

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年10月25日提出
【計算期間】	第12期(自 2021年7月27日至 2022年7月25日)
【ファンド名】	インデックスコレクション（国内株式）
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【連絡場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【電話番号】	03-6453-3610
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<ファンドの目的>

当ファンドは、確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

<信託金限度額>

上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

<基本的性格>

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

株式	年1回	グローバル	ファミリーファンド	あり ()	日経225	ブル・ベア型
一般						
大型株	年2回				TOPIX	条件付運用型
中小型株		日本		なし		
債券	年4回		ファンド・オブ・ファンズ		その他 ()	ロング・ショート型/ 絶対収益追求型
一般	年6回	北米				
公債	(隔月)	欧州				
社債						
その他債券	年12回	アジア				その他
クレジット属性 ()	(毎月)	オセアニア				()
不動産投信	日々					
その他資産 (投資信託証券 (株式一般))	その他 ()	中南米				
資産複合 ()		アフリカ				
資産配分 固定型		中近東 (中東)				
資産配分 変更型		エマージング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

(1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われ

ないファンドをいう。

- (2)追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産(収益の源泉)による区分]

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

- (1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

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

- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

<ファンドの特色>

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

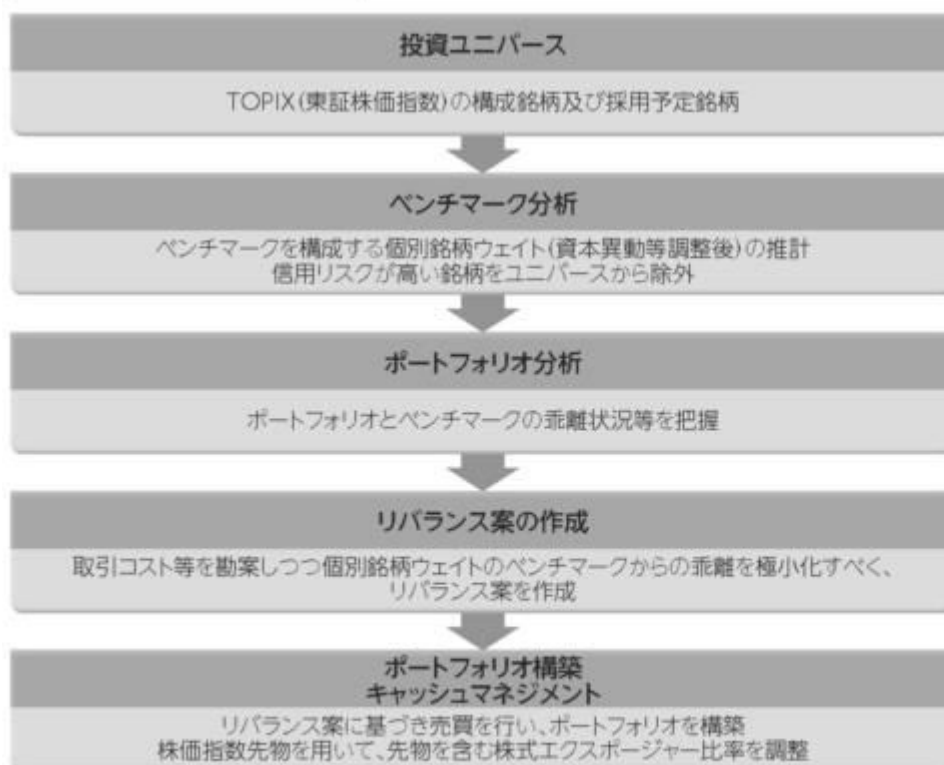
TOPIX（東証株価指数、配当込み）とは

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

TOPIX（東証株価指数）の著作権等について

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

マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

ファンドのしくみ

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



分配方針

- 年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。
- 分配対象額は、経費控除後の配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- 収益分配金は、自動的にファンドの受益権に再投資されます。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

2010年10月20日 信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始

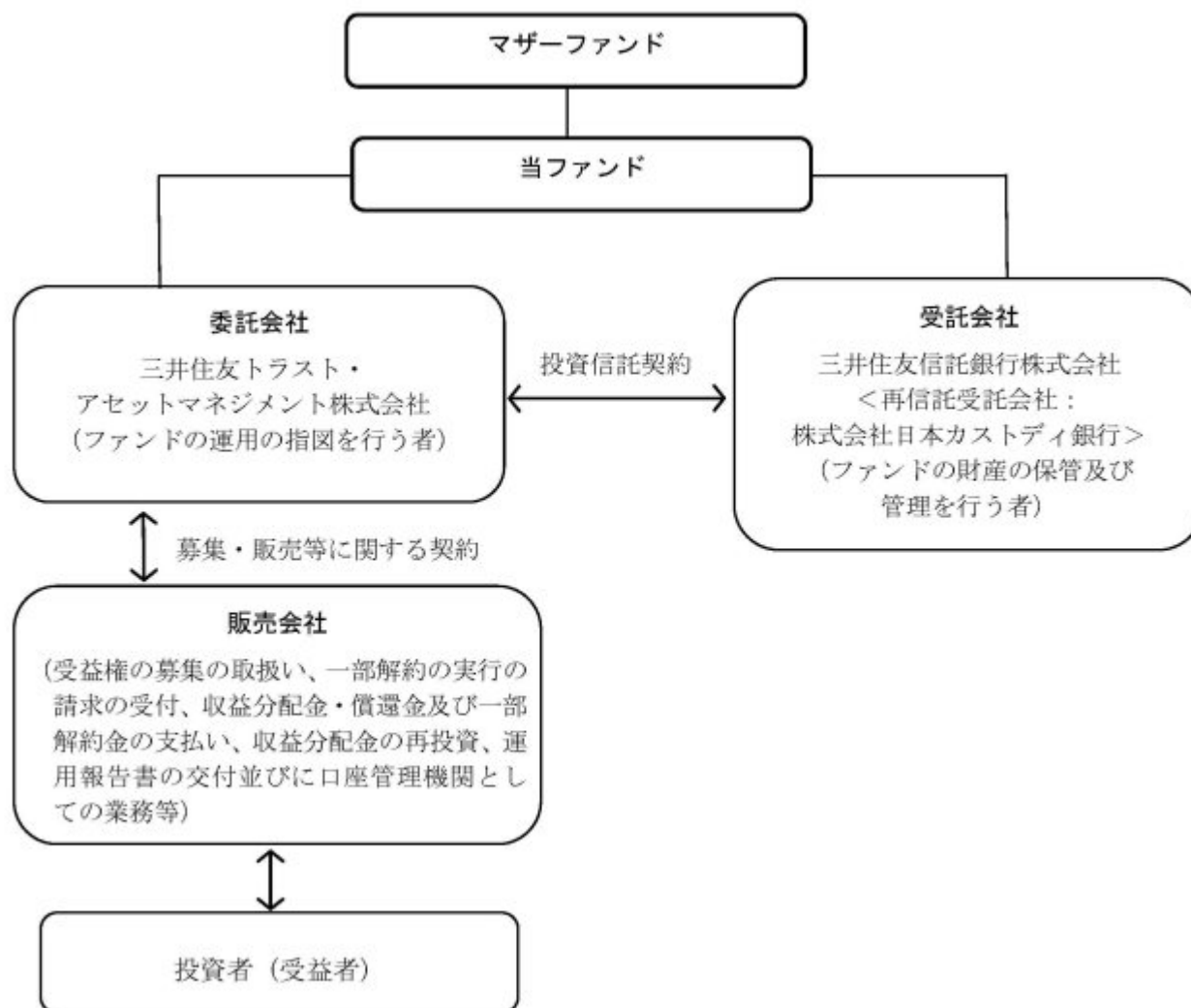
2012年4月1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継

当ファンドの名称を中央三井インデックスコレクション（国内株式）からインデックスコレクション（国内株式）に変更

当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンドに変更

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2022年 8月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

- 1986年11月1日： 住信キャピタルマネジメント株式会社設立
- 1987年2月20日： 投資顧問業の登録
- 1987年9月9日： 投資一任契約に係る業務の認可
- 1990年10月1日： 住信投資顧問株式会社に商号変更
- 1999年2月15日： 住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 1999年3月25日： 証券投資信託委託業の認可
- 2007年9月30日： 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）
- 2012年4月1日： 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 2018年10月1日： 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

ハ．大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

運用方針

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

投資態度

- A．株式への実質投資は、原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- B．株式への実質投資割合は、原則として高位（90%以上）とします。
- C．運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- D．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- E．資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。
- F．国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。
- G．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。
- H．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

（2）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- A．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。）
 - 1．有価証券
 - 2．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条、第24条及び第25条に定めるものに限りません。）
 - 3．金銭債権（上記1．、2．及び下記4．に掲げるものに該当するものを除きます。）
 - 4．約束手形（上記1．に掲げるものに該当するものを除きます。）
- B．次に掲げる特定資産以外の資産
 - 1．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

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

- 1．株券又は新株引受権証券
- 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が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6．資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 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．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証券
- 9．資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 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。）及び新株予約権証券
- 12．外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記1．から11．までの証券又は証書の性質を有するもの
- 13．投資信託又は外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。）
- 14．投資証券又は外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 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又は証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 17．預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18．外国法人が発行する譲渡性預金証券
- 19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 20．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 22．外国の者に対する権利で上記21．の有価証券の性質を有するもの

なお、上記1．の証券又は証書並びに上記12．及び17．の証券又は証書のうち上記1．の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記2．から6．までの証券並びに上記12．及び17．の証券又は証書のうち上記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、上記13．の証券及び上記14．の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用指図できる金融商品

A．委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法

第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

1. 預金

2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で上記5.の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

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

(参考) マザーファンドの概要

「日本株式マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の金利に係るオプション取引と類似の取引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スワップ取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

3. 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

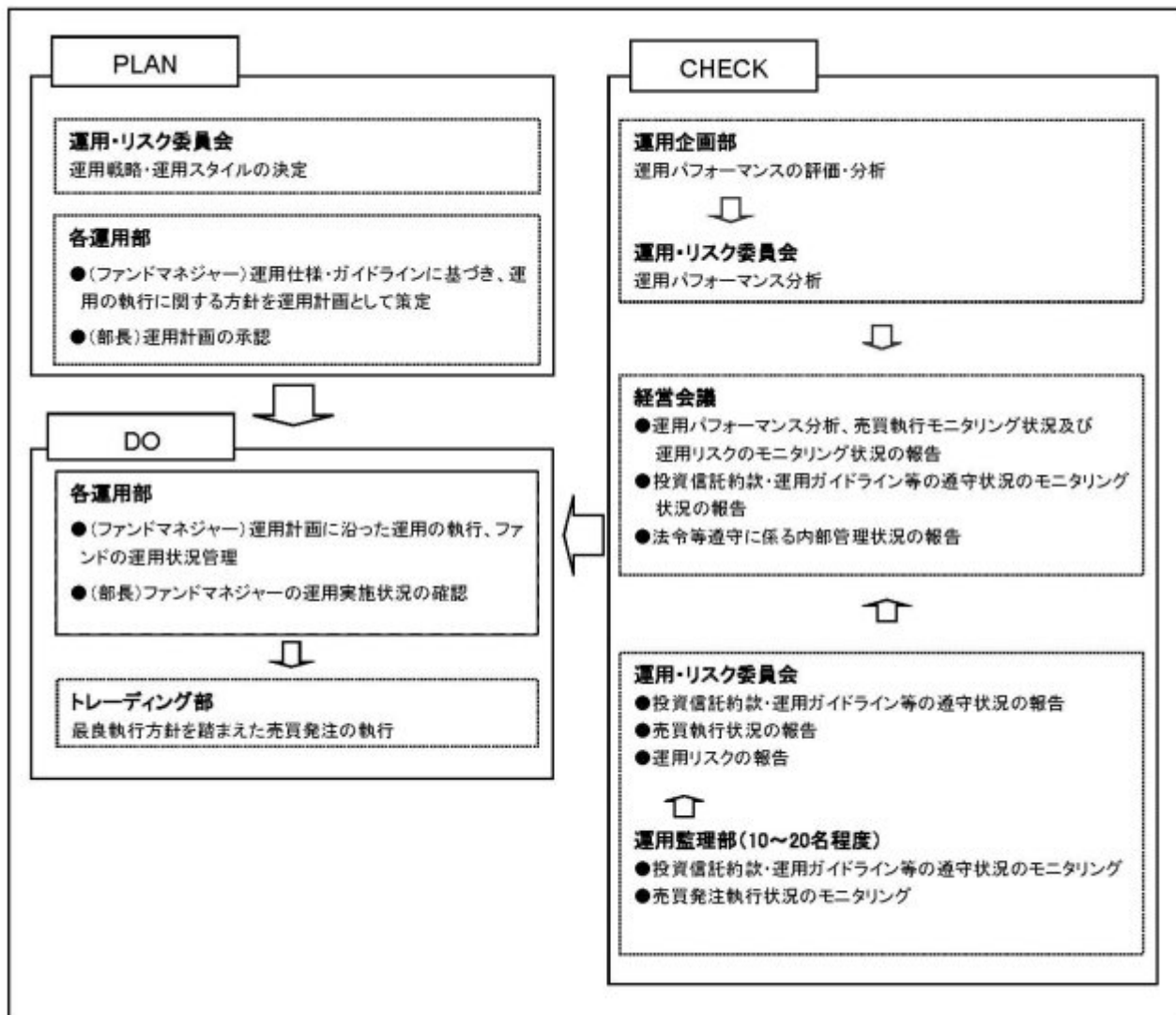
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

（3）【運用体制】

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



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

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

（４）【配分方針】

年１回の毎決算時（決算日は７月２５日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益配分を行う方針です。

- A．分配対象額は、経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）及び売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額。）等の全額とします。なお、前期から繰り越された分配準備積立金及び収益調整金は、全額配分に使用することがあります。
- B．分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。
- C．収益配分にあ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いて運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（５）【投資制限】

< 約款に定める投資制限 >

A．株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

C．新株引受権証券等への投資割合

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

D．同一銘柄の株式への投資割合

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

E．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

G．投資信託証券への投資割合

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

H．投資する株式等の範囲

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、わが国の金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

ロ．上記イ．の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

I．信用取引の指図範囲

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

ロ．上記イ．の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

J．先物取引等の運用指図

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

ロ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

K．スワップ取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

L．金利先渡取引の運用指図

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

ニ．委託会社は、金利先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるとき

は、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

M．有価証券の貸付の指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の a．及び b．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

a．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

b．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ． a．及び b．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが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ます。

N．公社債の空売りの指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下記 O．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができますものとしてします。

ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

O．公社債の借入れの指図及び範囲

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。

ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．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入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

P．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図

委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

Q．再投資の指図

委託会社は、上記 P．の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。

R．資金の借入れ

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

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から

信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金、解約代金及び償還金の合計額を限度とします。

八．収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

二．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

S．受託会社による資金の立替え

イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。

ロ．信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託会社がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

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

T．利害関係人等との取引等

イ．受託会社は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、信託財産と、受託会社（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託会社が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）及び受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下イ．及び下記ロ．において同じ。））、信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託会社における他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記I．からR．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

ロ．受託会社は、受託会社がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託会社又は受託会社の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託会社の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

八．委託会社は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託会社、その取締役、執行役及び委託会社の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）又は委託会社が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記I．からR．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託会社は、委託会社の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。

二．上記イ．から八．までの場合、委託会社及び受託会社は、受益者に対して信託法第31条第3項及び同法第32条第3項の通知は行いません。

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

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

< 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

株価変動リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

ファンドは、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行いますが、ファンドへの入出金、個別銘柄の実質組入比率の違い、売買コストや信託報酬等の影響等から、ファンドの基準価額騰落率と上記インデックスの騰落率は必ずしも一致しません。

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

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

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

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

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の

適用はありません。

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

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

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

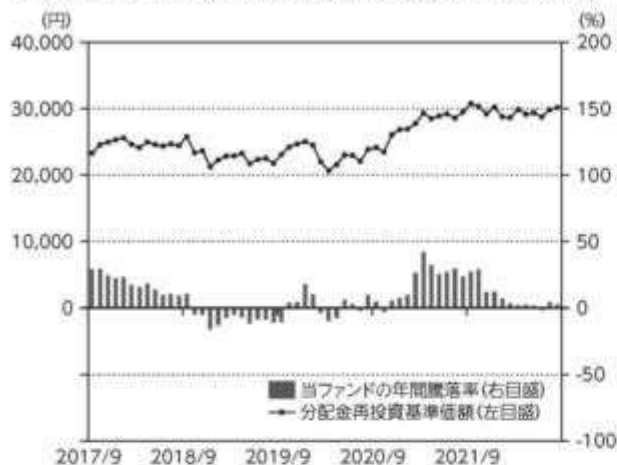
（２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

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

【参考情報】

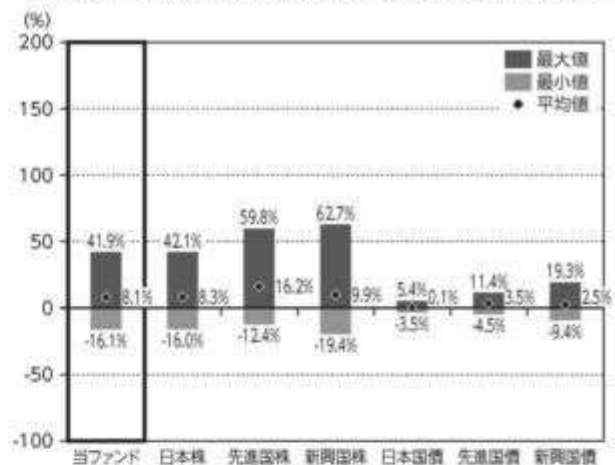
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

*当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



*2017年9月～2022年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX(東証株価指数、配当込み)	TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社JPMリサーチが算出、公表する指数で、日本の株式市場を広く網羅するとともに、投資対象としての適切性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数の指数値及び同指数に係る権利又は商標は、株式会社JPMリサーチ又は株式会社JPMリサーチの関連会社(以下「JPM」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る権利又は商標に関するすべての権利はJPMが有します。JPMは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPMにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPMは責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCI Emerging Markets インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Emerging Markets インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMLRA-BPI国債	NOMLRA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより開発されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのアドバイザーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、遅延又は遅延につき得る責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 J.P. Morgan Global Bond Index インデックス(配当込み、円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・配布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

< 解約手数料 >

ありません。

< 信託財産留保額 >

当ファンドは、ご解約時に信託財産留保額（ ）の控除はありません。ただし、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

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

(3) 【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.154%（税抜0.14%）（ ）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.099% （税抜 0.09%）	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.033% （税抜 0.03%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年率 0.022% （税抜 0.02%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

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

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料
 先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料
 組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料
 財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
 上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

確定拠出年金の課税上の取扱いは、下記の通りとなります。

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

上記は、2022年 8月31日現在のもので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

5【運用状況】

以下は、2022年8月31日現在の状況について記載してあります。

【インデックスコレクション（国内株式）】

（１）【投資状況】

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	48,219,135,339	99.95
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		24,185,819	0.05
合計（純資産総額）		48,243,321,158	100.00

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
------	----	-----	----	-----------	-----------	----------	----------	---------

日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	21,409,792,798	2.2285	47,711,777,649	2.2522	48,219,135,339	99.95
----	-----------	-------------	----------------	--------	----------------	--------	----------------	-------

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

		純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第3期計算期間末	(2013年 7月25日)	4,950,385,305	4,950,385,305	15,402	15,402
第4期計算期間末	(2014年 7月25日)	6,251,826,293	6,251,826,293	16,719	16,719
第5期計算期間末	(2015年 7月27日)	10,200,033,831	10,200,033,831	21,740	21,740
第6期計算期間末	(2016年 7月25日)	13,369,082,820	13,369,082,820	17,936	17,936
第7期計算期間末	(2017年 7月25日)	16,262,626,850	16,262,626,850	22,325	22,325
第8期計算期間末	(2018年 7月25日)	19,530,530,250	19,530,530,250	24,692	24,692
第9期計算期間末	(2019年 7月25日)	19,117,989,629	19,117,989,629	22,712	22,712
第10期計算期間末	(2020年 7月27日)	32,473,093,017	32,473,093,017	23,254	23,254
第11期計算期間末	(2021年 7月26日)	41,290,075,925	41,290,075,925	28,963	28,963
第12期計算期間末	(2022年 7月25日)	47,663,627,119	47,663,627,119	29,881	29,881
	2021年 8月末日	43,841,072,981		29,495	
	9月末日	46,241,392,087		30,776	
	10月末日	45,954,990,023		30,335	
	11月末日	44,333,397,872		29,231	
	12月末日	46,331,906,132		30,245	
	2022年 1月末日	44,285,477,219		28,781	
	2月末日	44,084,102,227		28,651	

3月末日	46,529,671,777		29,878
4月末日	45,743,136,557		29,159
5月末日	46,369,862,680		29,377
6月末日	46,106,171,513		28,768
7月末日	47,668,277,289		29,838
8月末日	48,243,321,158		30,192

【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	0
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	0
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	0
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	0
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	0
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	0
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	0
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	0

【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	73.7
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	8.6
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	30.0
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	17.5
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	24.5
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	10.6
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	8.0
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	2.4
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	24.6
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	3.2

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第3期計算期間	2012年 7月26日～2013年 7月25日	2,497,513,783	1,744,270,721	3,214,035,507
第4期計算期間	2013年 7月26日～2014年 7月25日	2,209,325,421	1,683,922,165	3,739,438,763
第5期計算期間	2014年 7月26日～2015年 7月27日	3,196,935,023	2,244,613,052	4,691,760,734
第6期計算期間	2015年 7月28日～2016年 7月25日	4,461,283,277	1,699,251,185	7,453,792,826
第7期計算期間	2016年 7月26日～2017年 7月25日	2,054,493,182	2,223,946,014	7,284,339,994
第8期計算期間	2017年 7月26日～2018年 7月25日	2,213,016,681	1,587,730,357	7,909,626,318
第9期計算期間	2018年 7月26日～2019年 7月25日	1,929,446,327	1,421,681,154	8,417,391,491
第10期計算期間	2019年 7月26日～2020年 7月27日	8,607,498,848	3,060,539,864	13,964,350,475
第11期計算期間	2020年 7月28日～2021年 7月26日	3,232,378,567	2,940,517,246	14,256,211,796
第12期計算期間	2021年 7月27日～2022年 7月25日	4,447,481,386	2,752,689,695	15,951,003,487

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

(参考)

日本株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	301,943,311,620	99.11
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,722,919,615	0.89
合計(純資産総額)		304,666,231,235	100.00

(注1)国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	2,727,180,000	0.90

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

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	5,481,800	2,273.13	12,460,844,034	2,101.50	11,520,002,700	3.78
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	753,300	12,706.75	9,571,994,775	11,135.00	8,387,995,500	2.75
日本	株式	キーエンス	電気機器	109,000	59,071.81	6,438,827,290	52,840.00	5,759,560,000	1.89
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,942,000	687.43	4,772,139,060	721.10	5,005,876,200	1.64
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,322,600	3,359.97	4,443,896,322	3,769.00	4,984,879,400	1.64
日本	株式	日立製作所	電気機器	578,300	6,302.25	3,644,591,175	6,996.00	4,045,786,800	1.33
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	707,600	5,348.79	3,784,803,804	5,562.00	3,935,671,200	1.29
日本	株式	任天堂	その他製品	67,900	54,403.84	3,694,020,736	56,990.00	3,869,621,000	1.27
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	823,100	5,904.74	4,860,191,494	4,483.00	3,689,957,300	1.21
日本	株式	KDDI	情報・通信業	860,300	3,650.16	3,140,232,648	4,277.00	3,679,503,100	1.21
日本	株式	第一三共	医薬品	872,300	2,622.52	2,287,624,196	4,197.00	3,661,043,100	1.20
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	945,100	3,377.94	3,192,491,094	3,850.00	3,638,635,000	1.19
日本	株式	三菱商事	卸売業	776,500	3,875.60	3,009,403,400	4,564.00	3,543,946,000	1.16
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	76,300	57,824.85	4,412,036,055	44,160.00	3,369,408,000	1.11
日本	株式	HOYA	精密機器	232,100	14,619.74	3,393,241,654	14,250.00	3,307,425,000	1.09
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	879,100	3,382.05	2,973,160,155	3,724.00	3,273,768,400	1.07
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	769,600	4,163.38	3,204,137,248	4,194.00	3,227,702,400	1.06
日本	株式	ダイキン工業	機械	131,300	24,714.71	3,245,041,423	24,485.00	3,214,880,500	1.06
日本	株式	信越化学工業	化学	186,700	18,675.99	3,486,807,333	16,315.00	3,046,010,500	1.00
日本	株式	三井物産	卸売業	858,500	2,854.30	2,450,416,550	3,266.00	2,803,861,000	0.92
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,787,300	1,450.25	2,592,031,825	1,529.50	2,733,675,350	0.90
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	710,000	3,685.58	2,616,761,800	3,843.00	2,728,530,000	0.90
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	330,000	6,813.62	2,248,494,600	7,792.00	2,571,360,000	0.84
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	122,200	18,894.29	2,308,882,238	20,850.00	2,547,870,000	0.84
日本	株式	日本電産	電気機器	267,200	10,954.49	2,927,039,728	9,324.00	2,491,372,800	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	328,000	8,557.28	2,806,787,840	7,554.00	2,477,712,000	0.81
日本	株式	ファナック	電気機器	105,500	22,956.52	2,421,912,860	22,535.00	2,377,442,500	0.78
日本	株式	S M C	機械	35,200	65,272.65	2,297,597,280	66,600.00	2,344,320,000	0.77
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,422,000	1,583.89	2,252,291,580	1,593.50	2,265,957,000	0.74
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	397,100	5,266.23	2,091,219,933	5,533.00	2,197,154,300	0.72

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

□ 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.32

建設業	2.16	
食料品	3.35	
繊維製品	0.47	
パルプ・紙	0.18	
化学	6.11	
医薬品	5.28	
石油・石炭製品	0.54	
ゴム製品	0.72	
ガラス・土石製品	0.72	
鉄鋼	0.81	
非鉄金属	0.74	
金属製品	0.60	
機械	5.32	
電気機器	17.33	
輸送用機器	7.98	
精密機器	2.82	
その他製品	2.39	
電気・ガス業	1.26	
陸運業	3.08	
海運業	0.68	
空運業	0.45	
倉庫・運輸関連業	0.16	
情報・通信業	8.97	
卸売業	5.71	
小売業	4.36	
銀行業	5.17	
証券、商品先物取引業	0.72	
保険業	2.19	
その他金融業	1.15	
不動産業	1.92	
サービス業	5.36	
	小計	99.11
合計		99.11

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの


資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	139円		2,725,919,900	2,727,180,000	0.90

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

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

参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


運用実績

当初設定日：2010年10月20日

作成基準日：2022年8月31日

基準価額・純資産の推移

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間%表示しております。

基準価額 30,192円

純資産総額 482.43億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2018年7月	0円
2019年7月	0円
2020年7月	0円
2021年7月	0円
2022年7月	0円
設定来 分配金合計額	0円

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

主要な資産の状況

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.8%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.8%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.9%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.6%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.6%
日立製作所	日本	株式	電気機器	1.3%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1.3%
任天堂	日本	株式	その他製品	1.3%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	1.2%
KDDI	日本	株式	情報・通信業	1.2%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

※2022年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

第2【管理及び運営】**1【申込（販売）手続等】**

< 申込手続 >

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

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

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

< 申込コース >

当ファンドは、「分配金再投資コース」（ ）専用ファンドです。

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

< 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として午後2時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込単位 >

1円以上1円単位とします。

< 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

< 申込手数料 >

ありません。

< 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

< 受付不可日 >

ありません。

< 申込受付の中止等 >

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

< その他 >

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

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

< 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

2【換金（解約）手続等】

< 一部解約手続 >

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

< 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後2時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

< 解約価額 >

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

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

< 一部解約代金の支払い >

受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

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

< 受付不可日 >

ありません。

< 一部解約受付の中止等 >

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

り消すことができます。

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

<一部解約の制限>

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

<その他>

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

<問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の算出方法>

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

<基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

<主要な投資対象資産の評価方法>

親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド）の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式の評価方法

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

< 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします。（2010年10月20日設定）

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

（4）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年7月26日から翌年7月25日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は2010年10月20日から2011年7月25日までとします。

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

（5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

- ・受益権の口数が30億口を下回るようになった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

委託会社は上記（１）によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約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。

受益者（委託会社及びこの信託の投資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。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記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以上に当たる多数をもって行います。

上記からまでの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記からまでの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

(1) 投資信託約款の変更等

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更すること又は受託会社を同一とする他のファンドとの併合を行うことができます。

- ・ 受益者の利益のため必要と認めるとき
- ・ やむを得ない事情が発生したとき

委託会社は、投資信託約款の変更又はファンドの併合を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続きに従います。

(2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）又はファンドの併合について、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（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、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資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。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記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以上に当たる多数をもって行います。

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

上記からまでの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をし

た場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンド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。

< 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して投資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、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き > に従い、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。

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

< 運用報告書 >

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

< 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

< 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

< 混蔵寄託 >

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

< 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

別して管理することがあります。

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

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

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

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

(2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

(3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

(4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期計算期間(2021年7月27日から2022年7月25日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【インデックスコレクション（国内株式）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 （2021年 7月26日現在）	第12期 （2022年 7月25日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	135,427,130	130,067,794
親投資信託受益証券	41,269,658,681	47,639,638,201
未収入金	-	144,278,860
流動資産合計	41,405,085,811	47,913,984,855
資産合計	41,405,085,811	47,913,984,855
負債の部		
流動負債		
未払解約金	83,161,737	214,972,031
未払受託者報酬	4,429,292	4,932,893
未払委託者報酬	26,575,676	29,597,237
未払利息	243	52
その他未払費用	842,938	855,523
流動負債合計	115,009,886	250,357,736
負債合計	115,009,886	250,357,736
純資産の部		
元本等		
元本	14,256,211,796	15,951,003,487
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	27,033,864,129	31,712,623,632
（分配準備積立金）	7,950,796,458	7,895,748,087
元本等合計	41,290,075,925	47,663,627,119
純資産合計	41,290,075,925	47,663,627,119
負債純資産合計	41,405,085,811	47,913,984,855

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自	2020年 7月28日 至 2021年 7月26日	自	2021年 7月27日 至 2022年 7月25日
営業収益				
受取利息		349		892
有価証券売買等損益		8,048,569,679		1,488,441,125
営業収益合計		8,048,570,028		1,488,442,017
営業費用				
支払利息		37,553		46,002
受託者報酬		8,320,961		9,951,041
委託者報酬		49,925,640		59,706,058
その他費用		1,688,705		1,729,445
営業費用合計		59,972,859		71,432,546
営業利益又は営業損失（ ）		7,988,597,169		1,417,009,471
経常利益又は経常損失（ ）		7,988,597,169		1,417,009,471
当期純利益又は当期純損失（ ）		7,988,597,169		1,417,009,471
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（ ）		1,011,367,093		164,618,901
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		18,508,742,542		27,033,864,129
剰余金増加額又は欠損金減少額		5,524,737,060		8,676,222,623
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		5,524,737,060		8,676,222,623
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,976,845,549		5,249,853,690
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,976,845,549		5,249,853,690
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		27,033,864,129		31,712,623,632

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他	ファンドの計算期間 当ファンドの計算期間は、原則として、毎年7月26日から翌年7月25日までとなっておりますが、前計算期間末日が休業日のため、第12期計算期間は2021年7月27日から2022年7月25日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第11期 (2021年7月26日現在)	第12期 (2022年7月25日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	14,256,211,796口	15,951,003,487口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.8963円 (28,963円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.9881円 (29,881円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第11期 自 2020年7月28日 至 2021年7月26日			第12期 自 2021年7月27日 至 2022年7月25日		
分配金の計算過程			分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	797,774,733円	費用控除後の配当等収益額	A	1,042,929,291円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	4,417,226,619円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	209,461,279円
収益調整金額	C	19,083,067,671円	収益調整金額	C	23,816,875,545円
分配準備積立金額	D	2,735,795,106円	分配準備積立金額	D	6,643,357,517円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	27,033,864,129円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	31,712,623,632円
当ファンドの期末残存口数	F	14,256,211,796口	当ファンドの期末残存口数	F	15,951,003,487口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	18,962円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	19,881円
1万口当たり分配金額	H	-円	1万口当たり分配金額	H	-円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	-円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	-円

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

	第12期 自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2．金融商品の時価等に関する事項

	第12期 (2022年 7月25日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第11期	第12期
	自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26日	自 2021年 7月27日 至 2022年 7月25日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	13,964,350,475円	14,256,211,796円
期中追加設定元本額	3,232,378,567円	4,447,481,386円
期中一部解約元本額	2,940,517,246円	2,752,689,695円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第11期 (2021年 7月26日現在)	第12期 (2022年 7月25日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	7,766,722,024	1,481,390,525
合計	7,766,722,024	1,481,390,525

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	21,376,486,674	47,639,638,201	
合計		21,376,486,674	47,639,638,201	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

項目	2022年 7月25日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,374,112,634
株式	299,712,490,320
派生商品評価勘定	42,747,300
未収入金	758,686,887
未収配当金	427,539,309
差入委託証拠金	66,107,300
流動資産合計	302,381,683,750
資産合計	302,381,683,750
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,814,800
前受金	38,951,200
未払金	438,450
未払解約金	491,816,603
未払利息	559
流動負債合計	535,021,612
負債合計	535,021,612
純資産の部	
元本等	
元本	135,440,792,758
剰余金	
剰余金又は欠損金()	166,405,869,380
元本等合計	301,846,662,138
純資産合計	301,846,662,138
負債純資産合計	302,381,683,750

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2022年 7月25日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。 当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2022年 7月25日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	135,440,792,758口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.2286円 (1万口当たり純資産額) (22,286円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

	2022年 7月25日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2022年 7月25日現在	
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理（流動性リスク管理等を含む）と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年 7月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2022年 7月25日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 7月27日
期首元本額	133,516,172,873円
期中追加設定元本額	10,967,966,860円
期中一部解約元本額	9,043,346,975円
期末元本額	135,440,792,758円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	614,431,733円
D C 日本株式インデックスファンド	289,015,491円
D C 日本株式インデックスファンド L	53,888,428,077円
D C 日本株式インデックスファンド A	664,326,423円
D C バランスファンド 3 0	2,433,151,911円
D C バランスファンド 5 0	3,810,580,363円
D C バランスファンド 7 0	2,315,813,582円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	576,228,395円
日本株式インデックス e	1,454,519,313円
インデックスコレクション（国内株式）	21,376,486,674円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	12,360,581,100円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	2,970,071,322円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	2,703,989,973円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,503,504,901円
日本株式パッシブファンド私募 A（適格機関投資家専用）	2,747,031,538円
日本株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	945,544,352円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	47,354,650円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	530,435,125円
V A バランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	65,889,800円
V A バランスファンド（株 5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	130,918,304円
V A バランスファンド（株 6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	87,710,306円
バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	670,764,688円
バランス V A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	416,729,867円
バランス V A 5 0 L（適格機関投資家専用）	7,274,523,570円
バランス V A 7 5（適格機関投資家専用）	696,113,028円

区分	2022年 7月25日現在
V Aバランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	67,576,872円
V Aポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	1,188,492,618円
V Aポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	24,764,450円
バランスV A 4 0（適格機関投資家専用）	144,874,181円
バランスファンドV A（適格機関投資家専用）	1,900,184,826円
V Aバランスファンド 2（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	52,171,958円
V Aバランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	53,497,721円
V Aファンド 2 5（適格機関投資家専用）	20,318,789円
バランスファンドV A 2（適格機関投資家専用）	586,145,334円
バランスV A 2 5 L（適格機関投資家専用）	261,702,011円
バランスファンドV A 3（適格機関投資家専用）	4,326,926,745円
世界バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	81,448,785円
国内バランスV A 3 0（適格機関投資家専用）	34,041,302円
国内バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	8,081,091円
V Aバランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	114,113,728円
私募日本株式インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	2,307,861円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年 7月25日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	2,448,030,642	
合計	2,448,030,642	

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

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2022年 7月25日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,846,243,800	-	1,885,195,000	38,951,200
	合計	1,846,243,800	-	1,885,195,000	38,951,200

(注)1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,300	3,630.00	19,239,000	
日本水産	151,300	595.00	90,023,500	
マルハニチロ	21,600	2,489.00	53,762,400	
雪国まいたけ	11,900	955.00	11,364,500	
カネコ種苗	4,600	1,649.00	7,585,400	
サカタのタネ	17,700	4,930.00	87,261,000	
ホクト	12,400	1,929.00	23,919,600	
ホクリヨウ	2,200	614.00	1,350,800	
住石ホールディングス	28,500	212.00	6,042,000	
日鉄鉱業	3,100	5,360.00	16,616,000	
三井松島ホールディングス	6,800	3,175.00	21,590,000	
I N P E X	568,200	1,394.00	792,070,800	
石油資源開発	19,200	3,270.00	62,784,000	
K & O エナジーグループ	6,300	1,552.00	9,777,600	
ショーボンドホールディングス	19,000	5,720.00	108,680,000	
ミライト・ワン	52,500	1,683.00	88,357,500	
タマホーム	9,900	2,504.00	24,789,600	
サンヨーホームズ	1,900	711.00	1,350,900	
日本アクア	6,500	604.00	3,926,000	
ファーストコーポレーション	4,000	735.00	2,940,000	
ベステラ	3,300	1,138.00	3,755,400	
R o b o t H o m e	27,200	200.00	5,440,000	
キャンディル	2,400	554.00	1,329,600	
ダイセキ環境ソリューション	3,100	836.00	2,591,600	
第一カッター興業	3,600	1,329.00	4,784,400	
安藤・間	74,200	874.00	64,850,800	
東急建設	43,700	636.00	27,793,200	
コムシスホールディングス	52,500	2,656.00	139,440,000	
ピーアールホールディングス	20,500	348.00	7,134,000	
高松コンストラクショングループ	10,400	2,118.00	22,027,200	
東建コーポレーション	4,500	8,760.00	39,420,000	
ソネック	1,700	1,002.00	1,703,400	
ヤマウラ	7,100	959.00	6,808,900	
オリエンタル白石	54,800	245.00	13,426,000	

大成建設	104,700	4,285.00	448,639,500	
大林組	349,400	982.00	343,110,800	
清水建設	323,100	768.00	248,140,800	
飛島建設	10,100	1,067.00	10,776,700	
長谷工コーポレーション	100,800	1,638.00	165,110,400	
松井建設	12,500	641.00	8,012,500	
銭高組	1,400	3,245.00	4,543,000	
鹿島建設	256,000	1,518.00	388,608,000	
不動テトラ	8,000	1,654.00	13,232,000	
大末建設	4,000	1,565.00	6,260,000	
鉄建建設	7,600	1,833.00	13,930,800	
西松建設	22,800	3,995.00	91,086,000	
三井住友建設	84,800	458.00	38,838,400	
大豊建設	5,500	4,310.00	23,705,000	
佐田建設	8,100	453.00	3,669,300	
ナカノフドー建設	9,000	324.00	2,916,000	
奥村組	18,700	2,975.00	55,632,500	
東鉄工業	14,800	2,372.00	35,105,600	
イチケン	2,700	1,815.00	4,900,500	
富士ピー・エス	4,900	461.00	2,258,900	
浅沼組	4,200	5,420.00	22,764,000	
戸田建設	144,200	719.00	103,679,800	
熊谷組	18,600	2,835.00	52,731,000	
北野建設	2,300	2,133.00	4,905,900	
植木組	3,100	1,368.00	4,240,800	
矢作建設工業	15,000	808.00	12,120,000	
ピーエス三菱	12,400	631.00	7,824,400	
日本ハウスホールディングス	25,300	411.00	10,398,300	
大東建託	38,500	12,470.00	480,095,000	
新日本建設	16,000	743.00	11,888,000	
東亜道路工業	1,900	5,960.00	11,324,000	
日本道路	3,300	6,950.00	22,935,000	
東亜建設工業	8,400	2,602.00	21,856,800	
日本国土開発	29,300	597.00	17,492,100	
若築建設	5,800	2,368.00	13,734,400	
東洋建設	42,200	864.00	36,460,800	
五洋建設	138,500	730.00	101,105,000	
世紀東急工業	18,100	822.00	14,878,200	
福田組	4,000	4,895.00	19,580,000	
住友林業	82,400	2,100.00	173,040,000	
日本基礎技術	9,200	594.00	5,464,800	
巴コーポレーション	13,700	457.00	6,260,900	

大和ハウス工業	297,800	3,287.00	978,868,600
ライト工業	20,700	1,924.00	39,826,800
積水ハウス	357,100	2,440.50	871,502,550
日特建設	7,800	871.00	6,793,800
北陸電気工事	6,700	805.00	5,393,500
ユアテック	21,500	742.00	15,953,000
日本リーテック	7,200	976.00	7,027,200
四電工	3,600	1,813.00	6,526,800
中電工	15,200	2,162.00	32,862,400
関電工	61,200	865.00	52,938,000
きんでん	76,400	1,620.00	123,768,000
東京エネシス	11,100	1,056.00	11,721,600
トーエネック	3,800	3,800.00	14,440,000
住友電設	9,300	2,678.00	24,905,400
日本電設工業	16,000	1,836.00	29,376,000
エクシオグループ	52,200	2,207.00	115,205,400
新日本空調	8,100	1,912.00	15,487,200
九電工	23,800	2,780.00	66,164,000
三機工業	24,400	1,674.00	40,845,600
日揮ホールディングス	106,300	1,622.00	172,418,600
中外炉工業	3,500	1,688.00	5,908,000
ヤマト	9,000	772.00	6,948,000
太平電業	6,800	3,060.00	20,808,000
高砂熱学工業	28,800	1,698.00	48,902,400
三晃金属工業	1,500	2,665.00	3,997,500
朝日工業社	4,600	1,913.00	8,799,800
明星工業	18,900	733.00	13,853,700
大気社	15,700	3,270.00	51,339,000
ダイダン	7,100	2,215.00	15,726,500
日比谷総合設備	10,200	1,994.00	20,338,800
フィル・カンパニー	1,900	1,227.00	2,331,300
テスホールディングス	10,500	1,196.00	12,558,000
インフロニア・ホールディングス	131,000	983.00	128,773,000
東洋エンジニアリング	15,800	641.00	10,127,800
レイズネクスト	16,100	1,218.00	19,609,800
ニッポン	29,400	1,631.00	47,951,400
日清製粉グループ本社	113,400	1,652.00	187,336,800
日東富士製粉	1,700	4,645.00	7,896,500
昭和産業	9,500	2,594.00	24,643,000
鳥越製粉	8,700	661.00	5,750,700
中部飼料	12,400	1,104.00	13,689,600
フィード・ワン	14,300	694.00	9,924,200

東洋精糖	2,000	924.00	1,848,000
日本甜菜製糖	6,300	1,705.00	10,741,500
D M三井製糖ホールディングス	9,700	1,919.00	18,614,300
塩水港精糖	14,300	208.00	2,974,400
日新製糖	5,700	1,785.00	10,174,500
森永製菓	24,200	4,340.00	105,028,000
中村屋	2,400	3,200.00	7,680,000
江崎グリコ	28,100	3,980.00	111,838,000
名糖産業	4,300	1,698.00	7,301,400
井村屋グループ	5,800	2,296.00	13,316,800
不二家	6,700	2,484.00	16,642,800
山崎製パン	73,900	1,664.00	122,969,600
第一屋製パン	2,300	493.00	1,133,900
モロゾフ	3,600	3,620.00	13,032,000
亀田製菓	6,200	4,705.00	29,171,000
寿スピリッツ	10,400	6,580.00	68,432,000
カルビー	54,900	2,876.00	157,892,400
森永乳業	20,400	5,120.00	104,448,000
六甲バター	8,000	1,408.00	11,264,000
ヤクルト本社	76,500	7,920.00	605,880,000
明治ホールディングス	66,300	7,040.00	466,752,000
雪印メグミルク	26,400	1,882.00	49,684,800
プリマハム	15,100	2,310.00	34,881,000
日本ハム	42,200	4,160.00	175,552,000
林兼産業	3,700	476.00	1,761,200
丸大食品	10,900	1,594.00	17,374,600
S Foods	10,800	3,065.00	33,102,000
柿安本店	4,200	2,386.00	10,021,200
伊藤ハム米久ホールディングス	77,500	683.00	52,932,500
サッポロホールディングス	35,200	2,962.00	104,262,400
アサヒグループホールディングス	245,500	4,672.00	1,146,976,000
キリンホールディングス	442,600	2,198.00	972,834,800
宝ホールディングス	67,000	1,062.00	71,154,000
オエノンホールディングス	31,800	307.00	9,762,600
養命酒製造	3,200	1,807.00	5,782,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	76,800	1,535.00	117,888,000
サントリー食品インターナショナル	80,600	5,250.00	423,150,000
ダイドーグループホールディングス	6,200	5,210.00	32,302,000
伊藤園	36,600	6,310.00	230,946,000
キーコーヒー	11,000	2,133.00	23,463,000
ユニカフェ	3,600	916.00	3,297,600
ジャパンフーズ	1,700	1,126.00	1,914,200

日清オイリオグループ	13,800	3,220.00	44,436,000
不二製油グループ本社	26,100	2,289.00	59,742,900
かどや製油	1,100	3,585.00	3,943,500
J・オイルミルズ	11,200	1,624.00	18,188,800
キッコーマン	72,200	8,120.00	586,264,000
味の素	240,000	3,492.00	838,080,000
ブルドックソース	4,300	1,898.00	8,161,400
キューピー	52,700	2,316.00	122,053,200
ハウス食品グループ本社	37,500	2,979.00	111,712,500
カゴメ	45,700	3,420.00	156,294,000
焼津水産化学工業	4,900	920.00	4,508,000
アリアケジャパン	11,000	5,360.00	58,960,000
ピエトロ	1,600	1,820.00	2,912,000
エバラ食品工業	2,600	3,075.00	7,995,000
やまみ	1,000	1,605.00	1,605,000
ニチレイ	44,900	2,418.00	108,568,200
東洋水産	53,700	5,400.00	289,980,000
イトアンドホールディングス	4,500	2,380.00	10,710,000
大冷	1,300	1,904.00	2,475,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,200	467.00	2,895,400
日清食品ホールディングス	38,800	9,650.00	374,420,000
永谷園ホールディングス	5,300	2,034.00	10,780,200
一正蒲鉾	4,700	790.00	3,713,000
フジッコ	11,200	2,003.00	22,433,600
ロック・フィールド	12,000	1,514.00	18,168,000
日本たばこ産業	645,700	2,411.00	1,556,782,700
ケンコーマヨネーズ	6,100	1,500.00	9,150,000
わらべや日洋ホールディングス	7,200	2,209.00	15,904,800
なとり	6,700	2,076.00	13,909,200
イフジ産業	2,100	939.00	1,971,900
ピクルスコーポレーション	5,700	1,148.00	6,543,600
ファーマフーズ	15,200	1,423.00	21,629,600
ユーグレナ	62,100	891.00	55,331,100
紀文食品	9,400	998.00	9,381,200
ミヨシ油脂	4,200	1,019.00	4,279,800
理研ビタミン	8,500	1,773.00	15,070,500
片倉工業	10,700	2,066.00	22,106,200
ゲンゼ	6,900	3,875.00	26,737,500
東洋紡	46,800	1,019.00	47,689,200
ユニチカ	33,700	235.00	7,919,500
富士紡ホールディングス	4,900	3,435.00	16,831,500
倉敷紡績	8,400	2,108.00	17,707,200

シキボウ	6,200	901.00	5,586,200
日本毛織	29,300	1,048.00	30,706,400
トーア紡コーポレーション	4,300	367.00	1,578,100
帝国繊維	12,500	1,711.00	21,387,500
帝人	103,500	1,439.00	148,936,500
東レ	729,700	733.60	535,307,920
住江織物	2,000	1,675.00	3,350,000
日本フェルト	7,400	420.00	3,108,000
イチカワ	1,600	1,394.00	2,230,400
日東製網	1,300	1,329.00	1,727,700
アツギ	8,600	485.00	4,171,000
ダイニック	3,800	639.00	2,428,200
セーレン	21,800	2,063.00	44,973,400
ソトー	4,400	840.00	3,696,000
東海染工	1,500	1,140.00	1,710,000
小松マテーレ	17,800	1,074.00	19,117,200
ワコールホールディングス	24,100	2,225.00	53,622,500
ホギメディカル	14,600	3,470.00	50,662,000
T S Iホールディングス	36,100	325.00	11,732,500
マツオカコーポレーション	3,500	933.00	3,265,500
ワールド	15,500	1,317.00	20,413,500
三陽商会	5,200	896.00	4,659,200
ナイガイ	4,400	273.00	1,201,200
オンワードホールディングス	65,200	250.00	16,300,000
ルックホールディングス	3,800	1,668.00	6,338,400
ゴールドウイン	19,500	8,300.00	161,850,000
デサント	20,100	2,945.00	59,194,500
キング	5,800	499.00	2,894,200
ヤマトインターナショナル	9,200	279.00	2,566,800
特種東海製紙	6,100	3,190.00	19,459,000
王子ホールディングス	453,400	566.00	256,624,400
日本製紙	47,600	986.00	46,933,600
三菱製紙	15,000	302.00	4,530,000
北越コーポレーション	70,100	706.00	49,490,600
中越パルプ工業	4,500	919.00	4,135,500
巴川製紙所	3,500	688.00	2,408,000
大王製紙	50,400	1,454.00	73,281,600
阿波製紙	2,700	300.00	810,000
レンゴー	90,900	763.00	69,356,700
トーモク	5,800	1,545.00	8,961,000
ザ・パック	7,400	2,474.00	18,307,600
北の達人コーポレーション	42,000	235.00	9,870,000

クラレ	158,600	1,088.00	172,556,800
旭化成	726,900	1,084.00	787,959,600
共和レザー	6,400	571.00	3,654,400
昭和電工	103,300	2,190.00	226,227,000
住友化学	801,700	523.00	419,289,100
住友精化	4,700	2,997.00	14,085,900
日産化学	52,900	6,810.00	360,249,000
ラサ工業	4,100	1,875.00	7,687,500
クレハ	8,500	10,190.00	86,615,000
多木化学	3,900	4,725.00	18,427,500
テイカ	6,700	1,229.00	8,234,300
石原産業	21,100	1,037.00	21,880,700
片倉コープアグリ	2,600	1,245.00	3,237,000
日本曹達	12,900	4,255.00	54,889,500
東ソー	145,300	1,756.00	255,146,800
トクヤマ	34,900	1,795.00	62,645,500
セントラル硝子	17,600	3,235.00	56,936,000
東亜合成	56,000	1,061.00	59,416,000
大阪ソーダ	9,000	3,360.00	30,240,000
関東電化工業	21,400	900.00	19,260,000
デンカ	39,600	3,395.00	134,442,000
信越化学工業	186,300	16,145.00	3,007,813,500
日本カーバイド工業	4,200	1,374.00	5,770,800
堺化学工業	7,600	1,915.00	14,554,000
第一稀元素化学工業	10,000	1,186.00	11,860,000
エア・ウォーター	94,100	1,790.00	168,439,000
日本酸素ホールディングス	96,800	2,190.00	211,992,000
日本化学工業	3,300	2,001.00	6,603,300
東邦アセチレン	2,300	1,132.00	2,603,600
日本パーカラライジング	49,400	966.00	47,720,400
高压ガス工業	16,600	689.00	11,437,400
チタン工業	1,400	1,630.00	2,282,000
四国化成工業	13,600	1,320.00	17,952,000
戸田工業	2,500	2,361.00	5,902,500
ステラ ケミファ	5,900	2,500.00	14,750,000
保土谷化学工業	3,100	3,460.00	10,726,000
日本触媒	16,700	5,410.00	90,347,000
大日精化工業	8,300	1,822.00	15,122,600
カネカ	25,300	3,550.00	89,815,000
三菱瓦斯化学	92,500	1,950.00	180,375,000
三井化学	91,500	2,835.00	259,402,500
J S R	109,500	3,645.00	399,127,500

東京応化工業	17,500	6,880.00	120,400,000
大阪有機化学工業	8,300	2,472.00	20,517,600
三菱ケミカルグループ	729,400	745.40	543,694,760
KHネオケム	18,000	2,545.00	45,810,000
ダイセル	158,000	856.00	135,248,000
住友ベークライト	16,600	4,300.00	71,380,000
積水化学工業	224,500	1,911.00	429,019,500
日本ゼオン	88,300	1,434.00	126,622,200
アイカ工業	27,700	3,015.00	83,515,500
UBE	55,400	2,102.00	116,450,800
積水樹脂	16,100	1,766.00	28,432,600
タキロンシーアイ	25,400	561.00	14,249,400
旭有機材	6,600	2,082.00	13,741,200
ニチバン	6,200	1,661.00	10,298,200
リケンテクノス	23,900	463.00	11,065,700
大倉工業	5,100	1,754.00	8,945,400
積水化成成品工業	14,000	417.00	5,838,000
群栄化学工業	2,300	2,592.00	5,961,600
タイガースポリマー	5,600	431.00	2,413,600
ミライアル	3,800	1,791.00	6,805,800
ダイキアクシス	4,600	715.00	3,289,000
ダイキョーニシカワ	24,800	557.00	13,813,600
竹本容器	4,200	778.00	3,267,600
森六ホールディングス	5,700	1,880.00	10,716,000
恵和	3,200	3,525.00	11,280,000
日本化薬	82,600	1,144.00	94,494,400
カーリットホールディングス	9,900	670.00	6,633,000
日本精化	7,600	1,992.00	15,139,200
扶桑化学工業	9,300	3,450.00	32,085,000
トリケミカル研究所	12,100	2,186.00	26,450,600
ADEKA	46,400	2,400.00	111,360,000
日油	33,900	5,320.00	180,348,000
新日本理化	16,700	286.00	4,776,200
ハリマ化成グループ	7,800	765.00	5,967,000
花王	247,700	5,793.00	1,434,926,100
第一工業製薬	4,000	2,497.00	9,988,000
石原ケミカル	5,500	1,302.00	7,161,000
日華化学	4,000	818.00	3,272,000
ニイタカ	2,200	2,370.00	5,214,000
三洋化成工業	7,000	4,770.00	33,390,000
有機合成薬品工業	8,200	271.00	2,222,200
大日本塗料	13,300	732.00	9,735,600

日本ペイントホールディングス	441,500	1,039.00	458,718,500
関西ペイント	101,600	1,936.00	196,697,600
神東塗料	9,200	148.00	1,361,600
中国塗料	25,400	882.00	22,402,800
日本特殊塗料	7,000	981.00	6,867,000
藤倉化成	14,600	490.00	7,154,000
太陽ホールディングス	17,300	2,867.00	49,599,100
D I C	42,500	2,476.00	105,230,000
サカタインクス	20,200	988.00	19,957,600
東洋インキS Cホールディングス	21,700	1,945.00	42,206,500
T & K T O K A	9,500	870.00	8,265,000
富士フィルムホールディングス	210,900	7,591.00	1,600,941,900
資生堂	223,500	5,486.00	1,226,121,000
ライオン	119,900	1,554.00	186,324,600
高砂香料工業	6,800	2,639.00	17,945,200
マンダム	23,400	1,651.00	38,633,400
ミルボン	14,800	5,250.00	77,700,000
ファンケル	48,600	2,563.00	124,561,800
コーセー	22,600	12,050.00	272,330,000
コタ	8,400	1,622.00	13,624,800
シーボン	1,600	1,692.00	2,707,200
ポーラ・オルビスホールディングス	51,200	1,641.00	84,019,200
ノエビアホールディングス	8,900	5,960.00	53,044,000
アジュバンホールディングス	2,700	979.00	2,643,300
新日本製薬	5,700	1,603.00	9,137,100
エステー	7,700	1,568.00	12,073,600
アグロ カネショウ	4,000	1,363.00	5,452,000
コニシ	18,200	1,624.00	29,556,800
長谷川香料	20,700	3,080.00	63,756,000
星光P M C	6,800	540.00	3,672,000
小林製薬	33,600	9,030.00	303,408,000
荒川化学工業	8,500	1,027.00	8,729,500
メック	8,200	2,340.00	19,188,000
日本高純度化学	2,800	2,397.00	6,711,600
タカラバイオ	31,400	2,187.00	68,671,800
J C U	12,300	3,575.00	43,972,500
新田ゼラチン	6,800	620.00	4,216,000
O A T アグリオ	4,900	1,600.00	7,840,000
デクセリアルズ	31,200	3,855.00	120,276,000
アース製薬	9,900	5,480.00	54,252,000
北興化学工業	10,100	952.00	9,615,200
大成ラミック	3,200	2,753.00	8,809,600

クミアイ化学工業	44,700	1,009.00	45,102,300
日本農薬	21,400	669.00	14,316,600
アキレス	7,700	1,410.00	10,857,000
有沢製作所	16,300	1,018.00	16,593,400
日東電工	72,500	8,960.00	649,600,000
レック	14,200	719.00	10,209,800
三光合成	13,700	393.00	5,384,100
きもと	18,400	223.00	4,103,200
藤森工業	9,300	3,625.00	33,712,500
前澤化成工業	7,000	1,343.00	9,401,000
未来工業	4,300	1,569.00	6,746,700
ウェーブロックホールディングス	4,600	626.00	2,879,600
JSP	7,000	1,490.00	10,430,000
エフピコ	22,100	3,150.00	69,615,000
天馬	9,400	2,323.00	21,836,200
信越ポリマー	21,500	1,263.00	27,154,500
東リ	27,400	210.00	5,754,000
ニフコ	40,000	3,280.00	131,200,000
バルカー	9,700	2,715.00	26,335,500
ユニ・チャーム	231,300	4,891.00	1,131,288,300
ショーエイコーポレーション	3,200	584.00	1,868,800
協和キリン	120,700	3,200.00	386,240,000
武田薬品工業	943,000	4,001.00	3,772,943,000
アステラス製薬	1,025,800	2,140.00	2,195,212,000
住友ファーマ	74,100	1,074.00	79,583,400
塩野義製薬	139,300	6,936.00	966,184,800
わかもと製薬	11,700	261.00	3,053,700
日本新薬	26,200	8,260.00	216,412,000
中外製薬	375,300	3,706.00	1,390,861,800
科研製薬	17,100	4,020.00	68,742,000
エーザイ	132,600	6,107.00	809,788,200
ロート製薬	57,200	4,075.00	233,090,000
小野薬品工業	231,300	3,860.00	892,818,000
久光製薬	25,400	3,625.00	92,075,000
持田製薬	13,500	3,350.00	45,225,000
参天製薬	209,000	1,103.00	230,527,000
扶桑薬品工業	3,900	2,176.00	8,486,400
日本ケミファ	1,300	1,882.00	2,446,600
ツムラ	34,300	3,235.00	110,960,500
日医工	34,000	370.00	12,580,000
キッセイ薬品工業	17,400	3,080.00	53,592,000
生化学工業	21,200	882.00	18,698,400

栄研化学	17,800	1,932.00	34,389,600
日水製薬	4,400	1,713.00	7,537,200
鳥居薬品	6,400	3,285.00	21,024,000
JCRファーマ	33,800	2,712.00	91,665,600
東和薬品	17,300	2,623.00	45,377,900
富士製薬工業	6,500	1,013.00	6,584,500
ゼリア新薬工業	17,800	2,251.00	40,067,800
第一三共	870,300	3,525.00	3,067,807,500
キョーリン製薬ホールディングス	21,700	1,884.00	40,882,800
大幸薬品	18,100	650.00	11,765,000
ダイト	7,500	2,700.00	20,250,000
大塚ホールディングス	228,600	4,956.00	1,132,941,600
大正製薬ホールディングス	22,200	5,480.00	121,656,000
ペプチドリーム	63,000	1,577.00	99,351,000
あすか製薬ホールディングス	11,400	1,079.00	12,300,600
サワイグループホールディングス	23,000	4,470.00	102,810,000
日本コークス工業	101,400	119.00	12,066,600
ニチレキ	13,000	1,400.00	18,200,000
ユシロ化学工業	5,700	914.00	5,209,800
ビーピー・カストロール	4,300	1,130.00	4,859,000
富士石油	26,200	311.00	8,148,200
MORESCO	4,000	1,174.00	4,696,000
出光興産	122,100	3,235.00	394,993,500
ENEOSホールディングス	1,804,900	501.30	904,796,370
コスモエネルギーホールディングス	47,400	3,585.00	169,929,000
横浜ゴム	56,800	1,988.00	112,918,400
TOYO TIRE	57,400	1,818.00	104,353,200
ブリヂストン	319,000	5,167.00	1,648,273,000
住友ゴム工業	98,000	1,240.00	121,520,000
藤倉コンポジット	9,600	865.00	8,304,000
オカモト	5,500	3,900.00	21,450,000
フコク	5,200	989.00	5,142,800
ニッタ	11,300	2,921.00	33,007,300
住友理工	23,300	623.00	14,515,900
三ツ星ベルト	14,600	3,045.00	44,457,000
バンドー化学	19,300	983.00	18,971,900
日東紡績	14,900	2,321.00	34,582,900
AGC	101,700	4,815.00	489,685,500
日本板硝子	54,200	392.00	21,246,400
石塚硝子	1,900	1,608.00	3,055,200
日本山村硝子	4,300	682.00	2,932,600
日本電気硝子	44,500	2,640.00	117,480,000

オハラ	4,800	1,218.00	5,846,400
住友大阪セメント	17,900	3,560.00	63,724,000
太平洋セメント	68,200	2,046.00	139,537,200
日本ヒューム	10,000	670.00	6,700,000
日本コンクリート工業	21,800	275.00	5,995,000
三谷セキサン	4,900	4,025.00	19,722,500
アジアパイルホールディングス	17,200	490.00	8,428,000
東海カーボン	92,200	1,042.00	96,072,400
日本カーボン	6,200	4,035.00	25,017,000
東洋炭素	7,100	2,952.00	20,959,200
ノリタケカンパニーリミテド	6,100	4,250.00	25,925,000
TOTO	72,500	4,520.00	327,700,000
日本碍子	118,200	1,943.00	229,662,600
日本特殊陶業	83,700	2,639.00	220,884,300
MARUWA	4,200	15,990.00	67,158,000
品川リフラクトリーズ	2,800	3,655.00	10,234,000
黒崎播磨	2,100	4,410.00	9,261,000
ヨータイ	7,700	1,514.00	11,657,800
東京窯業	12,100	279.00	3,375,900
ニッカトー	5,100	461.00	2,351,100
フジインコーポレーテッド	9,600	5,660.00	54,336,000
クニミネ工業	3,900	940.00	3,666,000
エーアンドエーマテリアル	2,000	857.00	1,714,000
ニチアス	25,300	2,402.00	60,770,600
ニチハ	15,300	2,786.00	42,625,800
日本製鉄	495,600	1,947.50	965,181,000
神戸製鋼所	206,800	607.00	125,527,600
中山製鋼所	16,500	435.00	7,177,500
合同製鐵	5,800	1,446.00	8,386,800
JFEホールディングス	274,700	1,468.00	403,259,600
東京製鐵	34,700	1,390.00	48,233,000
共英製鋼	11,700	1,419.00	16,602,300
大和工業	19,400	4,500.00	87,300,000
東京鐵鋼	4,900	1,301.00	6,374,900
大阪製鐵	6,300	1,419.00	8,939,700
淀川製鋼所	13,000	2,370.00	30,810,000
丸一鋼管	34,400	2,964.00	101,961,600
モリ工業	2,900	2,570.00	7,453,000
大同特殊鋼	16,200	3,715.00	60,183,000
日本高周波鋼業	4,500	323.00	1,453,500
日本冶金工業	8,100	2,190.00	17,739,000
山陽特殊製鋼	10,200	1,871.00	19,084,200

愛知製鋼	6,700	2,143.00	14,358,100
日立金属	127,800	2,045.00	261,351,000
日本金属	3,000	1,184.00	3,552,000
大太平洋金属	7,300	2,429.00	17,731,700
新日本電工	65,800	356.00	23,424,800
栗本鐵工所	4,900	1,668.00	8,173,200
虹技	1,500	977.00	1,465,500
三菱製鋼	7,700	942.00	7,253,400
日亜鋼業	13,700	263.00	3,603,100
日本精線	1,900	4,470.00	8,493,000
エンビプロ・ホールディングス	7,900	762.00	6,019,800
シンニッタン	14,500	221.00	3,204,500
新家工業	2,500	1,445.00	3,612,500
大紀アルミニウム工業所	14,700	1,213.00	17,831,100
日本軽金属ホールディングス	30,100	1,569.00	47,226,900
三井金属鉱業	32,000	3,135.00	100,320,000
東邦亜鉛	6,100	2,124.00	12,956,400
三菱マテリアル	68,600	1,992.00	136,651,200
住友金属鉱山	130,000	4,118.00	535,340,000
D O W Aホールディングス	27,700	4,780.00	132,406,000
古河機械金属	18,100	1,240.00	22,444,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,700	2,826.00	38,716,200
東邦チタニウム	21,300	2,343.00	49,905,900
U A C J	16,200	2,160.00	34,992,000
C Kサンエツ	2,200	4,220.00	9,284,000
古河電気工業	34,200	2,291.00	78,352,200
住友電気工業	414,100	1,503.00	622,392,300
フジクラ	132,300	787.00	104,120,100
昭和電線ホールディングス	10,400	1,599.00	16,629,600
東京特殊電線	1,500	2,297.00	3,445,500
タツタ電線	21,000	470.00	9,870,000
カナレ電気	1,800	1,525.00	2,745,000
平河ヒューテック	6,600	1,093.00	7,213,800
リョービ	12,200	1,107.00	13,505,400
アーレスティ	12,800	397.00	5,081,600
アサヒホールディングス	47,500	2,069.00	98,277,500
稲葉製作所	6,000	1,391.00	8,346,000
宮地エンジニアリンググループ	3,400	3,340.00	11,356,000
トーカロ	30,600	1,283.00	39,259,800
アルファC o	4,200	1,017.00	4,271,400
S U M C O	195,700	1,819.00	355,978,300
川田テクノロジーズ	2,200	3,725.00	8,195,000

RS Technologies	3,900	5,970.00	23,283,000
ジェイテックコーポレーション	1,500	2,069.00	3,103,500
信和	7,400	785.00	5,809,000
東洋製罐グループホールディングス	60,500	1,535.00	92,867,500
ホッカンホールディングス	5,500	1,254.00	6,897,000
コロナ	5,700	851.00	4,850,700
横河ブリッジホールディングス	17,000	2,027.00	34,459,000
駒井ハルテック	1,900	1,687.00	3,205,300
高田機工	1,000	2,402.00	2,402,000
三和ホールディングス	111,900	1,378.00	154,198,200
文化シャッター	35,000	1,026.00	35,910,000
三協立山	14,100	655.00	9,235,500
アルインコ	7,800	912.00	7,113,600
東洋シャッター	2,600	560.00	1,456,000
L I X I L	186,700	2,766.00	516,412,200
日本フィルコン	7,400	493.00	3,648,200
ノーリツ	18,900	1,504.00	28,425,600
長府製作所	12,100	1,820.00	22,022,000
リンナイ	20,500	10,190.00	208,895,000
ダイニチ工業	5,700	667.00	3,801,900
日東精工	13,400	513.00	6,874,200
三洋工業	1,400	1,675.00	2,345,000
岡部	18,400	620.00	11,408,000
ジーテクト	13,100	1,370.00	17,947,000
東プレ	18,100	1,111.00	20,109,100
高周波熱錬	18,300	679.00	12,425,700
東京製綱	7,300	917.00	6,694,100
サンコール	10,100	628.00	6,342,800
モリテック スチール	9,200	277.00	2,548,400
パイオラックス	15,600	2,013.00	31,402,800
エイチワン	10,600	623.00	6,603,800
日本発條	100,000	933.00	93,300,000
中央発條	5,700	747.00	4,257,900
アドバネクス	1,500	1,097.00	1,645,500
立川ブラインド工業	4,600	1,105.00	5,083,000
三益半導体工業	9,300	2,127.00	19,781,100
日本ドライケミカル	2,700	1,693.00	4,571,100
日本製鋼所	30,500	3,100.00	94,550,000
三浦工業	46,700	3,210.00	149,907,000
タクマ	34,100	1,371.00	46,751,100
ツガミ	24,400	1,161.00	28,328,400
オークマ	11,300	5,260.00	59,438,000

芝浦機械	13,500	2,795.00	37,732,500
アマダ	187,400	1,065.00	199,581,000
アイダエンジニアリング	26,100	929.00	24,246,900
滝澤鉄工所	3,500	1,190.00	4,165,000
F U J I	47,400	2,043.00	96,838,200
牧野フライス製作所	12,100	4,665.00	56,446,500
オーエスジー	51,800	1,720.00	89,096,000
ダイジェット工業	1,400	917.00	1,283,800
旭ダイヤモンド工業	29,300	633.00	18,546,900
D M G 森精機	65,800	1,729.00	113,768,200
ソディック	25,900	827.00	21,419,300
ディスコ	17,500	31,200.00	546,000,000
日東工器	5,700	1,599.00	9,114,300
日進工具	9,400	1,289.00	12,116,600
パンチ工業	10,200	465.00	4,743,000
富士ダイス	6,100	657.00	4,007,700
豊和工業	6,300	871.00	5,487,300
ニデックオーケーケー	4,500	1,259.00	5,665,500
東洋機械金属	7,800	576.00	4,492,800
津田駒工業	2,000	509.00	1,018,000
エンシュウ	2,800	863.00	2,416,400
島精機製作所	17,400	2,186.00	38,036,400
オプトラン	14,900	1,885.00	28,086,500
N C ホールディングス	3,300	2,200.00	7,260,000
イワキポンプ	7,600	1,010.00	7,676,000
フリー	10,600	1,124.00	11,914,400
ヤマシンフィルタ	18,800	331.00	6,222,800
日阪製作所	12,300	854.00	10,504,200
やまびこ	19,800	1,200.00	23,760,000
野村マイクロ・サイエンス	3,800	3,500.00	13,300,000
平田機工	5,200	4,525.00	23,530,000
ペガサスミシン製造	12,100	653.00	7,901,300
マルマエ	4,900	1,961.00	9,608,900
タツモ	6,100	1,240.00	7,564,000
ナプテスコ	63,200	3,135.00	198,132,000
三井海洋開発	12,700	1,235.00	15,684,500
レオン自動機	12,700	1,310.00	16,637,000
S M C	35,100	63,410.00	2,225,691,000
ホソカワミクロン	7,700	2,832.00	21,806,400
ユニオンツール	4,400	3,295.00	14,498,000
オイレス工業	15,400	1,621.00	24,963,400
日精エー・エス・ビー機械	4,600	3,500.00	16,100,000

サトーホールディングス	15,600	2,012.00	31,387,200
技研製作所	10,500	3,240.00	34,020,000
日本エアータック	5,500	1,053.00	5,791,500
カワタ	3,600	991.00	3,567,600
日精樹脂工業	7,600	926.00	7,037,600
オカダアイヨン	3,800	1,477.00	5,612,600
ワイエイシーホールディングス	4,700	1,533.00	7,205,100
小松製作所	543,800	2,949.00	1,603,666,200
住友重機械工業	64,200	3,030.00	194,526,000
日立建機	48,100	2,916.00	140,259,600
日工	15,200	655.00	9,956,000
巴工業	4,300	2,444.00	10,509,200
井関農機	9,600	1,207.00	11,587,200
TOWA	10,300	1,737.00	17,891,100
丸山製作所	2,000	1,560.00	3,120,000
北川鉄工所	4,800	1,423.00	6,830,400
ローツェ	5,900	8,140.00	48,026,000
タカキタ	3,800	506.00	1,922,800
クボタ	581,300	2,223.00	1,292,229,900
荏原実業	5,600	2,307.00	12,919,200
三菱化工機	3,600	2,060.00	7,416,000
月島機械	18,900	906.00	17,123,400
帝国電機製作所	7,700	1,789.00	13,775,300
新東工業	22,600	723.00	16,339,800
澁谷工業	9,500	2,479.00	23,550,500
アイチ コーポレーション	17,300	878.00	15,189,400
小森コーポレーション	27,700	823.00	22,797,100
鶴見製作所	8,500	2,060.00	17,510,000
住友精密工業	1,800	2,713.00	4,883,400
日本ギア工業	4,500	304.00	1,368,000
酒井重工業	2,000	2,932.00	5,864,000
荏原製作所	48,000	5,110.00	245,280,000
石井鐵工所	1,500	2,978.00	4,467,000
西島製作所	9,900	1,334.00	13,206,600
北越工業	10,200	927.00	9,455,400
ダイキン工業	131,000	23,410.00	3,066,710,000
オルガノ	3,500	8,990.00	31,465,000
トーヨーカネツ	4,200	2,711.00	11,386,200
栗田工業	60,600	5,270.00	319,362,000
椿本チエイン	15,700	3,180.00	49,926,000
大同工業	5,100	805.00	4,105,500
木村化工機	9,400	715.00	6,721,000

アネスト岩田	18,700	960.00	17,952,000
ダイフク	56,600	8,380.00	474,308,000
サムコ	3,300	2,807.00	9,263,100
加藤製作所	5,900	808.00	4,767,200
油研工業	1,900	1,809.00	3,437,100
タダノ	58,100	973.00	56,531,300
フジテック	36,900	2,937.00	108,375,300
C K D	30,400	1,821.00	55,358,400
キトー	9,400	2,641.00	24,825,400
平和	33,500	2,070.00	69,345,000
理想科学工業	10,100	2,418.00	24,421,800
S A N K Y O	24,700	4,245.00	104,851,500
日本金銭機械	12,300	688.00	8,462,400
マースグループホールディングス	7,700	1,662.00	12,797,400
フクシマガリレイ	7,400	3,570.00	26,418,000
オーイズミ	4,400	399.00	1,755,600
ダイコク電機	5,600	1,263.00	7,072,800
竹内製作所	18,300	2,492.00	45,603,600
アマノ	31,400	2,548.00	80,007,200
J U K I	16,700	752.00	12,558,400
ジャノメ	10,300	757.00	7,797,100
マックス	14,200	1,684.00	23,912,800
グローリー	28,500	2,211.00	63,013,500
新晃工業	11,200	1,692.00	18,950,400
大和冷機工業	17,400	1,126.00	19,592,400
セガサミーホールディングス	107,900	2,282.00	246,227,800
日本ピストンリング	4,400	1,280.00	5,632,000
リケン	4,400	2,426.00	10,674,400
T P R	13,100	1,274.00	16,689,400
ツバキ・ナカシマ	26,400	944.00	24,921,600
ホシザキ	70,200	3,940.00	276,588,000
大豊工業	9,900	680.00	6,732,000
日本精工	205,400	744.00	152,817,600
N T N	218,200	254.00	55,422,800
ジェイテクト	102,400	1,046.00	107,110,400
不二越	8,400	3,670.00	30,828,000
日本トムソン	27,500	522.00	14,355,000
T H K	67,700	2,721.00	184,211,700
ユーシン精機	9,400	719.00	6,758,600
前澤給装工業	7,800	911.00	7,105,800
イーグル工業	13,000	1,026.00	13,338,000
前澤工業	7,300	629.00	4,591,700

日本ピラー工業	10,300	2,650.00	27,295,000
キット	33,800	693.00	23,423,400
マキタ	135,600	3,569.00	483,956,400
三井E & Sホールディングス	44,200	349.00	15,425,800
日立造船	95,300	827.00	78,813,100
三菱重工業	176,000	4,913.00	864,688,000
I H I	75,000	3,490.00	261,750,000
スター精密	16,200	1,700.00	27,540,000
日清紡ホールディングス	69,300	1,061.00	73,527,300
イビデン	58,000	3,990.00	231,420,000
コニカミノルタ	245,600	469.00	115,186,400
ブラザー工業	137,200	2,509.00	344,234,800
ミネベアミツミ	191,300	2,390.00	457,207,000
日立製作所	577,100	6,728.00	3,882,728,800
東芝	209,700	5,363.00	1,124,621,100
三菱電機	1,119,800	1,475.50	1,652,264,900
富士電機	66,700	5,600.00	373,520,000
東洋電機製造	4,000	913.00	3,652,000
安川電機	119,200	4,375.00	521,500,000
シンフォニアテクノロジー	12,200	1,435.00	17,507,000
明電舎	17,000	2,164.00	36,788,000
オリジン	2,700	1,202.00	3,245,400
山洋電気	4,500	5,350.00	24,075,000
デンヨー	8,500	1,626.00	13,821,000
P H Cホールディングス	19,200	1,549.00	29,740,800
東芝テック	12,900	4,415.00	56,953,500
芝浦メカトロニクス	2,200	9,710.00	21,362,000
マブチモーター	27,800	3,830.00	106,474,000
日本電産	266,700	9,114.00	2,430,703,800
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,500	448.00	2,912,000
トレックス・セミコンダクター	5,600	2,653.00	14,856,800
東光高岳	7,200	1,737.00	12,506,400
ダイヘン	11,100	4,145.00	46,009,500
ヤーマン	20,200	1,587.00	32,057,400
J V Cケンウッド	103,500	175.00	18,112,500
ミマキエンジニアリング	12,500	568.00	7,100,000
I - P E X	6,300	1,324.00	8,341,200
日新電機	28,100	1,519.00	42,683,900
大崎電気工業	20,200	518.00	10,463,600
オムロン	99,900	7,409.00	740,159,100
日東工業	15,100	2,525.00	38,127,500
I D E C	14,900	2,897.00	43,165,300

正興電機製作所	4,100	1,186.00	4,862,600
不二電機工業	3,100	1,147.00	3,555,700
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,500	2,342.00	85,483,000
サクサホールディングス	2,800	1,279.00	3,581,200
メルコホールディングス	3,600	3,785.00	13,626,000
テクノメディカ	3,300	1,623.00	5,355,900
日本電気	142,300	5,390.00	766,997,000
富士通	108,000	18,980.00	2,049,840,000
沖電気工業	45,500	764.00	34,762,000
岩崎通信機	4,900	804.00	3,939,600
電気興業	5,800	2,516.00	14,592,800
サンケン電気	10,300	5,000.00	51,500,000
ナカヨ	2,000	1,121.00	2,242,000
アイホン	5,400	1,878.00	10,141,200
ルネサスエレクトロニクス	654,100	1,335.00	873,223,500
セイコーエプソン	134,000	2,042.00	273,628,000
ワコム	93,100	898.00	83,603,800
アルバック	23,900	4,890.00	116,871,000
アクセル	5,800	882.00	5,115,600
E I Z O	8,200	3,775.00	30,955,000
日本信号	25,500	991.00	25,270,500
京三製作所	23,400	448.00	10,483,200
能美防災	14,200	1,873.00	26,596,600
ホーチキ	8,300	1,320.00	10,956,000
星和電機	7,100	466.00	3,308,600
エレコム	28,100	1,705.00	47,910,500
パナソニック ホールディングス	1,279,600	1,128.50	1,444,028,600
シャープ	114,000	1,069.00	121,866,000
アンリツ	77,300	1,539.00	118,964,700
富士通ゼネラル	32,600	2,811.00	91,638,600
ソニーグループ	751,600	11,705.00	8,797,478,000
T D K	174,000	4,240.00	737,760,000
帝国通信工業	6,000	1,475.00	8,850,000
タムラ製作所	43,200	599.00	25,876,800
アルプスアルパイン	98,800	1,355.00	133,874,000
池上通信機	3,500	612.00	2,142,000
日本電波工業	12,900	1,103.00	14,228,700
鈴木	7,200	800.00	5,760,000
メイコー	13,300	3,220.00	42,826,000
日本トリム	2,700	2,486.00	6,712,200
ローランド ディー . ジー .	7,400	3,165.00	23,421,000
フォスター電機	11,200	735.00	8,232,000

S M K	2,800	2,205.00	6,174,000	
ヨコオ	8,500	1,956.00	16,626,000	
ホシデン	27,300	1,308.00	35,708,400	
ヒロセ電機	16,600	18,690.00	310,254,000	
日本航空電子工業	24,100	2,206.00	53,164,600	
T O A	12,900	815.00	10,513,500	
マクセル	22,600	1,468.00	33,176,800	
古野電気	15,200	1,132.00	17,206,400	
ユニデンホールディングス	2,600	4,095.00	10,647,000	
スミダコーポレーション	12,500	818.00	10,225,000	
アイコム	3,900	2,592.00	10,108,800	
リオン	4,600	2,340.00	10,764,000	
本多通信工業	11,300	537.00	6,068,100	
横河電機	110,100	2,355.00	259,285,500	
新電元工業	4,200	3,430.00	14,406,000	
アズビル	69,600	3,890.00	270,744,000	
東亜ディーケーケー	7,100	909.00	6,453,900	
日本光電工業	46,600	3,075.00	143,295,000	
チノー	3,800	1,671.00	6,349,800	
共和電業	11,500	333.00	3,829,500	
日本電子材料	5,600	1,675.00	9,380,000	
堀場製作所	20,600	6,510.00	134,106,000	
アドバンテスト	89,200	7,490.00	668,108,000	
小野測器	6,900	427.00	2,946,300	
エスベック	9,400	1,840.00	17,296,000	
キーエンス	108,700	54,800.00	5,956,760,000	
日置電機	5,900	6,320.00	37,288,000	
シスメックス	86,000	9,346.00	803,756,000	
日本マイクロニクス	18,700	1,248.00	23,337,600	
メガチップス	10,900	3,230.00	35,207,000	
O B A R A G R O U P	5,000	3,060.00	15,300,000	
澤藤電機	2,200	1,438.00	3,163,600	
原田工業	6,800	893.00	6,072,400	
コーセル	14,500	882.00	12,789,000	
イリソ電子工業	10,400	3,050.00	31,720,000	
オブテックスグループ	20,200	2,111.00	42,642,200	
千代田インテグレ	5,000	2,049.00	10,245,000	
レーザーテック	49,200	18,045.00	887,814,000	
スタンレー電気	77,800	2,398.00	186,564,400	
岩崎電気	4,200	2,647.00	11,117,400	
ウシオ電機	57,300	1,810.00	103,713,000	
岡谷電機産業	12,800	244.00	3,123,200	

ヘリオス テクノ ホールディング	13,200	340.00	4,488,000	
エノモト	4,000	1,526.00	6,104,000	
日本セラミック	11,600	2,101.00	24,371,600	
遠藤照明	6,800	769.00	5,229,200	
古河電池	9,400	1,241.00	11,665,400	
双信電機	7,800	510.00	3,978,000	
山一電機	8,400	1,690.00	14,196,000	
図研	8,100	3,435.00	27,823,500	
日本電子	23,200	5,820.00	135,024,000	
カシオ計算機	74,200	1,287.00	95,495,400	
ファナック	105,300	21,825.00	2,298,172,500	
日本シイエムケイ	23,400	447.00	10,459,800	
エンプラス	3,300	3,025.00	9,982,500	
大真空	15,900	913.00	14,516,700	
ローム	50,000	9,890.00	494,500,000	
浜松ホトニクス	80,100	6,000.00	480,600,000	
三井ハイテック	10,400	8,310.00	86,424,000	
新光電気工業	35,500	3,420.00	121,410,000	
京セラ	168,900	7,447.00	1,257,798,300	
太陽誘電	53,600	4,785.00	256,476,000	
村田製作所	327,400	7,856.00	2,572,054,400	
双葉電子工業	22,000	699.00	15,378,000	
北陸電気工業	5,400	1,122.00	6,058,800	
ニチコン	32,800	1,242.00	40,737,600	
日本ケミコン	11,900	1,755.00	20,884,500	
K O A	17,200	1,691.00	29,085,200	
市光工業	17,000	381.00	6,477,000	
小糸製作所	60,100	4,715.00	283,371,500	
ミツバ	18,700	430.00	8,041,000	
S C R E E Nホールディングス	18,900	9,450.00	178,605,000	
キャノン電子	11,700	1,575.00	18,427,500	
キャノン	596,200	3,243.00	1,933,476,600	
リコー	285,500	1,082.00	308,911,000	
象印マホービン	30,400	1,507.00	45,812,800	
M U T O Hホールディングス	2,000	2,035.00	4,070,000	
東京エレクトロン	76,100	45,020.00	3,426,022,000	
トヨタ紡織	41,900	2,088.00	87,487,200	
芦森工業	2,300	1,017.00	2,339,100	
ユニプレス	19,700	871.00	17,158,700	
豊田自動織機	85,000	8,080.00	686,800,000	
モリタホールディングス	19,200	1,393.00	26,745,600	
三櫻工業	16,600	705.00	11,703,000	

デンソー	234,800	7,649.00	1,795,985,200
東海理化電機製作所	31,600	1,562.00	49,359,200
川崎重工業	81,300	2,588.00	210,404,400
名村造船所	30,900	414.00	12,792,600
日本車輛製造	3,800	2,119.00	8,052,200
三菱ロジスネクスト	15,900	924.00	14,691,600
近畿車輛	1,800	1,104.00	1,987,200
日産自動車	1,415,000	514.10	727,451,500
いすゞ自動車	347,500	1,501.00	521,597,500
トヨタ自動車	5,469,700	2,166.00	11,847,370,200
日野自動車	149,800	732.00	109,653,600
三菱自動車工業	444,100	442.00	196,292,200
エフテック	7,700	536.00	4,127,200
レシップホールディングス	4,800	534.00	2,563,200
G M B	2,200	692.00	1,522,400
ファルテック	2,100	600.00	1,260,000
武蔵精密工業	26,800	1,453.00	38,940,400
日産車体	17,600	625.00	11,000,000
新明和工業	31,300	1,083.00	33,897,900
極東開発工業	19,100	1,455.00	27,790,500
トピー工業	9,000	1,314.00	11,826,000
ティラド	3,300	2,587.00	8,537,100
曙ブレーキ工業	65,900	157.00	10,346,300
タチエス	19,700	1,165.00	22,950,500
N O K	45,100	1,211.00	54,616,100
フタバ産業	26,700	401.00	10,706,700
K Y B	10,600	3,150.00	33,390,000
大同メタル工業	23,000	552.00	12,696,000
プレス工業	53,800	418.00	22,488,400
ミクニ	14,000	356.00	4,984,000
太平洋工業	22,800	1,120.00	25,536,000
河西工業	14,700	263.00	3,866,100
アイシン	87,800	4,235.00	371,833,000
マツダ	353,000	1,119.00	395,007,000
今仙電機製作所	7,900	622.00	4,913,800
本田技研工業	877,200	3,471.00	3,044,761,200
スズキ	237,800	4,375.00	1,040,375,000
S U B A R U	315,200	2,357.00	742,926,400
安永	4,800	703.00	3,374,400
ヤマハ発動機	156,500	2,560.00	400,640,000
T B K	12,100	339.00	4,101,900
エクセディ	18,100	1,859.00	33,647,900

豊田合成	33,900	2,249.00	76,241,100
愛三工業	18,800	709.00	13,329,200
盟和産業	1,700	1,019.00	1,732,300
日本プラスト	8,700	464.00	4,036,800
ヨロズ	9,300	907.00	8,435,100
エフ・シー・シー	19,600	1,457.00	28,557,200
シマノ	44,100	23,075.00	1,017,607,500
テイ・エス テック	50,700	1,523.00	77,216,100
ジャムコ	7,000	1,245.00	8,715,000
テルモ	339,500	4,500.00	1,527,750,000
クリエートメディック	3,600	989.00	3,560,400
日機装	30,500	830.00	25,315,000
日本エム・ディ・エム	6,900	1,692.00	11,674,800
島津製作所	143,400	4,735.00	678,999,000
JMS	9,300	574.00	5,338,200
長野計器	8,000	1,163.00	9,304,000
ブイ・テクノロジー	5,300	3,005.00	15,926,500
東京計器	7,600	1,315.00	9,994,000
愛知時計電機	4,300	1,477.00	6,351,100
インターアクション	6,000	2,035.00	12,210,000
オーバル	10,800	764.00	8,251,200
東京精密	18,700	4,620.00	86,394,000
マニー	43,800	1,586.00	69,466,800
ニコン	169,100	1,540.00	260,414,000
トプコン	56,400	1,942.00	109,528,800
オリンパス	580,800	2,838.00	1,648,310,400
理研計器	7,900	4,010.00	31,679,000
タムロン	8,400	2,780.00	23,352,000
H O Y A	231,600	13,295.00	3,079,122,000
シード	5,600	526.00	2,945,600
ノーリツ鋼機	10,800	2,378.00	25,682,400
A & D ホロンホールディングス	13,500	945.00	12,757,500
朝日インテック	131,500	2,485.00	326,777,500
シチズン時計	117,100	583.00	68,269,300
リズム	3,800	1,612.00	6,125,600
大研医器	9,500	482.00	4,579,000
メニコン	37,000	3,400.00	125,800,000
シンシア	1,300	431.00	560,300
松風	4,000	1,794.00	7,176,000
セイコーホールディングス	17,000	2,896.00	49,232,000
ニプロ	83,000	1,183.00	98,189,000
中本パックス	3,300	1,612.00	5,319,600

スノーピーク	15,600	2,616.00	40,809,600
パラマウントベッドホールディングス	23,000	2,479.00	57,017,000
トランザクション	7,700	1,060.00	8,162,000
粧美堂	3,000	396.00	1,188,000
ニホンフラッシュ	9,300	976.00	9,076,800
前田工織	10,800	3,075.00	33,210,000
永大産業	13,100	260.00	3,406,000
アートネイチャー	10,200	748.00	7,629,600
バンダイナムコホールディングス	99,200	10,280.00	1,019,776,000
アイフィスジャパン	3,100	618.00	1,915,800
共立印刷	16,400	154.00	2,525,600
S H O E I	10,500	5,740.00	60,270,000
フランスベッドホールディングス	15,400	935.00	14,399,000
パイロットコーポレーション	17,100	5,270.00	90,117,000
萩原工業	7,200	1,138.00	8,193,600
フジシールインターナショナル	24,700	1,562.00	38,581,400
タカラトミー	49,500	1,493.00	73,903,500
広済堂ホールディングス	7,400	1,070.00	7,918,000
エステールホールディングス	2,600	629.00	1,635,400
タカノ	4,100	853.00	3,497,300
プロネクサス	9,300	1,136.00	10,564,800
ホクシン	8,500	148.00	1,258,000
ウッドワン	3,700	1,165.00	4,310,500
大建工業	6,100	1,974.00	12,041,400
凸版印刷	156,300	2,302.00	359,802,600
大日本印刷	130,000	2,956.00	384,280,000
共同印刷	3,100	2,530.00	7,843,000
N I S S H A	20,800	1,553.00	32,302,400
光村印刷	900	1,240.00	1,116,000
T A K A R A & C O M P A N Y	6,900	1,990.00	13,731,000
アシックス	91,900	2,595.00	238,480,500
ツツミ	3,000	2,168.00	6,504,000
ローランド	8,400	4,250.00	35,700,000
小松ウオール工業	3,700	1,935.00	7,159,500
ヤマハ	69,800	5,690.00	397,162,000
河合楽器製作所	3,000	2,847.00	8,541,000
クリナップ	11,200	599.00	6,708,800
ピジョン	72,500	1,938.00	140,505,000
兼松サステック	800	1,641.00	1,312,800
キングジム	8,800	914.00	8,043,200
リンテック	22,800	2,342.00	53,397,600
イトーキ	22,100	394.00	8,707,400

任天堂	67,700	60,870.00	4,120,899,000
三菱鉛筆	16,200	1,541.00	24,964,200
タカスタンダード	19,300	1,374.00	26,518,200
コクヨ	52,800	1,822.00	96,201,600
ナカバヤシ	9,700	515.00	4,995,500
グローブライド	8,900	2,290.00	20,381,000
オカムラ	33,700	1,318.00	44,416,600
美津濃	9,900	2,537.00	25,116,300
東京電力ホールディングス	897,900	512.00	459,724,800
中部電力	338,800	1,360.00	460,768,000
関西電力	419,600	1,328.00	557,228,800
中国電力	173,100	867.00	150,077,700
北陸電力	101,900	540.00	55,026,000
東北電力	262,300	719.00	188,593,700
四国電力	99,700	792.00	78,962,400
九州電力	229,600	878.00	201,588,800
北海道電力	104,300	507.00	52,880,100
沖縄電力	25,400	1,310.00	33,274,000
電源開発	88,600	2,232.00	197,755,200
エフオン	7,300	550.00	4,015,000
イーレックス	15,500	2,296.00	35,588,000
レノバ	23,500	2,271.00	53,368,500
東京瓦斯	213,600	2,602.00	555,787,200
大阪瓦斯	201,800	2,380.00	480,284,000
東邦瓦斯	47,100	3,040.00	143,184,000
北海道瓦斯	5,900	1,610.00	9,499,000
広島ガス	21,000	321.00	6,741,000
西部ガスホールディングス	11,400	1,847.00	21,055,800
静岡ガス	28,400	961.00	27,292,400
メタウォーター	12,500	2,039.00	25,487,500
SBSホールディングス	8,900	2,818.00	25,080,200
東武鉄道	109,400	3,120.00	341,328,000
相鉄ホールディングス	35,600	2,337.00	83,197,200
東急	279,300	1,617.00	451,628,100
京浜急行電鉄	133,500	1,441.00	192,373,500
小田急電鉄	151,000	1,836.00	277,236,000
京王電鉄	52,700	4,960.00	261,392,000
京成電鉄	70,600	3,560.00	251,336,000
富士急行	12,300	4,025.00	49,507,500
新京成電鉄	2,800	2,899.00	8,117,200
東日本旅客鉄道	183,000	6,843.00	1,252,269,000
西日本旅客鉄道	127,200	4,830.00	614,376,000

東海旅客鉄道	84,400	15,390.00	1,298,916,000
西武ホールディングス	144,600	1,308.00	189,136,800
鴻池運輸	17,000	1,296.00	22,032,000
西日本鉄道	28,800	2,887.00	83,145,600
ハマキョウレックス	7,800	3,155.00	24,609,000
サカイ引越センター	5,500	4,915.00	27,032,500
近鉄グループホールディングス	106,500	4,265.00	454,222,500
阪急阪神ホールディングス	132,600	3,775.00	500,565,000
南海電気鉄道	47,500	2,554.00	121,315,000
京阪ホールディングス	44,300	3,265.00	144,639,500
神戸電鉄	2,700	3,370.00	9,099,000
名古屋鉄道	109,900	2,094.00	230,130,600
山陽電気鉄道	8,100	2,230.00	18,063,000
アルプス物流	7,900	1,142.00	9,021,800
ヤマトホールディングス	159,200	2,353.00	374,597,600
山九	27,600	4,180.00	115,368,000
丸運	5,400	233.00	1,258,200
丸全昭和運輸	7,700	3,220.00	24,794,000
センコーグループホールディングス	52,700	926.00	48,800,200
トナミホールディングス	2,200	3,680.00	8,096,000
ニッコンホールディングス	34,300	2,417.00	82,903,100
日本石油輸送	1,200	2,458.00	2,949,600
福山通運	14,500	3,150.00	45,675,000
セイノーホールディングス	61,900	1,131.00	70,008,900
エスライン	3,100	857.00	2,656,700
神奈川中央交通	2,800	3,555.00	9,954,000
日立物流	21,900	8,700.00	190,530,000
丸和運輸機関	19,200	1,497.00	28,742,400
C & F ロジホールディングス	9,600	1,152.00	11,059,200
九州旅客鉄道	76,200	2,785.00	212,217,000
S Gホールディングス	190,800	2,584.00	493,027,200
NIPPON EXPRESSホールディングス	33,700	7,830.00	263,871,000
日本郵船	95,200	10,320.00	982,464,000
商船三井	175,700	3,505.00	615,828,500
川崎汽船	35,100	9,840.00	345,384,000
NSユナイテッド海運	5,700	3,980.00	22,686,000
飯野海運	46,700	706.00	32,970,200
共栄タンカー	3,500	974.00	3,409,000
乾汽船	6,800	1,806.00	12,280,800
日本航空	244,300	2,280.00	557,004,000
ANAホールディングス	270,600	2,456.50	664,728,900
パスコ	2,100	1,342.00	2,818,200

トランコム	3,200	7,320.00	23,424,000
日新	8,300	1,657.00	13,753,100
三菱倉庫	27,500	3,470.00	95,425,000
三井倉庫ホールディングス	11,100	3,070.00	34,077,000
住友倉庫	33,400	2,072.00	69,204,800
澁澤倉庫	5,700	2,200.00	12,540,000
東陽倉庫	16,100	296.00	4,765,600
日本トランスシティ	20,000	503.00	10,060,000
ケイヒン	1,900	1,363.00	2,589,700
中央倉庫	5,900	981.00	5,787,900
川西倉庫	2,100	1,039.00	2,181,900
安田倉庫	7,600	943.00	7,166,800
ファイズホールディングス	2,400	738.00	1,771,200
東洋埠頭	3,200	1,296.00	4,147,200
上組	54,000	2,747.00	148,338,000
サンリツ	2,900	712.00	2,064,800
キムラユニティー	5,900	811.00	4,784,900
キューソー流通システム	5,700	1,262.00	7,193,400
東海運	6,500	285.00	1,852,500
エーアイティー	7,100	1,834.00	13,021,400
内外トランスライン	4,400	2,038.00	8,967,200
日本コンセプト	3,600	1,568.00	5,644,800
NEC ネットズエスアイ	39,000	1,980.00	77,220,000
クロスキャット	6,500	971.00	6,311,500
システナ	168,200	481.00	80,904,200
デジタルアーツ	6,300	6,260.00	39,438,000
日鉄ソリューションズ	20,500	3,935.00	80,667,500
キューブシステム	6,100	1,058.00	6,453,800
WOW WORLD	1,800	1,021.00	1,837,800
コア	5,100	1,509.00	7,695,900
手間いらず	1,700	5,190.00	8,823,000
ラクーンホールディングス	10,100	1,467.00	14,816,700
ソリトンシステムズ	6,000	1,318.00	7,908,000
ソフトクリエイティブホールディングス	5,200	4,235.00	22,022,000
T I S	103,000	3,800.00	391,400,000
J N S ホールディングス	5,400	394.00	2,127,600
グリー	53,700	833.00	44,732,100
G M O ペパボ	1,300	1,990.00	2,587,000
コーエーテクモホールディングス	37,600	4,895.00	184,052,000
三菱総合研究所	4,900	4,375.00	21,437,500
電算	1,400	2,208.00	3,091,200
A G S	4,800	764.00	3,667,200

ファインデックス	10,100	673.00	6,797,300
ブレインパッド	10,100	1,206.00	12,180,600
K L a b	20,100	480.00	9,648,000
ポールトゥウィンホールディングス	17,200	1,015.00	17,458,000
ネクソン	268,600	3,045.00	817,887,000
アイスタイル	30,900	284.00	8,775,600
エムアップホールディングス	13,700	1,451.00	19,878,700
エイチーム	7,500	749.00	5,617,500
エニグモ	13,000	539.00	7,007,000
テクノスジャパン	9,400	483.00	4,540,200
コロプラ	38,900	677.00	26,335,300
ブロードリーフ	58,700	458.00	26,884,600
クロス・マーケティンググループ	4,600	728.00	3,348,800
デジタルハーツホールディングス	5,400	1,874.00	10,119,600
システム情報	9,000	964.00	8,676,000
メディアドゥ	4,100	2,096.00	8,593,600
じげん	33,700	333.00	11,222,100
ブイキューブ	12,100	1,226.00	14,834,600
エンカレッジ・テクノロジー	2,800	530.00	1,484,000
サイバーリンクス	4,100	1,113.00	4,563,300
フィックスターズ	11,400	1,160.00	13,224,000
C A R T A H O L D I N G S	4,900	1,911.00	9,363,900
オブティム	8,400	820.00	6,888,000
セレス	4,500	1,219.00	5,485,500
S H I F T	7,300	19,110.00	139,503,000
ティーガイア	10,500	1,681.00	17,650,500
セック	1,800	2,459.00	4,426,200
テクマトリックス	20,000	1,838.00	36,760,000
プロシップ	4,000	1,615.00	6,460,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	30,600	2,593.00	79,345,800
G M O ペイメントゲートウェイ	22,800	10,490.00	239,172,000
ザッパラス	4,400	346.00	1,522,400
システムリサーチ	3,500	2,069.00	7,241,500
インターネットイニシアティブ	31,400	5,240.00	164,536,000
さくらインターネット	12,900	572.00	7,378,800
ヴィンクス	3,400	1,463.00	4,974,200
G M O グローバルサイン・ホールディングス	2,600	5,680.00	14,768,000
S R A ホールディングス	5,700	2,973.00	16,946,100
システムインテグレータ	4,000	462.00	1,848,000
朝日ネット	11,000	595.00	6,545,000
e B A S E	14,300	568.00	8,122,400
アバント	12,700	1,389.00	17,640,300

アドソル日進	4,300	1,702.00	7,318,600
ODKソリューションズ	2,700	595.00	1,606,500
フリービット	6,300	848.00	5,342,400
コムチュア	13,300	2,917.00	38,796,100
サイバーコム	1,900	1,378.00	2,618,200
アステリア	8,600	875.00	7,525,000
アイル	5,700	1,606.00	9,154,200
マークラインズ	6,000	2,251.00	13,506,000
メディカル・データ・ビジョン	15,000	1,245.00	18,675,000
gumi	16,500	615.00	10,147,500
ショーケース	2,900	423.00	1,226,700
モバイルファクトリー	2,800	1,001.00	2,802,800
テラスカイ	4,400	1,689.00	7,431,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,300	1,436.00	7,610,800
PCIホールディングス	4,800	963.00	4,622,400
パイプドHD	2,200	2,798.00	6,155,600
アイビーシー	2,000	423.00	846,000
ネオジャパン	3,400	1,150.00	3,910,000
PR TIMES	2,600	2,252.00	5,855,200
ラクス	54,100	1,695.00	91,699,500
ランドコンピュータ	2,800	880.00	2,464,000
ダブルスタンダード	3,600	1,982.00	7,135,200
オープンドア	7,100	1,687.00	11,977,700
マイネット	4,200	516.00	2,167,200
アカツキ	5,300	2,678.00	14,193,400
ベネフィットジャパン	1,000	1,917.00	1,917,000
Ubicomホールディングス	3,100	2,725.00	8,447,500
カナミックネットワーク	14,600	591.00	8,628,600
ノムラシステムコーポレーション	13,100	128.00	1,676,800
チェンジ	24,500	2,049.00	50,200,500
シンクロ・フード	6,400	380.00	2,432,000
オークネット	6,300	2,280.00	14,364,000
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	635.00	1,460,500
セグエグループ	3,300	536.00	1,768,800
エイトレッド	1,700	1,919.00	3,262,300
マクロミル	22,800	939.00	21,409,200
ビーグリー	2,900	1,277.00	3,703,300
オロ	3,700	1,603.00	5,931,100
ユーザーローカル	3,700	1,623.00	6,005,100
テモナ	2,500	324.00	810,000
ニーズウェル	3,600	649.00	2,336,400
マネーフォワード	24,000	3,255.00	78,120,000

サインポスト	3,800	881.00	3,347,800
電算システムホールディングス	4,900	2,442.00	11,965,800
ソルクシーズ	10,400	377.00	3,920,800
フェイス	3,300	581.00	1,917,300
プロトコーポレーション	12,600	1,101.00	13,872,600
ハイマックス	3,200	1,491.00	4,771,200
野村総合研究所	204,800	3,985.00	816,128,000
サイバネットシステム	8,500	964.00	8,194,000
C Eホールディングス	6,000	509.00	3,054,000
日本システム技術	2,100	2,686.00	5,640,600
インタージホールディングス	13,600	1,394.00	18,958,400
東邦システムサイエンス	3,200	933.00	2,985,600
ソースネクスト	51,300	227.00	11,645,100
インフォコム	12,900	2,200.00	28,380,000
シンプレクス・ホールディングス	18,700	1,783.00	33,342,100
HEROZ	3,500	965.00	3,377,500
ラクスル	14,100	2,127.00	29,990,700
I P S	3,300	2,412.00	7,959,600
F I G	13,200	317.00	4,184,400
システムサポート	4,400	1,394.00	6,133,600
イーソル	7,400	656.00	4,854,400
アルテリア・ネットワークス	11,300	1,277.00	14,430,100
東海ソフト	2,000	940.00	1,880,000
ウイングアーク1st	9,000	1,859.00	16,731,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,700	1,634.00	4,411,800
サーバーワークス	2,100	2,503.00	5,256,300
東名	900	1,095.00	985,500
ヴィッツ	1,200	1,050.00	1,260,000
トピラシステムズ	2,500	946.00	2,365,000
S a n s a n	37,300	1,196.00	44,610,800
L i n k - U	2,300	653.00	1,501,900
ギフティ	9,800	1,213.00	11,887,400
ベース	2,000	5,880.00	11,760,000
J M D C	14,800	6,420.00	95,016,000
フォーカスシステムズ	7,400	925.00	6,845,000
クレスコ	8,600	2,140.00	18,404,000
フジ・メディア・ホールディングス	104,800	1,222.00	128,065,600
オービック	37,100	21,480.00	796,908,000
ジャストシステム	16,800	4,015.00	67,452,000
T D C ソフト	9,500	1,166.00	11,077,000
Zホールディングス	1,698,100	436.70	741,560,270
トレンドマイクロ	57,700	7,560.00	436,212,000

I Dホールディングス	7,600	867.00	6,589,200
日本オラクル	19,100	8,380.00	160,058,000
アルファシステムズ	3,200	4,580.00	14,656,000
フューチャー	24,900	1,656.00	41,234,400
C A C Holdings	6,200	1,422.00	8,816,400
S Bテクノロジー	5,100	2,448.00	12,484,800
トーセ	3,100	751.00	2,328,100
オービックビジネスコンサルタント	11,300	4,435.00	50,115,500
伊藤忠テクノソリューションズ	53,700	3,630.00	194,931,000
アイティフォー	14,400	825.00	11,880,000
東計電算	1,400	6,170.00	8,638,000
エクスネット	2,000	1,011.00	2,022,000
大塚商会	63,700	4,155.00	264,673,500
サイボウズ	15,800	1,159.00	18,312,200
電通国際情報サービス	14,600	4,350.00	63,510,000
A C C E S S	13,500	825.00	11,137,500
デジタルガレージ	19,500	3,970.00	77,415,000
E Mシステムズ	19,600	1,015.00	19,894,000
ウェザーニューズ	3,500	7,670.00	26,845,000
C I J	9,300	745.00	6,928,500
ビジネスエンジニアリング	2,700	2,653.00	7,163,100
日本エンタープライズ	12,300	159.00	1,955,700
WOWOW	4,900	1,503.00	7,364,700
スカラ	10,100	750.00	7,575,000
インテリジェント ウェイブ	6,100	778.00	4,745,800
I M A G I C A GROUP	8,500	823.00	6,995,500
ネットワンシステムズ	43,500	3,115.00	135,502,500
システムソフト	36,000	105.00	3,780,000
アルゴグラフィックス	9,200	3,420.00	31,464,000
マーベラス	18,700	696.00	13,015,200
エイベックス	20,400	1,544.00	31,497,600
B I P R O G Y	36,800	2,830.00	104,144,000
兼松エレクトロニクス	6,400	4,135.00	26,464,000
都築電気	5,400	1,351.00	7,295,400
T B Sホールディングス	57,600	1,786.00	102,873,600
日本テレビホールディングス	98,400	1,325.00	130,380,000
朝日放送グループホールディングス	9,600	668.00	6,412,800
テレビ朝日ホールディングス	28,400	1,577.00	44,786,800
スカパーJ S A Tホールディングス	100,000	562.00	56,200,000
テレビ東京ホールディングス	7,300	2,018.00	14,731,400
日本BS放送	4,100	1,067.00	4,374,700
ビジョン	18,900	1,105.00	20,884,500

スマートバリュー	2,900	471.00	1,365,900
USEN-NEXT HOLDINGS	9,000	2,089.00	18,801,000
ワイヤレスゲート	5,300	279.00	1,478,700
コネクシオ	8,400	1,342.00	11,272,800
ク Robbins	2,300	933.00	2,145,900
日本電信電話	1,319,700	3,887.00	5,129,673,900
KDDI	858,300	4,436.00	3,807,418,800
ソフトバンク	1,783,300	1,541.50	2,748,956,950
光通信	13,600	14,750.00	200,600,000
エムティーアイ	9,400	542.00	5,094,800
GMOインターネット	41,300	2,586.00	106,801,800
ファイバーゲート	5,500	872.00	4,796,000
アйдママーケティングコミュニケーション	3,000	293.00	879,000
KADOKAWA	63,400	3,255.00	206,367,000
学研ホールディングス	16,800	946.00	15,892,800
ゼンリン	19,400	957.00	18,565,800
昭文社ホールディングス	5,100	336.00	1,713,600
インプレスホールディングス	9,800	217.00	2,126,600
アイネット	5,600	1,300.00	7,280,000
松竹	6,800	12,690.00	86,292,000
東宝	69,500	5,320.00	369,740,000
東映	3,300	19,960.00	65,868,000
エヌ・ティ・ティ・データ	313,500	1,989.00	623,551,500
ピー・シー・エー	7,000	1,246.00	8,722,000
ビジネスブレイン太田昭和	4,000	1,488.00	5,952,000
DTS	22,000	3,395.00	74,690,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	54,800	6,280.00	344,144,000
シーイーシー	12,700	1,232.00	15,646,400
カブコン	111,000	3,830.00	425,130,000
アイ・エス・ビー	5,600	1,037.00	5,807,200
ジャステック	6,900	1,205.00	8,314,500
SSSK	81,600	2,384.00	194,534,400
日本システムウエア	4,500	2,440.00	10,980,000
アイネス	10,200	1,626.00	16,585,200
TKC	18,000	3,495.00	62,910,000
富士ソフト	11,300	8,400.00	94,920,000
NSD	36,900	2,539.00	93,689,100
コナミグループ	42,800	7,690.00	329,132,000
福井コンピュータホールディングス	5,400	3,515.00	18,981,000
JBCホールディングス	8,000	1,675.00	13,400,000
ミロク情報サービス	10,500	1,373.00	14,416,500
ソフトバンクグループ	706,000	5,505.00	3,886,530,000

高千穂交易	4,200	2,009.00	8,437,800
オルパヘルスケアホールディングス	1,900	1,613.00	3,064,700
伊藤忠食品	2,400	4,970.00	11,928,000
エレマテック	9,500	1,289.00	12,245,500
あらた	8,700	4,200.00	36,540,000
トーメンデバイス	1,800	5,660.00	10,188,000
東京エレクトロン デバイス	3,500	5,230.00	18,305,000
フィールズ	10,400	970.00	10,088,000
双日	121,200	2,008.00	243,369,600
アルフレッサ ホールディングス	122,600	1,866.00	228,771,600
横浜冷凍	28,700	921.00	26,432,700
ラサ商事	5,400	965.00	5,211,000
アルコニックス	15,000	1,307.00	19,605,000
神戸物産	81,500	3,525.00	287,287,500
ハイパー	3,000	444.00	1,332,000
あい ホールディングス	16,900	1,663.00	28,104,700
ディーブイエックス	4,000	1,049.00	4,196,000
ダイワボウホールディングス	50,300	1,899.00	95,519,700
マクニカ・富士エレホールディングス	28,200	2,677.00	75,491,400
ラクト・ジャパン	4,100	2,557.00	10,483,700
グリムス	5,300	1,538.00	8,151,400
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,900	718.00	13,570,200
八洲電機	8,500	1,039.00	8,831,500
メディアスホールディングス	6,800	1,006.00	6,840,800
レスターホールディングス	11,200	1,952.00	21,862,400
ジューテックホールディングス	2,300	1,066.00	2,451,800
大光	5,000	703.00	3,515,000
OCHIホールディングス	2,700	1,226.00	3,310,200
TOKAIホールディングス	57,300	900.00	51,570,000
黒谷	3,200	610.00	1,952,000
Cominix	2,100	718.00	1,507,800
三洋貿易	10,800	1,015.00	10,962,000
ビューティガレージ	1,900	2,633.00	5,002,700
ウイン・パートナーズ	8,500	1,041.00	8,848,500
ミタチ産業	3,000	763.00	2,289,000
シップヘルスケアホールディングス	34,100	2,581.00	88,012,100
明治電機工業	3,600	1,105.00	3,978,000
デリカフーズホールディングス	4,600	510.00	2,346,000
スターティアホールディングス	2,700	828.00	2,235,600
コメダホールディングス	25,800	2,264.00	58,411,200
ピーバンドットコム	1,700	511.00	868,700
アセンテック	4,100	646.00	2,648,600

富士興産	3,000	1,120.00	3,360,000
協栄産業	1,200	1,391.00	1,669,200
フルサト・マルカホールディングス	10,500	2,852.00	29,946,000
ヤマエグループホールディングス	6,600	1,358.00	8,962,800
小野建	10,600	1,404.00	14,882,400
南陽	2,200	1,812.00	3,986,400
佐島電機	7,400	1,078.00	7,977,200
エコートレーディング	2,500	568.00	1,420,000
伯東	6,900	2,603.00	17,960,700
コンドーテック	8,900	1,043.00	9,282,700
中山福	6,300	316.00	1,990,800
ナガイレーベン	14,300	2,025.00	28,957,500
三菱食品	11,400	3,565.00	40,641,000
松田産業	8,600	2,045.00	17,587,000
第一興商	22,400	3,810.00	85,344,000
メディバルホールディングス	109,300	2,050.00	224,065,000
S P K	4,700	1,373.00	6,453,100
萩原電気ホールディングス	4,000	2,028.00	8,112,000
アズワン	17,000	6,370.00	108,290,000
スズデン	3,700	2,025.00	7,492,500
尾家産業	2,800	820.00	2,296,000
シモジマ	7,300	1,016.00	7,416,800
ドウシシャ	11,200	1,601.00	17,931,200
小津産業	2,600	1,883.00	4,895,800
高速	6,300	1,507.00	9,494,100
たけびし	4,000	1,503.00	6,012,000
リックス	2,400	2,045.00	4,908,000
丸文	9,400	771.00	7,247,400
ハビネット	9,000	1,643.00	14,787,000
橋本総業ホールディングス	2,100	2,012.00	4,225,200
日本ライフライン	35,000	988.00	34,580,000
タカショー	9,200	726.00	6,679,200
I D O M	35,900	759.00	27,248,100
進和	7,000	2,318.00	16,226,000
エスケイジャパン	2,900	463.00	1,342,700
ダイトロン	4,600	1,872.00	8,611,200
シークス	15,000	964.00	14,460,000
田中商事	3,700	578.00	2,138,600
オーハシテクニカ	5,800	1,382.00	8,015,600
白銅	3,800	2,454.00	9,325,200
ダイコー通産	1,400	1,085.00	1,519,000
伊藤忠商事	708,500	3,867.00	2,739,769,500

丸紅	1,023,700	1,226.00	1,255,056,200
高島	1,700	2,619.00	4,452,300
長瀬産業	54,100	2,019.00	109,227,900
蝶理	6,600	1,978.00	13,054,800
豊田通商	105,500	4,550.00	480,025,000
三共生興	15,200	514.00	7,812,800
兼松	40,900	1,391.00	56,891,900
ツカモトコーポレーション	2,000	1,095.00	2,190,000
三井物産	856,500	2,919.50	2,500,551,750
日本紙パルプ商事	5,600	4,100.00	22,960,000
カメイ	12,600	1,085.00	13,671,000
東都水産	600	4,795.00	2,877,000
OUGホールディングス	1,700	2,834.00	4,817,800
スターゼン	8,000	2,067.00	16,536,000
山善	42,600	1,011.00	43,068,600
椿本興業	1,900	3,835.00	7,286,500
住友商事	699,200	1,875.00	1,311,000,000
内田洋行	4,700	4,950.00	23,265,000
三菱商事	774,800	3,949.00	3,059,685,200
第一実業	4,600	3,335.00	15,341,000
キャノンマーケティングジャパン	29,300	2,938.00	86,083,400
西華産業	5,100	1,682.00	8,578,200
佐藤商事	8,100	1,123.00	9,096,300
菱洋エレクトロ	7,000	2,334.00	16,338,000
東京産業	9,600	727.00	6,979,200
ユアサ商事	9,500	3,625.00	34,437,500
神鋼商事	2,600	3,820.00	9,932,000
トルク	6,400	202.00	1,292,800
阪和興業	20,500	2,841.00	58,240,500
正栄食品工業	7,700	3,875.00	29,837,500
カナデン	9,600	1,056.00	10,137,600
菱電商事	9,400	1,648.00	15,491,200
岩谷産業	26,200	5,560.00	145,672,000
ナイス	3,600	1,710.00	6,156,000
ニチモウ	1,400	2,390.00	3,346,000
極東貿易	3,400	2,646.00	8,996,400
アステナホールディングス	15,200	439.00	6,672,800
三愛オブリ	26,500	1,048.00	27,772,000
稲畑産業	23,700	2,364.00	56,026,800
G S I クレオス	5,700	1,459.00	8,316,300
明和産業	10,900	743.00	8,098,700
クワザワホールディングス	4,300	453.00	1,947,900

ワキタ	21,300	1,113.00	23,706,900
東邦ホールディングス	32,100	2,143.00	68,790,300
サンゲツ	28,700	1,621.00	46,522,700
ミツウロコグループホールディングス	13,600	939.00	12,770,400
シナネンホールディングス	3,900	3,555.00	13,864,500
伊藤忠エネクス	26,100	1,076.00	28,083,600
サンリオ	33,200	3,035.00	100,762,000
サンワテクノス	6,000	1,383.00	8,298,000
リョーサン	12,100	2,219.00	26,849,900
新光商事	15,600	909.00	14,180,400
トーホー	4,500	1,246.00	5,607,000
三信電気	4,900	1,544.00	7,565,600
東陽テクニカ	11,700	1,198.00	14,016,600
モスフードサービス	15,500	3,390.00	52,545,000
加賀電子	9,600	3,185.00	30,576,000
ソーダニッカ	9,500	580.00	5,510,000
立花エレテック	7,700	1,565.00	12,050,500
フォーバル	4,200	870.00	3,654,000
PALTAC	16,600	4,415.00	73,289,000
三谷産業	18,500	314.00	5,809,000
西本Wismettacホールディングス	2,700	3,935.00	10,624,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	1,692.00	1,861,200
コア商事ホールディングス	7,400	728.00	5,387,200
国際紙パルプ商事	21,900	487.00	10,665,300
ヤマタネ	5,100	1,590.00	8,109,000
丸紅建材リース	1,000	1,947.00	1,947,000
日鉄物産	7,200	5,120.00	36,864,000
泉州電業	2,900	5,070.00	14,703,000
トラスコ中山	24,600	1,919.00	47,207,400
オートバックスセブン	36,700	1,440.00	52,848,000
モリト	8,600	767.00	6,596,200
加藤産業	12,800	3,395.00	43,456,000
北恵	3,000	797.00	2,391,000
イノテック	7,200	1,334.00	9,604,800
イエローハット	18,600	1,783.00	33,163,800
JKホールディングス	8,300	995.00	8,258,500
日伝	8,000	1,982.00	15,856,000
北沢産業	6,300	201.00	1,266,300
杉本商事	5,500	2,105.00	11,577,500
因幡電機産業	29,400	2,805.00	82,467,000
東テク	3,500	3,475.00	12,162,500
ミスミグループ本社	148,400	3,235.00	480,074,000

アルテック	7,300	286.00	2,087,800
タキヒヨー	3,200	825.00	2,640,000
蔵王産業	2,300	1,878.00	4,319,400
スズケン	42,400	3,880.00	164,512,000
ジェコス	8,200	835.00	6,847,000
グローセル	12,900	402.00	5,185,800
ローソン	26,200	4,765.00	124,843,000
サンエー	8,100	4,305.00	34,870,500
カワチ薬品	9,300	2,182.00	20,292,600
エービーシー・マート	18,500	5,780.00	106,930,000
ハードオフコーポレーション	5,400	1,008.00	5,443,200
アスクル	25,600	1,714.00	43,878,400
ゲオホールディングス	14,400	1,409.00	20,289,600
アダストリア	12,800	2,002.00	25,625,600
くら寿司	12,400	3,210.00	39,804,000
キャンドウ	4,500	2,214.00	9,963,000
アイケイ	4,200	447.00	1,877,400
パルグループホールディングス	10,400	2,267.00	23,576,800
エディオン	54,400	1,329.00	72,297,600
サーラコーポレーション	24,300	727.00	17,666,100
ワッツ	6,000	743.00	4,458,000
ハローズ	5,500	3,130.00	17,215,000
フジオフードグループ本社	8,800	1,347.00	11,853,600
あみやき亭	2,900	2,964.00	8,595,600
大黒天物産	3,800	5,710.00	21,698,000
ハニーズホールディングス	9,500	1,296.00	12,312,000
ファーマライズホールディングス	2,800	698.00	1,954,400
アルペン	8,800	2,118.00	18,638,400
ハブ	4,200	529.00	2,221,800
クオールホールディングス	14,600	1,468.00	21,432,800
ジズホールディングス	6,300	3,685.00	23,215,500
ビックカメラ	70,300	1,226.00	86,187,800
D C Mホールディングス	70,400	1,073.00	75,539,200
Monotaro	149,500	2,286.00	341,757,000
東京一番フーズ	3,000	588.00	1,764,000
きちりホールディングス	3,100	357.00	1,106,700
アーランドサービスホールディングス	8,700	2,152.00	18,722,400
J．フロント リテイリング	131,200	1,090.00	143,008,000
ドトール・日レスホールディングス	18,800	1,674.00	31,471,200
マツキヨココカラ&カンパニー	69,300	4,935.00	341,995,500
ブロンコビリー	6,300	2,446.00	15,409,800
Z O Z O	81,300	2,903.00	236,013,900

トレジャー・ファクトリー	3,600	1,581.00	5,691,600
物語コーポレーション	5,900	5,640.00	33,276,000
三越伊勢丹ホールディングス	177,600	1,058.00	187,900,800
H a m e e	4,500	1,016.00	4,572,000
マーケットエンタープライズ	1,400	1,045.00	1,463,000
ウエルシアホールディングス	62,500	3,035.00	189,687,500
クリエイティブSDホールディングス	17,500	3,125.00	54,687,500
丸善C H Iホールディングス	13,800	378.00	5,216,400
ミサワ	2,700	603.00	1,628,100
ティーライフ	1,700	1,400.00	2,380,000
チムニー	3,600	1,226.00	4,413,600
シュッピン	10,000	1,369.00	13,690,000
オイシックス・ラ・大地	17,100	1,735.00	29,668,500
ネクステージ	24,100	2,799.00	67,455,900
ジョイフル本田	34,000	1,669.00	56,746,000
鳥貴族ホールディングス	4,000	2,159.00	8,636,000
ホットランド	9,000	1,335.00	12,015,000
すかいらーくホールディングス	144,200	1,599.00	230,575,800
S F Pホールディングス	5,800	1,716.00	9,952,800
綿半ホールディングス	8,300	1,465.00	12,159,500
ヨシックスホールディングス	2,400	2,245.00	5,388,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	34,500	1,144.00	39,468,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,300	1,714.00	10,798,200
B E E N O S	6,000	2,497.00	14,982,000
あさひ	9,900	1,319.00	13,058,100
日本調剤	7,300	1,420.00	10,366,000
コスモス薬品	11,900	14,240.00	169,456,000
トーエル	5,400	922.00	4,978,800
セブン&アイ・ホールディングス	396,300	5,357.00	2,122,979,100
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	79,300	984.00	78,031,200
ツルハホールディングス	25,800	7,770.00	200,466,000
サンマルクホールディングス	9,500	1,625.00	15,437,500
フェリシモ	2,800	1,104.00	3,091,200
トリドールホールディングス	29,500	2,548.00	75,166,000
T O K Y O B A S E	11,500	324.00	3,726,000
ウイルプラスホールディングス	2,400	907.00	2,176,800
J Mホールディングス	9,100	1,642.00	14,942,200
サツドラホールディングス	5,600	651.00	3,645,600
アレンザホールディングス	8,100	1,057.00	8,561,700
串カツ田中ホールディングス	3,300	1,879.00	6,200,700
パロックジャパンリミテッド	8,500	828.00	7,038,000

クスリのアオキホールディングス	10,600	5,660.00	59,996,000
力の源ホールディングス	6,000	666.00	3,996,000
FOOD & LIFE COMPANIES	60,600	2,505.00	151,803,000
メディカルシステムネットワーク	10,800	441.00	4,762,800
はるやまホールディングス	6,000	437.00	2,622,000
ノジマ	19,200	3,035.00	58,272,000
カッパ・クリエイト	16,600	1,480.00	24,568,000
ライトオン	8,800	748.00	6,582,400
良品計画	136,100	1,382.00	188,090,200
パリミキホールディングス	15,400	268.00	4,127,200
アドヴァングループ	10,300	807.00	8,312,100
アルビス	3,500	2,307.00	8,074,500
コナカ	12,800	341.00	4,364,800
ハウス オブ ローゼ	1,600	1,655.00	2,648,000
G - 7ホールディングス	13,300	1,507.00	20,043,100
イオン北海道	15,700	1,066.00	16,736,200
コジマ	20,600	688.00	14,172,800
ヒマラヤ	3,900	990.00	3,861,000
コーナン商事	16,900	3,880.00	65,572,000
エコス	4,000	2,027.00	8,108,000
ワタミ	14,300	921.00	13,170,300
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	236,400	2,130.00	503,532,000
西松屋チェーン	23,500	1,678.00	39,433,000
ゼンショーホールディングス	57,800	3,485.00	201,433,000
幸楽苑ホールディングス	6,900	1,296.00	8,942,400
ハークスレイ	5,300	557.00	2,952,100
サイゼリヤ	17,600	2,765.00	48,664,000
V Tホールディングス	44,900	493.00	22,135,700
魚力	3,400	2,497.00	8,489,800
フジ・コーポレーション	6,400	1,265.00	8,096,000
ユナイテッドアローズ	12,500	1,814.00	22,675,000
ハイデイ日高	17,200	2,172.00	37,358,400
YU - WA Creation Holdings	7,900	203.00	1,603,700
コロワイド	48,600	1,933.00	93,943,800
ピーシーデポコーポレーション	14,400	306.00	4,406,400
壱番屋	8,400	4,725.00	39,690,000
PLANT	3,000	658.00	1,974,000
スギホールディングス	23,600	6,060.00	143,016,000
薬王堂ホールディングス	6,000	2,082.00	12,492,000
スクロール	18,400	935.00	17,204,000

ヨンドシーホールディングス	10,100	1,814.00	18,321,400
木曽路	15,800	2,255.00	35,629,000
S R Sホールディングス	17,200	881.00	15,153,200
千趣会	21,900	388.00	8,497,200
リテールパートナーズ	15,800	1,275.00	20,145,000
ケーヨー	22,000	988.00	21,736,000
上新電機	11,600	2,080.00	24,128,000
日本瓦斯	56,600	1,986.00	112,407,600
ロイヤルホールディングス	18,300	2,137.00	39,107,100
いなげや	11,800	1,290.00	15,222,000
チヨダ	10,300	846.00	8,713,800
ライフコーポレーション	9,300	2,656.00	24,700,800
リンガーハット	13,600	2,352.00	31,987,200
MrMaxHD	15,100	638.00	9,633,800
AOKIホールディングス	23,200	681.00	15,799,200
オークワ	17,000	875.00	14,875,000
コメリ	18,300	2,789.00	51,038,700
青山商事	22,800	905.00	20,634,000
しまむら	13,800	13,130.00	181,194,000
はせがわ	7,100	253.00	1,796,300
高島屋	79,500	1,432.00	113,844,000
松屋	20,000	926.00	18,520,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	51,400	1,002.00	51,502,800
近鉄百貨店	3,500	2,341.00	8,193,500
丸井グループ	85,600	2,392.00	204,755,200
アクシアル リテイリング	7,900	3,510.00	27,729,000
イオン	389,800	2,689.50	1,048,367,100
イズミ	18,700	3,265.00	61,055,500
平和堂	17,700	2,062.00	36,497,400
フジ	25,900	2,174.00	56,306,600
ヤオコー	13,400	6,500.00	87,100,000
ゼビオホールディングス	16,300	943.00	15,370,900
ケーズホールディングス	100,700	1,417.00	142,691,900
Olympicグループ	5,600	608.00	3,404,800
日産東京販売ホールディングス	18,200	272.00	4,950,400
シルバーライフ	2,600	1,300.00	3,380,000
Genky DrugStores	5,300	3,540.00	18,762,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,900	880.00	2,552,000
ブックオフグループホールディングス	6,900	994.00	6,858,600
ギフトホールディングス	1,900	2,597.00	4,934,300
アインホールディングス	14,500	7,420.00	107,590,000
元気寿司	3,400	2,587.00	8,795,800

ヤマダホールディングス	418,500	499.00	208,831,500	
アークランドサカモト	18,600	1,605.00	29,853,000	
ニトリホールディングス	46,900	14,465.00	678,408,500	
グルメ杵屋	9,600	1,047.00	10,051,200	
愛眼	8,600	178.00	1,530,800	
ケーユーホールディングス	6,400	1,186.00	7,590,400	
吉野家ホールディングス	41,300	2,550.00	105,315,000	
松屋フーズホールディングス	5,700	4,125.00	23,512,500	
サガミホールディングス	17,100	1,182.00	20,212,200	
関西フードマーケット	9,700	1,280.00	12,416,000	
王将フードサービス	7,800	6,930.00	54,054,000	
プレナス	13,300	2,003.00	26,639,900	
ミニストップ	8,800	1,470.00	12,936,000	
アークス	21,000	2,174.00	45,654,000	
パローホールディングス	24,200	1,935.00	46,827,000	
ベルク	5,300	5,450.00	28,885,000	
大庄	6,500	1,171.00	7,611,500	
ファーストリテイリング	15,800	79,780.00	1,260,524,000	
サンドラッグ	44,500	3,140.00	139,730,000	
サックスパー ホールディングス	11,500	607.00	6,980,500	
ヤマザワ	2,600	1,431.00	3,720,600	
やまや	2,400	2,634.00	6,321,600	
ベルーナ	25,600	826.00	21,145,600	
島根銀行	3,800	491.00	1,865,800	
じもとホールディングス	7,800	573.00	4,469,400	
めぶきフィナンシャルグループ	486,800	269.00	130,949,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,700	2,187.00	29,961,900	
九州フィナンシャルグループ	207,100	386.00	79,940,600	
ゆうちょ銀行	279,300	1,070.00	298,851,000	
富山第一銀行	26,300	430.00	11,309,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	585,800	450.00	263,610,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	62,100	743.00	46,140,300	
三十三フィナンシャルグループ	9,500	1,406.00	13,357,000	
第四北越フィナンシャルグループ	16,700	2,544.00	42,484,800	
ひろぎんホールディングス	151,300	614.00	92,898,200	
おきなわフィナンシャルグループ	10,000	2,233.00	22,330,000	
十六フィナンシャルグループ	13,800	2,461.00	33,961,800	
北國フィナンシャルホールディングス	9,800	4,550.00	44,590,000	
プロクレアホールディングス	12,000	2,041.00	24,492,000	
新生銀行	77,200	1,988.00	153,473,600	
あおぞら銀行	66,100	2,788.00	184,286,800	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,926,600	735.70	5,095,899,620	

りそなホールディングス	1,252,100	510.00	638,571,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	195,700	4,264.00	834,464,800	
三井住友フィナンシャルグループ	767,900	4,116.00	3,160,676,400	
千葉銀行	334,200	731.00	244,300,200	
群馬銀行	190,400	379.00	72,161,600	
武蔵野銀行	15,100	1,779.00	26,862,900	
千葉興業銀行	25,500	258.00	6,579,000	
筑波銀行	46,100	196.00	9,035,600	
七十七銀行	31,400	1,759.00	55,232,600	
秋田銀行	7,100	1,672.00	11,871,200	
山形銀行	10,900	909.00	9,908,100	
岩手銀行	7,200	1,982.00	14,270,400	
東邦銀行	84,700	209.00	17,702,300	
東北銀行	5,300	965.00	5,114,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	85,400	2,325.00	198,555,000	
静岡銀行	243,900	809.00	197,315,100	
スルガ銀行	103,800	375.00	38,925,000	
八十二銀行	219,500	498.00	109,311,000	
山梨中央銀行	11,900	1,133.00	13,482,700	
大垣共立銀行	20,300	1,743.00	35,382,900	
福井銀行	9,400	1,387.00	13,037,800	
清水銀行	4,200	1,464.00	6,148,800	
富山銀行	1,800	1,817.00	3,270,600	
滋賀銀行	19,300	2,732.00	52,727,600	
南都銀行	16,000	2,010.00	32,160,000	
百五銀行	99,400	324.00	32,205,600	
京都銀行	36,700	5,570.00	204,419,000	
紀陽銀行	35,100	1,424.00	49,982,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	67,200	850.00	57,120,000	
山陰合同銀行	65,800	674.00	44,349,200	
中国銀行	83,300	968.00	80,634,400	
鳥取銀行	3,800	1,145.00	4,351,000	
伊予銀行	132,700	639.00	84,795,300	
百十四銀行	10,900	1,711.00	18,649,900	
四国銀行	15,600	846.00	13,197,600	
阿波銀行	15,700	2,020.00	31,714,000	
大分銀行	6,400	1,922.00	12,300,800	
宮崎銀行	6,400	2,091.00	13,382,400	
佐賀銀行	6,200	1,470.00	9,114,000	
琉球銀行	25,700	806.00	20,714,200	
セブン銀行	351,400	267.00	93,823,800	
みずほフィナンシャルグループ	1,418,800	1,580.50	2,242,413,400	

高知銀行	3,700	694.00	2,567,800
山口フィナンシャルグループ	118,200	751.00	88,768,200
長野銀行	3,600	1,301.00	4,683,600
名古屋銀行	7,200	3,025.00	21,780,000
北洋銀行	148,700	227.00	33,754,900
愛知銀行	3,700	5,180.00	19,166,000
中京銀行	3,700	1,671.00	6,182,700
大光銀行	3,500	1,334.00	4,669,000
愛媛銀行	15,400	878.00	13,521,200
トマト銀行	3,600	1,005.00	3,618,000
京葉銀行	49,400	470.00	23,218,000
栃木銀行	53,100	275.00	14,602,500
北日本銀行	3,400	1,661.00	5,647,400
東和銀行	19,400	523.00	10,146,200
福島銀行	12,500	216.00	2,700,000
大東銀行	5,200	648.00	3,369,600
トモニホールディングス	85,400	312.00	26,644,800
フィデアホールディングス	10,800	1,292.00	13,953,600
池田泉州ホールディングス	125,600	205.00	25,748,000
F P G	40,000	1,012.00	40,480,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	9,300	1,442.00	13,410,600
マーキュリアホールディングス	6,600	596.00	3,933,600
S B Iホールディングス	146,200	2,663.00	389,330,600
ジャフコ グループ	41,000	1,805.00	74,005,000
大和証券グループ本社	760,200	615.30	467,751,060
野村ホールディングス	1,807,100	506.10	914,573,310
岡三証券グループ	85,800	351.00	30,115,800
丸三証券	35,500	487.00	17,288,500
東洋証券	36,500	235.00	8,577,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	116,900	381.00	44,538,900
光世証券	2,800	455.00	1,274,000
水戸証券	29,500	269.00	7,935,500
いちよし証券	19,800	640.00	12,672,000
松井証券	58,100	802.00	46,596,200
マネックスグループ	100,000	462.00	46,200,000
極東証券	13,700	707.00	9,685,900
岩井コスモホールディングス	11,300	1,277.00	14,430,100
アイザワ証券グループ	16,200	711.00	11,518,200
マネーパートナーズグループ	13,200	253.00	3,339,600
スパークス・グループ	55,200	301.00	16,615,200
かんぽ生命保険	119,100	2,167.00	258,089,700
S O M P Oホールディングス	168,400	5,936.00	999,622,400

アニコム ホールディングス	36,300	688.00	24,974,400
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	243,200	4,339.00	1,055,244,800
第一生命ホールディングス	576,300	2,300.00	1,325,490,000
東京海上ホールディングス	329,300	7,784.00	2,563,271,200
T & D ホールディングス	263,300	1,509.00	397,319,700
アドバンスクリエイト	5,700	994.00	5,665,800
全国保証	28,300	4,505.00	127,491,500
あんしん保証	5,900	265.00	1,563,500
イントラスト	5,500	585.00	3,217,500
日本モーゲージサービス	6,900	991.00	6,837,900
C a s a	4,500	904.00	4,068,000
アルヒ	17,800	1,049.00	18,672,200
プレミアグループ	6,100	4,500.00	27,450,000
ネットプロテクションズホールディングス	36,400	610.00	22,204,000
クレディセゾン	69,300	1,696.00	117,532,800
芙蓉総合リース	10,200	8,180.00	83,436,000
みずほリース	14,700	3,280.00	48,216,000
東京センチュリー	18,400	4,760.00	87,584,000
日本証券金融	46,900	859.00	40,287,100
アイフル	199,400	388.00	77,367,200
リコーリース	10,600	3,645.00	38,637,000
イオンフィナンシャルサービス	64,600	1,419.00	91,667,400
アコム	234,400	344.00	80,633,600
ジャックス	11,800	3,635.00	42,893,000
オリエントコーポレーション	322,400	135.00	43,524,000
オリックス	703,200	2,301.50	1,618,414,800
三菱H C キャピタル	383,000	638.00	244,354,000
九州リースサービス	5,600	575.00	3,220,000
日本取引所グループ	275,800	2,188.50	603,588,300
イー・ギャランティ	17,700	2,276.00	40,285,200
アサックス	6,700	612.00	4,100,400
N E C キャピタルソリューション	5,000	2,101.00	10,505,000
いちご	135,500	299.00	40,514,500
日本駐車場開発	123,200	171.00	21,067,200
スター・マイカ・ホールディングス	7,100	1,488.00	10,564,800
S R E ホールディングス	3,400	2,427.00	8,251,800
A D ワークスグループ	21,100	154.00	3,249,400
ヒューリック	258,500	1,054.00	272,459,000
三栄建築設計	5,400	1,629.00	8,796,600
野村不動産ホールディングス	61,600	3,225.00	198,660,000
三重交通グループホールディングス	26,200	486.00	12,733,200
サムティ	17,900	2,050.00	36,695,000

ディア・ライフ	16,300	615.00	10,024,500
地主	8,000	2,025.00	16,200,000
プレサンスコーポレーション	13,600	1,596.00	21,705,600
ハウスコム	3,200	903.00	2,889,600
JPMC	6,800	1,011.00	6,874,800
サンセイランディック	4,700	849.00	3,990,300
フージャースホールディングス	15,100	809.00	12,215,900
オープンハウスグループ	37,800	5,780.00	218,484,000
東急不動産ホールディングス	323,300	709.00	229,219,700
飯田グループホールディングス	99,200	2,194.00	217,644,800
イーランド	2,400	1,427.00	3,424,800
ムゲンエステート	9,500	478.00	4,541,000
And Doホールディングス	5,800	830.00	4,814,000
シーアールイー	5,100	1,688.00	8,608,800
ケイアイスター不動産	5,500	4,795.00	26,372,500
グッドコムアセット	6,000	1,232.00	7,392,000
ジェイ・エス・ビー	2,700	3,195.00	8,626,500
ロードスターキャピタル	3,500	1,906.00	6,671,000
テンポイノベーション	4,500	897.00	4,036,500
フェイスネットワーク	2,300	1,360.00	3,128,000
パーク24	70,700	1,849.00	130,724,300
パラカ	4,000	1,867.00	7,468,000
三井不動産	462,200	2,905.00	1,342,691,000
三菱地所	674,400	1,957.00	1,319,800,800
平和不動産	19,100	3,965.00	75,731,500
東京建物	101,900	1,903.00	193,915,700
京阪神ビルディング	16,300	1,293.00	21,075,900
住友不動産	213,100	3,617.00	770,782,700
テーオーシー	19,100	790.00	15,089,000
東京楽天地	2,000	4,025.00	8,050,000
スターツコーポレーション	16,500	2,868.00	47,322,000
フジ住宅	15,400	671.00	10,333,400
空港施設	13,800	549.00	7,576,200
明和地所	7,300	626.00	4,569,800
ゴールドクレスト	10,000	1,748.00	17,480,000
エスリード	5,200	1,721.00	8,949,200
日神グループホールディングス	21,800	439.00	9,570,200
日本エスコン	22,000	765.00	16,830,000
タカラレーベン	49,600	369.00	18,302,400
A V A N T I A	6,900	829.00	5,720,100
イオンモール	60,000	1,681.00	100,860,000
毎日コムネット	5,800	621.00	3,601,800

ファースト住建	5,400	1,122.00	6,058,800
カチタス	29,600	3,280.00	97,088,000
トーセイ	17,200	1,264.00	21,740,800
穴吹興産	3,100	2,117.00	6,562,700
サンフロンティア不動産	17,300	1,104.00	19,099,200
FJネクストホールディングス	12,600	1,082.00	13,633,200
インテリックス	2,700	545.00	1,471,500
ランドビジネス	4,000	231.00	924,000
サンネクスタグループ	4,800	1,021.00	4,900,800
グランディハウス	10,000	551.00	5,510,000
日本空港ビルデング	38,400	5,150.00	197,760,000
明豊ファシリティワークス	5,600	656.00	3,673,600
日本工営	7,400	3,440.00	25,456,000
LIFULL	36,200	175.00	6,335,000
ミクシィ	26,300	2,280.00	59,964,000
ジェイエイシーリクルートメント	9,400	1,947.00	18,301,800
日本M&Aセンターホールディングス	188,200	1,723.00	324,268,600
メンバーズ	3,100	2,776.00	8,605,600
中広	2,400	398.00	955,200
UTグループ	16,600	2,530.00	41,998,000
アイティメディア	5,600	1,622.00	9,083,200
E・Jホールディングス	6,700	1,327.00	8,890,900
夢真ビーネックスグループ	37,500	1,589.00	59,587,500
コシダカホールディングス	31,000	685.00	21,235,000
アルトナー	3,000	921.00	2,763,000
パソナグループ	12,500	1,951.00	24,387,500
CDS	2,900	1,843.00	5,344,700
リンクアンドモチベーション	25,300	555.00	14,041,500
エス・エム・エス	39,000	3,095.00	120,705,000
サニーサイドアップグループ	4,300	679.00	2,919,700
パーソルホールディングス	114,700	2,718.00	311,754,600
リニカル	6,700	820.00	5,494,000
クックパッド	37,000	205.00	7,585,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	5,900	589.00	3,475,100
学情	4,800	1,057.00	5,073,600
スタジオアリス	5,200	2,262.00	11,762,400
シミックホールディングス	5,800	1,519.00	8,810,200
エプコ	2,700	680.00	1,836,000
NJS	2,600	1,973.00	5,129,800
総合警備保障	41,900	4,015.00	168,228,500
カカクコム	84,200	2,566.00	216,057,200
アイロムグループ	4,100	1,946.00	7,978,600

セントケア・ホールディング	7,700	897.00	6,906,900
サイネックス	2,300	594.00	1,366,200
ルネサンス	8,200	956.00	7,839,200
ディップ	20,200	3,570.00	72,114,000
デジタルホールディングス	8,100	1,303.00	10,554,300
新日本科学	14,100	1,942.00	27,382,200
キャリアデザインセンター	2,500	1,167.00	2,917,500
ベネフィット・ワン	41,800	1,993.00	83,307,400
エムスリー	202,400	3,926.00	794,622,400
ツカダ・グローバルホールディング	7,300	316.00	2,306,800
アウトソーシング	65,900	1,141.00	75,191,900
ウェルネット	10,600	452.00	4,791,200
ワールドホールディングス	4,700	2,330.00	10,951,000
ディー・エヌ・エー	43,800	1,955.00	85,629,000
博報堂DYホールディングス	145,300	1,375.00	199,787,500
ぐるなび	17,300	374.00	6,470,200
タカミヤ	14,400	383.00	5,515,200
ジャパンベストレスキューシステム	6,500	763.00	4,959,500
ファンコミュニケーションズ	26,300	391.00	10,283,300
ライク	3,900	2,150.00	8,385,000
ビジネス・ブレークスルー	4,700	422.00	1,983,400
エスプール	32,600	1,027.00	33,480,200
WDBホールディングス	5,300	2,549.00	13,509,700
ティア	7,200	433.00	3,117,600
C D G	1,400	1,283.00	1,796,200
アドウェイズ	17,500	701.00	12,267,500
バリューコマース	9,100	3,130.00	28,483,000
インフォマート	126,100	450.00	56,745,000
J Pホールディングス	30,300	259.00	7,847,700
エコナックホールディングス	22,000	90.00	1,980,000
C Lホールディングス	2,600	934.00	2,428,400
プレステージ・インターナショナル	43,300	682.00	29,530,600
アミューズ	6,300	2,020.00	12,726,000
ドリームインキュベータ	3,600	2,034.00	7,322,400
クイック	7,300	1,464.00	10,687,200
T A C	7,200	214.00	1,540,800
電通グループ	107,500	4,555.00	489,662,500
イオンファンタジー	4,500	2,854.00	12,843,000
シーティーエス	13,200	840.00	11,088,000
ネクシィーズグループ	3,900	590.00	2,301,000
H . U . グループホールディングス	30,000	3,220.00	96,600,000
アルプス技研	9,800	1,896.00	18,580,800

ダイオーズ	2,400	1,091.00	2,618,400
日本空調サービス	12,300	797.00	9,803,100
オリエンタルランド	121,900	19,270.00	2,349,013,000
ダスキン	24,800	3,045.00	75,516,000
明光ネットワークジャパン	13,800	612.00	8,445,600
ファルコホールディングス	5,200	1,971.00	10,249,200
ラウンドワン	32,100	1,450.00	46,545,000
リゾートトラスト	48,600	2,109.00	102,497,400
ビー・エム・エル	14,600	3,930.00	57,378,000
りらいあコミュニケーションズ	17,100	1,119.00	19,134,900
リソー教育	53,100	303.00	16,089,300
早稲田アカデミー	6,500	1,175.00	7,637,500
ユー・エス・エス	128,400	2,648.00	340,003,200
東京個別指導学院	10,500	599.00	6,289,500
サイバーエージェント	245,000	1,356.00	332,220,000
楽天グループ	532,400	653.00	347,657,200
クリーク・アンド・リバー社	6,100	2,326.00	14,188,600
モーニングスター	20,400	517.00	10,546,800
テー・オー・ダブリュー	22,500	320.00	7,200,000
山田コンサルティンググループ	6,100	1,198.00	7,307,800
セントラルスポーツ	4,400	2,557.00	11,250,800
フルキャストホールディングス	9,900	2,260.00	22,374,000
エン・ジャパン	20,500	2,037.00	41,758,500
リソルホールディングス	1,300	4,800.00	6,240,000
テクノプロ・ホールディングス	68,700	3,045.00	209,191,500
アトラグループ	2,500	192.00	480,000
インターワークス	3,900	368.00	1,435,200
アイ・アールジャパンホールディングス	5,400	2,164.00	11,685,600
Keeper 技研	7,400	3,465.00	25,641,000
ファーストロジック	2,000	774.00	1,548,000
三機サービス	2,200	994.00	2,186,800
Gunosy	6,600	805.00	5,313,000
デザインワン・ジャパン	4,500	180.00	810,000
イー・ガーディアン	3,900	3,155.00	12,304,500
リブセンス	7,500	169.00	1,267,500
ジャパンマテリアル	35,400	1,869.00	66,162,600
ベクトル	16,200	1,210.00	19,602,000
ウチヤマホールディングス	6,300	309.00	1,946,700
チャーム・ケア・コーポレーション	8,700	1,179.00	10,257,300
キャリアリンク	4,300	2,163.00	9,300,900
I B J	9,700	708.00	6,867,600
アサンテ	5,200	1,575.00	8,190,000

バリューHR	10,100	1,363.00	13,766,300
M&Aキャピタルパートナーズ	9,500	3,530.00	33,535,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,600	1,299.00	5,975,400
E R Iホールディングス	3,400	1,053.00	3,580,200
アビスト	1,800	2,991.00	5,383,800
シグマクシス・ホールディングス	14,000	1,200.00	16,800,000
ウィルグループ	8,700	1,224.00	10,648,800
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	13,200	161.00	2,125,200
メドピア	8,100	2,072.00	16,783,200
レアジョブ	2,500	552.00	1,380,000
リクルートホールディングス	821,300	4,700.00	3,860,110,000
エラン	16,000	1,097.00	17,552,000
土木管理総合試験所	5,900	327.00	1,929,300
ネットマーケティング	6,000	598.00	3,588,000
日本郵政	1,252,800	965.20	1,209,202,560
ベルシステム24ホールディングス	16,600	1,499.00	24,883,400
鎌倉新書	13,400	584.00	7,825,600
S MN	2,900	579.00	1,679,100
グローバルキッズCOMPANY	2,000	727.00	1,454,000
エアトリ	6,700	2,378.00	15,932,600
アトラエ	8,200	1,780.00	14,596,000
ストライク	5,100	3,785.00	19,303,500
ソラスト	28,400	844.00	23,969,600
セラク	3,800	1,210.00	4,598,000
インソース	12,800	2,300.00	29,440,000
ベिकाレント・コンサルティング	8,100	36,700.00	297,270,000
Orchestra Holdings	2,300	2,646.00	6,085,800
アイモバイル	5,900	1,335.00	7,876,500
キャリアインデックス	4,300	548.00	2,356,400
MS - Japan	4,900	871.00	4,267,900
船場	2,600	708.00	1,840,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	36,500	1,588.00	57,962,000
フルテック	1,800	1,326.00	2,386,800
GameWith	3,900	463.00	1,805,700
MS&Consulting	2,000	639.00	1,278,000
ウェルビー	7,800	763.00	5,951,400
エル・ティー・エス	1,500	3,565.00	5,347,500
ミダックホールディングス	5,200	2,848.00	14,809,600
日総工産	9,300	586.00	5,449,800
キュービーネットホールディングス	5,500	1,342.00	7,381,000
RPAホールディングス	16,800	313.00	5,258,400
スプリックス	4,100	1,013.00	4,153,300

マネジメントソリューションズ	5,700	2,850.00	16,245,000
プロレド・パートナーズ	2,900	489.00	1,418,100
テノ・ホールディングス	1,700	635.00	1,079,500
フロンティア・マネジメント	3,100	1,318.00	4,085,800
ピアラ	2,100	696.00	1,461,600
コプロ・ホールディングス	2,500	847.00	2,117,500
ギークス	2,200	1,017.00	2,237,400
カーブスホールディングス	31,800	682.00	21,687,600
フォーラムエンジニアリング	7,200	959.00	6,904,800
Fast Fitness Japan	2,200	1,420.00	3,124,000
ダイレクトマーケティングミックス	11,700	2,001.00	23,411,700
ポピンズ	2,800	1,879.00	5,261,200
LITALICO	9,400	2,439.00	22,926,600
アドバンテッジリスクマネジメント	6,200	510.00	3,162,000
リログループ	62,800	2,120.00	133,136,000
東祥	8,700	1,333.00	11,597,100
ビーウィズ	3,200	1,450.00	4,640,000
TREホールディングス	21,700	1,546.00	33,548,200
人・夢・技術グループ	4,600	2,599.00	11,955,400
エイチ・アイ・エス	23,900	1,975.00	47,202,500
ラックランド	3,500	2,976.00	10,416,000
共立メンテナンス	20,500	4,985.00	102,192,500
イチネンホールディングス	11,900	1,268.00	15,089,200
建設技術研究所	5,900	2,693.00	15,888,700
スペース	7,700	898.00	6,914,600
燦ホールディングス	5,100	1,876.00	9,567,600
スバル興業	700	8,960.00	6,272,000
東京テアトル	4,200	1,224.00	5,140,800
タナベ経営	4,700	692.00	3,252,400
ナガワ	3,200	8,000.00	25,600,000
東京都競馬	8,600	4,165.00	35,819,000
カナモト	18,900	2,054.00	38,820,600
西尾レントオール	9,600	2,850.00	27,360,000
トランス・コスモス	14,600	3,800.00	55,480,000
乃村工藝社	49,400	890.00	43,966,000
藤田観光	5,000	2,637.00	13,185,000
KNT-CTホールディングス	7,100	1,494.00	10,607,400
日本管財	12,300	2,673.00	32,877,900
トーカイ	9,200	1,807.00	16,624,400
セコム	113,000	8,942.00	1,010,446,000
セントラル警備保障	5,600	2,554.00	14,302,400
丹青社	21,900	822.00	18,001,800

メイテック	40,900	2,389.00	97,710,100	
応用地質	11,000	1,741.00	19,151,000	
船井総研ホールディングス	21,600	2,322.00	50,155,200	
進学会ホールディングス	4,300	327.00	1,406,100	
オオバ	7,500	723.00	5,422,500	
いであ	2,900	1,723.00	4,996,700	
学究社	3,800	1,576.00	5,988,800	
ベネッセホールディングス	38,300	2,333.00	89,353,900	
イオンディライト	13,300	2,944.00	39,155,200	
ナック	5,600	966.00	5,409,600	
ダイセキ	21,000	3,810.00	80,010,000	
ステップ	4,300	1,758.00	7,559,400	
合 計	122,130,000		299,712,490,320	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

2【ファンドの現況】

【インデックスコレクション（国内株式）】

【純資産額計算書】

（2022年 8月31日現在）

資産総額	48,302,995,980円
負債総額	59,674,822円
純資産総額（ - ）	48,243,321,158円
発行済口数	15,978,664,394口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0192円
（1万口当たり純資産額）	（30,192円）

（参考）

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

（2022年 8月31日現在）

資産総額	304,753,995,657円
負債総額	87,764,422円
純資産総額（ - ）	304,666,231,235円
発行済口数	135,276,250,663口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2522円
（1万口当たり純資産額）	（22,522円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換等

該当事項はありません。

(2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(3)譲渡制限

該当事項はありません。

(4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

受益証券の不発行

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

ません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

受益権の再分割

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

償還金

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

質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2022年 8月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

[PLAN（計画）]

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

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

[D0（実行）]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

[CHECK（検証・評価）]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

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

こうした牽制態勢のもと、PLAN - D0 - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2022年10月25日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年8月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	539	14,041,250
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	70	221,703
単位型公社債投資信託	51	216,636
合計	660	14,479,589

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

(1) 【貸借対照表】

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

(単位：百万円)

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

(2) 【損益計算書】

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

（単位：百万円）

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	587	284	302	56,464
当期変動額				
剰余金の配当				3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,379	349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	349	1,029	4,360
当期末残高	791	65	726	60,824

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	587	284	302	56,464
当期変動額				
剰余金の配当				3,662
当期純利益				6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,379	349	1,029	1,029
当期変動額合計	1,379	349	1,029	4,360
当期末残高	791	65	726	60,824

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

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法によっております。

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法によっております。

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

2．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

3．金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

4．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

（2）無形固定資産

定額法によっております。

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

5．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

6．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

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

（2）退職給付引当金

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

過去勤務費用 ：発生事業年度に損益処理

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

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

7．収益及び費用の計上基準

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

（1）投資信託委託業務

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

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

(2) 投資一任業務

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

(3) 投資助言業務

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

(4) 成功報酬

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

8. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジ有効性評価の方法

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

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第42号 2021年8月21日)を適用する予定であります。

(会計方針の変更)

1. 「収益認識に関する会計基準」等の適用

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

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

2. 「時価の算定に関する会計基準」等の適用

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

この変更が財務諸表に与える影響はありません。

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

（未適用の会計基準等）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）

（1）概要

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

（2）適用予定日

2023年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

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

（追加情報）

退職給付債務及び費用の算定方法の変更

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

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

（貸借対照表関係）

1有形固定資産の減価償却累計額

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3．剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

4．基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 剰余金の配当に関する事項

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

4. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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

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

（リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日。以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した投資信託、市場価格のない株式等及び、時価算定適用指針第27項に従い経過措置を適用した組合出資金等は、次表には含まれておりません（（1）*2、*3及び（注2）参照）。

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

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産または負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

前事業年度（2021年3月31日）

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

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

当事業年度（2022年3月31日）

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

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

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

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

(2) 時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位:百万円)

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2021年3月31日）

(単位:百万円)

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

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

1．子会社株式

市場価格のある子会社株式はありません。

なお、市場価格のない子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

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

2．その他有価証券

前事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超える もの その他	9,940	8,798	1,142
小計	9,940	8,798	1,142
貸借対照表計上額が取得原価を超えない もの その他	9	10	1
小計	9	10	1
合計	9,950	8,809	1,141

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

非上場株式及び組合出資金等は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」に含めておりません。

なお、市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	109	1	0

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	7	0	0

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2021年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	2,889	-	41	41
	英ポンド	128	-	0	0
	カナダドル	21	-	0	0
	スイスフラン	51	-	0	0
	香港ドル	128	-	1	1
	ユーロ	246	-	0	0
	買建				
	米ドル	99	-	1	1
	香港ドル	2	-	0	0
合計		3,567	-	41	41

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	13,711	-	315	315
合計		13,711	-	315	315

（注）上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

当事業年度（2022年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)	
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	5,498	-	54	
	英ポンド	277	-	1	
	カナダドル	111	-	1	
	スイスフラン	139	-	2	
	香港ドル	190	-	1	
	ユーロ	676	-	18	
	買建				
	ユーロ	21	-	0	
	合計	6,915	-	80	80

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

(2) 株式関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引				
株価指数先物取引 売建	17,197	-	1,333	1,333
合計	17,197	-	1,333	1,333

(注) 上記取引の評価損益は損益計算書に計上しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。当社が有する退職一時金制度は従来簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しておりましたが、当事業年度より原則法と簡便法の併用により、これら計算を行っておりません。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

該当事項はありません。

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：百万円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

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

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

(5) 年金資産に関する事項

該当事項はありません。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
割引率	-	0.4%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度92百万円、当事業年度100百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

(資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針7.収益及び費用の計上基準」に記載の通りです。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において

存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,649百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*)	6,372百万円

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,365	未収運用受託報酬	5,402
							投信販売代行手数料等	9,124	未払手数料	1,888

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2021年3月31日）

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

当事業年度（2022年3月31日）

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

(1株当たり情報)

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

1株当たり純資産額	20,274,967円09銭	21,406,512円22銭
1株当たり当期純利益金額	2,331,221円85銭	2,162,405円20銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	6,993百万円	6,487百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

(1)自己又はその役員との取引

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

(2)運用財産相互間の取引

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

(3)通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2022年10月25日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2022年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2022年3月末日現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

(参考)再信託受託会社

名称：株式会社日本カストディ銀行

設立年月日：2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2022年3月末日現在）

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

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

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2021年10月26日	有価証券届出書
2021年10月26日	有価証券報告書
2022年 4月26日	有価証券届出書
2022年 4月26日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2022年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 藤 澤 孝

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による

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

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

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

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

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年10月5日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 後藤知弘 印

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」に掲げられているインデックスコレクション（国内株式）の2021年7月27日から2022年7月25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、インデックスコレクション（国内株式）の2022年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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드는継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。