

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2021年6月4日

【発行者名】 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ
株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 高村 孝

【本店の所在の場所】 東京都港区虎ノ門一丁目23番1号

【事務連絡者氏名】 鈴木 愛

【電話番号】 03 - 4530 - 7385

【届出の対象とした募集（売出）内国投資
信託受益証券に係るファンドの名称】 ステート・ストリート日本株式インデックス・
オープン

【届出の対象とした募集（売出）内国投資
信託受益証券の金額】 1兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

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】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額 とします。

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】

2021年6月5日から2022年6月3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】

申込証拠金

該当事項はありません。

本邦以外の地域での発行

該当事項はありません。

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】

当ファンドは、MA（マルチアセット）ファンドシリーズ の一つであり、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」（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、中長期的に日本の株式市場（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めざ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。

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。

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	年1回	グローバル		
一般	年2回	日本		
大型株	年4回	北米		日経 225
中小型株				

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	TOPIX
年12回 (毎月)	アジア オセアニア			
不動産投信	日々	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。

ファンドの特色

- 1 マザーファンドへの投資を通じて、日本の株式市場に投資します。
- 2 当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。
※ファミリーファンド方式については、「ファンドの仕組み」をご覧ください。
- 3 TOPIX(東証株価指数配当込み)に連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
※TOPIX(東証株価指数配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している株式全銘柄で構成される株価指数で、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。

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(東証株価指数配当込み)

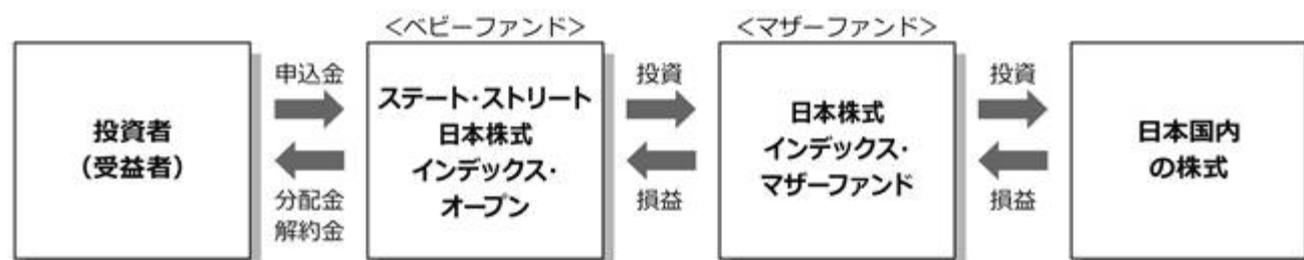
- ① TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。
- ② 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- ③ 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④ 株式会社東京証券取引所は、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、株式会社東京証券取引所は、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、株式会社東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥ 株式会社東京証券取引所は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。
- ⑦ 株式会社東京証券取引所は、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、株式会社東京証券取引所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】

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。



マザーファンドには、当ファンド以外にも、当該マザーファンドに投資する他のファンド（ベビーファンド）があります。

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。



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。

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。

TOPIX（東証株価指数配当込み）をベンチマークとします。

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。

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）の3)4)5)に定めるものに限り、）を行うことができます。

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。

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。

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。

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】

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

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。

委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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

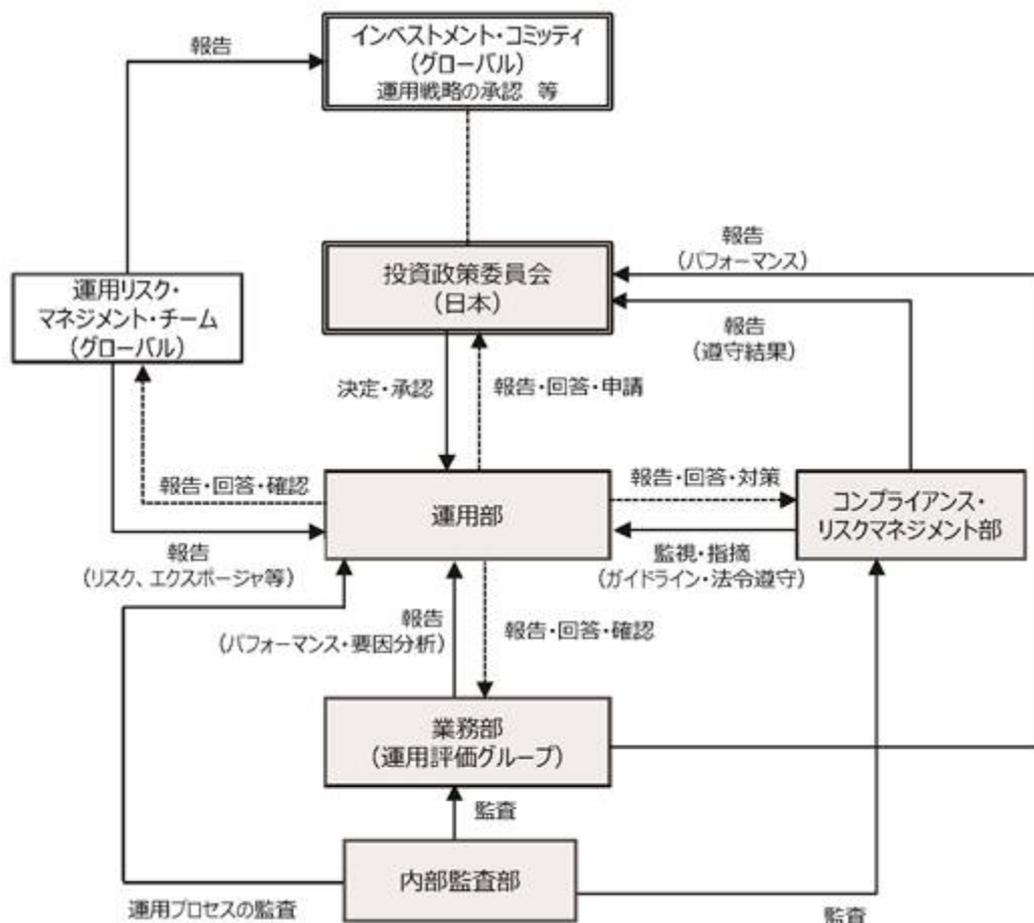
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形

上記の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、上記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)。

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)

上記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】

（信託約款「運用の基本方針」中「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、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

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。

分配金額は委託会社が基準価額水準、市場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。

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。なお、上記は収益分配方針であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

< 収益分配金に関する留意事項 >

- ・ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- ・ 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・ 受益者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全てが、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方が小さかった場合も同様です。

（５）【投資制限】

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。

信託約款上のその他の投資制限

1) 投資する株式等の範囲(信託約款第18条)

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、または取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するもの（上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものを含みます。）とします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。

2) 信用取引の指図範囲(信託約款第19条)

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

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。

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

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。

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。

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。

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、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。）を行うことができます。

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。）および金利先渡取引を行うことができます。

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。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

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

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、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。

委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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

上記 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 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。

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。

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

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行いません。

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。

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。

信用取引の指図は、信託約款第15条の範囲で行います。

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。

スワップ取引は、信託約款第17条の範囲で行います。

金利先渡取引は、信託約款第18条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー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。

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。

株価変動リスク

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、株式の投資に係る価格変動リスクを伴います。一般に、株式の価格は、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。

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。

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り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。

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。

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（参考指数）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。

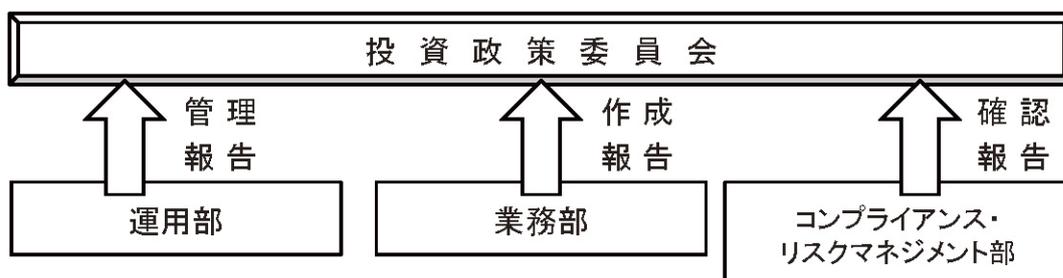
ファミリーファンド方式のリスク

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。

(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。

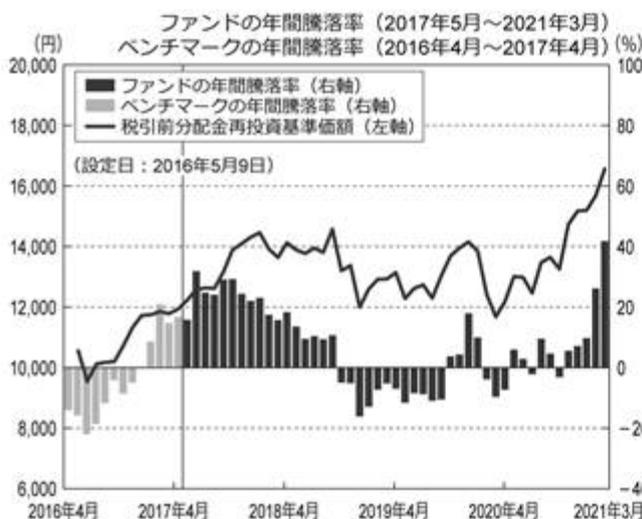
投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をします。

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。

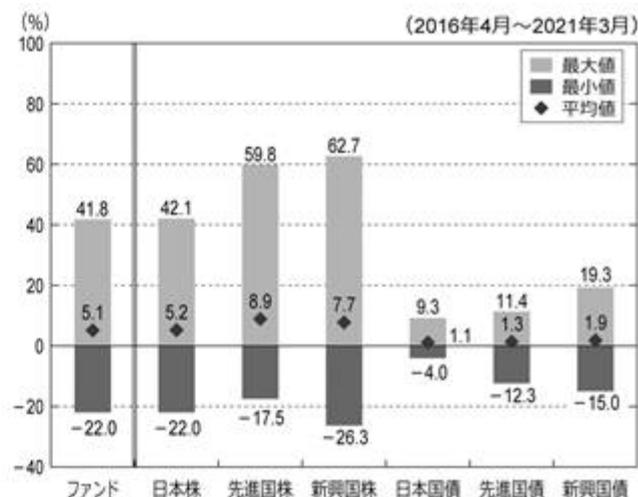
＜参考情報＞代表的な資産クラスと騰落率の比較等

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(ベンチマークの年間騰落率を含みます。)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。なお、ファンドの年間騰落率はベンチマークの年間騰落率(2016年4月～2017年4月)を含みます。
- ・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:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄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東京証券取引所に帰属します。

先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)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、野村證券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、野村證券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、円ベース)

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

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

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)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。

ただし、換金時に信託財産留保額（換金申込受付日の基準価額に0.05%の率を乗じて得た額）が差し引かれます。

(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0.187%（税抜0.17%）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	0.13%	委託した資金の運用の対価
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

（注）マザーファンドで有価証券の貸付の指図を行った場合は、その品貸料のうち当ファンドに属するとみなした額の100分の50以内の額を、別途、信託財産から支払います。

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】

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。

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。

上記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。

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（NISA）、未成年者少額投資非課税制度（ジュニアNISA）をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の投資者に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

< 注1 > 個別元本について

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。

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。

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

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。

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、2021年3月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

(2021年3月31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	9,810,231,105	99.99
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		1,445,053	0.01
純資産総額		9,811,676,158	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<参考情報>

親投資信託受益証券(日本株式インデックス・マザーファンド)

(2021年3月31日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	99,932,089,510	97.19
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		2,894,061,144	2.81
純資産総額		102,826,150,654	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

(2021年3月31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		2,883,242,059	3.2755	9,444,214,211	3.4025	9,810,231,105	99.99
									投資比率:合計	99.99

(注1)投資有価証券は1銘柄です。

(注2)投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	-	99.99
合計		99.99

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

【投資不動産物件】

該当する事項はありません。

【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)

投資有価証券の主要銘柄(上位30銘柄)

(2021年3月31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	377,800	7,969.00	3,010,688,200	8,616.00	3,255,124,800	3.17
2	日本	株式	ソニー	電気機器	233,600	11,215.00	2,619,824,000	11,595.00	2,708,592,000	2.63
3	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	290,300	10,055.00	2,918,966,500	9,330.00	2,708,499,000	2.63
4	日本	株式	キーエンス	電気機器	36,600	51,450.00	1,883,070,000	50,270.00	1,839,882,000	1.79
5	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2,515,700	565.00	1,421,370,500	591.70	1,488,539,690	1.45
6	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	255,200	4,931.00	1,258,391,200	5,401.00	1,378,335,200	1.34
7	日本	株式	任天堂	その他製品	21,300	62,030.00	1,321,239,000	61,810.00	1,316,553,000	1.28
8	日本	株式	信越化学工業	化学	67,500	17,490.00	1,180,575,000	18,610.00	1,256,175,000	1.22
9	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	310,200	3,758.00	1,165,731,600	3,985.00	1,236,147,000	1.20
10	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	428,000	2,761.50	1,181,922,000	2,842.00	1,216,376,000	1.18
11	日本	株式	日本電産	電気機器	89,700	13,295.00	1,192,561,500	13,435.00	1,205,119,500	1.17
12	日本	株式	ダイキン工業	機械	47,500	21,815.00	1,036,212,500	22,320.00	1,060,200,000	1.03
13	日本	株式	第一三共	医薬品	320,100	3,095.00	990,709,500	3,225.00	1,032,322,500	1.00
14	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	21,800	41,480.00	904,264,000	46,790.00	1,020,022,000	0.99
15	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	254,500	3,831.00	974,989,500	4,007.00	1,019,781,500	0.99
16	日本	株式	KDDI	情報・通信業	293,400	3,278.00	961,765,200	3,395.00	996,093,000	0.97
17	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	293,600	3,101.00	910,453,600	3,319.00	974,458,400	0.95
18	日本	株式	村田製作所	電気機器	109,500	9,278.00	1,015,941,000	8,842.00	968,199,000	0.94
19	日本	株式	HOYA	精密機器	73,400	11,880.00	871,992,000	13,005.00	954,567,000	0.93
20	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	256,900	3,329.00	855,220,100	3,587.00	921,500,300	0.90
21	日本	株式	日立製作所	電気機器	179,300	5,245.00	940,428,500	5,004.00	897,217,200	0.87
22	日本	株式	ファナック	電気機器	32,700	25,795.00	843,496,500	26,185.00	856,249,500	0.83
23	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	499,700	1,566.00	782,530,200	1,599.00	799,020,300	0.78
24	日本	株式	S M C	機械	10,900	63,550.00	692,695,000	64,310.00	700,979,000	0.68
25	日本	株式	三菱商事	卸売業	223,600	3,037.00	679,073,200	3,130.00	699,868,000	0.68
26	日本	株式	三井物産	卸売業	298,200	2,286.00	681,685,200	2,302.00	686,456,400	0.67
27	日本	株式	花王	化学	89,300	7,312.00	652,961,600	7,313.00	653,050,900	0.64
28	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	121,900	5,382.00	656,065,800	5,265.00	641,803,500	0.62
29	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	143,700	4,254.00	611,299,800	4,463.00	641,333,100	0.62
30	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	37,900	17,635.00	668,366,500	16,625.00	630,087,500	0.61
投資比率：合計										34.76

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	電気機器	16.96
	情報・通信業	8.95
	化学	7.17
	輸送用機器	7.16
	機械	5.51
	サービス業	5.43
	医薬品	5.35
	銀行業	5.02

卸売業	4.66
小売業	4.58
陸運業	3.32
食料品	3.24
精密機器	2.46
建設業	2.34
その他製品	2.31
不動産業	1.97
保険業	1.80
電気・ガス業	1.33
その他金融業	1.09
ガラス・土石製品	0.81
証券、商品先物取引業	0.76
鉄鋼	0.75
非鉄金属	0.74
金属製品	0.62
ゴム製品	0.59
繊維製品	0.48
空運業	0.45
石油・石炭製品	0.44
パルプ・紙	0.24
海運業	0.23
倉庫・運輸関連業	0.17
鉱業	0.17
水産・農林業	0.09
合 計	97.19

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類及び業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当する事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所等	買建 / 売建	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先 物取引	TOPIX(先物) (2021年6月限)	大阪取引所	買建	143	2,802,504,380	2,794,220,000	2.72

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該取引の評価金額の比率です。

(注2) 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

2021年3月31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： 分配落：	1,118,764,958 1,116,901,209	分配付： 分配落：	1.2006 1.1986
第2期	(2018年 3月 5日)	分配付： 分配落：	3,995,344,822 3,995,344,822	分配付： 分配落：	1.3319 1.3319
第3期	(2019年 3月 5日)	分配付： 分配落：	5,341,336,327 5,341,336,327	分配付： 分配落：	1.2988 1.2988
第4期	(2020年 3月 5日)	分配付： 分配落：	6,210,067,318 6,210,067,318	分配付： 分配落：	1.2444 1.2444
第5期	(2021年 3月 5日)	分配付： 分配落：	9,285,116,835 9,285,116,835	分配付： 分配落：	1.5910 1.5910
2020年 3月末日			4,941,199,254		1.1659
4月末日			4,985,267,069		1.2161
5月末日			5,341,074,840		1.2987
6月末日			5,328,271,940		1.2963
7月末日			5,392,166,995		1.2439
8月末日			7,387,383,536		1.3451
9月末日			7,606,842,323		1.3622
10月末日			7,386,466,113		1.3234
11月末日			8,045,259,622		1.4708
12月末日			8,360,674,492		1.5142
2021年 1月末日			8,560,804,879		1.5174
2月末日			9,063,808,530		1.5647
3月末日			9,811,676,158		1.6535

【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

【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%

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

(4) 【設定及び解約の実績】

計算期間		設定口数(口)	解約口数(口)	発行済口数(口)
第1期	自2016年 5月 9日 至2017年 3月 6日	1,097,585,702	165,710,844	931,874,858
第2期	自2017年 3月 7日 至2018年 3月 5日	2,989,270,154	921,318,659	2,999,826,353
第3期	自2018年 3月 6日 至2019年 3月 5日	2,748,295,843	1,635,702,002	4,112,420,194
第4期	自2019年 3月 6日 至2020年 3月 5日	2,803,938,166	1,925,883,127	4,990,475,233
第5期	自2020年 3月 6日 至2021年 3月 5日	4,249,133,906	3,403,409,841	5,836,199,298

(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。

（参考情報）運用実績

基準価額・純資産の推移

（2021年3月31日現在）



※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	16,535円
純資産総額	9,812百万円

分配の推移

決算期	分配金
第1期（2017年3月6日）	20円
第2期（2018年3月5日）	0円
第3期（2019年3月5日）	0円
第4期（2020年3月5日）	0円
第5期（2021年3月5日）	0円
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	3.17%
2 日本	株式	ソニー	2.63%
3 日本	株式	ソフトバンクグループ	2.63%
4 日本	株式	キーエンス	1.79%
5 日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.45%
6 日本	株式	リクルートホールディングス	1.34%
7 日本	株式	任天堂	1.28%
8 日本	株式	信越化学工業	1.22%
9 日本	株式	武田薬品工業	1.20%
10 日本	株式	日本電信電話	1.18%

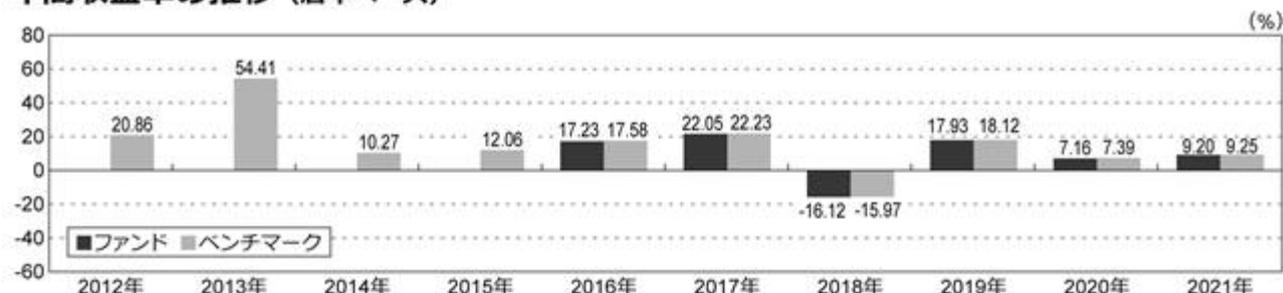
（注）投資比率は、マザーファンド純資産総額に対する各評価金額の比率で、上位10銘柄について記載しています。

＜業種別投資比率＞

	業種	投資比率
1	電気機器	16.96%
2	情報・通信業	8.95%
3	化学	7.17%
4	輸送用機器	7.16%
5	機械	5.51%
6	サービス業	5.43%
7	医薬品	5.35%
8	銀行業	5.02%
9	卸売業	4.66%
10	小売業	4.58%

（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。

※2021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算出しています。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- 1) 当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社に所定の方法で取引口座を開設のうえ、当ファンドの取得申込みを行ってください。
- 2) 当ファンドには、「分配金再投資コース」と「分配金受取コース」があります。なお、取扱い可能なコースおよびコース名については異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。その際、「分配金再投資コース」をお申し込みいただく方は、ご購入に際して、当ファンドに係る「自動けいぞく投資契約」（別の名称で同様の内容を有する契約を含みます。）を販売会社との間で結んでいただきます。ただし、「分配金再投資コース」を申し込まれた場合でも、分配金を定期的に受け取る旨の契約を締結することもできます。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- 3) 当ファンドの取得申込みの申込受付締切時間は、原則として販売会社の営業日の午後3時までとし、この受付時刻を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。
- 4) 申込単位（購入単位）は、販売会社が定める単位にて受付けます。
- 5) 取得申込価額（購入価額）は、取得申込受付日の基準価額です。基準価額は、販売会社または委託会社においてご確認いただけます。基準価額の照会方法については、後記「3 資産管理等の概要（1）資産の評価 3）基準価額の公表」をご参照ください。
- 6) 取得申込代金（購入代金）は、購入価額に取得申込の口数を乗じて得た金額に申込手数料（購入時手数料）および当該手数料に係る消費税等相当額を加えた金額です。
- 7) 購入代金は販売会社が定める期日までにお支払いください。
- 8) 購入時手数料は前記「4 手数料及び税金（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消すことがあります。
- 11) 当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社に取得申込と同時にまたはあらかじめ、当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。販売会社は、当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

2【換金（解約）手続等】

- 1) 受益者（当ファンドの受益権を取得した者）は、自己に帰属する受益権につき、取得申込みを行った販売会社を通じ、委託会社に一部解約の実行の請求を行うことにより、当ファンドを換金することができます。
- 2) 当ファンドの換金申込みの申込受付締切時間は、原則として販売会社の営業日の午後3時までとし、この受付時刻を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。
- 3) 解約単位（換金単位）は、販売会社が定める単位にて受付けます。
- 4) 解約価額（換金価額）は、換金申込受付日の基準価額から信託財産留保額を控除した価額です。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、上記4)の基準価額に0.05%の率を乗じて得た額とします。
上記金額は1口当たりの金額です。換金口数に応じてご負担いただきます。

- 6) 換金代金（換金価額に換金する口数を乗じて得た金額）は、原則として換金申込受付日から起算して5営業日目以降にお支払いします。
- 7) 信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口換金には制限を設ける場合があります。
- 8) 換金申込不可日はありません。
- 9) 取引所における取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更、クーデター等政変、テロリズム、戦争、天災地変等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）があるときは、委託会社の判断により、受益権の換金申込の受付を中止することおよび既に受付けた受益権の換金申込の受け取りを取消すことがあります。
- 10) 換金申込みを行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して、当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

1) 基準価額の算出方法

基準価額とは、算出日において、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公社債を除きます。)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または一部償却原価法*により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」)を、算出日における受益権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1万口当りの価額で表示されます。

*一部償却原価法とは、残存期間1年以内の公社債等について適用するアキュムレーションまたはアモチゼーションによる評価をいいます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
投資信託証券	原則として、基準価額算出日の基準価額で評価します。
株式	原則として、基準価額計算日の取引所の終値で評価します。

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

- 1) 当ファンドの計算期間は、毎年3月6日から翌年3月5日までとすることを原則とします。
- 2) 上記1)の規定にかかわらず、上記1)の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、後記（5）の1）2）3）5）に定める信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

1) 信託契約の解約

- (a) 委託会社は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することによりこの信託の受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合または下回ることが明らかとなった場合、もしくはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- (b) 委託会社は、上記（a）の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドに係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- (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。受託会社は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っ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、併合の事項にあってはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドに係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

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

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

(f) 上記(b)から上記(e)までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

(g) 上記(a)から上記(f)までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、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）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。

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。

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）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。

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。

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使用することができます。

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5期計算期間(2020年3月6日から2021年3月5日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

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4期 (2020年 3月 5日現在)	第5期 (2021年 3月 5日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	131,258	18,667
コール・ローン	61,669,060	56,429,506
親投資信託受益証券	6,209,753,982	9,283,705,193
未収入金	91,770,000	-
流動資産合計	6,363,324,300	9,340,153,366
資産合計		
	6,363,324,300	9,340,153,366
負債の部		
流動負債		
未払解約金	147,026,065	46,981,672
未払受託者報酬	1,038,480	1,342,470
未払委託者報酬	4,846,166	6,264,798
未払利息	170	154
その他未払費用	346,101	447,437
流動負債合計	153,256,982	55,036,531
負債合計	153,256,982	55,036,531
純資産の部		
元本等		
元本	1 4,990,475,233	1 5,836,199,298
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,219,592,085	3,448,917,537
(分配準備積立金)	231,443,337	1,371,381,305
元本等合計	6,210,067,318	9,285,116,835
純資産合計	6,210,067,318	9,285,116,835
負債純資産合計	6,363,324,300	9,340,153,366

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自 2019年 3月 6日 至 2020年 3月 5日	第5期 自 2020年 3月 6日 至 2021年 3月 5日
営業収益		
有価証券売買等損益	297,975,506	1,715,481,211
営業収益合計	297,975,506	1,715,481,211
営業費用		
支払利息	26,918	33,094
受託者報酬	1,930,439	2,250,786
委託者報酬	9,008,573	10,503,585
その他費用	643,835	750,805
営業費用合計	11,609,765	13,538,270
営業利益又は営業損失（ ）	309,585,271	1,701,942,941
経常利益又は経常損失（ ）	309,585,271	1,701,942,941
当期純利益又は当期純損失（ ）	309,585,271	1,701,942,941
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（ ）	40,847,387	127,273,963
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,228,916,133	1,219,592,085
剰余金増加額又は欠損金減少額	915,464,094	1,517,906,237
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	915,464,094	1,517,906,237
剰余金減少額又は欠損金増加額	574,355,484	863,249,763
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	574,355,484	863,249,763
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,219,592,085	3,448,917,537

(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。
-------------------	--

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第4期 (2020年 3月 5日現在)	第5期 (2021年 3月 5日現在)
1 期首元本額	4,112,420,194円	4,990,475,233円
期中追加設定元本額	2,803,938,166円	4,249,133,906円
期中一部解約元本額	1,925,883,127円	3,403,409,841円
2 受益権の総数	4,990,475,233口	5,836,199,298口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第4期 自 2019年 3月 6日 至 2020年 3月 5日	第5期 自 2020年 3月 6日 至 2021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(128,494,165円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(988,148,748円)及び分配準備積立金(102,949,172円)より分配対象収益は1,219,592,085円(1万口当たり2,443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(147,721,463円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,109,910,287円)、収益調整金(2,077,536,232円)及び分配準備積立金(113,749,555円)より分配対象収益は3,448,917,537円(1万口当たり5,909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)

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。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第4期 (2020年 3月 5日現在)	第5期 (2021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	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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4期 (2020年 3月 5日現在)	第5期 (2021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	295,783,586	1,776,450,717
合計	295,783,586	1,776,450,717

(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4期 (2020年 3月 5日現在)	第5期 (2021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)	1.2444円 (12,444円)	1.5910円 (15,910円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額(口)	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	2,836,104,721	9,283,705,193	
合計		2,836,104,721	9,283,705,193	

(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	(2020年 3月 5日現在)	(2021年 3月 5日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		6,293,913	624,279
コール・ローン		2,957,081,673	1,887,127,109
株式		99,664,370,430	98,406,580,570
派生商品評価勘定		3,966,820	24,340
未収配当金		225,820,755	159,127,530
差入委託証拠金		138,375,000	92,610,000
前払金		287,835,000	35,830,000
流動資産合計		103,283,743,591	100,581,923,828
資産合計		103,283,743,591	100,581,923,828
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		148,303,320	24,084,220
未払金		115,382,600	9,939,600
未払解約金		227,770,000	258,224,600
未払利息		8,171	5,150
その他未払費用		2,264	130
流動負債合計		491,466,355	292,253,700
負債合計		491,466,355	292,253,700
純資産の部			
元本等			
元本	1	40,231,347,788	30,638,101,356
剰余金			
剰余金又は欠損金()		62,560,929,448	69,651,568,772
元本等合計		102,792,277,236	100,289,670,128
純資産合計		102,792,277,236	100,289,670,128
負債純資産合計		103,283,743,591	100,581,923,828

(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。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（2020年 3月 5日現在）	（2021年 3月 5日現在）
1 期首元本額	33,368,916,556円	40,231,347,788円
期中追加設定元本額	16,799,288,366円	3,976,601,568円
期中一部解約元本額	9,936,857,134円	13,569,848,000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）	90,166,542円	77,885,317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＞	1,044,557,935円	966,240,070円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	2,548,552円	1,736,309円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	80,834,812円	59,201,981円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	119,168円	105,544円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	4,416,219円	3,015,362円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	8,589,144円	10,367,804円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	6,502,489,355円	5,303,997,623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＞	356,771,929円	303,816,355円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	5,594,540円	2,742,171円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	1,076,097,343円	798,633,669円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	719,657,554円	569,507,231円

バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	55,488,476円	40,187,535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>	171,579,416円	76,524,429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>	14,020,631,814円	8,411,224,876円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	203,904,954円	153,848,868円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	2,259,502,425円	1,874,170,550円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	398,992,260円	298,206,285円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	1,771,195,852円	1,360,705,574円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	53,792,516円	41,571,121円
日本株式インデックス・ファンドF O F<適格機関投資家限定>	4,631,174,569円	4,357,678,397円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	17,501,190円	15,286,865円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	18,727,349円	16,343,562円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	10,468,593円	8,617,886円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	506,387,190円	479,809,477円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	2,373,052円	1,809,379円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	3,262,687円	2,428,007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>	1,417,374,439円	243,957,820円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	328,365,026円	260,283,857円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	1,465,187,140円	1,247,534,323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>	92,231,633円	76,579,661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>	121,997,134円	195,842,569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>	81,234,469円	42,010,156円
ステート・ストリート日本株式インデックス・オープン	2,430,432,087円	2,836,104,721円
世界バランス40VA<適格機関投資家限定>	円	7,076,157円
世界バランス60VA<適格機関投資家限定>	円	47,243,042円

グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	568,014円	504,262円
グローバルバランス４０ＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	249,059,389円	421,913,485円
グローバルバランス４０ＶＡ３＜適格機関投資家限定＞	21,120,180円	16,741,986円
グローバルバランス５０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	6,952,841円	6,647,070円
計	40,231,347,788円	30,638,101,356円
2 受益権の総数	40,231,347,788口	30,638,101,356口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2020年 3月 5日現在)	(2021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	(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。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
	(2)有価証券 売買目的有価証券 「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。	(2)有価証券 売買目的有価証券 同左
	(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。	(3)デリバティブ取引 同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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
	「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。	

(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	(2020年 3月 5日現在)	(2021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	8,335,770,669	19,578,307,502
合計	8,335,770,669	19,578,307,502

(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	(2020年 3月 5日現在)		
		契 約 額 等	時 価	評 価 損 益
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX (先物)	2,418,237,500	2,274,000,000	144,237,500
	合 計	2,418,237,500	2,274,000,000	144,237,500

(単位：円)

区 分	種 類	(2021年 3月 5日現在)		
		契 約 額 等	時 価	評 価 損 益
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX (先物)	1,309,895,000	1,285,880,000	24,015,000
	合 計	1,309,895,000	1,285,880,000	24,015,000

(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)

	(2020年 3月 5日現在)	(2021年 3月 5日現在)
1口当たり純資産額	2.5550円	3.2734円
(1万口当たり純資産額)	(25,550円)	(32,734円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

銘 柄	株数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	1,800	3,105.00	5,589,000	
日本水産	47,500	542.00	25,745,000	
マルハニチロ	7,600	2,717.00	20,649,200	
ハウスイ	600	989.00	593,400	
雪国まいたけ	3,200	1,843.00	5,897,600	
カネコ種苗	1,800	1,600.00	2,880,000	
サカタのタネ	6,200	3,920.00	24,304,000	
ホクト	4,000	2,146.00	8,584,000	
ホクリヨウ	700	677.00	473,900	

ヒノキヤグループ	1,500	2,244.00	3,366,000
ショーボンドホールディングス	7,300	4,690.00	34,237,000
ミライト・ホールディングス	17,800	1,717.00	30,562,600
タマホーム	2,800	1,906.00	5,336,800
サンヨーホームズ	600	819.00	491,400
日本アクア	2,500	595.00	1,487,500
ファーストコーポレーション	1,700	712.00	1,210,400
ベステラ	1,100	1,673.00	1,840,300
TATERU	12,500	176.00	2,200,000
キャンディル	600	531.00	318,600
スペースバリューホールディングス	6,300	787.00	4,958,100
住石ホールディングス	11,700	121.00	1,415,700
日鉄鉱業	1,200	6,510.00	7,812,000
三井松島ホールディングス	2,300	1,036.00	2,382,800
国際石油開発帝石	188,800	811.00	153,116,800
石油資源開発	6,800	2,319.00	15,769,200
K&Oエナジーグループ	2,500	1,443.00	3,607,500
ダイセキ環境ソリューション	1,200	788.00	945,600
第一カッター興業	1,600	1,380.00	2,208,000
明豊ファシリティワークス	1,700	639.00	1,086,300
安藤・間	31,200	838.00	26,145,600
東急建設	15,200	590.00	8,968,000
コムシスホールディングス	18,200	3,160.00	57,512,000
ピーアールホールディングス	5,600	645.00	3,612,000
高松コンストラクショングループ	3,200	2,205.00	7,056,000
東建コーポレーション	1,600	8,900.00	14,240,000
ソネック	700	844.00	590,800
ヤマウラ	2,600	981.00	2,550,600
大成建設	36,900	3,900.00	143,910,000
大林組	118,600	967.00	114,686,200
清水建設	111,000	858.00	95,238,000
飛鳥建設	3,400	1,134.00	3,855,600
長谷工コーポレーション	38,800	1,436.00	55,716,800
松井建設	4,700	726.00	3,412,200
銭高組	600	4,595.00	2,757,000
鹿島建設	86,900	1,439.00	125,049,100
不動テトラ	3,100	1,908.00	5,914,800
大末建設	1,600	913.00	1,460,800
鉄建建設	2,600	1,994.00	5,184,400
西松建設	8,500	2,811.00	23,893,500
三井住友建設	29,100	494.00	14,375,400
大豊建設	2,600	3,815.00	9,919,000
前田建設工業	29,600	971.00	28,741,600
佐田建設	2,600	466.00	1,211,600
ナカノフドー建設	3,500	389.00	1,361,500
奥村組	5,700	2,848.00	16,233,600
東鉄工業	5,200	2,710.00	14,092,000
イチケン	800	2,100.00	1,680,000
富士ピー・エス	2,200	603.00	1,326,600

浅沼組	1,300	4,740.00	6,162,000
戸田建設	49,100	783.00	38,445,300
熊谷組	5,600	3,025.00	16,940,000
北野建設	900	2,499.00	2,249,100
植木組	600	2,910.00	1,746,000
矢作建設工業	5,300	849.00	4,499,700
ピーエス三菱	3,800	703.00	2,671,400
日本ハウスホールディングス	9,000	334.00	3,006,000
大東建託	12,900	11,460.00	147,834,000
新日本建設	5,100	855.00	4,360,500
N I P P O	10,000	2,987.00	29,870,000
東亜道路工業	700	4,300.00	3,010,000
前田道路	7,400	2,185.00	16,169,000
日本道路	1,200	8,200.00	9,840,000
東亜建設工業	3,100	2,406.00	7,458,600
日本国土開発	11,700	575.00	6,727,500
若築建設	2,500	1,370.00	3,425,000
東洋建設	13,400	585.00	7,839,000
五洋建設	48,100	810.00	38,961,000
世紀東急工業	5,700	926.00	5,278,200
福田組	1,400	5,030.00	7,042,000
日本ドライケミカル	1,100	1,570.00	1,727,000
住友林業	27,900	2,057.00	57,390,300
日本基礎技術	3,900	504.00	1,965,600
巴コーポレーション	5,800	394.00	2,285,200
大和ハウス工業	109,500	3,102.00	339,669,000
ライト工業	6,900	1,799.00	12,413,100
積水ハウス	128,600	2,150.00	276,490,000
日特建設	3,600	818.00	2,944,800
北陸電気工事	2,400	1,242.00	2,980,800
ユアテック	6,800	790.00	5,372,000
日本リーテック	2,500	2,450.00	6,125,000
四電工	700	2,907.00	2,034,900
中電工	4,900	2,307.00	11,304,300
関電工	17,200	925.00	15,910,000
きんでん	25,600	1,811.00	46,361,600
東京エネシス	3,900	929.00	3,623,100
トーエネック	1,200	3,765.00	4,518,000
住友電設	3,400	2,471.00	8,401,400
日本電設工業	6,600	1,992.00	13,147,200
協和エクシオ	18,000	2,753.00	49,554,000
新日本空調	3,200	2,340.00	7,488,000
日本工営	2,200	2,831.00	6,228,200
九電工	8,300	3,645.00	30,253,500
三機工業	8,500	1,385.00	11,772,500
日揮ホールディングス	39,500	1,313.00	51,863,500
中外炉工業	1,400	2,100.00	2,940,000
ヤマト	4,500	694.00	3,123,000
太平電業	2,600	2,755.00	7,163,000

高砂熱学工業	9,200	1,682.00	15,474,400
三晃金属工業	500	3,060.00	1,530,000
N E C ネットエスアイ	12,500	1,828.00	22,850,000
朝日工業社	900	3,045.00	2,740,500
明星工業	7,700	810.00	6,237,000
大気社	5,900	2,932.00	17,298,800
ダイダン	2,600	2,851.00	7,412,600
日比谷総合設備	3,900	1,900.00	7,410,000
ニッポン	11,300	1,653.00	18,678,900
日清製粉グループ本社	42,800	1,793.00	76,740,400
日東富士製粉	300	6,890.00	2,067,000
昭和産業	3,200	3,235.00	10,352,000
鳥越製粉	3,400	863.00	2,934,200
中部飼料	4,700	1,449.00	6,810,300
フィード・ワン	5,100	919.00	4,686,900
東洋精糖	900	1,198.00	1,078,200
日本甜菜製糖	2,000	1,675.00	3,350,000
三井製糖	2,900	1,956.00	5,672,400
塩水港精糖	3,900	238.00	928,200
日新製糖	1,800	1,893.00	3,407,400
L I F U L L	12,700	394.00	5,003,800
ミクシィ	7,000	2,620.00	18,340,000
ジェイエイシーリクルートメント	2,400	1,609.00	3,861,600
日本M & Aセンター	29,600	5,750.00	170,200,000
メンバーズ	1,000	2,356.00	2,356,000
中広	500	358.00	179,000
UTグループ	5,200	3,475.00	18,070,000
アイティメディア	1,400	1,774.00	2,483,600
タケエイ	4,100	1,199.00	4,915,900
E・Jホールディングス	1,600	1,015.00	1,624,000
ビーネックスグループ	4,600	1,618.00	7,442,800
コシダカホールディングス	8,700	550.00	4,785,000
アルトナー	600	845.00	507,000
パソナグループ	4,000	1,765.00	7,060,000
C D S	1,000	1,403.00	1,403,000
リンクアンドモチベーション	7,400	518.00	3,833,200
G C A	5,100	760.00	3,876,000
エス・エム・エス	12,300	3,305.00	40,651,500
サニーサイドアップグループ	800	709.00	567,200
パーソルホールディングス	36,100	2,088.00	75,376,800
リニカル	1,900	775.00	1,472,500
クックパッド	12,700	316.00	4,013,200
エスクリ	1,200	480.00	576,000
アイ・ケイ・ケイ	2,500	624.00	1,560,000
森永製菓	8,900	3,850.00	34,265,000
中村屋	1,000	4,070.00	4,070,000
江崎グリコ	10,400	4,510.00	46,904,000
名糖産業	1,800	1,558.00	2,804,400
井村屋グループ	2,200	2,591.00	5,700,200

不二家	2,600	2,276.00	5,917,600
山崎製パン	28,400	1,846.00	52,426,400
第一屋製パン	500	975.00	487,500
モロゾフ	600	5,670.00	3,402,000
亀田製菓	2,200	4,760.00	10,472,000
寿スピリッツ	3,700	7,620.00	28,194,000
カルビー	17,300	2,853.00	49,356,900
森永乳業	7,000	4,900.00	34,300,000
六甲バター	2,500	1,686.00	4,215,000
ヤクルト本社	26,100	5,520.00	144,072,000
明治ホールディングス	25,100	6,930.00	173,943,000
雪印メグミルク	9,300	2,248.00	20,906,400
プリマハム	5,400	3,340.00	18,036,000
日本ハム	14,500	4,840.00	70,180,000
林兼産業	1,200	651.00	781,200
丸大食品	3,700	1,705.00	6,308,500
S Foods	3,100	3,385.00	10,493,500
柿安本店	1,300	2,461.00	3,199,300
伊藤ハム米久ホールディングス	24,900	742.00	18,475,800
学情	1,400	1,410.00	1,974,000
スタジオアリス	1,800	2,044.00	3,679,200
クロスキャット	1,200	1,120.00	1,344,000
シミックホールディングス	2,000	1,608.00	3,216,000
エプロ	1,100	901.00	991,100
システナ	13,500	1,948.00	26,298,000
NJS	800	1,910.00	1,528,000
デジタルアーツ	1,900	9,760.00	18,544,000
日鉄ソリューションズ	5,700	3,275.00	18,667,500
総合警備保障	14,400	4,940.00	71,136,000
キューブシステム	2,200	1,067.00	2,347,400
いちご	42,100	342.00	14,398,200
エイジア	700	1,644.00	1,150,800
日本駐車場開発	37,100	146.00	5,416,600
コア	1,700	1,510.00	2,567,000
カカクコム	26,700	3,265.00	87,175,500
アイロムグループ	1,400	1,782.00	2,494,800
セントケア・ホールディング	2,900	985.00	2,856,500
サイネックス	400	712.00	284,800
ルネサンス	2,400	1,166.00	2,798,400
ディップ	5,000	2,856.00	14,280,000
SBSホールディングス	2,800	2,484.00	6,955,200
デジタルホールディングス	2,500	1,991.00	4,977,500
新日本科学	3,900	624.00	2,433,600
ツクイホールディングス	8,500	923.00	7,845,500
キャリアデザインセンター	1,300	1,013.00	1,316,900
ベネフィット・ワン	13,100	2,832.00	37,099,200
エムスリー	63,800	7,985.00	509,443,000
ツカダ・グローバルホールディング	2,800	328.00	918,400
プラス	200	522.00	104,400

アウトソーシング	20,600	1,614.00	33,248,400
ウェルネット	4,100	521.00	2,136,100
ワールドホールディングス	1,400	2,519.00	3,526,600
ディー・エヌ・エー	15,300	2,064.00	31,579,200
博報堂D Yホールディングス	50,300	1,850.00	93,055,000
ぐるなび	6,300	594.00	3,742,200
タカミヤ	4,200	535.00	2,247,000
ジャパンベストレスキューシステム	3,400	841.00	2,859,400
ファンコミュニケーションズ	10,000	401.00	4,010,000
ライク	900	1,831.00	1,647,900
ビジネス・ブレークスルー	1,800	427.00	768,600
エスプール	9,400	945.00	8,883,000
W D Bホールディングス	1,700	2,522.00	4,287,400
手間いらず	300	4,960.00	1,488,000
ティア	2,300	505.00	1,161,500
C D G	400	1,570.00	628,000
アドウェイズ	4,500	708.00	3,186,000
バリューコマース	2,500	2,865.00	7,162,500
インフォマート	36,500	926.00	33,799,000
サッポロホールディングス	13,200	2,206.00	29,119,200
アサヒグループホールディングス	82,900	4,771.00	395,515,900
麒麟ホールディングス	161,000	2,110.50	339,790,500
宝ホールディングス	28,100	1,457.00	40,941,700
オエノンホールディングス	11,900	404.00	4,807,600
養命酒製造	1,300	1,940.00	2,522,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	29,000	1,873.00	54,317,000
サントリー食品インターナショナル	25,400	3,935.00	99,949,000
ダイドーグループホールディングス	2,000	5,320.00	10,640,000
伊藤園	11,500	6,680.00	76,820,000
キーコーヒー	3,800	2,204.00	8,375,200
ユニカフェ	1,000	1,012.00	1,012,000
ジャパンフーズ	800	1,285.00	1,028,000
日清オイリオグループ	5,000	3,280.00	16,400,000
不二製油グループ本社	9,200	3,015.00	27,738,000
かどや製油	500	4,170.00	2,085,000
J - オイルミルズ	1,700	3,910.00	6,647,000
ローソン	9,400	5,170.00	48,598,000
サンエー	2,800	4,400.00	12,320,000
カワチ薬品	2,600	2,829.00	7,355,400
エービーシー・マート	5,900	6,310.00	37,229,000
ハードオフコーポレーション	1,700	823.00	1,399,100
高千穂交易	1,400	1,250.00	1,750,000
アスクル	3,300	3,315.00	10,939,500
ゲオホールディングス	5,000	1,255.00	6,275,000
アダストリア	5,200	1,959.00	10,186,800
ジーフット	3,200	410.00	1,312,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	800	409.00	327,200
オルパヘルスケアホールディングス	500	1,546.00	773,000
伊藤忠食品	900	5,540.00	4,986,000

くら寿司	2,200	7,420.00	16,324,000
キャンドウ	1,800	1,889.00	3,400,200
エレマテック	3,500	990.00	3,465,000
アイケイ	800	788.00	630,400
パルグループホールディングス	3,200	1,573.00	5,033,600
JALUX	1,100	1,675.00	1,842,500
エディオン	15,700	1,144.00	17,960,800
あらた	3,000	4,660.00	13,980,000
サーラコーポレーション	7,600	597.00	4,537,200
ワッツ	1,800	882.00	1,587,600
トーメンデバイス	500	4,010.00	2,005,000
ハローズ	1,400	2,900.00	4,060,000
J Pホールディングス	11,300	278.00	3,141,400
フジオフードグループ本社	3,100	1,351.00	4,188,100
あみやき亭	900	3,030.00	2,727,000
東京エレクトロン デバイス	1,200	3,670.00	4,404,000
ひらまつ	7,900	183.00	1,445,700
フィールズ	3,500	544.00	1,904,000
双日	205,500	295.00	60,622,500
アルフレッサ ホールディングス	38,600	1,997.00	77,084,200
大黒天物産	900	5,950.00	5,355,000
ハニーズホールディングス	3,300	1,050.00	3,465,000
ファーマライズホールディングス	800	782.00	625,600
キッコーマン	27,300	6,930.00	189,189,000
味の素	90,300	2,236.50	201,955,950
ブルドックソース	1,700	2,696.00	4,583,200
キューピー	21,100	2,411.00	50,872,100
ハウス食品グループ本社	14,200	3,595.00	51,049,000
カゴメ	15,500	3,440.00	53,320,000
焼津水産化学工業	2,000	1,010.00	2,020,000
アリアケジャパン	3,500	6,490.00	22,715,000
ピエトロ	500	1,811.00	905,500
エバラ食品工業	800	2,750.00	2,200,000
やまみ	200	2,125.00	425,000
ニチレイ	18,100	2,878.00	52,091,800
横浜冷凍	9,900	946.00	9,365,400
東洋水産	19,500	4,625.00	90,187,500
イトアンドホールディングス	1,500	1,881.00	2,821,500
大冷	700	1,961.00	1,372,700
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,500	900.00	2,250,000
日清食品ホールディングス	14,900	8,040.00	119,796,000
永谷園ホールディングス	1,900	2,375.00	4,512,500
一正蒲鉾	1,700	1,200.00	2,040,000
フジッコ	4,200	1,998.00	8,391,600
ロック・フィールド	4,100	1,551.00	6,359,100
日本たばこ産業	203,600	1,935.00	393,966,000
ケンコーマヨネーズ	2,100	1,951.00	4,097,100
わらべや日洋ホールディングス	2,500	1,671.00	4,177,500
なとり	2,100	2,043.00	4,290,300

イフジ産業	700	927.00	648,900
ビックスコーポレーション	800	3,330.00	2,664,000
北の達人コーポレーション	13,400	645.00	8,643,000
ユーグレナ	16,700	932.00	15,564,400
スター・マイカ・ホールディングス	2,300	1,236.00	2,842,800
S R Eホールディングス	400	4,425.00	1,770,000
A Dワークスグループ	8,100	157.00	1,271,700
片倉工業	5,000	1,368.00	6,840,000
ゲンゼ	2,800	3,915.00	10,962,000
ヒューリック	79,100	1,173.00	92,784,300
神栄	400	1,330.00	532,000
ラサ商事	2,300	915.00	2,104,500
アルペン	2,900	2,199.00	6,377,100
ハブ	1,300	670.00	871,000
ラクーンホールディングス	1,800	1,820.00	3,276,000
クオールホールディングス	5,000	1,499.00	7,495,000
アルコニックス	4,000	1,759.00	7,036,000
神戸物産	25,700	2,850.00	73,245,000
ソリトンシステムズ	1,800	1,612.00	2,901,600
ジンスホールディングス	2,000	7,580.00	15,160,000
ビックカメラ	22,000	1,195.00	26,290,000
D C Mホールディングス	23,300	1,104.00	25,723,200
ペッパーフードサービス	4,100	272.00	1,115,200
ハイパー	600	516.00	309,600
M o n o t a R O	26,500	6,150.00	162,975,000
東京一番フーズ	700	595.00	416,500
D Dホールディングス	1,600	626.00	1,001,600
あい ホールディングス	5,400	2,069.00	11,172,600
ディーブイエックス	1,200	1,085.00	1,302,000
きちりホールディングス	1,200	610.00	732,000
アークランドサービスホールディングス	3,100	2,068.00	6,410,800
J . フロント リテイリング	44,400	1,081.00	47,996,400
ドトール・日レスホールディングス	5,400	1,691.00	9,131,400
マツモトキヨシホールディングス	15,400	4,900.00	75,460,000
ブロンコビリー	2,000	2,310.00	4,620,000
Z O Z O	21,900	3,320.00	72,708,000
トレジャー・ファクトリー	1,200	883.00	1,059,600
物語コーポレーション	2,000	6,510.00	13,020,000
ココカラファイン	3,300	8,420.00	27,786,000
三越伊勢丹ホールディングス	65,100	783.00	50,973,300
東洋紡	14,900	1,419.00	21,143,100
ユニチカ	10,900	425.00	4,632,500
富士紡ホールディングス	1,800	4,000.00	7,200,000
日清紡ホールディングス	23,600	819.00	19,328,400
倉敷紡績	3,400	1,934.00	6,575,600
ダイワボウホールディングス	3,200	8,100.00	25,920,000
シキボウ	2,300	1,011.00	2,325,300
日東紡績	5,700	4,035.00	22,999,500
トヨタ紡織	11,200	1,734.00	19,420,800

マクニカ・富士エレホールディングス	9,100	2,137.00	19,446,700
H a m e e	900	1,585.00	1,426,500
ラクト・ジャパン	1,600	2,647.00	4,235,200
ウエルシアホールディングス	19,700	3,440.00	67,768,000
クリエイトSDホールディングス	5,600	3,330.00	18,648,000
グリムス	800	1,740.00	1,392,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	7,100	794.00	5,637,400
八洲電機	3,400	965.00	3,281,000
メディアスホールディングス	2,300	831.00	1,911,300
レスターホールディングス	3,900	2,089.00	8,147,100
ジューテックホールディングス	800	1,075.00	860,000
丸善CHIホールディングス	4,600	375.00	1,725,000
大光	1,800	676.00	1,216,800
OCHIホールディングス	1,200	1,375.00	1,650,000
TOKAIホールディングス	18,400	942.00	17,332,800
黒谷	700	776.00	543,200
ミサワ	500	664.00	332,000
ティーライフ	500	1,232.00	616,000
C o m i n i x	800	784.00	627,200
エー・ピーホールディングス	800	476.00	380,800
三洋貿易	3,700	1,124.00	4,158,800
チムニー	1,300	1,400.00	1,820,000
シュッピン	3,000	936.00	2,808,000
ビューティガレージ	700	2,430.00	1,701,000
オイシックス・ラ・大地	3,700	2,556.00	9,457,200
ウイン・パートナーズ	2,700	1,297.00	3,501,900
ネクステージ	6,400	1,656.00	10,598,400
ジョイフル本田	11,100	1,404.00	15,584,400
鳥貴族ホールディングス	1,400	1,707.00	2,389,800
ホットランド	2,800	1,233.00	3,452,400
すかいらくホールディングス	41,700	1,663.00	69,347,100
SFPホールディングス	1,700	1,414.00	2,403,800
綿半ホールディングス	3,000	1,286.00	3,858,000
日本毛織	12,400	965.00	11,966,000
ダイトウボウ	5,000	106.00	530,000
トーア紡コーポレーション	1,400	470.00	658,000
ダイドーリミテッド	5,900	190.00	1,121,000
ヨシックス	600	2,249.00	1,349,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	11,000	1,099.00	12,089,000
三栄建築設計	1,600	1,707.00	2,731,200
野村不動産ホールディングス	22,600	2,501.00	56,522,600
三重交通グループホールディングス	7,500	492.00	3,690,000
サムティ	5,400	1,831.00	9,887,400
ディア・ライフ	5,300	424.00	2,247,200
コーセーアールイー	1,300	607.00	789,100
日本商業開発	2,400	1,644.00	3,945,600
プレサンスコーポレーション	6,200	1,490.00	9,238,000
フィル・カンパニー	700	1,981.00	1,386,700
T H E グローバル社	1,700	253.00	430,100

ハウスコム	400	1,296.00	518,400
日本管理センター	2,200	1,262.00	2,776,400
サンセイランディック	1,600	829.00	1,326,400
エストラスト	600	690.00	414,000
フージャースホールディングス	5,900	669.00	3,947,100
オープンハウス	11,700	4,310.00	50,427,000
東急不動産ホールディングス	101,300	669.00	67,769,700
飯田グループホールディングス	31,100	2,506.00	77,936,600
イーグランド	500	936.00	468,000
ムゲンエステート	2,900	485.00	1,406,500
帝国繊維	4,200	2,237.00	9,395,400
日本コークス工業	35,300	103.00	3,635,900
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,900	1,099.00	2,088,100
ミタチ産業	1,700	592.00	1,006,400
B E E N O S	1,700	2,343.00	3,983,100
あさひ	2,800	1,501.00	4,202,800
日本調剤	2,300	1,755.00	4,036,500
コスモス薬品	3,800	15,400.00	58,520,000
シップヘルスケアホールディングス	6,600	6,010.00	39,666,000
トーエル	1,900	900.00	1,710,000
ソフトクリエイティブホールディングス	1,600	2,337.00	3,739,200
オンリー	500	449.00	224,500
セブン&アイ・ホールディングス	145,800	4,254.00	620,233,200
クリエイティブ・レストランツ・ホールディング	20,400	819.00	16,707,600
明治電機工業	1,100	1,421.00	1,563,100
ツルハホールディングス	8,100	14,060.00	113,886,000
デリカフーズホールディングス	1,400	627.00	877,800
スターティアホールディングス	1,000	1,091.00	1,091,000
サンマルクホールディングス	2,900	1,703.00	4,938,700
フェリシモ	800	1,279.00	1,023,200
トリドールホールディングス	9,400	1,598.00	15,021,200
帝人	34,800	1,941.00	67,546,800
東レ	268,200	696.10	186,694,020
クラレ	58,300	1,222.00	71,242,600
旭化成	245,500	1,157.00	284,043,500
サカイオーベックス	1,100	2,853.00	3,138,300
T O K Y O B A S E	3,300	738.00	2,435,400
稲葉製作所	2,100	1,422.00	2,986,200
宮地エンジニアリンググループ	1,300	2,264.00	2,943,200
トーカロ	9,600	1,339.00	12,854,400
アルファC o	1,300	1,190.00	1,547,000
S U M C O	47,900	2,459.00	117,786,100
川田テクノロジーズ	800	4,750.00	3,800,000
R S T e c h n o l o g i e s	1,200	5,960.00	7,152,000
ジェイテックコーポレーション	300	3,375.00	1,012,500
信和	1,900	837.00	1,590,300
ビーロッド	2,400	655.00	1,572,000
ファーストブラザーズ	1,000	944.00	944,000
ハウスドゥ	2,200	1,101.00	2,422,200

シーアールイー	1,200	1,190.00	1,428,000
プロパティエージェント	800	1,715.00	1,372,000
ケイアイスター不動産	1,200	4,245.00	5,094,000
アグレ都市デザイン	400	892.00	356,800
グッドコムアセット	2,000	1,499.00	2,998,000
ジェイ・エス・ビー	800	3,455.00	2,764,000
テンポイノベーション	1,200	957.00	1,148,400
グローバル・リンク・マネジメント	300	842.00	252,600
住江織物	1,000	2,033.00	2,033,000
日本フェルト	2,000	453.00	906,000
イチカワ	600	1,354.00	812,400
エコナックホールディングス	9,000	96.00	864,000
日東製網	400	1,560.00	624,000
芦森工業	800	1,095.00	876,000
アツギ	3,600	541.00	1,947,600
ウイルプラスホールディングス	400	1,199.00	479,600
J Mホールディングス	2,800	2,020.00	5,656,000
コメダホールディングス	8,300	1,949.00	16,176,700
サツドラホールディングス	500	2,090.00	1,045,000
アレンザホールディングス	2,000	1,242.00	2,484,000
串カツ田中ホールディングス	1,200	1,829.00	2,194,800
パロックジャパンリミテッド	3,200	769.00	2,460,800
クスリのアオキホールディングス	3,400	8,270.00	28,118,000
ダイニック	1,400	819.00	1,146,600
共和レザー	2,500	697.00	1,742,500
ピーバンドットコム	400	770.00	308,000
力の源ホールディングス	2,400	612.00	1,468,800
スシローグローバルホールディングス	20,400	4,530.00	92,412,000
アセンテック	1,000	1,657.00	1,657,000
セーレン	9,300	1,875.00	17,437,500
ソトー	1,600	814.00	1,302,400
東海染工	800	1,129.00	903,200
小松マテーレ	6,100	995.00	6,069,500
ワコールホールディングス	9,400	2,359.00	22,174,600
ホギメディカル	4,300	3,190.00	13,717,000
クラウドシアホールディングス	1,300	284.00	369,200
T S Iホールディングス	12,600	282.00	3,553,200
マツオカコーポレーション	1,200	1,873.00	2,247,600
ワールド	4,800	1,441.00	6,916,800
T I S	37,100	2,271.00	84,254,100
J N Sホールディングス	2,100	597.00	1,253,700
電算システム	1,400	3,045.00	4,263,000
グリー	23,200	568.00	13,177,600
G M Oペパボ	200	5,930.00	1,186,000
コーエーテックモホールディングス	7,600	6,210.00	47,196,000
三菱総合研究所	1,600	4,070.00	6,512,000
ボルテージ	900	494.00	444,600
電算	400	2,580.00	1,032,000
A G S	2,300	826.00	1,899,800

ファインデックス	3,500	1,056.00	3,696,000
ブレインパッド	1,000	5,040.00	5,040,000
K L a b	6,800	820.00	5,576,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	4,500	1,134.00	5,103,000
イーブックイニシアティブジャパン	600	2,417.00	1,450,200
ネクソン	93,800	3,395.00	318,451,000
アイスタイル	10,400	518.00	5,387,200
エムアップホールディングス	900	2,357.00	2,121,300
エイチーム	2,800	1,349.00	3,777,200
エニグモ	3,500	1,155.00	4,042,500
テクノスジャパン	2,800	640.00	1,792,000
e n i s h	2,000	477.00	954,000
コロブラ	12,400	850.00	10,540,000
オルトプラス	2,400	456.00	1,094,400
ブロードリーフ	18,700	520.00	9,724,000
クロス・マーケティンググループ	1,200	400.00	480,000
デジタルハーツホールディングス	1,600	1,403.00	2,244,800
システム情報	2,800	1,030.00	2,884,000
メディアドゥ	1,200	5,880.00	7,056,000
じげん	9,200	434.00	3,992,800
ブイキューブ	2,200	2,489.00	5,475,800
エンカレッジ・テクノロジー	500	626.00	313,000
サイバーリンクス	1,000	1,795.00	1,795,000
ディー・エル・イー	3,700	306.00	1,132,200
フィックスターズ	3,900	955.00	3,724,500
C A R T A H O L D I N G S	1,500	1,527.00	2,290,500
オブティム	2,000	2,835.00	5,670,000
セレス	1,300	3,930.00	5,109,000
S H I F T	1,700	12,350.00	20,995,000
特種東海製紙	2,300	4,910.00	11,293,000
ティーガイア	3,300	1,877.00	6,194,100
セック	600	2,723.00	1,633,800
日本アジアグループ	3,500	1,075.00	3,762,500
テクマトリックス	5,300	1,741.00	9,227,300
プロシップ	1,000	1,313.00	1,313,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	9,100	2,139.00	19,464,900
GMOペイメントゲートウェイ	7,900	13,440.00	106,176,000
ザッパラス	1,600	468.00	748,800
システムリサーチ	1,100	1,828.00	2,010,800
インターネットイニシアティブ	10,100	2,344.00	23,674,400
さくらインターネット	3,900	640.00	2,496,000
ヴィンクス	1,400	1,031.00	1,443,400
GMOグローバルサイン・ホールディングス	800	7,200.00	5,760,000
S R Aホールディングス	2,000	2,580.00	5,160,000
システムインテグレータ	1,500	619.00	928,500
朝日ネット	2,900	782.00	2,267,800
e B A S E	5,000	853.00	4,265,000
アバント	3,500	1,398.00	4,893,000
アドソル日進	1,500	2,728.00	4,092,000

ODKソリューションズ	600	774.00	464,400
フリービット	2,400	926.00	2,222,400
コムチュア	3,500	2,612.00	9,142,000
サイバーコム	900	1,533.00	1,379,700
アステリア	2,600	817.00	2,124,200
アイル	2,000	1,567.00	3,134,000
王子ホールディングス	166,700	686.00	114,356,200
日本製紙	16,700	1,433.00	23,931,100
三菱製紙	4,600	369.00	1,697,400
北越コーポレーション	22,400	528.00	11,827,200
中越パルプ工業	1,800	1,210.00	2,178,000
巴川製紙所	1,200	796.00	955,200
大王製紙	17,800	1,994.00	35,493,200
阿波製紙	1,000	446.00	446,000
マークライnz	1,700	2,219.00	3,772,300
メディカル・データ・ビジョン	4,300	1,883.00	8,096,900
gumi	4,800	864.00	4,147,200
ショーケース	600	865.00	519,000
モバイルファクトリー	1,100	1,021.00	1,123,100
テラスカイ	1,200	3,280.00	3,936,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,700	1,734.00	2,947,800
PCIホールディングス	1,600	1,312.00	2,099,200
パイブドHD	400	1,476.00	590,400
アイピーシー	800	985.00	788,000
ネオジャパン	700	1,657.00	1,159,900
PR TIMES	600	3,055.00	1,833,000
ランドコンピュータ	400	1,118.00	447,200
ダブルスタンダード	600	3,905.00	2,343,000
オープンドア	2,000	2,043.00	4,086,000
マイネット	1,500	752.00	1,128,000
アカツキ	1,300	4,105.00	5,336,500
ベネフィットジャパン	200	1,631.00	326,200
Ubicomホールディングス	800	2,960.00	2,368,000
カナミックネットワーク	3,300	726.00	2,395,800
ノムラシステムコーポレーション	1,200	312.00	374,400
レンゴー	35,800	902.00	32,291,600
トーモク	2,300	1,839.00	4,229,700
ザ・バック	2,800	2,720.00	7,616,000
チェンジ	5,200	3,015.00	15,678,000
シンクロ・フード	1,800	368.00	662,400
オークネット	2,200	1,360.00	2,992,000
キャピタル・アセット・プランニング	500	1,016.00	508,000
セグエグループ	600	1,177.00	706,200
エイトレッド	800	2,185.00	1,748,000
AOI TYO Holdings	4,100	523.00	2,144,300
マクロミル	7,600	896.00	6,809,600
ビーグリー	800	1,322.00	1,057,600
オロ	1,200	3,450.00	4,140,000
ユーザーローカル	300	4,260.00	1,278,000

テモナ	500	824.00	412,000
ニーズウェル	500	635.00	317,500
サインポスト	600	977.00	586,200
昭和電工	28,100	2,919.00	82,023,900
住友化学	291,500	550.00	160,325,000
住友精化	1,700	3,935.00	6,689,500
日産化学	20,400	5,700.00	116,280,000
ラサ工業	1,200	2,067.00	2,480,400
クレハ	3,200	7,160.00	22,912,000
多木化学	1,500	6,170.00	9,255,000
テイカ	2,700	1,504.00	4,060,800
石原産業	6,700	907.00	6,076,900
片倉コープアグリ	1,000	1,360.00	1,360,000
日本曹達	5,100	3,450.00	17,595,000
東ソー	57,200	2,109.00	120,634,800
トクヤマ	10,900	2,609.00	28,438,100
セントラル硝子	7,000	2,323.00	16,261,000
東亜合成	22,500	1,262.00	28,395,000
大阪ソーダ	3,800	2,651.00	10,073,800
関東電化工業	8,900	891.00	7,929,900
デンカ	13,500	4,100.00	55,350,000
イビデン	18,200	4,570.00	83,174,000
信越化学工業	68,500	17,490.00	1,198,065,000
日本カーバイド工業	1,400	1,362.00	1,906,800
堺化学工業	2,400	2,047.00	4,912,800
第一稀元素化学工業	4,000	1,120.00	4,480,000
エア・ウォーター	37,700	1,837.00	69,254,900
日本酸素ホールディングス	30,500	1,963.00	59,871,500
日本化学工業	1,100	3,140.00	3,454,000
東邦アセチレン	700	1,326.00	928,200
日本パーカライジング	19,100	1,132.00	21,621,200
高圧ガス工業	5,900	722.00	4,259,800
チタン工業	500	1,977.00	988,500
四国化成工業	4,800	1,231.00	5,908,800
戸田工業	900	2,062.00	1,855,800
ステラ ケミファ	2,000	3,235.00	6,470,000
保土谷化学工業	1,100	4,630.00	5,093,000
日本触媒	6,800	6,010.00	40,868,000
大日精化工業	3,000	2,456.00	7,368,000
カネカ	9,600	4,535.00	43,536,000
協和キリン	38,000	3,165.00	120,270,000
三菱瓦斯化学	37,100	2,551.00	94,642,100
三井化学	32,000	3,500.00	112,000,000
J S R	37,200	3,355.00	124,806,000
東京応化工業	6,300	6,230.00	39,249,000
大阪有機化学工業	3,500	3,385.00	11,847,500
三菱ケミカルホールディングス	247,600	785.50	194,489,800
K Hネオケム	6,200	2,512.00	15,574,400
ダイセル	47,300	823.00	38,927,900

住友ベークライト	5,900	4,350.00	25,665,000
積水化学工業	78,300	2,024.00	158,479,200
日本ゼオン	33,400	1,607.00	53,673,800
アイカ工業	10,300	3,895.00	40,118,500
宇部興産	18,700	2,272.00	42,486,400
積水樹脂	6,100	2,060.00	12,566,000
タキロンシーアイ	8,100	690.00	5,589,000
旭有機材	2,300	1,498.00	3,445,400
ニチバン	1,900	1,948.00	3,701,200
リケンテクノス	9,100	527.00	4,795,700
大倉工業	1,700	1,990.00	3,383,000
積水化成品工業	5,900	568.00	3,351,200
群栄化学工業	1,000	2,524.00	2,524,000
タイガースポリマー	2,100	460.00	966,000
ミライアル	1,300	1,215.00	1,579,500
ダイキアクシス	1,300	917.00	1,192,100
ダイキョーニシカワ	7,900	787.00	6,217,300
竹本容器	1,400	838.00	1,173,200
森六ホールディングス	2,000	2,247.00	4,494,000
恵和	100	2,044.00	204,400
日本化薬	23,400	1,081.00	25,295,400
カーリットホールディングス	4,400	696.00	3,062,400
E P Sホールディングス	4,900	1,107.00	5,424,300
ソルクシーズ	1,500	918.00	1,377,000
レグス	900	1,515.00	1,363,500
プレステージ・インターナショナル	13,800	756.00	10,432,800
フェイス	1,700	803.00	1,365,100
プロトコーポレーション	3,300	1,155.00	3,811,500
ハイマックス	1,440	1,225.00	1,764,000
アミューズ	2,000	2,660.00	5,320,000
野村総合研究所	67,700	3,220.00	217,994,000
ドリームインキュベータ	1,300	1,152.00	1,497,600
サイバネットシステム	2,600	799.00	2,077,400
クイック	2,600	1,184.00	3,078,400
T A C	2,500	251.00	627,500
C Eホールディングス	2,100	516.00	1,083,600
日本システム技術	500	1,530.00	765,000
電通グループ	40,600	3,855.00	156,513,000
インテージホールディングス	4,700	1,251.00	5,879,700
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,600	889.00	1,422,400
東邦システムサイエンス	1,300	925.00	1,202,500
びあ	1,000	3,125.00	3,125,000
イオンファンタジー	1,500	2,292.00	3,438,000
ソースネクスト	17,700	310.00	5,487,000
シーティーエス	4,500	850.00	3,825,000
ネクシーズグループ	1,500	1,049.00	1,573,500
インフォコム	3,400	2,703.00	9,190,200
メディカルシステムネットワーク	3,100	747.00	2,315,700
日本精化	3,000	1,497.00	4,491,000

扶桑化学工業	3,000	3,835.00	11,505,000
トリケミカル研究所	3,200	3,675.00	11,760,000
HEROZ	600	3,055.00	1,833,000
ラクスル	3,000	3,575.00	10,725,000
I P S	700	3,160.00	2,212,000
F I G	4,900	263.00	1,288,700
システムサポート	1,000	1,515.00	1,515,000
A D E K A	17,000	2,055.00	34,935,000
日油	13,900	5,500.00	76,450,000
ミヨシ油脂	1,600	1,194.00	1,910,400
新日本理化	6,200	263.00	1,630,600
ハリマ化成グループ	3,000	928.00	2,784,000
イーソル	2,400	1,234.00	2,961,600
アルテリア・ネットワークス	4,100	1,582.00	6,486,200
E d u L a b	400	7,190.00	2,876,000
東海ソフト	200	1,130.00	226,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	600	1,970.00	1,182,000
サーバーワークス	200	4,315.00	863,000
東名	200	1,172.00	234,400
ヴィッツ	200	2,086.00	417,200
トピラシステムズ	500	1,469.00	734,500
S a n s a n	2,500	9,370.00	23,425,000
L i n k - U	300	1,329.00	398,700
ギフティ	1,700	3,970.00	6,749,000
花王	90,600	7,312.00	662,467,200
第一工業製薬	1,400	3,650.00	5,110,000
石原ケミカル	1,100	2,235.00	2,458,500
日華化学	1,200	879.00	1,054,800
ニイタカ	900	2,532.00	2,278,800
三洋化成工業	2,200	5,460.00	12,012,000
ベース	300	5,360.00	1,608,000
武田薬品工業	314,800	3,758.00	1,183,018,400
アステラス製薬	328,000	1,734.00	568,752,000
大日本住友製薬	28,000	1,783.00	49,924,000
塩野義製薬	47,600	5,460.00	259,896,000
わかもと製薬	4,300	247.00	1,062,100
あすか製薬	4,400	1,380.00	6,072,000
日本新薬	10,700	7,330.00	78,431,000
バイオフェルミン製薬	700	2,508.00	1,755,600
中外製薬	118,300	4,504.00	532,823,200
科研製薬	6,600	4,245.00	28,017,000
エーザイ	41,800	7,255.00	303,259,000
理研ビタミン	3,600	1,355.00	4,878,000
ロート製薬	18,000	2,890.00	52,020,000
小野薬品工業	86,900	2,768.00	240,539,200
久光製薬	11,000	6,800.00	74,800,000
有機合成薬品工業	3,000	285.00	855,000
持田製薬	5,200	4,140.00	21,528,000
参天製薬	65,800	1,381.00	90,869,800

扶桑薬品工業	1,300	2,590.00	3,367,000
日本ケミファ	400	2,272.00	908,800
ツムラ	12,000	3,480.00	41,760,000
日医工	10,900	938.00	10,224,200
テルモ	116,000	4,026.00	467,016,000
H.U.グループホールディングス	10,100	3,280.00	33,128,000
キッセイ薬品工業	6,800	2,219.00	15,089,200
生化学工業	6,600	1,029.00	6,791,400
栄研化学	6,800	2,085.00	14,178,000
日水製薬	1,800	981.00	1,765,800
鳥居薬品	2,400	2,944.00	7,065,600
JCRファーマ	10,600	3,720.00	39,432,000
東和薬品	4,900	2,240.00	10,976,000
富士製薬工業	2,500	1,264.00	3,160,000
沢井製薬	7,900	4,945.00	39,065,500
ゼリア新薬工業	7,000	2,048.00	14,336,000
第一三共	324,800	3,095.00	1,005,256,000
キョーリン製薬ホールディングス	8,500	1,936.00	16,456,000
大幸薬品	4,700	1,229.00	5,776,300
ダイト	2,500	3,355.00	8,387,500
大塚ホールディングス	78,600	4,377.00	344,032,200
大正製薬ホールディングス	9,000	6,820.00	61,380,000
ペプチドリーム	19,500	4,885.00	95,257,500
大日本塗料	4,200	907.00	3,809,400
日本ペイントホールディングス	30,600	8,110.00	248,166,000
関西ペイント	41,600	2,779.00	115,606,400
神東塗料	2,000	199.00	398,000
中国塗料	8,800	959.00	8,439,200
日本特殊塗料	3,100	1,085.00	3,363,500
藤倉化成	5,900	529.00	3,121,100
太陽ホールディングス	2,800	5,750.00	16,100,000
DIC	15,600	2,807.00	43,789,200
サカタインクス	8,200	1,097.00	8,995,400
東洋インキS Cホールディングス	8,000	1,999.00	15,992,000
T & K TOKA	3,400	846.00	2,876,400
アルプス技研	3,200	2,030.00	6,496,000
サニックス	7,100	294.00	2,087,400
ダイオーズ	700	976.00	683,200
日本空調サービス	3,800	742.00	2,819,600
オリエンタルランド	38,400	17,635.00	677,184,000
フォーカスシステムズ	2,700	936.00	2,527,200
ダスキン	8,500	2,839.00	24,131,500
パーク24	20,000	2,218.00	44,360,000
明光ネットワークジャパン	5,000	557.00	2,785,000
ファルコホールディングス	2,000	1,560.00	3,120,000
クレスコ	2,500	1,510.00	3,775,000
フジ・メディア・ホールディングス	36,600	1,364.00	49,922,400
秀英予備校	1,000	434.00	434,000
田谷	800	569.00	455,200

ラウンドワン	10,200	1,084.00	11,056,800
リゾートトラスト	16,500	1,829.00	30,178,500
オービック	11,700	18,690.00	218,673,000
ジャストシステム	5,300	5,880.00	31,164,000
TDCソフト	3,200	964.00	3,084,800
Zホールディングス	509,900	601.40	306,653,860
ビー・エム・エル	4,700	3,565.00	16,755,500
ワタベウェディング	400	330.00	132,000
トレンドマイクロ	19,800	5,130.00	101,574,000
りらいあコミュニケーションズ	5,400	1,442.00	7,786,800
IDホールディングス	1,600	1,246.00	1,993,600
リソー教育	16,600	314.00	5,212,400
日本オラクル	7,500	11,320.00	84,900,000
早稲田アカデミー	1,700	978.00	1,662,600
アルファシステムズ	1,000	3,700.00	3,700,000
フューチャー	4,500	1,787.00	8,041,500
CAC Holdings	2,700	1,403.00	3,788,100
SBテクノロジー	1,500	3,010.00	4,515,000
トーセ	1,300	814.00	1,058,200
ユー・エス・エス	40,400	1,973.00	79,709,200
オービックビジネスコンサルタント	3,800	6,070.00	23,066,000
伊藤忠テクノソリューションズ	16,900	3,255.00	55,009,500
アイティフォー	4,500	826.00	3,717,000
東京個別指導学院	1,200	611.00	733,200
東計電算	500	4,160.00	2,080,000
サイバーエージェント	22,300	6,680.00	148,964,000
楽天	168,400	1,148.00	193,323,200
エクスネット	500	1,019.00	509,500
クリーク・アンド・リバー社	2,300	1,276.00	2,934,800
モーニングスター	4,300	463.00	1,990,900
テー・オー・ダブリュー	6,800	297.00	2,019,600
大塚商会	20,100	4,750.00	95,475,000
サイボウズ	4,400	2,245.00	9,878,000
山田コンサルティンググループ	2,400	992.00	2,380,800
セントラルスポーツ	1,300	2,472.00	3,213,600
パラカ	1,100	1,634.00	1,797,400
電通国際情報サービス	4,600	3,750.00	17,250,000
ACCESS	4,100	803.00	3,292,300
デジタルガレージ	6,200	3,945.00	24,459,000
EMシステムズ	5,300	830.00	4,399,000
ウェザーニューズ	1,100	4,940.00	5,434,000
CIJ	2,500	862.00	2,155,000
ビジネスエンジニアリング	500	3,305.00	1,652,500
日本エンタープライズ	4,000	242.00	968,000
WOWOW	1,800	2,846.00	5,122,800
スカラ	2,900	725.00	2,102,500
インテリジェント ウェイブ	2,600	655.00	1,703,000
フルキャストホールディングス	3,200	1,893.00	6,057,600
エン・ジャパン	6,400	3,135.00	20,064,000

富士フイルムホールディングス	66,500	6,127.00	407,445,500
コニカミノルタ	76,600	563.00	43,125,800
資生堂	75,200	8,128.00	611,225,600
ライオン	49,100	2,191.00	107,578,100
高砂香料工業	2,400	2,557.00	6,136,800
マンダム	7,900	1,844.00	14,567,600
ミルボン	5,000	6,130.00	30,650,000
ファンケル	13,800	3,900.00	53,820,000
コーセー	7,100	17,750.00	126,025,000
コタ	2,100	1,726.00	3,624,600
シーボン	700	2,046.00	1,432,200
ポーラ・オルビスホールディングス	16,100	2,502.00	40,282,200
ノエビアホールディングス	3,300	4,975.00	16,417,500
アジュバンコスメジャパン	800	1,144.00	915,200
新日本製薬	800	2,264.00	1,811,200
エステー	2,400	1,920.00	4,608,000
アグロ カネショウ	1,400	1,593.00	2,230,200
コニシ	6,300	1,712.00	10,785,600
長谷川香料	6,600	1,967.00	12,982,200
星光PMC	2,100	746.00	1,566,600
小林製薬	10,600	10,230.00	108,438,000
荒川化学工業	3,400	1,267.00	4,307,800
メック	2,600	2,105.00	5,473,000
日本高純度化学	1,200	2,800.00	3,360,000
タカラバイオ	9,900	2,738.00	27,106,200
JCU	4,200	3,640.00	15,288,000
新田ゼラチン	2,500	697.00	1,742,500
OATアグリオ	800	1,433.00	1,146,400
デクセリアルズ	10,000	1,655.00	16,550,000
アース製薬	2,900	6,220.00	18,038,000
北興化学工業	3,500	986.00	3,451,000
大成ラミック	1,200	2,902.00	3,482,400
クマイ化学工業	15,900	913.00	14,516,700
日本農薬	6,700	524.00	3,510,800
富士興産	1,400	1,291.00	1,807,400
ニチレキ	4,500	1,558.00	7,011,000
ユシロ化学工業	2,500	1,133.00	2,832,500
ビービー・カストロール	1,500	1,251.00	1,876,500
富士石油	8,700	229.00	1,992,300
MORESCO	1,300	1,084.00	1,409,200
出光興産	42,000	2,814.00	118,188,000
ENEOSホールディングス	569,000	491.70	279,777,300
コスモエネルギーホールディングス	11,200	2,640.00	29,568,000
横浜ゴム	21,900	1,881.00	41,193,900
TOYO TIRE	19,900	1,971.00	39,222,900
ブリヂストン	100,600	4,368.00	439,420,800
住友ゴム工業	33,900	1,201.00	40,713,900
藤倉コンポジット	3,100	475.00	1,472,500
オカモト	2,300	4,180.00	9,614,000

アキレス	2,600	1,477.00	3,840,200
フコク	1,700	719.00	1,222,300
ニッタ	3,900	2,487.00	9,699,300
クリエートメディック	1,400	982.00	1,374,800
住友理工	7,400	676.00	5,002,400
三ツ星ベルト	4,500	1,707.00	7,681,500
バンドー化学	6,700	746.00	4,998,200
A G C	34,700	4,255.00	147,648,500
日本板硝子	18,300	592.00	10,833,600
石塚硝子	800	1,997.00	1,597,600
有沢製作所	5,200	1,012.00	5,262,400
日本山村硝子	1,500	940.00	1,410,000
日本電気硝子	14,000	2,488.00	34,832,000
オハラ	1,600	2,010.00	3,216,000
住友大阪セメント	6,800	3,550.00	24,140,000
太平洋セメント	22,400	2,693.00	60,323,200
リソルホールディングス	500	4,185.00	2,092,500
日本ヒューム	3,300	775.00	2,557,500
日本コンクリート工業	9,500	409.00	3,885,500
三谷セキサン	1,800	4,205.00	7,569,000
アジアパイルホールディングス	5,900	506.00	2,985,400
東海カーボン	36,900	1,622.00	59,851,800
日本カーボン	2,100	4,080.00	8,568,000
東洋炭素	2,200	1,975.00	4,345,000
ノリタケカンパニーリミテド	2,100	3,855.00	8,095,500
T O T O	27,000	6,310.00	170,370,000
日本碍子	41,600	1,982.00	82,451,200
日本特殊陶業	28,700	1,923.00	55,190,100
ダントーホールディングス	3,000	378.00	1,134,000
M A R U W A	1,300	10,670.00	13,871,000
品川リフラクトリーズ	800	2,746.00	2,196,800
黒崎播磨	700	4,655.00	3,258,500
ヨータイ	2,600	1,022.00	2,657,200
イソライト工業	2,100	648.00	1,360,800
東京窯業	5,300	327.00	1,733,100
ニッカトー	1,900	735.00	1,396,500
フジミインコーポレーテッド	3,000	3,805.00	11,415,000
クニミネ工業	1,100	1,268.00	1,394,800
エーアンドエーマテリアル	800	1,070.00	856,000
ニチアス	9,700	2,706.00	26,248,200
日本製鉄	178,600	1,701.50	303,887,900
神戸製鋼所	68,300	707.00	48,288,100
中山製鋼所	5,700	405.00	2,308,500
合同製鐵	2,000	2,058.00	4,116,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	108,200	1,198.00	129,623,600
東京製鐵	14,800	744.00	11,011,200
共英製鋼	4,300	1,460.00	6,278,000
大和工業	8,100	2,718.00	22,015,800
東京鐵鋼	1,400	1,961.00	2,745,400

大阪製鐵	2,200	1,307.00	2,875,400
淀川製鋼所	5,100	2,399.00	12,234,900
丸一鋼管	12,100	2,399.00	29,027,900
モリ工業	1,300	2,350.00	3,055,000
大同特殊鋼	6,100	4,560.00	27,816,000
日本高周波鋼業	1,400	353.00	494,200
日本冶金工業	3,100	2,073.00	6,426,300
山陽特殊製鋼	2,500	1,627.00	4,067,500
愛知製鋼	2,100	3,160.00	6,636,000
日立金属	35,200	1,755.00	61,776,000
日本金属	1,000	1,040.00	1,040,000
大平洋金属	2,600	2,130.00	5,538,000
新日本電工	24,400	285.00	6,954,000
栗本鐵工所	1,800	1,735.00	3,123,000
虹技	500	1,186.00	593,000
日本鑄鉄管	300	1,394.00	418,200
日本製鋼所	11,300	2,620.00	29,606,000
三菱製鋼	3,100	784.00	2,430,400
日亜鋼業	6,000	295.00	1,770,000
日本精線	500	3,480.00	1,740,000
エンビプロ・ホールディングス	1,700	789.00	1,341,300
大紀アルミニウム工業所	6,200	859.00	5,325,800
日本軽金属ホールディングス	9,600	2,132.00	20,467,200
三井金属鉱業	10,100	3,605.00	36,410,500
東邦亜鉛	2,100	2,270.00	4,767,000
三菱マテリアル	24,700	2,474.00	61,107,800
住友金属鉱山	47,800	4,654.00	222,461,200
DOWAホールディングス	9,400	4,255.00	39,997,000
古河機械金属	6,100	1,365.00	8,326,500
エス・サイエンス	19,300	46.00	887,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	3,900	810.00	3,159,000
東邦チタニウム	6,700	917.00	6,143,900
UACJ	5,800	2,580.00	14,964,000
CKサンエツ	900	3,810.00	3,429,000
古河電気工業	11,600	2,834.00	32,874,400
住友電気工業	130,500	1,674.50	218,522,250
フジクラ	46,100	537.00	24,755,700
昭和電線ホールディングス	3,600	1,660.00	5,976,000
東京特殊電線	600	2,611.00	1,566,600
タツタ電線	6,400	617.00	3,948,800
カナレ電気	700	1,705.00	1,193,500
平河ヒューテック	1,800	1,174.00	2,113,200
リョービ	4,600	1,378.00	6,338,800
アーレスティ	5,700	399.00	2,274,300
アサヒホールディングス	6,700	3,950.00	26,465,000
東洋製罐グループホールディングス	23,800	1,377.00	32,772,600
ホッカインホールディングス	1,800	1,464.00	2,635,200
コロナ	2,400	943.00	2,263,200
横河ブリッジホールディングス	6,400	1,950.00	12,480,000

OSJBホールディングス	18,800	272.00	5,113,600
駒井ハルテック	800	2,006.00	1,604,800
高田機工	300	2,708.00	812,400
三和ホールディングス	35,200	1,379.00	48,540,800
文化シャッター	11,200	1,018.00	11,401,600
三協立山	5,400	817.00	4,411,800
アルインコ	3,000	996.00	2,988,000
東洋シャッター	1,500	655.00	982,500
LIXIL	51,500	2,934.00	151,101,000
日本ファイルコン	3,200	506.00	1,619,200
ノーリツ	7,900	1,675.00	13,232,500
長府製作所	3,900	2,138.00	8,338,200
リンナイ	7,300	11,160.00	81,468,000
ユニプレス	6,100	1,006.00	6,136,600
ダイニチ工業	2,000	816.00	1,632,000
日東精工	4,600	569.00	2,617,400
三洋工業	700	1,830.00	1,281,000
岡部	7,600	787.00	5,981,200
ジーテクト	4,700	1,439.00	6,763,300
東プレ	7,100	1,607.00	11,409,700
高周波熱錬	8,100	556.00	4,503,600
東京製綱	2,900	1,309.00	3,796,100
サンコール	2,100	475.00	997,500
モリテック スチール	2,800	401.00	1,122,800
パイオラックス	5,600	1,636.00	9,161,600
エイチワン	4,000	757.00	3,028,000
日本発條	37,200	821.00	30,541,200
中央発條	600	3,665.00	2,199,000
アドバネクス	600	1,590.00	954,000
三浦工業	16,200	5,540.00	89,748,000
タクマ	12,900	2,299.00	29,657,100
テクノプロ・ホールディングス	7,200	7,750.00	55,800,000
アトラ	700	339.00	237,300
インターワークス	700	389.00	272,300
アイ・アールジャパンホールディングス	1,500	12,600.00	18,900,000
Keeper 技研	2,300	1,918.00	4,411,400
ファーストロジック	400	746.00	298,400
三機サービス	800	1,037.00	829,600
Gunosy	2,700	766.00	2,068,200
デザインワン・ジャパン	600	249.00	149,400
イー・ガーディアン	1,600	2,805.00	4,488,000
リブセンス	2,500	234.00	585,000
ジャパンマテリアル	11,300	1,333.00	15,062,900
ベクトル	4,500	1,095.00	4,927,500
ウチヤマホールディングス	2,400	385.00	924,000
チャーム・ケア・コーポレーション	2,600	1,265.00	3,289,000
キャリアリンク	1,200	2,055.00	2,466,000
IBJ	2,900	1,059.00	3,071,100
アサンテ	1,600	1,756.00	2,809,600

N・フィールド	2,400	1,197.00	2,872,800
バリューHR	1,600	1,590.00	2,544,000
M&Aキャピタルパートナーズ	3,000	4,630.00	13,890,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,400	1,637.00	2,291,800
E R Iホールディングス	900	600.00	540,000
アビスト	600	2,918.00	1,750,800
シグマクシス	1,900	1,603.00	3,045,700
ウィルグループ	2,600	930.00	2,418,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	5,000	299.00	1,495,000
メドピア	1,700	5,620.00	9,554,000
レアジョブ	300	2,015.00	604,500
リクルートホールディングス	259,000	4,931.00	1,277,129,000
エラン	5,000	1,314.00	6,570,000
ツガミ	7,900	1,516.00	11,976,400
オークマ	4,300	6,150.00	26,445,000
芝浦機械	3,800	2,929.00	11,130,200
アマダ	54,800	1,321.00	72,390,800
アイダエンジニアリング	9,900	914.00	9,048,600
滝澤鉄工所	1,000	1,042.00	1,042,000
F U J I	14,900	2,590.00	38,591,000
牧野フライス製作所	4,500	4,080.00	18,360,000
オーエスジー	18,400	1,922.00	35,364,800
ダイジェット工業	400	1,359.00	543,600
旭ダイヤモンド工業	9,800	531.00	5,203,800
D M G 森精機	23,600	1,673.00	39,482,800
ソディック	8,200	1,005.00	8,241,000
ディスコ	5,100	32,850.00	167,535,000
日東工器	2,000	1,872.00	3,744,000
日進工具	1,500	2,780.00	4,170,000
パンチ工業	4,000	519.00	2,076,000
富士ダイス	2,400	657.00	1,576,800
土木管理総合試験所	1,200	361.00	433,200
ネットマーケティング	1,300	566.00	735,800
日本郵政	273,400	945.70	258,554,380
ベルシステム24ホールディングス	6,100	1,794.00	10,943,400
鎌倉新書	3,200	854.00	2,732,800
S M N	400	760.00	304,000
一蔵	400	395.00	158,000
L I T A L I C O	1,200	3,545.00	4,254,000
グローバルキッズCOMPANY	400	848.00	339,200
エアトリ	2,200	1,997.00	4,393,400
アトラエ	1,100	2,968.00	3,264,800
ストライク	1,400	4,550.00	6,370,000
ソラスト	9,000	1,361.00	12,249,000
セラク	1,300	1,628.00	2,116,400
インソース	3,000	2,281.00	6,843,000
豊田自動織機	30,600	9,420.00	288,252,000
豊和工業	2,300	840.00	1,932,000
O K K	2,200	451.00	992,200

石川製作所	900	1,658.00	1,492,200
東洋機械金属	2,800	447.00	1,251,600
津田駒工業	800	895.00	716,000
エンシュウ	1,100	930.00	1,023,000
島精機製作所	5,400	2,364.00	12,765,600
オプトラン	4,800	2,447.00	11,745,600
N C ホールディングス	1,100	660.00	726,000
イワキポンプ	2,900	850.00	2,465,000
フリー	3,700	1,091.00	4,036,700
ヤマシンフィルタ	7,400	817.00	6,045,800
日阪製作所	4,600	859.00	3,951,400
やまびこ	7,400	1,165.00	8,621,000
平田機工	1,800	6,490.00	11,682,000
ベガサスミシン製造	4,500	445.00	2,002,500
マルマエ	1,700	1,232.00	2,094,400
タツモ	1,900	1,517.00	2,882,300
ナプテスコ	22,000	4,565.00	100,430,000
三井海洋開発	4,000	1,926.00	7,704,000
レオン自動機	3,700	1,102.00	4,077,400
S M C	11,100	63,550.00	705,405,000
ホソカワミクロン	1,300	6,580.00	8,554,000
ユニオンツール	1,400	3,395.00	4,753,000
オイレス工業	4,900	1,667.00	8,168,300
日精エー・エス・ピー機械	1,100	5,230.00	5,753,000
サトーホールディングス	4,900	2,628.00	12,877,200
技研製作所	3,400	4,885.00	16,609,000
日本エアーテック	1,400	1,204.00	1,685,600
カワタ	1,300	855.00	1,111,500
日精樹脂工業	2,800	939.00	2,629,200
オカダアイヨン	1,200	1,239.00	1,486,800
ワイエイシイホールディングス	1,700	881.00	1,497,700
小松製作所	171,400	3,275.00	561,335,000
住友重機械工業	21,600	3,025.00	65,340,000
日立建機	17,700	3,390.00	60,003,000
日工	5,200	724.00	3,764,800
巴工業	1,500	2,074.00	3,111,000
井関農機	3,800	1,594.00	6,057,200
T O W A	3,500	1,963.00	6,870,500
丸山製作所	800	1,699.00	1,359,200
北川鉄工所	2,000	1,501.00	3,002,000
シンニッタン	4,100	245.00	1,004,500
ローツェ	1,700	7,240.00	12,308,000
タカキタ	1,300	672.00	873,600
クボタ	198,700	2,378.50	472,607,950
荏原実業	900	4,815.00	4,333,500
東洋エンジニアリング	5,500	606.00	3,333,000
三菱化工機	1,200	2,822.00	3,386,400
月島機械	7,100	1,282.00	9,102,200
帝国電機製作所	2,600	1,235.00	3,211,000

東京機械製作所	1,300	314.00	408,200
新東工業	9,100	771.00	7,016,100
澁谷工業	3,400	3,400.00	11,560,000
アイチ コーポレーション	6,600	903.00	5,959,800
小森コーポレーション	9,700	757.00	7,342,900
鶴見製作所	2,900	1,745.00	5,060,500
住友精密工業	700	2,089.00	1,462,300
日本ギア工業	1,200	306.00	367,200
酒井重工業	800	2,126.00	1,700,800
荏原製作所	15,700	4,185.00	65,704,500
石井鐵工所	500	2,953.00	1,476,500
西島製作所	3,800	827.00	3,142,600
北越工業	3,900	1,081.00	4,215,900
ダイキン工業	48,200	21,815.00	1,051,483,000
オルガノ	1,200	6,280.00	7,536,000
トーヨーカネツ	1,600	2,794.00	4,470,400
栗田工業	20,500	4,425.00	90,712,500
椿本チエイン	5,500	3,085.00	16,967,500
大同工業	1,700	815.00	1,385,500
日機装	12,400	1,176.00	14,582,400
木村化工機	3,700	641.00	2,371,700
レイズネクスト	6,400	1,242.00	7,948,800
アネスト岩田	5,900	1,012.00	5,970,800
ダイフク	20,800	10,310.00	214,448,000
サムコ	900	3,270.00	2,943,000
加藤製作所	2,300	1,070.00	2,461,000
油研工業	800	1,603.00	1,282,400
タダノ	18,600	1,070.00	19,902,000
フジテック	13,000	2,464.00	32,032,000
C K D	8,900	2,327.00	20,710,300
キトー	2,900	1,505.00	4,364,500
平和	10,700	1,847.00	19,762,900
理想科学工業	2,900	1,332.00	3,862,800
SANKYO	8,600	2,977.00	25,602,200
日本金銭機械	4,600	557.00	2,562,200
マースグループホールディングス	2,400	1,647.00	3,952,800
フクシマガリレイ	2,400	4,130.00	9,912,000
オーイズミ	2,000	408.00	816,000
ダイコク電機	1,900	960.00	1,824,000
竹内製作所	6,400	2,908.00	18,611,200
アマノ	10,100	2,533.00	25,583,300
JUKI	5,100	817.00	4,166,700
サンデンホールディングス	5,400	354.00	1,911,600
蛇の目マシン工業	3,700	805.00	2,978,500
ブラザー工業	46,200	2,292.00	105,890,400
マックス	5,100	1,644.00	8,384,400
モリタホールディングス	6,000	1,833.00	10,998,000
グローリー	9,900	2,363.00	23,393,700
新晃工業	3,500	1,948.00	6,818,000

大和冷機工業	6,000	1,032.00	6,192,000
セガサミーホールディングス	34,300	1,760.00	60,368,000
日本ピストンリング	1,300	1,120.00	1,456,000
リケン	1,800	2,439.00	4,390,200
T P R	5,100	1,565.00	7,981,500
ツバキ・ナカシマ	7,300	1,350.00	9,855,000
ホシザキ	11,900	9,560.00	113,764,000
大豊工業	3,600	770.00	2,772,000
日本精工	77,600	1,112.00	86,291,200
N T N	87,300	327.00	28,547,100
ジェイテクト	36,200	1,161.00	42,028,200
不二越	3,600	4,595.00	16,542,000
ミネベアミツミ	65,200	2,692.00	175,518,400
日本トムソン	11,200	585.00	6,552,000
T H K	23,600	3,495.00	82,482,000
ユーシン精機	2,400	947.00	2,272,800
前澤給装工業	1,300	2,349.00	3,053,700
イーグル工業	4,700	1,124.00	5,282,800
前澤工業	2,700	564.00	1,522,800
日本ピラー工業	3,900	1,728.00	6,739,200
キッツ	11,500	587.00	6,750,500
日立製作所	181,900	5,245.00	954,065,500
東芝	56,100	3,765.00	211,216,500
三菱電機	378,300	1,637.00	619,277,100
富士電機	22,800	4,440.00	101,232,000
東洋電機製造	1,600	1,244.00	1,990,400
安川電機	40,700	5,240.00	213,268,000
シンフォニアテクノロジー	5,000	1,311.00	6,555,000
明電舎	6,400	2,327.00	14,892,800
オリジン	1,100	1,359.00	1,494,900
山洋電気	1,900	5,870.00	11,153,000
デンヨー	3,300	2,111.00	6,966,300
バイカレント・コンサルティング	2,400	21,800.00	52,320,000
Orchestra Holdings	900	3,320.00	2,988,000
アイモバイル	1,600	1,284.00	2,054,400
キャリアインデックス	1,400	537.00	751,800
M S - J a p a n	1,600	1,035.00	1,656,000
船場	500	853.00	426,500
グレイステクノロジー	1,700	5,420.00	9,214,000
ジャパンエレベーターサービスホールディン	10,600	2,278.00	24,146,800
フルテック	400	1,358.00	543,200
グリーンズ	1,500	636.00	954,000
ツナググループ・ホールディングス	400	307.00	122,800
GameWith	700	597.00	417,900
ソウルドアウト	1,100	1,720.00	1,892,000
M S & C o n s u l t i n g	500	584.00	292,000
ウェルビー	900	1,413.00	1,271,700
エル・ティー・エス	300	3,390.00	1,017,000
ミダック	500	4,040.00	2,020,000

日総工産	2,300	802.00	1,844,600
キュービーネットホールディングス	1,800	1,718.00	3,092,400
R P Aホールディングス	3,300	627.00	2,069,100
三櫻工業	4,800	1,002.00	4,809,600
マキタ	49,300	4,830.00	238,119,000
東芝テック	4,100	4,375.00	17,937,500
芝浦メカトロニクス	700	4,870.00	3,409,000
マブチモーター	10,500	4,985.00	52,342,500
日本電産	91,100	13,295.00	1,211,174,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	2,200	892.00	1,962,400
トレックス・セミコンダクター	2,000	1,552.00	3,104,000
東光高岳	1,800	1,451.00	2,611,800
ダブル・スコープ	6,700	767.00	5,138,900
宮越ホールディングス	1,800	959.00	1,726,200
ダイヘン	4,200	4,435.00	18,627,000
ヤーマン	6,300	1,657.00	10,439,100
J V Cケンウッド	31,000	233.00	7,223,000
ミマキエンジニアリング	3,700	549.00	2,031,300
I - P E X	1,800	1,998.00	3,596,400
日新電機	9,000	1,224.00	11,016,000
大崎電気工業	7,500	590.00	4,425,000
オムロン	31,500	8,690.00	273,735,000
日東工業	5,600	2,032.00	11,379,200
I D E C	5,000	1,780.00	8,900,000
正興電機製作所	700	1,951.00	1,365,700
不二電機工業	600	1,275.00	765,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	12,900	3,155.00	40,699,500
サクサホールディングス	1,100	1,566.00	1,722,600
メルコホールディングス	1,300	3,765.00	4,894,500
テクノメディカ	1,000	1,652.00	1,652,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	500	2,564.00	1,282,000
日本電気	48,100	6,370.00	306,397,000
富士通	34,000	15,255.00	518,670,000
沖電気工業	15,600	1,075.00	16,770,000
岩崎通信機	1,800	925.00	1,665,000
電気興業	1,800	2,790.00	5,022,000
サンケン電気	4,200	5,640.00	23,688,000
ナカヨ	800	1,439.00	1,151,200
アイホン	2,100	1,820.00	3,822,000
ルネサスエレクトロニクス	162,700	1,149.00	186,942,300
セイコーエプソン	46,900	1,869.00	87,656,100
ワコム	26,000	740.00	19,240,000
アルバック	6,900	4,490.00	30,981,000
アクセル	1,700	790.00	1,343,000
E I Z O	3,000	3,975.00	11,925,000
ジャパンディスプレイ	110,000	47.00	5,170,000
日本信号	8,700	972.00	8,456,400
京三製作所	8,900	417.00	3,711,300
能美防災	5,100	2,244.00	11,444,400

ホーチキ	2,700	1,348.00	3,639,600
星和電機	2,300	599.00	1,377,700
エレコム	4,400	4,630.00	20,372,000
パナソニック	403,500	1,435.50	579,224,250
シャープ	43,700	2,055.00	89,803,500
アンリツ	22,700	2,385.00	54,139,500
富士通ゼネラル	10,500	2,973.00	31,216,500
ソニー	237,000	11,215.00	2,657,955,000
T D K	18,300	15,110.00	276,513,000
帝国通信工業	1,800	1,158.00	2,084,400
タムラ製作所	12,800	516.00	6,604,800
アルプスアルパイン	30,800	1,501.00	46,230,800
池上通信機	1,300	856.00	1,112,800
日本電波工業	3,700	738.00	2,730,600
鈴木	2,200	1,112.00	2,446,400
日本トリム	600	4,110.00	2,466,000
ローランド ディー . ジー .	2,300	1,748.00	4,020,400
フォスター電機	4,000	1,261.00	5,044,000
S M K	1,100	2,999.00	3,298,900
ヨコオ	2,500	2,900.00	7,250,000
ティアック	3,000	145.00	435,000
ホシデン	10,500	1,105.00	11,602,500
ヒロセ電機	5,800	16,490.00	95,642,000
日本航空電子工業	8,800	1,730.00	15,224,000
T O A	4,000	952.00	3,808,000
マクセルホールディングス	7,500	1,452.00	10,890,000
古野電気	4,900	1,052.00	5,154,800
ユニデンホールディングス	900	2,835.00	2,551,500
スミダコーポレーション	3,200	1,004.00	3,212,800
アイコム	1,500	2,768.00	4,152,000
リオン	1,600	2,873.00	4,596,800
本多通信工業	3,800	523.00	1,987,400
船井電機	4,500	535.00	2,407,500
横河電機	37,800	2,101.00	79,417,800
新電元工業	1,300	3,365.00	4,374,500
アズビル	25,600	4,595.00	117,632,000
東亜ディーケーケー	2,000	836.00	1,672,000
日本光電工業	15,600	3,155.00	49,218,000
チノー	1,400	1,399.00	1,958,600
共和電業	4,600	385.00	1,771,000
日本電子材料	1,600	1,698.00	2,716,800
堀場製作所	7,500	6,920.00	51,900,000
アドバンテスト	28,100	8,570.00	240,817,000
小野測器	1,600	537.00	859,200
エスベック	3,400	1,804.00	6,133,600
キーエンス	37,100	51,450.00	1,908,795,000
日置電機	1,800	3,860.00	6,948,000
シスメックス	29,500	11,075.00	326,712,500
日本マイクロニクス	6,700	1,595.00	10,686,500

メガチップス	3,600	3,340.00	12,024,000
OBARA GROUP	2,200	3,740.00	8,228,000
IMAGICA GROUP	3,400	539.00	1,832,600
澤藤電機	400	2,088.00	835,200
デンソー	83,300	6,759.00	563,024,700
原田工業	1,700	949.00	1,613,300
コーセル	4,500	1,089.00	4,900,500
イリソ電子工業	3,200	5,210.00	16,672,000
オプテックスグループ	6,300	1,599.00	10,073,700
千代田インテグレ	1,800	1,800.00	3,240,000
アイ・オー・データ機器	1,700	1,037.00	1,762,900
レーザーテック	16,600	12,660.00	210,156,000
スタンレー電気	26,500	3,345.00	88,642,500
岩崎電気	1,600	1,543.00	2,468,800
ウシオ電機	19,300	1,365.00	26,344,500
岡谷電機産業	3,100	371.00	1,150,100
ヘリオス テクノ ホールディング	3,900	338.00	1,318,200
エノモト	1,000	1,863.00	1,863,000
日本セラミック	3,900	2,704.00	10,545,600
遠藤照明	1,900	612.00	1,162,800
古河電池	2,900	1,656.00	4,802,400
双信電機	1,800	453.00	815,400
山一電機	2,700	1,401.00	3,782,700
図研	2,500	2,647.00	6,617,500
日本電子	7,000	3,915.00	27,405,000
カシオ計算機	30,400	2,137.00	64,964,800
ファナック	33,200	25,795.00	856,394,000
日本シイエムケイ	8,900	478.00	4,254,200
エンプラス	1,700	4,375.00	7,437,500
大真空	1,200	2,586.00	3,103,200
ローム	15,700	10,560.00	165,792,000
浜松ホトニクス	27,100	6,560.00	177,776,000
三井ハイテック	3,800	3,765.00	14,307,000
新光電気工業	12,700	2,770.00	35,179,000
京セラ	57,700	7,213.00	416,190,100
協栄産業	600	1,325.00	795,000
太陽誘電	16,800	5,340.00	89,712,000
村田製作所	111,100	9,278.00	1,030,785,800
双葉電子工業	6,000	968.00	5,808,000
日東電工	24,200	9,030.00	218,526,000
北陸電気工業	1,500	902.00	1,353,000
東海理化電機製作所	10,200	1,837.00	18,737,400
ニチコン	11,800	1,073.00	12,661,400
日本ケミコン	3,100	1,737.00	5,384,700
K O A	5,200	1,503.00	7,815,600
三井E & Sホールディングス	13,800	481.00	6,637,800
日立造船	30,500	851.00	25,955,500
三菱重工業	59,400	3,266.00	194,000,400
川崎重工業	29,400	2,547.00	74,881,800

I H I	25,400	2,109.00	53,568,600
名村造船所	10,800	186.00	2,008,800
サノヤスホールディングス	4,800	150.00	720,000
スプリックス	1,300	899.00	1,168,700
マネジメントソリューションズ	1,700	1,705.00	2,898,500
プロレド・パートナーズ	600	3,315.00	1,989,000
and factory	300	735.00	220,500
テノ・ホールディングス	300	1,133.00	339,900
フロンティア・マネジメント	600	1,692.00	1,015,200
ピアラ	200	1,660.00	332,000
コプロ・ホールディングス	300	2,900.00	870,000
ギークス	400	1,495.00	598,000
カーブスホールディングス	10,000	975.00	9,750,000
フォーラムエンジニアリング	2,100	1,057.00	2,219,700
日本車輛製造	1,300	2,549.00	3,313,700
三菱ロジスネクスト	5,100	1,216.00	6,201,600
近畿車輛	600	1,271.00	762,600
F P G	11,600	634.00	7,354,400
島根銀行	700	660.00	462,000
じもとホールディングス	2,900	783.00	2,270,700
全国保証	9,700	5,000.00	48,500,000
めぶきフィナンシャルグループ	193,500	235.00	45,472,500
ジャパンインベストメントアドバイザー	2,100	1,344.00	2,822,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	5,100	1,258.00	6,415,800
九州フィナンシャルグループ	76,000	444.00	33,744,000
かんぽ生命保険	46,200	2,238.00	103,395,600
ゆうちょ銀行	105,600	1,040.00	109,824,000
富山第一銀行	10,500	294.00	3,087,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	227,100	429.00	97,425,900
ジェイリース	800	700.00	560,000
西日本フィナンシャルホールディングス	25,300	721.00	18,241,300
マーキュリアインベストメント	1,600	774.00	1,238,400
イントラスト	1,600	684.00	1,094,400
日本モーゲージサービス	1,800	1,123.00	2,021,400
C a s a	1,200	1,034.00	1,240,800
アルヒ	5,400	1,637.00	8,839,800
プレミアグループ	1,700	2,378.00	4,042,600
日産自動車	446,100	604.20	269,533,620
いすゞ自動車	109,500	1,145.00	125,377,500
トヨタ自動車	383,300	7,969.00	3,054,517,700
日野自動車	47,200	1,019.00	48,096,800
三菱自動車工業	139,700	320.00	44,704,000
エフテック	2,600	669.00	1,739,400
レシップホールディングス	1,800	570.00	1,026,000
G M B	700	931.00	651,700
ファルテック	700	823.00	576,100
武蔵精密工業	8,600	1,851.00	15,918,600
日産車体	5,400	801.00	4,325,400
新明和工業	10,300	982.00	10,114,600

極東開発工業	6,500	1,611.00	10,471,500
トピー工業	3,100	1,456.00	4,513,600
ティラド	1,100	1,933.00	2,126,300
曙ブレーキ工業	20,500	176.00	3,608,000
タチエス	5,700	1,145.00	6,526,500
N O K	18,600	1,494.00	27,788,400
フタバ産業	9,300	551.00	5,124,300
K Y B	4,300	2,963.00	12,740,900
市光工業	5,700	779.00	4,440,300
大同メタル工業	7,200	587.00	4,226,400
プレス工業	18,900	332.00	6,274,800
ミクニ	4,600	282.00	1,297,200
太平洋工業	8,000	1,212.00	9,696,000
河西工業	6,000	404.00	2,424,000
アイシン精機	27,700	3,740.00	103,598,000
マツダ	118,600	917.00	108,756,200
今仙電機製作所	3,900	757.00	2,952,300
本田技研工業	297,900	3,101.00	923,787,900
スズキ	75,000	4,713.00	353,475,000
S U B A R U	108,400	2,077.00	225,146,800
安永	2,000	1,195.00	2,390,000
ヤマハ発動機	53,400	2,418.00	129,121,200
小糸製作所	22,700	7,720.00	175,244,000
T B K	5,300	449.00	2,379,700
エクセディ	5,200	1,646.00	8,559,200
ミツバ	7,000	612.00	4,284,000
豊田合成	12,200	2,836.00	34,599,200
愛三工業	5,900	595.00	3,510,500
盟和産業	500	888.00	444,000
日本ブラスト	2,900	591.00	1,713,900
ヨロズ	3,500	1,263.00	4,420,500
エフ・シー・シー	6,300	1,796.00	11,314,800
新家工業	900	1,619.00	1,457,100
シマノ	14,200	23,980.00	340,516,000
テイ・エス テック	8,800	3,270.00	28,776,000
関西みらいフィナンシャルグループ	17,700	614.00	10,867,800
三十三フィナンシャルグループ	3,500	1,386.00	4,851,000
第四北越フィナンシャルグループ	6,000	2,489.00	14,934,000
ひろぎんホールディングス	54,900	646.00	35,465,400
ダイレクトマーケティングミックス	1,400	3,190.00	4,466,000
ポピンズホールディングス	700	3,330.00	2,331,000
ジャムコ	2,600	885.00	2,301,000
小野建	3,300	1,336.00	4,408,800
はるやまホールディングス	1,600	714.00	1,142,400
南陽	900	1,609.00	1,448,100
ノジマ	6,800	2,822.00	19,189,600
佐島電機	2,200	763.00	1,678,600
カッパ・クリエイト	5,300	1,516.00	8,034,800
エコートレーディング	1,000	624.00	624,000

伯東	2,500	1,260.00	3,150,000
コンドーテック	2,800	1,079.00	3,021,200
中山福	2,300	489.00	1,124,700
ライトオン	3,200	650.00	2,080,000
ナガイレーベン	5,000	2,726.00	13,630,000
ジーンズメイト	1,300	283.00	367,900
三菱食品	4,200	3,050.00	12,810,000
良品計画	49,400	2,533.00	125,130,200
三城ホールディングス	4,900	296.00	1,450,400
松田産業	2,700	1,917.00	5,175,900
第一興商	5,500	4,540.00	24,970,000
メディパルホールディングス	37,300	2,158.00	80,493,400
アドヴァン	3,800	1,034.00	3,929,200
S P K	1,800	1,275.00	2,295,000
萩原電気ホールディングス	1,300	2,580.00	3,354,000
アルビス	1,400	2,454.00	3,435,600
アズワン	2,700	12,840.00	34,668,000
スズデン	1,500	1,280.00	1,920,000
尾家産業	1,200	1,370.00	1,644,000
シモジマ	2,300	1,379.00	3,171,700
ドウシシャ	3,500	1,850.00	6,475,000
小津産業	1,000	1,949.00	1,949,000
コナカ	4,200	338.00	1,419,600
高速	2,200	1,513.00	3,328,600
ハウス オブ ローゼ	600	1,708.00	1,024,800
G - 7ホールディングス	2,200	2,533.00	5,572,600
たけびし	1,400	1,562.00	2,186,800
イオン北海道	4,900	1,129.00	5,532,100
コジマ	7,100	648.00	4,600,800
ヒマラヤ	1,200	942.00	1,130,400
コーナン商事	5,400	2,960.00	15,984,000
ネットワンシステムズ	15,100	3,505.00	52,925,500
エコス	1,600	1,865.00	2,984,000
ワタミ	4,400	1,001.00	4,404,400
マルシェ	700	503.00	352,100
リックス	1,000	1,512.00	1,512,000
システムソフト	9,500	132.00	1,254,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	74,500	2,713.00	202,118,500
丸文	3,600	522.00	1,879,200
西松屋チェーン	8,300	1,426.00	11,835,800
ゼンショーホールディングス	20,000	2,781.00	55,620,000
ハピネット	3,100	1,552.00	4,811,200
幸楽苑ホールディングス	2,400	1,724.00	4,137,600
ハークスレイ	800	897.00	717,600
橋本総業ホールディングス	800	2,594.00	2,075,200
日本ライフライン	11,200	1,352.00	15,142,400
サイゼリヤ	5,600	2,352.00	13,171,200
タカショー	1,900	704.00	1,337,600

V Tホールディングス	13,800	421.00	5,809,800
マルカ	1,200	2,026.00	2,431,200
アルゴグラフィックス	2,900	2,960.00	8,584,000
魚力	1,200	1,869.00	2,242,800
I D O M	10,100	607.00	6,130,700
日本エム・ディ・エム	2,200	1,904.00	4,188,800
ボブラ	700	338.00	236,600
フジ・コーポレーション	1,100	2,418.00	2,659,800
ユナイテッドアローズ	3,900	1,971.00	7,686,900
進和	2,200	2,130.00	4,686,000
エスケイジャパン	900	438.00	394,200
ダイトロン	1,800	1,566.00	2,818,800
ハイデイ日高	5,500	1,703.00	9,366,500
シークス	4,800	1,746.00	8,380,800
京都きもの友禅	2,200	265.00	583,000
コロワイド	12,600	2,026.00	25,527,600
ピーシーデポコーポレーション	4,100	507.00	2,078,700
田中商事	1,600	700.00	1,120,000
オーハシテクニカ	2,100	1,599.00	3,357,900
壱番屋	2,700	4,955.00	13,378,500
白銅	1,500	1,436.00	2,154,000
トップカルチャー	1,700	370.00	629,000
P L A N T	700	745.00	521,500
スギホールディングス	7,400	7,850.00	58,090,000
ダイコー通産	300	1,513.00	453,900
薬王堂ホールディングス	1,600	2,615.00	4,184,000
島津製作所	48,700	3,870.00	188,469,000
J M S	3,200	904.00	2,892,800
クボテック	1,100	359.00	394,900
長野計器	3,200	934.00	2,988,800
ブイ・テクノロジー	1,800	5,260.00	9,468,000
スター精密	5,900	1,545.00	9,115,500
東京計器	2,600	938.00	2,438,800
愛知時計電機	600	4,325.00	2,595,000
インターアクション	1,900	2,409.00	4,577,100
オーバル	4,300	281.00	1,208,300
東京精密	6,400	4,750.00	30,400,000
マニー	15,000	2,465.00	36,975,000
ニコン	57,700	931.00	53,718,700
トプコン	19,000	1,336.00	25,384,000
オリンパス	209,300	2,324.50	486,517,850
理研計器	3,400	2,697.00	9,169,800
S C R E E Nホールディングス	6,600	8,440.00	55,704,000
キヤノン電子	3,500	1,660.00	5,810,000
タムロン	3,100	1,999.00	6,196,900
H O Y A	75,100	11,880.00	892,188,000
シード	2,300	629.00	1,446,700
ノーリツ鋼機	2,600	2,458.00	6,390,800
エー・アンド・デイ	3,100	1,155.00	3,580,500

朝日インテック	39,800	3,060.00	121,788,000
キヤノン	188,000	2,248.00	422,624,000
リコー	96,200	1,213.00	116,690,600
シチズン時計	45,100	417.00	18,806,700
リズム	1,200	826.00	991,200
大研医器	3,300	575.00	1,897,500
メニコン	5,500	6,130.00	33,715,000
シンシア	400	788.00	315,200
中本パックス	1,100	1,593.00	1,752,300
スノーピーク	2,400	2,861.00	6,866,400
パラマウントベッドホールディングス	3,700	4,475.00	16,557,500
トランザクション	2,000	1,130.00	2,260,000
粧美堂	1,600	409.00	654,400
ニホンフラッシュ	3,500	1,207.00	4,224,500
前田工織	4,200	2,916.00	12,247,200
永大産業	5,400	307.00	1,657,800
アートネイチャー	3,500	676.00	2,366,000
バンダイナムコホールディングス	31,300	8,061.00	252,309,300
アイフィスジャパン	900	780.00	702,000
共立印刷	6,000	133.00	798,000
SHOEI	3,400	4,355.00	14,807,000
フランスベッドホールディングス	5,400	956.00	5,162,400
マーベラス	5,700	829.00	4,725,300
パイロットコーポレーション	6,800	3,460.00	23,528,000
萩原工業	2,100	1,451.00	3,047,100
エイベックス	6,400	1,493.00	9,555,200
トッパン・フォームズ	6,700	1,032.00	6,914,400
フジシールインターナショナル	7,700	2,223.00	17,117,100
タカラトミー	17,300	1,036.00	17,922,800
廣済堂	2,900	1,037.00	3,007,300
エステールホールディングス	1,000	663.00	663,000
レック	4,100	1,325.00	5,432,500
タカノ	1,700	609.00	1,035,300
三光合成	4,700	419.00	1,969,300
プロネクサス	3,200	1,231.00	3,939,200
ホクシン	3,100	114.00	353,400
ウッドワン	1,400	1,083.00	1,516,200
大建工業	2,600	2,046.00	5,319,600
きもと	6,100	193.00	1,177,300
凸版印刷	57,500	1,762.00	101,315,000
大日本印刷	45,700	2,076.00	94,873,200
共同印刷	1,200	2,927.00	3,512,400
NISSHA	7,900	1,320.00	10,428,000
光村印刷	300	1,775.00	532,500
藤森工業	3,500	4,545.00	15,907,500
ヴィア・ホールディングス	5,400	227.00	1,225,800
TAKARA & COMPANY	1,800	1,739.00	3,130,200
前澤化成工業	2,800	986.00	2,760,800
未来工業	1,300	1,725.00	2,242,500

アシックス	33,400	1,817.00	60,687,800
ツツミ	900	2,147.00	1,932,300
ウェーブロックホールディングス	1,900	721.00	1,369,900
J S P	2,200	1,880.00	4,136,000
ニチハ	5,400	2,970.00	16,038,000
ローランド	2,200	3,900.00	8,580,000
エフピコ	6,900	4,450.00	30,705,000
小松ウオール工業	1,400	1,943.00	2,720,200
ヤマハ	22,500	6,190.00	139,275,000
河合楽器製作所	1,200	3,645.00	4,374,000
クリナップ	4,100	516.00	2,115,600
ビジョン	24,300	4,065.00	98,779,500
天馬	2,500	2,219.00	5,547,500
オリバー	900	2,583.00	2,324,700
兼松サステック	400	1,785.00	714,000
キングジム	3,700	897.00	3,318,900
象印マホービン	10,400	1,764.00	18,345,600
リンテック	8,200	2,470.00	20,254,000
信越ポリマー	5,700	998.00	5,688,600
東リ	11,100	253.00	2,808,300
イトーキ	7,400	369.00	2,730,600
任天堂	21,700	62,030.00	1,346,051,000
三菱鉛筆	6,300	1,495.00	9,418,500
松風	1,700	1,900.00	3,230,000
タカラスタンダード	7,900	1,598.00	12,624,200
コクヨ	18,500	1,553.00	28,730,500
ナカバヤシ	4,400	627.00	2,758,800
ニフコ	13,900	3,995.00	55,530,500
立川ブラインド工業	1,800	1,391.00	2,503,800
グローブライド	1,700	4,090.00	6,953,000
オカムラ	13,400	1,150.00	15,410,000
バルカー	3,100	2,109.00	6,537,900
MUTOHホールディングス	500	1,634.00	817,000
伊藤忠商事	260,600	3,329.00	867,537,400
丸紅	367,400	822.50	302,186,500
スクロール	5,200	1,100.00	5,720,000
高島	700	1,688.00	1,181,600
ヨンドシーホールディングス	3,400	1,869.00	6,354,600
三陽商会	2,300	744.00	1,711,200
長瀬産業	20,900	1,777.00	37,139,300
ナイガイ	1,200	325.00	390,000
蝶理	2,400	1,624.00	3,897,600
豊田通商	37,400	4,545.00	169,983,000
オンワードホールディングス	22,300	285.00	6,355,500
三共生興	5,600	552.00	3,091,200
兼松	14,200	1,414.00	20,078,800
美津濃	3,500	2,153.00	7,535,500
ツカモトコーポレーション	900	1,527.00	1,374,300
ルックホールディングス	1,300	1,167.00	1,517,100

三井物産	302,500	2,286.00	691,515,000
日本紙パルプ商事	1,900	3,690.00	7,011,000
東京エレクトロン	22,200	41,480.00	920,856,000
カメイ	4,900	1,191.00	5,835,900
東都水産	500	4,080.00	2,040,000
OUGホールディングス	600	2,829.00	1,697,400
スターゼン	1,400	4,615.00	6,461,000
セイコーホールディングス	5,400	2,076.00	11,210,400
山善	14,800	1,003.00	14,844,400
椿本興業	800	3,750.00	3,000,000
住友商事	235,100	1,553.00	365,110,300
日本ユニシス	12,900	3,100.00	39,990,000
内田洋行	1,500	4,765.00	7,147,500
三菱商事	226,900	3,037.00	689,095,300
第一実業	1,800	4,140.00	7,452,000
キヤノンマーケティングジャパン	9,400	2,400.00	22,560,000
西華産業	2,300	1,380.00	3,174,000
佐藤商事	3,600	1,038.00	3,736,800
菱洋エレクトロ	2,900	2,772.00	8,038,800
東京産業	3,700	651.00	2,408,700
ユアサ商事	3,600	3,080.00	11,088,000
神鋼商事	1,100	2,023.00	2,225,300
トルク	2,600	257.00	668,200
阪和興業	7,100	3,050.00	21,655,000
正栄食品工業	2,400	3,965.00	9,516,000
カナデン	3,000	1,191.00	3,573,000
菱電商事	2,700	1,616.00	4,363,200
ニプロ	26,700	1,359.00	36,285,300
フルサト工業	1,800	1,323.00	2,381,400
岩谷産業	8,900	6,080.00	54,112,000
ナイス	1,400	1,707.00	2,389,800
昭光通商	1,300	802.00	1,042,600
ニチモウ	700	1,929.00	1,350,300
極東貿易	1,200	1,450.00	1,740,000
イワキ	5,700	616.00	3,511,200
兼松エレクトロニクス	2,000	3,675.00	7,350,000
三愛石油	9,300	1,184.00	11,011,200
稲畑産業	8,300	1,619.00	13,437,700
G S Iクレオス	900	2,559.00	2,303,100
明和産業	4,100	491.00	2,013,100
クワザワホールディングス	1,300	700.00	910,000
キムラタン	14,500	27.00	391,500
ヤマエ久野	3,100	1,107.00	3,431,700
ゴールドウイン	6,100	7,060.00	43,066,000
ユニ・チャーム	80,200	4,546.00	364,589,200
デサント	6,400	1,827.00	11,692,800
キング	1,700	581.00	987,700
ワキタ	7,200	962.00	6,926,400
ヤマトインターナショナル	4,100	330.00	1,353,000

東邦ホールディングス	12,200	1,891.00	23,070,200
サンゲツ	10,200	1,617.00	16,493,400
ミツウロコグループホールディングス	5,600	1,275.00	7,140,000
シナネンホールディングス	1,500	3,105.00	4,657,500
伊藤忠エネクス	8,300	1,047.00	8,690,100
サンリオ	10,700	1,751.00	18,735,700
サンワテクノス	2,900	1,030.00	2,987,000
リョーサン	4,200	2,259.00	9,487,800
新光商事	4,900	802.00	3,929,800
トーホー	1,700	1,786.00	3,036,200
三信電気	2,000	1,996.00	3,992,000
東陽テクニカ	3,900	1,065.00	4,153,500
モスフードサービス	5,000	3,185.00	15,925,000
加賀電子	3,300	2,488.00	8,210,400
三益半導体工業	3,000	2,483.00	7,449,000
都築電気	1,300	1,586.00	2,061,800
ソーダニッカ	4,500	560.00	2,520,000
立花エレテック	2,800	1,547.00	4,331,600
木曽路	5,000	2,390.00	11,950,000
S R Sホールディングス	4,400	902.00	3,968,800
千趣会	7,900	381.00	3,009,900
タカキュー	3,300	138.00	455,400
リテールパートナーズ	4,500	1,429.00	6,430,500
ケーヨー	6,800	708.00	4,814,400
上新電機	4,500	3,060.00	13,770,000
日本瓦斯	6,000	5,120.00	30,720,000
ロイヤルホールディングス	6,600	1,888.00	12,460,800
東天紅	300	964.00	289,200
いなげや	4,100	1,701.00	6,974,100
チヨダ	3,900	990.00	3,861,000
ライフコーポレーション	2,900	3,290.00	9,541,000
リンガーハット	4,700	2,265.00	10,645,500
Mr Max HD	5,600	726.00	4,065,600
テナアライド	4,900	363.00	1,778,700
A O K Iホールディングス	7,300	673.00	4,912,900
オークワ	5,900	1,206.00	7,115,400
コメリ	5,900	2,829.00	16,691,100
青山商事	8,700	862.00	7,499,400
しまむら	4,300	10,600.00	45,580,000
はせがわ	2,100	294.00	617,400
高島屋	27,100	1,134.00	30,731,400
松屋	7,600	1,016.00	7,721,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	17,900	915.00	16,378,500
近鉄百貨店	1,400	3,245.00	4,543,000
丸井グループ	31,500	2,044.00	64,386,000
クレディセゾン	22,200	1,350.00	29,970,000
アクシアル リテイリング	3,100	4,610.00	14,291,000
井筒屋	1,700	268.00	455,600
イオン	143,400	3,079.00	441,528,600

イズミ	7,700	4,050.00	31,185,000
フォーバル	1,900	845.00	1,605,500
平和堂	6,800	2,097.00	14,259,600
フジ	4,600	1,945.00	8,947,000
ヤオコー	4,300	6,670.00	28,681,000
ゼビオホールディングス	4,500	940.00	4,230,000
ケーズホールディングス	33,100	1,420.00	47,002,000
PALTAC	6,000	6,070.00	36,420,000
三谷産業	5,900	418.00	2,466,200
Olympicグループ	1,900	851.00	1,616,900
日産東京販売ホールディングス	5,900	255.00	1,504,500
新生銀行	30,400	1,719.00	52,257,600
あおぞら銀行	22,200	2,376.00	52,747,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,552,800	565.00	1,442,332,000
りそなホールディングス	405,600	438.90	178,017,840
三井住友トラスト・ホールディングス	70,500	3,685.00	259,792,500
三井住友フィナンシャルグループ	258,200	3,831.00	989,164,200
千葉銀行	124,400	707.00	87,950,800
群馬銀行	73,100	362.00	26,462,200
武蔵野銀行	5,600	1,694.00	9,486,400
千葉興業銀行	9,100	257.00	2,338,700
筑波銀行	18,300	184.00	3,367,200
七十七銀行	11,600	1,483.00	17,202,800
青森銀行	2,900	2,464.00	7,145,600
秋田銀行	2,400	1,469.00	3,525,600
山形銀行	4,100	1,101.00	4,514,100
岩手銀行	2,500	2,237.00	5,592,500
東邦銀行	33,700	224.00	7,548,800
東北銀行	2,000	1,086.00	2,172,000
みちのく銀行	2,800	1,075.00	3,010,000
ふくおかフィナンシャルグループ	33,600	2,035.00	68,376,000
静岡銀行	90,800	831.00	75,454,800
十六銀行	4,700	2,094.00	9,841,800
スルガ銀行	33,100	368.00	12,180,800
八十二銀行	83,800	370.00	31,006,000
山梨中央銀行	4,300	866.00	3,723,800
大垣共立銀行	7,500	2,114.00	15,855,000
福井銀行	3,200	1,904.00	6,092,800
北國銀行	3,400	2,792.00	9,492,800
清水銀行	1,800	1,683.00	3,029,400
富山銀行	800	2,875.00	2,300,000
滋賀銀行	7,600	2,095.00	15,922,000
南都銀行	5,400	1,897.00	10,243,800
百五銀行	34,100	320.00	10,912,000
京都銀行	13,300	6,420.00	85,386,000
紀陽銀行	13,500	1,494.00	20,169,000
ほくほくフィナンシャルグループ	25,400	1,001.00	25,425,400
山陰合同銀行	22,500	494.00	11,115,000
中国銀行	32,000	905.00	28,960,000

鳥取銀行	1,400	1,126.00	1,576,400
伊予銀行	49,300	629.00	31,009,700
百十四銀行	4,000	1,634.00	6,536,000
四国銀行	5,700	755.00	4,303,500
阿波銀行	5,700	2,375.00	13,537,500
大分銀行	2,200	2,116.00	4,655,200
宮崎銀行	2,500	2,279.00	5,697,500
佐賀銀行	2,300	1,471.00	3,383,300
沖縄銀行	3,500	2,843.00	9,950,500
琉球銀行	8,700	787.00	6,846,900
セブン銀行	124,300	242.00	30,080,600
みずほフィナンシャルグループ	507,100	1,566.00	794,118,600
高知銀行	1,300	805.00	1,046,500
山口フィナンシャルグループ	46,400	705.00	32,712,000
芙蓉総合リース	3,900	7,350.00	28,665,000
みずほリース	5,900	3,375.00	19,912,500
東京センチュリー	8,700	7,160.00	62,292,000
SBIホールディングス	45,700	2,994.00	136,825,800
日本証券金融	15,600	621.00	9,687,600
アイフル	58,000	293.00	16,994,000
日本アジア投資	4,000	254.00	1,016,000
長野銀行	1,200	1,287.00	1,544,400
名古屋銀行	2,800	3,040.00	8,512,000
北洋銀行	57,200	270.00	15,444,000
愛知銀行	1,400	3,000.00	4,200,000
中京銀行	1,300	1,768.00	2,298,400
大光銀行	1,500	1,365.00	2,047,500
愛媛銀行	5,200	987.00	5,132,400
トマト銀行	1,400	1,073.00	1,502,200
京葉銀行	16,100	448.00	7,212,800
栃木銀行	17,900	178.00	3,186,200
北日本銀行	1,300	1,951.00	2,536,300
東和銀行	6,600	690.00	4,554,000
福島銀行	3,400	272.00	924,800
大東銀行	1,800	676.00	1,216,800
リコーリース	3,000	3,425.00	10,275,000
イオンフィナンシャルサービス	22,800	1,371.00	31,258,800
アコム	74,800	490.00	36,652,000
ジャックス	4,200	2,103.00	8,832,600
オリエントコーポレーション	102,600	149.00	15,287,400
日立キャピタル	8,800	3,020.00	26,576,000
オリックス	226,500	1,819.00	412,003,500
三菱UFJリース	84,000	598.00	50,232,000
ジャフコグループ	5,700	6,650.00	37,905,000
九州リースサービス	1,700	665.00	1,130,500
トモニホールディングス	29,300	312.00	9,141,600
大和証券グループ本社	279,300	538.00	150,263,400
野村ホールディングス	569,700	643.00	366,317,100
岡三証券グループ	32,300	418.00	13,501,400

丸三証券	11,200	621.00	6,955,200
東洋証券	14,700	172.00	2,528,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	39,500	373.00	14,733,500
光世証券	900	660.00	594,000
水戸証券	9,600	291.00	2,793,600
いちよし証券	6,900	572.00	3,946,800
松井証券	18,600	925.00	17,205,000
S O M P Oホールディングス	65,800	3,985.00	262,213,000
日本取引所グループ	100,800	2,431.00	245,044,800
マネックスグループ	27,800	825.00	22,935,000
極東証券	5,000	791.00	3,955,000
岩井コスモホールディングス	3,500	1,563.00	5,470,500
藍澤證券	6,700	911.00	6,103,700
フィデアホールディングス	36,200	125.00	4,525,000
池田泉州ホールディングス	43,300	165.00	7,144,500
アニコム ホールディングス	10,700	1,034.00	11,063,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	90,600	3,087.00	279,682,200
マネーパートナーズグループ	4,400	274.00	1,205,600
スパークス・グループ	17,300	313.00	5,414,900
小林洋行	1,300	291.00	378,300
第一生命ホールディングス	197,100	1,886.50	371,829,150
東京海上ホールディングス	123,700	5,382.00	665,753,400
アドバンテッジリスクマネジメント	2,200	736.00	1,619,200
イー・ギャランティ	4,500	1,946.00	8,757,000
アサクス	2,100	747.00	1,568,700
N E Cキャピタルソリューション	1,500	2,016.00	3,024,000
T & Dホールディングス	111,500	1,371.00	152,866,500
アドバンスクリエイト	900	1,836.00	1,652,400
三井不動産	170,100	2,452.00	417,085,200
三菱地所	245,100	1,819.50	445,959,450
平和不動産	6,500	3,350.00	21,775,000
東京建物	36,800	1,571.00	57,812,800
ダイビル	9,800	1,298.00	12,720,400
京阪神ビルディング	6,100	1,495.00	9,119,500
住友不動産	83,900	3,680.00	308,752,000
太平洋興発	1,500	705.00	1,057,500
テーオーシー	7,400	775.00	5,735,000
東京楽天地	700	4,465.00	3,125,500
レオパレス21	31,000	143.00	4,433,000
スターツコーポレーション	4,500	2,853.00	12,838,500
フジ住宅	4,300	717.00	3,083,100
空港施設	4,200	550.00	2,310,000
明和地所	2,100	709.00	1,488,900
ゴールドクレスト	3,000	1,662.00	4,986,000
リログループ	19,700	2,285.00	45,014,500
エスリード	1,600	1,688.00	2,700,800
日神グループホールディングス	6,500	467.00	3,035,500
日本エスコン	6,800	767.00	5,215,600

タカラレーベン	17,200	370.00	6,364,000
A V A N T I A	2,000	869.00	1,738,000
イオンモール	18,700	1,808.00	33,809,600
毎日コムネット	1,200	702.00	842,400
ファースト住建	1,900	1,184.00	2,249,600
ランド	239,500	11.00	2,634,500
カチタス	9,400	2,938.00	27,617,200
東祥	2,200	1,852.00	4,074,400
トーセイ	5,200	1,055.00	5,486,000
穴吹興産	1,000	1,780.00	1,780,000
サンフロンティア不動産	4,500	1,009.00	4,540,500
エフ・ジェー・ネクスト	3,800	1,089.00	4,138,200
インテリックス	1,300	587.00	763,100
ランドビジネス	1,700	350.00	595,000
サンネクスタグループ	1,000	953.00	953,000
グランディハウス	3,400	475.00	1,615,000
東武鉄道	39,400	3,080.00	121,352,000
相鉄ホールディングス	12,400	2,589.00	32,103,600
東急	95,400	1,418.00	135,277,200
京浜急行電鉄	48,500	1,696.00	82,256,000
小田急電鉄	60,600	3,100.00	187,860,000
京王電鉄	21,100	7,770.00	163,947,000
京成電鉄	28,300	3,840.00	108,672,000
富士急行	5,100	5,710.00	29,121,000
新京成電鉄	1,100	2,194.00	2,413,400
東日本旅客鉄道	66,600	7,994.00	532,400,400
西日本旅客鉄道	33,700	6,453.00	217,466,100
東海旅客鉄道	31,500	17,250.00	543,375,000
西武ホールディングス	45,500	1,237.00	56,283,500
鴻池運輸	6,100	1,064.00	6,490,400
西日本鉄道	10,500	3,100.00	32,550,000
ハマキョウレックス	2,900	3,300.00	9,570,000
サカイ引越センター	1,700	4,950.00	8,415,000
近鉄グループホールディングス	35,800	4,440.00	158,952,000
阪急阪神ホールディングス	47,800	3,550.00	169,690,000
南海電気鉄道	16,900	2,610.00	44,109,000
京阪ホールディングス	15,900	4,995.00	79,420,500
神戸電鉄	1,000	3,695.00	3,695,000
名古屋鉄道	29,400	2,747.00	80,761,800
山陽電気鉄道	2,600	2,006.00	5,215,600
アルプス物流	2,400	989.00	2,373,600
トランコム	1,000	8,320.00	8,320,000
日本通運	12,400	7,980.00	98,952,000
ヤマトホールディングス	50,200	2,782.00	139,656,400
山九	9,200	4,630.00	42,596,000
日新	2,800	1,436.00	4,020,800
丸運	2,800	254.00	711,200
丸全昭和運輸	2,900	3,200.00	9,280,000
センコーグループホールディングス	20,100	1,074.00	21,587,400

トナミホールディングス	900	5,300.00	4,770,000
ニッコンホールディングス	12,200	2,142.00	26,132,400
日本石油輸送	400	2,662.00	1,064,800
福山通運	4,700	4,365.00	20,515,500
セイノーホールディングス	26,800	1,561.00	41,834,800
エスライン	1,100	908.00	998,800
神奈川中央交通	900	3,880.00	3,492,000
日立物流	8,000	3,515.00	28,120,000
丸和運輸機関	7,800	1,883.00	14,687,400
C & F ロジホールディングス	3,700	1,743.00	6,449,100
日本郵船	29,900	3,165.00	94,633,500
商船三井	21,200	3,375.00	71,550,000
川崎汽船	11,300	2,073.00	23,424,900
N S ユナイテッド海運	1,600	1,675.00	2,680,000
明治海運	3,700	396.00	1,465,200
飯野海運	17,200	481.00	8,273,200
共栄タンカー	600	1,064.00	638,400
九州旅客鉄道	27,700	2,724.00	75,454,800
S G ホールディングス	67,700	2,458.00	166,406,600
日本航空	87,300	2,507.00	218,861,100
A N A ホールディングス	96,700	2,530.50	244,699,350
パスコ	1,000	1,289.00	1,289,000
西本W i s m e t t a c ホールディングス	900	2,909.00	2,618,100
シルバーライフ	500	2,033.00	1,016,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	400	1,553.00	621,200
一家ダイニングプロジェクト	400	592.00	236,800
Genky Drug Stores	1,700	3,510.00	5,967,000
コア商事ホールディングス	800	1,178.00	942,400
国際紙パルプ商事	9,800	249.00	2,440,200
ナルミヤ・インターナショナル	600	1,136.00	681,600
ブックオフグループホールディングス	2,600	904.00	2,350,400
ギフト	400	2,006.00	802,400
三菱倉庫	11,600	3,325.00	38,570,000
三井倉庫ホールディングス	3,800	2,194.00	8,337,200
住友倉庫	13,100	1,476.00	19,335,600
澁澤倉庫	2,000	2,266.00	4,532,000
ヤマタネ	1,500	1,482.00	2,223,000
東陽倉庫	7,600	340.00	2,584,000
乾汽船	2,400	1,048.00	2,515,200
日本トランスシティ	7,900	542.00	4,281,800
ケイヒン	600	1,377.00	826,200
中央倉庫	2,600	1,206.00	3,135,600
川西倉庫	700	1,194.00	835,800
安田倉庫	3,500	959.00	3,356,500
ファイズホールディングス	1,000	850.00	850,000
東洋埠頭	1,200	1,501.00	1,801,200
宇徳	3,400	490.00	1,666,000
上組	19,900	2,094.00	41,670,600
サンリツ	1,200	702.00	842,400

キムラユニティー	1,400	1,168.00	1,635,200
キューソー流通システム	1,000	1,621.00	1,621,000
近鉄エクスプレス	6,900	2,606.00	17,981,400
東海運	2,700	323.00	872,100
エーアイティー	2,200	1,003.00	2,206,600
内外トランスライン	1,500	1,390.00	2,085,000
ショーエイコーポレーション	700	1,058.00	740,600
日本コンセプト	1,400	1,679.00	2,350,600
TBSホールディングス	24,600	2,117.00	52,078,200
日本テレビホールディングス	30,900	1,455.00	44,959,500
朝日放送グループホールディングス	4,300	728.00	3,130,400
テレビ朝日ホールディングス	10,400	2,108.00	21,923,200
スカパーJSATホールディングス	24,800	463.00	11,482,400
テレビ東京ホールディングス	2,700	2,484.00	6,706,800
日本BS放送	1,400	1,110.00	1,554,000
ビジョン	4,600	1,148.00	5,280,800
スマートバリュー	1,000	872.00	872,000
USEN-NEXT HOLDINGS	1,400	1,856.00	2,598,400
ワイヤレスゲート	2,200	478.00	1,051,600
コネクシオ	2,100	1,357.00	2,849,700
日本通信	29,100	265.00	7,711,500
クロップス	800	805.00	644,000
日本電信電話	434,300	2,761.50	1,199,319,450
KDDI	297,700	3,278.00	975,860,600
ソフトバンク	337,400	1,412.50	476,577,500
光通信	4,400	21,060.00	92,664,000
エムティーアイ	4,000	810.00	3,240,000
GMOインターネット	13,300	3,065.00	40,764,500
ファイバーゲート	1,400	1,822.00	2,550,800
アйдママーケティングコミュニケーション	1,400	500.00	700,000
KADOKAWA	10,000	4,170.00	41,700,000
学研ホールディングス	5,000	1,423.00	7,115,000
ゼンリン	6,700	1,299.00	8,703,300
昭文社ホールディングス	1,500	478.00	717,000
インプレスホールディングス	3,200	203.00	649,600
東京電力ホールディングス	320,700	354.00	113,527,800
中部電力	115,700	1,311.50	151,740,550
関西電力	143,300	1,097.00	157,200,100
中国電力	54,500	1,298.00	70,741,000
北陸電力	35,300	680.00	24,004,000
東北電力	88,500	973.00	86,110,500
四国電力	32,000	788.00	25,216,000
九州電力	83,500	947.00	79,074,500
北海道電力	36,000	462.00	16,632,000
沖縄電力	7,500	1,489.00	11,167,500
電源開発	30,000	1,796.00	53,880,000
エフオン	2,200	991.00	2,180,200
イーレックス	5,600	1,871.00	10,477,600
レノバ	6,500	3,300.00	21,450,000

東京瓦斯	72,700	2,260.50	164,338,350
大阪瓦斯	68,500	1,955.00	133,917,500
東邦瓦斯	18,600	6,370.00	118,482,000
北海道瓦斯	2,000	1,616.00	3,232,000
広島ガス	9,100	387.00	3,521,700
西部瓦斯	4,300	2,932.00	12,607,600
静岡ガス	10,900	945.00	10,300,500
メタウォーター	3,700	2,121.00	7,847,700
アイネット	1,900	1,453.00	2,760,700
松竹	2,400	15,230.00	36,552,000
東宝	21,900	4,145.00	90,775,500
エイチ・アイ・エス	5,300	2,256.00	11,956,800
東映	1,200	21,960.00	26,352,000
ラックランド	1,200	2,392.00	2,870,400
エヌ・ティ・ティ・データ	98,800	1,743.00	172,208,400
共立メンテナンス	6,100	3,850.00	23,485,000
イチネンホールディングス	4,100	1,375.00	5,637,500
建設技術研究所	2,300	2,351.00	5,407,300
スペース	2,800	889.00	2,489,200
長大	1,600	1,635.00	2,616,000
アインホールディングス	5,400	7,050.00	38,070,000
燦ホールディングス	1,800	1,132.00	2,037,600
ピー・シー・エー	600	4,225.00	2,535,000
スバル興業	200	7,990.00	1,598,000
東京テアトル	1,600	1,301.00	2,081,600
タナベ経営	700	1,411.00	987,700
ビジネスブレイン太田昭和	1,400	1,713.00	2,398,200
ナガワ	1,200	9,340.00	11,208,000
東京都競馬	2,400	5,310.00	12,744,000
常磐興産	1,700	1,427.00	2,425,900
カナモト	6,500	2,574.00	16,731,000
D T S	7,700	2,364.00	18,202,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	15,800	6,120.00	96,696,000
シーイーシー	4,000	1,443.00	5,772,000
カブコン	15,900	6,520.00	103,668,000
西尾レントオール	3,400	2,678.00	9,105,200
アイ・エス・ビー	2,000	1,184.00	2,368,000
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	29,000	26.00	754,000
日本空港ビルデング	11,900	5,020.00	59,738,000
トランス・コスモス	3,500	2,928.00	10,248,000
乃村工藝社	15,800	831.00	13,129,800
ジャステック	2,400	1,210.00	2,904,000
S C S K	8,600	6,310.00	54,266,000
藤田観光	1,400	1,862.00	2,606,800
K N T - C Tホールディングス	1,800	1,081.00	1,945,800
日本管財	3,900	2,147.00	8,373,300
トーカイ	3,500	2,255.00	7,892,500
白洋舎	400	2,354.00	941,600
セコム	35,600	9,211.00	327,911,600

日本システムウエア	1,400	1,984.00	2,777,600
セントラル警備保障	1,800	3,345.00	6,021,000
アイネス	3,700	1,316.00	4,869,200
丹青社	6,900	829.00	5,720,100
メイテック	4,500	5,660.00	25,470,000
T K C	3,200	6,400.00	20,480,000
富士ソフト	4,000	5,320.00	21,280,000
応用地質	4,100	1,271.00	5,211,100
船井総研ホールディングス	7,600	2,127.00	16,165,200
N S D	12,200	1,895.00	23,119,000
進学会ホールディングス	1,400	481.00	673,400
丸紅建材リース	400	1,887.00	754,800
オオバ	2,800	758.00	2,122,400
コナミホールディングス	13,500	6,880.00	92,880,000
いであ	800	1,684.00	1,347,200
学究社	1,300	1,417.00	1,842,100
ベネッセホールディングス	12,300	2,181.00	26,826,300
イオンディライト	4,500	3,210.00	14,445,000
ナック	1,600	964.00	1,542,400
福井コンピュータホールディングス	1,500	3,495.00	5,242,500
ダイセキ	6,200	3,415.00	21,173,000
ステップ	1,500	1,530.00	2,295,000
日鉄物産	2,700	3,990.00	10,773,000
泉州電業	1,000	3,570.00	3,570,000
元気寿司	1,100	2,501.00	2,751,100
トラスコ中山	8,700	2,705.00	23,533,500
ヤマダホールディングス	124,700	540.00	67,338,000
オートバックスセブン	14,100	1,458.00	20,557,800
モリト	3,000	621.00	1,863,000
アークランドサカモト	5,900	1,589.00	9,375,100
ニトリホールディングス	14,800	20,030.00	296,444,000
グルメ杵屋	3,100	999.00	3,096,900
愛眼	3,800	232.00	881,600
ケーユーホールディングス	2,100	913.00	1,917,300
吉野家ホールディングス	12,200	2,094.00	25,546,800
加藤産業	5,500	3,770.00	20,735,000
北恵	700	920.00	644,000
イノテック	1,900	1,210.00	2,299,000
イエローハット	7,200	1,797.00	12,938,400
松屋フーズホールディングス	1,800	3,565.00	6,417,000
J B C C ホールディングス	2,500	1,426.00	3,565,000
J K ホールディングス	3,300	841.00	2,775,300
サガミホールディングス	5,000	1,203.00	6,015,000
日伝	3,000	2,163.00	6,489,000
関西スーパーマーケット	3,100	1,136.00	3,521,600
ミロク情報サービス	3,300	2,064.00	6,811,200
北沢産業	4,000	265.00	1,060,000
杉本商事	2,000	2,369.00	4,738,000
因幡電機産業	9,900	2,677.00	26,502,300

王将フードサービス	2,500	5,920.00	14,800,000	
ブレナス	4,200	1,922.00	8,072,400	
ミニストップ	2,800	1,417.00	3,967,600	
アークス	7,100	2,284.00	16,216,400	
パローホールディングス	7,600	2,373.00	18,034,800	
東テク	1,400	2,850.00	3,990,000	
ミスミグループ本社	46,700	3,290.00	153,643,000	
藤久	1,000	727.00	727,000	
アルテック	2,400	288.00	691,200	
ベルク	1,900	5,680.00	10,792,000	
大庄	2,200	989.00	2,175,800	
タキヒヨー	1,200	1,804.00	2,164,800	
ファーストリテイリング	5,000	95,870.00	479,350,000	
ソフトバンクグループ	294,600	10,055.00	2,962,203,000	
蔵王産業	1,000	1,380.00	1,380,000	
スズケン	15,800	4,100.00	64,780,000	
サンドラッグ	14,000	4,125.00	57,750,000	
サックスパー ホールディングス	3,700	626.00	2,316,200	
ジェコス	3,000	959.00	2,877,000	
ヤマザワ	800	1,727.00	1,381,600	
やまや	900	2,289.00	2,060,100	
グローセル	4,400	488.00	2,147,200	
ベルーナ	8,100	1,092.00	8,845,200	
合計	39,857,740		98,406,580,570	

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】

(2021年3月31日現在)

資産総額	9,830,553,429円
負債総額	18,877,271円
純資産総額(-)	9,811,676,158円
発行済口数	5,934,034,633口
1口当たり純資産額(/)	1.6535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）

(2021年3月31日現在)

資産総額	103,075,058,991円
負債総額	248,908,337円
純資産総額(-)	102,826,150,654円
発行済口数	30,220,594,786口
1口当たり純資産額(/)	3.4025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 >

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。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、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せん。）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。

上記の振替について、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てします。)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）

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。

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。

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。

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

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。

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。

2021年3月31日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、合計127本であり、その純資産総額は2,231,184百万円です(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23期事業年度（2019年4月1日から2020年3月31日まで）の財務諸表ならびに第24期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020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。

1. 財務諸表

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2019年3月31日現在)		当事業年度 (2020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	2,933,318		3,114,127	
有価証券	44,368		21,254	
前払金	42,741		39,342	
前払費用	15,949		9,920	
未収入金	500,748		902,862	
未収還付法人税等	2,367		-	
未収委託者報酬	617,227		660,964	
未収収益	122,922		40,244	
流動資産計	4,279,642	60.3	4,788,718	65.6
固定資産				
有形固定資産	84,968		69,492	
建物附属設備	66,820		59,016	
器具備品	18,147		10,475	
無形固定資産	0		0	
ソフトウェア	0		0	
投資その他の資産	2,732,068		2,445,819	
長期差入保証金	63,377		69,819	
繰延税金資産	2,662,416		2,369,725	
その他投資	6,275		6,275	
固定資産計	2,817,037	39.7	2,515,312	34.4
資産合計	7,096,680	100.0	7,304,030	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2019年3月31日現在)		当事業年度 (2020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	134,522		137,851	
未払金	286,607		350,943	
未払手数料	123,825		140,557	
その他未払金	162,781		210,386	
未払費用	1,928		11,122	
未払法人税等	1,181		3,635	
未払消費税等	27,995		72,142	
賞与引当金	57,088		67,981	
流動負債計	509,323	7.2	643,675	8.8
固定負債				
退職給付引当金	67,644		96,989	
固定負債計	67,644	1.0	96,989	1.3
負債合計	576,968	8.1	740,665	10.1
(純資産の部)		%		%

株主資本		6,519,711	91.9		6,563,364	89.9
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	6,100,591			6,144,244		
純資産合計		6,519,711	91.9		6,563,364	89.9
負債・純資産合計		7,096,680	100.0		7,304,030	100.0

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日			当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日		
	金 額	構成比		金 額	構成比	
営業収益			%			%
委託者報酬		2,337,607		2,392,782		
投資顧問収入		2,367,856		2,907,674		
その他営業収益		17,873		66,452		
営業収益計		4,723,337	100.0	5,366,908	100.0	
営業費用						
支払手数料		502,719		520,256		
広告宣伝費		39,808		30,443		
公告費		1,140		1,140		
調査費		585,088		632,099		
調査費	353,007			369,545		
委託調査費	230,952			261,450		
図書費	1,129			1,102		
委託計算費		153,098		265,563		
営業雑経費		44,871		39,755		
通信費	4,783			4,801		
印刷費	9,076			15,648		
協会費	8,632			16,300		
諸会費	6,374			-		
その他	16,005			3,005		
営業費用計		1,326,726	28.1	1,489,258	27.7	
一般管理費						
給料		1,315,296		1,322,366		
役員報酬	211,622			197,080		
給料・手当	876,471			848,305		
賞与	192,102			253,121		
賞与引当金繰入額	35,098			23,858		
交際費		3,029		10,725		
旅費交通費		21,095		8,872		
租税公課		6,373		8,801		
不動産賃借料		104,671		97,021		
退職給付費用		79,897		106,349		
固定資産減価償却費		21,600		22,666		

福利厚生費		116,798			126,755	
事務手数料		773,947			1,057,318	
諸経費		190,123			186,258	
一般管理費計		2,632,834	55.7		2,947,135	54.9
営業利益		763,777	16.2		930,515	17.3
営業外収益						
為替差益		-			166	
有価証券運用益		1,711			3,384	
雑収入		50			63	
営業外収益計		1,762	0.0		3,614	0.1
営業外費用						
支払利息		-			-	
為替差損		46			289	
有価証券運用損		-			4,123	
雑損失		277			490	
営業外費用計		324	0.0		4,903	0.1
経常利益		765,215	16.2		929,225	17.3
特別利益						
事業再構築費用戻入		5,262			-	
特別利益計		5,262	0.1		-	0.0
特別損失						
事業再構築費用		6,296			102,351	
事務処理損失		714			-	
ゴルフ会員権売却損		2,800			-	
特別損失計		9,811	0.2		102,351	1.9
税引前当期純利益		760,665	16.1		826,874	15.4
法人税、住民税及び事業税		530	0.0		530	0.0
法人税等調整額		269,303	5.7		292,691	5.5
当期純利益		490,831	10.4		533,652	9.9

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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			株主資本合計	
			その他利益剰余金		利益剰余金合計		
			別途積立金	繰越利益剰余金			
当期首残高	310,000	77,500	31,620	5,609,759	5,718,879	6,028,879	6,028,879
当期変動額							
当期純利益	-	-	-	490,831	490,831	490,831	490,831
当期変動額合計	-	-	-	490,831	490,831	490,831	490,831
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,100,591	6,209,711	6,519,711	6,519,711

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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			株主資本合計	
			その他利益剰余金		利益剰余金合計		
			別途積立金	繰越利益剰余金			

当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,100,591	6,209,711	6,519,711	6,519,711
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	(490,000)	(490,000)	(490,000)	(490,000)
当期純利益	-	-	-	533,652	533,652	533,652	533,652
当期変動額合計	-	-	-	43,652	43,652	43,652	43,652
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,144,244	6,253,364	6,563,364	6,563,364

[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	(1) 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。 建物附属設備 9～10年 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。 (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。 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。 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。
5. その他 財務諸表作成のための重要な事項	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。

(追加情報)

(新型コロナウイルス感染症（COVID-19）の影響に関する仮定について）

新型コロナウイルス感染症（COVID-19）の感染拡大やそれに伴う経済活動停滞による影響は今後1年程度続くものと想定し、当社が顧客から収受する投資顧問料等に一定の影響があるとの仮定を置いております。かかる仮定に基づいた今後の業績見通し及び将来収益力等を勘案し、「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」に基づき、繰延税金資産の回収可能性について慎重に検討し、繰延税金資産を計上しています。

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 54,843千円 器具備品 38,003千円	1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 68,147千円 器具備品 46,953千円
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 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
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17,341千円は、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773,947千円は、損益計算書の事務手数料に含まれております。	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65,925千円は、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1,057,318千円は、損益計算書の事務手数料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。	関係会社に係る注記 同左

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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

該当ありません。

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
2019年6月26日 定時株主総会	普通株式	490,000千円	利益剰余金	79,032.25円	2019年3月31日	2019年6月27日

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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
2019年6月26日 定時株主総会	普通株式	490,000千円	79,032.25円	2019年3月31日	2019年6月27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
2020年6月24日 定時株主総会	普通株式	533,000千円	利益剰余金	85,967.74円	2020年3月31日	2020年6月25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

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。

2019年3月31日現在

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 預金	2,933,318	2,933,318	
(2) 未収入金	500,748	500,748	
(3) 未収委託者報酬	617,227	617,227	
(4) 預り金	134,522	134,522	
(5) 未払手数料	123,825	123,825	
(6) その他未払金	162,781	162,781	

（注1）金融商品の時価の算定方法に関する事項

（1）預金

預金は、すべて満期のない預金であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（2）未収入金、(3)未収委託者報酬、(4)預り金、(5)未払手数料及び(6)その他未払金

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似していることから、当該帳簿価額によっております。

（注2）金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものはありません。

（注3）社債、長期借入金、リース債務およびその他の有利子負債の決算日後の返済予定額

記載すべき事項はありません。

2020年3月31日現在

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
--	----------	----	----

(1)預金	3,114,127	3,114,127	
(2)未収入金	902,862	902,862	
(3)未収委託者報酬	660,964	660,964	
(4)預り金	137,851	137,851	
(5)未払手数料	140,557	140,557	
(6)その他未払金	210,386	210,386	

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

(1) 預金

預金は、すべて満期のない預金であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(2) 未収入金、(3)未収委託者報酬、(4)預り金、(5)未払手数料及び(6)その他未払金

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものはありません。

(注3) 社債、長期借入金、リース債務およびその他の有利子負債の決算日後の返済予定額

記載すべき事項はありません。

(有価証券関係)

前事業年度 (2019年3月31日現在)		当事業年度 (2020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	44,368千円	貸借対照表計上額	21,254千円
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	1,704千円	に含まれた評価差額	4,123千円

(デリバティブ取引関係)

前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020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 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020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 2018年4月 1日 至 2019年3月31日

退職給付債務の期首残高	473,087
勤務費用	51,555
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	52,891
退職給付の支払額	<u>75,129</u>
退職給付債務の期末残高	502,405

(単位：千円)

	当事業年度
	自 2019年4月 1日
	至 2020年3月31日
退職給付債務の期首残高	502,405
勤務費用	57,391
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	53,802
退職給付の支払額	<u>85,470</u>
退職給付債務の期末残高	420,524

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 2018年4月 1日
	至 2019年3月31日
年金資産の期首残高	380,344
期待運用収益	2,814
数理計算上の差異の発生額	32,480
事業主からの拠出額	56,396
退職給付の支払額	<u>75,129</u>
年金資産の期末残高	396,905

(単位：千円)

	当事業年度
	自 2019年4月 1日
	至 2020年3月31日
年金資産の期首残高	396,905
期待運用収益	2,938
数理計算上の差異の発生額	28,742
事業主からの拠出額	54,241
退職給付の支払額	<u>85,470</u>
年金資産の期末残高	339,872

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 2018年4月 1日
	至 2019年3月31日

積立型制度の退職給付債務	502,405
年金資産	396,905
	<hr/>
	105,499
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	105,499
未認識数理計算上の差異	20,411
未認識過去勤務費用	17,443
	<hr/>
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	67,644

(単位：千円)

	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
積立型制度の退職給付債務	420,524
年金資産	339,872
	<hr/>
	80,651
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	80,651
未認識数理計算上の差異	25,059
未認識過去勤務費用	8,721
	<hr/>
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	96,989

5．退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	58,810
(1)勤務費用	51,555
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益（減算）	2,814
(4)過去勤務費用の費用処理額	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	1,347

(単位：千円)

	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	86,784
(1)勤務費用	57,391
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益（減算）	2,938
(4)過去勤務費用の費用処理額	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	20,411

(6)その他

6．年金資産に関する事項

前事業年度（2019年3月31日現在）

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%

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（2020年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定） 97.7%

その他 2.3%

合計 100.0%

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 (2019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 (2020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 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は18,720千円であります。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は19,564千円であります。

(税効果会計関係)

前事業年度	当事業年度
自 2018年4月 1日	自 2019年4月 1日
至 2019年3月31日	至 2020年3月31日

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位:千円)		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位:千円)	
繰延税金資産		繰延税金資産	
連結納税適用に伴う影響額	1,225,179	連結納税適用に伴う影響額	612,589
賞与引当金繰入超過額	14,373	賞与引当金繰入超過額	17,497
退職給付引当金	21,778	退職給付引当金	31,083
繰越欠損金	1,372,856	(注) 繰越欠損金	1,652,186
その他	28,228	その他	56,367
繰延税金資産 合計	2,662,416	繰延税金資産 合計	2,369,725
繰延税金負債との相殺	-	繰延税金負債との相殺	-
繰延税金資産の純額	2,662,416	繰延税金資産の純額	2,369,725

(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(2019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)	-	-	-	-	-	1,372,856	1,372,856
繰延税金資産	-	-	-	-	-	1,372,856	1,372,856 (*2)

(*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1,372,856千円(法定実効税率を乗じた金額)について、繰延税金資産1,372,856千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(2020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)	-	-	-	-	-	1,652,186	1,652,186
繰延税金資産	-	-	-	-	-	1,652,186	1,652,186 (*2)

(*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1,652,186千円(法定実効税率を乗じた金額)について、繰延税金資産1,652,186千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(2019年3月31日現在)	当事業年度(2020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	5.3%	交際費等永久に損金に 算入されない項目	5.1%
その他	0.5%	その他	0.3%
税効果会計適用後の 法人税等の負担率	35.4%	税効果会計適用後の 法人税等の負担率	35.4%
	=====		=====

（資産除去債務関係）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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35,341千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、変動は有りません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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35,341千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、変動は有りません。

（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

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。

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、投資顧問料については、顧客との守秘義務契約により、開示が出来ないため、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）

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 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

前事業年度											
自 2018年4月 1日											
至 2019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・オブ・ニューヨーク・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 ソフトウェアの使用契約 人件費等及び事務手数料の支払	ソフトウェア使用料の支払 投資顧問料の支払 人件費等の支払 事務手数料の受取 事務手数料の支払	229,260 164,709 135,677 17,341 773,947	前払金 未払金	8,051 30,899
	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 兼職社員の人件費支払等	投資信託計理業務委託 人件費等の支払	35,235 159,558	前払金	34,689
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インテグリティ・キャピタル・マネジメント	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	16,146	-	-
	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	531 19,937	-	-

(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

- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020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	309,576	前払金	694
								投資顧問料の支払	189,363		
								ソフトウェアの使用契約	129,383	未払金	
								人件費等及び事務手数料の受取	65,925		
							事務手数料の支払	1,057,318			
	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	37,991	前払金	38,648
								兼職社員の人件費支払等	138,065		
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・リミテッド・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	13,752	-	-
	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	526	-	-
								投資顧問料の支払	22,050		

(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

- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。

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 2018年4月 1日 至 2019年3月31日		当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日	
1株当たり純資産	1,051,566円42銭	1株当たり純資産	1,058,607円22銭
1株当たり当期純利益	79,166円44銭	1株当たり当期純利益	86,073円06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 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
当期純利益（千円）	490,831	533,652
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）	490,831	533,652
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 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

科 目	第24期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)	
	金 額	構成比
(資産の部)		%
流動資産		
預金	3,412,150	
有価証券	22,205	

前払金			50,496	
前払費用			15,233	
未収入金			681,858	
未収委託者報酬			625,087	
未収収益			356,269	
		流動資産計	5,163,300	68.8
固定資産				
有形固定資産			59,326	
建物附属設備	1	52,073		
器具備品	1	7,252		
無形固定資産			0	
ソフトウェア		0		
投資その他の資産			2,287,499	
長期差入保証金		67,230		
繰延税金資産		2,213,993		
その他投資		6,275		
固定資産計			2,346,825	31.2
		資産合計	7,510,126	100.0
		(負債の部)		%
流動負債				
預り金			30,857	
未払金			774,451	
未払手数料		147,653		
その他未払金		626,798		
未払費用			11,165	
未払法人税等			1,831	
未払消費税等	2		90,325	
賞与引当金			202,413	
流動負債計			1,111,044	14.8
固定負債				
退職給付引当金			89,098	
固定負債計			89,098	1.2
		負債合計	1,200,143	16.0
		(純資産の部)		%
株主資本			6,309,982	84.0
資本金		310,000		
利益剰余金		5,999,982		
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		5,890,862		
		純資産合計	6,309,982	84.0
		負債・純資産合計	7,510,126	100.0

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

科 目	期 別	第24期中間会計期間	
		自 2020年4月 1日 至 2020年9月30日	
		金 額	構成比
営業収益			%
委託者報酬		1,202,593	
投資顧問収入		1,410,901	
その他営業収益	1	38,003	
営業収益計		2,651,497	100.0

営業費用・一般管理費				
営業費用			686,141	
支払手数料	299,305			
その他営業費用	386,836			
一般管理費		2	1,525,243	
営業費用・一般管理費計			2,211,385	83.4
営業利益			440,111	16.6
営業外収益			1,052	0.0
営業外費用			838	0.0
経常利益			440,325	16.6
特別損失			4,711	0.2
税引前中間純利益			435,613	16.4
法人税,住民税及び事業税			265	0.0
法人税等調整額			155,731	5.9
中間純利益			279,617	10.5

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

（単位：千円）

	株 主 資 本					株主資本 合計	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		
			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	6,144,244	6,253,364	6,563,364	6,563,364
当中間期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	-533,000	-533,000	-533,000	-533,000
中間純利益	-	-	-	279,617	279,617	279,617	279,617
当中間期変動額合計	-	-	-	-253,382	-253,382	-253,382	-253,382
当中間期末残高	310,000	77,500	31,620	5,890,862	5,999,982	6,309,982	6,309,982

[重要な会計方針]

	第24期中間会計期間 自 2020年4月 1日 至 2020年9月30日
1. 資産の評価基準及び評価方法	有価証券 売買目的有価証券 中間決算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	(1) 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。 建物附属設備 9～10年 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、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。

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>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>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。</p> <p>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. その他中間 財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<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>

(追加情報)

(新型コロナウイルス感染症（COVID-19）の影響に関する仮定について）

新型コロナウイルス感染症（COVID-19）の感染拡大やそれに伴う経済活動停滞による影響は今後1年程度続くものと想定し、当社が顧客から收受する投資顧問料等に一定の影響があるとの仮定を置いております。かかる仮定に基づいた今後の業績見通し及び将来収益力等を勘案し、「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」に基づき、繰延税金資産の回収可能性について慎重に検討し、繰延税金資産を計上しております。

注 記 事 項

(中間貸借対照表関係)

第24期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)					
1. 有形固定資産の減価償却累計額	<table border="0"> <tr> <td>建物附属設備</td> <td>75,090千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>50,177千円</td> </tr> </table>	建物附属設備	75,090千円	器具備品	50,177千円
建物附属設備	75,090千円				
器具備品	50,177千円				
2. 消費税等の取扱い	<p>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。</p>				

(中間損益計算書関係)

第24期中間会計期間	
自	2020年4月1日
至	2020年9月30日

1. 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調整額37,877千円は、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610,748千円は、損益計算書の事務手数料に含まれております。	
2. 減価償却実施額	
有形固定資産	10,422千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第24期中間会計期間 自 2020年4月 1日 至 2020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	
2. 当中間会計期間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株あたりの配当 額	基準日	効力発生日
2020年6月24日 定時株主総会	普通株式	533,000千円	85,967.74円	2020年3月31日	2020年6月25日

(金融商品関係)

第24期中間会計期間 自 2020年4月 1日 至 2020年9月30日			
1. 金融商品の時価等に関する事項			
2020年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。			
(単位：千円)			
	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)預金	3,412,150	3,412,150	
(2)未収入金	681,858	681,858	
(3)未収委託者報酬	625,087	625,087	
(4)未収収益	356,269	356,269	
(5)未払手数料	147,653	147,653	
(6)その他未払金	626,798	626,798	

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

(1) 預金

預金は、すべて満期のない預金であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(2) 未収入金、(3) 未収委託者報酬、(4) 未収収益、(5) 未払手数料及び(6) その他未払金

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券関係)

第24期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)	
売買目的の有価証券	
貸借対照表計上額	22,205千円
当中間会計期間の損益に含まれた評価差額	950千円

(資産除去債務関係)

第24期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)	
資産除去債務の総額の期中における増減はありません。	

(デリバティブ取引関係)

第24期中間会計期間末 (2020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24期中間会計期間末 (2020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、記載を省略しています。

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、記載を省略しています。

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、投資顧問料については、顧客との守秘義務契約により、開示が出来ないため、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。

（1株当たり情報）

第24期中間会計期間

自 2020年4月 1日

至 2020年9月30日

1株当たり純資産額 1,017,739円12銭

1株当たり中間純利益 45,099円63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24期中間会計期間	
自 2020年4月 1日	
至 2020年9月30日	
中間純利益（千円）	279,617
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）	279,617
期中平均株式数（株）	6,200

(重要な後発事象)

第24期中間会計期間

自 2020年4月 1日

至 2020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。

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。)。

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。)。

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。

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。

上記 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。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称

三井住友信託銀行株式会社

資本金の額

342,037百万円（2020年3月末現在）

事業の内容

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

（参考）再信託受託会社

名 称：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2020年9月末現在）

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

(2) 販売会社

名 称	資本金の額	事業の内容
楽天証券株式会社	7,495百万円 (2020年12月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理・計算、受益権の設定に係る振替機関への通知、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行います。

(2) 販売会社

当ファンドの販売会社として受益権の募集の取扱い等を行います。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

- (1) 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
- (2) 目論見書の表紙および裏表紙に、委託会社の名称および本店の所在地、当ファンドの基本的形態等を記載すること、委託会社および当ファンドのロゴマークを表示し、図案を採用することがあります。
- (3) 目論見書の表紙等に、以下のような別称を使用することがあります。
交付目論見書 「投資信託説明書（交付目論見書）」
請求目論見書 「投資信託説明書（請求目論見書）」
- (4) 目論見書の表紙裏に、以下の事項を記載することがあります。
「当ファンドは、有価証券などの値動きのある証券に投資しますので、基準価額は変動します。従って、元本が保証されているものではありません。」
- (5) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。
- (6) 目論見書に当該委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額および目論見書の使用を開始する日を記載することがあります。
- (7) 目論見書に投資信託財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2020年6月29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

業務執行社員

公認会計士

伊藤雅人

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2019年4月1日から2020年3月31日までの第23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2020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。

財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

監査役の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

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せん。

独立監査人の監査報告書

2021年4月21日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御中

PwC あらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているステート・ストリート日本株式インデックス・オープンの2020年3月6日から2021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2021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、すべ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。

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. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年12月18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 伊藤 雅人
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2020年4月1日から2021年3月31日までの第24期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020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2020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（2020年4月1日から2020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。

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) 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。