

# 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。

2024年6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2024年6月5日に関東財務局長に提出しており、2024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 新原 謙介
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】

2024年6月6日から2025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 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。
- 3 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。

※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。

#### ベンチマーク

##### TOPIX

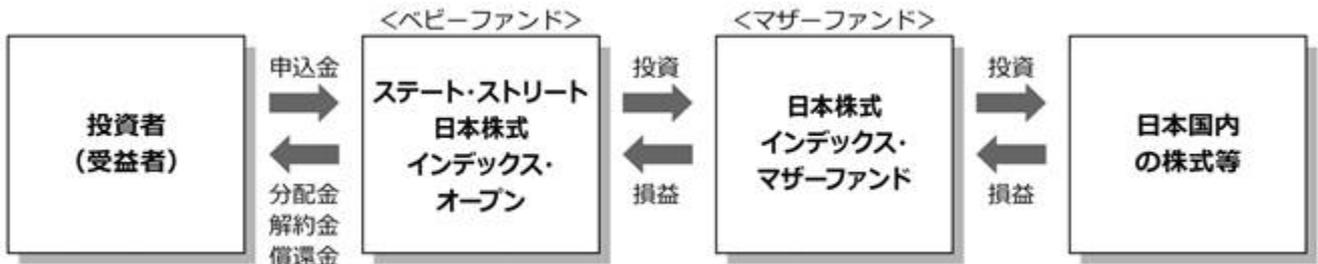
- ①TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」と言います。)の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利はJPXが有します。
- ②JPXは、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- ③JPXは、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④JPX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。
- ⑥JPX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。
- ⑦JPX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。

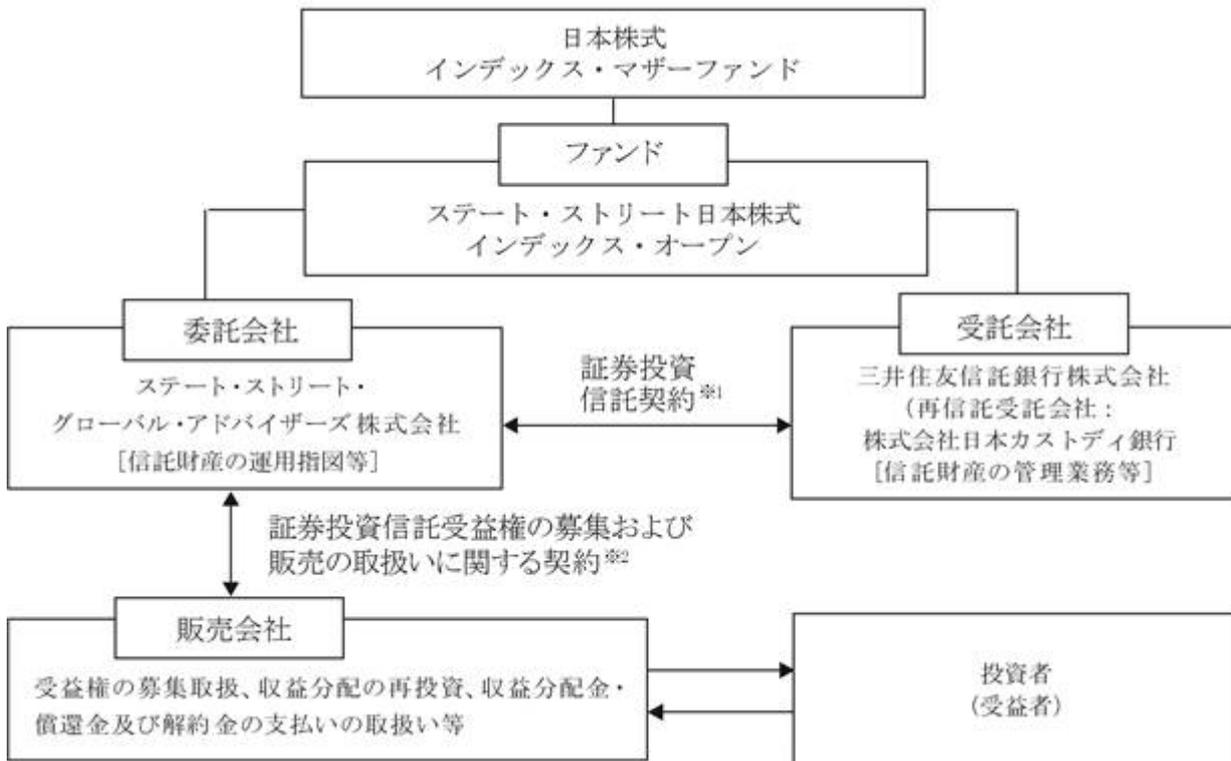


② ファンドの関係法人

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

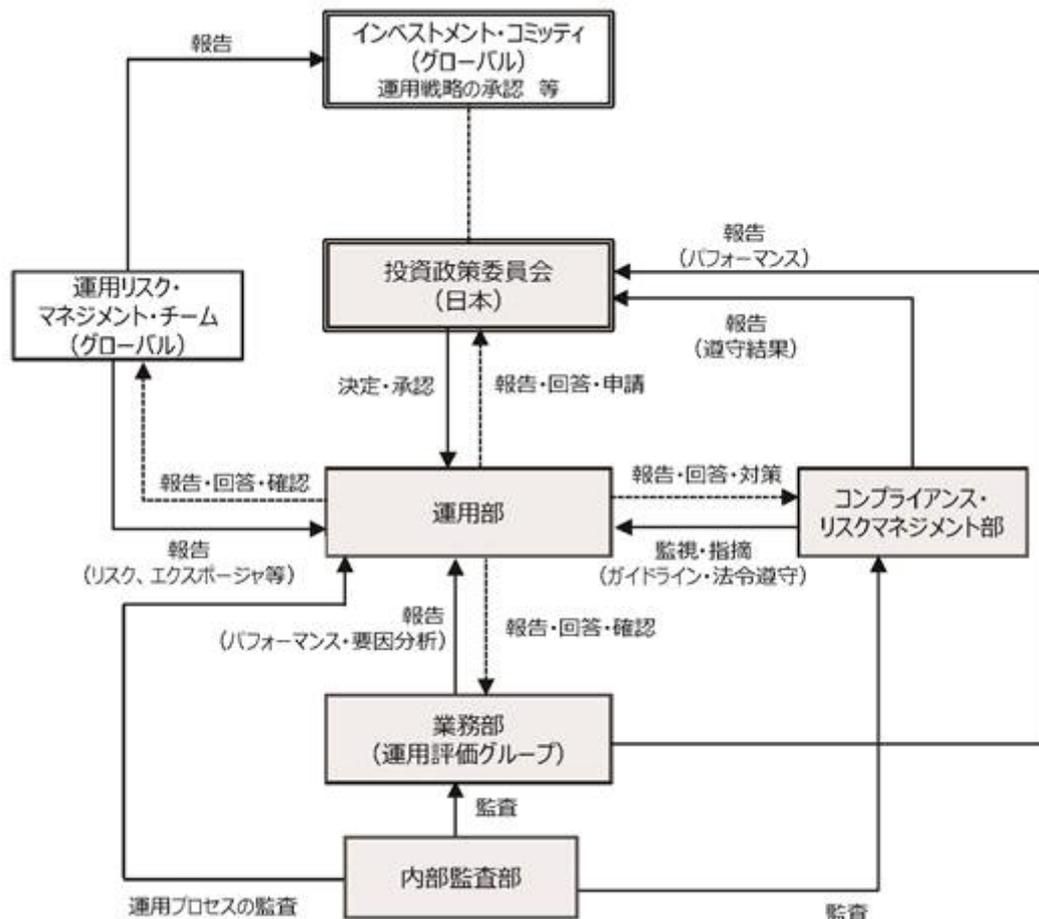
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券(金融商品取引法第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。

#### <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るものとします。
- (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ます。
- (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ます。
- (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ます。

### 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ます（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。
  - (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します。
  - (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します。
  - (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します。
- 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。
  - (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します。
  - (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します。
- 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します。
- 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します。
  - (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ます。
  - (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が、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。

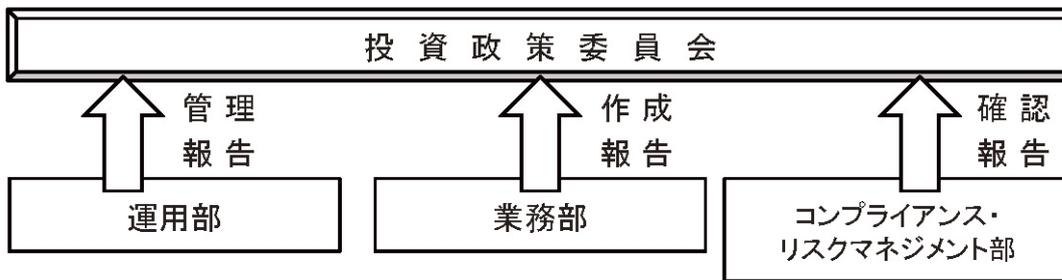
(2) その他の留意点

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ある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。

ファンドの基準価額と対象インデックスは、費用等の要因により、完全に一致するものではありません。また、ファンドの投資成果が対象インデックスとの連動または上回ることを保証するものではありません。

(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。

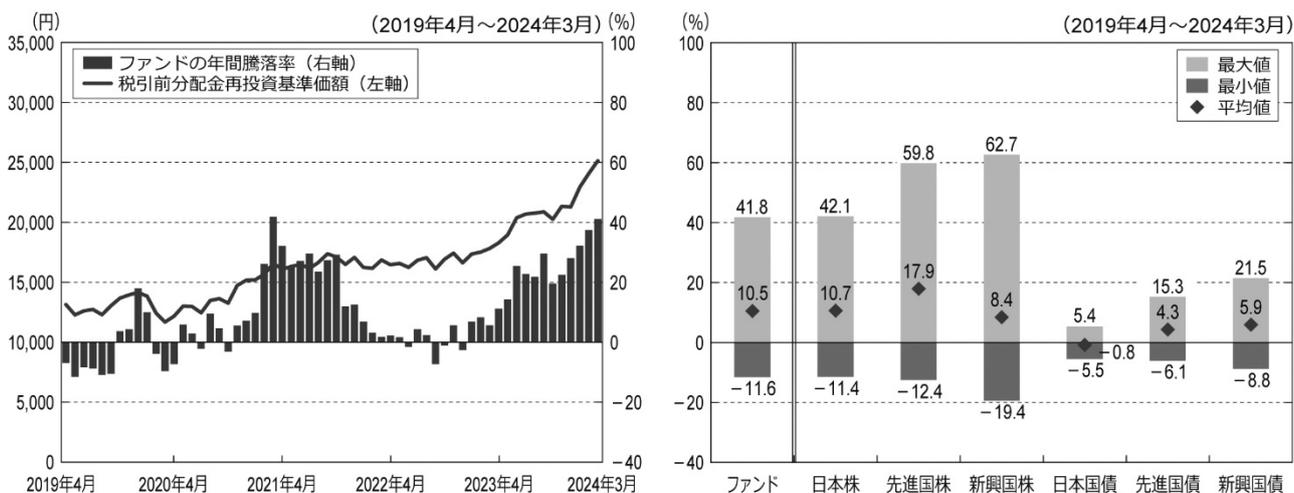
取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

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・ディバースファイド(円換算ベース)

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(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）」について

公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。当ファンドは、NISAの対象ではありません。

#### ◆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、2024年3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。

(参考情報) ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率 (①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.09%	0.08%	0.01%

※対象期間は2023年3月7日～2024年3月5日です。

※上記は、対象期間の運用報告書に記載されている総経費率(原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含まれていません。)です。平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。

※その他費用とは監査費用や有価証券の保管費用等です。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 5 【運用状況】

### (1) 【投資状況】

(2024年3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	15,424,966,706	100.00
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		761,721	0.00
純資産総額		15,425,728,427	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

#### <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)

(2024年3月29日現在)

種類	国/地域名	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	57,115,635,020	96.58
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		2,025,154,252	3.42
純資産総額		59,140,789,272	100.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

### (2) 【投資資産】

#### ① 【投資有価証券の主要銘柄】

(2024年3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	—	2,969,537,715	5.0564	15,015,170,503	5.1944	15,424,966,706	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資産の時価比率です。

#### 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資産の時価比率です。

#### 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)

(2024年3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	801,200	3,729.00	2,987,674,800	3,792.00	3,038,150,400	5.14
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	875,100	1,596.50	1,397,097,150	1,557.00	1,362,530,700	2.30
3	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	103,200	12,950.00	1,336,440,000	12,985.00	1,340,052,000	2.27

4	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	30,900	39,450.00	1,219,005,000	39,570.00	1,222,713,000	2.07
5	日本	株式	三菱商事	卸売業	296,400	3,287.00	974,266,800	3,487.00	1,033,546,800	1.75
6	日本	株式	キーエンス	電気機器	14,600	74,880.00	1,093,248,000	69,540.00	1,015,284,000	1.72
7	日本	株式	日立製作所	電気機器	70,800	13,310.00	942,348,000	13,905.00	984,474,000	1.66
8	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	102,200	8,623.00	881,270,600	8,909.00	910,499,800	1.54
9	日本	株式	信越化学工業	化学	131,100	6,588.00	863,686,800	6,584.00	863,162,400	1.46
10	日本	株式	三井物産	卸売業	115,600	6,816.00	787,929,600	7,106.00	821,453,600	1.39
11	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4,352,500	180.70	786,496,750	179.80	782,579,500	1.32
12	日本	株式	任天堂	その他製品	92,100	8,390.00	772,719,000	8,196.00	754,851,600	1.28
13	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	111,000	6,299.00	699,189,000	6,707.00	744,477,000	1.26
14	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	103,800	6,666.00	691,930,800	6,466.00	671,170,800	1.13
15	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	142,000	4,408.00	625,936,000	4,703.00	667,826,000	1.13
16	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	345,700	1,798.50	621,741,450	1,891.00	653,718,700	1.11
17	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	72,200	9,008.00	650,377,600	8,962.00	647,056,400	1.09
18	日本	株式	第一三共	医薬品	127,500	4,945.00	630,487,500	4,777.00	609,067,500	1.03
19	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	193,900	2,878.00	558,044,200	3,046.00	590,619,400	1.00
20	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	129,500	4,343.00	562,418,500	4,184.00	541,828,000	0.92
21	日本	株式	HOYA	精密機器	28,700	19,855.00	569,838,500	18,740.00	537,838,000	0.91
22	日本	株式	KDDI	情報・通信業	113,100	4,506.00	509,628,600	4,482.00	506,914,200	0.86
23	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	235,600	1,953.00	460,126,800	1,951.00	459,655,600	0.78
24	日本	株式	三菱電機	電気機器	164,000	2,432.50	398,930,000	2,512.00	411,968,000	0.70
25	日本	株式	ディスコ	機械	7,100	53,450.00	379,495,000	57,190.00	406,049,000	0.69
26	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	79,400	5,276.00	418,914,400	4,849.00	385,010,600	0.65
27	日本	株式	村田製作所	電気機器	132,700	3,005.00	398,763,500	2,824.00	374,744,800	0.63
28	日本	株式	三菱重工業	機械	258,000	1,230.00	317,340,000	1,448.50	373,713,000	0.63
29	日本	株式	SMC	機械	4,400	91,220.00	401,368,000	84,830.00	373,252,000	0.63
30	日本	株式	ダイキン工業	機械	17,600	21,165.00	372,504,000	20,600.00	362,560,000	0.61

(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資産の時価比率です。

#### 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	16.81
	輸送用機器	9.17
	卸売業	7.16
	銀行業	7.15
	情報・通信業	7.02
	化学	5.51
	機械	5.43
	サービス業	4.29
	医薬品	4.11
	小売業	4.07
	食料品	2.98
	保険業	2.63
	陸運業	2.41
	その他製品	2.20
	精密機器	2.14
	不動産業	2.07
	建設業	2.01
	電気・ガス業	1.34
	その他金融業	1.15

鉄鋼	0.91
証券、商品先物取引業	0.90
非鉄金属	0.68
海運業	0.68
ゴム製品	0.67
ガラス・土石製品	0.66
石油・石炭製品	0.50
金属製品	0.50
空運業	0.39
繊維製品	0.35
鉱業	0.32
パルプ・紙	0.16
倉庫・運輸関連業	0.13
水産・農林業	0.08
合 計	96.58

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

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) (2024年6月限)	大阪取引所	買建	68	1,866,252,620	1,883,600,000	3.18

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

(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】

2024年3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	分配付 :	1.7869
		分配落 :	12,213,219,047	分配落 :	1.7869

第8期	(2024年 3月 5日)	分配付： 15,155,601,598 分配落： 15,155,601,598	分配付： 2.4426 分配落： 2.4426
	2023年 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
	10月 末日	14,528,642,735	2.0209
	11月 末日	15,089,419,012	2.1299
	12月 末日	14,890,296,601	2.1249
	2024年 1月 末日	12,197,700,578	2.2905
	2月 末日	14,949,125,521	2.4029
	3月 末日	15,425,728,427	2.5090

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
第8期	自2023年 3月 7日 至2024年 3月 5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%
第8期	自2023年 3月 7日 至2024年 3月 5日	36.7%

(注) 各計算期間中の分配金を加味して算出しています。

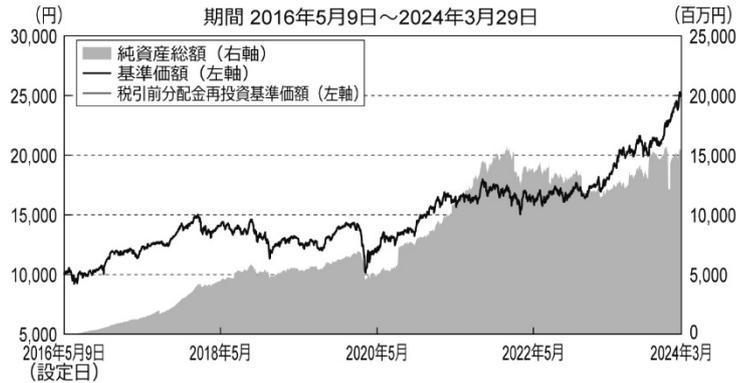
(4) 【設定及び解約の実績】

	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
第8期	自2023年 3月 7日 至2024年 3月 5日	3,426,684,132	4,056,680,728	6,204,798,078

(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	25,090円
純資産総額	15,426百万円

### 分配の推移

決算期	分配金
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
第8期 (2024年3月5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	5.14%
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.30%
3	日本	株式	ソニーグループ	2.27%
4	日本	株式	東京エレクトロン	2.07%
5	日本	株式	三菱商事	1.75%
6	日本	株式	キーエンス	1.72%
7	日本	株式	日立製作所	1.66%
8	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	1.54%
9	日本	株式	信越化学工業	1.46%
10	日本	株式	三井物産	1.39%

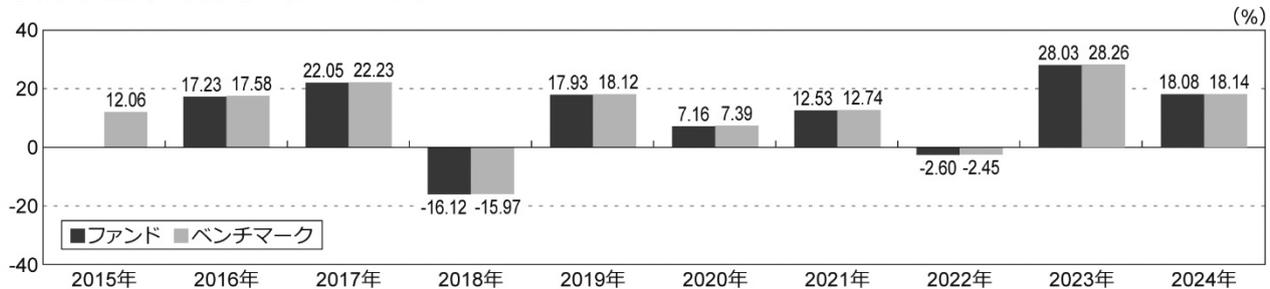
(注) 投資比率は、マザーファンド純資産総額に対する各評価金額の比率で、上位10銘柄について記載しています。

### <業種別投資比率>

	業種	投資比率
1	電気機器	16.81%
2	輸送用機器	9.17%
3	卸売業	7.16%
4	銀行業	7.15%
5	情報・通信業	7.02%
6	化学	5.51%
7	機械	5.43%
8	サービス業	4.29%
9	医薬品	4.11%
10	小売業	4.07%

(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。

※2024年のファンドとベンチマークの年間収益率は年初から3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。なお、2024年11月5日より東京証券取引所の取引時間が午後3時30分までに変更される予定です。これにより、ファンドの申込締切時間が変更される場合があります。詳しくは販売会社にお問合せください。
- 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。なお、2024年11月5日より東京証券取引所の取引時間が午後3時30分までに変更される予定です。これにより、ファンドの申込締切時間が変更される場合があります。詳しくは販売会社にお問合せください。
- 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り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10億口を下回るように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)の規定にしたがいます。
- 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)の規定にしたがい、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にあっても、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）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8期計算期間(2023年3月7日から2024年3月5日まで)の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により監査を受けております。

# 独立監査人の監査報告書

2024年5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 Japan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 榎原 康太  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているステート・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2024年3月5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2024年3月5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7期 (2023年3月6日現在)	第8期 (2024年3月5日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	147,816	674,042
コール・ローン	25,384,408	38,368,288
親投資信託受益証券	12,212,521,157	15,154,759,427
未収入金	15,900,000	40,100,000
流動資産合計	12,253,953,381	15,233,901,757
資産合計	12,253,953,381	15,233,901,757
負債の部		
流動負債		
未払解約金	28,351,938	67,808,336
未払受託者報酬	2,063,734	2,349,266
未払委託者報酬	9,630,738	7,359,387
未払利息	67	103
その他未払費用	687,857	783,067
流動負債合計	40,734,334	78,300,159
負債合計	40,734,334	78,300,159
純資産の部		
元本等		
元本	6,834,794,674	6,204,798,078
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	5,378,424,373	8,950,803,520
(分配準備積立金)	1,599,149,632	4,003,710,910
元本等合計	12,213,219,047	15,155,601,598
純資産合計	12,213,219,047	15,155,601,598
負債純資産合計	12,253,953,381	15,233,901,757

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期 自 2022年3月8日 至 2023年3月6日	第8期 自 2023年3月7日 至 2024年3月5日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,988,355,454	4,317,248,270
営業収益合計	1,988,355,454	4,317,248,270
営業費用		
支払利息	30,350	32,968
受託者報酬	4,317,298	4,415,101
委託者報酬	20,147,314	16,999,848
その他費用	1,439,279	1,471,942
営業費用合計	25,934,241	22,919,859
営業利益又は営業損失(△)	1,962,421,213	4,294,328,411
経常利益又は経常損失(△)	1,962,421,213	4,294,328,411
当期純利益又は当期純損失(△)	1,962,421,213	4,294,328,411
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(△)	472,746,055	1,135,962,894
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	1,534,357,297	3,795,200,309
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	1,534,357,297	3,795,200,309
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,053,103,606	3,381,186,679
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	2,053,103,606	3,381,186,679
分配金	—	—
期末剰余金又は期末欠損金(△)	5,378,424,373	8,950,803,520

## (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。
-------------------	--

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

第7期 (2023年3月6日現在)	第8期 (2024年3月5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7期 (2023年3月6日現在)	第8期 (2024年3月5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	3,426,684,132円
期中一部解約元本額	3,715,667,036円	4,056,680,728円
2 受益権の総数	6,834,794,674口	6,204,798,078口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第7期 自 2022年3月8日 至 2023年3月6日	第8期 自 2023年3月7日 至 2024年3月5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(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(295,241,581円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(2,863,123,936円)、収益調整金(4,947,092,610円)及び分配準備積立金(845,345,393円)より分配対象収益は8,950,803,520円(1万口当たり14,425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7期 (2023年3月6日現在)	第8期 (2024年3月5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 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いての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	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	第7期 (2023年3月6日現在)	第8期 (2024年3月5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	1,631,556,040	3,377,714,599
合計	1,631,556,040	3,377,714,599

(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7期 (2023年3月6日現在)	第8期 (2024年3月5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)	2.4426円 (24,426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	2,997,084,827	15,154,759,427	
合 計		2,997,084,827	15,154,759,427	

(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	(2023年3月6日現在)	(2024年3月5日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		4,098,840	40,934,947
コール・ローン		703,891,541	2,330,126,115
株式		53,012,482,760	57,233,358,650
派生商品評価勘定		—	2,171,160
未収入金		19,104,480	143,805,300
未収配当金		105,426,527	96,529,405
差入委託証拠金		28,620,000	109,375,719
流動資産合計		53,873,624,148	59,956,301,296
資産合計		53,873,624,148	59,956,301,296
負債の部			
流動負債			
前受金		12,980,000	135,182,500
派生商品評価勘定		341,120	—
未払解約金		113,201,000	269,424,770
未払利息		1,884	6,280
その他未払費用		759	3,151
流動負債合計		126,524,763	404,616,701
負債合計		126,524,763	404,616,701
純資産の部			
元本等			
元本	1	14,558,908,008	11,777,311,876
剰余金			
剰余金又は欠損金 (△)		39,188,191,377	47,774,372,719
元本等合計		53,747,099,385	59,551,684,595
純資産合計		53,747,099,385	59,551,684,595
負債純資産合計		53,873,624,148	59,956,301,296

(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)

(2023年3月6日現在)	(2024年3月5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	(2023年3月6日現在)	(2024年3月5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	2,185,943,329円
期中一部解約元本額	12,399,049,064円	4,967,539,461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	53,886,760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	666,372,134円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	2,898,566円	839,684円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	23,988,398円	13,040,589円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	95,561円	79,230円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	2,369,752円	785,686円

バランスファンドVA50A<適格機関投資家限定>	4,168,214円	2,571,702円
バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	4,005,086,693円	3,164,567,945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	256,396,367円
バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	2,111,954円	1,804,583円
バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	524,962,098円	343,219,708円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	435,713,404円	331,404,255円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	31,673,865円	21,356,478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	71,318,276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	74,782,260円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	94,542,489円	60,772,701円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	1,423,723,607円	1,082,086,300円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	193,801,129円	125,825,994円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	942,430,300円	675,613,760円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	31,132,700円	22,962,049円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	9,828,013円	7,219,369円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	14,088,522円	11,116,907円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	5,225,456円	3,485,215円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	339,407,323円	241,054,524円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	1,174,704円	773,576円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	2,163,323円	1,062,669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	46,907,714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	145,603,727円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	879,179,744円	625,986,247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	55,548,166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	403,673,754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	52,570,779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	2,997,084,827円
ステート・ストリートTOPIXイン デックス・オープン	—円	534,288円
世界バランス40VA＜適格機関投資 家限定＞	2,753,384円	1,814,418円
世界バランス60VA＜適格機関投資 家限定＞	3,682,872円	1,544,249円
グローバルバランス40VA＜適格機 関投資家限定＞	194,223円	105,025円
グローバルバランス40VA2＜適格 機関投資家限定＞	289,049,365円	203,220,820円
グローバルバランス40VA3＜適格 機関投資家限定＞	10,430,102円	5,248,840円
グローバルバランス50VA＜適格機 関投資家限定＞	3,664,926円	3,070,301円
計	14,558,908,008円	11,777,311,876円
2 受益権の総数	14,558,908,008口	11,777,311,876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	<p>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。</p>
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	<p>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</p>

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	(2023年3月6日現在)	(2024年3月5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	(2023年3月6日現在)	(2024年3月5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	6,220,285,630	14,234,701,828
合計	6,220,285,630	14,234,701,828

(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	(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	(2024年3月5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)	1,997,260,000	—	1,999,480,000 2,220,000
	合 計	1,997,260,000	—	1,999,480,000 2,220,000

## (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)

	(2023年3月6日現在)	(2024年3月5日現在)
1口当たり純資産額	3.6917円	5.0565円
(1万口当たり純資産額)	(36,917円)	(50,565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	800	3,530.00	2,824,000	
ニッスイ	20,700	937.80	19,412,460	
マルハニチロ	3,000	2,851.00	8,553,000	
雪国まいたけ	1,700	1,010.00	1,717,000	
カネコ種苗	800	1,401.00	1,120,800	
サカタのタネ	2,300	3,675.00	8,452,500	
ホクト	1,700	1,794.00	3,049,800	
ホクリヨウ	200	1,056.00	211,200	
ショーボンドホールディングス	2,800	6,182.00	17,309,600	
ミライト・ワン	6,800	1,862.00	12,661,600	
タマホーム	1,300	4,175.00	5,427,500	
サンヨーホームズ	100	762.00	76,200	
日本アクア	500	1,014.00	507,000	
ファーストコーポレーション	400	799.00	319,600	
ベステラ	400	1,139.00	455,600	
Robot Home	4,600	157.00	722,200	
キャンディル	600	574.00	344,400	
住石ホールディングス	2,100	4,165.00	8,746,500	
日鉄鉱業	800	5,090.00	4,072,000	
三井松島ホールディングス	1,100	3,215.00	3,536,500	
INPEX	69,900	2,109.00	147,419,100	
石油資源開発	2,400	6,020.00	14,448,000	
K&Oエナジーグループ	1,000	2,390.00	2,390,000	
ダイセキ環境ソリューション	300	980.00	294,000	
第一カッター興業	700	1,489.00	1,042,300	
明豊ファシリティワークス	400	897.00	358,800	
安藤・間	12,000	1,227.00	14,724,000	
東急建設	6,200	819.00	5,077,800	
コムシスホールディングス	6,600	3,380.00	22,308,000	
ビーアールホールディングス	3,700	375.00	1,387,500	
高松コンストラクショングループ	1,500	2,896.00	4,344,000	
東建コーポレーション	600	9,500.00	5,700,000	
ソネック	200	931.00	186,200	
ヤマウラ	1,000	1,521.00	1,521,000	
オリエンタル白石	7,400	388.00	2,871,200	
大成建設	13,600	5,090.00	69,224,000	
大林組	51,900	1,757.00	91,188,300	
清水建設	41,100	916.20	37,655,820	
飛島建設	1,400	1,500.00	2,100,000	
長谷工コーポレーション	13,300	1,848.00	24,578,400	
松井建設	1,400	858.00	1,201,200	
銭高組	100	4,200.00	420,000	
鹿島建設	32,200	2,938.00	94,603,600	
不動産テトラ	1,100	2,232.00	2,455,200	

大末建設	400	1,591.00	636,400	
鉄建建設	1,000	2,461.00	2,461,000	
西松建設	2,700	4,545.00	12,271,500	
三井住友建設	11,100	421.00	4,673,100	
大豊建設	500	3,200.00	1,600,000	
佐田建設	600	723.00	433,800	
ナカノフドー建設	800	683.00	546,400	
奥村組	2,300	5,070.00	11,661,000	
東鉄工業	1,900	3,000.00	5,700,000	
イチケン	300	2,477.00	743,100	
富士ピー・エス	400	454.00	181,600	
浅沼組	1,100	4,335.00	4,768,500	
戸田建設	19,600	994.20	19,486,320	
熊谷組	2,400	3,890.00	9,336,000	
北野建設	200	3,230.00	646,000	
植木組	400	1,726.00	690,400	
矢作建設工業	1,900	1,523.00	2,893,700	
ピーエス三菱	2,100	1,048.00	2,200,800	
日本ハウスホールディングス	3,400	312.00	1,060,800	
大東建託	5,400	17,480.00	94,392,000	
新日本建設	2,300	1,408.00	3,238,400	
東亜道路工業	600	6,500.00	3,900,000	
日本道路	1,500	2,013.00	3,019,500	
東亜建設工業	1,100	5,030.00	5,533,000	
日本国土開発	4,400	522.00	2,296,800	
若築建設	500	3,315.00	1,657,500	
東洋建設	3,800	1,401.00	5,323,800	
五洋建設	20,500	773.60	15,858,800	
世紀東急工業	2,000	1,918.00	3,836,000	
福田組	600	5,340.00	3,204,000	
日本ドライケミカル	300	2,623.00	786,900	
住友林業	12,500	4,267.00	53,337,500	
日本基礎技術	800	490.00	392,000	
巴コーポレーション	1,500	657.00	985,500	
大和ハウス工業	40,200	4,344.00	174,628,800	
ライト工業	2,900	1,868.00	5,417,200	
積水ハウス	44,100	3,375.00	148,837,500	
日特建設	1,300	1,159.00	1,506,700	
北陸電気工事	900	1,183.00	1,064,700	
ユアテック	3,400	1,329.00	4,518,600	
日本リーテック	1,300	1,242.00	1,614,600	
四電工	700	4,015.00	2,810,500	
中電工	2,200	2,900.00	6,380,000	
関電工	9,000	1,749.00	15,741,000	
きんでん	10,200	2,576.50	26,280,300	
東京エネシス	1,700	1,116.00	1,897,200	
トーエネック	500	5,070.00	2,535,000	
住友電設	1,400	3,140.00	4,396,000	
日本電設工業	2,700	1,992.00	5,378,400	

エクシオグループ	7,100	3,178.00	22,563,800	
新日本空調	800	2,919.00	2,335,200	
九電工	3,100	5,721.00	17,735,100	
三機工業	3,100	1,987.00	6,159,700	
日揮ホールディングス	14,300	1,383.50	19,784,050	
中外炉工業	400	2,988.00	1,195,200	
ヤマト	800	962.00	769,600	
太平電業	900	4,360.00	3,924,000	
高砂熱学工業	3,900	4,345.00	16,945,500	
三晃金属工業	100	5,060.00	506,000	
NEC ネットエスアイ	5,700	2,606.00	14,854,200	
朝日工業社	600	3,065.00	1,839,000	
明星工業	2,600	1,226.00	3,187,600	
大気社	1,700	4,655.00	7,913,500	
ダイダン	1,800	1,867.00	3,360,600	
日比谷総合設備	1,000	2,644.00	2,644,000	
ニッポン	4,300	2,342.00	10,070,600	
日清製粉グループ本社	13,400	2,032.00	27,228,800	
日東富士製粉	300	5,360.00	1,608,000	
昭和産業	1,400	3,410.00	4,774,000	
鳥越製粉	1,100	694.00	763,400	
中部飼料	2,300	1,225.00	2,817,500	
フィード・ワン	2,200	1,023.00	2,250,600	
東洋精糖	200	2,484.00	496,800	
日本甜菜製糖	900	2,094.00	1,884,600	
DM三井製糖ホールディングス	1,400	3,250.00	4,550,000	
塩水港精糖	1,400	300.00	420,000	
ウェルネオシュガー	800	2,331.00	1,864,800	
L I F U L L	6,000	164.00	984,000	
M I X I	3,200	2,476.00	7,923,200	
ジェイエシーリクルートメント	5,600	743.00	4,160,800	
日本M&Aセンターホールディングス	24,100	963.30	23,215,530	
メンバーズ	600	850.00	510,000	
中広	500	410.00	205,000	
UTグループ	2,000	3,670.00	7,340,000	
アイティメディア	700	1,946.00	1,362,200	
ケアネット	2,700	676.00	1,825,200	
E・Jホールディングス	800	1,672.00	1,337,600	
オープンアップグループ	4,500	2,033.00	9,148,500	
コシダカホールディングス	4,500	915.00	4,117,500	
アルトナー	300	2,586.00	775,800	
パソナグループ	1,800	2,848.00	5,126,400	
CDS	300	1,709.00	512,700	
リンクアンドモチベーション	4,400	607.00	2,670,800	
エス・エム・エス	5,300	2,476.00	13,122,800	
サニーサイドアップグループ	300	723.00	216,900	
パーソルホールディングス	154,700	209.90	32,471,530	
リニカル	600	386.00	231,600	
クックパッド	4,500	123.00	553,500	

エスクリ	300	306.00	91,800	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	400	763.00	305,200	
森永製菓	6,200	2,647.50	16,414,500	
中村屋	400	3,130.00	1,252,000	
江崎グリコ	4,200	4,424.00	18,580,800	
名糖産業	600	1,839.00	1,103,400	
井村屋グループ	900	2,448.00	2,203,200	
不二家	1,100	2,451.00	2,696,100	
山崎製パン	9,700	3,628.00	35,191,600	
第一屋製パン	500	724.00	362,000	
モロゾフ	500	4,255.00	2,127,500	
亀田製菓	800	4,325.00	3,460,000	
寿スピリッツ	6,800	1,858.00	12,634,400	
カルビー	6,600	3,219.00	21,245,400	
森永乳業	5,100	3,042.00	15,514,200	
六甲バター	1,200	1,331.00	1,597,200	
ヤクルト本社	20,800	3,153.00	65,582,400	
明治ホールディングス	17,900	3,329.00	59,589,100	
雪印メグミルク	3,500	2,204.00	7,714,000	
プリマハム	1,900	2,259.00	4,292,100	
日本ハム	6,300	5,307.00	33,434,100	
林兼産業	300	565.00	169,500	
丸大食品	1,400	1,623.00	2,272,200	
S Foods	1,600	3,045.00	4,872,000	
柿安本店	500	2,646.00	1,323,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	2,200	4,145.00	9,119,000	
学情	800	1,802.00	1,441,600	
スタジオアリス	900	2,041.00	1,836,900	
クロスキャット	1,000	1,922.00	1,922,000	
エプロ	500	850.00	425,000	
システナ	23,400	284.00	6,645,600	
NJS	400	2,804.00	1,121,600	
デジタルアーツ	1,000	4,380.00	4,380,000	
日鉄ソリューションズ	2,500	5,030.00	12,575,000	
総合警備保障	25,300	823.20	20,826,960	
キューブシステム	1,000	1,093.00	1,093,000	
いちご	16,500	395.00	6,517,500	
日本駐車場開発	14,900	185.00	2,756,500	
コア	700	1,833.00	1,283,100	
カカクコム	10,000	1,643.00	16,430,000	
アイロムグループ	700	1,832.00	1,282,400	
セントケア・ホールディング	1,300	888.00	1,154,400	
サイネックス	400	852.00	340,800	
ルネサンス	1,400	1,040.00	1,456,000	
ディップ	2,400	2,579.00	6,189,600	
SBSホールディングス	1,300	2,323.00	3,019,900	
デジタルホールディングス	800	1,137.00	909,600	
新日本科学	1,400	1,578.00	2,209,200	
キャリアデザインセンター	300	1,703.00	510,900	

ベネフィット・ワン	5,200	2,169.50	11,281,400	
エムスリー	30,100	2,087.50	62,833,750	
ツカダ・グローバルホールディング	1,100	407.00	447,700	
プラス	200	684.00	136,800	
アウトソーシング	9,700	1,748.00	16,955,600	
ウェルネット	1,100	539.00	592,900	
ワールドホールディングス	600	2,424.00	1,454,400	
ディー・エヌ・エー	5,600	1,338.50	7,495,600	
博報堂DYホールディングス	19,300	1,335.00	25,765,500	
ぐるなび	3,100	267.00	827,700	
タカミヤ	2,300	542.00	1,246,600	
ファンコミュニケーションズ	2,100	399.00	837,900	
ライク	700	1,557.00	1,089,900	
A o b a - B B T	600	393.00	235,800	
エスプール	4,600	310.00	1,426,000	
WDBホールディングス	900	2,187.00	1,968,300	
手間いらず	300	2,732.00	819,600	
ティア	1,100	455.00	500,500	
CDG	100	1,247.00	124,700	
アドウェイズ	2,300	463.00	1,064,900	
バリューコマース	1,400	1,095.00	1,533,000	
インフォマート	15,600	425.00	6,630,000	
サッポロホールディングス	4,800	6,345.00	30,456,000	
アサヒグループホールディングス	33,700	5,128.00	172,813,600	
キリンホールディングス	60,800	2,045.50	124,366,400	
宝ホールディングス	9,900	1,200.00	11,880,000	
オエノンホールディングス	4,700	337.00	1,583,900	
養命酒製造	600	1,886.00	1,131,600	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	11,400	1,996.00	22,754,400	
ライフドリンク カンパニー	200	4,560.00	912,000	
サントリー食品インターナショナル	10,300	4,740.00	48,822,000	
ダイドーグループホールディングス	1,600	2,804.00	4,486,400	
伊藤園	4,900	3,800.00	18,620,000	
キーコーヒー	1,600	2,034.00	3,254,400	
ユニカフェ	400	906.00	362,400	
ジャパンフーズ	100	1,419.00	141,900	
日清オイリオグループ	2,000	5,160.00	10,320,000	
不二製油グループ本社	3,400	2,377.50	8,083,500	
かどや製油	100	3,875.00	387,500	
J-オイルミルズ	1,700	1,932.00	3,284,400	
ローソン	3,300	10,275.00	33,907,500	
サンエー	1,200	4,510.00	5,412,000	
カワチ薬品	1,200	2,722.00	3,266,400	
エービーシー・マート	6,800	2,611.00	17,754,800	
ハードオフコーポレーション	600	1,707.00	1,024,200	
高千穂交易	400	3,840.00	1,536,000	
アスクル	3,800	2,083.00	7,915,400	
ゲオホールディングス	1,600	1,875.00	3,000,000	
アダストリア	1,900	3,400.00	6,460,000	

ジーフット	500	282.00	141,000	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	100	684.00	68,400	
オルパヘルスケアホールディングス	200	1,895.00	379,000	
伊藤忠食品	300	7,510.00	2,253,000	
くら寿司	1,800	4,005.00	7,209,000	
キャンドウ	600	2,617.00	1,570,200	
エレマテック	1,500	1,864.00	2,796,000	
I Kホールディングス	800	375.00	300,000	
パルグループホールディングス	3,000	2,243.00	6,729,000	
エディオン	6,100	1,522.00	9,284,200	
あらた	2,400	3,195.00	7,668,000	
サーラコーポレーション	3,200	795.00	2,544,000	
ワッツ	700	607.00	424,900	
トーメンデバイス	200	5,760.00	1,152,000	
ハローズ	700	4,440.00	3,108,000	
J Pホールディングス	3,800	462.00	1,755,600	
フジオフードグループ本社	1,700	1,330.00	2,261,000	
あみやき亭	400	4,580.00	1,832,000	
東京エレクトロン デバイス	1,600	7,860.00	12,576,000	
ひらまつ	2,800	246.00	688,800	
円谷フィールズホールディングス	2,600	1,498.00	3,894,800	
双日	17,400	3,899.00	67,842,600	
アルフレッサ ホールディングス	15,700	2,210.00	34,697,000	
大黒天物産	500	9,600.00	4,800,000	
ハニーズホールディングス	1,400	1,653.00	2,314,200	
ファーマライズホールディングス	200	658.00	131,600	
キッコーマン	9,700	10,040.00	97,388,000	
味の素	34,700	5,546.00	192,446,200	
ブルドックソース	800	2,129.00	1,703,200	
キューピー	7,800	2,775.00	21,645,000	
ハウス食品グループ本社	5,000	3,053.00	15,265,000	
カゴメ	6,200	3,331.00	20,652,200	
焼津水産化学工業	500	1,348.00	674,000	
アリアケジャパン	1,400	5,110.00	7,154,000	
ピエトロ	100	1,830.00	183,000	
エバラ食品工業	300	2,956.00	886,800	
やまみ	100	3,640.00	364,000	
ニチレイ	6,700	3,761.00	25,198,700	
横浜冷凍	4,200	1,062.00	4,460,400	
東洋水産	7,400	8,888.00	65,771,200	
イートアンドホールディングス	800	2,030.00	1,624,000	
大冷	100	1,930.00	193,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	600	1,238.00	742,800	
日清食品ホールディングス	15,400	4,271.00	65,773,400	
永谷園ホールディングス	700	2,207.00	1,544,900	
一正蒲鉾	300	744.00	223,200	
フジッコ	1,600	1,926.00	3,081,600	
ロック・フィールド	1,600	1,639.00	2,622,400	
日本たばこ産業	88,700	3,872.00	343,446,400	

ケンコーマヨネーズ	1,100	2,031.00	2,234,100	
わらべや日洋ホールディングス	900	2,698.00	2,428,200	
なとり	1,000	2,136.00	2,136,000	
イフジ産業	200	1,600.00	320,000	
ファーマフーズ	2,400	923.00	2,215,200	
北の達人コーポレーション	7,200	202.00	1,454,400	
ユーグレナ	8,900	611.00	5,437,900	
紀文食品	1,300	1,242.00	1,614,600	
ピクルスホールディングス	1,000	1,171.00	1,171,000	
スター・マイカ・ホールディングス	1,500	520.00	780,000	
SREホールディングス	600	3,860.00	2,316,000	
ADワークスグループ	2,200	239.00	525,800	
片倉工業	1,300	1,777.00	2,310,100	
グンゼ	1,100	5,520.00	6,072,000	
ヒューリック	34,000	1,486.50	50,541,000	
神栄	100	1,642.00	164,200	
ラサ商事	500	1,953.00	976,500	
アルペン	1,200	1,937.00	2,324,400	
ハブ	400	745.00	298,000	
ラクーンホールディングス	1,400	600.00	840,000	
クオールホールディングス	2,100	1,651.00	3,467,100	
アルコニックス	2,000	1,404.00	2,808,000	
神戸物産	12,100	3,808.00	46,076,800	
ソリトンシステムズ	700	1,347.00	942,900	
ジズホールディングス	1,000	4,085.00	4,085,000	
ビックカメラ	8,300	1,256.00	10,424,800	
DCMホールディングス	8,200	1,389.00	11,389,800	
ペッパーフードサービス	2,800	124.00	347,200	
ハイパー	600	303.00	181,800	
Monotaro	22,200	1,414.00	31,390,800	
東京一番フーズ	100	519.00	51,900	
DDグループ	700	1,262.00	883,400	
あいホールディングス	2,500	2,322.00	5,805,000	
ディーブイエックス	400	1,053.00	421,200	
きちりホールディングス	300	913.00	273,900	
J. フロント リテイリング	17,900	1,520.50	27,216,950	
ドトール・日レスホールディングス	2,700	2,021.00	5,456,700	
マツキヨココカラ&カンパニー	28,500	2,372.00	67,602,000	
ブロンコビリー	1,000	3,370.00	3,370,000	
ZOZO	10,000	3,608.00	36,080,000	
トレジャー・ファクトリー	800	1,407.00	1,125,600	
物語コーポレーション	2,600	4,540.00	11,804,000	
三越伊勢丹ホールディングス	26,400	2,208.50	58,304,400	
東洋紡	6,300	1,107.00	6,974,100	
ユニチカ	5,600	164.00	918,400	
富士紡ホールディングス	700	4,375.00	3,062,500	
日清紡ホールディングス	11,200	1,238.00	13,865,600	
倉敷紡績	1,100	3,185.00	3,503,500	
ダイワボウホールディングス	6,900	2,582.00	17,815,800	

シキボウ	700	1,207.00	844,900	
日東紡績	1,900	6,100.00	11,590,000	
トヨタ紡織	6,200	2,433.00	15,084,600	
マクニカホールディングス	3,700	8,370.00	30,969,000	
H a m e e	500	1,067.00	533,500	
マーケットエンタープライズ	200	804.00	160,800	
ラクト・ジャパン	700	2,218.00	1,552,600	
ウエルシアホールディングス	8,100	2,759.50	22,351,950	
クリエイトSDホールディングス	2,600	3,195.00	8,307,000	
グリムス	700	2,069.00	1,448,300	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,000	1,260.00	2,520,000	
八洲電機	1,500	1,549.00	2,323,500	
メディアスホールディングス	1,200	723.00	867,600	
レスターホールディングス	1,400	2,938.00	4,113,200	
ジオリーブグループ	400	1,349.00	539,600	
丸善CHIホールディングス	1,400	334.00	467,600	
大光	500	630.00	315,000	
OCHIホールディングス	100	1,715.00	171,500	
TOKAIホールディングス	8,400	1,009.00	8,475,600	
黒谷	700	599.00	419,300	
ミサワ	500	615.00	307,500	
ティーライフ	200	1,370.00	274,000	
C o m i n i x	200	848.00	169,600	
エー・ピーホールディングス	100	985.00	98,500	
三洋貿易	2,000	1,231.00	2,462,000	
チムニー	400	1,433.00	573,200	
シュッピン	1,300	1,129.00	1,467,700	
ビューティガレージ	600	2,354.00	1,412,400	
オイシックス・ラ・大地	2,000	1,329.00	2,658,000	
ウイン・パートナーズ	1,200	1,274.00	1,528,800	
ネクステージ	3,500	2,465.00	8,627,500	
ジョイフル本田	4,500	2,067.00	9,301,500	
鳥貴族ホールディングス	600	4,500.00	2,700,000	
ホットランド	1,300	1,808.00	2,350,400	
すかいらーくホールディングス	21,400	2,228.00	47,679,200	
SFPホールディングス	1,000	1,935.00	1,935,000	
綿半ホールディングス	1,100	1,495.00	1,644,500	
日本毛織	4,100	1,360.00	5,576,000	
ダイトウボウ	1,000	93.00	93,000	
トーア紡コーポレーション	300	430.00	129,000	
ダイドーリミテッド	1,200	684.00	820,800	
ヨシックスホールディングス	200	2,945.00	589,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	4,500	956.00	4,302,000	
野村不動産ホールディングス	8,100	3,803.00	30,804,300	
三重交通グループホールディングス	3,500	602.00	2,107,000	
サムティ	2,300	2,440.00	5,612,000	
ディア・ライフ	2,600	931.00	2,420,600	
コーセーアールイー	500	876.00	438,000	
地主	1,100	2,146.00	2,360,600	

プレサンスコーポレーション	2,300	1,669.00	3,838,700	
フィル・カンパニー	500	777.00	388,500	
THEグローバル社	400	412.00	164,800	
ハウスコム	400	964.00	385,600	
JPMC	1,000	1,192.00	1,192,000	
サンセイランディック	300	997.00	299,100	
エストラスト	100	645.00	64,500	
フージャースホールディングス	2,200	1,066.00	2,345,200	
オープンハウスグループ	5,300	4,549.00	24,109,700	
東急不動産ホールディングス	43,800	1,003.50	43,953,300	
飯田グループホールディングス	13,900	1,906.00	26,493,400	
イーグランド	200	1,588.00	317,600	
ムゲンエステート	800	1,411.00	1,128,800	
帝国繊維	1,800	2,190.00	3,942,000	
日本コークス工業	14,200	120.00	1,704,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,000	567.00	567,000	
ミタチ産業	400	1,231.00	492,400	
BEENOS	700	1,891.00	1,323,700	
あさひ	1,400	1,290.00	1,806,000	
日本調剤	1,200	1,415.00	1,698,000	
コスモス薬品	1,300	13,990.00	18,187,000	
シップヘルスケアホールディングス	5,600	2,195.00	12,292,000	
トーエル	500	795.00	397,500	
ソフトクリエイトホールディングス	1,400	1,850.00	2,590,000	
セブン&アイ・ホールディングス	162,000	2,178.00	352,836,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	10,500	1,022.00	10,731,000	
明治電機工業	600	1,514.00	908,400	
ツルハホールディングス	3,300	11,240.00	37,092,000	
デリカフーズホールディングス	500	585.00	292,500	
スターティアホールディングス	200	1,494.00	298,800	
サンマルクホールディングス	1,400	2,189.00	3,064,600	
フェリシモ	400	913.00	365,200	
トリドールホールディングス	4,400	4,172.00	18,356,800	
帝人	14,200	1,264.50	17,955,900	
東レ	99,400	686.10	68,198,340	
クラレ	21,600	1,474.50	31,849,200	
旭化成	100,400	1,057.50	106,173,000	
TOKYO BASE	1,600	294.00	470,400	
稲葉製作所	800	1,490.00	1,192,000	
宮地エンジニアリンググループ	800	4,255.00	3,404,000	
トーカロ	4,400	1,728.00	7,603,200	
アルファC o	400	1,636.00	654,400	
SUMCO	27,100	2,529.00	68,535,900	
川田テクノロジーズ	400	9,290.00	3,716,000	
RS Technologies	1,000	2,947.00	2,947,000	
ジェイテックコーポレーション	100	2,010.00	201,000	
信和	600	749.00	449,400	
ビーロット	700	948.00	663,600	
ファーストブラザーズ	100	1,250.00	125,000	

And Doホールディングス	1,000	1,138.00	1,138,000	
シーアールイー	800	1,311.00	1,048,800	
ケイアイスター不動産	700	3,505.00	2,453,500	
アグレ都市デザイン	200	1,669.00	333,800	
グッドコムアセット	1,400	750.00	1,050,000	
ジェイ・エス・ビー	800	2,624.00	2,099,200	
ロードスターキャピタル	1,000	2,187.00	2,187,000	
テンポイノベーション	500	908.00	454,000	
グローバル・リンク・マネジメント	100	2,681.00	268,100	
フェイスネットワーク	400	1,498.00	599,200	
霞ヶ関キャピタル	400	14,360.00	5,744,000	
住江織物	200	2,450.00	490,000	
日本フェルト	600	434.00	260,400	
イチカワ	200	1,810.00	362,000	
エコナックホールディングス	2,200	136.00	299,200	
日東製網	100	1,635.00	163,500	
芦森工業	200	2,848.00	569,600	
アツギ	500	603.00	301,500	
ウイルプラスホールディングス	100	1,001.00	100,100	
JMホールディングス	1,100	2,453.00	2,698,300	
コメダホールディングス	3,800	2,683.00	10,195,400	
サツドラホールディングス	400	830.00	332,000	
アレンザホールディングス	1,100	1,047.00	1,151,700	
串カツ田中ホールディングス	500	1,708.00	854,000	
バロックジャパンリミテッド	1,000	769.00	769,000	
クスリのアオキホールディングス	4,700	3,100.00	14,570,000	
ダイニック	300	749.00	224,700	
共和レザー	700	846.00	592,200	
ピーバンドットコム	400	388.00	155,200	
力の源ホールディングス	600	1,563.00	937,800	
FOOD & LIFE COMPANIE	8,300	2,995.00	24,858,500	
アセンテック	400	712.00	284,800	
セーレン	2,800	2,449.00	6,857,200	
ソトー	400	690.00	276,000	
東海染工	300	812.00	243,600	
小松マテーレ	2,000	755.00	1,510,000	
ワコールホールディングス	3,000	3,631.00	10,893,000	
ホギメディカル	2,000	3,650.00	7,300,000	
クラウドディアホールディングス	100	384.00	38,400	
T S I ホールディングス	4,900	653.00	3,199,700	
マツオカコーポレーション	400	1,552.00	620,800	
ワールド	2,100	1,879.00	3,945,900	
T I S	16,200	3,390.00	54,918,000	
テクミラホールディングス	800	472.00	377,600	
グリー	5,000	472.00	2,360,000	
GMOペパボ	300	1,411.00	423,300	
コーエーテクモホールディングス	9,300	1,755.50	16,326,150	
三菱総合研究所	700	5,030.00	3,521,000	
ボルテージ	900	265.00	238,500	

電算	200	1,497.00	299,400	
AGS	400	899.00	359,600	
ファインデックス	1,200	1,231.00	1,477,200	
ブレインパッド	1,200	1,634.00	1,960,800	
KL a b	3,700	350.00	1,295,000	
ポールトゥウィンホールディングス	3,000	513.00	1,539,000	
ネクソン	33,200	2,466.50	81,887,800	
アイスタイル	4,700	509.00	2,392,300	
エムアップホールディングス	2,100	1,127.00	2,366,700	
エイチーム	1,300	563.00	731,900	
エニグモ	2,200	364.00	800,800	
テクノスジャパン	900	623.00	560,700	
e n i s h	800	300.00	240,000	
コロプラ	5,600	548.00	3,068,800	
オルトプラス	500	137.00	68,500	
ブロードリーフ	6,900	599.00	4,133,100	
クロス・マーケティンググループ	700	543.00	380,100	
デジタルハーツホールディングス	900	925.00	832,500	
メディアドゥ	700	1,288.00	901,600	
じげん	4,900	575.00	2,817,500	
ブイキューブ	2,100	312.00	655,200	
エンカレッジ・テクノロジー	500	625.00	312,500	
サイバーリンクス	600	897.00	538,200	
ディー・エル・イー	700	185.00	129,500	
フィックスターズ	1,800	2,016.00	3,628,800	
CARTA HOLDINGS	800	1,438.00	1,150,400	
オプティム	1,400	1,183.00	1,656,200	
セレス	800	1,687.00	1,349,600	
SHIFT	1,000	26,560.00	26,560,000	
特種東海製紙	700	3,860.00	2,702,000	
ティーガイア	1,500	2,064.00	3,096,000	
セック	200	4,845.00	969,000	
テクマトリックス	2,800	1,939.00	5,429,200	
プロシップ	700	1,497.00	1,047,900	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,800	2,125.50	8,076,900	
GMOペイメントゲートウェイ	3,000	10,205.00	30,615,000	
ザッパラス	200	437.00	87,400	
システムリサーチ	500	3,270.00	1,635,000	
インターネットイニシアティブ	7,100	2,745.00	19,489,500	
さくらインターネット	1,600	9,850.00	15,760,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	2,724.00	1,362,000	
SRAホールディングス	800	3,935.00	3,148,000	
システムインテグレータ	800	409.00	327,200	
朝日ネット	1,800	620.00	1,116,000	
eBASE	2,400	753.00	1,807,200	
アバントグループ	1,800	1,319.00	2,374,200	
アドソル日進	700	1,676.00	1,173,200	
ODKソリューションズ	600	624.00	374,400	
フリービット	700	1,640.00	1,148,000	

コムチュア	2,100	2,046.00	4,296,600	
アステリア	1,500	664.00	996,000	
アイル	700	3,870.00	2,709,000	
王子ホールディングス	61,700	591.30	36,483,210	
日本製紙	8,300	1,127.00	9,354,100	
三菱製紙	1,600	564.00	902,400	
北越コーポレーション	7,200	1,473.00	10,605,600	
中越パルプ工業	400	1,829.00	731,600	
巴川コーポレーション	100	869.00	86,900	
大王製紙	6,500	1,142.00	7,423,000	
阿波製紙	300	451.00	135,300	
マークラインズ	900	3,125.00	2,812,500	
メディカル・データ・ビジョン	1,800	567.00	1,020,600	
g u m i	2,300	397.00	913,100	
ショーケース	600	331.00	198,600	
モバイルファクトリー	400	764.00	305,600	
テラスカイ	700	1,526.00	1,068,200	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	900	1,861.00	1,674,900	
P C I ホールディングス	400	941.00	376,400	
アイビーシー	200	426.00	85,200	
ネオジャパン	700	1,083.00	758,100	
P R T I M E S	400	1,930.00	772,000	
ラクス	7,000	2,202.50	15,417,500	
ランドコンピュータ	600	850.00	510,000	
ダブルスタンダード	600	1,818.00	1,090,800	
オーブンドア	1,200	710.00	852,000	
マイネット	900	354.00	318,600	
アカツキ	700	2,419.00	1,693,300	
ベネフィットジャパン	200	1,264.00	252,800	
U b i c o mホールディングス	500	1,280.00	640,000	
カナミックネットワーク	2,200	507.00	1,115,400	
ノムラシステムコーポレーション	2,400	117.00	280,800	
レンゴー	13,400	1,088.00	14,579,200	
トーモク	800	2,427.00	1,941,600	
ザ・パック	1,100	3,560.00	3,916,000	
チェンジホールディングス	3,300	1,408.00	4,646,400	
シンクロ・フード	800	665.00	532,000	
オークネット	600	2,216.00	1,329,600	
キャピタル・アセット・プランニング	100	749.00	74,900	
セグエグループ	900	675.00	607,500	
エイトレッド	200	1,432.00	286,400	
マクロミル	2,900	711.00	2,061,900	
ビーグリー	100	1,120.00	112,000	
オロ	600	2,701.00	1,620,600	
ユーザーローカル	600	2,513.00	1,507,800	
テモナ	500	231.00	115,500	
ニーズウェル	600	1,127.00	676,200	
マネーフォワード	3,300	6,678.00	22,037,400	
サインポスト	600	596.00	357,600	

レゾナック・ホールディングス	14,300	3,625.00	51,837,500	
住友化学	109,900	304.00	33,409,600	
住友精化	700	5,050.00	3,535,000	
日産化学	7,000	6,069.00	42,483,000	
ラサ工業	700	2,605.00	1,823,500	
クレハ	3,200	2,628.00	8,409,600	
多木化学	600	3,555.00	2,133,000	
テイカ	1,100	1,581.00	1,739,100	
石原産業	2,400	1,518.00	3,643,200	
片倉コープアグリ	300	1,038.00	311,400	
日本曹達	1,700	6,050.00	10,285,000	
東ソー	19,800	2,024.50	40,085,100	
トクヤマ	4,800	2,489.00	11,947,200	
セントラル硝子	1,500	2,833.00	4,249,500	
東亜合成	7,400	1,472.50	10,896,500	
大阪ソーダ	1,000	11,070.00	11,070,000	
関東電化工業	2,800	1,004.00	2,811,200	
Sun Asterisk	900	955.00	859,500	
デンカ	5,400	2,411.00	13,019,400	
イビデン	7,800	7,252.00	56,565,600	
信越化学工業	133,400	6,588.00	878,839,200	
日本カーバイド工業	500	1,899.00	949,500	
プラスアルファ・コンサルティング	800	2,491.00	1,992,800	
電算システムホールディングス	600	2,637.00	1,582,200	
堺化学工業	1,200	1,969.00	2,362,800	
第一稀元素化学工業	1,500	931.00	1,396,500	
エア・ウォーター	14,000	2,312.00	32,368,000	
日本酸素ホールディングス	14,400	4,821.00	69,422,400	
日本化学工業	600	2,377.00	1,426,200	
東邦アセチレン	1,500	396.00	594,000	
日本パーカライジング	6,500	1,240.00	8,060,000	
高圧ガス工業	2,500	856.00	2,140,000	
チタン工業	200	1,070.00	214,000	
四国化成ホールディングス	1,800	1,852.00	3,333,600	
戸田工業	400	1,711.00	684,400	
ステラ ケミファ	800	3,835.00	3,068,000	
保土谷化学工業	500	3,595.00	1,797,500	
日本触媒	2,100	5,610.00	11,781,000	
大日精化工業	1,000	2,730.00	2,730,000	
カネカ	3,700	3,631.00	13,434,700	
協和キリン	17,900	2,941.00	52,643,900	
Appier Group	5,000	1,813.00	9,065,000	
三菱瓦斯化学	11,000	2,540.00	27,940,000	
三井化学	12,200	4,184.00	51,044,800	
JSR	16,200	4,255.00	68,931,000	
東京応化工業	7,100	4,678.00	33,213,800	
大阪有機化学工業	1,300	3,290.00	4,277,000	
三菱ケミカルグループ	108,500	852.70	92,517,950	
KHネオケム	2,200	2,201.00	4,842,200	

ビジョナル	1,100	8,390.00	9,229,000	
ダイセル	19,000	1,493.00	28,367,000	
住友ベークライト	2,100	9,010.00	18,921,000	
積水化学工業	29,800	2,109.00	62,848,200	
日本ゼオン	10,100	1,253.00	12,655,300	
アイカ工業	3,700	3,634.00	13,445,800	
UBE	7,000	2,534.50	17,741,500	
積水樹脂	2,200	2,521.00	5,546,200	
タキロンシーアイ	3,600	638.00	2,296,800	
旭有機材	1,000	4,525.00	4,525,000	
ニチバン	700	1,888.00	1,321,600	
リケンテクノス	3,100	949.00	2,941,900	
大倉工業	800	3,140.00	2,512,000	
積水化成工業	2,600	470.00	1,222,000	
群栄化学工業	400	3,620.00	1,448,000	
タイガースポリマー	400	1,124.00	449,600	
ミライアル	400	1,622.00	648,800	
ダイキアクシス	700	700.00	490,000	
ダイキョーニシカワ	3,700	751.00	2,778,700	
竹本容器	700	776.00	543,200	
森六ホールディングス	700	2,700.00	1,890,000	
恵和	1,200	1,115.00	1,338,000	
日本化薬	11,300	1,269.50	14,345,350	
カーリットホールディングス	1,400	1,031.00	1,443,400	
ソルクシーズ	800	335.00	268,000	
CLホールディングス	600	1,028.00	616,800	
プレステージ・インターナショナル	7,000	641.00	4,487,000	
フェイス	200	457.00	91,400	
プロトコーポレーション	1,600	1,318.00	2,108,800	
ハイマックス	500	1,408.00	704,000	
アミューズ	900	1,494.00	1,344,600	
野村総合研究所	32,900	4,431.00	145,779,900	
ドリームインキュベータ	500	2,936.00	1,468,000	
クイック	1,100	2,401.00	2,641,100	
TAC	300	191.00	57,300	
CEホールディングス	400	529.00	211,600	
日本システム技術	400	4,005.00	1,602,000	
電通グループ	15,000	3,934.00	59,010,000	
インテージホールディングス	1,800	1,897.00	3,414,600	
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	1,054.00	527,000	
東邦システムサイエンス	400	1,310.00	524,000	
ぴあ	600	3,090.00	1,854,000	
イオンファンタジー	500	2,272.00	1,136,000	
ソースネクスト	6,100	136.00	829,600	
シーティーエス	1,800	740.00	1,332,000	
NEXYZ. Group	300	611.00	183,300	
インフォコム	1,900	2,230.00	4,237,000	
メディカルシステムネットワーク	1,400	630.00	882,000	
日本精化	1,000	2,675.00	2,675,000	

扶桑化学工業	1,500	5,170.00	7,755,000	
トリケミカル研究所	1,800	4,715.00	8,487,000	
シンプレクス・ホールディングス	2,300	2,760.00	6,348,000	
HEROZ	500	2,014.00	1,007,000	
ラクスル	3,500	1,116.00	3,906,000	
メルカリ	7,200	2,018.50	14,533,200	
I P S	400	2,390.00	956,000	
F I G	1,600	310.00	496,000	
システムサポート	600	1,936.00	1,161,600	
ADEKA	5,100	3,168.00	16,156,800	
日油	4,500	6,633.00	29,848,500	
ミヨシ油脂	200	1,290.00	258,000	
新日本理化	1,300	205.00	266,500	
ハリマ化成グループ	1,000	916.00	916,000	
イーソル	1,200	889.00	1,066,800	
東海ソフト	100	1,175.00	117,500	
ウイングアーク 1 s t	1,500	2,965.00	4,447,500	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	400	1,123.00	449,200	
サーバーワークス	300	4,155.00	1,246,500	
東名	100	2,386.00	238,600	
ヴィッツ	200	766.00	153,200	
トビラシステムズ	500	863.00	431,500	
S a n s a n	4,800	1,762.00	8,457,600	
L i n k - U グループ	100	680.00	68,000	
ギフトィ	1,400	1,334.00	1,867,600	
花王	33,600	5,746.00	193,065,600	
第一工業製薬	700	3,410.00	2,387,000	
石原ケミカル	700	1,867.00	1,306,900	
日華化学	200	914.00	182,800	
ニイタカ	200	1,901.00	380,200	
三洋化成工業	900	4,215.00	3,793,500	
メドレー	2,000	4,880.00	9,760,000	
ベース	600	3,380.00	2,028,000	
J M D C	2,600	3,627.00	9,430,200	
武田薬品工業	131,800	4,343.00	572,407,400	
アステラス製薬	130,400	1,636.00	213,334,400	
住友ファーマ	11,500	358.00	4,117,000	
塩野義製薬	18,700	7,815.00	146,140,500	
わかもと製薬	800	200.00	160,000	
日本新薬	3,900	4,512.00	17,596,800	
中外製薬	46,600	6,317.00	294,372,200	
科研製薬	2,500	3,554.00	8,885,000	
エーザイ	18,100	6,094.00	110,301,400	
理研ビタミン	1,300	2,491.00	3,238,300	
ロート製薬	14,400	2,993.50	43,106,400	
小野薬品工業	31,500	2,409.50	75,899,250	
久光製薬	3,300	3,780.00	12,474,000	
有機合成薬品工業	1,300	328.00	426,400	
持田製薬	1,700	3,225.00	5,482,500	

参天製薬	27,000	1,473.00	39,771,000	
扶桑薬品工業	500	2,242.00	1,121,000	
日本ケミファ	100	1,623.00	162,300	
ツムラ	4,600	2,765.50	12,721,300	
テルモ	41,500	5,957.00	247,215,500	
H. U. グループホールディングス	4,400	2,594.00	11,413,600	
キッセイ薬品工業	2,400	3,400.00	8,160,000	
生化学工業	2,500	754.00	1,885,000	
栄研化学	2,700	1,892.00	5,108,400	
鳥居薬品	800	4,180.00	3,344,000	
JCRファーマ	5,300	891.00	4,722,300	
東和薬品	2,400	2,814.00	6,753,600	
富士製薬工業	1,200	1,681.00	2,017,200	
ゼリア新薬工業	2,000	2,119.00	4,238,000	
そーせいグループ	4,800	1,515.00	7,272,000	
第一三共	129,700	4,945.00	641,366,500	
杏林製薬	3,200	1,763.00	5,641,600	
大幸薬品	3,200	308.00	985,600	
ダイト	1,300	2,094.00	2,722,200	
大塚ホールディングス	30,900	6,079.00	187,841,100	
大正製薬ホールディングス	3,300	8,590.00	28,347,000	
ペプチドリーム	7,100	1,452.00	10,309,200	
大日本塗料	1,500	1,121.00	1,681,500	
日本ペイントホールディングス	78,800	1,123.00	88,492,400	
関西ペイント	14,500	2,160.50	31,327,250	
神東塗料	2,000	129.00	258,000	
中国塗料	3,000	2,127.00	6,381,000	
日本特殊塗料	600	1,398.00	838,800	
藤倉化成	1,500	466.00	699,000	
太陽ホールディングス	2,600	3,320.00	8,632,000	
DIC	5,800	2,869.50	16,643,100	
サカタインクス	3,200	1,405.00	4,496,000	
artience	3,300	2,767.00	9,131,100	
T&K TOKA	1,600	1,411.00	2,257,600	
アルプス技研	1,500	2,835.00	4,252,500	
サニックス	2,300	294.00	676,200	
日本空調サービス	1,500	885.00	1,327,500	
オリエンタルランド	80,800	5,276.00	426,300,800	
フォーカスシステムズ	1,300	1,162.00	1,510,600	
ダスキン	3,400	3,309.00	11,250,600	
パーク24	9,400	1,727.50	16,238,500	
明光ネットワークジャパン	1,700	695.00	1,181,500	
ファルコホールディングス	700	2,317.00	1,621,900	
クレスコ	1,300	2,036.00	2,646,800	
フジ・メディア・ホールディングス	14,200	1,772.00	25,162,400	
秀英予備校	100	305.00	30,500	
田谷	100	418.00	41,800	
ラウンドワン	14,200	700.00	9,940,000	
リゾートトラスト	6,600	2,473.50	16,325,100	

オービック	5,000	23,110.00	115,550,000	
ジャストシステム	2,200	2,553.00	5,616,600	
TDCソフト	1,400	2,109.00	2,952,600	
LINEヤフー	211,500	390.30	82,548,450	
ビー・エム・エル	1,800	2,790.00	5,022,000	
トレンドマイクロ	7,000	7,552.00	52,864,000	
IDホールディングス	1,000	1,605.00	1,605,000	
リソー教育	7,800	219.00	1,708,200	
日本オラクル	2,800	11,695.00	32,746,000	
早稲田アカデミー	900	1,592.00	1,432,800	
アルファシステムズ	400	3,315.00	1,326,000	
フューチャー	3,100	1,647.00	5,105,700	
CAC Holdings	700	1,812.00	1,268,400	
SBテクノロジー	700	2,109.00	1,476,300	
トーセ	200	699.00	139,800	
ユー・エス・エス	17,100	2,595.00	44,374,500	
オービックビジネスコンサルタント	2,100	7,192.00	15,103,200	
アイティフォー	2,100	1,383.00	2,904,300	
東京個別指導学院	1,700	432.00	734,400	
東計電算	400	3,295.00	1,318,000	
サイバーエージェント	33,600	1,043.00	35,044,800	
楽天グループ	130,500	822.20	107,297,100	
エクスネット	100	1,131.00	113,100	
クリーク・アンド・リバー社	700	1,831.00	1,281,700	
SBIグローバルアセットマネジメント	2,800	770.00	2,156,000	
テー・オー・ダブリュー	3,300	378.00	1,247,400	
大塚商会	7,400	6,607.00	48,891,800	
サイボウズ	2,000	1,781.00	3,562,000	
山田コンサルティンググループ	800	1,763.00	1,410,400	
セントラルスポーツ	500	2,445.00	1,222,500	
バラカ	600	1,920.00	1,152,000	
電通総研	1,800	5,350.00	9,630,000	
ACCESS	1,900	1,348.00	2,561,200	
デジタルガレージ	2,300	3,335.00	7,670,500	
EMシステムズ	2,300	732.00	1,683,600	
ウェザーニューズ	500	5,030.00	2,515,000	
C I J	2,600	758.00	1,970,800	
ビジネスエンジニアリング	200	3,955.00	791,000	
日本エンタープライズ	500	126.00	63,000	
WOWOW	900	1,107.00	996,300	
スカラ	1,700	721.00	1,225,700	
インテリジェント ウェイブ	600	1,239.00	743,400	
フルキャストホールディングス	1,400	1,411.00	1,975,400	
エン・ジャパン	2,600	2,537.00	6,596,200	
セルソース	400	1,379.00	551,600	
あすか製薬ホールディングス	1,500	2,002.00	3,003,000	
サワイグループホールディングス	3,400	6,259.00	21,280,600	
富士フイルムホールディングス	27,600	9,921.00	273,819,600	
コニカミノルタ	33,200	490.90	16,297,880	

資生堂	31,000	4,125.00	127,875,000	
ライオン	19,400	1,319.00	25,588,600	
高砂香料工業	1,100	3,345.00	3,679,500	
マンダム	3,300	1,310.00	4,323,000	
ミルボン	2,000	3,128.00	6,256,000	
ファンケル	6,500	1,990.50	12,938,250	
コーセー	3,000	7,904.00	23,712,000	
コタ	1,300	1,614.00	2,098,200	
シーボン	100	1,491.00	149,100	
ポーラ・オルビスホールディングス	7,600	1,441.00	10,951,600	
ノエビアホールディングス	1,300	5,120.00	6,656,000	
アジュバンホールディングス	300	959.00	287,700	
新日本製薬	900	1,632.00	1,468,800	
I-n-e	300	1,815.00	544,500	
アクシージア	700	839.00	587,300	
エステー	1,300	1,550.00	2,015,000	
アグロ カネショウ	700	1,214.00	849,800	
コニシ	4,400	1,508.00	6,635,200	
長谷川香料	2,800	3,025.00	8,470,000	
小林製薬	4,300	5,866.00	25,223,800	
荒川化学工業	1,200	1,127.00	1,352,400	
メック	1,200	4,510.00	5,412,000	
日本高純度化学	400	2,886.00	1,154,400	
タカラバイオ	3,900	989.00	3,857,100	
JCU	1,600	4,150.00	6,640,000	
新田ゼラチン	700	716.00	501,200	
OATアグリオ	300	1,715.00	514,500	
デクセリアルズ	3,700	6,127.00	22,669,900	
アース製薬	1,300	4,135.00	5,375,500	
北興化学工業	1,400	1,270.00	1,778,000	
大成ラミック	500	2,983.00	1,491,500	
クミアイ化学工業	6,200	824.00	5,108,800	
日本農薬	2,600	710.00	1,846,000	
富士興産	200	2,066.00	413,200	
ニチレキ	2,000	2,438.00	4,876,000	
ユシロ化学工業	700	2,211.00	1,547,700	
ビーピー・カストロール	300	937.00	281,100	
富士石油	3,300	340.00	1,122,000	
MORESCO	400	1,375.00	550,000	
出光興産	82,400	972.20	80,109,280	
ENEOSホールディングス	235,200	654.50	153,938,400	
コスモエネルギーホールディングス	4,400	6,787.00	29,862,800	
ANYCOLOR	1,600	3,095.00	4,952,000	
テスホールディングス	3,600	459.00	1,652,400	
インフロニア・ホールディングス	16,700	1,550.00	25,885,000	
横浜ゴム	7,500	3,899.00	29,242,500	
TOYO TIRE	8,500	2,691.00	22,873,500	
ブリヂストン	43,600	6,335.00	276,206,000	
住友ゴム工業	14,500	1,749.50	25,367,750	

藤倉コンポジット	1,100	1,399.00	1,538,900	
オカモト	700	4,800.00	3,360,000	
アキレス	1,000	1,593.00	1,593,000	
フコク	900	1,655.00	1,489,500	
ニッタ	1,500	3,710.00	5,565,000	
クリエートメディック	600	958.00	574,800	
住友理工	2,300	1,263.00	2,904,900	
三ツ星ベルト	1,800	4,800.00	8,640,000	
バンドー化学	2,100	1,752.00	3,679,200	
AGC	13,200	5,286.00	69,775,200	
日本板硝子	6,900	511.00	3,525,900	
石塚硝子	200	2,838.00	567,600	
有沢製作所	2,700	1,157.00	3,123,900	
日本山村硝子	300	1,502.00	450,600	
日本電気硝子	6,000	3,819.00	22,914,000	
オハラ	800	1,259.00	1,007,200	
住友大阪セメント	2,400	3,655.00	8,772,000	
太平洋セメント	8,800	3,209.00	28,239,200	
リソルホールディングス	100	5,720.00	572,000	
日本ヒューム	1,400	892.00	1,248,800	
日本コンクリート工業	2,900	410.00	1,189,000	
三谷セキサン	600	5,560.00	3,336,000	
アジアパイルホールディングス	2,000	775.00	1,550,000	
東海カーボン	13,600	968.00	13,164,800	
日本カーボン	800	5,300.00	4,240,000	
東洋炭素	1,100	7,770.00	8,547,000	
ノリタケカンパニーリミテド	800	8,420.00	6,736,000	
TOTO	9,800	4,180.00	40,964,000	
日本碍子	17,200	1,946.00	33,471,200	
日本特殊陶業	12,400	4,634.00	57,461,600	
ダントーホールディングス	600	981.00	588,600	
MARUWA	500	33,850.00	16,925,000	
品川リフラクトリーズ	1,800	1,927.00	3,468,600	
黒崎播磨	300	14,180.00	4,254,000	
ヨータイ	800	1,461.00	1,168,800	
東京窯業	900	470.00	423,000	
ニッカトー	800	585.00	468,000	
フジミインコーポレーテッド	4,000	3,895.00	15,580,000	
クミネ工業	200	1,027.00	205,400	
エーアンドエーマテリアル	300	1,320.00	396,000	
ニチアス	3,700	3,965.00	14,670,500	
日本製鉄	68,500	3,775.00	258,587,500	
神戸製鋼所	30,700	2,031.00	62,351,700	
中山製鋼所	3,100	938.00	2,907,800	
合同製鐵	800	5,910.00	4,728,000	
JFEホールディングス	42,500	2,518.50	107,036,250	
東京製鐵	4,200	1,682.00	7,064,400	
共英製鋼	1,700	2,406.00	4,090,200	
大和工業	2,900	8,368.00	24,267,200	

東京鐵鋼	700	5,590.00	3,913,000	
大阪製鐵	800	2,191.00	1,752,800	
淀川製鋼所	1,700	4,545.00	7,726,500	
中部鋼板	1,000	2,502.00	2,502,000	
丸一鋼管	4,600	3,922.00	18,041,200	
モリ工業	300	5,610.00	1,683,000	
大同特殊鋼	9,600	1,829.00	17,558,400	
日本高周波鋼業	100	620.00	62,000	
日本冶金工業	1,100	4,820.00	5,302,000	
山陽特殊製鋼	1,500	2,236.00	3,354,000	
愛知製鋼	900	3,765.00	3,388,500	
日本金属	100	855.00	85,500	
ミガロホールディングス	200	1,760.00	352,000	
大平洋金属	1,300	1,382.00	1,796,600	
新日本電工	8,000	301.00	2,408,000	
栗本鐵工所	700	3,540.00	2,478,000	
虹技	100	1,503.00	150,300	
日本鑄鉄管	300	1,140.00	342,000	
日本製鋼所	4,100	2,902.00	11,898,200	
三菱製鋼	1,000	1,459.00	1,459,000	
日亜鋼業	1,100	341.00	375,100	
日本精線	200	6,390.00	1,278,000	
エンビプロ・ホールディングス	800	527.00	421,600	
大紀アルミニウム工業所	1,800	1,202.00	2,163,600	
日本軽金属ホールディングス	4,500	1,754.00	7,893,000	
三井金属鉱業	4,400	4,375.00	19,250,000	
東邦亜鉛	1,100	1,010.00	1,111,000	
三菱マテリアル	10,900	2,633.00	28,699,700	
住友金属鉱山	17,700	3,973.00	70,322,100	
DOWAホールディングス	3,800	5,187.00	19,710,600	
古河機械金属	2,000	1,768.00	3,536,000	
エス・サイエンス	5,700	26.00	148,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,600	2,620.00	6,812,000	
東邦チタニウム	3,100	1,626.00	5,040,600	
UACJ	2,100	4,075.00	8,557,500	
CKサンエツ	400	3,815.00	1,526,000	
古河電気工業	5,100	2,948.50	15,037,350	
住友電気工業	57,200	2,224.00	127,212,800	
フジクラ	18,000	1,967.50	35,415,000	
SWCC	1,800	3,510.00	6,318,000	
タツタ電線	2,700	700.00	1,890,000	
カナレ電気	100	1,786.00	178,600	
平河ビューテック	1,100	1,353.00	1,488,300	
いよぎんホールディングス	17,300	1,135.50	19,644,150	
しずおかフィナンシャルグループ	32,400	1,479.00	47,919,600	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	12,200	1,169.00	14,261,800	
楽天銀行	5,000	2,975.00	14,875,000	
京都フィナンシャルグループ	18,500	2,742.50	50,736,250	
リョービ	1,600	2,725.00	4,360,000	

アーレスティ	1,100	797.00	876,700	
AREホールディングス	5,700	1,901.00	10,835,700	
東洋製罐グループホールディングス	9,100	2,450.00	22,295,000	
ホッカンホールディングス	900	1,956.00	1,760,400	
コロナ	1,100	964.00	1,060,400	
横河ブリッジホールディングス	2,400	2,870.00	6,888,000	
駒井ハルテック	300	2,020.00	606,000	
高田機工	100	3,505.00	350,500	
三和ホールディングス	15,300	2,504.50	38,318,850	
文化シヤッター	4,100	1,569.00	6,432,900	
三協立山	1,900	863.00	1,639,700	
アルインコ	1,400	1,060.00	1,484,000	
東洋シヤッター	600	714.00	428,400	
LIXIL	23,800	1,880.50	44,755,900	
日本ファイルコン	300	538.00	161,400	
ノーリツ	2,500	1,690.00	4,225,000	
長府製作所	1,600	2,110.00	3,376,000	
リンナイ	7,500	3,457.00	25,927,500	
ユニプレス	2,800	1,110.00	3,108,000	
ダイニチ工業	700	712.00	498,400	
日東精工	2,500	605.00	1,512,500	
三洋工業	100	3,435.00	343,500	
岡部	2,900	731.00	2,119,900	
ジーテクト	1,900	2,061.00	3,915,900	
東プレ	2,600	2,455.00	6,383,000	
高周波熱錬	2,300	1,052.00	2,419,600	
東京製綱	900	1,478.00	1,330,200	
サンコール	1,300	488.00	634,400	
モリテック スチール	900	253.00	227,700	
パイオラックス	2,000	2,744.00	5,488,000	
エイチワン	1,900	681.00	1,293,900	
日本発條	13,400	1,447.00	19,389,800	
中央発條	1,000	844.00	844,000	
アドバネクス	200	1,025.00	205,000	
三浦工業	6,200	2,923.00	18,122,600	
タクマ	5,000	1,879.00	9,395,000	
テクノプロ・ホールディングス	8,900	2,971.00	26,441,900	
アトラグループ	700	177.00	123,900	
アイ・アールジャパンホールディングス	900	1,333.00	1,199,700	
Keepers 技研	900	5,250.00	4,725,000	
ファーストロジック	100	484.00	48,400	
三機サービス	300	1,397.00	419,100	
Gunosy	1,100	673.00	740,300	
デザインワン・ジャパン	600	131.00	78,600	
イー・ガーディアン	600	1,372.00	823,200	
リブセンス	500	229.00	114,500	
ジャパンマテリアル	4,600	2,579.00	11,863,400	
ベクトル	1,800	1,164.00	2,095,200	
ウチヤマホールディングス	200	387.00	77,400	

チャーム・ケア・コーポレーション	1,500	1,378.00	2,067,000	
キャリアリンク	500	2,690.00	1,345,000	
I B J	1,000	575.00	575,000	
アサンテ	900	1,668.00	1,501,200	
バリューHR	1,300	1,280.00	1,664,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,200	2,603.00	3,123,600	
ライドオンエクスプレスホールディングス	800	1,094.00	875,200	
E R I ホールディングス	200	1,852.00	370,400	
アビスト	200	3,215.00	643,000	
シグマクシス・ホールディングス	2,000	1,757.00	3,514,000	
ウィルグループ	1,500	1,118.00	1,677,000	
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	1,800	138.00	248,400	
メドピア	1,500	723.00	1,084,500	
レアジョブ	200	857.00	171,400	
リクルートホールディングス	113,000	6,299.00	711,787,000	
エラン	1,900	986.00	1,873,400	
ツガミ	3,200	1,174.00	3,756,800	
オークマ	1,300	7,086.00	9,211,800	
芝浦機械	1,500	3,550.00	5,325,000	
アマダ	23,800	1,696.50	40,376,700	
アイダエンジニアリング	3,400	847.00	2,879,800	
F U J I	7,000	2,711.00	18,977,000	
牧野フライス製作所	1,600	6,000.00	9,600,000	
オーエスジー	6,500	2,072.50	13,471,250	
ダイジェット工業	100	853.00	85,300	
旭ダイヤモンド工業	3,500	910.00	3,185,000	
DMG森精機	9,000	3,657.00	32,913,000	
ソディック	3,900	714.00	2,784,600	
ディスコ	7,200	53,450.00	384,840,000	
日東工器	800	1,985.00	1,588,000	
日進工具	1,300	991.00	1,288,300	
パンチ工業	1,000	443.00	443,000	
富士ダイス	600	698.00	418,800	
土木管理総合試験所	1,200	331.00	397,200	
日本郵政	179,000	1,454.00	260,266,000	
ベルシステム24ホールディングス	1,600	1,610.00	2,576,000	
鎌倉新書	1,100	607.00	667,700	
SMN	400	365.00	146,000	
一蔵	400	608.00	243,200	
グローバルキッズCOMPANY	400	671.00	268,400	
エアトリ	1,100	1,345.00	1,479,500	
アトラエ	900	433.00	389,700	
ストライク	700	5,300.00	3,710,000	
ソラスト	4,500	501.00	2,254,500	
セラク	600	1,112.00	667,200	
インソース	3,200	916.00	2,931,200	
豊田自動織機	12,700	15,535.00	197,294,500	
豊和工業	600	782.00	469,200	
石川製作所	300	1,217.00	365,100	

リケンNPR	1,700	2,977.00	5,060,900	
東洋機械金属	900	744.00	669,600	
津田駒工業	100	383.00	38,300	
エンシュウ	400	686.00	274,400	
島精機製作所	2,300	1,366.00	3,141,800	
オプトラン	2,400	2,057.00	4,936,800	
NCホールディングス	300	1,621.00	486,300	
イワキポンプ	1,000	2,650.00	2,650,000	
フリー	1,400	1,180.00	1,652,000	
ヤマシンフィルタ	3,800	398.00	1,512,400	
日阪製作所	1,700	1,025.00	1,742,500	
やまびこ	2,400	1,904.00	4,569,600	
野村マイクロ・サイエンス	500	21,170.00	10,585,000	
平田機工	700	8,290.00	5,803,000	
PEGASUS	2,100	489.00	1,026,900	
マルマエ	800	2,332.00	1,865,600	
タツモ	900	4,110.00	3,699,000	
ナブテスコ	9,400	2,466.50	23,185,100	
三井海洋開発	2,000	3,200.00	6,400,000	
レオン自動機	1,800	1,411.00	2,539,800	
SMC	4,500	91,220.00	410,490,000	
ホソカワミクロン	1,000	4,740.00	4,740,000	
ユニオンツール	700	4,050.00	2,835,000	
瑞光	1,200	1,602.00	1,922,400	
オイレス工業	2,000	2,119.00	4,238,000	
日精エー・エス・ビー機械	600	4,640.00	2,784,000	
サトーホールディングス	2,100	2,267.00	4,760,700	
技研製作所	1,400	2,011.00	2,815,400	
日本エアータック	900	1,162.00	1,045,800	
カワタ	300	1,055.00	316,500	
日精樹脂工業	1,000	1,149.00	1,149,000	
オカダアイヨン	400	2,983.00	1,193,200	
ワイエイシイホールディングス	400	2,424.00	969,600	
小松製作所	70,200	4,531.00	318,076,200	
住友重機械工業	8,800	4,548.00	40,022,400	
日立建機	5,900	4,523.00	26,685,700	
日工	2,300	783.00	1,800,900	
巴工業	600	3,915.00	2,349,000	
井関農機	1,500	982.00	1,473,000	
TOWA	1,700	10,400.00	17,680,000	
丸山製作所	200	2,275.00	455,000	
北川鉄工所	600	1,549.00	929,400	
シンニッタン	1,000	287.00	287,000	
ローツェ	800	22,500.00	18,000,000	
タカキタ	200	489.00	97,800	
クボタ	78,500	2,230.00	175,055,000	
荏原実業	800	3,365.00	2,692,000	
東洋エンジニアリング	2,100	920.00	1,932,000	
三菱化工機	600	4,105.00	2,463,000	

月島ホールディングス	1,900	1,483.00	2,817,700	
帝国電機製作所	1,000	2,686.00	2,686,000	
東京機械製作所	300	441.00	132,300	
新東工業	3,100	1,166.00	3,614,600	
澁谷工業	1,400	3,100.00	4,340,000	
アイチ コーポレーション	2,000	1,106.00	2,212,000	
小森コーポレーション	3,900	1,278.00	4,984,200	
鶴見製作所	1,100	3,650.00	4,015,000	
日本ギア工業	200	623.00	124,600	
酒井重工業	200	6,530.00	1,306,000	
荏原製作所	6,200	13,220.00	81,964,000	
石井鐵工所	100	2,749.00	274,900	
西島製作所	1,200	2,770.00	3,324,000	
北越工業	1,600	2,234.00	3,574,400	
ダイキン工業	17,900	21,165.00	378,853,500	
オルガノ	1,800	8,040.00	14,472,000	
トーヨーカネツ	500	4,465.00	2,232,500	
栗田工業	8,400	6,275.00	52,710,000	
椿本チエイン	2,100	4,950.00	10,395,000	
大同工業	400	758.00	303,200	
日機装	3,600	1,238.00	4,456,800	
木村化工機	1,200	707.00	848,400	
レイズネクスト	2,000	2,272.00	4,544,000	
アネスト岩田	2,300	1,343.00	3,088,900	
ダイフク	25,200	3,456.00	87,091,200	
サムコ	400	5,640.00	2,256,000	
加藤製作所	600	1,456.00	873,600	
油研工業	200	2,377.00	475,400	
タダノ	8,500	1,266.50	10,765,250	
フジテック	3,500	3,782.00	13,237,000	
CKD	4,100	3,500.00	14,350,000	
平和	4,400	2,026.00	8,914,400	
理想科学工業	1,200	3,260.00	3,912,000	
SANKYO	17,000	1,677.50	28,517,500	
日本金銭機械	1,800	1,321.00	2,377,800	
マースグループホールディングス	700	3,225.00	2,257,500	
フクシマガリレイ	1,000	5,580.00	5,580,000	
オーイズミ	900	398.00	358,200	
ダイコク電機	700	3,960.00	2,772,000	
竹内製作所	2,700	5,650.00	15,255,000	
アマノ	4,200	3,638.00	15,279,600	
JUKI	2,900	525.00	1,522,500	
サンデン	1,900	162.00	307,800	
ジャノメ	1,700	677.00	1,150,900	
ブラザー工業	20,000	2,594.50	51,890,000	
マックス	2,100	3,110.00	6,531,000	
モリタホールディングス	2,700	1,613.00	4,355,100	
グローリー	3,600	2,906.50	10,463,400	
新晃工業	1,500	3,240.00	4,860,000	

大和冷機工業	2,200	1,428.00	3,141,600	
セガサミーホールディングス	13,300	1,801.50	23,959,950	
T P R	1,900	2,176.00	4,134,400	
ツバキ・ナカシマ	3,200	740.00	2,368,000	
ホシザキ	8,800	5,064.00	44,563,200	
大豊工業	1,300	895.00	1,163,500	
日本精工	27,600	821.80	22,681,680	
NTN	32,100	317.60	10,194,960	
ジェイテクト	13,200	1,422.50	18,777,000	
不二越	1,100	3,405.00	3,745,500	
ミネベアミツミ	26,000	3,172.00	82,472,000	
日本トムソン	3,900	650.00	2,535,000	
THK	8,600	3,441.00	29,592,600	
ユーシン精機	1,600	675.00	1,080,000	
前澤給装工業	1,100	1,296.00	1,425,600	
イーグル工業	1,600	1,772.00	2,835,200	
前澤工業	400	1,084.00	433,600	
日本ピラー工業	1,400	5,890.00	8,246,000	
キッツ	4,900	1,290.00	6,321,000	
日立製作所	72,100	13,310.00	959,651,000	
三菱電機	166,900	2,432.50	405,984,250	
富士電機	9,100	9,239.00	84,074,900	
東洋電機製造	300	1,072.00	321,600	
安川電機	16,200	6,585.00	106,677,000	
シンフォニアテクノロジー	1,600	2,789.00	4,462,400	
明電舎	2,700	2,753.00	7,433,100	
オリジン	300	1,234.00	370,200	
山洋電気	600	6,850.00	4,110,000	
デンヨー	1,100	2,380.00	2,618,000	
PHCホールディングス	3,000	1,217.00	3,651,000	
KOKUSAI ELECTRIC	5,800	4,650.00	26,970,000	
ソシオネクスト	10,800	4,000.00	43,200,000	
ベイカレント・コンサルティング	11,200	3,156.00	35,347,200	
Orchestra Holdings	400	1,021.00	408,400	
アイモバイル	2,400	461.00	1,106,400	
キャリアインデックス	600	178.00	106,800	
MS-Japan	500	1,180.00	590,000	
船場	100	1,266.00	126,600	
ジャパンエレベーターサービスホールディング	4,900	2,340.00	11,466,000	
フルテック	100	1,100.00	110,000	
グリーンズ	400	2,066.00	826,400	
ツナググループ・ホールディングス	400	714.00	285,600	
GameWith	700	304.00	212,800	
MS&Consulting	100	590.00	59,000	
ウェルビー	600	1,085.00	651,000	
エル・ティー・エス	200	2,661.00	532,200	
ミダックホールディングス	900	1,474.00	1,326,600	
キュービーネットホールディングス	900	1,223.00	1,100,700	
RPAホールディングス	2,200	283.00	622,600	

三櫻工業	2,400	1,095.00	2,628,000	
マキタ	17,100	3,914.00	66,929,400	
東芝テック	2,000	3,080.00	6,160,000	
芝浦メカトロニクス	800	6,710.00	5,368,000	
マブチモーター	7,300	2,656.50	19,392,450	
ニデック	33,100	5,664.00	187,478,400	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	600	354.00	212,400	
トレックス・セミコンダクター	800	1,812.00	1,449,600	
東光高岳	1,000	2,457.00	2,457,000	
ダブル・スコープ	4,600	718.00	3,302,800	
宮越ホールディングス	800	1,266.00	1,012,800	
ダイヘン	1,500	8,490.00	12,735,000	
ヤーマン	2,800	990.00	2,772,000	
JVCケンウッド	11,700	843.00	9,863,100	
ミマキエンジニアリング	1,500	1,081.00	1,621,500	
IPEX	1,000	1,824.00	1,824,000	
大崎電気工業	3,700	652.00	2,412,400	
オムロン	11,400	5,583.00	63,646,200	
日東工業	2,000	4,455.00	8,910,000	
IDEC	2,300	2,794.00	6,426,200	
正興電機製作所	300	1,223.00	366,900	
不二電機工業	200	1,130.00	226,000	
ジーエス・ユアサコーポレーション	5,800	2,834.00	16,437,200	
サクサホールディングス	300	3,245.00	973,500	
メルコホールディングス	400	3,185.00	1,274,000	
テクノメディカ	500	1,781.00	890,500	
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	600	655.00	393,000	
日本電気	19,700	10,260.00	202,122,000	
富士通	13,800	24,530.00	338,514,000	
沖電気工業	6,700	1,084.00	7,262,800	
岩崎通信機	600	641.00	384,600	
電気興業	700	2,070.00	1,449,000	
サンケン電気	1,400	8,226.00	11,516,400	
ナカヨ	300	1,165.00	349,500	
アイホン	800	2,901.00	2,320,800	
ルネサスエレクトロニクス	97,700	2,753.50	269,016,950	
セイコーエプソン	19,200	2,445.00	46,944,000	
ワコム	11,200	640.00	7,168,000	
アルバック	3,500	9,742.00	34,097,000	
アクセル	600	2,074.00	1,244,400	
EIZO	1,100	5,170.00	5,687,000	
ジャパンディスプレイ	62,800	21.00	1,318,800	
日本信号	3,300	1,002.00	3,306,600	
京三製作所	3,500	476.00	1,666,000	
能美防災	2,000	2,241.00	4,482,000	
ホーチキ	1,200	2,213.00	2,655,600	
星和電機	400	523.00	209,200	
エレコム	3,500	1,542.00	5,397,000	
パナソニックホールディングス	176,800	1,452.00	256,713,600	

シャープ	25,100	817.00	20,506,700	
アンリツ	10,500	1,293.00	13,576,500	
富士通ゼネラル	4,200	1,976.50	8,301,300	
ソニーグループ	105,000	12,950.00	1,359,750,000	
TDK	23,700	8,198.00	194,292,600	
帝国通信工業	700	1,899.00	1,329,300	
タムラ製作所	5,800	544.00	3,155,200	
アルプスアルパイン	13,300	1,111.50	14,782,950	
池上通信機	600	799.00	479,400	
日本電波工業	1,700	1,420.00	2,414,000	
鈴木	1,000	1,170.00	1,170,000	
メイコー	1,500	5,040.00	7,560,000	
日本トリム	400	3,640.00	1,456,000	
ローランド ディー. ジー.	900	5,010.00	4,509,000	
フォスター電機	1,000	1,184.00	1,184,000	
SMK	400	2,482.00	992,800	
ヨコオ	1,300	1,590.00	2,067,000	
ティアック	3,000	99.00	297,000	
ホシデン	3,500	1,965.00	6,877,500	
ヒロセ電機	2,200	15,500.00	34,100,000	
日本航空電子工業	3,500	2,711.00	9,488,500	
TOA	1,800	1,120.00	2,016,000	
マクセル	3,300	1,560.00	5,148,000	
古野電気	1,900	2,225.00	4,227,500	
スミダコーポレーション	1,900	1,167.00	2,217,300	
アイコム	600	3,335.00	2,001,000	
リオン	600	2,951.00	1,770,600	
横河電機	16,300	3,342.00	54,474,600	
新電元工業	500	3,120.00	1,560,000	
アズビル	10,200	4,236.00	43,207,200	
東亜ディーケーケー	500	969.00	484,500	
日本光電工業	6,300	4,140.00	26,082,000	
チノー	600	2,431.00	1,458,600	
共和電業	700	420.00	294,000	
日本電子材料	1,000	3,305.00	3,305,000	
堀場製作所	2,800	15,375.00	43,050,000	
アドバンテスト	42,500	7,185.00	305,362,500	
小野測器	600	591.00	354,600	
エスベック	1,200	2,858.00	3,429,600	
キーエンス	14,900	74,880.00	1,115,712,000	
日置電機	700	6,740.00	4,718,000	
シスメックス	12,800	8,249.00	105,587,200	
日本マイクロニクス	2,600	8,280.00	21,528,000	
メガチップス	1,200	4,250.00	5,100,000	
OBARA GROUP	800	3,760.00	3,008,000	
IMAGICA GROUP	1,600	720.00	1,152,000	
澤藤電機	100	1,308.00	130,800	
デンソー	122,300	2,801.50	342,623,450	
原田工業	600	751.00	450,600	

コーセル	1,700	1,588.00	2,699,600	
イリソ電子工業	1,300	2,964.00	3,853,200	
オプテックスグループ	2,800	1,842.00	5,157,600	
千代田インテグレ	600	2,607.00	1,564,200	
レーザーテック	6,800	41,440.00	281,792,000	
スタンレー電気	9,500	2,613.00	24,823,500	
ウシオ電機	7,500	2,077.50	15,581,250	
岡谷電機産業	1,300	272.00	353,600	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,100	602.00	662,200	
エノモト	400	1,603.00	641,200	
日本セラミック	1,300	2,617.00	3,402,100	
遠藤照明	300	1,509.00	452,700	
古河電池	1,200	983.00	1,179,600	
双信電機	900	292.00	262,800	
山一電機	1,300	2,314.00	3,008,200	
図研	1,300	4,765.00	6,194,500	
日本電子	3,700	6,705.00	24,808,500	
カシオ計算機	10,600	1,177.50	12,481,500	
ファナック	72,300	4,534.00	327,808,200	
日本シイエムケイ	3,300	605.00	1,996,500	
エンプラス	400	8,610.00	3,444,000	
大真空	2,100	843.00	1,770,300	
ローム	27,400	2,534.00	69,431,600	
浜松ホトニクス	11,900	5,380.00	64,022,000	
三井ハイテック	1,300	8,541.00	11,103,300	
新光電気工業	5,200	5,685.00	29,562,000	
京セラ	92,100	2,189.00	201,606,900	
協栄産業	100	3,010.00	301,000	
太陽誘電	7,200	3,336.00	24,019,200	
村田製作所	135,100	3,005.00	405,975,500	
双葉電子工業	2,900	511.00	1,481,900	
日東電工	9,600	13,990.00	134,304,000	
北陸電気工業	300	1,430.00	429,000	
東海理化電機製作所	4,100	2,437.00	9,991,700	
ニチコン	3,800	1,241.00	4,715,800	
日本ケミコン	1,700	1,388.00	2,359,600	
KOA	2,300	1,506.00	3,463,800	
三井E&S	7,600	2,390.00	18,164,000	
日立造船	13,100	1,255.00	16,440,500	
三菱重工業	26,200	12,300.00	322,260,000	
川崎重工業	12,100	4,324.00	52,320,400	
IHI	11,100	3,513.00	38,994,300	
名村造船所	3,700	2,330.00	8,621,000	
サノヤスホールディングス	1,400	149.00	208,600	
スプリックス	300	813.00	243,900	
マネジメントソリューションズ	700	2,865.00	2,005,500	
プロレド・パートナーズ	600	385.00	231,000	
and factory	300	312.00	93,600	
テノ.ホールディングス	300	480.00	144,000	

フロンティア・マネジメント	300	1,809.00	542,700	
ピアラ	200	325.00	65,000	
コプロ・ホールディングス	400	1,802.00	720,800	
ギークス	400	465.00	186,000	
アンビスホールディングス	1,600	2,327.00	3,723,200	
カーブスホールディングス	4,000	726.00	2,904,000	
フォーラムエンジニアリング	1,800	1,000.00	1,800,000	
Fast Fitness Japan	500	944.00	472,000	
日本車輛製造	400	2,400.00	960,000	
三菱ロジスネクスト	2,500	1,806.00	4,515,000	
近畿車輛	100	2,468.00	246,800	
一家ホールディングス	400	713.00	285,200	
フルサト・マルカホールディングス	1,500	2,219.00	3,328,500	
ヤマエグループホールディングス	900	2,609.00	2,348,100	
ジャパングラフトホールディングス	600	164.00	98,400	
FPG	4,900	1,883.00	9,226,700	
島根銀行	700	536.00	375,200	
じもとホールディングス	500	675.00	337,500	
全国保証	3,800	5,361.00	20,371,800	
めぶきフィナンシャルグループ	72,200	469.70	33,912,340	
ジャパンインベストメントアドバイザー	2,600	860.00	2,236,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,800	4,610.00	8,298,000	
九州フィナンシャルグループ	28,100	1,140.00	32,034,000	
かんぽ生命保険	14,800	2,870.00	42,476,000	
ゆうちょ銀行	160,400	1,625.00	260,650,000	
あんしん保証	1,300	250.00	325,000	
富山第一銀行	4,500	947.00	4,261,500	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	78,200	759.80	59,416,360	
ジェイリース	600	1,313.00	787,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	8,200	1,902.00	15,596,400	
イントラスト	400	787.00	314,800	
日本モーゲージサービス	600	533.00	319,800	
Casa	300	823.00	246,900	
SBIアルヒ	1,300	933.00	1,212,900	
プレミアグループ	2,400	1,870.00	4,488,000	
日産自動車	200,200	578.50	115,815,700	
いすゞ自動車	43,100	2,094.00	90,251,400	
トヨタ自動車	815,300	3,729.00	3,040,253,700	
日野自動車	22,100	491.40	10,859,940	
三菱自動車工業	57,600	468.70	26,997,120	
エフテック	800	730.00	584,000	
レシップホールディングス	400	695.00	278,000	
GMB	100	1,122.00	112,200	
ファルテック	100	542.00	54,200	
武蔵精密工業	3,600	1,630.00	5,868,000	
日産車体	1,700	969.00	1,647,300	
新明和工業	4,400	1,202.00	5,288,800	
極東開発工業	2,500	2,435.00	6,087,500	
トピー工業	1,200	3,055.00	3,666,000	

ティラド	300	3,880.00	1,164,000	
曙ブレーキ工業	11,400	116.00	1,322,400	
タチエス	2,600	1,998.00	5,194,800	
NOK	5,700	2,055.00	11,713,500	
フタバ産業	4,300	1,061.00	4,562,300	
カヤバ	1,400	5,130.00	7,182,000	
市光工業	2,500	553.00	1,382,500	
大同メタル工業	3,200	566.00	1,811,200	
プレス工業	6,000	668.00	4,008,000	
ミクニ	1,300	472.00	613,600	
太平洋工業	3,500	1,477.00	5,169,500	
河西工業	1,100	234.00	257,400	
アイシン	11,400	5,859.00	66,792,600	
マツダ	49,000	1,755.50	86,019,500	
今仙電機製作所	1,000	642.00	642,000	
本田技研工業	362,100	1,798.50	651,236,850	
スズキ	27,200	6,594.00	179,356,800	
SUBARU	45,900	3,348.00	153,673,200	
安永	300	723.00	216,900	
ヤマハ発動機	64,000	1,362.00	87,168,000	
小糸製作所	15,300	1,915.00	29,299,500	
TBK	1,000	403.00	403,000	
エクセディ	2,500	2,997.00	7,492,500	
ミツバ	2,700	1,442.00	3,893,400	
豊田合成	4,300	3,085.00	13,265,500	
愛三工業	2,400	1,562.00	3,748,800	
盟和産業	100	1,021.00	102,100	
日本プラスト	600	562.00	337,200	
ヨロズ	1,400	991.00	1,387,400	
エフ・シー・シー	2,600	2,103.00	5,467,800	
新家工業	100	4,025.00	402,500	
シマノ	6,000	20,365.00	122,190,000	
テイ・エス テック	5,200	1,910.50	9,934,600	
三十三フィナンシャルグループ	1,300	1,987.00	2,583,100	
第四北越フィナンシャルグループ	2,300	4,340.00	9,982,000	
ひろぎんホールディングス	20,700	1,053.50	21,807,450	
マーキュリアホールディングス	400	999.00	399,600	
おきなわフィナンシャルグループ	1,200	2,570.00	3,084,000	
ダイレクトマーケティングミックス	2,100	284.00	596,400	
ポピンズ	200	1,370.00	274,000	
LITALICO	1,100	2,045.00	2,249,500	
コンフィデンス・インターワークス	100	1,652.00	165,200	
十六フィナンシャルグループ	1,900	4,425.00	8,407,500	
北國フィナンシャルホールディングス	1,500	4,695.00	7,042,500	
ネットプロテクションズホールディングス	5,500	190.00	1,045,000	
プロクレアホールディングス	1,700	1,890.00	3,213,000	
FPパートナー	300	7,310.00	2,193,000	
あいちフィナンシャルグループ	2,200	2,688.00	5,913,600	
ジャムコ	500	1,270.00	635,000	

小野建	1,700	1,801.00	3,061,700	
はるやまホールディングス	500	629.00	314,500	
南陽	200	2,754.00	550,800	
ノジマ	4,500	1,686.00	7,587,000	
佐島電機	800	2,547.00	2,037,600	
カップ・クリエイト	2,400	1,650.00	3,960,000	
エコートレーディング	100	1,207.00	120,700	
伯東	900	5,900.00	5,310,000	
コンドーテック	1,100	1,332.00	1,465,200	
中山福	1,000	358.00	358,000	
ライトオン	900	412.00	370,800	
ナガイレーベン	1,900	2,242.00	4,259,800	
三菱食品	1,400	5,430.00	7,602,000	
良品計画	17,100	2,383.00	40,749,300	
パリミキホールディングス	1,400	409.00	572,600	
松田産業	1,300	2,325.00	3,022,500	
第一興商	6,000	1,914.00	11,484,000	
メディバルホールディングス	16,200	2,241.00	36,304,200	
アドヴァングループ	1,600	1,214.00	1,942,400	
S P K	800	2,018.00	1,614,400	
萩原電気ホールディングス	700	4,660.00	3,262,000	
アルビス	600	2,622.00	1,573,200	
アズワン	2,400	5,002.00	12,004,800	
スズデン	500	2,214.00	1,107,000	
尾家産業	300	1,707.00	512,100	
シモジマ	1,200	1,300.00	1,560,000	
ドウシシャ	1,500	2,119.00	3,178,500	
小津産業	200	1,699.00	339,800	
コナカ	1,300	413.00	536,900	
高速	900	2,427.00	2,184,300	
ハウス オブ ローゼ	100	1,633.00	163,300	
G-7ホールディングス	1,700	1,322.00	2,247,400	
たけびし	700	1,971.00	1,379,700	
イオン北海道	4,500	881.00	3,964,500	
コジマ	2,900	735.00	2,131,500	
ヒマラヤ	300	917.00	275,100	
コーナン商事	2,000	3,970.00	7,940,000	
ネットワンシステムズ	6,000	2,646.00	15,876,000	
エコス	700	2,231.00	1,561,700	
ワタミ	1,600	992.00	1,587,200	
マルシェ	700	237.00	165,900	
リックス	300	3,985.00	1,195,500	
システムソフト	6,200	60.00	372,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホ	31,600	3,464.00	109,462,400	
丸文	1,400	1,496.00	2,094,400	
西松屋チェーン	3,200	2,216.00	7,091,200	
ゼンショーホールディングス	8,000	6,408.00	51,264,000	
ハピネット	1,300	3,130.00	4,069,000	
幸楽苑ホールディングス	1,300	1,384.00	1,799,200	

ハークスレイ	300	951.00	285,300	
橋本総業ホールディングス	800	1,416.00	1,132,800	
日本ライフライン	4,800	1,283.00	6,158,400	
サイゼリヤ	2,300	4,740.00	10,902,000	
タカショー	1,400	515.00	721,000	
V Tホールディングス	6,400	518.00	3,315,200	
アルゴグラフィックス	1,300	4,180.00	5,434,000	
魚力	600	2,342.00	1,405,200	
I D O M	4,200	896.00	3,763,200	
日本エム・ディ・エム	1,200	689.00	826,800	
ポプラ	700	260.00	182,000	
フジ・コーポレーション	800	1,912.00	1,529,600	
ユナイテッドアローズ	1,900	1,730.00	3,287,000	
進和	1,000	2,412.00	2,412,000	
エスケイジャパン	200	706.00	141,200	
ダイトロン	700	3,260.00	2,282,000	
ハイデイ日高	2,400	2,574.00	6,177,600	
シークス	2,300	1,616.00	3,716,800	
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i	500	149.00	74,500	
コロワイド	6,700	2,184.50	14,636,150	
田中商事	200	849.00	169,800	
オーハシテクニカ	800	1,767.00	1,413,600	
壺番屋	6,000	1,205.00	7,230,000	
白銅	400	2,566.00	1,026,400	
トップカルチャー	400	160.00	64,000	
P L A N T	200	1,724.00	344,800	
スギホールディングス	9,300	2,337.50	21,738,750	
ダイコー通産	300	1,261.00	378,300	
薬王堂ホールディングス	700	2,787.00	1,950,900	
島津製作所	19,700	4,118.00	81,124,600	
J M S	1,700	519.00	882,300	
クボテック	300	231.00	69,300	
長野計器	1,200	2,439.00	2,926,800	
ブイ・テクノロジー	800	2,603.00	2,082,400	
スター精密	2,700	1,762.00	4,757,400	
東京計器	1,300	2,504.00	3,255,200	
愛知時計電機	600	2,434.00	1,460,400	
インターアクション	800	1,252.00	1,001,600	
オーバル	1,200	585.00	702,000	
東京精密	3,000	11,695.00	35,085,000	
マニー	5,900	2,103.00	12,407,700	
ニコン	21,400	1,550.00	33,170,000	
トプコン	7,100	1,763.50	12,520,850	
オリンパス	91,200	2,148.50	195,943,200	
理研計器	1,000	7,710.00	7,710,000	
S C R E E Nホールディングス	5,100	19,445.00	99,169,500	
キヤノン電子	1,600	2,460.00	3,936,000	
タムロン	900	6,580.00	5,922,000	
HOYA	29,200	19,855.00	579,766,000	

シード	600	686.00	411,600	
ノーリツ鋼機	1,400	3,210.00	4,494,000	
A&Dホロンホールディングス	2,100	2,476.00	5,199,600	
朝日インテック	18,100	3,089.00	55,910,900	
キヤノン	74,100	4,390.00	325,299,000	
リコー	37,100	1,276.00	47,339,600	
シチズン時計	13,500	1,017.00	13,729,500	
リズム	100	4,025.00	402,500	
大研医器	1,000	554.00	554,000	
メニコン	5,100	1,691.50	8,626,650	
シンシア	400	500.00	200,000	
KYORITSU	2,600	189.00	491,400	
中本パックス	400	1,643.00	657,200	
スノーピーク	2,300	1,245.00	2,863,500	
パラマウントベッドホールディングス	3,000	2,504.00	7,512,000	
トランザクション	1,000	2,446.00	2,446,000	
粧美堂	400	653.00	261,200	
ニホンフラッシュ	1,700	972.00	1,652,400	
前田工織	1,200	3,430.00	4,116,000	
永大産業	2,200	287.00	631,400	
アートネイチャー	1,200	768.00	921,600	
フルヤ金属	400	10,170.00	4,068,000	
バンダイナムコホールディングス	40,600	2,913.50	118,288,100	
アイフィスジャパン	300	618.00	185,400	
SHOEI	3,300	2,136.00	7,048,800	
フランスベッドホールディングス	1,800	1,282.00	2,307,600	
マーベラス	2,700	718.00	1,938,600	
パイロットコーポレーション	2,100	3,805.00	7,990,500	
萩原工業	1,000	1,489.00	1,489,000	
エイベックス	2,500	1,284.00	3,210,000	
フジシールインターナショナル	2,900	2,018.00	5,852,200	
タカラトミー	6,700	2,637.50	17,671,250	
広済堂ホールディングス	3,500	625.00	2,187,500	
エステルホールディングス	400	650.00	260,000	
レック	2,200	1,105.00	2,431,000	
タカノ	400	1,032.00	412,800	
三光合成	2,300	671.00	1,543,300	
プロネクサス	1,300	1,235.00	1,605,500	
ホクシン	200	121.00	24,200	
ウッドワン	300	1,048.00	314,400	
きもと	1,400	216.00	302,400	
TOPPANホールディングス	18,200	3,450.00	62,790,000	
大日本印刷	16,200	4,268.00	69,141,600	
共同印刷	400	3,285.00	1,314,000	
NISSHA	2,700	1,537.00	4,149,900	
光村印刷	100	1,593.00	159,300	
藤森工業	1,100	3,910.00	4,301,000	
ヴィア・ホールディングス	2,400	131.00	314,400	
TAKARA & COMPANY	900	2,761.00	2,484,900	

前澤化成工業	1,100	1,653.00	1,818,300	
未来工業	600	4,970.00	2,982,000	
アシックス	12,600	6,558.00	82,630,800	
ツツミ	300	2,085.00	625,500	
ウェーブロックホールディングス	300	679.00	203,700	
JSP	1,200	2,227.00	2,672,400	
ニチハ	1,900	3,375.00	6,412,500	
ローランド	1,100	4,525.00	4,977,500	
エフピコ	2,800	2,684.00	7,515,200	
小松ウオール工業	600	3,355.00	2,013,000	
ヤマハ	9,300	3,148.00	29,276,400	
河合楽器製作所	400	3,335.00	1,334,000	
クリナップ	1,300	758.00	985,400	
ピジョン	9,400	1,527.00	14,353,800	
天馬	1,100	2,365.00	2,601,500	
キングジム	1,200	872.00	1,046,400	
象印マホービン	4,000	1,396.00	5,584,000	
リンテック	2,900	3,115.00	9,033,500	
信越ポリマー	3,100	1,576.00	4,885,600	
東リ	1,400	401.00	561,400	
イトーキ	3,000	1,642.00	4,926,000	
任天堂	93,700	8,390.00	786,143,000	
三菱鉛筆	2,100	2,479.00	5,205,900	
松風	600	2,727.00	1,636,200	
タカラスタンダード	3,100	1,832.00	5,679,200	
コクヨ	6,000	2,368.00	14,208,000	
ナカバヤシ	1,700	533.00	906,100	
ニフコ	4,400	3,710.00	16,324,000	
立川ブラインド工業	900	1,492.00	1,342,800	
グローブライド	1,400	1,985.00	2,779,000	
オカムラ	4,400	2,140.00	9,416,000	
バルカー	1,300	4,825.00	6,272,500	
MUTOHホールディングス	200	2,249.00	449,800	
伊藤忠商事	105,600	6,666.00	703,929,600	
丸紅	131,000	2,512.00	329,072,000	
スクロール	2,600	930.00	2,418,000	
高島	800	1,363.00	1,090,400	
ヨンドシーホールディングス	1,400	1,918.00	2,685,200	
三陽商会	500	2,522.00	1,261,000	
長瀬産業	7,100	2,478.50	17,597,350	
ナイガイ	1,200	261.00	313,200	
蝶理	900	3,155.00	2,839,500	
豊田通商	13,800	10,160.00	140,208,000	
オンワードホールディングス	9,000	497.00	4,473,000	
三共生興	2,000	774.00	1,548,000	
兼松	6,500	2,548.00	16,562,000	
美津濃	1,400	5,330.00	7,462,000	
ツカモトコーポレーション	200	1,270.00	254,000	
ルックホールディングス	400	2,482.00	992,800	

三井物産	118,400	6,816.00	807,014,400	
日本紙パルプ商事	800	5,110.00	4,088,000	
東京エレクトロン	31,400	39,450.00	1,238,730,000	
カメイ	1,800	1,955.00	3,519,000	
東都水産	100	6,180.00	618,000	
OUGホールディングス	200	2,556.00	511,200	
スターゼン	1,100	2,818.00	3,099,800	
セイコーグループ	2,100	3,725.00	7,822,500	
山善	4,600	1,316.00	6,053,600	
椿本興業	300	7,090.00	2,127,000	
住友商事	95,100	3,582.00	340,648,200	
BIPROGY	4,800	4,568.00	21,926,400	
内田洋行	600	7,010.00	4,206,000	
三菱商事	301,700	3,287.00	991,687,900	
第一実業	1,500	2,137.00	3,205,500	
キヤノンマーケティングジャパン	3,600	4,366.00	15,717,600	
西華産業	700	3,230.00	2,261,000	
佐藤商事	1,000	1,779.00	1,779,000	
菱洋エレクトロ	1,500	4,050.00	6,075,000	
東京産業	1,800	713.00	1,283,400	
ユアサ商事	1,200	5,060.00	6,072,000	
神鋼商事	400	7,170.00	2,868,000	
トルク	400	296.00	118,400	
阪和興業	2,800	5,700.00	15,960,000	
正栄食品工業	1,100	4,670.00	5,137,000	
カナデン	1,100	1,548.00	1,702,800	
RYODEN	1,200	2,595.00	3,114,000	
ニプロ	12,300	1,227.00	15,092,100	
岩谷産業	3,600	7,751.00	27,903,600	
ナイス	400	1,550.00	620,000	
ニチモウ	400	2,147.00	858,800	
極東貿易	1,000	2,185.00	2,185,000	
アステナホールディングス	2,800	473.00	1,324,400	
三愛オブリ	3,900	1,983.00	7,733,700	
稲畑産業	3,100	3,190.00	9,889,000	
G S I クレオス	800	2,362.00	1,889,600	
明和産業	1,900	655.00	1,244,500	
クワザワホールディングス	300	889.00	266,700	
キムラタン	14,500	18.00	261,000	
ゴールドウイン	2,600	8,832.00	22,963,200	
ユニ・チャーム	31,000	4,879.00	151,249,000	
デサント	2,500	3,390.00	8,475,000	
キング	300	702.00	210,600	
ワキタ	2,700	1,553.00	4,193,100	
ヤマトインターナショナル	900	297.00	267,300	
東邦ホールディングス	4,300	3,200.00	13,760,000	
サンゲツ	3,600	3,365.00	12,114,000	
ミツウロコグループホールディングス	2,100	1,420.00	2,982,000	
シナネンホールディングス	400	4,380.00	1,752,000	

伊藤忠エネクス	3,800	1,516.00	5,760,800	
サンリオ	4,400	8,723.00	38,381,200	
サンワテクノス	900	2,388.00	2,149,200	
リョーサン	1,100	5,240.00	5,764,000	
新光商事	2,100	1,211.00	2,543,100	
トーホー	700	2,925.00	2,047,500	
三信電気	700	2,271.00	1,589,700	
東陽テクニカ	1,700	1,488.00	2,529,600	
モスフードサービス	2,300	3,495.00	8,038,500	
加賀電子	1,400	6,490.00	9,086,000	
三益半導体工業	1,400	3,270.00	4,578,000	
都築電気	900	2,464.00	2,217,600	
ソーダニッカ	1,300	1,233.00	1,602,900	
立花エレテック	1,100	3,170.00	3,487,000	
木曾路	2,300	2,669.00	6,138,700	
S R Sホールディングス	2,500	1,191.00	2,977,500	
千趣会	3,700	281.00	1,039,700	
タカキュー	3,300	67.00	221,100	
リテールパートナーズ	2,300	1,681.00	3,866,300	
上新電機	1,500	2,349.00	3,523,500	
日本瓦斯	8,300	2,401.00	19,928,300	
ロイヤルホールディングス	2,700	2,391.00	6,455,700	
東天紅	300	846.00	253,800	
いなげや	1,400	1,304.00	1,825,600	
チョダ	1,500	877.00	1,315,500	
ライフコーポレーション	1,600	3,660.00	5,856,000	
リンガーハット	2,100	2,302.00	4,834,200	
MrMaxHD	1,800	602.00	1,083,600	
テンアライド	1,400	315.00	441,000	
AOKIホールディングス	3,300	1,104.00	3,643,200	
オークワ	2,200	828.00	1,821,600	
コメリ	2,500	3,340.00	8,350,000	
青山商事	3,500	1,636.00	5,726,000	
しまむら	3,700	7,816.00	28,919,200	
はせがわ	500	348.00	174,000	
高島屋	10,800	2,262.00	24,429,600	
松屋	2,500	968.00	2,420,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,900	1,764.00	12,171,600	
近鉄百貨店	600	2,392.00	1,435,200	
丸井グループ	10,400	2,386.00	24,814,400	
クレディセゾン	9,200	2,976.50	27,383,800	
アクシアル リテイリング	1,000	3,945.00	3,945,000	
井筒屋	500	345.00	172,500	
イオン	53,300	3,538.00	188,575,400	
イズミ	2,800	3,433.00	9,612,400	
フォーバル	700	1,233.00	863,100	
平和堂	2,600	1,943.00	5,051,800	
フジ	2,400	1,832.00	4,396,800	
ヤオコー	1,800	8,444.00	15,199,200	

ゼビオホールディングス	2,400	967.00	2,320,800	
ケーズホールディングス	11,000	1,276.00	14,036,000	
PAL TAC	2,100	4,177.00	8,771,700	
三谷産業	2,800	396.00	1,108,800	
O l y m p i cグループ	300	507.00	152,100	
日産東京販売ホールディングス	1,800	522.00	939,600	
あおぞら銀行	10,500	2,524.00	26,502,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	890,600	1,596.50	1,421,842,900	
りそなホールディングス	170,100	864.90	147,119,490	
三井住友トラスト・ホールディングス	52,400	3,188.00	167,051,200	
三井住友フィナンシャルグループ	104,000	8,623.00	896,792,000	
千葉銀行	40,600	1,227.00	49,816,200	
群馬銀行	28,200	812.50	22,912,500	
武蔵野銀行	2,100	2,869.00	6,024,900	
千葉興業銀行	2,400	998.00	2,395,200	
筑波銀行	6,700	287.00	1,922,900	
七十七銀行	4,200	3,900.00	16,380,000	
秋田銀行	1,100	2,109.00	2,319,900	
山形銀行	1,800	1,167.00	2,100,600	
岩手銀行	900	2,681.00	2,412,900	
東邦銀行	12,400	346.00	4,290,400	
東北銀行	500	1,235.00	617,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	12,700	4,025.00	51,117,500	
スルガ銀行	12,700	783.00	9,944,100	
八十二銀行	31,200	929.90	29,012,880	
山梨中央銀行	1,700	1,858.00	3,158,600	
大垣共立銀行	2,700	2,186.00	5,902,200	
福井銀行	1,200	1,872.00	2,246,400	
清水銀行	600	1,592.00	955,200	
富山銀行	100	1,828.00	182,800	
滋賀銀行	2,400	4,105.00	9,852,000	
南都銀行	2,300	2,859.00	6,575,700	
百五銀行	13,600	654.00	8,894,400	
紀陽銀行	5,200	1,828.00	9,505,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	9,000	1,772.50	15,952,500	
山陰合同銀行	9,000	1,172.00	10,548,000	
鳥取銀行	400	1,473.00	589,200	
百十四銀行	1,500	2,844.00	4,266,000	
四国銀行	2,000	1,149.00	2,298,000	
阿波銀行	2,000	2,738.00	5,476,000	
大分銀行	800	2,791.00	2,232,800	
宮崎銀行	800	2,822.00	2,257,600	
佐賀銀行	900	2,023.00	1,820,700	
琉球銀行	3,200	1,153.00	3,689,600	
セブン銀行	45,400	296.50	13,461,100	
みずほフィナンシャルグループ	197,400	2,878.00	568,117,200	
高知銀行	300	1,003.00	300,900	
山口フィナンシャルグループ	14,200	1,547.00	21,967,400	
芙蓉総合リース	1,300	13,255.00	17,231,500	

みずほリース	2,400	5,400.00	12,960,000	
東京センチュリー	10,800	1,576.00	17,020,800	
SBIホールディングス	21,400	3,968.00	84,915,200	
日本証券金融	5,300	1,658.00	8,787,400	
アイフル	21,200	407.00	8,628,400	
日本アジア投資	800	230.00	184,000	
名古屋銀行	1,000	6,510.00	6,510,000	
北洋銀行	21,800	420.00	9,156,000	
大光銀行	300	1,445.00	433,500	
愛媛銀行	1,900	1,139.00	2,164,100	
トマト銀行	300	1,288.00	386,400	
京葉銀行	6,300	747.00	4,706,100	
栃木銀行	7,900	345.00	2,725,500	
北日本銀行	600	2,284.00	1,370,400	
東和銀行	2,800	686.00	1,920,800	
福島銀行	1,300	264.00	343,200	
大東銀行	400	770.00	308,000	
リコーリース	1,400	5,130.00	7,182,000	
イオンフィナンシャルサービス	8,300	1,285.00	10,665,500	
アコム	25,800	389.90	10,059,420	
ジャックス	1,500	5,420.00	8,130,000	
オリエントコーポレーション	4,700	1,068.00	5,019,600	
オリックス	87,700	3,184.00	279,236,800	
三菱HCキャピタル	65,000	1,045.00	67,925,000	
ジャフコグループ	4,500	1,731.00	7,789,500	
九州リースサービス	400	1,495.00	598,000	
トモニホールディングス	13,600	413.00	5,616,800	
大和証券グループ本社	113,000	1,124.00	127,012,000	
野村ホールディングス	245,400	906.70	222,504,180	
岡三証券グループ	12,700	789.00	10,020,300	
丸三証券	4,700	1,025.00	4,817,500	
東洋証券	3,600	388.00	1,396,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	17,100	600.00	10,260,000	
光世証券	100	764.00	76,400	
水戸証券	4,100	498.00	2,041,800	
いちよし証券	3,100	815.00	2,526,500	
松井証券	7,400	845.00	6,253,000	
SOMPOホールディングス	22,000	9,052.00	199,144,000	
日本取引所グループ	38,100	4,102.00	156,286,200	
マネックスグループ	14,200	947.00	13,447,400	
極東証券	2,000	1,088.00	2,176,000	
岩井コスモホールディングス	1,800	2,295.00	4,131,000	
アイザワ証券グループ	2,000	1,180.00	2,360,000	
フィデアホールディングス	1,600	1,610.00	2,576,000	
池田泉州ホールディングス	20,200	387.00	7,817,400	
アニコムホールディングス	4,800	571.00	2,740,800	
MS&ADインシュアランスグループホール	32,700	7,586.00	248,062,200	
マネーパートナーズグループ	700	297.00	207,900	
スパークス・グループ	1,600	1,900.00	3,040,000	

小林洋行	1,300	269.00	349,700	
第一生命ホールディングス	71,300	3,591.00	256,038,300	
東京海上ホールディングス	144,500	4,408.00	636,956,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	400	404.00	161,600	
イー・ギャランティ	2,300	1,900.00	4,370,000	
アサックス	600	749.00	449,400	
NECキャピタルソリューション	800	3,765.00	3,012,000	
T&Dホールディングス	39,200	2,683.00	105,173,600	
アドバンスクリエイト	900	1,003.00	902,700	
三井不動産	67,500	4,220.00	284,850,000	
三菱地所	95,400	2,428.50	231,678,900	
平和不動産	2,300	3,765.00	8,659,500	
東京建物	12,700	2,192.00	27,838,400	
京阪神ビルディング	2,700	1,449.00	3,912,300	
住友不動産	21,100	4,476.00	94,443,600	
太平洋興発	200	828.00	165,600	
テーオーシー	2,900	657.00	1,905,300	
レオパレス21	15,100	451.00	6,810,100	
スターツコーポレーション	2,100	2,967.00	6,230,700	
フジ住宅	1,700	721.00	1,225,700	
空港施設	2,000	599.00	1,198,000	
明和地所	700	1,089.00	762,300	
ゴールドクレスト	1,200	2,250.00	2,700,000	
リログループ	7,600	1,182.00	8,983,200	
エスリード	700	3,370.00	2,359,000	
日神グループホールディングス	2,600	510.00	1,326,000	
日本エスコン	2,900	1,013.00	2,937,700	
MIRARTHホールディングス	6,800	484.00	3,291,200	
AVANTIA	500	846.00	423,000	
イオンモール	7,500	1,724.50	12,933,750	
毎日コムネット	400	770.00	308,000	
ファースト住建	300	1,105.00	331,500	
ランド	110,100	7.00	770,700	
カチタス	3,900	2,013.00	7,850,700	
東祥	1,300	765.00	994,500	
トーセイ	2,400	1,993.00	4,783,200	
穴吹興産	200	2,062.00	412,400	
サンフロンティア不動産	2,200	1,638.00	3,603,600	
FJネクストホールディングス	1,600	1,185.00	1,896,000	
インテリックス	600	539.00	323,400	
ランドビジネス	200	264.00	52,800	
サンネクスタグループ	300	954.00	286,200	
グランディハウス	700	646.00	452,200	
東武鉄道	16,300	3,892.00	63,439,600	
相鉄ホールディングス	5,300	2,749.00	14,569,700	
東急	41,500	1,931.50	80,157,250	
京浜急行電鉄	18,300	1,309.50	23,963,850	
小田急電鉄	24,500	2,094.00	51,303,000	
京王電鉄	7,100	4,148.00	29,450,800	

京成電鉄	9,500	6,941.00	65,939,500	
富士急行	1,800	3,900.00	7,020,000	
東日本旅客鉄道	27,300	8,788.00	239,912,400	
西日本旅客鉄道	17,600	6,213.00	109,348,800	
東海旅客鉄道	57,100	3,794.00	216,637,400	
西武ホールディングス	17,900	2,164.00	38,735,600	
鴻池運輸	2,600	1,804.00	4,690,400	
西日本鉄道	3,900	2,382.00	9,289,800	
ハマキョウレックス	1,300	3,715.00	4,829,500	
サカイ引越センター	1,600	2,550.00	4,080,000	
近鉄グループホールディングス	14,800	4,601.00	68,094,800	
阪急阪神ホールディングス	19,700	4,409.00	86,857,300	
南海電気鉄道	6,600	3,063.00	20,215,800	
京阪ホールディングス	8,100	3,431.00	27,791,100	
神戸電鉄	500	2,832.00	1,416,000	
名古屋鉄道	15,200	2,127.50	32,338,000	
山陽電気鉄道	1,100	2,133.00	2,346,300	
アルプス物流	1,100	2,507.00	2,757,700	
トランコム	400	6,120.00	2,448,000	
ヤマトホールディングス	18,900	2,182.00	41,239,800	
山九	3,700	5,206.00	19,262,200	
日新	1,100	2,875.00	3,162,500	
丸運	700	276.00	193,200	
丸全昭和運輸	900	4,380.00	3,942,000	
センコーグループホールディングス	7,700	1,067.00	8,215,900	
トナミホールディングス	300	4,355.00	1,306,500	
ニッコンホールディングス	4,700	3,005.00	14,123,500	
日本石油輸送	100	2,850.00	285,000	
福山通運	1,700	3,940.00	6,698,000	
セイノーホールディングス	8,300	2,094.00	17,380,200	
エスライングループ本社	500	890.00	445,000	
神奈川中央交通	500	3,040.00	1,520,000	
AZ-COM丸和ホールディングス	3,900	1,462.00	5,701,800	
C&Fロジホールディングス	1,600	1,880.00	3,008,000	
日本郵船	42,400	4,634.00	196,481,600	
商船三井	32,100	5,029.00	161,430,900	
川崎汽船	11,900	7,174.00	85,370,600	
NSユニテッド海運	800	5,210.00	4,168,000	
明海グループ	900	870.00	783,000	
飯野海運	5,400	1,280.00	6,912,000	
共栄タンカー	100	1,146.00	114,600	
九州旅客鉄道	10,400	3,534.00	36,753,600	
SGホールディングス	24,800	1,861.00	46,152,800	
NIPPON EXPRESSホールディン	5,000	7,657.00	38,285,000	
ID&Eホールディングス	1,000	3,765.00	3,765,000	
日本航空	36,300	2,726.50	98,971,950	
ANAホールディングス	40,200	3,182.00	127,916,400	
ビーウィズ	300	2,139.00	641,700	
パスコ	200	1,874.00	374,800	

TREホールディングス	2,800	1,241.00	3,474,800	
人・夢・技術グループ	600	1,704.00	1,022,400	
西本Wismettacホールディングス	400	5,910.00	2,364,000	
シルバーライフ	500	838.00	419,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	2,548.00	509,600	
Genky DrugStores	700	6,290.00	4,403,000	
コア商事ホールディングス	800	724.00	579,200	
KPPグループホールディングス	4,100	677.00	2,775,700	
ナルミヤ・インターナショナル	100	1,162.00	116,200	
ブックオフグループホールディングス	900	1,290.00	1,161,000	
ギフトホールディングス	600	2,900.00	1,740,000	
三菱倉庫	3,600	4,607.00	16,585,200	
三井倉庫ホールディングス	1,400	4,620.00	6,468,000	
住友倉庫	4,000	2,530.00	10,120,000	
澁澤倉庫	600	2,997.00	1,798,200	
ヤマタネ	700	2,667.00	1,866,900	
東陽倉庫	300	1,508.00	452,400	
乾汽船	1,700	1,002.00	1,703,400	
日本トランスシティ	3,300	614.00	2,026,200	
ケイヒン	300	1,975.00	592,500	
中央倉庫	800	1,144.00	915,200	
川西倉庫	300	1,214.00	364,200	
安田倉庫	1,100	1,222.00	1,344,200	
ファイズホールディングス	100	1,180.00	118,000	
NISSOホールディングス	1,500	813.00	1,219,500	
大栄環境	2,700	2,749.00	7,422,300	
日本管財ホールディングス	1,600	2,547.00	4,075,200	
東洋埠頭	200	1,371.00	274,200	
上組	6,800	3,317.00	22,555,600	
サンリツ	200	777.00	155,400	
キムラユニティー	600	1,591.00	954,600	
キューソー流通システム	400	998.00	399,200	
東海運	1,000	300.00	300,000	
エーアイティー	1,000	1,738.00	1,738,000	
内外トランスライン	600	2,345.00	1,407,000	
ショーエイコーボレーション	700	620.00	434,000	
日本コンセプト	600	1,839.00	1,103,400	
TBSホールディングス	7,400	4,053.00	29,992,200	
日本テレビホールディングス	13,100	2,130.00	27,903,000	
朝日放送グループホールディングス	1,400	687.00	961,800	
テレビ朝日ホールディングス	3,600	1,929.00	6,944,400	
スカパーJ SATホールディングス	11,400	952.00	10,852,800	
テレビ東京ホールディングス	1,000	2,931.00	2,931,000	
日本BS放送	500	890.00	445,000	
ビジョン	2,300	1,152.00	2,649,600	
スマートバリュー	100	415.00	41,500	
USEN-NEXT HOLDINGS	1,600	4,405.00	7,048,000	
ワイヤレスゲート	1,100	212.00	233,200	
日本通信	15,900	214.00	3,402,600	

クロップス	300	1,003.00	300,900	
日本電信電話	4,429,700	180.70	800,446,790	
KDDI	115,100	4,506.00	518,640,600	
ソフトバンク	239,700	1,953.00	468,134,100	
光通信	1,500	27,465.00	41,197,500	
エムティーアイ	1,000	760.00	760,000	
GMOインターネットグループ	5,500	2,871.00	15,790,500	
ファイバーゲート	1,000	1,000.00	1,000,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	200	233.00	46,600	
KADOKAWA	7,800	2,805.50	21,882,900	
学研ホールディングス	2,400	950.00	2,280,000	
ゼンリン	2,400	837.00	2,008,800	
昭文社ホールディングス	400	385.00	154,000	
インプレスホールディングス	900	170.00	153,000	
東京電力ホールディングス	133,500	772.00	103,062,000	
中部電力	54,600	1,880.00	102,648,000	
関西電力	57,200	1,925.00	110,110,000	
中国電力	25,700	1,012.00	26,008,400	
北陸電力	15,000	707.60	10,614,000	
東北電力	38,900	1,003.50	39,036,150	
四国電力	13,700	1,089.50	14,926,150	
九州電力	34,100	1,242.00	42,352,200	
北海道電力	14,200	682.80	9,695,760	
沖縄電力	3,600	1,107.00	3,985,200	
電源開発	12,100	2,465.00	29,826,500	
エフオン	1,200	405.00	486,000	
イーレックス	2,900	708.00	2,053,200	
レノバ	3,900	1,101.00	4,293,900	
東京瓦斯	31,300	3,351.00	104,886,300	
大阪瓦斯	30,000	3,042.00	91,260,000	
東邦瓦斯	6,400	2,965.50	18,979,200	
北海道瓦斯	1,000	2,258.00	2,258,000	
広島ガス	3,800	378.00	1,436,400	
西部ガスホールディングス	1,600	1,869.00	2,990,400	
静岡ガス	3,200	924.00	2,956,800	
メタウォーター	1,900	2,249.00	4,273,100	
M&A総研ホールディングス	700	6,980.00	4,886,000	
アイネット	1,000	2,173.00	2,173,000	
松竹	800	10,225.00	8,180,000	
東宝	8,200	4,845.00	39,729,000	
エイチ・アイ・エス	4,400	1,677.00	7,378,800	
東映	500	19,820.00	9,910,000	
ラックランド	600	2,276.00	1,365,600	
NTTデータグループ	38,800	2,495.00	96,806,000	
共立メンテナンス	2,400	6,132.00	14,716,800	
イチネンホールディングス	1,800	1,638.00	2,948,400	
建設技術研究所	800	5,750.00	4,600,000	
スペース	1,000	988.00	988,000	
アインホールディングス	2,100	4,546.00	9,546,600	

燦ホールディングス	1,400	1,030.00	1,442,000	
ピー・シー・エー	1,000	1,673.00	1,673,000	
スバル興業	500	3,100.00	1,550,000	
東京テアトル	400	1,125.00	450,000	
タナベコンサルティンググループ	300	1,049.00	314,700	
ビジネスブレイン太田昭和	600	2,263.00	1,357,800	
ナガワ	500	7,590.00	3,795,000	
東京都競馬	1,300	4,075.00	5,297,500	
常磐興産	400	1,246.00	498,400	
カナモト	2,300	2,874.00	6,610,200	
D T S	3,100	4,020.00	12,462,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,800	6,133.00	41,704,400	
シーイーシー	1,900	1,824.00	3,465,600	
カプコン	13,300	5,962.00	79,294,600	
ニシオホールディングス	1,400	3,895.00	5,453,000	
アイ・エス・ビー	900	1,367.00	1,230,300	
アゴーラ ホスピタリティール グループ	9,000	81.00	729,000	
日本空港ビルデング	5,100	5,649.00	28,809,900	
トランス・コスモス	1,900	3,020.00	5,738,000	
乃村工藝社	7,000	845.00	5,915,000	
ジャステック	900	1,373.00	1,235,700	
S C S K	10,400	2,812.00	29,244,800	
藤田観光	600	5,840.00	3,504,000	
KNT-C Tホールディングス	1,000	1,200.00	1,200,000	
トーカイ	1,300	2,165.00	2,814,500	
白洋舎	100	2,696.00	269,600	
セコム	15,500	11,355.00	176,002,500	
N S W	600	3,245.00	1,947,000	
セントラル警備保障	900	2,504.00	2,253,600	
アイネス	1,100	1,618.00	1,779,800	
丹青社	3,300	800.00	2,640,000	
メイテックグループホールディングス	5,500	3,067.00	16,868,500	
T K C	2,300	3,670.00	8,441,000	
富士ソフト	3,000	6,270.00	18,810,000	
応用地質	1,400	2,253.00	3,154,200	
船井総研ホールディングス	3,100	2,488.00	7,712,800	
N S D	5,300	2,854.00	15,126,200	
進学会ホールディングス	200	269.00	53,800	
丸紅建材リース	100	2,987.00	298,700	
オオバ	700	978.00	684,600	
コナミグループ	5,600	10,180.00	57,008,000	
いであ	200	2,296.00	459,200	
学究社	600	2,066.00	1,239,600	
ベネッセホールディングス	5,100	2,580.00	13,158,000	
イオンディライト	1,600	3,380.00	5,408,000	
ナック	1,800	570.00	1,026,000	
福井コンピュータホールディングス	900	2,619.00	2,357,100	
ダイセキ	3,100	3,735.00	11,578,500	
ステップ	700	2,001.00	1,400,700	

泉州電業	800	4,250.00	3,400,000	
元気寿司	900	3,600.00	3,240,000	
トラスコ中山	3,300	2,232.00	7,365,600	
ヤマダホールディングス	48,000	430.00	20,640,000	
オートバックスセブン	5,400	1,627.50	8,788,500	
モリト	1,200	1,422.00	1,706,400	
アー克蘭ズ	4,600	1,621.00	7,456,600	
ニトリホールディングス	5,700	22,680.00	129,276,000	
グルメ杵屋	1,200	1,115.00	1,338,000	
愛眼	1,300	187.00	243,100	
ケーユーホールディングス	600	1,182.00	709,200	
吉野家ホールディングス	5,700	3,243.00	18,485,100	
加藤産業	1,900	4,650.00	8,835,000	
北恵	200	855.00	171,000	
イノテック	900	2,056.00	1,850,400	
イエローハット	2,600	1,890.00	4,914,000	
松屋フーズホールディングス	700	5,880.00	4,116,000	
JBC Cホールディングス	1,000	3,600.00	3,600,000	
J Kホールディングス	1,300	1,031.00	1,340,300	
サガミホールディングス	2,400	1,513.00	3,631,200	
日伝	1,000	2,686.00	2,686,000	
関西フードマーケット	1,000	1,585.00	1,585,000	
ミロク情報サービス	1,500	1,888.00	2,832,000	
北沢産業	500	346.00	173,000	
杉本商事	800	2,236.00	1,788,800	
因幡電機産業	4,000	3,515.00	14,060,000	
王将フードサービス	1,200	7,770.00	9,324,000	
ミニストップ	1,200	1,530.00	1,836,000	
アークス	2,800	3,010.00	8,428,000	
バローホールディングス	3,000	2,390.00	7,170,000	
東テック	500	7,180.00	3,590,000	
ミスミグループ本社	23,600	2,258.00	53,288,800	
アルテック	1,000	272.00	272,000	
ベルク	800	6,150.00	4,920,000	
大庄	700	1,268.00	887,600	
タキヒヨー	300	1,163.00	348,900	
ファーストリテイリング	7,100	44,280.00	314,388,000	
ソフトバンクグループ	73,500	9,008.00	662,088,000	
蔵王産業	200	2,567.00	513,400	
スズケン	5,900	4,471.00	26,378,900	
サンドラッグ	5,300	4,582.00	24,284,600	
サックスパー ホールディングス	1,500	875.00	1,312,500	
ジェコス	1,000	1,122.00	1,122,000	
ヤマザワ	100	1,252.00	125,200	
やまや	100	3,330.00	333,000	
ベルーナ	4,000	611.00	2,444,000	
合 計	23,202,300		57,233,358,650	

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。

## 2 【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

(2024年3月29日現在)

I 資産総額	15,494,950,696円
II 負債総額	69,222,269円
III 純資産総額 (I - II)	15,425,728,427円
IV 発行済口数	6,148,175,805口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	2.5090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)

(2024年3月29日現在)

I 資産総額	59,336,582,382円
II 負債総額	195,793,110円
III 純資産総額 (I - II)	59,140,789,272円
IV 発行済口数	11,385,385,489口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	5.1944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。

2024年3月末現在、委託会社の運用する証券投資信託は、123本であり、その純資産総額は3,598,216百万円です（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。  
また、委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規制」（昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という）ならびに同規則第38条第1項及び第57条第1項の規定に基づき、「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. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 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、第26期事業年度（2022年4月1日から2023年3月31日まで）の財務諸表ならびに第27期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の中間財務諸表について、EY新日本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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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金額を計上しております。

	<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</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <p>繰延税金資産</p> <p style="padding-left: 20px;">賞与引当金繰入超過額 19,674</p> <p style="padding-left: 20px;">退職給付引当金 27,681</p> <p>(注) 繰越欠損金 1,727,082</p> <p style="padding-left: 20px;">その他 51,898</p> <hr style="width: 20%; margin-left: 100px;"/> <p style="padding-left: 20px;">繰延税金資産 合計 1,826,336</p> <p style="padding-left: 20px;">繰延税金負債との相殺 -</p> <hr style="width: 20%; margin-left: 100px;"/> <p>繰延税金資産の純額 1,826,336</p>	<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</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <p>繰延税金資産</p> <p style="padding-left: 20px;">賞与引当金繰入超過額 22,144</p> <p style="padding-left: 20px;">退職給付引当金 25,052</p> <p>(注) 繰越欠損金 1,453,659</p> <p style="padding-left: 20px;">その他 36,485</p> <hr style="width: 20%; margin-left: 100px;"/> <p style="padding-left: 20px;">繰延税金資産 合計 1,537,341</p> <p style="padding-left: 20px;">繰延税金負債との相殺 -</p> <hr style="width: 20%; margin-left: 100px;"/> <p>繰延税金資産の純額 1,537,341</p>

(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 $\Delta$ 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)

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	関連当事者との関係 役員の 兼任等	事業上の関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
同一の親 会社を持 つ会社	ステート・スト リート・バンク・ アット・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	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	人件費等の支払	396,782	未払金	28,457
							人件費等及び 事務手数料の 支払	85,395			
							移転価格調整金 の支払	363,220			
	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	38,999	前払金	119,051
							兼職社員の人 件費支払等	人件費等の支払	127,476		
	ステート・スト リート・グロ ーバル・アト ム・イサー 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	19,193	-	-

	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ及びETF商品の紹介	紹介料の受取 投資顧問料の支払	264 24,400	-	-
--	---------------------------------	-------------------	--------------	-------	----	----	------------------------	--------------------	---------------	---	---

(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 マサチューセッツ州ボストン市	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				
								ソフトウェアの使用契約	175,762			未払金	24,509
								人件費等及び事務手数料の受取	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	人件費等の支払	127,670				
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・コナイテッド・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・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール シンガポール 市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ及びETF商品の紹介	紹介料の受取  投資顧問料の支払	250  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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2023年12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

### 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第27期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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

### 中間監査意見の根拠

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

### 中間財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

監査役の責任は、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。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役に対して、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。

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するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用し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) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）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) 中間貸借対照表

(単位：千円)

科 目	第27期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)		
	期 別	金 額	構成比
(資産の部)			
流動資産			%
預金		5,594,690	
前払金		98,445	
前払費用		27,130	
未収入金		687,092	
未収委託者報酬		735,800	
未収収益		301,004	
流動資産計		7,444,163	83.4
固定資産			
有形固定資産		7	
器具備品	※1	7	
投資その他の資産		1,478,931	
投資有価証券		26,352	
長期差入保証金		50,200	
繰延税金資産		1,396,103	
その他投資		6,275	
固定資産計		1,478,939	16.6
資 産 合 計		8,923,103	100.0
(負債の部)			
流動負債			%
預り金		43,582	
未払金		390,886	
未払手数料		206,128	
その他未払金		184,758	
未払費用		13,156	
未払法人税等		233,970	
未払消費税等	※2	16,949	
賞与引当金		299,712	
流動負債計		998,258	11.2
固定負債			
退職給付引当金		69,904	
固定負債計		69,904	0.8
負 債 合 計		1,068,163	12.0
(純資産の部)			
株主資本		7,850,518	88.0
資本金		310,000	
利益剰余金		7,540,518	
利益準備金		77,500	
その他利益剰余金			
別途積立金		31,620	
繰越利益剰余金		7,431,398	
評価・換算差額等		4,421	
その他有価証券評価差額金		4,421	
純 資 産 合 計		7,854,940	88.0
負 債 ・ 純 資 産 合 計		8,923,103	100.0

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

科 目	期 別	第27期中間会計期間 自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日	
		金 額	構成比
営業収益			%
委託者報酬			1,435,040
投資顧問収入			1,434,219
その他営業収益	※1		63,660
営業収益計			2,932,920
営業費用・一般管理費			
営業費用			1,028,805
支払手数料		427,673	
その他営業費用		601,131	
一般管理費	※2		967,219
営業費用・一般管理費計			1,996,024
営業利益			936,895
営業外収益	※1		69,185
営業外費用			4,146
経常利益			1,001,933
特別利益			0
特別損失			0
税引前中間純利益			1,001,933
法人税, 住民税及び事業税			215,714
法人税等調整額			139,286
中間純利益			646,932

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

(単位：千円)

	株 主 資 本					株主資本 合計	評価・換算差額等		純資産 合計
	資本金	利益剰余金			利益剰余金 合計		その他有 価証券評 価差額金	評価・ 換算差額等 合計	
		利益 準備金	その他利益 剰余金						
		別途積立金	繰越利益 剰余金						
当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,784,466	6,893,586	7,203,586	-	-	7,203,586
当中間期変動額									
中間純利益				646,932	646,932	646,932			646,932
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)	-	-	-	-	-	-	4,421	4,421	4,421
当中間期変動額合計	-	-	-	646,932	646,932	646,932	4,421	4,421	651,353
当中間期末残高	310,000	77,500	31,620	7,431,398	7,540,518	7,850,518	4,421	4,421	7,854,940

[重要な会計方針]

	<p>第27期中間会計期間 自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日</p>
1. 資産の評価基準及び評価方法	<p>有価証券          其他有価証券          市場価格のない株式等以外のもの          時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。          市場価格のない株式等          移動平均法による原価法を採用しております。</p>
2. 固定資産の減価償却方法	<p>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とおりであります。          器具備品 3～7年</p>
3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、中間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。</p>
4. 引当金の計上基準	<p>(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中間会計期間に負担すべき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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</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中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、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          発生翌事業年度に一括費用処理しております。</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	<p>消費税等の処理方法</p>

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。
------------------------	--------------------------------

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第27期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)	
※1. 有形固定資産の減価償却累計額 器具備品	30,766千円
※2. 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。	

(中間損益計算書関係)

第27期中間会計期間 自 2023年4月 1日 至 2023年9月30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。当中間会計期間にステート・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63,545千円は、中間損益計算書のその他営業収益に、移転価格調整額66,918千円は、中間損益計算書の営業外収益に含まれております。	
※2. 減価償却実施額 有形固定資産	320千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第27期中間会計期間 自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日				
1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項				
株式の種類	当事業年度期首 株式数 (株)	当中間会計期間 増加株式数 (株)	当中間会計期間 減少株式数 (株)	当中間会計期間末 株式数 (株)
普通株式	6,200	—	—	6,200

(金融商品関係)

第27期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)			
1. 金融商品の時価等に関する事項			
	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
投資有価証券	26,352	26,352	-
資産計	26,352	26,352	-
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。			
2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項			

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。

時価で中間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
投資有価証券	-	26,352	-	26,352
その他有価証券	-	26,352	-	26,352
資産計	-	26,352	-	26,352

(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

投資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)

第27期中間会計期間末  
(2023年9月30日現在)

その他有価証券

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
投資信託	26,352千円	19,980千円	6,372千円
小計	26,352千円	19,980千円	6,372千円
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
合計	26,352千円	19,980千円	6,372千円

(資産除去債務関係)

第27期中間会計期間末  
(2023年9月30日現在)

当社は建物所有者との間で建物賃貸借契約を締結しており、貸借期間終了時に原状回復する義務をゆうしているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷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、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

(デリバティブ取引関係)

第27期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)
当社はデリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第27期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)
(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。
(セグメント関連情報)
1. 商品およびサービスごとの情報 単一の商品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。
2. 地域ごとの情報
(1) 営業収益 本邦に所在している顧客への収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しています。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、集計対象より除いております。
(2) 有形固定資産 本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。
3. 主要な顧客ごとの情報 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、中間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。

(収益認識関係)

第27期中間会計期間 自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日
(1) 収益の分解情報 当中間会計期間の収益の構成は次のとおりです。 委託者報酬 1,435,040千円 投資顧問収入 1,434,219千円 <u>その他営業収益 63,660千円</u> 合計 2,932,920千円
(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。

(1 株当たり情報)

第27期中間会計期間

自 2023年4月 1日

至 2023年9月30日

1株当たり純資産額 1,266,925円84銭

1株当たり中間純利益 104,343円97銭

なお、潜在株式調整後1株当たり中間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株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第27期中間会計期間	
自 2023年4月 1日	
至 2023年9月30日	
中間純利益 (千円)	646,932
普通株主に帰属しない金額	—
普通株式にかかる中間純利益 (千円)	646,932
期中平均株式数 (株)	6,200

(重要な後発事象)

第27期中間会計期間

自 2023年4月 1日

至 2023年9月30日

該当事項はありません。

#### 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、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、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）をいいます。）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け、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ます。）
  - 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ます。）
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

ものとしてします。

(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てします。

- 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てします。
- 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てします。

(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てします。

- 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てします。
- 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てします。
- 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。