【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年4月22日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田　賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目１番１号
【事務連絡者氏名】	北添　道生
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	日本株式インデックスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

日本株式インデックスファンド

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

①追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

②三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

③当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（3）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（※）とします。

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

（5）【申込手数料】

取得申込受付日の基準価額に、2.2%（税抜　2.0%）（※）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

申込手数料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「（8）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

※「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。

（6）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。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「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1口単位です。

（7）【申込期間】

2024年 4月23日から2024年10月22日までとします。

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

（８）【申込取扱場所】

下記の照会先にお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

＜振替受益権について＞

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

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

＜受益権の取得申込みの方法＞

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後2時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

＜申込みコース＞

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

＜受益権の取得申込みの受付の中止等＞

収益分配金の再投資をする場合を除き、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。）における取引の停止、その他やむを得ない事情が

あるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受付けを中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取消すことができます。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜ファンドの目的＞

当ファンドは、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

＜信託金限度額＞

上限　3,000億円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

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

（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

①一般…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。

②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。

③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
①一般…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。
②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。
③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。
④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。
⑤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①から④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①から④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。
①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。
②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、為替のヘッジを行な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。

◆ESG分類：当ファンドはESG投信ではありません。

＜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）とは

インデックスの概要
（2024年2月末現在）

構成国	1ヵ国（日本）
構成銘柄数	2,151銘柄
時価総額	約507兆円※

※上記時価総額は浮動株ベース

TOPIXの構成銘柄時価総額上位10銘柄

順位	銘柄名	時価総額（億円）
1	トヨタ自動車	265,845
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	123,661
3	ソニーグループ	122,434
4	東京エレクトロン	104,335
5	キーエンス	93,688
6	三菱商事	87,059
7	日立製作所	82,198
8	三井住友フィナンシャルグループ	78,122
9	信越化学工業	76,709
10	日本電信電話	72,717

※上記時価総額は浮動株ベース

（出所）株式会社東京証券取引所のデータを基に三井住友トラスト・アセットマネジメント作成

※「TOPIX（東証株価指数）」とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下、「配当込みTOPIX」という。）の指数値及び配当込みTOPIX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、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、配当込みTOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）の著作権等について

１．TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下、「配当込みＴＯＰＩＸ」という。）の指数値及び配当込みＴＯＰＩＸ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、利用など配当込みＴＯＰＩＸに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みＴＯＰＩＸに係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有する。

２．ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、配当込みＴＯＰＩＸの指数値の算出若しくは公表の停止又は配当込みＴＯＰＩＸ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る。

３．ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値及び配当込みＴＯＰＩＸ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配当込みＴＯＰＩＸの指数値について、何ら保証、言及をするものではない。

４．ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸ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ない。また、ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。

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ない。

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わない。

７．ＪＰＸは、当社又は本件商品の購入者のニーズを配当込みＴＯＰＩＸ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ない。

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ない。

マザーファンドの投資プロセス

投資ユニバース

TOPIX(東証株価指数)の構成銘柄及び採用予定銘柄

↓

ベンチマーク分析

ベンチマークを構成する個別銘柄ウェイト(資本異動等調整後)の推計
信用リスクが高い銘柄をユニバースから除外

↓

ポートフォリオ分析

ポートフォリオとベンチマークの乖離状況等を把握

↓

リバランス案の作成

取引コスト等を勘案しつつ個別銘柄ウェイトのベンチマークからの乖離を極小化すべく、
リバランス案を作成

↓

ポートフォリオ構築
キャッシュマネジメント

リバランス案に基づき売買を行い、ポートフォリオを構築
株価指数先物を用いて、先物を含む株式エクスポージャー比率を調整

※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。

※各ファンドの純資産総額(2024年2月末現在)
ベビーファンド:18.42億円、マザーファンド:4,190.05億円

分配方針

●年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。
ただし、分配を行わないことがあります。

●分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

●収益分配金は、税引後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。

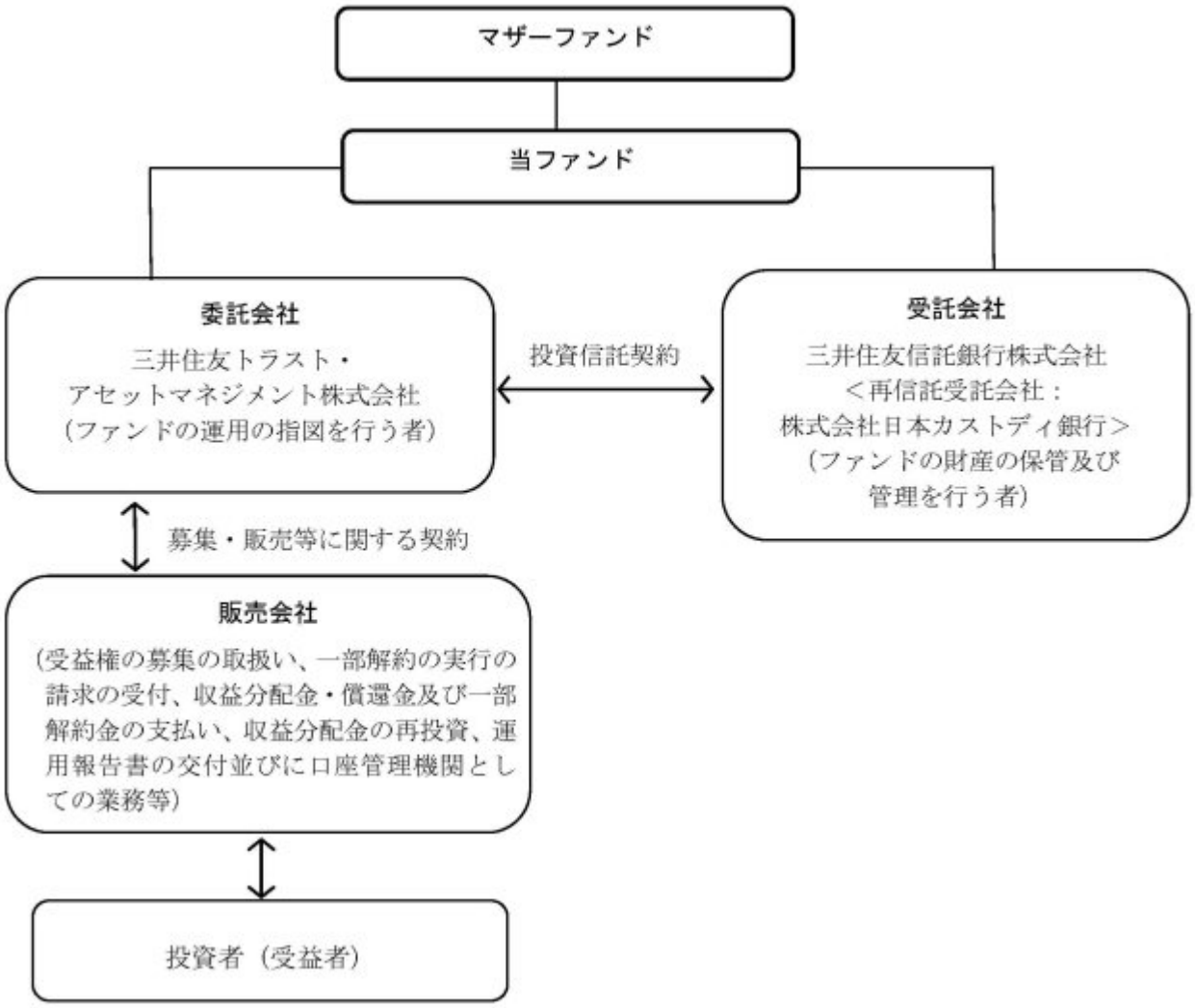
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

（２）【ファンドの沿革】

2001年１月23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日本株式インデックスファンドから日本株式インデックスファンドに変更** **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】

①当ファンドの仕組み及び関係法人



②委託会社の概況（2024年 2月29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】

①　運用方針

当ファンドは、主としてわが国の株式に投資する日本株式マザーファンドを主要投資対象とし、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。

②　投資態度

A．株式への実質投資は、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．株式の実質投資割合は、原則として高位（90%以上）とします。

C．株式以外の資産（他の投資信託受益証券（振替受益権を含みます。）を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

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

E．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。

F．信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内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（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

G．信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった受取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価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引を行うことができます。

（2）【投資対象】

①　投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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、後記（５）投資制限＜約款に定める投資制限＞Ｊ．、Ｋ．及びＬ．に定めるものに限ります。）

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

②　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し、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「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。）の受益証券並びに次に掲げる有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）（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書
２．国債証券
３．地方債証券
４．特別の法律により法人の発行する債券
５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
６．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書
９．資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
10．コマーシャル・ペーパー
11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）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．証券投資信託又は外国証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいい、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．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
18．外国法人が発行する譲渡性預金証書
19．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20．抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます。）
21．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22．外国の者に対する権利で上記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。

③　運用指図できる金融商品

Ａ．委託会社は、信託金を、上記②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（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②の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、上記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（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を主要投資対象とします。

（２）投資態度

①　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。

②　株式の投資割合は、原則として高位（90%以上）とします。

③　信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

④　ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等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。

⑤　信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、有価証券先物取引等を行うことができます。

⑥　信託財産に属する資産の価格変動リスク回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、スワップ取引を行うことができます。

⑦　信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引を行うことができます。

３．投資制限

①　株式への投資割合には制限を設けません。

②　外貨建資産への投資は、行いません。

③　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。

④　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。

⑤　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。

⑥　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。

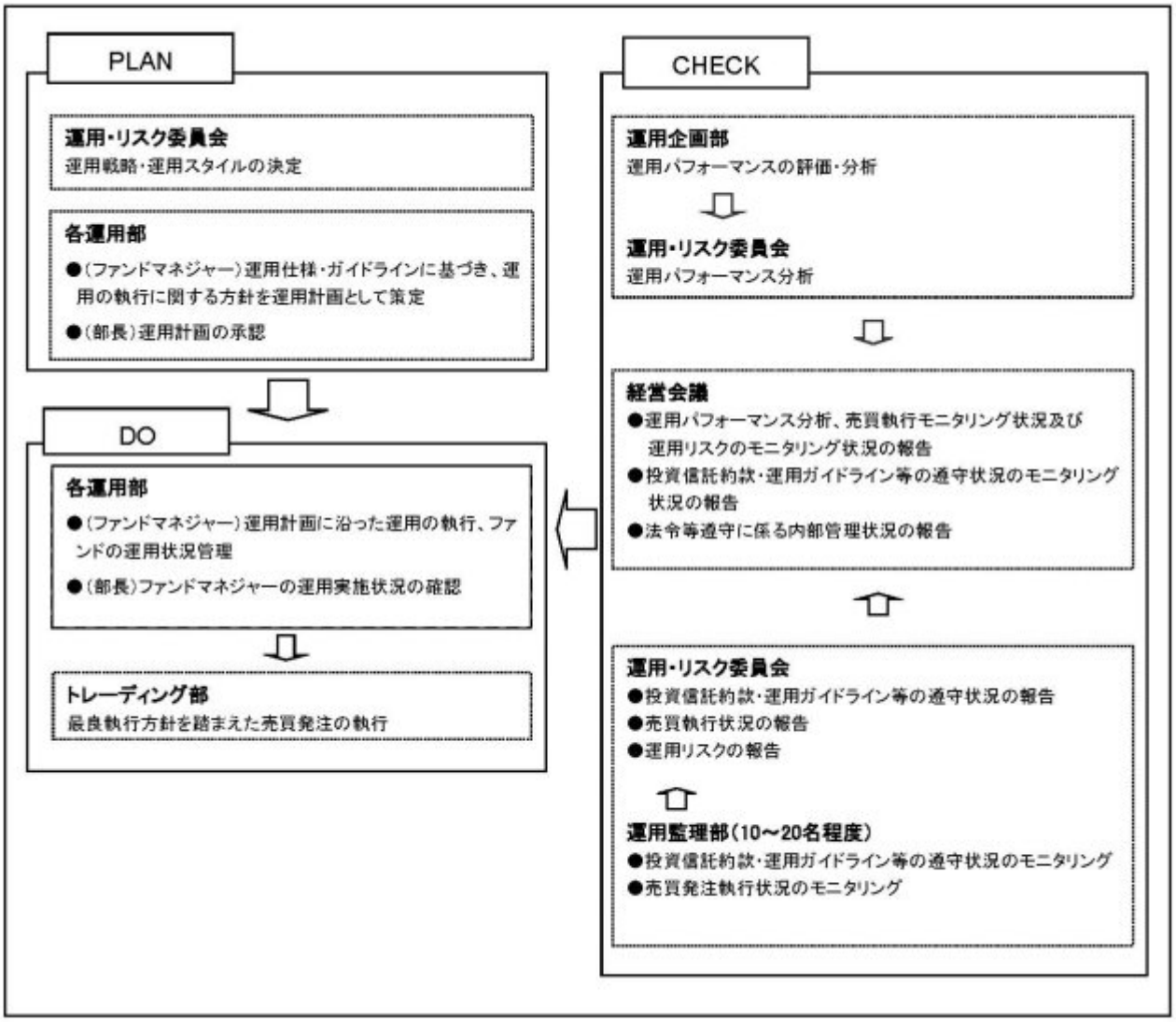
⑦　投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

⑧　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。

⑨　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）【分配方針】

・年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

（5）【投資制限】

＜約款に定める投資制限＞

A．株式への投資割合

委託会社は、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

委託会社は、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

委託会社は、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．投資信託証券への投資割合

委託会社は、投資信託証券（マザーファンドを除きます。）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。

E．同一銘柄の株式への投資割合

委託会社は、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。

F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

委託会社は、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．同一銘柄の転換社債等への投資割合

委託会社は、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。

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、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るものとします。

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。）と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、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の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。

ロ．委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引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価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。

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

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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

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．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って必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

N．公社債の空売り

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない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、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）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るものとします。

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

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れを指図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、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、当該有価証券の売却代金、有価証券等の解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

ハ．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。

ニ．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。

ハ．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．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。

Ｕ．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、投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元

本を割り込むことがあります。
●信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様に帰属します。
●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。
①　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。
②　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。
③　有価証券の貸付等に係るリスク
有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産などにより決済が不履行となるリスクがあります。貸付契約が不履行となった場合、担保金による有価証券の買戻しの際、時価変動の影響から損失を被り、基準価額の下落要因となる可能性があります。
④　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＞
①　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。
②　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。
③　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。
④　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。
⑤　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生じた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。

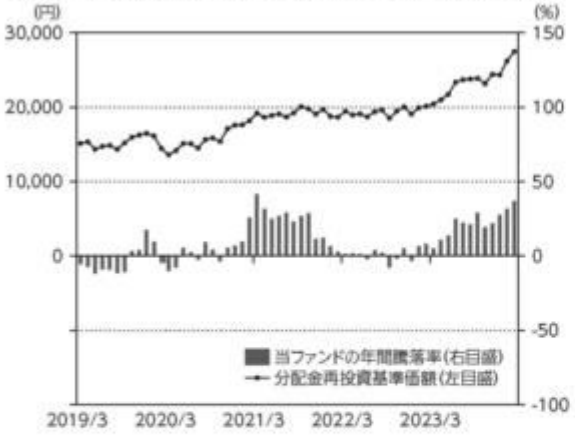
（2）リスクの管理体制

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〕

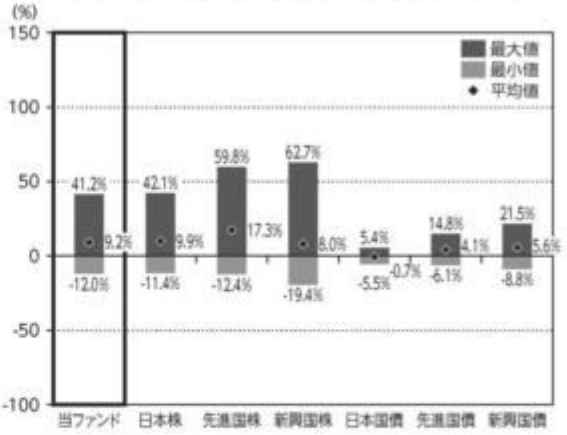
当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



＊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



＊2019年3月～2024年2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。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
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エマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、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 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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により運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。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、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(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諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

①取得申込受付日の基準価額に、2.2%（税抜　2.0%）（※1）の率を上限として、販売会社が別に定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料は、商品説明等に係る費用等の対価として、販売会社に支払われます。

※1：「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（以下同じ。）。

②「分配金再投資コース」（※2）において収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

※2：当ファンドは「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）専用ファンドです。

③上記①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、下記に記載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）手数料】

＜解約手数料＞

ありません。

＜信託財産留保額＞

ご解約時には、解約請求受付日の基準価額に0.2%の率を乗じて得た額を信託財産留保額（※）として当該基準価額から控除します。また、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

①信託報酬の総額は、以下のイ．及びロ．を合計した額とします。

イ．当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率　0.66%（税抜　0.6%）を乗じて得た額（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　0.253%　（税抜　0.23%）**	**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　0.33%　（税抜　0.3%）**	**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　0.077%　（税抜　0.07%）**	**運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価**

ロ．有価証券の貸付の指図を行った場合は、ファンドの品貸料及びマザーファンドの品貸料のうち

ファンドに属するとみなした額に50%未満の率（※）を乗じて得た額

※2024年4月23日現在、合計で49.5%（税抜45%）以内とし、その配分は委託会社29.7%（税抜27%）、受託会社19.8%（税抜18%）です。（品貸料はファンドの収益として計上され、その一部を委託会社と受託会社が信託報酬として受け取るものです。）

②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。

③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】

①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を含みます。）。

②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。

③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を含みます。）。

④投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（※）は、投資信託財産から収受する信託報酬中より委託会社が支弁します。

⑤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。

①個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（原則として配当控除の適用が可能です。）のいずれかを選択することもできます。

	税　率（内　訳）
2037年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
2038年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されま

す（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税　率　（所得税のみ）
2037年12月31日まで	15.315%
2038年1月1日以降	15%

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

③個別元本について

イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。

ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

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

（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について」をご参照ください。）

④普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、

ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

※上記は、2024年 2月29日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

(参考情報)ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.66%	0.66%	0.00%

※対象期間は2023年1月24日～2024年1月22日です。
※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、購入時手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。
※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。
※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

以下は、2024年2月29日現在の状況について記載してあります。

【日本株式インデックスファンド】

（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	1,841,437,022	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	920,861	0.05
合計(純資産総額)		1,842,357,883	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】

①【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	577,216,796	3.0326	1,750,467,656	3.1902	1,841,437,022	99.95

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【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14期計算期間末 (2015年 1月22日)	1,739,678,795	1,739,678,795	12,210	12,210
第15期計算期間末 (2016年 1月22日)	1,511,120,357	1,511,120,357	12,240	12,240
第16期計算期間末 (2017年 1月23日)	1,425,698,476	1,425,698,476	13,705	13,705
第17期計算期間末 (2018年 1月22日)	1,561,462,955	1,561,462,955	17,381	17,381
第18期計算期間末 (2019年 1月22日)	1,268,815,740	1,268,815,740	14,528	14,528
第19期計算期間末 (2020年 1月22日)	1,345,137,239	1,345,137,239	16,584	16,584
第20期計算期間末 (2021年 1月22日)	1,288,455,721	1,288,455,721	17,977	17,977
第21期計算期間末 (2022年 1月24日)	1,328,843,911	1,328,843,911	18,961	18,961
第22期計算期間末 (2023年 1月23日)	1,380,988,544	1,380,988,544	19,504	19,504
第23期計算期間末 (2024年 1月22日)	1,743,755,020	1,743,755,020	25,995	25,995
2023年 2月末日	1,407,005,571	—	19,980	—
3月末日	1,438,384,114	—	20,310	—
4月末日	1,461,523,056	—	20,847	—
5月末日	1,478,913,072	—	21,587	—
6月末日	1,593,930,502	—	23,205	—
7月末日	1,622,121,519	—	23,540	—
8月末日	1,617,996,754	—	23,627	—
9月末日	1,610,552,477	—	23,739	—
10月末日	1,570,275,092	—	23,017	—
11月末日	1,635,893,271	—	24,248	—
12月末日	1,642,491,303	—	24,183	—
2024年 1月末日	1,752,615,329	—	26,056	—
2月末日	1,842,357,883	—	27,325	—

②【分配の推移】

	期　間	1万口当たりの分配金（円）
第14期計算期間	2014年 1月23日～2015年 1月22日	0
第15期計算期間	2015年 1月23日～2016年 1月22日	0
第16期計算期間	2016年 1月23日～2017年 1月23日	0
第17期計算期間	2017年 1月24日～2018年 1月22日	0
第18期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月22日	0
第19期計算期間	2019年 1月23日～2020年 1月22日	0
第20期計算期間	2020年 1月23日～2021年 1月22日	0
第21期計算期間	2021年 1月23日～2022年 1月24日	0
第22期計算期間	2022年 1月25日～2023年 1月23日	0
第23期計算期間	2023年 1月24日～2024年 1月22日	0

③【収益率の推移】

	期　間	収益率（%）
第14期計算期間	2014年 1月23日～2015年 1月22日	8.5
第15期計算期間	2015年 1月23日～2016年 1月22日	0.2

第16期計算期間	2016年 1月23日～2017年 1月23日	12.0
第17期計算期間	2017年 1月24日～2018年 1月22日	26.8
第18期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月22日	△16.4
第19期計算期間	2019年 1月23日～2020年 1月22日	14.2
第20期計算期間	2020年 1月23日～2021年 1月22日	8.4
第21期計算期間	2021年 1月23日～2022年 1月24日	5.5
第22期計算期間	2022年 1月25日～2023年 1月23日	2.9
第23期計算期間	2023年 1月24日～2024年 1月22日	33.3

(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14期計算期間	2014年 1月23日～2015年 1月22日	242,283,577	519,772,037	1,424,821,376
第15期計算期間	2015年 1月23日～2016年 1月22日	170,893,016	361,128,191	1,234,586,201
第16期計算期間	2016年 1月23日～2017年 1月23日	103,289,662	297,570,165	1,040,305,698
第17期計算期間	2017年 1月24日～2018年 1月22日	103,921,774	245,848,679	898,378,793
第18期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月22日	91,034,172	116,079,618	873,333,347
第19期計算期間	2019年 1月23日～2020年 1月22日	43,963,648	106,209,645	811,087,350
第20期計算期間	2020年 1月23日～2021年 1月22日	64,482,177	158,846,582	716,722,945
第21期計算期間	2021年 1月23日～2022年 1月24日	61,776,808	77,658,292	700,841,461
第22期計算期間	2022年 1月25日～2023年 1月23日	49,007,566	41,812,416	708,036,611
第23期計算期間	2023年 1月24日～2024年 1月22日	78,652,811	115,885,558	670,803,864

(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	413,373,865,730	98.66
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	5,630,690,128	1.34
合計(純資産総額)		419,004,555,858	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	5,362,000,000	1.28

(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	5,991,200	2,982.00	17,865,758,400	3,621.00	21,694,135,200	5.18
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	6,544,300	1,308.00	8,559,944,400	1,542.00	10,091,310,600	2.41
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	771,800	14,800.00	11,422,640,000	12,945.00	9,990,951,000	2.38
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	230,900	28,700.00	6,626,830,000	36,870.00	8,513,283,000	2.03
日本	株式	キーエンス	電気機器	109,200	66,720.00	7,285,824,000	70,040.00	7,648,368,000	1.83
日本	株式	三菱商事	卸売業	2,214,600	2,602.50	5,763,496,500	3,205.00	7,097,793,000	1.69
日本	株式	日立製作所	電気機器	529,600	11,425.00	6,050,680,000	12,665.00	6,707,384,000	1.60
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	764,000	7,373.00	5,632,972,000	8,344.00	6,374,816,000	1.52
日本	株式	信越化学工業	化学	979,200	5,872.00	5,749,862,400	6,387.00	6,254,150,400	1.49
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	32,551,000	191.20	6,223,751,200	182.30	5,934,047,300	1.42
日本	株式	任天堂	その他製品	688,900	8,103.00	5,582,156,700	8,400.00	5,786,760,000	1.38
日本	株式	三井物産	卸売業	869,800	5,978.00	5,199,664,400	6,553.00	5,699,799,400	1.36
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	776,000	6,647.00	5,158,072,000	6,516.00	5,056,416,000	1.21
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	830,400	6,149.00	5,106,129,600	6,044.00	5,018,937,600	1.20
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	539,800	6,723.00	3,629,075,400	8,790.00	4,744,842,000	1.13
日本	株式	第一三共	医薬品	953,300	4,392.00	4,186,893,600	4,974.00	4,741,714,200	1.13
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,660,800	1,610.00	4,283,888,000	1,782.00	4,741,545,600	1.13
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,062,200	3,831.00	4,069,288,200	4,376.00	4,648,187,200	1.11
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	968,500	4,381.00	4,242,998,500	4,387.00	4,248,809,500	1.01
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	214,800	18,590.00	3,993,132,000	19,485.00	4,185,378,000	1.00
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,450,500	2,587.50	3,753,168,750	2,801.00	4,062,850,500	0.97
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	845,600	5,070.00	4,287,192,000	4,554.00	3,850,862,400	0.92
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,760,900	1,990.50	3,505,071,450	1,972.50	3,473,375,250	0.83
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	593,600	5,593.00	3,320,004,800	5,363.00	3,183,476,800	0.76
日本	株式	村田製作所	電気機器	992,700	3,051.00	3,028,727,700	3,023.00	3,000,932,100	0.72
日本	株式	ＳＭＣ	機械	33,000	85,390.00	2,817,870,000	90,150.00	2,974,950,000	0.71
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,226,600	2,208.50	2,708,946,100	2,381.50	2,921,147,900	0.70
日本	株式	ダイキン工業	機械	131,600	24,560.00	3,232,096,000	21,175.00	2,786,630,000	0.67
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	1,193,700	1,930.33	2,304,238,900	2,230.00	2,661,951,000	0.64
日本	株式	ディスコ	機械	53,100	41,070.00	2,180,817,000	48,260.00	2,562,606,000	0.61

(注1)国／地域は、発行体の所在地によって記載しております。
(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／外国	業種	投資比率(%)

株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.30
		建設業	1.97
		食料品	3.07
		繊維製品	0.34
		パルプ・紙	0.15
		化学	5.68
		医薬品	4.43
		石油・石炭製品	0.47
		ゴム製品	0.68
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.95
		非鉄金属	0.66
		金属製品	0.52
		機械	5.40
		電気機器	17.25
		輸送用機器	9.26
		精密機器	2.31
		その他製品	2.31
		電気・ガス業	1.28
		陸運業	2.55
		海運業	0.82
		空運業	0.41
		倉庫・運輸関連業	0.13
		情報・通信業	7.43
		卸売業	7.22
		小売業	4.11
		銀行業	7.21
		証券、商品先物取引業	0.88
		保険業	2.56
		その他金融業	1.16
		不動産業	1.87
		サービス業	4.49
		小計	98.66
合計			98.66

(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	東証株価指数先物	買建	200	円	5,196,279,850	5,362,000,000	1.28

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

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

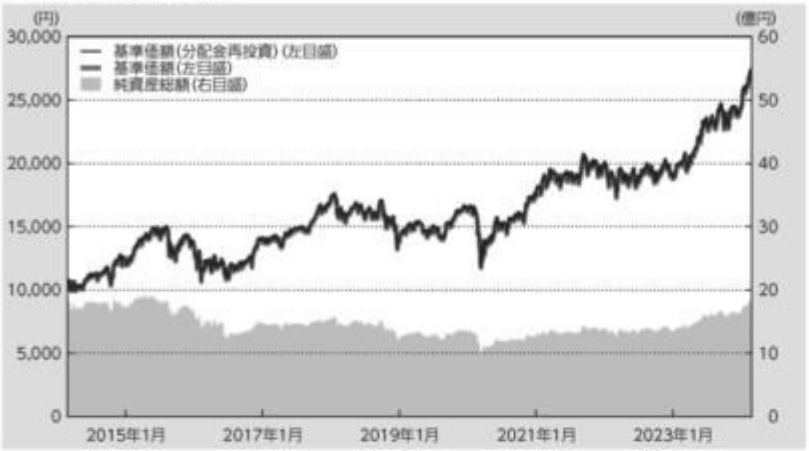
≪参考情報≫

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

運用実績

当初設定日：2001年1月23日
作成基準日：2024年2月29日

基準価額・純資産の推移



※基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

基準価額	27,325円
純資産総額	18.42億円

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2020年1月	0円
2021年1月	0円
2022年1月	0円
2023年1月	0円
2024年1月	0円
設定来分配金合計額	70円

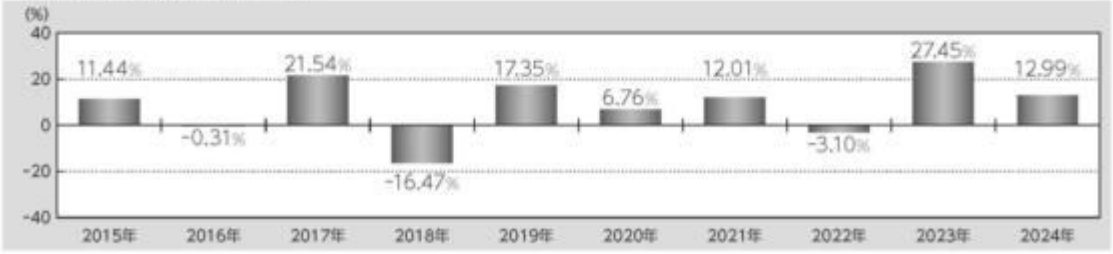
※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

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	5.2%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	2.4%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.4%
東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	2.0%
キーエンス	日本	株式	電気機器	1.8%
三菱商事	日本	株式	卸売業	1.7%
日立製作所	日本	株式	電気機器	1.6%
三井住友フィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	1.5%
信越化学工業	日本	株式	化学	1.5%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.4%

※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)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。
※2024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＞

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＞

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＜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＞

前記　第1ファンドの状況 4手数料等及び税金 (1)申込手数料をご覧ください。

＜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付けを中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取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ます。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＞

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

＜解約価額＞

一部解約の実行の請求受付日の基準価額から、当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（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。

＜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付けを中止することができます。

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

します。

＜一部解約の制限＞

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

＜その他＞

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

＜問い合わせ先＞

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の算出方法＞

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

①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。

②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。（2001年 1月23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１月23日から翌年１月22日までとすることを原則とします。
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）
①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30億口を下回ることとなった場合
・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
②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。
③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。
④委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。
(2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）における公告等の手続き
委託会社は上記（1）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。
①委託会社は、ファンドの繰上償還について、あらかじめ、ファンドを繰上償還しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
②上記①の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を

述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

③上記②の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、ファンドの繰上償還を行いません。

④委託会社は、このファンドの繰上償還を行わないこととしたときは、ファンドの繰上償還を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑤ファンドの繰上償還において、上記②から④までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記②の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

＜投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き＞

(1)投資信託約款の変更

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができます。

・受益者の利益のため必要と認めるとき

・やむを得ない事情が発生したとき

委託会社は、投資信託約款の変更を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

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

(2)重大な投資信託約款の変更における公告等の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

①委託会社は、ファンドの重大な約款変更について、あらかじめ、変更をしようとする旨及びその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

②上記①の公告及び書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

③上記②の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、当該約款変更を行いません。

④委託会社は、当該約款変更を行わないこととしたときは、約款変更を行わない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

＜受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い＞

①受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に背いた場合、又はその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記＜投資信託約款の変更と重大な投資信託約款の変更手続き＞に従い、新受託会社を選任します。

②委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

＜反対者の買取請求権＞

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

＜運用報告書＞

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

＜関係法人との契約の更改手続き＞

・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約
当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

＜公告＞

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

＜混蔵寄託＞

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

＜投資信託財産の登記等及び記載等の留保等＞

①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。

②上記①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。

③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。

④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金に対する請求権

①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。

②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

①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。

②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。

③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。

④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、受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23期計算期間(2023年1月24日から2024年1月22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】

【日本株式インデックスファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第22期 （2023年 1月23日現在）	第23期 （2024年 1月22日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,207,630	7,549,667
親投資信託受益証券	1,380,304,618	1,742,895,105
未収入金	434,686	2,199,933
流動資産合計	1,385,946,934	1,752,644,705
資産合計	1,385,946,934	1,752,644,705
負債の部		
流動負債		
未払解約金	431,392	3,519,140
未払受託者報酬	528,153	626,572
未払委託者報酬	3,998,844	4,743,970
未払利息	1	3
流動負債合計	4,958,390	8,889,685
負債合計	4,958,390	8,889,685
純資産の部		
元本等		
元本	708,036,611	670,803,864
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	672,951,933	1,072,951,156
（分配準備積立金）	475,887,562	813,226,592
元本等合計	1,380,988,544	1,743,755,020
純資産合計	1,380,988,544	1,743,755,020
負債純資産合計	1,385,946,934	1,752,644,705

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第22期 自　2022年 1月25日 至　2023年 1月23日	第23期 自　2023年 1月24日 至　2024年 1月22日
営業収益		
受取利息	12	10
有価証券売買等損益	48,953,000	457,387,408
営業収益合計	48,953,012	457,387,418
営業費用		
支払利息	1,311	1,429
受託者報酬	1,034,652	1,188,540
委託者報酬	7,833,719	8,998,843
営業費用合計	8,869,682	10,188,812
営業利益又は営業損失（△）	40,083,330	447,198,606
経常利益又は経常損失（△）	40,083,330	447,198,606
当期純利益又は当期純損失（△）	40,083,330	447,198,606
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（△）	992,450	36,347,614
期首剰余金又は期首欠損金（△）	628,002,450	672,951,933
剰余金増加額又は欠損金減少額	43,129,693	100,535,897
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	43,129,693	100,535,897
剰余金減少額又は欠損金増加額	37,271,090	111,387,666
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	37,271,090	111,387,666
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	672,951,933	1,072,951,156

（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1月23日から翌年1月22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23期計算期間は2023年 1月24日から2024年 1月22日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第22期 (2023年 1月23日現在)		第23期 (2024年 1月22日現在)	
１. 計算期間の末日における受益権の総数		708,036,611口		670,803,864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	1.9504円	1口当たり純資産額	2.5995円
	(1万口当たり純資産額)	(19,504円)	(1万口当たり純資産額)	(25,995円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第22期
自 2022年 1月25日
至 2023年 1月23日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	29,117,820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	9,973,060円
収益調整金額	C	496,785,135円
分配準備積立金額	D	436,796,682円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	972,672,697円
当ファンドの期末残存口数	F	708,036,611口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	13,737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

第23期
自 2023年 1月24日
至 2024年 1月22日

分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	35,809,427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	375,041,565円
収益調整金額	C	519,826,959円
分配準備積立金額	D	402,375,600円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,333,053,551円
当ファンドの期末残存口数	F	670,803,864口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	19,872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

（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23期 自 2023年 1月24日 至 2024年 1月22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23期 (2024年 1月22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。

	第23期 (2024年 1月22日現在)
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22期 自 2022年 1月25日 至 2023年 1月23日	第23期 自 2023年 1月24日 至 2024年 1月22日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	700,841,461円	708,036,611円
期中追加設定元本額	49,007,566円	78,652,811円
期中一部解約元本額	41,812,416円	115,885,558円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第22期 (2023年 1月23日現在)	第23期 (2024年 1月22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	49,157,016	426,701,270
合計	49,157,016	426,701,270

（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	574,681,847	1,742,895,105	
合計		574,681,847	1,742,895,105	

(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

	2024年 1月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,160,553,139
株式	395,768,237,970
新株予約権証券	4,209,700
派生商品評価勘定	265,657,200
未収配当金	527,698,620
差入委託証拠金	221,295,320
流動資産合計	399,947,651,949
資産合計	399,947,651,949
負債の部	
流動負債	
前受金	265,710,000
未払解約金	230,895,744
未払利息	1,621
流動負債合計	496,607,365
負債合計	496,607,365
純資産の部	
元本等	
元本	131,708,805,527
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	267,742,239,057
元本等合計	399,451,044,584
純資産合計	399,451,044,584
負債純資産合計	399,947,651,949

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2024年 1月22日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1)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)新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)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）

		2024年 1月22日現在
1．	計算期間の末日における受益権の総数	131,708,805,527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 3.0328円 (1万口当たり純資産額) (30,328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

	2024年 1月22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。
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、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、並びに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、株価指数先物取引を行っております。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

	2024年 1月22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	2024年 1月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2023年 1月24日
期首元本額	135,107,273,836円
期中追加設定元本額	9,401,509,168円
期中一部解約元本額	12,799,977,477円
期末元本額	131,708,805,527円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	574,681,847円

区分	2024年 1月22日現在
ＤＣ日本株式インデックスファンド	268,478,159円
ＤＣ日本株式インデックスファンドＬ	54,277,962,483円
ＤＣ日本株式インデックスファンドＡ	648,765,239円
ＤＣバランスファンド３０	2,075,512,526円
ＤＣバランスファンド５０	3,505,812,694円
ＤＣバランスファンド７０	2,339,584,384円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	508,650,276円
日本株式インデックスｅ	1,351,988,131円
インデックスコレクション（国内株式）	23,520,845,160円
インデックスコレクション（バランス株式３０）	11,155,481,709円
インデックスコレクション（バランス株式５０）	3,440,947,162円
インデックスコレクション（バランス株式７０）	3,475,021,599円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,986,078,724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）	2,647,002,345円
日本株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	600,468,138円
バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	24,741,727円
バランスＶＡ５０（適格機関投資家専用）	331,180,170円
ＶＡバランスファンド（株２５／１００）（適格機関投資家専用）	45,587,960円
ＶＡバランスファンド（株５０／１００）（適格機関投資家専用）	107,021,403円
ＶＡバランスファンド（株６０／１００）（適格機関投資家専用）	31,239,593円
バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	416,604,805円
バランスＶＡ３７．５（適格機関投資家専用）	300,947,011円
バランスＶＡ５０Ｌ（適格機関投資家専用）	5,403,583,594円
バランスＶＡ７５（適格機関投資家専用）	547,690,716円
ＶＡバランスファンド（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	41,488,125円
ＶＡポートフォリオ４０（適格機関投資家専用）	872,389,853円
ＶＡポートフォリオ２０（適格機関投資家専用）	15,660,957円
バランスＶＡ４０（適格機関投資家専用）	105,470,342円
バランスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	1,406,058,056円
ＶＡバランスファンド２（株４０／１００）（適格機関投資家専用）	35,292,107円
ＶＡバランス５０－５０（適格機関投資家専用）	40,039,354円
ＶＡファンド２５（適格機関投資家専用）	12,016,816円
バランスファンドＶＡ２（適格機関投資家専用）	366,649,762円
バランスＶＡ２５Ｌ（適格機関投資家専用）	186,329,002円
バランスファンドＶＡ３（適格機関投資家専用）	2,874,133,314円
世界バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	60,057,906円
国内バランスＶＡ３０（適格機関投資家専用）	20,182,090円
国内バランスＶＡ２５（適格機関投資家専用）	6,134,358円
ＶＡバランス２０－８０（適格機関投資家専用）	78,405,024円
私募日本株式インデックスファンドＡＬ（適格機関投資家専用）	2,620,906円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年 1月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	91,356,810,145
新株予約権証券	4,209,700
合計	91,361,019,845

(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

（2024年 1月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引				

	買建	3,225,735,000	―	3,491,445,000	265,710,000
合計		3,225,735,000	―	3,491,445,000	265,710,000

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、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	5,800	3,935.00	22,823,000	
ニッスイ	153,700	791.20	121,607,440	
マルハニチロ	22,800	2,922.00	66,621,600	
雪国まいたけ	13,100	961.00	12,589,100	
カネコ種苗	4,700	1,469.00	6,904,300	
サカタのタネ	17,500	3,770.00	65,975,000	
ホクト	12,300	1,771.00	21,783,300	
ホクリヨウ	1,500	1,056.00	1,584,000	
住石ホールディングス	15,900	1,732.00	27,538,800	
日鉄鉱業	6,200	5,350.00	33,170,000	
三井松島ホールディングス	9,100	2,842.00	25,862,200	
ＩＮＰＥＸ	568,400	2,001.50	1,137,652,600	
石油資源開発	17,800	5,860.00	104,308,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	7,000	2,255.00	15,785,000	
ショーボンドホールディングス	20,900	6,688.00	139,779,200	
ミライト・ワン	50,800	1,942.00	98,653,600	
タマホーム	9,700	4,135.00	40,109,500	
サンヨーホームズ	1,200	752.00	902,400	
日本アクア	4,300	1,002.00	4,308,600	
ファーストコーポレーション	2,600	765.00	1,989,000	
ベステラ	2,200	1,096.00	2,411,200	
キャンディル	1,800	587.00	1,056,600	
ダイセキ環境ソリューション	2,100	1,089.00	2,286,900	
第一カッター興業	3,900	1,405.00	5,479,500	
安藤・間	89,000	1,187.00	105,643,000	
東急建設	46,300	829.00	38,382,700	
コムシスホールディングス	49,100	3,295.00	161,784,500	
ビーアールホールディングス	24,300	373.00	9,063,900	
高松コンストラクショングループ	11,400	2,900.00	33,060,000	
東建コーポレーション	4,400	9,470.00	41,668,000	

ソネック	1,100	944.00	1,038,400	
ヤマウラ	7,800	1,659.00	12,940,200	
オリエンタル白石	56,900	360.00	20,484,000	
大成建設	100,600	5,427.00	545,956,200	
大林組	384,500	1,370.00	526,765,000	
清水建設	304,800	1,030.00	313,944,000	
飛島建設	11,800	1,493.00	17,617,400	
長谷工コーポレーション	98,600	1,982.00	195,425,200	
松井建設	10,000	813.00	8,130,000	
錢高組	900	4,500.00	4,050,000	
鹿島建設	238,400	2,674.00	637,481,600	
不動テトラ	7,400	2,382.00	17,626,800	
大末建設	2,600	1,408.00	3,660,800	
鉄建建設	7,700	2,070.00	15,939,000	
西松建設	20,500	4,054.00	83,107,000	
三井住友建設	80,000	409.00	32,720,000	
大豊建設	3,700	3,745.00	13,856,500	
佐田建設	4,600	647.00	2,976,200	
ナカノフドー建設	5,100	519.00	2,646,900	
奥村組	17,400	5,060.00	88,044,000	
東鉄工業	13,300	3,070.00	40,831,000	
イチケン	1,600	2,331.00	3,729,600	
富士ピー・エス	3,200	453.00	1,449,600	
淺沼組	7,900	4,195.00	33,140,500	
戸田建設	145,500	952.10	138,530,550	
熊谷組	18,000	3,790.00	68,220,000	
北野建設	1,300	3,095.00	4,023,500	
植木組	2,000	1,563.00	3,126,000	
矢作建設工業	14,600	1,453.00	21,213,800	
ピーエス三菱	13,600	921.00	12,525,600	
日本ハウスホールディングス	23,000	302.00	6,946,000	
新日本建設	15,100	1,202.00	18,150,200	
東亜道路工業	4,300	7,000.00	30,100,000	
日本道路	11,500	2,152.00	24,748,000	
東亜建設工業	8,300	3,820.00	31,706,000	
日本国土開発	30,600	550.00	16,830,000	
若築建設	3,700	3,090.00	11,433,000	
東洋建設	27,100	1,279.00	34,660,900	
五洋建設	152,400	823.60	125,516,640	
世紀東急工業	13,800	1,877.00	25,902,600	
福田組	4,100	5,450.00	22,345,000	
住友林業	92,900	4,591.00	426,503,900	

日本基礎技術	4,300	475.00	2,042,500	
巴コーポレーション	8,000	561.00	4,488,000	
大和ハウス工業	297,300	4,614.00	1,371,742,200	
ライト工業	22,100	2,148.00	47,470,800	
積水ハウス	326,100	3,485.00	1,136,458,500	
日特建設	10,300	1,166.00	12,009,800	
北陸電気工事	7,400	1,190.00	8,806,000	
ユアテック	23,700	1,163.00	27,563,100	
日本リーテック	9,400	1,234.00	11,599,600	
四電工	4,500	3,440.00	15,480,000	
中電工	16,700	2,732.00	45,624,400	
関電工	67,300	1,458.00	98,123,400	
きんでん	75,700	2,478.50	187,622,450	
東京エネシス	10,700	1,037.00	11,095,900	
トーエネック	3,600	4,630.00	16,668,000	
住友電設	10,200	2,870.00	29,274,000	
日本電設工業	20,200	2,028.00	40,965,600	
エクシオグループ	54,000	3,275.00	176,850,000	
新日本空調	6,400	2,520.00	16,128,000	
九電工	23,200	5,143.00	119,317,600	
三機工業	23,700	1,838.00	43,560,600	
日揮ホールディングス	106,400	1,713.00	182,263,200	
中外炉工業	3,500	2,639.00	9,236,500	
ヤマト	5,900	930.00	5,487,000	
太平電業	6,700	4,335.00	29,044,500	
高砂熱学工業	28,800	3,380.00	97,344,000	
三晃金属工業	900	4,800.00	4,320,000	
朝日工業社	4,700	3,055.00	14,358,500	
明星工業	19,300	1,169.00	22,561,700	
大氣社	12,400	4,300.00	53,320,000	
ダイダン	14,100	1,528.00	21,544,800	
日比谷総合設備	7,800	2,611.00	20,365,800	
フィル・カンパニー	1,700	830.00	1,411,000	
テスホールディングス	23,200	450.00	10,440,000	
インフロニア・ホールディングス	123,900	1,573.00	194,894,700	
東洋エンジニアリング	15,800	796.00	12,576,800	
レイズネクスト	15,500	1,536.00	23,808,000	
ニップン	32,300	2,262.00	73,062,600	
日清製粉グループ本社	99,800	2,045.00	204,091,000	
日東富士製粉	1,900	5,010.00	9,519,000	
昭和産業	9,800	3,260.00	31,948,000	
鳥越製粉	6,400	664.00	4,249,600	

中部飼料	14,900	1,111.00	16,553,900	
フィード・ワン	15,800	835.00	13,193,000	
東洋精糖	1,300	2,207.00	2,869,100	
日本甜菜製糖	6,300	2,032.00	12,801,600	
DM三井製糖ホールディングス	10,700	3,135.00	33,544,500	
塩水港精糖	8,600	247.00	2,124,200	
ウェルネオシュガー	5,600	2,229.00	12,482,400	
森永製菓	46,200	2,680.50	123,839,100	
中村屋	2,700	3,125.00	8,437,500	
江崎グリコ	30,900	4,313.00	133,271,700	
名糖産業	4,200	1,707.00	7,169,400	
井村屋グループ	6,000	2,432.00	14,592,000	
不二家	7,400	2,494.00	18,455,600	
山崎製パン	72,200	3,615.00	261,003,000	
第一屋製パン	1,400	640.00	896,000	
モロゾフ	3,500	3,860.00	13,510,000	
亀田製菓	6,200	4,135.00	25,637,000	
寿スピリッツ	51,000	2,015.50	102,790,500	
カルビー	49,400	2,924.50	144,470,300	
森永乳業	39,200	2,945.00	115,444,000	
六甲バター	7,900	1,354.00	10,696,600	
ヤクルト本社	154,300	3,198.00	493,451,400	
明治ホールディングス	132,300	3,500.00	463,050,000	
雪印メグミルク	26,100	2,248.00	58,672,800	
プリマハム	14,500	2,321.00	33,654,500	
日本ハム	46,400	4,944.00	229,401,600	
林兼産業	2,200	558.00	1,227,600	
丸大食品	10,900	1,630.00	17,767,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	11,900	3,395.00	40,400,500	
柿安本店	4,200	2,531.00	10,630,200	
伊藤ハム米久ホールディングス	16,500	4,065.00	67,072,500	
サッポロホールディングス	35,500	6,738.00	239,199,000	
アサヒグループホールディングス	249,400	5,500.00	1,371,700,000	
キリンホールディングス	449,600	2,108.00	947,756,800	
宝ホールディングス	73,700	1,242.50	91,572,250	
オエノンホールディングス	32,300	351.00	11,337,300	
養命酒製造	3,600	1,885.00	6,786,000	
コカ･コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	84,600	2,063.00	174,529,800	
ライフドリンク　カンパニー	1,600	5,160.00	8,256,000	
サントリー食品インターナショナル	76,000	4,944.00	375,744,000	
ダイドーグループホールディングス	12,200	2,930.00	35,746,000	
伊藤園	36,600	4,280.00	156,648,000	

キーコーヒー	12,100	2,119.00	25,639,900	
ユニカフェ	2,400	911.00	2,186,400	
ジャパンフーズ	1,100	1,305.00	1,435,500	
日清オイリオグループ	15,200	4,460.00	67,792,000	
不二製油グループ本社	25,100	2,466.50	61,909,150	
かどや製油	900	3,710.00	3,339,000	
Ｊ－オイルミルズ	11,800	2,045.00	24,131,000	
キッコーマン	71,500	9,600.00	686,400,000	
味の素	256,500	6,145.00	1,576,192,500	
ブルドックソース	5,700	2,226.00	12,688,200	
キユーピー	58,000	2,534.00	146,972,000	
ハウス食品グループ本社	37,200	3,226.00	120,007,200	
カゴメ	46,400	3,211.00	148,990,400	
焼津水産化学工業	2,800	1,192.00	3,337,600	
アリアケジャパン	10,800	4,530.00	48,924,000	
ピエトロ	1,000	1,805.00	1,805,000	
エバラ食品工業	2,900	2,926.00	8,485,400	
やまみ	700	3,835.00	2,684,500	
ニチレイ	49,500	3,505.00	173,497,500	
東洋水産	54,500	8,048.00	438,616,000	
イートアンドホールディングス	5,000	2,112.00	10,560,000	
大冷	900	1,930.00	1,737,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,900	1,034.00	5,066,600	
日清食品ホールディングス	113,700	5,027.00	571,569,900	
永谷園ホールディングス	5,300	2,194.00	11,628,200	
一正蒲鉾	3,100	739.00	2,290,900	
フジッコ	11,100	1,963.00	21,789,300	
ロック・フィールド	12,100	1,616.00	19,553,600	
日本たばこ産業	655,900	3,801.00	2,493,075,900	
ケンコーマヨネーズ	7,400	1,735.00	12,839,000	
わらべや日洋ホールディングス	7,200	2,938.00	21,153,600	
なとり	6,800	2,122.00	14,429,600	
イフジ産業	1,200	1,325.00	1,590,000	
ファーマフーズ	15,500	1,064.00	16,492,000	
ユーグレナ	67,200	689.00	46,300,800	
紀文食品	8,700	1,173.00	10,205,100	
ピックルスホールディングス	6,300	1,230.00	7,749,000	
ミヨシ油脂	2,800	1,317.00	3,687,600	
理研ビタミン	9,300	2,304.00	21,427,200	
片倉工業	10,300	1,700.00	17,510,000	
グンゼ	7,900	5,270.00	41,633,000	
東洋紡	47,800	1,112.00	53,153,600	

ユニチカ	37,500	169.00	6,337,500	
富士紡ホールディングス	4,600	3,880.00	17,848,000	
倉敷紡績	8,300	2,896.00	24,036,800	
シキボウ	4,400	1,203.00	5,293,200	
日本毛織	29,200	1,481.00	43,245,200	
トーア紡コーポレーション	2,900	427.00	1,238,300	
帝国繊維	12,500	2,277.00	28,462,500	
帝人	105,700	1,340.00	141,638,000	
東レ	736,100	732.10	538,898,810	
住江織物	1,600	2,409.00	3,854,400	
日本フエルト	4,800	436.00	2,092,800	
イチカワ	1,100	1,767.00	1,943,700	
日東製網	800	1,572.00	1,257,600	
アツギ	4,600	522.00	2,401,200	
ダイニック	1,900	718.00	1,364,200	
セーレン	21,300	2,494.00	53,122,200	
ソトー	2,500	688.00	1,720,000	
東海染工	800	855.00	684,000	
小松マテーレ	16,000	842.00	13,472,000	
ワコールホールディングス	22,500	3,455.00	77,737,500	
ホギメディカル	14,700	3,315.00	48,730,500	
ＴＳＩホールディングス	37,000	711.00	26,307,000	
マツオカコーポレーション	2,100	1,662.00	3,490,200	
ワールド	15,100	1,730.00	26,123,000	
三陽商会	3,600	2,674.00	9,626,400	
ナイガイ	2,900	268.00	777,200	
オンワードホールディングス	64,900	538.00	34,916,200	
ルックホールディングス	2,700	2,544.00	6,868,800	
ゴールドウイン	19,500	9,980.00	194,610,000	
デサント	18,900	3,670.00	69,363,000	
キング	3,400	697.00	2,369,800	
ヤマトインターナショナル	6,200	310.00	1,922,000	
特種東海製紙	6,000	3,915.00	23,490,000	
王子ホールディングス	457,400	574.50	262,776,300	
日本製紙	62,000	1,280.00	79,360,000	
三菱製紙	8,800	568.00	4,998,400	
北越コーポレーション	54,000	1,351.00	72,954,000	
中越パルプ工業	2,900	1,962.00	5,689,800	
大王製紙	48,500	1,109.00	53,786,500	
阿波製紙	1,700	603.00	1,025,100	
レンゴー	100,000	945.10	94,510,000	
トーモク	6,300	2,318.00	14,603,400	

ザ・パック	8,200	3,350.00	27,470,000	
北の達人コーポレーション	46,300	235.00	10,880,500	
クラレ	160,000	1,531.50	245,040,000	
旭化成	742,800	1,118.00	830,450,400	
共和レザー	4,200	796.00	3,343,200	
巴川コーポレーション	2,300	1,079.00	2,481,700	
レゾナック・ホールディングス	106,100	3,021.00	320,528,100	
住友化学	814,800	338.30	275,646,840	
住友精化	5,000	5,320.00	26,600,000	
日産化学	51,600	5,866.00	302,685,600	
ラサ工業	4,200	2,199.00	9,235,800	
クレハ	24,000	2,893.00	69,432,000	
多木化学	4,300	3,155.00	13,566,500	
テイカ	7,800	1,395.00	10,881,000	
石原産業	18,200	1,550.00	28,210,000	
片倉コープアグリ	1,500	1,139.00	1,708,500	
日本曹達	13,000	5,810.00	75,530,000	
東ソー	146,600	1,864.00	273,262,400	
トクヤマ	35,500	2,483.00	88,146,500	
セントラル硝子	11,700	2,755.00	32,233,500	
東亞合成	55,100	1,355.50	74,688,050	
大阪ソーダ	7,700	9,520.00	73,304,000	
関東電化工業	21,200	890.00	18,868,000	
デンカ	39,900	2,580.50	102,961,950	
信越化学工業	995,700	5,872.00	5,846,750,400	
日本カーバイド工業	3,400	1,505.00	5,117,000	
堺化学工業	8,400	1,902.00	15,976,800	
第一稀元素化学工業	10,600	977.00	10,356,200	
エア・ウォーター	103,600	1,988.00	205,956,800	
日本酸素ホールディングス	106,500	3,797.00	404,380,500	
日本化学工業	3,800	1,915.00	7,277,000	
東邦アセチレン	7,500	374.00	2,805,000	
日本パーカライジング	48,900	1,170.00	57,213,000	
高圧ガス工業	15,900	853.00	13,562,700	
チタン工業	900	1,127.00	1,014,300	
四国化成ホールディングス	14,100	1,903.00	26,832,300	
戸田工業	2,500	1,547.00	3,867,500	
ステラ　ケミファ	6,000	3,285.00	19,710,000	
保土谷化学工業	3,300	3,625.00	11,962,500	
日本触媒	16,700	5,516.00	92,117,200	
大日精化工業	7,600	2,757.00	20,953,200	
カネカ	27,900	3,600.00	100,440,000	

三菱瓦斯化学	82,000	2,448.50	200,777,000	
三井化学	90,600	4,463.00	404,347,800	
ＪＳＲ	119,600	4,051.00	484,499,600	
東京応化工業	52,500	3,437.00	180,442,500	
大阪有機化学工業	9,200	2,940.00	27,048,000	
三菱ケミカルグループ	802,700	911.00	731,259,700	
ＫＨネオケム	16,800	2,300.00	38,640,000	
ダイセル	141,100	1,457.50	205,653,250	
住友ベークライト	15,400	7,743.00	119,242,200	
積水化学工業	222,600	2,206.50	491,166,900	
日本ゼオン	75,300	1,300.00	97,890,000	
アイカ工業	27,700	3,434.00	95,121,800	
ＵＢＥ	52,200	2,395.00	125,019,000	
積水樹脂	15,700	2,551.00	40,050,700	
タキロンシーアイ	25,600	666.00	17,049,600	
旭有機材	7,300	4,045.00	29,528,500	
ニチバン	6,000	1,751.00	10,506,000	
リケンテクノス	23,700	864.00	20,476,800	
大倉工業	5,100	2,552.00	13,015,200	
積水化成品工業	15,400	497.00	7,653,800	
群栄化学工業	2,600	3,285.00	8,541,000	
タイガースポリマー	3,300	871.00	2,874,300	
ミライアル	2,200	1,568.00	3,449,600	
ダイキアクシス	3,000	719.00	2,157,000	
ダイキョーニシカワ	24,200	732.00	17,714,400	
竹本容器	2,800	783.00	2,192,400	
森六ホールディングス	6,000	2,834.00	17,004,000	
恵和	7,900	1,400.00	11,060,000	
日本化薬	83,900	1,345.50	112,887,450	
カーリットホールディングス	10,600	934.00	9,900,400	
日本精化	6,500	3,045.00	19,792,500	
扶桑化学工業	11,600	4,415.00	51,214,000	
トリケミカル研究所	13,300	3,975.00	52,867,500	
ＡＤＥＫＡ	38,300	2,885.00	110,495,500	
日油	34,000	6,851.00	232,934,000	
新日本理化	10,100	198.00	1,999,800	
ハリマ化成グループ	5,800	868.00	5,034,400	
花王	248,300	5,757.00	1,429,463,100	
第一工業製薬	4,200	1,907.00	8,009,400	
石原ケミカル	5,000	2,146.00	10,730,000	
日華化学	2,900	903.00	2,618,700	
ニイタカ	1,300	1,884.00	2,449,200	

三洋化成工業	6,800	4,380.00	29,784,000	
有機合成薬品工業	5,400	286.00	1,544,400	
大日本塗料	13,400	1,076.00	14,418,400	
日本ペイントホールディングス	583,000	1,096.00	638,968,000	
関西ペイント	107,600	2,526.50	271,851,400	
神東塗料	6,100	128.00	780,800	
中国塗料	22,500	1,790.00	40,275,000	
日本特殊塗料	4,600	1,312.00	6,035,200	
藤倉化成	14,700	438.00	6,438,600	
太陽ホールディングス	19,100	3,105.00	59,305,500	
ＤＩＣ	42,900	2,676.00	114,800,400	
サカタインクス	24,400	1,388.00	33,867,200	
ａｒｔｉｅｎｃｅ	23,900	2,727.00	65,175,300	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	10,000	1,476.00	14,760,000	
富士フイルムホールディングス	204,000	9,275.00	1,892,100,000	
資生堂	229,600	4,016.00	922,073,600	
ライオン	143,900	1,332.00	191,674,800	
高砂香料工業	7,700	3,580.00	27,566,000	
マンダム	23,700	1,287.00	30,501,900	
ミルボン	14,900	3,544.00	52,805,600	
ファンケル	48,100	2,333.50	112,241,350	
コーセー	22,400	9,460.00	211,904,000	
コタ	10,100	1,587.00	16,028,700	
シーボン	900	1,495.00	1,345,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	56,400	1,545.00	87,138,000	
ノエビアホールディングス	9,800	5,230.00	51,254,000	
アジュバンホールディングス	1,800	928.00	1,670,400	
新日本製薬	6,300	1,740.00	10,962,000	
Ｉ－ｎｅ	2,200	2,478.00	5,451,600	
アクシージア	5,600	905.00	5,068,000	
エステー	8,500	1,537.00	13,064,500	
アグロ　カネショウ	4,400	1,407.00	6,190,800	
コニシ	36,600	1,392.00	50,947,200	
長谷川香料	21,000	3,240.00	68,040,000	
小林製薬	32,000	6,653.00	212,896,000	
荒川化学工業	9,300	1,072.00	9,969,600	
メック	9,100	4,370.00	39,767,000	
日本高純度化学	2,700	2,535.00	6,844,500	
タカラバイオ	29,600	1,218.00	36,052,800	
ＪＣＵ	12,300	3,815.00	46,924,500	
新田ゼラチン	4,500	772.00	3,474,000	
ＯＡＴアグリオ	3,200	1,911.00	6,115,200	

デクセリアルズ	27,600	4,361.00	120,363,600	
アース製薬	10,000	4,470.00	44,700,000	
北興化学工業	11,100	1,016.00	11,277,600	
大成ラミック	3,500	2,988.00	10,458,000	
クミアイ化学工業	43,700	858.00	37,494,600	
日本農薬	20,200	670.00	13,534,000	
アキレス	6,900	1,586.00	10,943,400	
有沢製作所	18,500	1,084.00	20,054,000	
日東電工	70,600	11,370.00	802,722,000	
レック	14,100	1,057.00	14,903,700	
三光合成	13,800	672.00	9,273,600	
きもと	10,800	227.00	2,451,600	
藤森工業	8,700	4,010.00	34,887,000	
前澤化成工業	7,100	1,597.00	11,338,700	
未来工業	3,900	3,635.00	14,176,500	
ウェーブロックホールディングス	2,200	669.00	1,471,800	
ＪＳＰ	7,700	1,929.00	14,853,300	
エフピコ	20,800	2,839.50	59,061,600	
天馬	8,000	2,268.00	18,144,000	
信越ポリマー	23,700	1,799.00	42,636,300	
東リ	16,400	332.00	5,444,800	
ニフコ	32,900	3,898.00	128,244,200	
バルカー	9,200	4,335.00	39,882,000	
ユニ・チャーム	229,000	5,136.00	1,176,144,000	
ショーエイコーポレーション	2,100	601.00	1,262,100	
協和キリン	132,800	2,363.50	313,872,800	
武田薬品工業	973,000	4,381.00	4,262,713,000	
アステラス製薬	964,400	1,710.00	1,649,124,000	
住友ファーマ	81,600	467.00	38,107,200	
塩野義製薬	138,600	7,424.00	1,028,966,400	
わかもと製薬	6,800	216.00	1,468,800	
日本新薬	28,800	5,120.00	147,456,000	
中外製薬	344,100	5,598.00	1,926,271,800	
科研製薬	18,800	3,490.00	65,612,000	
エーザイ	133,700	7,009.00	937,103,300	
ロート製薬	106,500	3,010.00	320,565,000	
小野薬品工業	233,300	2,594.50	605,296,850	
久光製薬	24,400	4,221.00	102,992,400	
持田製薬	12,600	3,325.00	41,895,000	
参天製薬	200,400	1,476.50	295,890,600	
扶桑薬品工業	3,700	2,224.00	8,228,800	
日本ケミファ	700	1,599.00	1,119,300	

ツムラ	34,600	2,714.50	93,921,700	
キッセイ薬品工業	18,200	3,175.00	57,785,000	
生化学工業	18,600	771.00	14,340,600	
栄研化学	21,400	1,773.00	37,942,200	
鳥居薬品	5,900	3,745.00	22,095,500	
ＪＣＲファーマ	37,200	1,161.00	43,189,200	
東和薬品	16,900	2,574.00	43,500,600	
富士製薬工業	8,100	1,912.00	15,487,200	
ゼリア新薬工業	15,200	2,030.00	30,856,000	
そーせいグループ	35,400	1,464.00	51,825,600	
第一三共	957,800	4,392.00	4,206,657,600	
杏林製薬	23,800	1,801.00	42,863,800	
大幸薬品	22,700	304.00	6,900,800	
ダイト	8,500	1,946.00	16,541,000	
大塚ホールディングス	228,700	5,861.00	1,340,410,700	
ペプチドリーム	53,300	1,376.50	73,367,450	
セルソース	3,000	1,209.00	3,627,000	
あすか製薬ホールディングス	11,300	1,881.00	21,255,300	
サワイグループホールディングス	25,100	5,682.00	142,618,200	
日本コークス工業	111,500	134.00	14,941,000	
ニチレキ	13,500	2,593.00	35,005,500	
ユシロ化学工業	5,700	1,856.00	10,579,200	
ビーピー・カストロール	2,800	873.00	2,444,400	
富士石油	29,100	378.00	10,999,800	
ＭＯＲＥＳＣＯ	2,400	1,389.00	3,333,600	
出光興産	610,500	829.80	506,592,900	
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,740,500	609.00	1,059,964,500	
コスモエネルギーホールディングス	32,600	6,176.00	201,337,600	
横浜ゴム	55,600	3,437.00	191,097,200	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	63,200	2,355.00	148,836,000	
ブリヂストン	321,800	6,347.00	2,042,464,600	
住友ゴム工業	107,800	1,666.50	179,648,700	
藤倉コンポジット	7,400	1,490.00	11,026,000	
オカモト	5,200	5,070.00	26,364,000	
フコク	5,800	1,416.00	8,212,800	
ニッタ	11,200	3,815.00	42,728,000	
住友理工	17,100	1,179.00	20,160,900	
三ツ星ベルト	13,400	4,760.00	63,784,000	
バンドー化学	16,300	1,804.00	29,405,200	
日東紡績	13,900	5,040.00	70,056,000	
ＡＧＣ	98,100	5,377.00	527,483,700	
日本板硝子	52,400	604.00	31,649,600	

石塚硝子	1,200	3,400.00	4,080,000	
日本山村硝子	2,800	1,390.00	3,892,000	
日本電気硝子	44,900	3,167.00	142,198,300	
オハラ	5,300	1,158.00	6,137,400	
住友大阪セメント	18,300	3,714.00	67,966,200	
太平洋セメント	65,100	2,994.00	194,909,400	
日本ヒューム	9,800	908.00	8,898,400	
日本コンクリート工業	21,700	475.00	10,307,500	
三谷セキサン	4,600	5,140.00	23,644,000	
アジアパイルホールディングス	17,300	728.00	12,594,400	
東海カーボン	101,500	1,026.00	104,139,000	
日本カーボン	5,800	4,415.00	25,607,000	
東洋炭素	7,800	4,795.00	37,401,000	
ノリタケカンパニーリミテド	6,000	7,390.00	44,340,000	
ＴＯＴＯ	72,600	3,941.00	286,116,600	
日本碍子	128,000	1,824.50	233,536,000	
日本特殊陶業	92,100	3,960.00	364,716,000	
ＭＡＲＵＷＡ	4,100	30,400.00	124,640,000	
品川リフラクトリーズ	13,600	1,890.00	25,704,000	
黒崎播磨	2,300	12,080.00	27,784,000	
ヨータイ	6,300	1,479.00	9,317,700	
東京窯業	7,100	480.00	3,408,000	
ニッカトー	3,500	579.00	2,026,500	
フジミインコーポレーテッド	29,600	3,090.00	91,464,000	
クニミネ工業	2,300	1,037.00	2,385,100	
エーアンドエーマテリアル	1,500	1,307.00	1,960,500	
ニチアス	27,800	3,420.00	95,076,000	
ニチハ	13,800	2,986.00	41,206,800	
日本製鉄	506,400	3,455.00	1,749,612,000	
神戸製鋼所	227,500	1,998.00	454,545,000	
中山製鋼所	25,900	865.00	22,403,500	
合同製鐵	6,300	4,975.00	31,342,500	
ＪＦＥホールディングス	314,600	2,318.50	729,400,100	
東京製鐵	31,800	1,760.00	55,968,000	
共英製鋼	12,900	2,081.00	26,844,900	
大和工業	21,300	7,955.00	169,441,500	
東京鐵鋼	5,400	4,485.00	24,219,000	
大阪製鐵	5,200	2,309.00	12,006,800	
淀川製鋼所	12,900	3,930.00	50,697,000	
中部鋼鈑	7,400	2,449.00	18,122,600	
丸一鋼管	34,400	3,898.00	134,091,200	
モリ工業	1,700	4,670.00	7,939,000	

大同特殊鋼	71,500	1,497.50	107,071,250	
日本高周波鋼業	2,600	596.00	1,549,600	
日本冶金工業	8,300	4,605.00	38,221,500	
山陽特殊製鋼	11,200	2,509.00	28,100,800	
愛知製鋼	6,500	3,535.00	22,977,500	
日本金属	1,600	871.00	1,393,600	
大平洋金属	9,700	1,254.00	12,163,800	
新日本電工	56,300	294.00	16,552,200	
栗本鐵工所	5,400	3,525.00	19,035,000	
虹技	900	1,200.00	1,080,000	
三菱製鋼	7,900	1,565.00	12,363,500	
日亜鋼業	7,700	340.00	2,618,000	
日本精線	1,600	5,080.00	8,128,000	
エンビプロ・ホールディングス	6,100	614.00	3,745,400	
シンニッタン	8,200	267.00	2,189,400	
新家工業	1,600	2,911.00	4,657,600	
大紀アルミニウム工業所	14,300	1,226.00	17,531,800	
日本軽金属ホールディングス	33,100	1,767.00	58,487,700	
三井金属鉱業	32,900	4,757.00	156,505,300	
東邦亜鉛	7,300	1,131.00	8,256,300	
三菱マテリアル	80,900	2,652.50	214,587,250	
住友金属鉱山	131,100	4,073.00	533,970,300	
ＤＯＷＡホールディングス	28,000	5,211.00	145,908,000	
古河機械金属	14,900	1,913.00	28,503,700	
大阪チタニウムテクノロジーズ	19,600	2,708.00	53,076,800	
東邦チタニウム	23,400	1,800.00	42,120,000	
ＵＡＣＪ	15,900	3,965.00	63,043,500	
ＣＫサンエツ	2,700	3,930.00	10,611,000	
古河電気工業	37,700	2,448.00	92,289,600	
住友電気工業	423,100	1,952.00	825,891,200	
フジクラ	133,400	1,189.50	158,679,300	
ＳＷＣＣ	12,700	2,897.00	36,791,900	
タツタ電線	20,200	697.00	14,079,400	
カナレ電気	1,300	1,703.00	2,213,900	
平河ヒューテック	6,800	1,400.00	9,520,000	
リョービ	12,100	2,765.00	33,456,500	
アーレスティ	8,400	729.00	6,123,600	
ＡＲＥホールディングス	42,500	2,033.00	86,402,500	
稲葉製作所	5,900	1,518.00	8,956,200	
宮地エンジニアリンググループ	5,700	3,420.00	19,494,000	
トーカロ	31,000	1,513.00	46,903,000	
アルファＣｏ	2,800	1,473.00	4,124,400	

ＳＵＭＣＯ	201,000	2,470.00	496,470,000	
川田テクノロジーズ	2,700	7,140.00	19,278,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	7,600	3,155.00	23,978,000	
ジェイテックコーポレーション	1,000	2,392.00	2,392,000	
信和	4,200	758.00	3,183,600	
東洋製罐グループホールディングス	67,500	2,377.50	160,481,250	
ホッカンホールディングス	6,100	1,694.00	10,333,400	
コロナ	6,300	958.00	6,035,400	
横河ブリッジホールディングス	17,700	2,748.00	48,639,600	
駒井ハルテック	1,200	2,099.00	2,518,800	
高田機工	600	3,575.00	2,145,000	
三和ホールディングス	113,600	2,389.00	271,390,400	
文化シヤッター	29,600	1,513.00	44,784,800	
三協立山	12,900	921.00	11,880,900	
アルインコ	8,600	1,058.00	9,098,800	
東洋シヤッター	1,700	678.00	1,152,600	
ＬＩＸＩＬ	176,600	1,883.50	332,626,100	
日本フイルコン	4,900	577.00	2,827,300	
ノーリツ	18,700	1,544.00	28,872,800	
長府製作所	11,200	2,077.00	23,262,400	
リンナイ	55,400	3,339.00	184,980,600	
ダイニチ工業	3,700	703.00	2,601,100	
日東精工	16,400	546.00	8,954,400	
三洋工業	900	2,939.00	2,645,100	
岡部	20,200	781.00	15,776,200	
ジーテクト	13,400	1,807.00	24,213,800	
東プレ	19,900	2,166.00	43,103,400	
高周波熱錬	17,400	1,034.00	17,991,600	
東京製綱	7,300	1,352.00	9,869,600	
サンコール	7,500	473.00	3,547,500	
モリテック　スチール	5,500	286.00	1,573,000	
パイオラックス	14,000	2,540.00	35,560,000	
エイチワン	11,600	823.00	9,546,800	
日本発條	100,000	1,220.00	122,000,000	
中央発條	8,400	709.00	5,955,600	
アドバネクス	900	969.00	872,100	
立川ブラインド工業	5,100	1,465.00	7,471,500	
三益半導体工業	8,700	3,425.00	29,797,500	
日本ドライケミカル	1,800	2,844.00	5,119,200	
日本製鋼所	30,500	2,443.50	74,526,750	
三浦工業	46,200	2,755.50	127,304,100	
タクマ	37,500	1,776.00	66,600,000	

ツガミ	24,600	1,195.00	29,397,000	
オークマ	9,700	6,462.00	62,681,400	
芝浦機械	11,100	3,565.00	39,571,500	
アマダ	176,700	1,598.50	282,454,950	
アイダエンジニアリング	24,200	853.00	20,642,600	
ＦＵＪＩ	52,100	2,528.00	131,708,800	
牧野フライス製作所	12,300	6,020.00	74,046,000	
オーエスジー	48,800	2,047.50	99,918,000	
ダイジェット工業	800	841.00	672,800	
旭ダイヤモンド工業	26,600	881.00	23,434,600	
ＤＭＧ森精機	67,100	2,971.00	199,354,100	
ソディック	27,000	729.00	19,683,000	
ディスコ	53,300	41,070.00	2,189,031,000	
日東工器	5,400	1,925.00	10,395,000	
日進工具	9,600	1,062.00	10,195,200	
パンチ工業	6,700	421.00	2,820,700	
冨士ダイス	4,300	693.00	2,979,900	
豊和工業	4,100	758.00	3,107,800	
リケンＮＰＲ	12,000	2,636.00	31,632,000	
東洋機械金属	5,100	716.00	3,651,600	
エンシュウ	1,700	680.00	1,156,000	
島精機製作所	17,600	1,541.00	27,121,600	
オプトラン	18,200	1,786.00	32,505,200	
ＮＣホールディングス	1,500	1,601.00	2,401,500	
イワキポンプ	7,400	2,170.00	16,058,000	
フリュー	10,500	1,305.00	13,702,500	
ヤマシンフィルタ	26,700	328.00	8,757,600	
日阪製作所	11,200	980.00	10,976,000	
やまびこ	18,100	1,524.00	27,584,400	
野村マイクロ・サイエンス	3,700	12,930.00	47,841,000	
平田機工	5,300	6,640.00	35,192,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	12,300	448.00	5,510,400	
マルマエ	4,800	2,111.00	10,132,800	
タツモ	6,700	3,320.00	22,244,000	
ナブテスコ	69,500	2,805.00	194,947,500	
三井海洋開発	14,000	2,369.00	33,166,000	
レオン自動機	12,300	1,514.00	18,622,200	
ＳＭＣ	33,100	85,390.00	2,826,409,000	
ホソカワミクロン	7,100	4,580.00	32,518,000	
ユニオンツール	4,900	3,415.00	16,733,500	
瑞光	8,000	1,821.00	14,568,000	
オイレス工業	15,500	2,081.00	32,255,500	

日精エー・エス・ビー機械	4,400	4,390.00	19,316,000	
サトーホールディングス	15,800	2,204.00	34,823,200	
技研製作所	10,400	2,179.00	22,661,600	
日本エアーテック	5,200	1,236.00	6,427,200	
カワタ	2,200	1,137.00	2,501,400	
日精樹脂工業	8,300	1,151.00	9,553,300	
オカダアイヨン	2,300	2,518.00	5,791,400	
ワイエイシイホールディングス	3,700	2,563.00	9,483,100	
小松製作所	519,000	3,998.00	2,074,962,000	
住友重機械工業	65,500	3,768.00	246,804,000	
日立建機	44,100	4,164.00	183,632,400	
日工	16,500	718.00	11,847,000	
巴工業	4,300	3,670.00	15,781,000	
井関農機	10,400	1,137.00	11,824,800	
ＴＯＷＡ	12,300	7,070.00	86,961,000	
丸山製作所	1,300	2,553.00	3,318,900	
北川鉄工所	4,400	1,518.00	6,679,200	
ローツェ	5,800	16,560.00	96,048,000	
タカキタ	2,100	481.00	1,010,100	
クボタ	581,000	2,191.00	1,272,971,000	
荏原実業	5,900	3,015.00	17,788,500	
三菱化工機	3,900	3,560.00	13,884,000	
月島ホールディングス	15,000	1,365.00	20,475,000	
帝国電機製作所	7,800	3,080.00	24,024,000	
新東工業	22,400	1,107.00	24,796,800	
澁谷工業	10,400	2,529.00	26,301,600	
アイチ　コーポレーション	15,500	1,110.00	17,205,000	
小森コーポレーション	27,200	1,350.00	36,720,000	
鶴見製作所	8,500	3,765.00	32,002,500	
日本ギア工業	2,600	521.00	1,354,600	
酒井重工業	1,400	7,050.00	9,870,000	
荏原製作所	45,400	9,355.00	424,717,000	
石井鐵工所	900	2,685.00	2,416,500	
酉島製作所	9,600	2,414.00	23,174,400	
北越工業	11,100	2,671.00	29,648,100	
ダイキン工業	132,200	24,560.00	3,246,832,000	
オルガノ	13,300	6,310.00	83,923,000	
トーヨーカネツ	4,200	4,135.00	17,367,000	
栗田工業	61,900	5,511.00	341,130,900	
椿本チエイン	15,700	4,145.00	65,076,500	
大同工業	3,000	748.00	2,244,000	
木村化工機	8,500	726.00	6,171,000	

アネスト岩田	17,100	1,300.00	22,230,000	
ダイフク	186,900	2,994.50	559,672,050	
サムコ	3,000	4,820.00	14,460,000	
加藤製作所	3,500	1,435.00	5,022,500	
油研工業	1,100	2,235.00	2,458,500	
タダノ	63,800	1,204.00	76,815,200	
フジテック	25,900	3,656.00	94,690,400	
ＣＫＤ	30,600	2,666.00	81,579,600	
平和	32,700	2,163.00	70,730,100	
理想科学工業	8,900	2,860.00	25,454,000	
ＳＡＮＫＹＯ	25,500	9,148.00	233,274,000	
日本金銭機械	13,400	1,505.00	20,167,000	
マースグループホールディングス	5,600	2,732.00	15,299,200	
フクシマガリレイ	7,200	5,190.00	37,368,000	
オーイズミ	2,900	439.00	1,273,100	
ダイコク電機	5,500	3,605.00	19,827,500	
竹内製作所	20,100	4,795.00	96,379,500	
アマノ	31,400	3,478.00	109,209,200	
ＪＵＫＩ	17,200	453.00	7,791,600	
ジャノメ	11,200	692.00	7,750,400	
マックス	15,600	3,360.00	52,416,000	
グローリー	26,600	3,043.00	80,943,800	
新晃工業	11,200	2,913.00	32,625,600	
大和冷機工業	17,000	1,618.00	27,506,000	
セガサミーホールディングス	98,900	2,145.50	212,189,950	
ＴＰＲ	13,400	1,954.00	26,183,600	
ツバキ・ナカシマ	22,200	741.00	16,450,200	
ホシザキ	65,300	5,497.00	358,954,100	
大豊工業	9,600	838.00	8,044,800	
日本精工	205,000	804.80	164,984,000	
ＮＴＮ	240,200	272.50	65,454,500	
ジェイテクト	98,500	1,317.00	129,724,500	
不二越	8,200	3,565.00	29,233,000	
日本トムソン	29,200	587.00	17,140,400	
ＴＨＫ	63,900	2,879.50	184,000,050	
ユーシン精機	8,800	681.00	5,992,800	
前澤給装工業	8,000	1,319.00	10,552,000	
イーグル工業	12,300	1,720.00	21,156,000	
前澤工業	4,200	1,131.00	4,750,200	
日本ピラー工業	10,300	4,930.00	50,779,000	
キッツ	37,100	1,217.00	45,150,700	
マキタ	126,300	3,936.00	497,116,800	

三井Ｅ＆Ｓ	54,700	773.00	42,283,100	
日立造船	97,700	938.00	91,642,600	
三菱重工業	193,600	9,493.00	1,837,844,800	
ＩＨＩ	82,400	2,792.50	230,102,000	
スター精密	20,800	1,778.00	36,982,400	
日清紡ホールディングス	83,200	1,204.00	100,172,800	
イビデン	57,800	7,989.00	461,764,200	
コニカミノルタ	247,600	413.50	102,382,600	
ブラザー工業	148,000	2,536.00	375,328,000	
ミネベアミツミ	192,600	3,082.00	593,593,200	
日立製作所	532,100	11,425.00	6,079,242,500	
三菱電機	1,232,200	2,208.50	2,721,313,700	
富士電機	67,300	6,886.00	463,427,800	
東洋電機製造	2,400	1,079.00	2,589,600	
安川電機	120,300	5,945.00	715,183,500	
シンフォニアテクノロジー	12,200	2,339.00	28,535,800	
明電舎	20,500	2,700.00	55,350,000	
オリジン	1,600	1,228.00	1,964,800	
山洋電気	4,800	6,380.00	30,624,000	
デンヨー	8,400	2,320.00	19,488,000	
ＰＨＣホールディングス	20,800	1,523.00	31,678,400	
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	42,600	3,685.00	156,981,000	
ソシオネクスト	80,500	3,158.00	254,219,000	
東芝テック	14,200	3,105.00	44,091,000	
芝浦メカトロニクス	6,300	7,140.00	44,982,000	
マブチモーター	55,000	2,539.00	139,645,000	
ニデック	244,500	5,782.00	1,413,699,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	8,500	369.00	3,136,500	
トレックス・セミコンダクター	5,800	1,888.00	10,950,400	
東光高岳	6,800	2,235.00	15,198,000	
ダブル・スコープ	31,700	828.00	26,247,600	
ダイヘン	11,100	6,660.00	73,926,000	
ヤーマン	19,300	998.00	19,261,400	
ＪＶＣケンウッド	87,600	776.00	67,977,600	
ミマキエンジニアリング	10,800	937.00	10,119,600	
Ｉ－ＰＥＸ	7,800	1,784.00	13,915,200	
大崎電気工業	26,200	662.00	17,344,400	
オムロン	84,500	6,849.00	578,740,500	
日東工業	14,900	3,850.00	57,365,000	
ＩＤＥＣ	16,300	3,060.00	49,878,000	
正興電機製作所	2,700	1,069.00	2,886,300	
不二電機工業	1,700	1,192.00	2,026,400	

ジーエス・ユアサ　コーポレーション	43,300	2,094.00	90,670,200	
サクサホールディングス	1,500	2,632.00	3,948,000	
メルコホールディングス	2,900	3,400.00	9,860,000	
テクノメディカ	2,800	2,009.00	5,625,200	
日本電気	145,400	9,445.00	1,373,303,000	
富士通	101,900	20,505.00	2,089,459,500	
沖電気工業	50,100	1,046.00	52,404,600	
岩崎通信機	3,200	750.00	2,400,000	
電気興業	4,700	2,331.00	10,955,700	
サンケン電気	10,300	7,248.00	74,654,400	
ナカヨ	1,200	1,169.00	1,402,800	
アイホン	6,000	2,912.00	17,472,000	
ルネサスエレクトロニクス	722,600	2,638.00	1,906,218,800	
セイコーエプソン	142,000	2,249.00	319,358,000	
ワコム	84,400	686.00	57,898,400	
アルバック	26,300	7,034.00	184,994,200	
アクセル	3,500	2,320.00	8,120,000	
ＥＩＺＯ	8,100	5,180.00	41,958,000	
日本信号	25,200	953.00	24,015,600	
京三製作所	23,200	465.00	10,788,000	
能美防災	15,100	2,291.00	34,594,100	
ホーチキ	8,400	2,004.00	16,833,600	
星和電機	3,700	480.00	1,776,000	
エレコム	26,600	1,718.00	45,698,800	
パナソニック　ホールディングス	1,307,900	1,406.00	1,838,907,400	
シャープ	186,600	1,071.50	199,941,900	
アンリツ	78,000	1,342.50	104,715,000	
富士通ゼネラル	31,400	2,171.50	68,185,100	
ソニーグループ	775,400	14,800.00	11,475,920,000	
ＴＤＫ	175,300	7,476.00	1,310,542,800	
帝国通信工業	5,100	2,054.00	10,475,400	
タムラ製作所	44,100	557.00	24,563,700	
アルプスアルパイン	99,000	1,272.00	125,928,000	
池上通信機	2,300	861.00	1,980,300	
日本電波工業	13,400	1,284.00	17,205,600	
鈴木	6,100	1,178.00	7,185,800	
メイコー	11,000	4,500.00	49,500,000	
日本トリム	2,600	3,165.00	8,229,000	
ローランド　ディー．ジー．	6,100	3,785.00	23,088,500	
フォスター電機	8,200	1,149.00	9,421,800	
ＳＭＫ	2,600	2,565.00	6,669,000	
ヨコオ	9,900	1,441.00	14,265,900	

ホシデン	25,800	1,806.00	46,594,800	
ヒロセ電機	16,300	18,255.00	297,556,500	
日本航空電子工業	26,500	3,165.00	83,872,500	
ＴＯＡ	12,600	1,115.00	14,049,000	
マクセル	23,800	1,635.00	38,913,000	
古野電気	14,500	2,156.00	31,262,000	
スミダコーポレーション	15,000	1,250.00	18,750,000	
アイコム	4,300	3,755.00	16,146,500	
リオン	4,600	2,460.00	11,316,000	
横河電機	121,100	2,952.00	357,487,200	
新電元工業	4,200	3,180.00	13,356,000	
アズビル	75,400	4,963.00	374,210,200	
東亜ディーケーケー	3,700	950.00	3,515,000	
日本光電工業	47,100	4,576.00	215,529,600	
チノー	4,600	2,390.00	10,994,000	
共和電業	6,800	435.00	2,958,000	
日本電子材料	7,200	1,917.00	13,802,400	
堀場製作所	20,900	12,445.00	260,100,500	
アドバンテスト	314,100	5,994.00	1,882,715,400	
小野測器	3,500	464.00	1,624,000	
エスペック	8,800	2,611.00	22,976,800	
キーエンス	109,700	66,720.00	7,319,184,000	
日置電機	5,200	6,350.00	33,020,000	
シスメックス	94,600	8,360.00	790,856,000	
日本マイクロニクス	19,700	4,115.00	81,065,500	
メガチップス	9,000	5,140.00	46,260,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	6,000	4,085.00	24,510,000	
澤藤電機	1,000	1,235.00	1,235,000	
原田工業	3,500	753.00	2,635,500	
コーセル	13,300	1,487.00	19,777,100	
イリソ電子工業	10,100	3,550.00	35,855,000	
オプテックスグループ	20,200	1,780.00	35,956,000	
千代田インテグレ	4,400	2,864.00	12,601,600	
レーザーテック	50,200	40,000.00	2,008,000,000	
スタンレー電気	70,200	2,786.00	195,577,200	
ウシオ電機	55,800	2,059.50	114,920,100	
岡谷電機産業	6,400	288.00	1,843,200	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	7,200	557.00	4,010,400	
エノモト	2,000	1,638.00	3,276,000	
日本セラミック	9,000	2,754.00	24,786,000	
遠藤照明	3,400	1,397.00	4,749,800	
古河電池	8,300	898.00	7,453,400	

双信電機	3,600	310.00	1,116,000	
山一電機	9,900	2,193.00	21,710,700	
図研	9,600	4,105.00	39,408,000	
日本電子	27,500	6,730.00	185,075,000	
カシオ計算機	79,200	1,270.50	100,623,600	
ファナック	534,500	4,285.00	2,290,332,500	
日本シイエムケイ	23,600	776.00	18,313,600	
エンプラス	3,200	14,510.00	46,432,000	
大真空	16,500	945.00	15,592,500	
ローム	202,700	2,728.50	553,066,950	
浜松ホトニクス	88,000	5,987.00	526,856,000	
三井ハイテック	9,700	6,902.00	66,949,400	
新光電気工業	38,700	5,490.00	212,463,000	
京セラ	681,200	2,219.50	1,511,923,400	
太陽誘電	53,400	3,731.00	199,235,400	
村田製作所	997,400	3,051.00	3,043,067,400	
双葉電子工業	21,200	524.00	11,108,800	
北陸電気工業	2,900	1,395.00	4,045,500	
ニチコン	28,900	1,314.00	37,974,600	
日本ケミコン	11,800	1,391.00	16,413,800	
ＫＯＡ	16,700	1,561.00	26,068,700	
市光工業	20,100	572.00	11,497,200	
小糸製作所	113,700	2,187.00	248,661,900	
ミツバ	20,600	1,079.00	22,227,400	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	37,500	14,310.00	536,625,000	
キヤノン電子	12,200	2,032.00	24,790,400	
キヤノン	546,700	3,770.00	2,061,059,000	
リコー	274,800	1,197.00	328,935,600	
象印マホービン	29,900	1,516.00	45,328,400	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,100	2,135.00	2,348,500	
東京エレクトロン	232,000	28,700.00	6,658,400,000	
イノテック	7,400	1,869.00	13,830,600	
トヨタ紡織	46,200	2,410.50	111,365,100	
芦森工業	1,400	2,127.00	2,977,800	
ユニプレス	19,700	1,024.00	20,172,800	
豊田自動織機	93,500	12,670.00	1,184,645,000	
モリタホールディングス	19,300	1,555.00	30,011,500	
三櫻工業	16,800	840.00	14,112,000	
デンソー	904,400	2,298.50	2,078,763,400	
東海理化電機製作所	30,900	2,330.00	71,997,000	
川崎重工業	89,500	3,289.00	294,365,500	
名村造船所	23,900	1,506.00	35,993,400	

日本車輌製造	4,200	2,120.00	8,904,000	
三菱ロジスネクスト	17,500	1,473.00	25,777,500	
近畿車輛	1,000	1,943.00	1,943,000	
日産自動車	1,557,100	583.70	908,879,270	
いすゞ自動車	318,700	2,062.00	657,159,400	
トヨタ自動車	6,019,000	2,982.00	17,948,658,000	
日野自動車	164,900	500.50	82,532,450	
三菱自動車工業	427,600	462.30	197,679,480	
エフテック	5,100	655.00	3,340,500	
レシップホールディングス	2,900	674.00	1,954,600	
ＧＭＢ	1,500	1,256.00	1,884,000	
ファルテック	1,300	542.00	704,600	
武蔵精密工業	26,800	1,695.00	45,426,000	
日産車体	12,900	971.00	12,525,900	
新明和工業	31,600	1,221.00	38,583,600	
極東開発工業	18,100	2,017.00	36,507,700	
トピー工業	8,900	2,830.00	25,187,000	
ティラド	2,800	3,520.00	9,856,000	
曙ブレーキ工業	66,900	117.00	7,827,300	
タチエス	20,300	1,955.00	39,686,500	
ＮＯＫ	42,600	1,979.00	84,305,400	
フタバ産業	29,400	880.00	25,872,000	
カヤバ	10,600	5,210.00	55,226,000	
大同メタル工業	21,500	553.00	11,889,500	
プレス工業	43,900	638.00	28,008,200	
ミクニ	8,500	478.00	4,063,000	
太平洋工業	25,200	1,438.00	36,237,600	
アイシン	84,600	5,514.00	466,484,400	
マツダ	362,600	1,749.00	634,187,400	
今仙電機製作所	4,700	636.00	2,989,200	
本田技研工業	2,673,100	1,610.00	4,303,691,000	
スズキ	201,300	6,556.00	1,319,722,800	
ＳＵＢＡＲＵ	340,000	2,969.00	1,009,460,000	
安永	3,300	663.00	2,187,900	
ヤマハ発動機	473,700	1,468.50	695,628,450	
ＴＢＫ	7,400	405.00	2,997,000	
エクセディ	18,000	2,802.00	50,436,000	
豊田合成	32,000	2,866.00	91,712,000	
愛三工業	18,200	1,348.00	24,533,600	
盟和産業	1,100	1,016.00	1,117,600	
日本プラスト	5,900	556.00	3,280,400	
ヨロズ	10,300	930.00	9,579,000	

エフ・シー・シー	19,500	1,944.00	37,908,000	
シマノ	44,500	21,775.00	968,987,500	
テイ・エス　テック	39,100	1,840.00	71,944,000	
ジャムコ	4,700	1,642.00	7,717,400	
テルモ	306,500	5,084.00	1,558,246,000	
クリエートメディック	2,400	892.00	2,140,800	
日機装	25,500	1,109.00	28,279,500	
日本エム・ディ・エム	7,300	776.00	5,664,800	
島津製作所	145,600	4,163.00	606,132,800	
ＪＭＳ	10,200	521.00	5,314,200	
長野計器	8,000	2,158.00	17,264,000	
ブイ・テクノロジー	5,800	2,760.00	16,008,000	
東京計器	8,400	1,887.00	15,850,800	
愛知時計電機	4,500	2,476.00	11,142,000	
インターアクション	5,200	1,117.00	5,808,400	
オーバル	6,500	523.00	3,399,500	
東京精密	22,400	10,010.00	224,224,000	
マニー	43,900	2,142.50	94,055,750	
ニコン	158,500	1,477.00	234,104,500	
トプコン	53,300	1,631.00	86,932,300	
オリンパス	674,700	2,236.50	1,508,966,550	
理研計器	7,800	7,570.00	59,046,000	
タムロン	6,700	5,640.00	37,788,000	
ＨＯＹＡ	215,800	18,590.00	4,011,722,000	
シード	3,700	813.00	3,008,100	
ノーリツ鋼機	10,400	3,400.00	35,360,000	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	16,000	2,037.00	32,592,000	
朝日インテック	122,500	2,962.50	362,906,250	
シチズン時計	100,900	931.00	93,937,900	
リズム	2,300	2,854.00	6,564,200	
大研医器	5,500	510.00	2,805,000	
メニコン	37,700	2,290.50	86,351,850	
シンシア	900	539.00	485,100	
松風	5,000	2,799.00	13,995,000	
セイコーグループ	15,300	2,674.00	40,912,200	
ニプロ	91,400	1,224.00	111,873,600	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	10,900	187.00	2,038,300	
中本パックス	2,200	1,698.00	3,735,600	
スノーピーク	15,600	911.00	14,211,600	
パラマウントベッドホールディングス	22,800	2,721.00	62,038,800	
トランザクション	7,200	2,341.00	16,855,200	
粧美堂	2,000	657.00	1,314,000	

ニホンフラッシュ	10,300	938.00	9,661,400	
前田工繊	9,300	3,220.00	29,946,000	
永大産業	7,700	233.00	1,794,100	
アートネイチャー	11,300	800.00	9,040,000	
バンダイナムコホールディングス	300,300	3,045.00	914,413,500	
アイフィスジャパン	2,000	615.00	1,230,000	
ＳＨＯＥＩ	24,800	1,985.00	49,228,000	
フランスベッドホールディングス	12,900	1,412.00	18,214,800	
パイロットコーポレーション	15,400	4,142.00	63,786,800	
萩原工業	7,300	1,516.00	11,066,800	
フジシールインターナショナル	22,200	1,774.00	39,382,800	
タカラトミー	49,900	2,527.00	126,097,300	
広済堂ホールディングス	24,700	747.00	18,450,900	
エステールホールディングス	1,700	637.00	1,082,900	
タカノ	2,700	1,033.00	2,789,100	
プロネクサス	9,400	1,313.00	12,342,200	
ホクシン	5,600	115.00	644,000	
ウッドワン	2,400	1,032.00	2,476,800	
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	134,700	4,287.00	577,458,900	
大日本印刷	119,800	4,345.00	520,531,000	
共同印刷	3,100	3,365.00	10,431,500	
ＮＩＳＳＨＡ	18,800	1,578.00	29,666,400	
光村印刷	600	1,500.00	900,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	7,000	2,884.00	20,188,000	
アシックス	93,400	4,706.00	439,540,400	
ツツミ	1,900	2,190.00	4,161,000	
ローランド	8,100	4,855.00	39,325,500	
小松ウオール工業	4,200	2,996.00	12,583,200	
ヤマハ	69,100	3,317.00	229,204,700	
河合楽器製作所	3,200	3,765.00	12,048,000	
クリナップ	12,200	734.00	8,954,800	
ピジョン	69,800	1,585.50	110,667,900	
キングジム	9,700	877.00	8,506,900	
リンテック	22,000	2,762.00	60,764,000	
イトーキ	22,500	1,495.00	33,637,500	
任天堂	692,100	8,103.00	5,608,086,300	
三菱鉛筆	15,600	2,006.00	31,293,600	
タカラスタンダード	23,100	1,744.00	40,286,400	
コクヨ	47,300	2,417.50	114,347,750	
ナカバヤシ	11,800	552.00	6,513,600	
グローブライド	9,800	2,047.00	20,060,600	
オカムラ	33,000	2,242.00	73,986,000	

美津濃	10,900	4,355.00	47,469,500	
東京電力ホールディングス	988,100	796.80	787,318,080	
中部電力	403,900	1,911.00	771,852,900	
関西電力	423,300	1,976.50	836,652,450	
中国電力	190,400	1,039.50	197,920,800	
北陸電力	112,100	715.40	80,196,340	
東北電力	288,600	992.00	286,291,200	
四国電力	102,100	1,082.00	110,472,200	
九州電力	252,700	1,070.00	270,389,000	
北海道電力	105,900	656.00	69,470,400	
沖縄電力	28,000	1,156.00	32,368,000	
電源開発	90,000	2,458.50	221,265,000	
エフオン	7,100	444.00	3,152,400	
イーレックス	19,500	791.00	15,424,500	
レノバ	29,200	1,223.00	35,711,600	
東京瓦斯	231,700	3,404.00	788,706,800	
大阪瓦斯	222,000	3,107.00	689,754,000	
東邦瓦斯	47,500	3,018.00	143,355,000	
北海道瓦斯	6,500	2,255.00	14,657,500	
広島ガス	23,200	395.00	9,164,000	
西部ガスホールディングス	11,200	1,937.00	21,694,400	
静岡ガス	24,700	1,025.00	25,317,500	
メタウォーター	13,500	2,136.00	28,836,000	
ＳＢＳホールディングス	9,800	2,519.00	24,686,200	
東武鉄道	120,400	4,084.00	491,713,600	
相鉄ホールディングス	39,200	2,800.50	109,779,600	
東急	307,400	1,763.00	541,946,200	
京浜急行電鉄	135,600	1,318.00	178,720,800	
小田急電鉄	181,300	2,325.00	421,522,500	
京王電鉄	52,700	4,484.00	236,306,800	
京成電鉄	70,700	7,055.00	498,788,500	
富士急行	13,500	4,560.00	61,560,000	
東日本旅客鉄道	201,400	8,465.00	1,704,851,000	
西日本旅客鉄道	130,000	6,161.00	800,930,000	
東海旅客鉄道	422,200	3,714.00	1,568,050,800	
西武ホールディングス	132,600	2,096.00	277,929,600	
鴻池運輸	18,700	1,941.00	36,296,700	
西日本鉄道	29,300	2,473.00	72,458,900	
ハマキョウレックス	8,800	4,155.00	36,564,000	
サカイ引越センター	12,100	2,825.00	34,182,500	
近鉄グループホールディングス	109,400	4,783.00	523,260,200	
阪急阪神ホールディングス	145,900	4,657.00	679,456,300	

南海電気鉄道	48,800	2,911.50	142,081,200	
京阪ホールディングス	60,300	3,712.00	223,833,600	
神戸電鉄	3,000	2,920.00	8,760,000	
名古屋鉄道	112,900	2,307.50	260,516,750	
山陽電気鉄道	8,200	2,199.00	18,031,800	
アルプス物流	8,700	1,811.00	15,755,700	
ヤマトホールディングス	140,100	2,619.50	366,991,950	
山九	27,800	5,228.00	145,338,400	
丸運	3,600	283.00	1,018,800	
丸全昭和運輸	6,800	4,035.00	27,438,000	
センコーグループホールディングス	57,900	1,172.00	67,858,800	
トナミホールディングス	2,400	4,755.00	11,412,000	
ニッコンホールディングス	35,000	3,142.00	109,970,000	
日本石油輸送	700	2,875.00	2,012,500	
福山通運	12,500	4,150.00	51,875,000	
セイノーホールディングス	61,500	2,171.50	133,547,250	
エスライングループ本社	2,000	888.00	1,776,000	
神奈川中央交通	3,100	3,030.00	9,393,000	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	28,000	1,595.00	44,660,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	10,500	1,664.00	17,472,000	
九州旅客鉄道	77,400	3,245.00	251,163,000	
ＳＧホールディングス	183,800	2,026.00	372,378,800	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	37,100	8,872.00	329,151,200	
日本郵船	313,900	5,016.00	1,574,522,400	
商船三井	237,700	5,200.00	1,236,040,000	
川崎汽船	92,600	7,269.00	673,109,400	
ＮＳユナイテッド海運	6,100	5,150.00	31,415,000	
飯野海運	40,900	1,287.00	52,638,300	
共栄タンカー	2,400	871.00	2,090,400	
乾汽船	14,600	1,135.00	16,571,000	
日本航空	268,800	2,827.00	759,897,600	
ＡＮＡホールディングス	297,800	3,198.00	952,364,400	
パスコ	1,400	1,847.00	2,585,800	
トランコム	3,200	7,170.00	22,944,000	
日新	8,300	2,710.00	22,493,000	
三菱倉庫	26,900	4,633.00	124,627,700	
三井倉庫ホールディングス	10,200	5,040.00	51,408,000	
住友倉庫	29,500	2,680.00	79,060,000	
澁澤倉庫	4,600	3,160.00	14,536,000	
東陽倉庫	1,900	1,528.00	2,903,200	
日本トランスシティ	22,000	661.00	14,542,000	
ケイヒン	1,300	1,819.00	2,364,700	

中央倉庫	5,400	1,175.00	6,345,000	
川西倉庫	1,200	1,133.00	1,359,600	
安田倉庫	7,500	1,235.00	9,262,500	
ファイズホールディングス	1,300	1,239.00	1,610,700	
東洋埠頭	2,100	1,400.00	2,940,000	
上組	52,500	3,455.00	181,387,500	
サンリツ	1,600	786.00	1,257,600	
キムラユニティー	3,500	1,433.00	5,015,500	
キユーソー流通システム	4,200	937.00	3,935,400	
東海運	4,300	293.00	1,259,900	
エーアイテイー	6,900	1,794.00	12,378,600	
内外トランスライン	4,400	2,448.00	10,771,200	
日本コンセプト	4,000	1,714.00	6,856,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	42,900	2,338.00	100,300,200	
クロスキャット	6,400	1,137.00	7,276,800	
システナ	166,400	304.00	50,585,600	
デジタルアーツ	7,000	5,180.00	36,260,000	
日鉄ソリューションズ	18,800	4,985.00	93,718,000	
キューブシステム	6,500	1,121.00	7,286,500	
コア	4,900	1,830.00	8,967,000	
手間いらず	1,900	2,846.00	5,407,400	
ラクーンホールディングス	9,100	670.00	6,097,000	
ソリトンシステムズ	5,700	1,422.00	8,105,400	
ソフトクリエイトホールディングス	9,000	1,711.00	15,399,000	
ＴＩＳ	120,200	3,399.00	408,559,800	
テクミラホールディングス	3,400	406.00	1,380,400	
グリー	29,500	589.00	17,375,500	
GMOペパボ	1,400	1,193.00	1,670,200	
コーエーテクモホールディングス	68,900	1,798.00	123,882,200	
三菱総合研究所	5,400	4,870.00	26,298,000	
電算	900	1,512.00	1,360,800	
ＡＧＳ	3,100	808.00	2,504,800	
ファインデックス	8,700	969.00	8,430,300	
ブレインパッド	8,200	1,216.00	9,971,200	
ＫＬａｂ	20,200	280.00	5,656,000	
ポールトゥウィンホールディングス	18,800	520.00	9,776,000	
ネクソン	245,700	2,302.50	565,724,250	
アイスタイル	32,700	431.00	14,093,700	
エムアップホールディングス	13,500	1,054.00	14,229,000	
エイチーム	6,500	577.00	3,750,500	
エニグモ	14,000	367.00	5,138,000	
テクノスジャパン	6,000	639.00	3,834,000	

コロプラ	42,700	611.00	26,089,700	
ブロードリーフ	52,200	576.00	30,067,200	
クロス・マーケティンググループ	4,400	560.00	2,464,000	
デジタルハーツホールディングス	6,900	979.00	6,755,100	
メディアドゥ	4,800	1,345.00	6,456,000	
じげん	32,100	536.00	17,205,600	
ブイキューブ	13,200	317.00	4,184,400	
エンカレッジ・テクノロジ	1,700	568.00	965,600	
サイバーリンクス	2,800	823.00	2,304,400	
フィックスターズ	12,400	1,523.00	18,885,200	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	5,200	1,497.00	7,784,400	
オプティム	9,900	984.00	9,741,600	
セレス	4,400	1,134.00	4,989,600	
ＳＨＩＦＴ	7,300	28,020.00	204,546,000	
ティーガイア	11,500	1,986.00	22,839,000	
セック	1,200	5,600.00	6,720,000	
テクマトリックス	20,100	1,682.00	33,808,200	
プロシップ	4,900	1,420.00	6,958,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	28,600	2,429.50	69,483,700	
GMOペイメントゲートウェイ	22,000	9,060.00	199,320,000	
ザッパラス	2,100	453.00	951,300	
システムリサーチ	3,500	3,035.00	10,622,500	
インターネットイニシアティブ	52,600	3,085.00	162,271,000	
さくらインターネット	12,300	3,505.00	43,111,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,400	2,810.00	9,554,000	
ＳＲＡホールディングス	5,600	3,760.00	21,056,000	
システムインテグレータ	2,200	420.00	924,000	
朝日ネット	11,800	625.00	7,375,000	
ｅＢＡＳＥ	15,500	742.00	11,501,000	
アバントグループ	13,900	1,475.00	20,502,500	
アドソル日進	4,600	1,629.00	7,493,400	
ＯＤＫソリューションズ	1,700	601.00	1,021,700	
フリービット	5,800	1,500.00	8,700,000	
コムチュア	15,900	1,867.00	29,685,300	
アステリア	8,600	618.00	5,314,800	
アイル	5,100	3,290.00	16,779,000	
マークラインズ	6,000	2,994.00	17,964,000	
メディカル・データ・ビジョン	13,200	661.00	8,725,200	
ｇｕｍｉ	16,300	402.00	6,552,600	
ショーケース	1,700	344.00	584,800	
モバイルファクトリー	1,600	655.00	1,048,000	
テラスカイ	4,800	1,575.00	7,560,000	

デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,400	1,664.00	10,649,600	
ＰＣＩホールディングス	2,800	1,003.00	2,808,400	
アイビーシー	1,200	527.00	632,400	
ネオジャパン	3,700	1,065.00	3,940,500	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	2,800	2,095.00	5,866,000	
ラクス	52,000	2,429.50	126,334,000	
ランドコンピュータ	3,600	900.00	3,240,000	
ダブルスタンダード	3,400	1,593.00	5,416,200	
オープンドア	7,700	830.00	6,391,000	
アカツキ	5,200	2,647.00	13,764,400	
ベネフィットジャパン	500	1,265.00	632,500	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	3,400	1,547.00	5,259,800	
カナミックネットワーク	11,900	422.00	5,021,800	
ノムラシステムコーポレーション	8,200	115.00	943,000	
チェンジホールディングス	23,900	1,380.00	32,982,000	
シンクロ・フード	4,700	618.00	2,904,600	
オークネット	4,300	1,988.00	8,548,400	
キャピタル・アセット・プランニング	1,400	744.00	1,041,600	
セグエグループ	2,300	901.00	2,072,300	
エイトレッド	1,100	1,406.00	1,546,600	
マクロミル	21,600	777.00	16,783,200	
ビーグリー	1,600	1,254.00	2,006,400	
オロ	4,000	2,886.00	11,544,000	
ユーザーローカル	4,000	2,083.00	8,332,000	
テモナ	1,800	264.00	475,200	
ニーズウェル	4,000	743.00	2,972,000	
マネーフォワード	24,500	5,298.00	129,801,000	
サインポスト	2,800	529.00	1,481,200	
Ｓｕｎ　Ａｓｔｅｒｉｓｋ	7,800	985.00	7,683,000	
プラスアルファ・コンサルティング	6,500	2,731.00	17,751,500	
電算システムホールディングス	4,900	2,963.00	14,518,700	
Ａｐｐｉｅｒ　Ｇｒｏｕｐ	37,600	1,807.00	67,943,200	
ソルクシーズ	6,000	396.00	2,376,000	
フェイス	2,100	476.00	999,600	
プロトコーポレーション	12,000	1,291.00	15,492,000	
ハイマックス	3,400	1,416.00	4,814,400	
野村総合研究所	243,600	4,417.00	1,075,981,200	
ＣＥホールディングス	3,800	644.00	2,447,200	
日本システム技術	3,400	3,370.00	11,458,000	
インテージホールディングス	12,400	1,725.00	21,390,000	
東邦システムサイエンス	3,300	1,301.00	4,293,300	
ソースネクスト	55,900	156.00	8,720,400	

インフォコム	14,200	2,598.00	36,891,600	
シンプレクス・ホールディングス	16,500	2,873.00	47,404,500	
ＨＥＲＯＺ	3,700	1,684.00	6,230,800	
ラクスル	26,500	1,098.00	29,097,000	
メルカリ	66,700	2,463.00	164,282,100	
ＩＰＳ	3,600	1,967.00	7,081,200	
ＦＩＧ	8,500	328.00	2,788,000	
システムサポート	4,300	1,904.00	8,187,200	
イーソル	7,900	592.00	4,676,800	
東海ソフト	1,100	1,163.00	1,279,300	
ウイングアーク１ｓｔ	11,400	2,781.00	31,703,400	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,900	1,240.00	3,596,000	
サーバーワークス	2,200	4,085.00	8,987,000	
東名	600	2,207.00	1,324,200	
ヴィッツ	700	861.00	602,700	
トビラシステムズ	2,100	895.00	1,879,500	
Ｓａｎｓａｎ	36,000	1,405.00	50,580,000	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	1,800	664.00	1,195,200	
ギフティ	9,600	1,563.00	15,004,800	
メドレー	14,800	4,315.00	63,862,000	
ベース	3,800	3,360.00	12,768,000	
ＪＭＤＣ	18,700	4,029.00	75,342,300	
フォーカスシステムズ	8,000	1,021.00	8,168,000	
クレスコ	8,700	1,971.00	17,147,700	
フジ・メディア・ホールディングス	105,600	1,766.50	186,542,400	
オービック	36,700	24,550.00	900,985,000	
ジャストシステム	15,800	3,245.00	51,271,000	
ＴＤＣソフト	9,600	2,285.00	21,936,000	
ＬＩＮＥヤフー	1,565,000	480.00	751,200,000	
トレンドマイクロ	52,000	8,155.00	424,060,000	
ＩＤホールディングス	7,400	1,749.00	12,942,600	
日本オラクル	21,000	11,970.00	251,370,000	
アルファシステムズ	2,900	3,055.00	8,859,500	
フューチャー	23,500	1,758.00	41,313,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	5,900	1,761.00	10,389,900	
ＳＢテクノロジー	4,700	2,482.00	11,665,400	
トーセ	2,100	708.00	1,486,800	
オービックビジネスコンサルタント	15,500	6,780.00	105,090,000	
アイティフォー	14,500	1,209.00	17,530,500	
東計電算	3,000	3,540.00	10,620,000	
エックスネット	1,000	1,130.00	1,130,000	
大塚商会	54,500	6,168.00	336,156,000	

サイボウズ	15,100	2,149.00	32,449,900	
電通総研	13,400	5,810.00	77,854,000	
ＡＣＣＥＳＳ	13,000	785.00	10,205,000	
デジタルガレージ	17,600	3,610.00	63,536,000	
ＥＭシステムズ	18,300	704.00	12,883,200	
ウェザーニューズ	3,400	5,350.00	18,190,000	
ＣＩＪ	18,300	670.00	12,261,000	
ビジネスエンジニアリング	1,800	4,690.00	8,442,000	
日本エンタープライズ	7,700	127.00	977,900	
ＷＯＷＯＷ	8,300	1,123.00	9,320,900	
スカラ	10,200	764.00	7,792,800	
インテリジェント　ウェイブ	3,900	1,084.00	4,227,600	
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	3,900	3,520.00	13,728,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	11,000	615.00	6,765,000	
ネットワンシステムズ	44,400	2,347.50	104,229,000	
システムソフト	38,500	62.00	2,387,000	
アルゴグラフィックス	10,100	3,825.00	38,632,500	
マーベラス	17,900	761.00	13,621,900	
エイベックス	18,700	1,407.00	26,310,900	
ＢＩＰＲＯＧＹ	36,000	4,422.00	159,192,000	
都築電気	5,800	2,237.00	12,974,600	
ＴＢＳホールディングス	56,300	3,578.00	201,441,400	
日本テレビホールディングス	97,300	1,715.00	166,869,500	
朝日放送グループホールディングス	10,300	668.00	6,880,400	
テレビ朝日ホールディングス	26,700	1,769.00	47,232,300	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	85,400	757.00	64,647,800	
テレビ東京ホールディングス	7,900	3,110.00	24,569,000	
日本ＢＳ放送	2,600	902.00	2,345,200	
ビジョン	16,600	1,162.00	19,289,200	
スマートバリュー	1,800	421.00	757,800	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	12,300	4,435.00	54,550,500	
ワイヤレスゲート	3,300	283.00	933,900	
日本通信	108,300	230.00	24,909,000	
クロップス	1,200	1,159.00	1,390,800	
日本電信電話	32,702,100	191.20	6,252,641,520	
ＫＤＤＩ	849,500	5,070.00	4,306,965,000	
ソフトバンク	1,768,900	1,990.50	3,520,995,450	
光通信	11,100	25,515.00	283,216,500	
エムティーアイ	7,600	605.00	4,598,000	
ＧＭＯインターネットグループ	40,600	2,755.00	111,853,000	
ファイバーゲート	5,900	964.00	5,687,600	
アイドママーケティングコミュニケーション	1,700	239.00	406,300	

ＫＡＤＯＫＡＷＡ	58,100	3,139.00	182,375,900	
学研ホールディングス	18,300	1,031.00	18,867,300	
ゼンリン	18,800	886.00	16,656,800	
昭文社ホールディングス	3,200	357.00	1,142,400	
インプレスホールディングス	6,500	176.00	1,144,000	
アイネット	6,700	2,076.00	13,909,200	
松竹	5,700	9,567.00	54,531,900	
東宝	61,200	4,779.00	292,474,800	
東映	3,600	21,200.00	76,320,000	
ＮＴＴデータグループ	287,500	2,160.00	621,000,000	
ピー・シー・エー	6,300	1,218.00	7,673,400	
ビジネスブレイン太田昭和	4,700	2,200.00	10,340,000	
ＤＴＳ	23,400	3,740.00	87,516,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	50,200	5,758.00	289,051,600	
シーイーシー	13,900	1,694.00	23,546,600	
カプコン	98,300	5,626.00	553,035,800	
アイ・エス・ビー	5,600	1,583.00	8,864,800	
ジャステック	6,800	1,381.00	9,390,800	
ＳＣＳＫ	76,900	2,962.50	227,816,250	
ＮＳＷ	4,400	2,964.00	13,041,600	
アイネス	8,100	1,607.00	13,016,700	
ＴＫＣ	17,500	3,875.00	67,812,500	
富士ソフト	22,100	6,520.00	144,092,000	
ＮＳＤ	39,200	2,817.00	110,426,400	
コナミグループ	41,200	9,055.00	373,066,000	
福井コンピュータホールディングス	6,800	2,633.00	17,904,400	
ＪＢＣＣホールディングス	7,300	4,025.00	29,382,500	
ミロク情報サービス	10,000	1,838.00	18,380,000	
ソフトバンクグループ	542,300	6,723.00	3,645,882,900	
高千穂交易	3,000	4,170.00	12,510,000	
オルバヘルスケアホールディングス	1,200	1,831.00	2,197,200	
伊藤忠食品	2,600	7,770.00	20,202,000	
エレマテック	10,400	1,883.00	19,583,200	
あらた	17,800	3,240.00	57,672,000	
トーメンデバイス	1,700	5,450.00	9,265,000	
東京エレクトロン　デバイス	11,600	5,980.00	69,368,000	
円谷フィールズホールディングス	19,900	1,530.00	30,447,000	
双日	129,100	3,508.00	452,882,800	
アルフレッサ　ホールディングス	116,400	2,504.50	291,523,800	
横浜冷凍	31,600	1,098.00	34,696,800	
ラサ商事	4,000	1,634.00	6,536,000	
アルコニックス	15,300	1,393.00	21,312,900	

神戸物産	89,700	3,897.00	349,560,900	
ハイパー	1,800	305.00	549,000	
あい　ホールディングス	18,600	2,471.00	45,960,600	
ディーブイエックス	2,100	1,082.00	2,272,200	
ダイワボウホールディングス	51,300	3,202.00	164,262,600	
マクニカホールディングス	27,400	8,574.00	234,927,600	
ラクト・ジャパン	4,500	2,192.00	9,864,000	
グリムス	4,900	2,147.00	10,520,300	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	15,200	1,103.00	16,765,600	
八洲電機	9,400	1,353.00	12,718,200	
メディアスホールディングス	7,400	756.00	5,594,400	
レスターホールディングス	9,900	3,195.00	31,630,500	
ジオリーブグループ	1,800	1,359.00	2,446,200	
大光	3,300	620.00	2,046,000	
ＯＣＨＩホールディングス	1,800	1,560.00	2,808,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	63,000	989.00	62,307,000	
黒谷	2,100	607.00	1,274,700	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,500	827.00	1,240,500	
三洋貿易	13,100	1,239.00	16,230,900	
ビューティガレージ	3,700	2,147.00	7,943,900	
ウイン・パートナーズ	8,400	1,240.00	10,416,000	
ミタチ産業	2,000	1,169.00	2,338,000	
シップヘルスケアホールディングス	41,700	2,300.50	95,930,850	
明治電機工業	4,300	1,446.00	6,217,800	
デリカフーズホールディングス	3,000	594.00	1,782,000	
スターティアホールディングス	1,500	1,484.00	2,226,000	
コメダホールディングス	28,400	2,840.00	80,656,000	
ピーバンドットコム	1,200	384.00	460,800	
アセンテック	4,400	573.00	2,521,200	
富士興産	1,700	1,998.00	3,396,600	
協栄産業	700	2,670.00	1,869,000	
フルサト・マルカホールディングス	10,500	2,451.00	25,735,500	
ヤマエグループホールディングス	6,600	3,430.00	22,638,000	
小野建	11,400	1,810.00	20,634,000	
南陽	1,500	2,206.00	3,309,000	
佐鳥電機	5,700	2,362.00	13,463,400	
エコートレーディング	1,500	1,262.00	1,893,000	
伯東	6,600	6,170.00	40,722,000	
コンドーテック	8,900	1,248.00	11,107,200	
中山福	4,200	372.00	1,562,400	
ナガイレーベン	14,700	2,444.00	35,926,800	
三菱食品	10,700	5,000.00	53,500,000	

松田産業	8,800	2,612.00	22,985,600	
第一興商	44,900	2,100.00	94,290,000	
メディパルホールディングス	120,200	2,390.50	287,338,100	
ＳＰＫ	5,200	1,976.00	10,275,200	
萩原電気ホールディングス	5,000	5,230.00	26,150,000	
アズワン	18,200	5,518.00	100,427,600	
スズデン	4,100	2,477.00	10,155,700	
尾家産業	1,800	1,775.00	3,195,000	
シモジマ	8,000	1,327.00	10,616,000	
ドウシシャ	10,700	2,171.00	23,229,700	
小津産業	1,700	1,623.00	2,759,100	
高速	6,100	2,235.00	13,633,500	
たけびし	4,400	2,055.00	9,042,000	
リックス	1,600	3,685.00	5,896,000	
丸文	10,400	1,780.00	18,512,000	
ハピネット	9,900	2,841.00	28,125,900	
橋本総業ホールディングス	4,600	1,296.00	5,961,600	
日本ライフライン	34,000	1,310.00	44,540,000	
タカショー	10,100	521.00	5,262,100	
ＩＤＯＭ	30,700	820.00	25,174,000	
進和	7,100	2,465.00	17,501,500	
エスケイジャパン	1,900	730.00	1,387,000	
ダイトロン	4,600	3,015.00	13,869,000	
シークス	16,500	1,464.00	24,156,000	
田中商事	2,200	810.00	1,782,000	
オーハシテクニカ	5,800	1,756.00	10,184,800	
白銅	3,300	2,406.00	7,939,800	
ダイコー通産	800	1,203.00	962,400	
伊藤忠商事	779,600	6,647.00	5,182,001,200	
丸紅	967,000	2,547.50	2,463,432,500	
高島	4,800	1,246.00	5,980,800	
長瀬産業	53,200	2,390.50	127,174,600	
蝶理	6,600	2,969.00	19,595,400	
豊田通商	101,600	9,734.00	988,974,400	
三共生興	16,100	732.00	11,785,200	
兼松	48,500	2,245.00	108,882,500	
ツカモトコーポレーション	1,100	1,210.00	1,331,000	
三井物産	873,800	5,978.00	5,223,576,400	
日本紙パルプ商事	5,500	5,060.00	27,830,000	
カメイ	12,300	1,922.00	23,640,600	
東都水産	400	7,080.00	2,832,000	
ＯＵＧホールディングス	1,100	2,469.00	2,715,900	

スターゼン	8,000	2,737.00	21,896,000	
山善	35,200	1,223.00	43,049,600	
椿本興業	1,900	6,590.00	12,521,000	
住友商事	701,900	3,384.00	2,375,229,600	
内田洋行	4,700	7,580.00	35,626,000	
三菱商事	2,298,000	2,602.50	5,980,545,000	
第一実業	10,900	1,924.00	20,971,600	
キヤノンマーケティングジャパン	26,900	4,376.00	117,714,400	
西華産業	4,600	3,130.00	14,398,000	
佐藤商事	8,100	1,582.00	12,814,200	
菱洋エレクトロ	11,000	3,990.00	43,890,000	
東京産業	10,600	747.00	7,918,200	
ユアサ商事	9,100	4,860.00	44,226,000	
神鋼商事	2,900	5,960.00	17,284,000	
トルク	4,200	288.00	1,209,600	
阪和興業	20,800	5,320.00	110,656,000	
正栄食品工業	7,700	4,665.00	35,920,500	
カナデン	8,000	1,559.00	12,472,000	
ＲＹＯＤＥＮ	9,400	2,778.00	26,113,200	
岩谷産業	26,400	6,665.00	175,956,000	
ナイス	2,100	1,620.00	3,402,000	
ニチモウ	2,000	2,143.00	4,286,000	
極東貿易	6,900	2,156.00	14,876,400	
アステナホールディングス	21,800	487.00	10,616,600	
三愛オブリ	27,900	1,677.00	46,788,300	
稲畑産業	23,300	3,090.00	71,997,000	
ＧＳＩクレオス	6,700	2,278.00	15,262,600	
明和産業	15,400	667.00	10,271,800	
クワザワホールディングス	2,500	672.00	1,680,000	
ワキタ	19,200	1,578.00	30,297,600	
東邦ホールディングス	32,100	3,298.00	105,865,800	
サンゲツ	26,700	3,305.00	88,243,500	
ミツウロコグループホールディングス	14,800	1,574.00	23,295,200	
シナネンホールディングス	3,200	4,085.00	13,072,000	
伊藤忠エネクス	28,800	1,605.00	46,224,000	
サンリオ	32,900	6,167.00	202,894,300	
サンワテクノス	5,900	2,342.00	13,817,800	
リョーサン	8,200	5,210.00	42,722,000	
新光商事	15,600	1,258.00	19,624,800	
トーホー	5,000	2,821.00	14,105,000	
三信電気	4,700	2,508.00	11,787,600	
東陽テクニカ	11,800	1,469.00	17,334,200	

モスフードサービス	17,100	3,400.00	58,140,000	
加賀電子	10,600	7,080.00	75,048,000	
ソーダニッカ	6,000	1,225.00	7,350,000	
立花エレテック	7,700	3,220.00	24,794,000	
フォーバル	4,600	1,402.00	6,449,200	
ＰＡＬＴＡＣ	15,600	4,555.00	71,058,000	
三谷産業	20,300	379.00	7,693,700	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,900	6,300.00	18,270,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	600	2,220.00	1,332,000	
コーア商事ホールディングス	6,500	745.00	4,842,500	
ＫＰＰグループホールディングス	30,100	693.00	20,859,300	
ヤマタネ	5,100	2,587.00	13,193,700	
丸紅建材リース	700	2,791.00	1,953,700	
泉州電業	5,800	3,690.00	21,402,000	
トラスコ中山	24,400	2,505.00	61,122,000	
オートバックスセブン	40,400	1,613.50	65,185,400	
モリト	8,300	1,465.00	12,159,500	
加藤産業	14,400	4,710.00	67,824,000	
北恵	2,000	870.00	1,740,000	
イエローハット	18,400	1,805.00	33,212,000	
ＪＫホールディングス	8,900	1,056.00	9,398,400	
日伝	7,100	2,919.00	20,724,900	
北沢産業	4,200	286.00	1,201,200	
杉本商事	5,200	2,278.00	11,845,600	
因幡電機産業	30,100	3,570.00	107,457,000	
東テク	3,900	5,170.00	20,163,000	
ミスミグループ本社	175,100	2,483.50	434,860,850	
アルテック	4,200	260.00	1,092,000	
タキヒヨー	1,900	1,072.00	2,036,800	
蔵王産業	1,300	2,500.00	3,250,000	
スズケン	44,100	4,844.00	213,620,400	
ジェコス	6,900	1,099.00	7,583,100	
グローセル	11,900	670.00	7,973,000	
ローソン	24,700	8,332.00	205,800,400	
サンエー	8,900	4,545.00	40,450,500	
カワチ薬品	9,200	2,734.00	25,152,800	
エービーシー・マート	50,900	2,500.00	127,250,000	
ハードオフコーポレーション	3,600	1,775.00	6,390,000	
アスクル	24,100	2,121.00	51,116,100	
ゲオホールディングス	13,100	2,350.00	30,785,000	
アダストリア	14,100	3,320.00	46,812,000	
くら寿司	13,700	3,900.00	53,430,000	

キャンドゥ	4,200	2,728.00	11,457,600	
ＩＫホールディングス	3,300	332.00	1,095,600	
パルグループホールディングス	22,900	2,270.00	51,983,000	
エディオン	46,100	1,620.00	74,682,000	
サーラコーポレーション	24,800	839.00	20,807,200	
ワッツ	4,300	592.00	2,545,600	
ハローズ	5,300	4,285.00	22,710,500	
あみやき亭	2,900	4,260.00	12,354,000	
大黒天物産	3,600	8,490.00	30,564,000	
ハニーズホールディングス	9,300	1,662.00	15,456,600	
ファーマライズホールディングス	2,200	674.00	1,482,800	
アルペン	9,700	1,995.00	19,351,500	
ハブ	2,900	754.00	2,186,600	
クオールホールディングス	16,100	1,781.00	28,674,100	
ジンズホールディングス	7,000	4,305.00	30,135,000	
ビックカメラ	61,900	1,357.00	83,998,300	
ＤＣＭホールディングス	61,500	1,356.00	83,394,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	164,600	1,446.00	238,011,600	
東京一番フーズ	2,400	522.00	1,252,800	
きちりホールディングス	1,800	1,088.00	1,958,400	
Ｊ．フロント　リテイリング	133,300	1,393.50	185,753,550	
ドトール・日レスホールディングス	20,700	2,211.00	45,767,700	
マツキヨココカラ&カンパニー	211,100	2,743.50	579,152,850	
ブロンコビリー	6,900	3,515.00	24,253,500	
ＺＯＺＯ	74,000	3,300.00	244,200,000	
トレジャー・ファクトリー	5,800	1,214.00	7,041,200	
物語コーポレーション	19,400	5,270.00	102,238,000	
三越伊勢丹ホールディングス	195,500	1,759.00	343,884,500	
Ｈａｍｅｅ	4,400	1,090.00	4,796,000	
マーケットエンタープライズ	1,000	1,014.00	1,014,000	
ウエルシアホールディングス	60,300	2,381.00	143,574,300	
クリエイトＳＤホールディングス	19,300	3,115.00	60,119,500	
丸善ＣＨＩホールディングス	10,000	329.00	3,290,000	
ミサワ	1,900	708.00	1,345,200	
ティーライフ	1,300	1,447.00	1,881,100	
チムニー	2,400	1,452.00	3,484,800	
シュッピン	10,300	1,057.00	10,887,100	
オイシックス・ラ・大地	15,800	1,389.00	21,946,200	
ネクステージ	26,600	2,329.00	61,951,400	
ジョイフル本田	33,900	1,947.00	66,003,300	
鳥貴族ホールディングス	4,400	3,820.00	16,808,000	
ホットランド	9,000	1,972.00	17,748,000	

すかいらーくホールディングス	158,700	2,405.00	381,673,500	
ＳＦＰホールディングス	6,300	2,107.00	13,274,100	
綿半ホールディングス	9,200	1,441.00	13,257,200	
ヨシックスホールディングス	2,000	3,020.00	6,040,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	32,700	1,025.00	33,517,500	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,700	619.00	3,528,300	
ＢＥＥＮＯＳ	5,000	1,485.00	7,425,000	
あさひ	10,400	1,290.00	13,416,000	
日本調剤	8,100	1,397.00	11,315,700	
コスモス薬品	11,500	15,550.00	178,825,000	
トーエル	3,800	781.00	2,967,800	
セブン&アイ・ホールディングス	399,700	5,791.00	2,314,662,700	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	78,500	1,127.00	88,469,500	
ツルハホールディングス	24,400	12,795.00	312,198,000	
サンマルクホールディングス	9,500	2,241.00	21,289,500	
フェリシモ	2,000	919.00	1,838,000	
トリドールホールディングス	32,600	4,725.00	154,035,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	15,100	338.00	5,103,800	
ウイルプラスホールディングス	1,500	997.00	1,495,500	
ＪＭホールディングス	8,900	2,321.00	20,656,900	
サツドラホールディングス	3,900	781.00	3,045,900	
アレンザホールディングス	9,000	1,111.00	9,999,000	
串カツ田中ホールディングス	3,300	1,840.00	6,072,000	
バロックジャパンリミテッド	9,200	822.00	7,562,400	
クスリのアオキホールディングス	31,200	3,248.00	101,337,600	
力の源ホールディングス	5,200	1,485.00	7,722,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	62,000	3,164.00	196,168,000	
メディカルシステムネットワーク	12,200	654.00	7,978,800	
はるやまホールディングス	3,800	589.00	2,238,200	
ノジマ	33,800	1,908.00	64,490,400	
カッパ・クリエイト	18,200	1,772.00	32,250,400	
ライトオン	5,800	413.00	2,395,400	
良品計画	126,700	2,337.00	296,097,900	
パリミキホールディングス	10,500	489.00	5,134,500	
アドヴァングループ	11,300	1,066.00	12,045,800	
アルビス	3,900	2,699.00	10,526,100	
コナカ	8,400	415.00	3,486,000	
ハウス　オブ　ローゼ	1,100	1,610.00	1,771,000	
Ｇ－７ホールディングス	12,900	1,248.00	16,099,200	
イオン北海道	34,400	943.00	32,439,200	

コジマ	19,600	747.00	14,641,200	
ヒマラヤ	2,800	940.00	2,632,000	
コーナン商事	14,300	3,920.00	56,056,000	
エコス	4,400	2,469.00	10,863,600	
ワタミ	12,200	1,052.00	12,834,400	
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	234,200	3,321.00	777,778,200	
西松屋チェーン	23,000	2,098.00	48,254,000	
ゼンショーホールディングス	59,100	7,590.00	448,569,000	
幸楽苑ホールディングス	8,000	1,237.00	9,896,000	
ハークスレイ	3,200	961.00	3,075,200	
サイゼリヤ	17,200	5,160.00	88,752,000	
ＶＴホールディングス	44,600	529.00	23,593,400	
魚力	3,800	2,338.00	8,884,400	
フジ・コーポレーション	5,900	1,719.00	10,142,100	
ユナイテッドアローズ	13,800	1,936.00	26,716,800	
ハイデイ日高	17,300	2,924.00	50,585,200	
ＹＵ－ＷＡ　Ｃｒｅａｔｉｏｎ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	6,400	147.00	940,800	
コロワイド	49,900	2,359.00	117,714,100	
壱番屋	9,200	6,100.00	56,120,000	
ＰＬＡＮＴ	2,200	1,719.00	3,781,800	
スギホールディングス	23,400	6,700.00	156,780,000	
薬王堂ホールディングス	5,800	2,565.00	14,877,000	
スクロール	17,600	1,031.00	18,145,600	
ヨンドシーホールディングス	10,600	2,008.00	21,284,800	
木曽路	17,700	2,654.00	46,975,800	
ＳＲＳホールディングス	19,400	1,211.00	23,493,400	
千趣会	22,100	320.00	7,072,000	
リテールパートナーズ	17,400	1,860.00	32,364,000	
上新電機	10,900	2,474.00	26,966,600	
日本瓦斯	61,600	2,304.50	141,957,200	
ロイヤルホールディングス	20,400	2,605.00	53,142,000	
いなげや	11,300	1,281.00	14,475,300	
チヨダ	11,400	903.00	10,294,200	
ライフコーポレーション	12,200	3,830.00	46,726,000	
リンガーハット	15,000	2,467.00	37,005,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	16,700	629.00	10,504,300	
ＡＯＫＩホールディングス	23,600	1,206.00	28,461,600	
オークワ	16,800	897.00	15,069,600	
コメリ	17,900	3,275.00	58,622,500	
青山商事	25,000	1,784.00	44,600,000	
しまむら	13,600	16,635.00	226,236,000	

はせがわ	4,600	367.00	1,688,200	
高島屋	80,200	2,077.50	166,615,500	
松屋	19,700	981.00	19,325,700	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	51,400	1,628.00	83,679,200	
近鉄百貨店	5,100	2,536.00	12,933,600	
丸井グループ	77,000	2,515.00	193,655,000	
アクシアル　リテイリング	8,000	4,025.00	32,200,000	
イオン	393,200	3,527.00	1,386,816,400	
イズミ	20,600	3,616.00	74,489,600	
平和堂	19,400	2,207.00	42,815,800	
フジ	17,800	1,988.00	35,386,400	
ヤオコー	13,100	8,624.00	112,974,400	
ゼビオホールディングス	16,000	969.00	15,504,000	
ケーズホールディングス	82,200	1,326.50	109,038,300	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	3,500	545.00	1,907,500	
日産東京販売ホールディングス	10,500	463.00	4,861,500	
シルバーライフ	2,500	890.00	2,225,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	5,100	5,800.00	29,580,000	
ナルミヤ・インターナショナル	1,500	1,196.00	1,794,000	
ブックオフグループホールディングス	5,800	1,267.00	7,348,600	
ギフトホールディングス	5,100	2,644.00	13,484,400	
アインホールディングス	16,000	4,525.00	72,400,000	
元気寿司	6,600	3,810.00	25,146,000	
ヤマダホールディングス	357,400	448.10	160,150,940	
アークランズ	34,800	1,705.00	59,334,000	
ニトリホールディングス	42,200	18,450.00	778,590,000	
グルメ杵屋	9,700	1,092.00	10,592,400	
愛眼	5,700	188.00	1,071,600	
ケーユーホールディングス	5,700	1,170.00	6,669,000	
吉野家ホールディングス	42,800	3,381.00	144,706,800	
松屋フーズホールディングス	5,500	5,930.00	32,615,000	
サガミホールディングス	17,600	1,546.00	27,209,600	
関西フードマーケット	8,100	1,465.00	11,866,500	
王将フードサービス	8,600	8,210.00	70,606,000	
ミニストップ	8,500	1,543.00	13,115,500	
アークス	21,400	2,927.00	62,637,800	
バローホールディングス	22,300	2,517.00	56,129,100	
ベルク	5,800	6,270.00	36,366,000	
大庄	4,700	1,345.00	6,321,500	
ファーストリテイリング	52,200	39,610.00	2,067,642,000	
サンドラッグ	39,200	4,535.00	177,772,000	
サックスバー　ホールディングス	11,300	851.00	9,616,300	

ヤマザワ	1,700	1,269.00	2,157,300	
やまや	1,700	3,110.00	5,287,000	
ベルーナ	28,400	624.00	17,721,600	
いよぎんホールディングス	128,500	978.10	125,685,850	
しずおかフィナンシャルグループ	239,900	1,283.00	307,791,700	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	90,900	1,033.00	93,899,700	
楽天銀行	37,500	2,222.00	83,325,000	
京都フィナンシャルグループ	136,800	2,335.00	319,428,000	
島根銀行	2,500	525.00	1,312,500	
じもとホールディングス	6,300	520.00	3,276,000	
めぶきフィナンシャルグループ	535,700	436.80	233,993,760	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,800	4,220.00	58,236,000	
九州フィナンシャルグループ	208,900	867.70	181,262,530	
ゆうちょ銀行	1,186,300	1,504.50	1,784,788,350	
富山第一銀行	34,300	790.00	27,097,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	579,300	685.30	396,994,290	
西日本フィナンシャルホールディングス	60,900	1,647.00	100,302,300	
三十三フィナンシャルグループ	9,700	1,890.00	18,333,000	
第四北越フィナンシャルグループ	16,900	3,970.00	67,093,000	
ひろぎんホールディングス	153,700	956.60	147,029,420	
おきなわフィナンシャルグループ	9,200	2,397.00	22,052,400	
十六フィナンシャルグループ	14,000	3,995.00	55,930,000	
北國フィナンシャルホールディングス	11,400	4,310.00	49,134,000	
プロクレアホールディングス	12,300	1,898.00	23,345,400	
あいちフィナンシャルグループ	16,600	2,541.00	42,180,600	
あおぞら銀行	77,600	3,245.00	251,812,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	6,576,200	1,308.00	8,601,669,600	
りそなホールディングス	1,258,900	770.30	969,730,670	
三井住友トラスト・ホールディングス	388,000	2,899.00	1,124,812,000	
三井住友フィナンシャルグループ	767,600	7,373.00	5,659,514,800	
千葉銀行	300,900	1,065.50	320,608,950	
群馬銀行	209,500	709.90	148,724,050	
武蔵野銀行	14,400	2,742.00	39,484,800	
千葉興業銀行	17,900	865.00	15,483,500	
筑波銀行	47,400	246.00	11,660,400	
七十七銀行	31,400	3,485.00	109,429,000	
秋田銀行	7,200	1,956.00	14,083,200	
山形銀行	12,000	1,090.00	13,080,000	
岩手銀行	6,800	2,517.00	17,115,600	
東邦銀行	85,400	302.00	25,790,800	
東北銀行	3,500	1,165.00	4,077,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	94,000	3,440.00	323,360,000	

スルガ銀行	95,200	885.00	84,252,000	
八十二銀行	231,700	785.50	182,000,350	
山梨中央銀行	12,000	1,726.00	20,712,000	
大垣共立銀行	20,600	1,925.00	39,655,000	
福井銀行	9,600	1,695.00	16,272,000	
清水銀行	4,300	1,559.00	6,703,700	
富山銀行	1,100	1,712.00	1,883,200	
滋賀銀行	18,000	3,435.00	61,830,000	
南都銀行	16,200	2,582.00	41,828,400	
百五銀行	101,600	566.00	57,505,600	
紀陽銀行	38,600	1,673.00	64,577,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	66,800	1,581.00	105,610,800	
山陰合同銀行	67,600	1,023.00	69,154,800	
鳥取銀行	2,300	1,418.00	3,261,400	
百十四銀行	10,600	2,420.00	25,652,000	
四国銀行	17,100	993.00	16,980,300	
阿波銀行	15,100	2,443.00	36,889,300	
大分銀行	6,500	2,639.00	17,153,500	
宮崎銀行	6,500	2,695.00	17,517,500	
佐賀銀行	6,300	1,900.00	11,970,000	
琉球銀行	23,000	1,128.00	25,944,000	
セブン銀行	338,400	307.30	103,990,320	
みずほフィナンシャルグループ	1,457,200	2,587.50	3,770,505,000	
高知銀行	2,500	947.00	2,367,500	
山口フィナンシャルグループ	105,900	1,339.00	141,800,100	
名古屋銀行	7,100	5,390.00	38,269,000	
北洋銀行	163,600	364.00	59,550,400	
大光銀行	2,100	1,311.00	2,753,100	
愛媛銀行	14,500	1,062.00	15,399,000	
トマト銀行	2,400	1,193.00	2,863,200	
京葉銀行	45,300	707.00	32,027,100	
栃木銀行	53,900	308.00	16,601,200	
北日本銀行	3,800	2,193.00	8,333,400	
東和銀行	19,800	625.00	12,375,000	
福島銀行	7,600	238.00	1,808,800	
大東銀行	2,800	752.00	2,105,600	
トモニホールディングス	87,300	392.00	34,221,600	
フィデアホールディングス	11,200	1,557.00	17,438,400	
池田泉州ホールディングス	149,700	330.00	49,401,000	
ＦＰＧ	36,600	1,700.00	62,220,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	8,900	841.00	7,484,900	
マーキュリアホールディングス	3,800	708.00	2,690,400	

ＳＢＩホールディングス	158,000	3,625.00	572,750,000	
ジャフコ　グループ	32,200	1,710.00	55,062,000	
大和証券グループ本社	836,400	1,044.00	873,201,600	
野村ホールディングス	1,815,700	752.20	1,365,769,540	
岡三証券グループ	94,900	759.00	72,029,100	
丸三証券	36,000	878.00	31,608,000	
東洋証券	28,900	306.00	8,843,400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	128,300	555.00	71,206,500	
光世証券	1,800	574.00	1,033,200	
水戸証券	31,300	477.00	14,930,100	
いちよし証券	20,300	775.00	15,732,500	
松井証券	53,200	806.00	42,879,200	
マネックスグループ	105,900	761.00	80,589,900	
極東証券	14,300	1,064.00	15,215,200	
岩井コスモホールディングス	12,300	2,057.00	25,301,100	
アイザワ証券グループ	15,700	1,244.00	19,530,800	
マネーパートナーズグループ	7,800	304.00	2,371,200	
スパークス・グループ	12,100	1,800.00	21,780,000	
かんぽ生命保険	110,000	2,681.50	294,965,000	
ＦＰパートナー	2,100	5,930.00	12,453,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	162,400	7,697.00	1,249,992,800	
アニコム　ホールディングス	36,700	575.00	21,102,500	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	241,700	6,030.00	1,457,451,000	
第一生命ホールディングス	527,500	3,158.00	1,665,845,000	
東京海上ホールディングス	1,067,100	3,831.00	4,088,060,100	
Ｔ＆Ｄホールディングス	290,000	2,422.00	702,380,000	
アドバンスクリエイト	6,200	1,015.00	6,293,000	
全国保証	28,300	5,419.00	153,357,700	
あんしん保証	4,200	244.00	1,024,800	
イントラスト	3,000	808.00	2,424,000	
日本モーゲージサービス	4,300	521.00	2,240,300	
Ｃａｓａ	3,000	889.00	2,667,000	
ＳＢＩアルヒ	10,600	850.00	9,010,000	
プレミアグループ	18,300	1,793.00	32,811,900	
ネットプロテクションズホールディングス	36,800	183.00	6,734,400	
クレディセゾン	68,500	2,839.50	194,505,750	
芙蓉総合リース	9,900	13,315.00	131,818,500	
みずほリース	18,100	5,310.00	96,111,000	
東京センチュリー	80,800	1,636.50	132,229,200	
日本証券金融	39,800	1,566.00	62,326,800	
アイフル	159,400	377.00	60,093,800	
リコーリース	10,300	5,070.00	52,221,000	

イオンフィナンシャルサービス	62,100	1,345.50	83,555,550	
アコム	193,200	368.00	71,097,600	
ジャックス	11,500	5,730.00	65,895,000	
オリエントコーポレーション	35,400	1,120.00	39,648,000	
オリックス	658,100	2,844.00	1,871,636,400	
三菱ＨＣキャピタル	481,300	1,028.00	494,776,400	
九州リースサービス	3,600	1,077.00	3,877,200	
日本取引所グループ	281,700	3,287.00	925,947,900	
イー・ギャランティ	17,700	2,019.00	35,736,300	
アサックス	3,600	730.00	2,628,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	5,400	3,715.00	20,061,000	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	32,300	172.00	5,555,600	
大東建託	39,600	16,410.00	649,836,000	
いちご	125,500	378.00	47,439,000	
日本駐車場開発	116,500	188.00	21,902,000	
スター・マイカ・ホールディングス	13,200	594.00	7,840,800	
ＳＲＥホールディングス	5,500	2,733.00	15,031,500	
ＡＤワークスグループ	18,100	227.00	4,108,700	
ヒューリック	252,100	1,612.50	406,511,250	
野村不動産ホールディングス	60,200	4,107.00	247,241,400	
三重交通グループホールディングス	23,900	644.00	15,391,600	
サムティ	17,400	2,499.00	43,482,600	
ディア・ライフ	19,000	992.00	18,848,000	
地主	8,500	2,342.00	19,907,000	
プレサンスコーポレーション	17,400	1,687.00	29,353,800	
ハウスコム	1,700	916.00	1,557,200	
ＪＰＭＣ	6,600	1,138.00	7,510,800	
サンセイランディック	2,600	1,065.00	2,769,000	
フージャースホールディングス	16,600	1,136.00	18,857,600	
オープンハウスグループ	39,600	4,567.00	180,853,200	
東急不動産ホールディングス	325,000	1,033.50	335,887,500	
飯田グループホールディングス	103,600	2,281.50	236,363,400	
イーグランド	1,400	1,551.00	2,171,400	
ムゲンエステート	5,200	1,151.00	5,985,200	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	6,500	1,083.00	7,039,500	
シーアールイー	6,300	1,470.00	9,261,000	
ケイアイスター不動産	5,300	3,465.00	18,364,500	
グッドコムアセット	10,700	734.00	7,853,800	
ジェイ・エス・ビー	5,600	2,515.00	14,084,000	
ロードスターキャピタル	7,300	1,962.00	14,322,600	
テンポイノベーション	2,600	1,025.00	2,665,000	
フェイスネットワーク	2,300	1,568.00	3,606,400	

霞ヶ関キャピタル	2,600	10,480.00	27,248,000	
パーク２４	70,300	1,850.00	130,055,000	
パラカ	4,000	1,933.00	7,732,000	
三井不動産	499,400	3,844.00	1,919,693,600	
三菱地所	705,900	2,145.50	1,514,508,450	
平和不動産	17,600	3,950.00	69,520,000	
東京建物	94,500	2,343.50	221,460,750	
京阪神ビルディング	19,000	1,453.00	27,607,000	
住友不動産	156,200	4,708.00	735,389,600	
テーオーシー	20,100	705.00	14,170,500	
東京楽天地	1,900	6,690.00	12,711,000	
レオパレス２１	108,000	414.00	44,712,000	
スターツコーポレーション	15,600	2,970.00	46,332,000	
フジ住宅	15,700	720.00	11,304,000	
空港施設	14,400	623.00	8,971,200	
明和地所	5,000	1,346.00	6,730,000	
ゴールドクレスト	9,000	2,329.00	20,961,000	
エスリード	5,200	3,610.00	18,772,000	
日神グループホールディングス	18,200	517.00	9,409,400	
日本エスコン	24,000	981.00	23,544,000	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	49,600	499.00	24,750,400	
ＡＶＡＮＴＩＡ	4,600	899.00	4,135,400	
イオンモール	56,200	1,811.50	101,806,300	
毎日コムネット	3,300	782.00	2,580,600	
ファースト住建	3,300	1,110.00	3,663,000	
カチタス	29,200	1,790.00	52,268,000	
トーセイ	18,200	2,228.00	40,549,600	
穴吹興産	1,700	2,107.00	3,581,900	
サンフロンティア不動産	16,300	1,813.00	29,551,900	
ＦＪネクストホールディングス	11,800	1,200.00	14,160,000	
インテリックス	1,800	558.00	1,004,400	
ランドビジネス	2,600	269.00	699,400	
サンネクスタグループ	2,600	958.00	2,490,800	
グランディハウス	7,300	648.00	4,730,400	
日本空港ビルデング	38,200	6,064.00	231,644,800	
明豊ファシリティワークス	4,000	864.00	3,456,000	
ＬＩＦＵＬＬ	39,600	198.00	7,840,800	
ＭＩＸＩ	24,300	2,533.00	61,551,900	
ジェイエイシーリクルートメント	40,800	666.00	27,172,800	
日本M&Aセンターホールディングス	179,800	769.70	138,392,060	
メンバーズ	4,000	1,010.00	4,040,000	
中広	1,500	416.00	624,000	

ＵＴグループ	14,900	2,239.00	33,361,100	
アイティメディア	4,500	1,040.00	4,680,000	
ケアネット	17,500	847.00	14,822,500	
Ｅ・Ｊホールディングス	6,700	1,721.00	11,530,700	
オープンアップグループ	33,900	2,215.00	75,088,500	
コシダカホールディングス	33,900	1,034.00	35,052,600	
アルトナー	1,900	2,309.00	4,387,100	
パソナグループ	13,800	2,691.00	37,135,800	
ＣＤＳ	2,000	1,704.00	3,408,000	
リンクアンドモチベーション	32,400	553.00	17,917,200	
エス・エム・エス	39,600	2,560.00	101,376,000	
サニーサイドアップグループ	2,500	575.00	1,437,500	
パーソルホールディングス	1,148,000	233.50	268,058,000	
リニカル	4,500	528.00	2,376,000	
クックパッド	32,500	114.00	3,705,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	4,000	712.00	2,848,000	
学情	5,800	1,780.00	10,324,000	
スタジオアリス	5,700	2,073.00	11,816,100	
エプコ	2,300	960.00	2,208,000	
ＮＪＳ	2,500	2,780.00	6,950,000	
綜合警備保障	188,500	817.50	154,098,750	
カカクコム	74,500	1,720.50	128,177,250	
アイロムグループ	4,500	2,063.00	9,283,500	
セントケア・ホールディング	7,700	1,006.00	7,746,200	
サイネックス	1,600	867.00	1,387,200	
ルネサンス	8,500	923.00	7,845,500	
ディップ	17,300	2,522.00	43,630,600	
デジタルホールディングス	6,000	1,216.00	7,296,000	
新日本科学	10,400	1,667.00	17,336,800	
キャリアデザインセンター	1,700	2,091.00	3,554,700	
ベネフィット・ワン	39,300	2,130.00	83,709,000	
エムスリー	222,800	2,369.00	527,813,200	
ツカダ・グローバルホールディング	4,800	383.00	1,838,400	
アウトソーシング	72,500	1,737.00	125,932,500	
ウェルネット	6,100	566.00	3,452,600	
ワールドホールディングス	5,100	2,943.00	15,009,300	
ディー・エヌ・エー	40,200	1,509.50	60,681,900	
博報堂ＤＹホールディングス	143,900	1,125.50	161,959,450	
ぐるなび	21,700	272.00	5,902,400	
タカミヤ	15,700	493.00	7,740,100	
ファンコミュニケーションズ	16,200	405.00	6,561,000	
ライク	4,300	1,513.00	6,505,900	

Ａｏｂａ－ＢＢＴ	3,300	409.00	1,349,700	
エスプール	32,900	325.00	10,692,500	
ＷＤＢホールディングス	5,800	2,288.00	13,270,400	
ティア	4,800	470.00	2,256,000	
ＣＤＧ	1,000	1,207.00	1,207,000	
アドウェイズ	15,900	527.00	8,379,300	
バリューコマース	10,000	1,533.00	15,330,000	
インフォマート	117,400	405.00	47,547,000	
ＪＰホールディングス	32,900	449.00	14,772,100	
エコナックホールディングス	7,700	134.00	1,031,800	
ＣＬホールディングス	2,900	893.00	2,589,700	
プレステージ・インターナショナル	50,700	597.00	30,267,900	
アミューズ	6,400	1,548.00	9,907,200	
ドリームインキュベータ	3,800	3,275.00	12,445,000	
クイック	7,900	2,525.00	19,947,500	
ＴＡＣ	4,600	198.00	910,800	
電通グループ	110,800	3,935.00	435,998,000	
イオンファンタジー	4,100	2,577.00	10,565,700	
シーティーエス	13,500	705.00	9,517,500	
ＮＥＸＹＺ．Ｇｒｏｕｐ	2,600	711.00	1,848,600	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	33,100	2,740.00	90,694,000	
アルプス技研	10,800	2,758.00	29,786,400	
日本空調サービス	12,300	828.00	10,184,400	
オリエンタルランド	596,400	5,593.00	3,335,665,200	
ダスキン	25,100	3,433.00	86,168,300	
明光ネットワークジャパン	13,900	726.00	10,091,400	
ファルコホールディングス	5,200	2,186.00	11,367,200	
ラウンドワン	106,400	665.00	70,756,000	
リゾートトラスト	49,000	2,546.00	124,754,000	
ビー・エム・エル	13,900	2,912.00	40,476,800	
リソー教育	58,500	243.00	14,215,500	
早稲田アカデミー	6,400	1,721.00	11,014,400	
ユー・エス・エス	126,500	2,885.00	364,952,500	
東京個別指導学院	13,800	449.00	6,196,200	
サイバーエージェント	249,200	933.80	232,702,960	
楽天グループ	965,600	658.60	635,944,160	
クリーク・アンド・リバー社	5,800	2,000.00	11,600,000	
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	21,500	625.00	13,437,500	
テー・オー・ダブリュー	22,700	328.00	7,445,600	
山田コンサルティンググループ	5,800	1,733.00	10,051,400	
セントラルスポーツ	4,300	2,507.00	10,780,100	
フルキャストホールディングス	10,900	1,773.00	19,325,700	

エン・ジャパン	18,400	2,594.00	47,729,600	
リソルホールディングス	700	6,110.00	4,277,000	
テクノプロ・ホールディングス	66,600	3,518.00	234,298,800	
アトラグループ	2,200	189.00	415,800	
アイ・アールジャパンホールディングス	6,000	1,591.00	9,546,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	7,000	6,630.00	46,410,000	
ファーストロジック	2,400	536.00	1,286,400	
三機サービス	1,300	1,325.00	1,722,500	
Ｇｕｎｏｓｙ	9,300	708.00	6,584,400	
デザインワン・ジャパン	3,000	130.00	390,000	
イー・ガーディアン	4,400	1,579.00	6,947,600	
リブセンス	4,200	253.00	1,062,600	
ジャパンマテリアル	34,600	2,585.00	89,441,000	
ベクトル	14,000	1,186.00	16,604,000	
ウチヤマホールディングス	3,800	383.00	1,455,400	
チャーム・ケア・コーポレーション	9,600	1,207.00	11,587,200	
キャリアリンク	4,200	2,549.00	10,705,800	
ＩＢＪ	8,900	724.00	6,443,600	
アサンテ	5,700	1,695.00	9,661,500	
バリューＨＲ	10,000	1,480.00	14,800,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	9,200	2,387.00	21,960,400	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,400	1,031.00	4,536,400	
ＥＲＩホールディングス	2,000	1,768.00	3,536,000	
アビスト	1,200	3,105.00	3,726,000	
シグマクシス・ホールディングス	15,300	1,377.00	21,068,100	
ウィルグループ	9,600	1,199.00	11,510,400	
エスクロー・エージェント・ジャパン	9,300	141.00	1,311,300	
メドピア	10,200	708.00	7,221,600	
レアジョブ	1,600	882.00	1,411,200	
リクルートホールディングス	834,300	6,149.00	5,130,110,700	
エラン	15,100	1,049.00	15,839,900	
土木管理総合試験所	4,100	331.00	1,357,100	
日本郵政	1,324,300	1,391.50	1,842,763,450	
ベルシステム２４ホールディングス	12,200	1,830.00	22,326,000	
鎌倉新書	10,000	620.00	6,200,000	
ＳＭＮ	2,300	292.00	671,600	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	1,700	651.00	1,106,700	
エアトリ	8,400	1,843.00	15,481,200	
アトラエ	6,900	676.00	4,664,400	
ストライク	4,800	4,350.00	20,880,000	
ソラスト	31,400	585.00	18,369,000	
セラク	3,600	1,189.00	4,280,400	

インソース	24,700	798.00	19,710,600	
ベイカレント・コンサルティング	82,900	3,674.00	304,574,600	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,600	1,014.00	2,636,400	
アイモバイル	15,500	445.00	6,897,500	
キャリアインデックス	3,200	209.00	668,800	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	3,800	1,249.00	4,746,200	
船場	1,800	860.00	1,548,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	36,600	2,170.00	79,422,000	
フルテック	1,200	1,157.00	1,388,400	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	2,900	329.00	954,100	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	1,200	609.00	730,800	
ウェルビー	8,600	847.00	7,284,200	
エル・ティー・エス	1,400	2,920.00	4,088,000	
ミダックホールディングス	6,900	2,033.00	14,027,700	
キュービーネットホールディングス	5,500	1,505.00	8,277,500	
ＲＰＡホールディングス	15,900	251.00	3,990,900	
スプリックス	2,400	833.00	1,999,200	
マネジメントソリューションズ	4,900	3,095.00	15,165,500	
プロレド・パートナーズ	3,300	373.00	1,230,900	
テノ．ホールディングス	1,200	509.00	610,800	
フロンティア・マネジメント	3,000	1,576.00	4,728,000	
コプロ・ホールディングス	2,600	1,618.00	4,206,800	
ギークス	1,300	508.00	660,400	
アンビスホールディングス	12,100	2,704.00	32,718,400	
カーブスホールディングス	31,100	727.00	22,609,700	
フォーラムエンジニアリング	14,700	824.00	12,112,800	
Ｆａｓｔ　Ｆｉｔｎｅｓｓ　Ｊａｐａｎ	4,000	1,120.00	4,480,000	
ダイレクトマーケティングミックス	12,000	451.00	5,412,000	
ポピンズ	1,800	1,151.00	2,071,800	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	8,900	1,876.00	16,696,400	
コンフィデンス・インターワークス	500	1,534.00	767,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	3,800	471.00	1,789,800	
リログループ	56,600	1,567.50	88,720,500	
東祥	8,100	881.00	7,136,100	
ＩＤ&Ｅホールディングス	6,900	3,505.00	24,184,500	
ビーウィズ	3,000	1,923.00	5,769,000	
ＴＲＥホールディングス	21,800	1,225.00	26,705,000	
人・夢・技術グループ	4,400	1,808.00	7,955,200	
ＮＩＳＳＯホールディングス	10,000	843.00	8,430,000	
大栄環境	20,600	2,561.00	52,756,600	
日本管財ホールディングス	11,900	2,634.00	31,344,600	
M&A総研ホールディングス	5,400	4,630.00	25,002,000	

エイチ・アイ・エス	32,800	1,812.00	59,433,600	
ラックランド	5,200	2,547.00	13,244,400	
共立メンテナンス	17,700	6,094.00	107,863,800	
イチネンホールディングス	12,100	1,597.00	19,323,700	
建設技術研究所	5,800	6,080.00	35,264,000	
スペース	8,300	953.00	7,909,900	
燦ホールディングス	10,100	1,124.00	11,352,400	
スバル興業	600	15,900.00	9,540,000	
東京テアトル	2,800	1,122.00	3,141,600	
タナベコンサルティンググループ	3,200	1,066.00	3,411,200	
ナガワ	3,100	7,600.00	23,560,000	
東京都競馬	9,500	4,745.00	45,077,500	
カナモト	17,500	2,913.00	50,977,500	
ニシオホールディングス	10,500	4,100.00	43,050,000	
トランス・コスモス	14,100	3,130.00	44,133,000	
乃村工藝社	49,400	872.00	43,076,800	
藤田観光	5,000	6,390.00	31,950,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	6,700	1,351.00	9,051,700	
トーカイ	10,100	2,123.00	21,442,300	
セコム	114,800	11,130.00	1,277,724,000	
セントラル警備保障	6,200	2,547.00	15,791,400	
丹青社	22,100	878.00	19,403,800	
メイテックグループホールディングス	40,700	2,928.00	119,169,600	
応用地質	10,600	2,178.00	23,086,800	
船井総研ホールディングス	23,500	2,596.00	61,006,000	
進学会ホールディングス	3,100	255.00	790,500	
オオバ	4,900	1,015.00	4,973,500	
いであ	2,100	1,768.00	3,712,800	
学究社	4,600	2,080.00	9,568,000	
ベネッセホールディングス	37,900	2,630.00	99,677,000	
イオンディライト	12,500	3,665.00	45,812,500	
ナック	5,100	1,064.00	5,426,400	
ダイセキ	23,000	4,440.00	102,120,000	
ステップ	4,200	1,969.00	8,269,800	
合　計	168,541,000		395,768,237,970	

(2)株式以外の有価証券

種類	銘　柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
新株予約権証券	株式会社ジャパンインベストメントアドバイザー第４回新株予約権	8,900	4,209,700	
合計		8,900	4,209,700	

(注)券面総額欄の数値は、証券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

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】

【日本株式インデックスファンド】

【純資産額計算書】

（2024年 2月29日現在）

Ⅰ　資産総額	1,844,790,285円
Ⅱ　負債総額	2,432,402円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,842,357,883円
Ⅳ　発行済口数	674,240,764口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7325円
（1万口当たり純資産額）	（27,325円）

（参考）

日本株式マザーファンド

純資産額計算書

（2024年 2月29日現在）

Ⅰ　資産総額	419,389,821,324円
Ⅱ　負債総額	385,265,466円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	419,004,555,858円
Ⅳ　発行済口数	131,342,357,471口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.1902円
（1万口当たり純資産額）	（31,902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。

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤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ます。）に支払います。

⑥質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1)資本金の額（2024年 2月29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年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

会社に取締役（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、監査等委員以外の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発します。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。

②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

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。

［DO（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－DO－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2024年 4月22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。

2024年 2月29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	536	14,901,081
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	64	218,348
単位型公社債投資信託	51	174,969
合計	651	15,294,398

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。

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57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、財務諸表及び中間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、第37期事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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。
また、第38期事業年度の中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間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 (2022年3月31日)		当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		21,675		23,067
金銭の信託		14,913		14,693
前払費用		166		198
未収委託者報酬		9,067		9,147
未収運用受託報酬		6,252		5,815
未収収益		179		176
短期差入証拠金		2,528		3,541
その他		2,363		1,566
流動資産合計		57,146		58,207
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	289	※1	255
器具備品	※1	687	※1	560
有形固定資産合計		976		816
無形固定資産				
ソフトウェア		6,292		7,203
その他		31		40
無形固定資産合計		6,324		7,244
投資その他の資産				
投資有価証券		6,607		4,063
関係会社株式		5,636		5,636
繰延税金資産		907		1,181
その他		31		31
投資その他の資産合計		13,182		10,911
固定資産合計		20,482		18,972
資産合計		77,629		77,179

（単位：百万円）

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	47	49

未払金	8,285	7,174
未払収益分配金	0	0
未払手数料	4,561	4,586
その他未払金	3,723	2,588
未払費用	1,049	1,089
未払法人税等	504	726
賞与引当金	578	613
その他	1,958	303
流動負債合計	12,423	9,958
固定負債		
退職給付引当金	820	904
資産除去債務	153	153
その他	12	27
固定負債合計	986	1,086
負債合計	13,410	11,044
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	41,948	44,755
利益剰余金合計	44,548	47,355
株主資本合計	63,788	66,595
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	941	49
繰延ヘッジ損益	△509	△510
評価・換算差額等合計	431	△460
純資産合計	64,219	66,134
負債・純資産合計	77,629	77,179

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）	当事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	41,730	40,724
運用受託報酬	11,883	10,918

その他営業収益	390	351
営業収益合計	54,004	51,993
営業費用		
支払手数料	20,567	20,123
広告宣伝費	286	307
公告費	―	2
調査費	5,567	5,309
調査費	1,062	1,104
委託調査費	4,487	4,191
図書費	17	13
営業雑経費	5,201	5,842
通信費	68	77
印刷費	454	419
協会費	55	58
諸会費	35	38
情報機器関連費	4,473	5,153
その他営業雑経費	112	94
営業費用合計	31,622	31,585
一般管理費		
給料	6,295	6,451
役員報酬	249	318
給料・手当	5,072	5,144
賞与	972	987
退職給付費用	254	252
福利費	632	671
交際費	3	7
旅費交通費	20	122
租税公課	327	289
不動産賃借料	323	327
寄付金	5	―
減価償却費	989	1,698
業務委託費	1,081	1,277
諸経費	1,301	1,454
一般管理費合計	11,234	12,553
営業利益	11,147	7,854

（単位：百万円）

	前事業年度 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）	当事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）
営業外収益		
受取利息	2	57
収益分配金	16	4
投資有価証券売却益	0	738
投資有価証券償還益	219	121
デリバティブ利益	―	565
その他	8	11

営業外収益合計	247	1,499
営業外費用		
金銭の信託運用損	332	158
投資有価証券売却損	0	16
為替差損	291	1,227
デリバティブ費用	1,191	－
その他	33	32
営業外費用合計	1,848	1,435
経常利益	9,545	7,918
特別損失		
退職給付費用	120	－
特別損失合計	120	－
税引前当期純利益	9,425	7,918
法人税、住民税及び事業税	3,403	2,350
法人税等調整額	△465	119
法人税等合計	2,937	2,470
当期純利益	6,487	5,448

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2021年4月1日　至　2022年3月31日）

（単位：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	500	2,100	38,258	40,858	60,098
当期変動額					
剰余金の配当			△2,797	△2,797	△2,797
当期純利益			6,487	6,487	6,487
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	－	－	3,689	3,689	3,689
当期末残高	500	2,100	41,948	44,548	63,788

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	791	△65	726	60,824
当期変動額				
剰余金の配当				△2,797
当期純利益				6,487
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	149	△444	△295	△295
当期変動額合計	149	△444	△295	3,394
当期末残高	941	△509	431	64,219

当事業年度（自　2022年4月1日　至　2023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	500	2,100	41,948	44,548	63,788
当期変動額					
剰余金の配当			△2,641	△2,641	△2,641
当期純利益			5,448	5,448	5,448
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）					
当期変動額合計	－	－	2,807	2,807	2,807
当期末残高	500	2,100	44,755	47,355	66,595

	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	941	△509	431	64,219
当期変動額				
剰余金の配当				△2,641
当期純利益				5,448
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△891	△0	△891	△891
当期変動額合計	△891	△0	△891	1,915
当期末残高	49	△510	△460	66,134

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．グループ通算制度の適用
グループ通算制度を適用しております。

（会計方針の変更）
「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用
「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号　2021年6月17日。以下、「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することといたしました。これによる財務諸表への影響はありません。
なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-3項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

（表示方法の変更）
（貸借対照表関係）
前事業年度において、「流動資産」の「その他」に含めていた「短期差入証拠金」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。
この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「その他」に表示していた4,891百万円は、「短期差入証拠金」2,528百万円、「その他」2,363百万円として組み替えております。

（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 （2022年3月31日）		当事業年度 （2023年3月31日）	
建　　物	146	百万円	184	百万円
器具備品	535	〃	681	〃
計	681	〃	866	〃

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2021年4月1日　至 2022年3月31日）

1．発行済株式に関する事項

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

2．自己株式に関する事項
該当事項はありません。

3.配当に関する事項
(1) 配当金支払額

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

(2) 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
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

当事業年度（自 2022年4月1日　至 2023年3月31日）

１．発行済株式に関する事項

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

２．自己株式に関する事項
該当事項はありません。

３.配当に関する事項
（1）配当金支払額

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
2022年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,641	880,447	2022年3月31日	2022年6月24日

（2）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
2023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
2023年6月22日 定時株主総会	普通株式	3,367	利益剰余金	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

（リース取引関係）

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、自社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。

①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。

②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。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払い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。

（4）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。

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 2021年6月17日）第24-16 項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、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順位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（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
資産計	－	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。

当事業年度（2023年3月31日）

区　分	貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,029	12,703	－	13,733
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	－	3,844	－	3,844
資産計	1,029	16,547	－	17,577
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	(10)	(48)	－	(58)
ヘッジ会計が適用されているもの	－	(88)	－	(88)
デリバティブ取引計	(10)	(136)	－	(147)

(*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) 金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額は960百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の貸借対照表計上額は14,693百万円であります。
(*3) 投資有価証券のうち、組合出資金等（貸借対照表計上額218百万円）は上記に含めておりません。
(*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、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。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。

投資有価証券
私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、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 （2022年3月31日）	当事業年度 （2023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（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

当事業年度（2023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	23,067	―	―	―
未収委託者報酬	9,147	―	―	―
未収運用受託報酬	5,815	―	―	―
投資有価証券 投資信託	―	594	2,144	38

（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 （2022年3月31日）	当事業年度 （2023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（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

当事業年度（2023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	986	622	364
小計	986	622	364
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,857	3,150	△292
小計	2,857	3,150	△292
合計	3,844	3,772	71

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（2022年3月31日）	当事業年度（2023年3月31日）
非上場株式	0	0
組合出資金等	133	218

3．事業年度中に売却したその他有価証券
前事業年度（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

当事業年度（自　2022年4月1日　至　2023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	3,429	738	16

（デリバティブ取引関係）

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
前事業年度（2022年3月31日）

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	△54
	英ポンド	277	－	△1	△1
	カナダドル	111	－	△1	△1
	スイスフラン	139	－	△2	△2
	香港ドル	190	－	△1	△1
	ユーロ	676	－	△18	△18
	買建				
	ユーロ	21	－	0	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。

当事業年度（2023年3月31日）

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	5,923	－	△21	△21
	英ポンド	256	－	△6	△6
	カナダドル	109	－	△1	△1
	スイスフラン	163	－	△2	△2
	香港ドル	202	－	△0	△0
	ユーロ	651	－	△19	△19
	買建 米ドル	152	－	3	3
合計		7,458	－	△48	△48

（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
前事業年度（2022年3月31日）

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。

当事業年度（2023年3月31日）

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	12,195	－	△9	△9
	債券先物取引 売建	182	－	△0	△0
合計		12,378	－	△10	△10

（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
前事業年度（2022年3月31日）

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 米ドル	投資有価証券 関係会社株式	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

当事業年度（2023年3月31日）

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 米ドル 英ポンド スイスフラン 香港ドル ユーロ	投資有価証券 関係会社株式	1,729 3,228 20 83 21	－ － － － －	△6 △81 △0 △0 △0
合計			5,082	－	△88

（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。

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 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）	当事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）
退職給付債務の期首残高	626	820
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
数理計算上の差異の発生額	－	6
退職給付の支払額	△81	△57
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
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	820	911

（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 （2022年3月31日）	当事業年度 （2023年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	820	911
未認識数理計算上の差異	－	△6
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904
退職給付引当金	820	904
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	820	904

（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 （自　2021年4月1日 至　2022年3月31日）	当事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）
勤務費用	124	133
利息費用	2	3
簡便法で計算した退職給付費用	8	6
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	274	142

（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　2021年4月1日 至　2022年3月31日）	当事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）
割引率	0.4%	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100百万円、当事業年度109百万円であります。

（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 （2022年3月31日）		当事業年度 （2023年3月31日）	
繰延税金資産				
未払事業税	112	百万円	58	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	177	〃	187	〃
退職給付引当金損金算入限度超過額	251	〃	277	〃
税務上の収益認識差額	74	〃	―	〃
税務上の費用認識差額	439		412	
繰延ヘッジ損益	224	〃	225	〃
その他	76	〃	75	〃
繰延税金資産 合計	1,357	〃	1,236	〃
繰延税金負債				
有価証券評価差額	△415	〃	△21	〃
その他	△34	〃	△32	〃
繰延税金負債 合計	△450	〃	△54	〃
繰延税金資産の純額	907	〃	1,181	〃

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。

3．法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「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12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（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 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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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	9,887百万円

［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 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㈱	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
① 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。
② 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 2022年4月1日 至 2023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㈱	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	9,593	未収運用受託報酬	5,271
							投信販売代行手数料等	9,445	未払手数料	2,029

（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
① 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。

② 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（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）

当事業年度（2023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　2021年4月1日 至　2022年3月31日）	当事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）
1株当たり純資産額	21,406,512円22銭	22,044,962円63銭
1株当たり当期純利益金額	2,162,405円20銭	1,816,227円49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　2021年4月1日 至　2022年3月31日）	当事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）
当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株主に帰属しない金額	―	―
普通株式に係る当期純利益	6,487百万円	5,448百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

中間貸借対照表

（単位：百万円）

		第38期中間会計期間末 （2023年9月30日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		19,075
金銭の信託		16,243
未収委託者報酬		10,120
未収運用受託報酬		5,852
短期差入証拠金		4,241
その他		2,069
流動資産合計		57,601
固定資産		
有形固定資産	※1	727
無形固定資産		
ソフトウェア		7,456
その他		45
無形固定資産合計		7,502
投資その他の資産		
投資有価証券		4,409
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		1,136
その他		31
投資その他の資産合計		11,213
固定資産合計		19,443
資産合計		77,045

負債の部		
流動負債		
未払金		8,680
未払法人税等		441
賞与引当金		377
その他	※2	1,624
流動負債合計		11,124
固定負債		
退職給付引当金		932
資産除去債務		154
その他		35
固定負債合計		1,121
負債合計		12,246

（単位：百万円）

	第38期中間会計期間末 （2023年9月30日）
純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
その他資本剰余金	17,239
資本剰余金合計	17,239
利益剰余金	
利益準備金	500
その他利益剰余金	
別途積立金	2,100
繰越利益剰余金	43,700
利益剰余金合計	46,300
株主資本合計	65,540
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	164
繰延ヘッジ損益	△906
評価・換算差額等合計	△741
純資産合計	64,798
負債・純資産合計	77,045

中間損益計算書

（単位：百万円）

		第38期中間会計期間 （自　2023年4月1日 至　2023年9月30日）
営業収益		
委託者報酬		21,671
運用受託報酬		5,502
その他営業収益		178
営業収益合計		27,352
営業費用		16,664
一般管理費	※1	6,965

営業利益		3,722
営業外収益	※2	1,680
営業外費用	※3	2,074
経常利益		3,327
税引前中間純利益		3,327
法人税、住民税及び事業税		846
法人税等調整額		169
法人税等合計		1,015
中間純利益		2,312

中間株主資本等変動計算書
第38期中間会計期間（自 2023年4月1日　至 2023年9月30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
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）			
当中間期変動額合計	－	－	－
当中間期末残高	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	500	2,100	44,755	47,355	66,595
当中間期変動額					
剰余金の配当			△3,367	△3,367	△3,367
中間純利益			2,312	2,312	2,312
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	－	－	△1,055	△1,055	△1,055
当中間期末残高	500	2,100	43,700	46,300	65,540

	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	49	△510	△460	66,134
当中間期変動額				
剰余金の配当				△3,367
中間純利益				2,312
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	114	△395	△280	△280
当中間期変動額合計	114	△395	△280	△1,335
当中間期末残高	164	△906	△741	64,798

注記事項
（重要な会計方針）

第38期中間会計期間
（自　2023年4月1日
至　2023年9月30日）

１．資産の評価基準及び評価方法
(1) 有価証券
子会社株式
移動平均法による原価法によっております。
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
時価法によっております。

(3) 金銭の信託
時価法によっております。

２．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。

３．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中間会計期間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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については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、退職給付に係る当中間会計期間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。

４．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。

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、中間会計期間末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．ヘッジ会計の方法
(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。

７．グループ通算制度の適用
グループ通算制度を適用しております。

（表示方法の変更）

第38期中間会計期間 （自　2023年4月1日 至　2023年9月30日）
従来「無形固定資産」に含めていた「ソフトウェア」は、金額的重要性が増したため、当中間会計期間において独立掲記することとしました。

（中間貸借対照表関係）

第38期中間会計期間末 （2023年9月30日）
※1　有形固定資産の減価償却累計額　957百万円
※2　仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

（中間損益計算書関係）

第38期中間会計期間 （自　2023年4月1日 至　2023年9月30日）
※1　減価償却実施額 有形固定資産　91百万円 無形固定資産　972百万円
※2　営業外収益の主要項目 金銭の信託運用益　1,589百万円
※3　営業外費用の主要項目 デリバティブ費用　1,269百万円 為替差損　784百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第38期中間会計期間（自 2023年4月1日　至 2023年9月30日）

１．発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式 （株）	3,000	－	－	3,000

２．自己株式に関する事項

該当事項はありません。

３．配当に関する事項

（１）配当金支払額

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
2023年6月23日 定時株主総会	普通株式	3,367	1,122,459	2023年3月31日	2023年6月26日

（２）基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

（リース取引関係）

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）

第38期中間会計期間末（2023年9月30日）

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

中間貸借対照表計上額、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 2021年6月17日）第24-16 項を適用した組合出資金等及び、市場価格のない株式等は、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順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

（１）時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

区　分	中間貸借対照表計上額（百万円）（*1）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託(*2)	1,206	13,995	－	15,201
投資有価証券(*3)				
その他有価証券	－	4,137	－	4,137
資産計	1,206	18,133	－	19,339
デリバティブ取引(*4)				
株式関連取引	226	113	－	339
通貨関連取引	－	(134)	－	(134)
デリバティブ取引計	226	(20)	－	205

(*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)金銭の信託の信託財産のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額1,041百万円）は上記に含めておりません。組合出資金等も含めた金銭の信託の中間貸借対照表計上額は16,243百万円であります。
(*3)投資有価証券のうち、組合出資金等（中間貸借対照表計上額271百万円）は上記に含めておりません。
(*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）時価をもって中間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、短期差入証拠金、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、上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。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。

投資有価証券

私募投信等、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買戻請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限がない場合には基準価額等を時価としており、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。為替予約及びトータルリターンスワップの時価は、為替レートや金利や株価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中間貸借対照表計上額は次の通りであります。

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
投資有価証券	0
関係会社株式	5,636

（有価証券関係）
第38期中間会計期間末（2023年9月30日）
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中間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)

	中間貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

２．その他有価証券

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額	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	2,711	2,131	580
小計	2,711	2,131	580
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,426	1,769	△343
小計	1,426	1,769	△343
合計	4,137	3,900	237

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額0百万円）及び組合出資金等（中間貸借対照表計上額271百万円）は、市場価格のない株式等のため、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）
第38期中間会計期間（自　2023年4月1日　至　2023年9月30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)
店頭	為替予約取引 売建 米ドル 英ポンド カナダドル スイスフラン 香港ドル ユーロ	 5,944 267 126 176 214 719	 － － － － － －	 △76 △1 △1 △0 △2 △3	 △76 △1 △1 △0 △2 △3
合計		7,449	－	△84	△84

（注）上記取引の評価損益は中間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	9,373	－	226	226
店頭	トータルリターンスワップ取引 売建	3,866	－	113	113
合計		13,239	－	339	339

（注）上記取引の評価損益は中間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	デリバティブ取引 の種類等	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 米ドル 英ポンド スイスフラン 香港ドル ユーロ	 投資有価証券 関係会社株式	 1,935 3,612 22 90 51	 － － － － －	 △24 △23 △0 △1 △0
合計			5,713	－	△49

（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）

第38期中間会計期間（自　2023年4月1日　至　2023年9月30日）

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４．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中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後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］

第38期中間会計期間（自　2023年4月1日　至　2023年9月30日）

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］

第38期中間会計期間（自　2023年4月1日　至　2023年9月30日）

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中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

２．地域ごとの情報

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

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

3．主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	5,057百万円

［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］
第38期中間会計期間（自　2023年4月1日　至　2023年9月30日）
該当事項はありません。

［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］
第38期中間会計期間（自　2023年4月1日　至　2023年9月30日）
該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］
第38期中間会計期間（自　2023年4月1日　至　2023年9月30日）
該当事項はありません。

（１株当たり情報）

	第38期中間会計期間 （自　2023年4月1日 至　2023年9月30日）
1株当たり純資産額	21,599,648円64銭
1株当たり中間純利益	770,782円86銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。	

（注）1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第38期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）
中間純利益	2,312百万円
普通株主に帰属しない金額	―
普通株式に係る中間純利益	2,312百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株

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

2024年 4月22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

①名称　　：三井住友信託銀行株式会社

②資本金の額：342,037百万円（2023年3月末日現在）

③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） （2023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。
ソニー銀行株式会社	38,500	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
フィデリティ証券株式会社	11,757	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
東海東京証券株式会社	6,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

株式会社ＳＢＩ証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

２【関係業務の概要】

(1)受託会社

当ファンドの受託会社として、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

①名称　　：株式会社日本カストディ銀行
②設立年月日　：2000年6月20日
③資本金の額　：51,000百万円（2023年3月末日現在）
④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。
⑤再信託の目的：原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第３【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

①ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

②本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

③交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

④ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

⑤ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットやＳＮＳのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）、名称や利用上の注意事項等を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

(7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。

(8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。

(10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2023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2022年４月１日から2023年３月31日までの第37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2023年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
　その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。
　当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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

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

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

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

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

・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人

は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

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

２．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年4月3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　中島紀子

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」に掲げられている日本株式インデックスファンドの2023年1月24日から2024年1月22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、日本株式インデックスファンドの2024年1月22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、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。**

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

利害関係

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．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月１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　　田中洋一

中間監査意見
　当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年４月１日から2024年３月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（2023年４月１日から2023年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

　当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2023年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年４月１日から2023年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任
　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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

　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。

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

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

・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務

諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以　上

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

２．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。