銀行	2,100	1,217.00	2,555,700	
岩手銀行	1,300	2,451.00	3,186,300	
東邦銀行	13,700	235.00	3,219,500	
東北銀行	900	1,041.00	936,900	
ふくおかフィナンシャルグループ	14,200	3,010.00	42,742,000	
スルガ銀行	15,500	428.00	6,634,000	
八十二銀行	36,400	613.00	22,313,200	
山梨中央銀行	1,700	1,342.00	2,281,400	
大垣共立銀行	3,300	2,021.00	6,669,300	
福井銀行	1,700	1,689.00	2,871,300	
清水銀行	800	1,553.00	1,242,400	
富山銀行	300	1,744.00	523,200	
滋賀銀行	2,900	2,871.00	8,325,900	
南都銀行	2,700	2,672.00	7,214,400	
百五銀行	16,500	416.00	6,864,000	
京都銀行	5,600	6,510.00	36,456,000	
紀陽銀行	6,300	1,632.00	10,281,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	11,600	1,056.00	12,249,600	
山陰合同銀行	11,200	838.00	9,385,600	
鳥取銀行	400	1,247.00	498,800	
百十四銀行	1,700	1,983.00	3,371,100	



四国銀行	3,000	964.00	2,892,000	
阿波銀行	2,600	2,203.00	5,727,800	
大分銀行	1,200	2,320.00	2,784,000	
宮崎銀行	1,200	2,677.00	3,212,400	
佐賀銀行	1,100	1,840.00	2,024,000	
琉球銀行	4,000	1,056.00	4,224,000	
セブン銀行	64,800	274.00	17,755,200	
みずほフィナンシャルグループ	258,000	2,153.00	555,474,000	
高知銀行	700	752.00	526,400	
山口フィナンシャルグループ	20,000	921.00	18,420,000	
芙蓉総合リース	1,600	9,340.00	14,944,000	
みずほリース	2,700	3,695.00	9,976,500	
東京センチュリー	3,300	4,775.00	15,757,500	
SBIホールディングス	25,800	2,924.00	75,439,200	
日本証券金融	7,100	1,036.00	7,355,600	
アイフル	29,300	372.00	10,899,600	
日本アジア投資	2,300	261.00	600,300	
長野銀行	600	1,551.00	930,600	
名古屋銀行	1,200	3,560.00	4,272,000	
北洋銀行	26,700	314.00	8,383,800	
大光銀行	700	1,259.00	881,300	
愛媛銀行	2,300	988.00	2,272,400	
トマト銀行	700	1,108.00	775,600	
京葉銀行	8,700	645.00	5,611,500	
栃木銀行	7,900	343.00	2,709,700	
北日本銀行	600	2,257.00	1,354,200	
東和銀行	3,500	610.00	2,135,000	
福島銀行	1,300	254.00	330,200	
大東銀行	900	733.00	659,700	
リコーリース	1,700	4,020.00	6,834,000	
イオンフィナンシャルサービス	10,400	1,282.00	13,332,800	
アコム	31,500	338.00	10,647,000	
ジャックス	1,900	4,430.00	8,417,000	
オリエントコーポレーション	4,900	1,177.00	5,767,300	
オリックス	117,200	2,466.00	289,015,200	
三菱HCキャピタル	69,400	721.00	50,037,400	
ジャフコグループ	6,000	2,245.00	13,470,000	
九州リースサービス	800	936.00	748,800	
トモニホールディングス	14,300	395.00	5,648,500	
大和証券グループ本社	127,400	651.00	82,937,400	
野村ホールディングス	328,400	564.20	185,283,280	
岡三証券グループ	16,100	433.00	6,971,300	
丸三証券	6,200	437.00	2,709,400	
東洋証券	6,500	343.00	2,229,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19,400	379.00	7,352,600	
光世証券	900	414.00	372,600	
水戸証券	5,300	306.00	1,621,800	
いちよし証券	3,100	644.00	1,996,400	
松井証券	10,300	806.00	8,301,800	

SOMPOホールディングス	30,600	5,816.00	177,969,600	
日本取引所グループ	50,100	2,023.50	101,377,350	
マネックスグループ	19,700	476.00	9,377,200	
極東証券	2,600	633.00	1,645,800	
岩井コスモホールディングス	2,000	1,384.00	2,768,000	
アイザワ証券グループ	2,400	706.00	1,694,400	
フィデアホールディングス	1,900	1,518.00	2,884,200	
池田泉州ホールディングス	23,500	261.00	6,133,500	
アニコムホールディングス	6,400	536.00	3,430,400	
MS&ADインシュアランスグループホール	36,300	4,487.00	162,878,100	
マネーパートナーズグループ	2,000	250.00	500,000	
スパークス・グループ	1,900	1,569.00	2,981,100	
小林洋行	1,300	242.00	314,600	
第一生命ホールディングス	90,800	2,876.50	261,186,200	
東京海上ホールディングス	179,600	2,868.00	515,092,800	
アドバンテッジリスクマネジメント	1,400	459.00	642,600	
イー・ギャランティ	2,800	2,148.00	6,014,400	
アサックス	600	667.00	400,200	
NECキャピタルソリューション	800	2,693.00	2,154,400	
T&Dホールディングス	47,800	1,998.00	95,504,400	
アドバンスクリエイト	1,200	1,181.00	1,417,200	
三井不動産	77,500	2,553.00	197,857,500	
三菱地所	107,600	1,673.00	180,014,800	
平和不動産	2,900	3,785.00	10,976,500	
東京建物	16,900	1,665.00	28,138,500	
京阪神ビルディング	2,200	1,214.00	2,670,800	
住友不動産	32,200	3,160.00	101,752,000	
太平洋興発	700	949.00	664,300	
テーオーシー	3,500	663.00	2,320,500	
東京楽天地	300	4,405.00	1,321,500	
レオパレス21	19,800	330.00	6,534,000	
スターツコーポレーション	2,600	2,648.00	6,884,800	
フジ住宅	2,400	693.00	1,663,200	
空港施設	2,000	571.00	1,142,000	
明和地所	700	938.00	656,600	
ゴールドクレスト	1,600	1,707.00	2,731,200	
リログroup	10,300	2,184.00	22,495,200	
エスリード	800	2,177.00	1,741,600	
日神グループホールディングス	3,300	480.00	1,584,000	
日本エスコン	3,900	866.00	3,377,400	
MIRARTHホールディングス	8,700	379.00	3,297,300	
AVANTIA	900	797.00	717,300	
イオンモール	9,400	1,779.00	16,722,600	
毎日コムネット	400	766.00	306,400	
ファースト住建	700	1,099.00	769,300	
ランド	110,100	10.00	1,101,000	
カチタス	4,800	2,653.00	12,734,400	
東祥	1,300	1,204.00	1,565,200	
トーセイ	2,900	1,527.00	4,428,300	

穴吹興産	400	2,268.00	907,200	
サンフロンティア不動産	2,900	1,273.00	3,691,700	
FJネクストホールディングス	2,000	1,019.00	2,038,000	
インテリックス	600	558.00	334,800	
ランドビジネス	1,700	232.00	394,400	
サンネクスタグループ	600	1,000.00	600,000	
グランディハウス	1,400	594.00	831,600	
東武鉄道	19,900	3,055.00	60,794,500	
相鉄ホールディングス	6,000	2,260.00	13,560,000	
東急	50,700	1,707.00	86,544,900	
京浜急行電鉄	20,500	1,271.00	26,055,500	
小田急電鉄	27,400	1,650.00	45,210,000	
京王電鉄	9,600	4,760.00	45,696,000	
京成電鉄	11,700	3,930.00	45,981,000	
富士急行	2,200	4,250.00	9,350,000	
東日本旅客鉄道	30,700	6,982.00	214,347,400	
西日本旅客鉄道	23,100	5,269.00	121,713,900	
東海旅客鉄道	13,900	15,265.00	212,183,500	
西武ホールディングス	21,800	1,350.00	29,430,000	
鴻池運輸	3,200	1,503.00	4,809,600	
西日本鉄道	4,800	2,402.00	11,529,600	
ハマキョウレックス	1,500	3,300.00	4,950,000	
サカイ引越センター	900	4,520.00	4,068,000	
近鉄グループホールディングス	18,100	4,170.00	75,477,000	
阪急阪神ホールディングス	24,100	3,945.00	95,074,500	
南海電気鉄道	8,600	2,764.00	23,770,400	
京阪ホールディングス	7,400	3,420.00	25,308,000	
神戸電鉄	500	3,195.00	1,597,500	
名古屋鉄道	19,900	2,058.00	40,954,200	
山陽電気鉄道	1,500	2,235.00	3,352,500	
アルプス物流	1,400	1,304.00	1,825,600	
トランコム	500	6,900.00	3,450,000	
ヤマトホールディングス	23,100	2,318.00	53,545,800	
山九	4,600	5,100.00	23,460,000	
日新	1,500	2,151.00	3,226,500	
丸運	700	230.00	161,000	
丸全昭和運輸	1,200	3,140.00	3,768,000	
センコーグループホールディングス	9,500	968.00	9,196,000	
トナミホールディングス	400	4,040.00	1,616,000	
ニッコンホールディングス	5,900	2,559.00	15,098,100	
日本石油輸送	200	2,355.00	471,000	
福山通運	1,400	3,455.00	4,837,000	
セイノーホールディングス	11,400	1,437.00	16,381,800	
エスライン	500	842.00	421,000	
神奈川中央交通	500	3,325.00	1,662,500	
AZ-COM丸和ホールディングス	4,300	1,806.00	7,765,800	
C&Fロジホールディングス	1,900	1,312.00	2,492,800	
日本郵船	48,300	3,580.00	172,914,000	
商船三井	31,800	3,605.00	114,639,000	

川崎汽船	15,400	3,320.00	51,128,000	
NSユニテッド海運	1,000	4,615.00	4,615,000	
明治海運	1,400	709.00	992,600	
飯野海運	6,500	1,135.00	7,377,500	
共栄タンカー	600	975.00	585,000	
九州旅客鉄道	12,800	3,015.00	38,592,000	
SGホールディングス	34,600	1,987.00	68,750,200	
NIPPON EXPRESSホールディング	6,700	7,850.00	52,595,000	
日本航空	44,400	2,593.00	115,129,200	
ANAホールディングス	49,200	2,812.00	138,350,400	
ビーウィズ	300	1,649.00	494,700	
パスコ	200	1,449.00	289,800	
TREホールディングス	4,000	1,579.00	6,316,000	
人・夢・技術グループ	800	1,536.00	1,228,800	
西本Wismettacホールディングス	500	3,635.00	1,817,500	
シルバーライフ	500	1,995.00	997,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,810.00	362,000	
Genky DrugStores	900	3,950.00	3,555,000	
コア商事ホールディングス	1,300	676.00	878,800	
KPPグループホールディングス	4,100	733.00	3,005,300	
ナルミヤ・インターナショナル	600	924.00	554,400	
ブックオフグループホールディングス	1,200	1,278.00	1,533,600	
ギフトホールディングス	400	4,345.00	1,738,000	
三菱倉庫	3,900	3,220.00	12,558,000	
三井倉庫ホールディングス	1,700	4,025.00	6,842,500	
住友倉庫	4,900	2,220.00	10,878,000	
澁澤倉庫	800	2,271.00	1,816,800	
ヤマタネ	900	1,714.00	1,542,600	
東陽倉庫	3,100	299.00	926,900	
乾汽船	2,400	2,148.00	5,155,200	
日本トランスシティ	4,100	608.00	2,492,800	
ケイヒン	300	1,642.00	492,600	
中央倉庫	1,100	1,056.00	1,161,600	
川西倉庫	300	1,022.00	306,600	
安田倉庫	1,500	1,031.00	1,546,500	
ファイズホールディングス	400	1,258.00	503,200	
大栄環境	3,500	1,866.00	6,531,000	
東洋埠頭	500	1,408.00	704,000	
上組	8,600	2,735.00	23,521,000	
サンリツ	700	755.00	528,500	
キムラユニティー	1,000	1,055.00	1,055,000	
キューソー流通システム	1,000	965.00	965,000	
東海運	1,000	298.00	298,000	
エーアイテイー	1,200	1,578.00	1,893,600	
内外トランスライン	600	2,231.00	1,338,600	
ショーエイコーポレーション	700	573.00	401,100	
日本コンセプト	600	1,473.00	883,800	
TBSホールディングス	9,400	1,764.00	16,581,600	
日本テレビホールディングス	16,300	1,122.00	18,288,600	

朝日放送グループホールディングス	1,900	678.00	1,288,200	
テレビ朝日ホールディングス	4,500	1,440.00	6,480,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	16,500	515.00	8,497,500	
テレビ東京ホールディングス	1,400	2,296.00	3,214,400	
日本BS放送	500	916.00	458,000	
ビジョン	2,300	1,656.00	3,808,800	
スマートバリュー	1,000	456.00	456,000	
USEN-NEXT HOLDINGS	1,600	2,528.00	4,044,800	
ワイヤレスゲート	1,100	264.00	290,400	
日本通信	17,300	237.00	4,100,100	
クロップス	300	1,150.00	345,000	
日本電信電話	232,800	3,979.00	926,311,200	
KDDI	140,400	4,052.00	568,900,800	
ソフトバンク	291,800	1,541.00	449,663,800	
光通信	2,100	20,180.00	42,378,000	
エムティーアイ	1,800	564.00	1,015,200	
GMOインターネットグループ	6,800	2,635.00	17,918,000	
ファイバーゲート	1,000	944.00	944,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	1,400	290.00	406,000	
KADOKAWA	9,600	2,730.00	26,208,000	
学研ホールディングス	2,900	865.00	2,508,500	
ゼンリン	3,400	855.00	2,907,000	
昭文社ホールディングス	1,500	300.00	450,000	
インプレスホールディングス	900	204.00	183,600	
東京電力ホールディングス	163,100	458.00	74,699,800	
中部電力	66,700	1,409.00	93,980,300	
関西電力	69,900	1,268.00	88,633,200	
中国電力	28,700	670.00	19,229,000	
北陸電力	17,200	591.00	10,165,200	
東北電力	44,100	638.00	28,135,800	
四国電力	15,300	736.00	11,260,800	
九州電力	41,600	726.00	30,201,600	
北海道電力	17,300	477.00	8,252,100	
沖縄電力	4,500	1,020.00	4,590,000	
電源開発	13,600	2,166.00	29,457,600	
エフオン	1,200	617.00	740,400	
イーレックス	3,200	1,988.00	6,361,600	
レノバ	4,900	2,146.00	10,515,400	
東京瓦斯	38,300	2,569.00	98,392,700	
大阪瓦斯	36,600	2,200.00	80,520,000	
東邦瓦斯	7,200	2,535.00	18,252,000	
北海道瓦斯	1,000	1,845.00	1,845,000	
広島ガス	3,800	353.00	1,341,400	
西部ガスホールディングス	1,600	1,806.00	2,889,600	
静岡ガス	4,100	1,148.00	4,706,800	
メタウォーター	2,200	1,707.00	3,755,400	
アイネット	1,000	1,293.00	1,293,000	
松竹	1,000	11,200.00	11,200,000	
東宝	11,300	4,750.00	53,675,000	

エイチ・アイ・エス	4,900	2,055.00	10,069,500	
東映	500	17,820.00	8,910,000	
ラックランド	600	2,897.00	1,738,200	
エヌ・ティ・ティ・データ	57,000	1,817.00	103,569,000	
共立メンテナンス	3,200	5,290.00	16,928,000	
イチネンホールディングス	2,100	1,311.00	2,753,100	
建設技術研究所	900	3,550.00	3,195,000	
スペース	1,400	912.00	1,276,800	
アインホールディングス	2,600	5,650.00	14,690,000	
燦ホールディングス	900	2,150.00	1,935,000	
ピー・シー・エー	1,000	1,270.00	1,270,000	
スバル興業	100	9,350.00	935,000	
東京テアトル	700	1,147.00	802,900	
タナベコンサルティンググループ	700	913.00	639,100	
ビジネスブレイン太田昭和	600	2,103.00	1,261,800	
ナガワ	500	7,520.00	3,760,000	
東京都競馬	1,500	3,815.00	5,722,500	
常磐興産	700	1,247.00	872,900	
カナモト	3,500	2,234.00	7,819,000	
D T S	3,900	3,270.00	12,753,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9,100	6,350.00	57,785,000	
シーイーシー	2,200	1,526.00	3,357,200	
カプコン	18,000	4,385.00	78,930,000	
西尾レントオール	1,800	3,150.00	5,670,000	
アイ・エス・ビー	900	1,251.00	1,125,900	
アゴーラ ホスピタリティグループ	9,000	26.00	234,000	
日本空港ビルデング	6,300	6,650.00	41,895,000	
トランス・コスモス	2,400	3,350.00	8,040,000	
乃村工藝社	8,000	899.00	7,192,000	
ジャステック	1,200	1,258.00	1,509,600	
S C S K	14,800	1,968.00	29,126,400	
藤田観光	900	3,385.00	3,046,500	
KNT-CTホールディングス	1,200	1,733.00	2,079,600	
日本管財	2,000	2,594.00	5,188,000	
トーカイ	1,700	1,964.00	3,338,800	
白洋舎	100	1,579.00	157,900	
セコム	19,000	7,992.00	151,848,000	
NSW	800	2,136.00	1,708,800	
セントラル警備保障	1,000	2,627.00	2,627,000	
アイネス	1,300	1,401.00	1,821,300	
丹青社	4,000	736.00	2,944,000	
メイテック	7,500	2,450.00	18,375,000	
TKC	3,200	3,705.00	11,856,000	
富士ソフト	2,000	8,110.00	16,220,000	
応用地質	1,800	2,128.00	3,830,400	
船井総研ホールディングス	3,900	2,873.00	11,204,700	
NSD	6,600	2,407.00	15,886,200	
進学会ホールディングス	1,400	310.00	434,000	
丸紅建材リース	200	2,005.00	401,000	

オオバ	1,300	738.00	959,400	
コナミグループ	7,800	6,260.00	48,828,000	
いであ	500	1,575.00	787,500	
学究社	600	2,025.00	1,215,000	
ベネッセホールディングス	7,000	2,024.00	14,168,000	
イオンディライト	2,000	2,963.00	5,926,000	
ナック	900	978.00	880,200	
福井コンピュータホールディングス	1,300	2,851.00	3,706,300	
ダイセキ	3,800	4,180.00	15,884,000	
ステップ	700	1,837.00	1,285,900	
日鉄物産	1,300	9,280.00	12,064,000	
泉州電業	1,000	3,510.00	3,510,000	
元気寿司	600	3,110.00	1,866,000	
トラスコ中山	4,000	2,223.00	8,892,000	
ヤマダホールディングス	78,400	485.00	38,024,000	
オートバックスセブン	6,600	1,462.00	9,649,200	
モリト	1,500	1,025.00	1,537,500	
アークランズ	2,800	1,482.00	4,149,600	
ニトリホールディングス	7,700	15,485.00	119,234,500	
グルメ杵屋	1,600	1,028.00	1,644,800	
愛眼	1,300	169.00	219,700	
ケーユーホールディングス	1,100	1,512.00	1,663,200	
吉野家ホールディングス	7,600	2,350.00	17,860,000	
加藤産業	2,400	3,625.00	8,700,000	
北恵	700	714.00	499,800	
イノテック	1,200	1,410.00	1,692,000	
イエローハット	3,500	1,812.00	6,342,000	
松屋フーズホールディングス	900	4,050.00	3,645,000	
JBC Cホールディングス	1,400	2,077.00	2,907,800	
JKホールディングス	1,600	1,147.00	1,835,200	
サガミホールディングス	3,100	1,300.00	4,030,000	
日伝	1,200	1,987.00	2,384,400	
関西フードマーケット	1,900	1,445.00	2,745,500	
ミロク情報サービス	1,800	1,795.00	3,231,000	
北沢産業	1,900	305.00	579,500	
杉本商事	800	2,023.00	1,618,400	
因幡電機産業	5,000	2,894.00	14,470,000	
王将フードサービス	1,300	6,110.00	7,943,000	
ミニストップ	1,500	1,385.00	2,077,500	
アークス	3,600	2,211.00	7,959,600	
パローホールディングス	3,800	2,001.00	7,603,800	
東テック	700	4,495.00	3,146,500	
ミスミグループ本社	28,900	3,430.00	99,127,000	
アルテック	1,000	305.00	305,000	
ベルク	900	5,540.00	4,986,000	
大庄	1,100	1,017.00	1,118,700	
タキヒヨー	300	985.00	295,500	
ファーストリテイリング	8,700	28,655.00	249,298,500	
ソフトバンクグループ	105,000	5,708.00	599,340,000	

蔵王産業	400	2,053.00	821,200	
スズケン	5,900	3,460.00	20,414,000	
サンドラッグ	7,200	3,585.00	25,812,000	
サックスパー ホールディングス	1,900	822.00	1,561,800	
ジェコス	1,400	904.00	1,265,600	
ヤマザワ	400	1,286.00	514,400	
やまや	400	2,638.00	1,055,200	
グローセル	2,200	428.00	941,600	
バルーナ	4,500	700.00	3,150,000	
合 計	21,302,064	—	53,012,482,760	

② 株式以外の有価証券

該当する事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

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（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。



# 独立監査人の中間監査報告書

2023年11月17日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社  
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榎原 康太

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているステート・ストリート日本株式インデックス・オープンの2023年3月7日から2023年9月6日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ステート・ストリート日本株式インデックス・オープンの2023年9月6日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年3月7日から2023年9月6日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められる

かどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ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. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。  
2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

【中間財務諸表】

ステート・ストリート日本株式インデックス・オープン

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前計算期間末 (2023年3月6日現在)	当中間計算期間末 (2023年9月6日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	147,816	626,732
コール・ローン	25,384,408	43,562,880
親投資信託受益証券	12,212,521,157	13,927,625,046
未収入金	15,900,000	40,400,000
流動資産合計	12,253,953,381	14,012,214,658
資産合計	12,253,953,381	14,012,214,658
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	28,351,938	71,481,007
未払受託者報酬	2,063,734	2,065,835
未払委託者報酬	9,630,738	9,640,461
未払利息	67	117
その他未払費用	687,857	688,604
流動負債合計	40,734,334	83,876,024
負債合計	40,734,334	83,876,024
純資産の部		
元本等		
元本	6,834,794,674	6,548,667,935
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	5,378,424,373	7,379,670,699
(分配準備積立金)	1,599,149,632	1,296,909,352
元本等合計	12,213,219,047	13,928,338,634
純資産合計	12,213,219,047	13,928,338,634
負債純資産合計	12,253,953,381	14,012,214,658

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 自 2022年3月8日 至 2022年9月7日	当中間計算期間 自 2023年3月7日 至 2023年9月6日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,073,377,300	2,217,213,889
営業収益合計	1,073,377,300	2,217,213,889
営業費用		
支払利息	17,584	15,085
受託者報酬	2,253,564	2,065,835
委託者報酬	10,516,576	9,640,461
その他費用	751,390	688,697
営業費用合計	13,539,114	12,410,078
営業利益又は営業損失(△)	1,059,838,186	2,204,803,811
経常利益又は経常損失(△)	1,059,838,186	2,204,803,811
中間純利益又は中間純損失(△)	1,059,838,186	2,204,803,811
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う中間純損失金額の分配額(△)	247,827,356	167,291,244
期首剰余金又は期首欠損金(△)	4,407,495,524	5,378,424,373
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,049,191,266	1,039,237,696
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	1,049,191,266	1,039,237,696
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,102,177,554	1,075,503,937
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	1,102,177,554	1,075,503,937
中間剰余金又は中間欠損金(△)	5,166,520,066	7,379,670,699

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
-------------------	--

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末 (2023年3月6日現在)	当中間計算期間末 (2023年9月6日現在)
1 期首元本額	8,242,506,024円	6,834,794,674円
期中追加設定元本額	2,307,955,686円	1,074,617,971円
期中一部解約元本額	3,715,667,036円	1,360,744,710円
2 受益権の総数	6,834,794,674口	6,548,667,935口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当する事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	前計算期間末 (2023年3月6日現在)	当中間計算期間末 (2023年9月6日現在)
1 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	中間貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（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。 (3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左  (2)有価証券 売買目的有価証券 同左  (3)デリバティブ取引 同左
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	同左

合、当該価額が異なることもありま す。
------------------------

(有価証券関係に関する注記)

該当する事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	前計算期間末 (2023年3月6日現在)	当中間計算期間末 (2023年9月6日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7869円 (17,869円)	2.1269円 (21,269円)

<参考>

当ファンドは「日本株式インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「日本株式インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2023年3月6日現在)	(2023年9月6日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		4,098,840	9,675,338
コール・ローン		703,891,541	672,512,789
株式		53,012,482,760	56,765,201,273
派生商品評価勘定		—	3,933,780
未収入金		19,104,480	12,620,506
未収配当金		105,426,527	34,418,512
差入委託証拠金		28,620,000	23,250,000
流動資産合計		53,873,624,148	57,521,612,198
資産合計		53,873,624,148	57,521,612,198
負債の部			
流動負債			
前受金		12,980,000	860,000
派生商品評価勘定		341,120	—
未払解約金		113,201,000	151,002,000
未払利息		1,884	1,806
その他未払費用		759	2,124
流動負債合計		126,524,763	151,865,930
負債合計		126,524,763	151,865,930
純資産の部			
元本等			
元本	1	14,558,908,008	13,042,881,349
剰余金			
剰余金又は欠損金 (△)		39,188,191,377	44,326,864,919
元本等合計		53,747,099,385	57,369,746,268
純資産合計		53,747,099,385	57,369,746,268
負債純資産合計		53,873,624,148	57,521,612,198

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年3月6日から、翌年3月5日までであります。

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、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。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	(2023年3月6日現在)	(2023年9月6日現在)
1 期首元本額	25,300,275,343円	14,558,908,008円
期中追加設定元本額	1,657,681,729円	830,423,711円
期中一部解約元本額	12,399,049,064円	2,346,450,370円
元本の内訳		
ファンド名		
AMC／ステート・ストリート・リ スクバジェット型バランス・オープ ン（ステイブル）	68,981,331円	60,246,870円
日本株式インデックス・ファンド （年金1）＜適格機関投資家限定＞	710,654,042円	668,116,430円
バランスファンド VA30A＜適格機関 投資家限定＞	2,898,566円	2,576,309円
バランスファンド VA30B＜適格機関 投資家限定＞	23,988,398円	17,484,784円
バランスファンド VA40A＜適格機関 投資家限定＞	95,561円	87,248円
バランスファンド VA40B＜適格機関 投資家限定＞	2,369,752円	840,042円
バランスファンド VA50A＜適格機関 投資家限定＞	4,168,214円	3,220,530円
バランスファンド VA50B＜適格機関 投資家限定＞	4,005,086,693円	3,540,100,856円
日本株式インデックス・ファンド VA1＜適格機関投資家限定＞	254,435,197円	288,665,062円
バランスファンド VA50C＜適格機関 投資家限定＞	2,111,954円	1,953,644円



バランスファンド VA25A<適格機関投資家限定>	524,962,098円	433,708,836円
バランスファンド VA37.5A<適格機関投資家限定>	435,713,404円	380,321,606円
バランスファンド VA75A<適格機関投資家限定>	31,673,865円	23,904,655円
日本株式インデックス・ファンドM<適格機関投資家限定>	73,098,076円	71,387,908円
日本株式インデックス・ファンドS<適格機関投資家限定>	76,775,165円	74,837,750円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	94,542,489円	73,511,811円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	1,423,723,607円	1,219,799,889円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	193,801,129円	150,694,161円
バランスファンド VA35A<適格機関投資家限定>	942,430,300円	788,149,327円
バランスファンド VA40C<適格機関投資家限定>	31,132,700円	26,909,014円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	9,828,013円	8,296,005円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	14,088,522円	12,551,005円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	5,225,456円	4,122,287円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	339,407,323円	287,568,126円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	1,174,704円	1,014,709円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	2,163,323円	1,969,264円
日本株式インデックス・ファンドVA2<適格機関投資家限定>	41,848,936円	57,529,563円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	200,452,844円	169,642,480円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	879,179,744円	741,950,461円
T a dリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）年金<適格機関投資家限定>	68,530,913円	60,848,258円
フレックス資産配分戦略ファンド<適格機関投資家限定>	430,650,499円	395,622,534円
T a dリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）<適格機関投資家限定>	45,838,046円	58,642,120円
ステート・ストリート日本株式インデックス・オープン	3,308,102,272円	3,166,448,800円
世界バランス40VA<適格機関投資家限定>	2,753,384円	2,341,370円

世界バランス60VA<適格機関投資家限定>	3,682,872円	1,651,296円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	194,223円	112,650円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	289,049,365円	236,181,603円
グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定>	10,430,102円	6,584,786円
グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定>	3,664,926円	3,287,300円
計	14,558,908,008円	13,042,881,349円
2 受益権の総数	14,558,908,008口	13,042,881,349口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2023年3月6日現在)	(2023年9月6日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表(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>(3)デリバティブ取引 「注記表(デリバティブ取引等関係に関する注記)」に記載しております。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</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る場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>「注記表(デリバティブ取引等関係に関する注記)」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ</p>	同左

	取引に係る市場リスクを示すものではありません。	
--	-------------------------	--

(有価証券関係に関する注記)

該当する事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項  
株式関連

(単位：円)

区 分	種 類	(2023年3月6日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX (先物)	644,000,000	—	643,680,000	△320,000
	合 計	644,000,000	—	643,680,000	△320,000

(単位：円)

区 分	種 類	(2023年9月6日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX (先物)	399,550,000	—	403,495,000	3,945,000
	合 計	399,550,000	—	403,495,000	3,945,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又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、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。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約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。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
5. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	(2023年3月6日現在)	(2023年9月6日現在)
1口当たり純資産額	3.6917円	4.3985円
(1万口当たり純資産額)	(36,917円)	(43,985円)

## 2 【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	13,607,194,923円
II 負債総額	55,712,543円
III 純資産総額 (I - II)	13,551,482,380円
IV 発行済口数	6,503,692,706口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	2.0837円

### <参考情報>

親投資信託受益証券 (日本株式インデックス・マザーファンド)

(2023年9月29日現在)

I 資産総額	54,828,351,193円
II 負債総額	366,992,751円
III 純資産総額 (I - II)	54,461,358,442円
IV 発行済口数	12,637,173,347口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	4.3096円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

受益者が委託会社に対して行う下記の手続きは、販売会社を通じて、委託会社に請求することにより行うことができます。詳しくは販売会社にお問い合わせ下さい。

### (1) 受益証券の名義書換等

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託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また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、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。したがって該当事項はありません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

### (2) 受益者等名簿の閉鎖の時期

該当事項はありません。

### (3) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

### (4) 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容

#### <受益権の譲渡>

- ① 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また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。
- ② 上記①の申請のある場合には、上記①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およ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または記録するものとします。ただし、上記①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。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- ③ 上記①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また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またはやむをえ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または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

### (5) その他内国投資信託受益証券事務に関し投資者に示すことが必要な事項

#### <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また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かか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また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。)に支払います。

<質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて>

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたが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（本書提出日現在）

###### ① 資本金の額

委託会社の資本金の額は金3億1千万円です。

###### ② 発行する株式の総数

委託会社の発行する株式の総数は6,200株です。

###### ③ 発行済株式の総数

委託会社の発行済株式総数は6,200株です。

###### ④ 最近5年間における主な資本金の額の増減

該当事項はありません。

##### (2) 委託会社の機構

###### ① 会社の意思決定機構

取締役会は、委託会社の業務執行の基本方針を決定します。代表取締役社長は、委託会社を代表し、全般の業務執行について指揮統括します。取締役は、委嘱された業務の執行にあたり、また、代表取締役社長に事故があるときにその職務を代行します。監査役は、委託会社の会計監査を行います。各部には、部長をおき、部長は、代表取締役社長または取締役の命を受け、所属員を指揮監督し、部の業務を統括します。

###### ② 投資運用の意思決定機構

###### 1) 運用基本方針の決定

投資政策委員会で、投資対象地域経済、産業、政治について更に精緻に分析を行い、投資対象企業、債券を様々な面より分析しつつ、基本的な運用方針を決定します。

###### 2) 運用実施計画の作成

ファンド・マネージャーは決定された運用基本方針に基づいて、具体的な銘柄選択と運用実施計画を作成します。

###### 3) 運用の実行

ファンド・マネージャーは運用計画に基づいて、組入有価証券の売買等を指図します。

#### 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、第一種金融商品取引業及び第二種金融商品取引業を行っています。

2023年9月末現在、委託会社の運用する証券投資信託は、121本であり、その純資産総額は3,299,243百万円です（親投資信託を除く、公募投資信託および私募投資信託の合計値です。）。

### 3 【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（以下「委託会社」といいます）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）ならびに同規則第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8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 委託会社は、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（2022年4月1日から2023年3月31日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。



# 独立監査人の監査報告書

2023年6月22日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

取締役会 御中

## EY 新日本 有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和  
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、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第26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、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

### 財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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。

監査役の責任は、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、監査役に対して、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。

監査人は、監査役に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容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) 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。

1. 財務諸表

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2022年3月31日現在)			当事業年度 (2023年3月31日現在)		
	金 額	構成比		金 額	構成比	
(資産の部)			%			%
流動資産						
預金		4,391,110			4,944,755	
有価証券		23,294			24,319	
前払金		119,649			232,900	
前払費用		29,290			34,419	
未収入金		688,466			615,211	
未収委託者報酬		685,229			665,966	
未収収益		42,751			36,568	
流動資産計		5,979,793	75.8		6,554,141	80.5
固定資産						
有形固定資産		375			112	
建物附属設備	※1	0		0		
器具備品	※1	375		112		
無形固定資産		0			0	
ソフトウェア		0		0		
投資その他の資産		1,904,306			1,586,165	
長期差入保証金		71,694		42,548		
繰延税金資産		1,826,336		1,537,341		
その他投資		6,275		6,275		
固定資産計		1,904,682	24.2		1,586,278	19.5
資産合計		7,884,475	100.0		8,140,419	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2022年3月31日現在)			当事業年度 (2023年3月31日現在)		
	金 額	構成比	%	金 額	構成比	%
(負債の部)			%			%
流動負債						
預り金		172,682		211,213		
未払金		344,370		341,855		
未払手数料	177,539			180,016		
その他未払金	166,831			161,839		
未払費用		11,699		12,884		
未払法人税等		296,332		176,932		
未払消費税等		30,068		25,106		
賞与引当金		74,876		92,579		
流動負債計		930,030	11.8	860,572		10.6
固定負債						
退職給付引当金		84,840		76,260		
固定負債計		84,840	1.1	76,260		0.9
負債合計		1,014,871	12.9	936,833		11.5
(純資産の部)			%			%
株主資本		6,869,604	87.1	7,203,586		88.5
資本金	310,000			310,000		
利益剰余金						
利益準備金	77,500			77,500		
その他利益剰余金						
別途積立金	31,620			31,620		
繰越利益剰余金	6,450,484			6,784,466		
純資産合計		6,869,604	87.1	7,203,586		88.5
負債・純資産合計		7,884,475	100.0	8,140,419		100.0

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日		当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日			
	金 額		構成比	金 額		構成比
			%			%
営業収益						
委託者報酬		2,655,508			2,681,106	
投資顧問収入		3,030,659			2,805,885	
その他営業収益 ※ 1		85,660			12,640	
営業収益計		5,771,828	100.0		5,499,631	100.0
営業費用						
支払手数料		711,649			753,876	
広告宣伝費		53,735			51,264	
公告費		1,140			1,140	
調査費		712,486			654,933	
調査費	407,466			337,268		
委託調査費	304,641			317,181		
図書費	378			483		
委託計算費		485,872			387,357	
営業雑経費		29,696			44,076	
通信費	3,997			6,765		
印刷費	7,276			14,575		
協会費	12,853			17,758		
諸会費	55			7		
その他	5,512			4,968		
営業費用計		1,994,579	34.6		1,892,648	34.4
一般管理費						
給料		1,568,661			1,475,040	
役員報酬	425,268			251,291		
給料・手当	787,766			816,610		
賞与	285,950			330,579		
賞与引当金繰入額	69,676			76,559		
交際費		1,607			3,676	
旅費交通費		676			10,847	
租税公課		32,240			3,770	
不動産賃借料		60,478			64,855	
退職給付費用		74,675			61,481	
固定資産減価償却費		2,571			765	
福利厚生費		130,238			139,590	
諸経費		186,753			192,029	
一般管理費計		2,057,903	35.7		1,952,057	35.5
営業利益		1,719,345	29.8		1,654,925	30.1
営業外収益						
移転価格調整金 ※ 1、※ 2					131,841	
為替差益		18			1,707	
有価証券運用益		1,013			2,727	
雑収入		881			106	
営業外収益計		1,913	0.0		136,383	2.5
営業外費用						
移転価格調整金 ※ 1		363,220			-	
為替差損		214			1,046	
有価証券運用損		1			-	
雑損失		329			73	
営業外費用計		363,766	6.3		1,119	0.0
経常利益		1,357,491	23.5		1,790,188	32.6
特別利益						

事業再構築費用戻入		7,084			—	
特別利益計		7,084	0.1		—	0.0
特別損失						
事務処理損失		146			4,303	
固定資産除却損		2,326			—	
特別損失計		2,472	0.0		4,303	0.1
税引前当期純利益		1,362,102	23.6		1,785,884	32.5
法人税, 住民税及び事業税		261,905	4.5		324,907	5.9
法人税等調整額		261,874	4.5		288,994	5.3
当期純利益		838,322	14.5		1,171,982	21.3

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位: 千円)

	株 主 資 本						純資産合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計	株主資本 合計	
			その他利益 剰余金	繰越利益 剰余金			
		別途積立金					
当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,091,161	6,200,281	6,510,281	6,510,281
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	(479,000)	(479,000)	(479,000)	(479,000)
当期純利益	-	-	-	838,322	838,322	838,322	838,322
当期変動額合計	-	-	-	359,322	359,322	359,322	359,322
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,450,484	6,559,604	6,869,604	6,869,604

当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位: 千円)

	株 主 資 本						純資産合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計	株主資本 合計	
			その他利益 剰余金	繰越利益 剰余金			
		別途積立金					
当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,450,484	6,559,604	6,869,604	6,869,604
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	(838,000)	(838,000)	(838,000)	(838,000)
当期純利益	-	-	-	1,171,982	1,171,982	1,171,982	1,171,982
当期変動額合計	-	-	-	333,982	333,982	333,982	333,982
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,784,466	6,893,586	7,203,586	7,203,586

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	有価証券 売買目的有価証券 決算期末日の市場価格等に基づく時価法（取得原価は移動平均法により算定）を採用しております。
2. 固定資産の減価償却方法	有形固定資産 リース資産以外の有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下の通りであります 器具備品 3～7年
3. 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処理しております。
4. 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当期に負担すべき

	<p>金額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等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及び年金資産の見込額に基づき、必要額を計上しております。</p> <p>① 退職給付見込額の期間帰属方法 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、期間定額基準によっております。</p> <p>② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(11年)による定額法により費用処理しております。 数理計算上の差異 発生の翌事業年度に一括損益処理しております。</p>
5. 収益の計上方法	<p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託約款に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資信託約款毎に、日々の純資産総額に信託報酬率を乗じた金額で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問収入 投資顧問収入は、投資顧問契約に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資顧問契約毎に計算基礎額に投資顧問料率を乗じた金額で収益を認識しております。</p>
6. その他 財務諸表作成のための重要な事項	<p>消費税等の処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

## 会計方針の変更

(時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。ただし、これによる具体的な会計方針の変更は無く、したがって、時価算定会計基準適用指針の適用にともなう当事業年度における貸借対照表、損益計算書および株主資本等変動計算書への影響は有りません。

## 会計上の見積りに関する注記

会計上の見積りにより、当事業年度に係る財務諸表にその額を計上した項目であって、翌事業年度に係る財務諸表に重要な影響を及ぼす可能性があるものは、次のとおりです。

繰延税金資産 1,537,341千円

繰延税金資産の認識は、将来の事業計画に基づく課税所得の発生および金額によって見積もっております。

当該見積りは、将来の不確実な経済条件の変動などによって影響を受ける可能性があり、実際に発生した課税所得の時期および金額が見積りと異なった場合や将来の税法の改正等により、翌事業年度の財務諸表において、繰延税金資産の金額に重要な影響を与える可能性があります。

注記事項

(貸借対照表関係)

前事業年度 (2022年3月31日現在)	当事業年度 (2023年3月31日現在)
※1. 有形固定資産の減価償却累計額 器 具 備 品 30,399千円	※1. 有形固定資産の減価償却累計額 器 具 備 品 30,661千円
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	関係会社に係る注記 同左

(損益計算書関係)

前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
※1. 移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額85,395千円は、損益計算書のその他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額363,220千円は、損益計算書の営業外費用である移転価格調整金に含まれております。	※1. 移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた事務手数料調整額12,389千円は、損益計算書のその他営業収益に、移転価格調整額131,841千円は、損益計算書の営業外収益に含まれております。
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	※2. 関係会社に係る注記 関係会社との取引高 営業外収益 131,841千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 発行済株式の総数に関する事項

	当事業年度期首	当期増加株式数	当期減少株式数	当事業年度末
普通株式	6,200株	-	-	6,200株

2. 当事業年度中に行った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	1株当たりの 配当額	基準日	効力発生日
2021年6月24日 定時株主総会	普通株式	479,000千円	77,258.06円	2021年3月31日	2021年6月25日



3. 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当事業年度の末日後となるもの

(決議)	株式の種類	配当金の総額	配当の原資	1株当たりの 配当額	基準日	効力発生日
2022年6月27日 定時株主総会	普通株式	838,000千円	利益剰余金	135,161.29円	2022年3月31日	2022年6月28日

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式の総数に関する事項

	当事業年度期首	当期増加株式数	当期減少株式数	当事業年度末
普通株式	6,200株	-	-	6,200株

2. 当事業年度中に行った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	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2022年6月27日 定時株主総会	普通株式	838,000千円	135,161.29円	2022年3月31日	2022年6月28日

3. 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当事業年度の末日後となるもの

(決議)	株式の種類	配当金の総額	配当の原資	1株当たりの 配当額	基準日	効力発生日
2023年6月27日 定時株主総会	普通株式	1,171,000千円	利益剰余金	188,870.96円	2023年3月31日	2023年6月28日

(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、投資運用業、投資助言業、第二種金融商品取引業及び第一種金融商品取引業を行っております。これらの事業を行うための資金運用については、短期的な預金等に限定し、資金調達については、現状必要性を想定しておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社の営業債権である未収委託者報酬は、投資信託及び投資法人に関する法律により、信託銀行において分別管理される信託財産のため、当該報酬は、計理上日々の未払委託者報酬として投資信託財産の負債項目に計上されております。このため、顧客の信用リスクは限定されております。

同じく営業債権である未収投資顧問料は、概ね6か月以内に回収される債権であり、また顧客の業種等も多岐にわたり分散されていることから、顧客の信用リスクは限定されております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年3月31日現在

預金、未収入金、未収委託者報酬、未収収益、未払手数料及びその他未払金は、短期間で決済されるため、時価が帳簿価額に近似することから、注記を省略しております。

2023年3月31日現在

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
有価証券	24,319	24,319	-
資産計	24,319	24,319	-

預金、未収入金、未収委託者報酬、未収収益、未払手数料及びその他未払金は、短期間で決済されるため、時価が帳簿価額に近似することから、注記を省略しております。

### 3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

2022年3月31日現在

前項にて注記を省略しているため、記載を省略しております。

2023年3月31日現在

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又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算定に係るインプットを用いて算定した時価

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券	-	24,319	-	24,319
資産計	-	24,319	-	24,319

(注) 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

有価証券は投資信託であり基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル2に分類しております。

(有価証券関係)

前事業年度 (2022年3月31日現在)		当事業年度 (2023年3月31日現在)	
売買目的の有価証券		売買目的の有価証券	
貸借対照表計上額	23,294千円	貸借対照表計上額	24,319千円
当事業年度の損益		当事業年度の損益	
に含まれた評価差額	1,013千円	に含まれた評価差額	1,025千円

(デリバティブ取引関係)

前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日		当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日	
該当事項はありません。		同左	

(退職給付関係)

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日		当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日	
2011年4月1日に確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）、確定拠出年金制度を導入いたしました。 また、2000年9月29日より退職給付信託を設定しております。		同左	

2. 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度
	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	450,505
勤務費用	58,354
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	△10,018
退職給付の支払額	<u>△18,668</u>
退職給付債務の期末残高	480,173

(単位：千円)

	当事業年度
	自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
退職給付債務の期首残高	480,173
勤務費用	53,150
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	△12,549
退職給付の支払額	<u>△37,376</u>
退職給付債務の期末残高	483,396

3. 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度
	自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
年金資産の期首残高	368,935
期待運用収益	2,728
数理計算上の差異の発生額	△2,919
事業主からの拠出額	52,354
退職給付の支払額	<u>△18,668</u>
年金資産の期末残高	402,431

(単位：千円)

	当事業年度
	自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
年金資産の期首残高	402,431
期待運用収益	2,979
数理計算上の差異の発生額	△3,493
事業主からの拠出額	51,651
退職給付の支払額	<u>△37,376</u>
年金資産の期末残高	416,191

4. 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：千円)

	前事業年度
	自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
積立型制度の退職給付債務	480,173
年金資産	<u>△402,431</u>
	77,742
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	<u>77,742</u>
未認識数理計算上の差異	<u>7,098</u>
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	84,840

(単位：千円)

	当事業年度
	自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
積立型制度の退職給付債務	483,396
年金資産	<u>△416,191</u>
	67,205
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	<u>67,205</u>
未認識数理計算上の差異	<u>9,055</u>
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	76,260

5. 退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度
	自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	<u>55,694</u>
(1) 勤務費用	58,354
(2) 利息費用	-
(3) 期待運用収益	△2,728
(4) 過去勤務費用の費用処理額	0
(5) 数理計算上の差異の費用処理額	69
(6) その他	-

(単位：千円)

	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	43,071
(1)勤務費用	53,150
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益	△2,979
(4)過去勤務費用の費用処理額	0
(5)数理計算上の差異の費用処理額	△7,098
(6)その他	-

## 6. 年金資産に関する事項

前事業年度（2022年3月31日現在）

## ① 年金資産の内訳

保険資産（一般勘定）	98.1%
その他	1.9%
合計	100.0%

## ② 長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

当事業年度（2023年3月31日現在）

## ① 年金資産の内訳

保険資産（一般勘定）	98.2%
その他	1.8%
合計	100.0%

## ② 長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

## 7. 退職給付債務等の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (2022年3月31日現在)
(1)割引率	0.0%
(2)長期期待運用収益率	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年

	当事業年度 (2023年3月31日現在)
(1)割引率	0.0%
(2)長期期待運用収益率	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年

## 8. 確定拠出制度

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は18,980千円であります。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は18,410千円であります。

（税効果会計関係）

前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日																																				
<p>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 (単位：千円)</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">19,674</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">27,681</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">(注) 繰越欠損金</td> <td style="text-align: right;">1,727,082</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">その他</td> <td style="text-align: right;">51,898</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;"></td> <td style="border-top: 1px solid black;"></td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">繰延税金資産 合計</td> <td style="text-align: right;">1,826,336</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">繰延税金負債との相殺</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;"></td> <td style="border-top: 1px solid black;"></td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right;">1,826,336</td> </tr> </table>	賞与引当金繰入超過額	19,674	退職給付引当金	27,681	(注) 繰越欠損金	1,727,082	その他	51,898			繰延税金資産 合計	1,826,336	繰延税金負債との相殺	-			繰延税金資産の純額	1,826,336	<p>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 (単位：千円)</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">賞与引当金繰入超過額</td> <td style="text-align: right;">22,144</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">25,052</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">(注) 繰越欠損金</td> <td style="text-align: right;">1,453,659</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">その他</td> <td style="text-align: right;">36,485</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;"></td> <td style="border-top: 1px solid black;"></td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">繰延税金資産 合計</td> <td style="text-align: right;">1,537,341</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">繰延税金負債との相殺</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;"></td> <td style="border-top: 1px solid black;"></td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right;">1,537,341</td> </tr> </table>	賞与引当金繰入超過額	22,144	退職給付引当金	25,052	(注) 繰越欠損金	1,453,659	その他	36,485			繰延税金資産 合計	1,537,341	繰延税金負債との相殺	-			繰延税金資産の純額	1,537,341
賞与引当金繰入超過額	19,674																																				
退職給付引当金	27,681																																				
(注) 繰越欠損金	1,727,082																																				
その他	51,898																																				
繰延税金資産 合計	1,826,336																																				
繰延税金負債との相殺	-																																				
繰延税金資産の純額	1,826,336																																				
賞与引当金繰入超過額	22,144																																				
退職給付引当金	25,052																																				
(注) 繰越欠損金	1,453,659																																				
その他	36,485																																				
繰延税金資産 合計	1,537,341																																				
繰延税金負債との相殺	-																																				
繰延税金資産の純額	1,537,341																																				

（注）税務上の繰越欠損金及びその繰延税金資産の繰越期限別の金額

前事業年度（2022年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超 2年以内 (千円)	2年超 3年以内 (千円)	3年超 4年以内 (千円)	4年超 5年以内 (千円)	5年超 (千円)	合計 (千円)
税務上の繰越欠損金(*1)	-	-	-	597,044	157,331	972,706	1,727,082
繰延税金資産	-	-	-	597,044	157,331	972,706	(*2) 1,727,082

(\*1) 税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額であります。

(\*2) 税務上の繰越欠損金1,727,082千円（法定実効税率を乗じた金額）について、繰延税金資産1,727,082千円を計上しております。当該税務上の繰越欠損金に係る繰延税金資産については、将来の課税所得の見込等により回収可能と判断しております。

当事業年度（2023年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超 2年以内 (千円)	2年超 3年以内 (千円)	3年超 4年以内 (千円)	4年超 5年以内 (千円)	5年超 (千円)	合計 (千円)
税務上の繰越欠損金(*1)	-	-	319,359	158,439	-	975,860	1,453,659
繰延税金資産	-	-	319,359	158,439	-	975,860	(*2) 1,453,659

(\*1) 税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額であります。

(\*2) 税務上の繰越欠損金1,453,659千円（法定実効税率を乗じた金額）について、繰延税金資産1,453,659千円を計上しております。当該税務上の繰越欠損金に係る繰延税金資産については、将来の課税所得の見込等により回収可能と判断しております。

前事業年度（2022年3月31日現在）	当事業年度（2023年3月31日現在）
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間の差異の原因となった主要な項目別内訳	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間の差異の原因となった主要な項目別内訳
法定実効税率 30.6%	法定実効税率 30.6%
交際費等永久に損金に 算入されない項目 8.0%	交際費等永久に損金に 算入されない項目 3.1%
その他 △ 0.2%	その他 0.6%
-----	-----
税効果会計適用後の 法人税等の負担率 38.4%	税効果会計適用後の 法人税等の負担率 34.3%
=====	=====

（資産除去債務関係）

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

当社は、本社オフィス及びバックアップセンターの不動産賃貸借契約に基づき、退去時における原状回復に係る債務を資産除去債務として認識しておりますが、当該資産除去債務に関しては、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当事業年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を賃貸借契約期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は14,661千円であります。当事業年度において、本社オフィスの一部解約等に伴う原状回復費用の精算が行われたことから、資産除去債務の総額は、20,679千円減少しました。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

当社は、本社オフィス及びバックアップセンターの不動産賃貸借契約に基づき、退去時における原状回復に係る債務を資産除去債務として認識しておりますが、当該資産除去債務に関しては、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当事業年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を賃貸借契約期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は15,059千円であります。当事業年度において、原状回復費用の見直しが行われたことから、資産除去債務の総額は、397千円増加千円減少しました。

(収益認識関係)

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

当社は、「(セグメント情報)」に記載のとおり、投資運用業の単一セグメントであり、営業収益のうち委託者報酬と投資顧問収入は、顧客との契約から生じる収益であります。

- (1) 収益の分解情報  
損益計算書に記載のとおりです。
- (2) 収益を理解するための基礎となる情報  
重要な会計方針「5. 収益の計上方法」に記載のとおりです。
- (3) 当期及び翌期以降の収益の金額を理解するための情報  
重要性が乏しいため、注記を省略しております。

当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

当社は、「(セグメント情報)」に記載のとおり、投資運用業の単一セグメントであり、営業収益のうち委託者報酬と投資顧問収入は、顧客との契約から生じる収益であります。

- (1) 収益の分解情報  
損益計算書に記載のとおりです。
- (2) 収益を理解するための基礎となる情報  
重要な会計方針「5. 収益の計上方法」に記載のとおりです。
- (3) 当期及び翌期以降の収益の金額を理解するための情報  
重要性が乏しいため、注記を省略しております。

(セグメント情報)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

2. セグメント関連情報

1. 商品及びサービスに関する情報

単一の商品・サービスの区分の外部顧客へ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. 地域に関する情報

① 営業収益

本邦に所在している顧客への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。

なお、委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、集計対象より除外しております。

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. 主要な顧客に関する情報

委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、記載を省略しております。

また、投資顧問収入については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。



(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)

I 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

該当事項はありません。

(2) 同一の親会社を持つ会社

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

種 類	会社等の 名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の内容 又は 職業	議決権の 所有(被所 有)割合	前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)		
						関連当事者との関係 役員の 兼任等	事業上の関係						
同一の親 会社を持 つ会社	ステート・スト ート・バンク・ アンド・トラ スト・カンパニ ー	米国 マサチューセツ 州ボースト ン市	29百万 米ドル	銀行、投資 顧問、投資 信託委託業 務、及びそ れらの関連 業務	なし	なし	助言などの投 資顧問サービ スの提供並び に受入れ	ソフトウェア使 用料の支払	351,919	前払金	598		
								投資顧問料の支 払	221,949				
								ソフトウェア の使用契約	396,782			未払金	28,457
								人件費等の支払	85,395				
							事務手数料の受 取	363,220					
							移転価格調整金 の支払						
							人件費等及び 事務手数料の 支払						
							兼職社員の人 件費支払等						
							投資信託計理 の事務サービ スの受入れ	38,999	前払金	119,051			
							人件費等の支払	127,476					
							投資顧問サー ビスの受入れ	19,193	-	-			
							投資顧問料の支 払						
							紹介料の受取	264	-	-			
							投資顧問サー ビスの受入れ及 びETF商品 の紹介	24,400					
							投資顧問料の支 払						

(注) 上記の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、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。

取引条件及び取引条件の決定方針等

1. ソフトウェア使用料及び事務手数料については、グループ全体の費用を一定の基準で配分した金額に基づき決定しております。
2. 人件費及び事務所賃借料については、実際支払額を基として支払いを行っております。
3. 役員料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて支払われております。
4. 投資顧問料については、当社との間で締結された投資顧問契約に記載された料率に基づいて計算されております。
5. ETF商品の紹介料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて計算されております。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

当事業年度 自 2022年4月1日 至 2023年3月31日												
種 類	会社等の 名称	所在地	資本金又 は 出資金	事業の内容 又は 職業	議決権の 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 (千円)	科目	期末 残高 (千円)	
						役員の 兼任等	事業上の関係					
同一の親 会社を持 つ会社	ステート・スト リート・バンク・ アンド・トラ スト・カンパニ ー	米国 マサチューセツ 州ボストン 市	29百万 米ドル	銀行、投資 顧問、投資 信託委託業 務、及びそ れらの関連 業務	なし	なし	助言などの投 資顧問サービ スの提供並び に受入れ	ソフトウェア使 用料の支払	295,434	前払金	3,388	
								投資顧問料の支 払	232,843			
								人件費等の支払	175,762	未払金		24,509
								事務手数料の受 取	12,389			
								移転価格調整金 の受取	131,841			
ステート・スト リート信託銀 行株式会 社	東京都港 区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理 の事務サービ スの受入れ	投資信託計理業 務委託	39,303	前払金	229,512		
							兼職社員の人 件費支払等	127,670				
ステート・スト リート・グロ ーバル・アド ヴァイザー ズ・ユナイテ ッド・キング ダム	英国 ロンドン	62百万ポ ンド	投資顧問、 投資信託委 託業務	なし	なし	投資顧問サービ スの受入れ	投資顧問料の支 払	19,754	-	-		
ステート・スト リート・グロ ーバル・アド ヴァイザー ズ・シンガ ポール	シンガポ ール 市	136万シ ンガポ ール	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービ スの受入れ及 びE T F 商品 の紹介	紹介料の受取	250	-	-		
							投資顧問料の支 払	22,792				

(注) 上記の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、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。

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

1. ソフトウェア使用料及び事務手数料については、グループ全体の費用を一定の基準で配分した金額に基づき決定しております。
2. 人件費及び事務所賃借料については、実際支払額を基として支払いを行っております。
3. 役員料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて支払われております。
4. 投資顧問料については、当社との間で締結された投資顧問契約に記載された料率に基づいて計算されております。
5. ETF商品の紹介料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて計算されております。

## II 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

ステート・ストリート・コーポレーション（ニューヨーク証券取引所に上場）

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インク（非上場）

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インターナショナル・ホールディングス（非上場）

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ジャパン・ホールディングス合同会社（非上場）

### (2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

### (1株当たり情報)

前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
1株当たり純資産 1,108,000円68銭	1株当たり純資産 1,161,868円75銭
1株当たり当期純利益 135,213円36銭	1株当たり当期純利益 189,029円36銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。	なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

(注) 1株当たり当期純利益の算定基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
当期純利益（千円）	838,322	1,171,982
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式にかかる当期純利益（千円）	838,322	1,171,982
期中平均株式数（株）	6,200	6,200

### (重要な後発事象)

前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度

自 2022年4月 1日

至 2023年3月31日

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 自己又はその取締役若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、若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が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、若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が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④⑤において同じ。）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金融デリバティブ取引を行うこと。
- ④ 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、運用財産の額若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 上記③④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、若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

委託会社の定款変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

その他、営業譲渡および営業譲受、出資の状況その他の重要な事項は予定されておりません。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実は存在しておりません。

追加型証券投資信託

ステート・ストリート日本株式  
インデックス・オープン

約 款

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

## 運用の基本方針

約款第17条の規定に基づき、委託者が定める運用の基本方針は次のものとします。

### 1. 基本方針

この投資信託は、日本の取引所に上場されている株式を投資対象とした「日本株式インデックス・マザーファンド」受益証券に投資することにより、中長期的に TOPIX（東証株価指数、配当込み）に連動した投資成果を目指して運用を行うことを基本とします。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

- ①日本株式インデックス・マザーファンド受益証券（以下「マザーファンド受益証券」といいます。）を主要投資対象とします。
- ②投資状況に応じ、マザーファンドと同様の運用を直接行うことがあります。

#### (2) 投資態度

- ①TOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとします。
- ②マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持するものとし、株式への実質的投資割合は、原則として信託財産総額の50%超（非株式割合は50%以下）を基本とします。
- ③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および為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。以下同じ。）を行うことができます。
- ④信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。
- ⑤信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。
- ⑥信託財産の効率的な運用に資するため等、運用上必要と認めるときには、委託者もしくは委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）が設定または運用する国内投資信託証券等に投資する場合があります。
- ⑦大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が行われない場合や、当ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

#### (3) 投資制限

- ①マザーファンド受益証券の投資割合には制限を設けません。
- ②株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）の実質投資割合には制限を設けません。
- ③原則として、外貨建資産への実質投資は行いません（外貨建資産割合は0%）。
- ④投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）の実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

- ⑤デリバティブ取引は、約款第 20 条、第 21 条および第 22 条の範囲で行います。
- ⑥一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 100 分の 10、合計で 100 分の 20 を超えないものとし、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従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

### 3. 収益分配方針

毎決算時（原則として 3 月 5 日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

#### ① 分配対象額の範囲

経費控除後の利子・配当収入および売買益（評価益を含みます。）等全額とします。

#### ② 分配対象収益についての分配方針

分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないこともあります。

#### ③ 留保益の運用方針

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。



追加型証券投資信託  
ステート・ストリート日本株式インデックス・オープン

約 款

(信託の種類、委託者および受託者、信託事務の委託)

第1条 この信託は、証券投資信託であり、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ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ます。

- ② この信託は、信託法（平成18年法律第108号）（以下「信託法」といいます。）の適用を受けます。
- ③ 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関（受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条、第16条および第27条において同じ。）を含みます。）と信託契約を締結し、これを委託することができます。
- ④ 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

(信託の目的、金額および追加信託の限度額)

第2条 委託者は、金1,000億円を上限として受益者のために利殖する目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

- ② 委託者は、受託者と合意のうえ金1兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ③ 委託者は、受託者と合意のうえ、第2項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第3条 この信託の期間は、信託契約締結日から第45条第1項および第2項、第46条第1項、第47条第1項、第49条第2項の規定による信託終了日または信託契約解約の日までとします。

(受益権の取得申込みの勧誘の種類)

第4条 この信託に係る受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

(当初の受益者)

第5条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第6条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

(受益権の分割および再分割)

第6条 委託者は、第2条第1項に規定する信託によって生じた受益権については、これを1,000億口を上限とし、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど、第7条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

- ② 委託者は、受託者と協議のうえ、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。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第7条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益

権の口数を乗じた額とします。

- ② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第26条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た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。

（信託日時の異なる受益権の内容）

第8条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第9条 この信託のすべての受益権は、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ることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）およ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または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載また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。）。

- ② 委託者は、この信託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また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。

なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

- ③ 委託者は、第6条の規定により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また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ます。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

第10条 受託者は、この信託契約締結により生じた受益権については信託設定時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、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。

（受益権の申込単位および価額）

第11条 委託者の指定する第一種金融商品取引業者（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）は、第6条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、第4項に規定する受益権の価額に取得申込口数を乗じて得た金額について、委託者の承諾を得て各第一種金融商品取引業者および登録金融機関が定める申込単位をもって当該受益権の取得の申込に応ずることができるものとします。ただし、第41条第2項に規定する収益分配金の再投資に係る受益権の取得の申込に限り、1口の整数倍をもって取得の申込に応ずることができるものとします。

- ② 前項の取得申込者は委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託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

の記載または記録が行われます。なお、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、当該取得申込の代金（第3項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

- ③ 第1項の受益権の価額は、取得申込日の基準価額に、手数料および当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込みに係る受益権の価額は、1口につき1円に、手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ④ 前項の手数料額は、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関がそれぞれ定めるものとします。
- ⑤ 前2項の規定にかかわらず、受益者が委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関との間に結ばれた別に定める自動けいぞく投資約款にしたがった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価額は、原則として、第35条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑥ 前各項の規定にかかわらず、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8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を「金融商品取引所」といい、金融商品取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「取引所」といいます。以下同じ。）における取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更、クーデター等政変、テロリズム、戦争、天災地変等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）があるときは、委託者の判断により、受益権の取得申込の受け付けを中止することおよび既に受け付けた受益権の取得申込の受け付けを取り消すことができます。

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

第12条 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また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。

- ② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少およ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または記録するものとします。ただし、前項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。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- ③ 委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載また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、委託者が必要と認めるときまた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）

第13条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

（投資の対象とする資産の種類）

第14条 この信託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、約款第 20 条、第 21 条および第 22 条に定めるものに限り、以下同じ。）
  - 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

（運用の指図範囲等）

第15条 委託者は、信託金を、主としてステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ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「日本株式インデックス・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下「マザーファンド受益証券」といいます。）および次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）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券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社に係る特定社債券（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. 特定目的会社に係る優先出資証券（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、前号までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいいます。）
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、以下同じ。）
17. 預託証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 20 号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
19. 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
20. 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
21. 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、以下同じ。）
22. 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。）

なお、第1号の証券または証書、第12号および第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号までの証券ならびに第12号および第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を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- ② 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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
- ③ 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、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には、委託者は、信託金を、前項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。
- ④ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券（取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。以下同じ。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑤ 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（利害関係人等との取引等）

第16条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となつて行うものを含みます。）および受託者の利害関係人、第27条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、前2条に定める資産への投資等を行うことができます。

- ② 前項の取扱いは、第19条ないし第22条、第24条ないし第26条、第30条ないし第32条における委託者の指図による取引その他これらに類する行為を行う場合についても同様とします。
- ③ 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ④ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等又は子法人等を含みます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等ならびに第19条ないし第22条、第24条ないし第26条、第30条ないし第32条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。
- ⑤ 前4項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

(運用の基本方針)

第17条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

(投資する株式等の範囲)

第18条 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、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、または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（上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものを含みます。）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。

(信用取引の指図範囲)

第19条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができますものとしします。

- ② 前項の信用取引の指図にあたっては、当該売り付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売り付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額を超えないものとしします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとしします。
- ④ 第2項においてマザーファンドの信託財産に属する当該売り付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売り付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤ 委託者は、第1項の取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとしします。

(先物取引等の運用指図)

第20条 委託者は、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。）を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとしします（以下同じ。）。)

- ② 委託者は、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金利に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

(スワップ取引の運用指図)

第21条 委託者は、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、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

- ② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第3条に定める信託期間を超えないものとしします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可

能なものについてはこの限りではありません。

- ③ スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち当該信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少してスワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部解約を指図するものとします。
- ④ 前項においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ⑤ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。
- ⑥ 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### （金利先渡取引の運用指図）

第22条 委託者は、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、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第3条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③ 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。
- ④ 委託者は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### （デリバティブ取引等にかかる投資制限）

第23条 委託者は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### （有価証券の貸付の指図および範囲）

第24条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券を貸付けることの指図をすることができます。

- ② 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### （公社債の空売りの指図範囲）

第25条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- ② 前項の売り付けの指図にあたっては、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

(公社債の借入れ)

第26条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- ② 前項の指図にあたっては、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ④ 第1項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

(信託業務の委託等)

第27条 受託者は、委託者と協議の上、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
  1. 信託財産の保存に係る業務
  2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
  3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
  4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

(混蔵寄託)

第28条 金融機関また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およ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。以下本条において同じ。）から、売買代金およ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またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関また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または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第29条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載また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、受託者が認める場合は、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。

- ④ 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。

（有価証券の売却等の指図）

第30条 委託者は、信託財産に属するマザーファンド受益証券に係る信託契約の一部解約、有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第31条 委託者は、前条の規定による一部解約金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第32条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- ② 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券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信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の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、当該資金借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないものとします。
- ③ 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ④ 借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

（損益の帰属）

第33条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

（受託者による資金の立替え）

第34条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

（計算期間）

第35条 この信託の計算期間は、毎年3月6日から翌年3月5日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成28年5月9日から平成29年3月6日までとします。

- ② 前項の規定にかかわらず、前項の原則により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、第3条に定める信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告等)

第36条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。
- ③ 受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。
- ④ 受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

(信託事務の諸費用)

第37条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ② 信託財産に係る監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末（ただし、当日が休業日の場合は翌営業日とします。）または信託終了のとき信託財産中から支弁します。
- ③ 第1項に定める信託事務の処理等に要する諸費用は、マザーファンドに関連して生じた諸費用のうちマザーファンドにおいて負担せずかつ委託者の合理的判断によりこの信託に関連して生じたと認めるものを含みます。

(信託報酬等)

第38条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第35条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の8の率を乗じて得た金額とします。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末（ただし、当日が休業日の場合は翌営業日とします。）または信託終了のときに信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。
- ③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(収益の分配)

第39条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
  2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- ② 毎計算期末において信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第40条 受託者は、収益分配金については、第41条第1項に規定する支払開始日および同条第2項に規定する交付開始前までに、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第41条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第44条第4項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第41条第4項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第41条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヶ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末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計算期間の末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委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関と受益権の取得申込者との間に結ばれた別に定める自動けいぞく投資約款にしたがった契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関に交付されます。この場合、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関は、受益者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けを行います。ただし、第44条第1項により信託の一部解約が行われた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、第1項に準じて受益者に支払います。当該売付けにより増加した受益権は、第9条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③ 償還金は、信託終了日後1ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了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、当該信託終了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委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還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、社振法の規定にしたが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または記録が行われます。
- ④ 一部解約金は、第44条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として5営業日目から当該受益者に支払います。
- ⑤ 前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および登録金融機関の営業所等において行うものとし、
- ⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、
- ⑦ 前項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、各受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとし、また、前項に規定する「各受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、各受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとし、

(収益分配金および償還金の時効)

第42条 受益者が、収益分配金については第41条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金について第41条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第43条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載また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、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

(一部解約)

第44条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に対し、委託者の承諾を得て各第一種金融商品取引業者および登録金融機関が定める解約単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

- ② 信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ③ 委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第1項の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信託契約の一部解約を委託者が行うのと引き換えに、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、社振法の規定にしたが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または記録が行われます。
- ④ 前項の一部解約の価額は、解約請求日の基準価額とします。
- ⑤ 委託者は、取引所における取引の停止その他やむを得ない事情(投資対象国における非常事態(金融危機、デフォルト、重大な政策変更、クーデター等政変、テロリズム、戦争、天災地変等)による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等)があるときは、委託者の判断により、第1項による一部解約の実行の請求の受付を中止することおよび既に受け付けた第1項による一部解約の実行の請求を取り消すことができます。
- ⑥ 前項により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第4項の規定に準じて計算された価額とします。

(信託契約の解約)

第45条 委託者は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することによりこの信託の受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合または下回ることが明らかとなった場合、もしくはこの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とき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- ③ 前項の書面決議において、受益者(委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受

益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- ④ 第2項の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行います。
- ⑤ 第2項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、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、第2項から前項までに規定するこの信託契約の解約の手続を行うことが困難な場合には適用しません。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第46条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第50条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第47条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第50条の書面決議が否決となる場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第48条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第49条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第50条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更等)

第50条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- ② 委託者は、前項の事項(前項の変更事項にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽

微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④ 第2項の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にわたる多数をもって行います。
- ⑤ 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑥ 第2項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ⑦ 前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

（反対受益者の受益権買取請求の不適用）

第51条 この信託は、受益者が第44条に規定による一部解約の実行の請求を行ったときは、委託者が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、第45条に規定する投資信託の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行なう場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

（他の受益者の氏名等の開示の請求の制限）

第52条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

（公 告）

第53条 委託者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。

（信託約款に関する疑義の取扱い）

第54条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

（運用報告書に記載すべき事項の提供）

第55条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

上記条項により信託契約を締結します。

平成 28 年 5 月 9 日

平成 28 年 5 月 31 日変更

平成 28 年 6 月 24 日変更

平成 28 年 11 月 15 日変更

令和 5 年 12 月 6 日変更

委託者     ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

受託者     三井住友信託銀行株式会社

#### (付則)

第1条 第22条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日からの一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

# 親投資信託

日本株式インデックス・マザーファンド

約

款

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社



## 運用の基本方針

約款第13条の規定に基づき、委託者が別に定める運用の基本方針は次のものとします。

### 1. 基本方針

この投資信託は、中長期的な観点から、TOPIX（東証株価指数、配当込み）に連動した投資成果を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

- ①TOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとします。
- ②株式の組入比率は、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。
- ③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、投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）の指図をすることができます。
- ④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、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、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- ⑤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、投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ⑥信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。
- ⑦大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむをえない事情が発生した場合には、上記のような運用が行われない場合や、当ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

#### (3) 投資制限

- ①株式への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資は行いません。
- ③投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤信用取引の指図は、約款第15条の範囲で行います。
- ⑥有価証券先物取引等は、約款第16条の範囲で行います。
- ⑦スワップ取引は、約款第17条の範囲で行います。
- ⑧金利先渡取引は、約款第18条の範囲で行います。
- ⑨一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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、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従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

親投資信託  
日本株式インデックス・マザーファンド  
約 款

(信託の種類、委託者および受託者)

第1条 この信託は、その受益権を他の投資信託の受託者に取得させることを目的とする証券投資信託であり、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ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ます。

- ② この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法(大正11年法律第62号) (以下「信託法」といいます。) の適用を受けます。
- ③ 第1項の受託者は、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関と信託契約を締結し、これを委託することができます。

(信託の目的、金額および追加信託の限度額)

第2条 委託者は、金50億円を上限として受益者のために利殖する目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

- ② 委託者は、受託者と合意のうえ金2兆円を限度として信託金を追加することができるものとし、追加信託が行われたときは、受託者は、その引き受けを証する書面を委託者に交付します。
- ③ 委託者は、受託者と合意のうえ、第2項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第3条 この信託の期間は、信託契約締結日から、第40条第1項、第2項、第41条第1項、第42条第1項、第44条第2項の規定による信託終了日または信託契約解約の日までとします。

(受益証券の取得申込みの勧誘の種類)

第4条 この信託にかかる受益証券の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第2号イに掲げる場合に該当する勧誘のうち、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第9項第1号に掲げる適格機関投資家私募により行われます。

(受益者)

第5条 この信託の元本および収益の受益者は、この信託の受益証券を投資対象とするステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の証券投資信託 (以下「ベビーファンド」といいます。) の受託者である信託業務を営む銀行とします。

(受益権の分割および再分割)

第6条 委託者は、第2条第1項に規定する信託によって生じた受益権については、これを50億口を上限として、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど、第7条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受託者と協議の上、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

第7条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に、当該基準価額に0.05%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として加算した価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第22条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た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。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第8条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益証券の発行および種類)

第9条 委託者は、第6条第1項の規定により分割された受益権を表示する受益証券を発行します。この場合の受益証券は、記名式とします。

② 委託者が発行する受益証券は、1口の整数倍の口数を表示した受益証券とします。

③ 受益者は、当該受益証券を他に譲渡することはできません。

(受益証券の発行についての受託者の認証)

第10条 委託者は、前条第1項の規定により受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

② 前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行います。

(投資の対象とする資産の種類)

第11条 この信託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、約款第16条、第17条および第18条に定めるものに限り。）
  - 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

（運用の指図範囲等）

第12条 委託者は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）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とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社に係る特定社債券（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. 特定目的会社に係る優先出資証券（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. 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。）
13. 投資証券もしくは投資法人債券（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。）
14. 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。）
15. 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。）
16. 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

17. 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。）

18. 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。）

なお、第1号の証券または証書、第15号の証書のうち第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、第15号の証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第12号の証券および第13号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

② 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）

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

③ 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、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には、委託者は、信託金を、前項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。

④ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

⑤ 委託者は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

（運用の基本方針）

第13条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

（投資する株式等の範囲）

第14条 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、国内の取引所（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8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を「金融商品取引所」といい、金融商品取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「取引所」もしくは「証券取引所」といいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、または国内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（上場予定または登録予定の株式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

るものを含みます。)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。

#### (信用取引の指図範囲)

第15条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- ② 前項の信用取引の指図にあたっては、当該売り付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- ④ 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の信用取引による株券の売り付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。当該売り付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の100分の5を上回ることとなった場合には、委託者は、速やかに、その超える額に相当する当該売り付けに係る建玉を決済するための指図をするものとします。
- ⑤ 委託者は、第1項の取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### (先物取引等の運用指図)

第16条 委託者は、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、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。）の指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

- ② 委託者は、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、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

#### (スワップ取引の運用指図)

第17条 委託者は、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、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」とい

います。)を行うことの指図をすることができます。

- ② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期間が、原則として第3条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
- ③ スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少してスワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部解約を指図するものとします。
- ④ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。
- ⑤ 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### (金利先渡取引の運用指図)

第18条 委託者は、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、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- ② 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第3条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ③ 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。
- ④ 委託者は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### (デリバティブ取引等にかかる投資制限)

第18条の2 委託者は、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用いて、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方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### (有価証券の貸付の指図および範囲)

第19条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券を貸付けることの指図をすることができます。

- ② 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行う

ものとしします。

(公社債の空売りの指図範囲)

第20条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）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るものとしします。

- ② 前項の売り付けの指図にあたっては、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えないものとしします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとしします。

(公社債の借入れ)

第21条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認められた時は、担保の提供の指図を行うものとしします。

- ② 前項の指図にあたっては、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えないものとしします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を決済するための指図をするものとしします。
- ④ 第1項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

(保管業務の委任)

第22条 受託者は、委託者と協議の上、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

(有価証券の保管)

第23条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

(混蔵寄託)

第24条 金融機関または第一種金融商品取引業者（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およ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。以下本条において同じ。) から、売買代金およ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またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

#### (一括登録)

第25条 信託財産に属する国債証券のうち振替決済に係る国債証券については、日本銀行で保管することがあります。この場合、日本銀行においては日本銀行名義で一括登録することがあります。

#### (信託財産の登記等および記載等の留保等)

第26条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載また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、受託者が認める場合は、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。
- ④ 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。

#### (有価証券の売却等の指図)

第27条 委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

#### (再投資の指図)

第28条 委託者は、前条の規定による売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

#### (損益の帰属)

第29条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第30条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利息等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立て替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(計算期間)

第31条 この信託の計算期間は、毎年3月6日から翌年3月5日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は平成15年5月20日から平成16年3月5日までとします。

- ② 前項の規定にかかわらず、前項の原則により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。但し、最終計算期間の終了日は、第3条に定める信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告)

第32条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

(信託事務の諸費用)

第33条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立て替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ② 第1項に定める信託事務の処理等に要する諸費用のうち、ベビーファンドに関連して生じたものについては、委託者はこれをこの信託に関連して生じたものではないとみなすことができます。

(信託報酬等)

第34条 委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を収受しません。

(利益の留保)

第35条 信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産に留保し、期中には分配を行いま

せん。

(追加信託金および一部解約金の計理処理)

第36条 追加信託金または一部解約金は、当該金額と元本に相当する金額の差額を、追加信託にあつては追加信託差金、信託の一部解約にあつては解約差金として処理します。

(償還金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責)

第37条 受託者は、信託が終了した時は、償還金(信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。)の全額を委託者に交付します。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者に償還金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(償還金の支払い)

第38条 委託者は、受託者より償還金の交付を受けた後、受益証券と引き換えに当該償還金を受益者に支払います。

(一部解約)

第39条 委託者は、受益者の請求があつた場合には、この信託契約の一部を解約します。

- ② 前項の一部解約の価額は、一部解約実行日の前営業日の基準価額から当該基準価額に0.05%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。

(信託契約の解約)

第40条 委託者は、信託期間中において、この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とき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、この信託の受益証券を投資対象とすることを信託約款において定めるすべての証券投資信託がその信託を終了させることとなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- ③ 委託者は、前2項の事項について、あらかじめ、解約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。
- ④ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者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。

- ⑤ 前項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、第1項の信託契約の解約をしません。
- ⑥ 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およ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。
- ⑦ 第4項から前項までの規定は、第2項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合には適用しません。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第41条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第45条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第42条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁が、この信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第45条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第43条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第44条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第45条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更)

第45条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およ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。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者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。
- ④ 前項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、第1項の信託約款の変更をしません。
- ⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およ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。

(反対者の買取請求権)

第46条 第40条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第40条第4項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己の有する受益証券を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

(利益相反のおそれがある場合の受益者の書面交付)

第47条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第13条第1項に定める書面を交付しません。

(運用報告書)

第48条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条に定める運用報告書を交付しません。

(公 告)

第49条 委託者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。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第50条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成 15 年 5 月 20 日  
平成 17 年 6 月 8 日変更  
平成 17 年 7 月 1 日変更  
平成 18 年 5 月 1 日変更  
平成 19 年 9 月 30 日変更  
平成 19 年 10 月 1 日変更  
平成 19 年 11 月 30 日変更  
平成 20 年 5 月 16 日変更  
平成 20 年 7 月 1 日変更  
平成 20 年 6 月 30 日変更  
平成 24 年 4 月 1 日変更  
平成 25 年 1 月 4 日変更  
平成 26 年 12 月 1 日変更  
平成 28 年 4 月 28 日変更  
平成 28 年 5 月 31 日変更  
令和 5 年 12 月 6 日変更

委託者 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

受託者 三井住友信託銀行株式会社

(付則)

第 1 条 第 18 条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日からの一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。