

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2024年6月5日

【計算期間】 第8期 自 2023年3月7日 至 2024年3月5日

【ファンド名】 ステート・ストリート日本株式インデックス・オープン

【発行者名】 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役 新原 謙介

【本店の所在の場所】 東京都港区虎ノ門一丁目23番1号

【事務連絡者氏名】 久保 政喜

【連絡場所】 東京都港区虎ノ門一丁目23番1号

【電話番号】 03-4530-7297

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

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

当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	目論見書又は信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	株式	目論見書又は信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書又は信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般	年2回	日本		
大型株	年4回	北米		日経 225
中小型株				

債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州	ファミリーファンド	TOPIX
年12回 (毎月)	アジア オセアニア			
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))	その他 ()	アフリカ		その他
資産複合 資産配分固定型 資産配分変動型		中近東 (中東) エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

当ファンドが該当する属性区分

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

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

ファンドの特色

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

※資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

投資対象とするマザーファンドの概要

日本株式インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	日本の取引所に上場されている株式
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・TOPIX(東証株価指数、配当込み)をベンチマークとします。 ・株式の組入比率は、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。

ベンチマーク

TOPIX

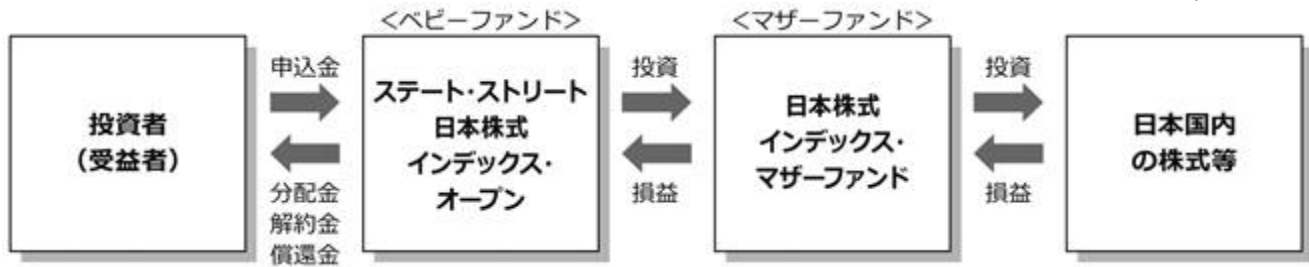
- ①TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」と言います。)の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利はJPXが有します。
- ②JPXは、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- ③JPXは、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
-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

(2)【ファンドの沿革】

2016年5月9日 信託契約締結、設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

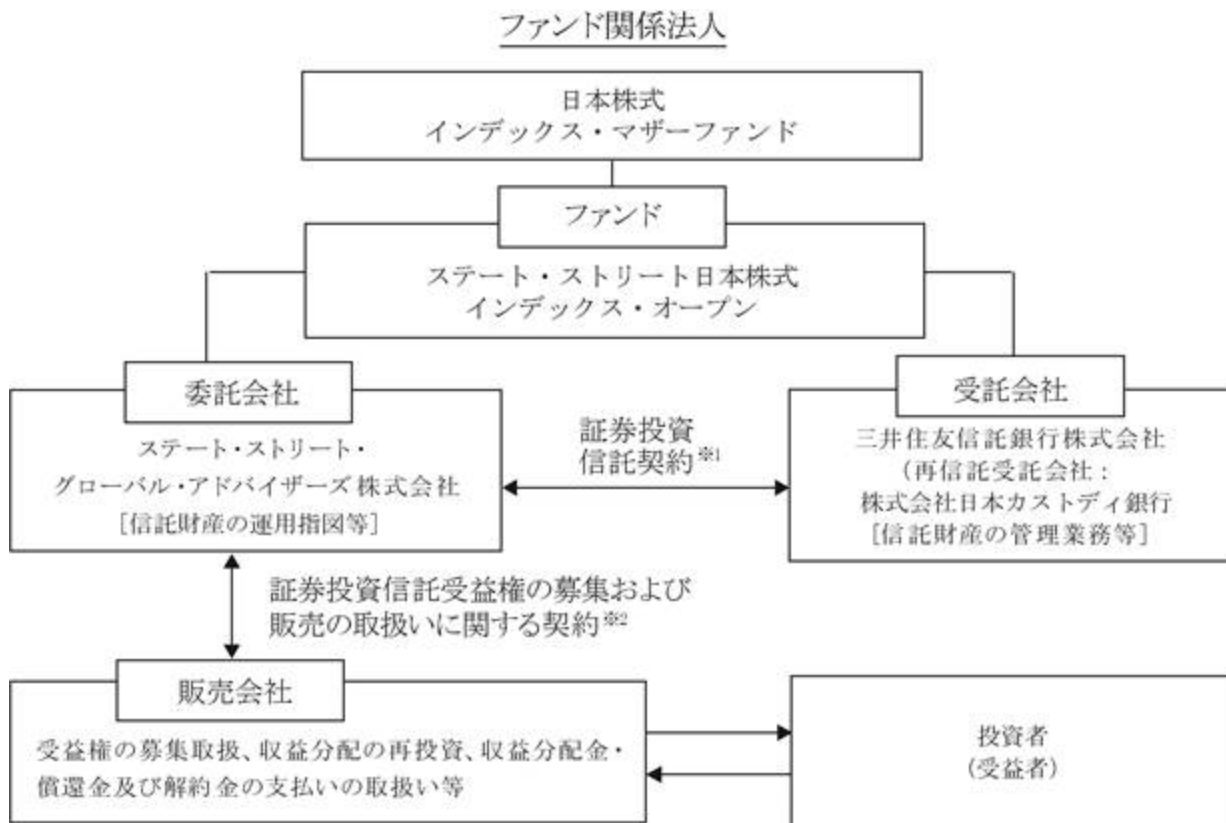
当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。「ファミリーファンド方式」とは、投資者からの資金をまとめてベビーファンド(当ファンド)とし、その資金をマザーファンドの受益証券に投資して、その実質的な運用を行う仕組みです。また、マザーファンドの損益はすべてベビーファンドに還元されます。



ファンドの関係法人

ファンドの関係法人は以下のとおりです。

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



1 証券投資信託契約

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

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

2 証券投資信託受益権の募集および販売の取扱いに関する契約

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

委託会社の概況（本書提出日現在）

1) 資本金の額

3億1千万円

2) 沿革

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

3) 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

投資状況に応じ、マザーファンドと同様の運用を直接行うことがあります。

TOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとします。

マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持するものとし、株式への実質的投資割合は、原則として信託財産総額の50%超（非株式割合は50%以下）を基本とします。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後記（5）の3)4)5)に定めるものに限ります。以下同じ。）を行うことができます。

信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。

信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。

信託財産の効率的な運用に資するため等、運用上必要と認めるときには、委託会社もしくは委託会社の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）が設定または運用する国内投資信託証券等に投資する場合があります。

大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が行われない場合や、当ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- (a) 為替手形

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

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

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。 以下同じ。)および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)から11)までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 14) 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 15) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 16) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 17) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 20) 外国の者に対する権利で19)の有価証券の性質を有するもの

21) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

22) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

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

委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品により運用することを指図することができます(信託約款第15条第2項)。

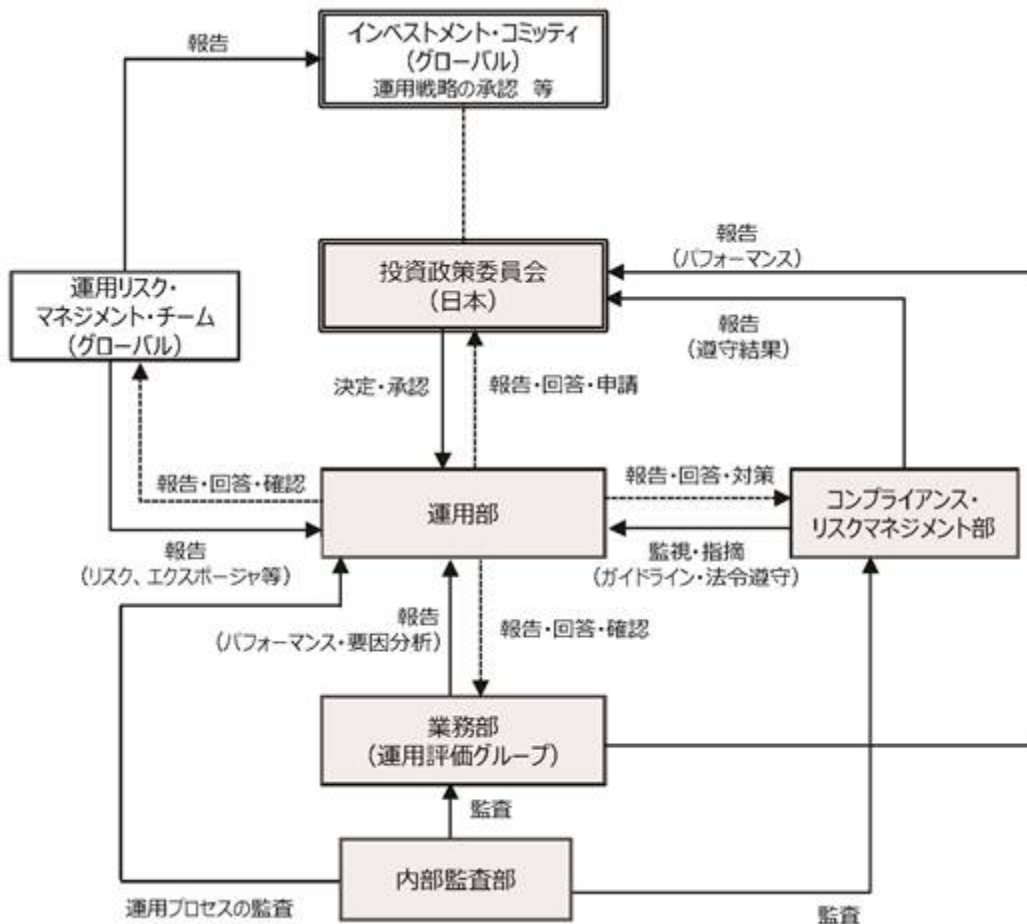
- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形

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

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

上記 において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。(信託約款第15条第5項)

(3) 【運用体制】



委託会社において、運用部の各ファンド担当者がそのポートフォリオ管理・運用を行っています。

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

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

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

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

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

上記運用体制は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

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

分配対象額の範囲

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

分配対象収益についての分配方針

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

留保益の運用方針

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

<分配金に関する留意事項>

- ・分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- ・分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

(5) 【投資制限】

信託約款の「運用の基本方針」に定める投資制限

- 1) マザーファンド受益証券の投資割合には制限を設けません。
- 2) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)の実質投資割合には制限を設けません。
- 3) 原則として、外貨建資産への実質投資は行いません(外貨建資産割合は0%)。
- 4) 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)の実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 5) デリバティブ取引は、後記の3)4)5)の範囲で行います。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

信託約款上のその他の投資制限

- 1) 投資する株式等の範囲(信託約款第18条)

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、または取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するもの(上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予

約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものを含みます。)とします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。

2) 信用取引の指図範囲(信託約款第19条)

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

3) 先物取引等の運用指図(信託約款第20条)

- (a) 財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)
- (b) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

4) スワップ取引の運用指図(信託約款第21条)

- (a) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- (b) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
- (c) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち当該信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少してスワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部解約を指図するものとします。

- (d) 上記(c)においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (e) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。
- (f) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 5) 金利先渡取引の運用指図(信託約款第22条)
- (a) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (b) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (c) 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。
- (d) 委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 6) デリバティブ取引等にかかる投資制限(信託約款第23条)
- 委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
- 7) 有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款第24条)
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券を貸付けることの指図をすることができます。
- (b) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- 8) 公社債の空売りの指図範囲(信託約款第25条)
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債(信託財産により借り入れた公社債を含みます。)の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (b) 上記(a)の売り付けの指図にあたっては、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- 9) 公社債の借入れ(信託約款第26条)
- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (b) 上記(a)の指図にあたっては、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (c) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(b)の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

(d) 上記(a)の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

1) 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

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

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

（参考）「日本株式インデックス・マザーファンド」の概要

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

（1）投資方針

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

日本の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

TOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとします。

株式の組入比率は、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）の指図をすることができます。

信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

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

信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する有価証券の貸付けを行うことができます。大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむをえない事情が発生した場合には、上記のような運用が行われない場合や、当ファンドの投資目的が達成されない場合があります。

（2）投資対象

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

投資の対象とする有価証券の指図範囲等

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12) 投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 13) 投資証券もしくは投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
- 15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 16) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
- 18) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形

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

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

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

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行いません。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

信用取引の指図は、信託約款第15条の範囲で行います。

有価証券先物取引等は、信託約款第16条の範囲で行います。

スワップ取引は、信託約款第17条の範囲で行います。

金利先渡取引は、信託約款第18条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク特性

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

したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

なお、投資信託は預貯金とは異なります。

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

株価変動リスク

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

信用リスク

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

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

流動性リスク

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

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

デリバティブ取引のリスク

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

パッシブ運用のリスク

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

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

きない場合、インデックスの投資成果に連動させるため、インデックス採用銘柄以外の銘柄に投資する場合があります。

ファミリーファンド方式のリスク

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

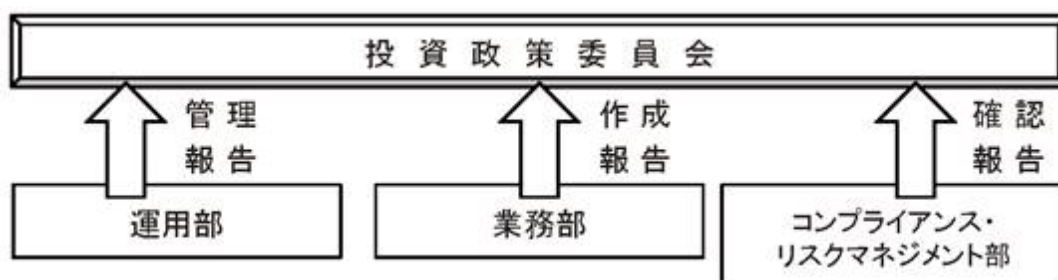
(2) その他の留意点

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

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

(3) リスク管理体制



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

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

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

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

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

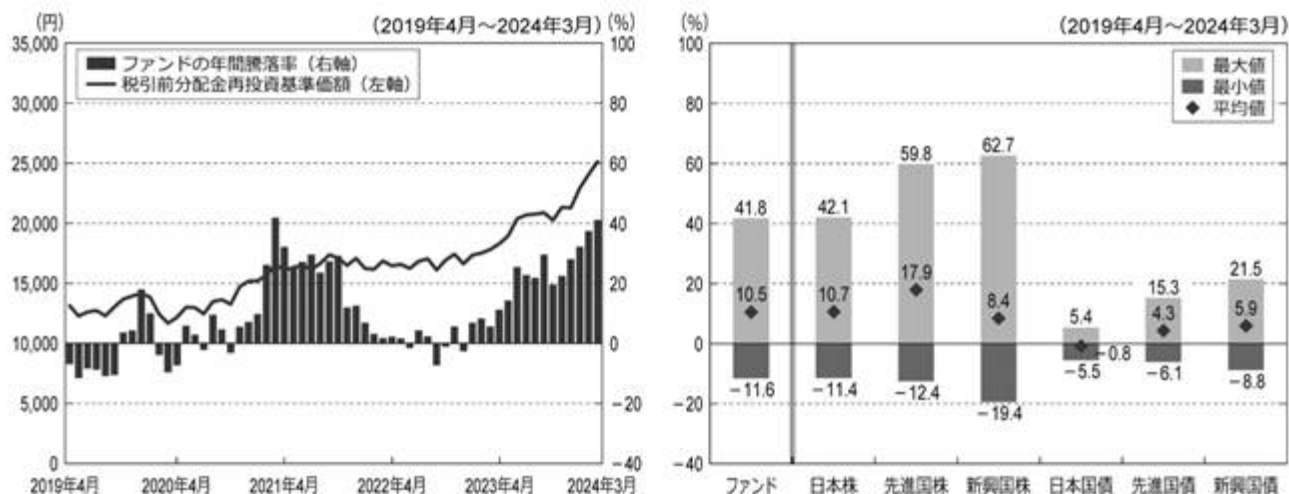
取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

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

＜参考情報＞代表的な資産クラスと騰落率の比較等

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

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



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

「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

日本株:TOPIX(東証株価指数、配当込み)

TOPIX(東証株価指数、配当込み)は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。

先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

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

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

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

日本国債:NOMURA-BPI国債

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

先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込手数料はありません。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

(3)【信託報酬等】

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

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

< 信託報酬率の配分（税抜） >

支払先	信託報酬率（年率）	役務の内容
委託会社	0.04%	委託した資金の運用、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	0.01%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	0.03%	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

消費税等相当額は、消費税および地方消費税に相当する金額です。

(4)【その他の手数料等】

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

信託財産に係る監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末（ただし、当日が休業日の場合は翌営業日とします。）または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

上記に定める信託事務の処理等に要する諸費用は、マザーファンドに関連して生じた諸費用のうちマザーファンドにおいて負担せずかつ委託会社の合理的判断によりこの信託に関連して生じたと認めるものを含みます。

ファンドの組入れ有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等は、信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料に対する消費税等相当額および先物取引、オプション取引等に要する費用についても信託財産が負担します。

信託財産において資金借入れを行った場合、当該借入金の利息は、信託財産中より支弁します。

上記のほか、信託約款の規定に基づく運用指図等により生じた費用をご負担いただく場合があります。その他の手数料等は、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することはできません。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われ、日本の居住者（法人を含みます。）である受益者については、以下のような取扱いとなります。なお、税制が改正された場合には、その内容が変更されることがあります。

個人、法人別の課税について

個人の投資者に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

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

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

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

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

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

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」について

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

法人の投資者に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

< 注1 > 個別元本について

投資者ごとの信託時の受益権の価額等が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

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

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

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

< 注2 > 収益分配金の課税について

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

投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

上記は、2024年3月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

（参考情報）ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

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

※対象期間は2023年3月7日～2024年3月5日です。

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

※その他費用とは監査費用や有価証券の保管費用等です。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧ください。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

(2024年3月29日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	15,424,966,706	100.00
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		761,721	0.00
純資産総額		15,425,728,427	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

<参考情報>

親投資信託受益証券(日本株式インデックス・マザーファンド)

(2024年3月29日現在)

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

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

(2024年3月29日現在)

順位	国/地域名	種類	銘柄名	業種	数量(口)	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックス・マザーファンド		2,969,537,715	5.0564	15,015,170,503	5.1944	15,424,966,706	100.00

(注1)投資有価証券は1銘柄です。

(注2)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

種類別及び業種別投資比率

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

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

【投資不動産物件】

該当する事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当する事項はありません。

<参考情報>

親投資信託受益証券(日本株式インデックス・マザーファンド)

投資有価証券の主要銘柄(上位30銘柄)

(2024年3月29日現在)

順位	国/地域名	種類	銘柄名	業種	数量(株)	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	801,200	3,729.00	2,987,674,800	3,792.00	3,038,150,400	5.14
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	875,100	1,596.50	1,397,097,150	1,557.00	1,362,530,700	2.30

3	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	103,200	12,950.00	1,336,440,000	12,985.00	1,340,052,000	2.27
4	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	30,900	39,450.00	1,219,005,000	39,570.00	1,222,713,000	2.07
5	日本	株式	三菱商事	卸売業	296,400	3,287.00	974,266,800	3,487.00	1,033,546,800	1.75
6	日本	株式	キーエンス	電気機器	14,600	74,880.00	1,093,248,000	69,540.00	1,015,284,000	1.72
7	日本	株式	日立製作所	電気機器	70,800	13,310.00	942,348,000	13,905.00	984,474,000	1.66
8	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	102,200	8,623.00	881,270,600	8,909.00	910,499,800	1.54
9	日本	株式	信越化学工業	化学	131,100	6,588.00	863,686,800	6,584.00	863,162,400	1.46
10	日本	株式	三井物産	卸売業	115,600	6,816.00	787,929,600	7,106.00	821,453,600	1.39
11	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4,352,500	180.70	786,496,750	179.80	782,579,500	1.32
12	日本	株式	任天堂	その他製品	92,100	8,390.00	772,719,000	8,196.00	754,851,600	1.28
13	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	111,000	6,299.00	699,189,000	6,707.00	744,477,000	1.26
14	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	103,800	6,666.00	691,930,800	6,466.00	671,170,800	1.13
15	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	142,000	4,408.00	625,936,000	4,703.00	667,826,000	1.13
16	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	345,700	1,798.50	621,741,450	1,891.00	653,718,700	1.11
17	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	72,200	9,008.00	650,377,600	8,962.00	647,056,400	1.09
18	日本	株式	第一三共	医薬品	127,500	4,945.00	630,487,500	4,777.00	609,067,500	1.03
19	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	193,900	2,878.00	558,044,200	3,046.00	590,619,400	1.00
20	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	129,500	4,343.00	562,418,500	4,184.00	541,828,000	0.92
21	日本	株式	HOYA	精密機器	28,700	19,855.00	569,838,500	18,740.00	537,838,000	0.91
22	日本	株式	KDDI	情報・通信業	113,100	4,506.00	509,628,600	4,482.00	506,914,200	0.86
23	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	235,600	1,953.00	460,126,800	1,951.00	459,655,600	0.78
24	日本	株式	三菱電機	電気機器	164,000	2,432.50	398,930,000	2,512.00	411,968,000	0.70
25	日本	株式	ディスコ	機械	7,100	53,450.00	379,495,000	57,190.00	406,049,000	0.69
26	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	79,400	5,276.00	418,914,400	4,849.00	385,010,600	0.65
27	日本	株式	村田製作所	電気機器	132,700	3,005.00	398,763,500	2,824.00	374,744,800	0.63
28	日本	株式	三菱重工業	機械	258,000	1,230.00	317,340,000	1,448.50	373,713,000	0.63
29	日本	株式	S M C	機械	4,400	91,220.00	401,368,000	84,830.00	373,252,000	0.63
30	日本	株式	ダイキン工業	機械	17,600	21,165.00	372,504,000	20,600.00	362,560,000	0.61

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

種類別及び業種別投資比率

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

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

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

投資不動産物件

該当する事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所等	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	TOPIX（先物） （2024年6月限）	大阪取引所	買建	68	1,866,252,620	1,883,600,000	3.18

（注1）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

（注2）先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

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

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

2024年3月29日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

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

第7期	(2023年 3月 6日)	分配付： 12,213,219,047 分配落： 12,213,219,047	分配付： 1.7869 分配落： 1.7869
第8期	(2024年 3月 5日)	分配付： 15,155,601,598 分配落： 15,155,601,598	分配付： 2.4426 分配落： 2.4426
	2023年 3月末日	11,938,185,900	1.7786
	4月末日	12,035,039,016	1.8264
	5月末日	12,200,724,327	1.8919
	6月末日	12,557,082,661	2.0346
	7月末日	13,516,462,332	2.0647
	8月末日	13,621,692,232	2.0731
	9月末日	13,551,482,380	2.0837
	10月末日	14,528,642,735	2.0209
	11月末日	15,089,419,012	2.1299
	12月末日	14,890,296,601	2.1249
	2024年 1月末日	12,197,700,578	2.2905
	2月末日	14,949,125,521	2.4029
	3月末日	15,425,728,427	2.5090

【分配の推移】

	計算期間	一口当たりの分配金
第1期	自2016年 5月 9日 至2017年 3月 6日	0.0020円
第2期	自2017年 3月 7日 至2018年 3月 5日	0.0000円
第3期	自2018年 3月 6日 至2019年 3月 5日	0.0000円
第4期	自2019年 3月 6日 至2020年 3月 5日	0.0000円
第5期	自2020年 3月 6日 至2021年 3月 5日	0.0000円
第6期	自2021年 3月 6日 至2022年 3月 7日	0.0000円
第7期	自2022年 3月 8日 至2023年 3月 6日	0.0000円
第8期	自2023年 3月 7日 至2024年 3月 5日	0.0000円

【収益率の推移】

	計算期間	収益率
第1期	自2016年 5月 9日 至2017年 3月 6日	20.1%
第2期	自2017年 3月 7日 至2018年 3月 5日	11.1%
第3期	自2018年 3月 6日 至2019年 3月 5日	2.5%
第4期	自2019年 3月 6日 至2020年 3月 5日	4.2%

第5期	自2020年 3月 6日 至2021年 3月 5日	27.9%
第6期	自2021年 3月 6日 至2022年 3月 7日	3.5%
第7期	自2022年 3月 8日 至2023年 3月 6日	16.4%
第8期	自2023年 3月 7日 至2024年 3月 5日	36.7%

（注）各計算期間中の分配金を加味して算出しています。

（４）【設定及び解約の実績】

	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第1期	自2016年 5月 9日 至2017年 3月 6日	1,097,585,702	165,710,844	931,874,858
第2期	自2017年 3月 7日 至2018年 3月 5日	2,989,270,154	921,318,659	2,999,826,353
第3期	自2018年 3月 6日 至2019年 3月 5日	2,748,295,843	1,635,702,002	4,112,420,194
第4期	自2019年 3月 6日 至2020年 3月 5日	2,803,938,166	1,925,883,127	4,990,475,233
第5期	自2020年 3月 6日 至2021年 3月 5日	4,249,133,906	3,403,409,841	5,836,199,298
第6期	自2021年 3月 6日 至2022年 3月 7日	5,432,894,442	3,026,587,716	8,242,506,024
第7期	自2022年 3月 8日 至2023年 3月 6日	2,307,955,686	3,715,667,036	6,834,794,674
第8期	自2023年 3月 7日 至2024年 3月 5日	3,426,684,132	4,056,680,728	6,204,798,078

（注１）日本国外における設定、解約はありません。

（注２）第１期の設定口数は、当初募集期間の設定口数を含みます。

(参考情報) 運用実績

(2024年3月29日現在)

基準価額・純資産の推移



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

＜基準価額・純資産総額＞

基準価額	25,090円
純資産総額	15,426百万円

分配の推移

決算期	分配金
第4期 (2020年3月5日)	0円
第5期 (2021年3月5日)	0円
第6期 (2022年3月7日)	0円
第7期 (2023年3月6日)	0円
第8期 (2024年3月5日)	0円
設定来累計	20円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

主要な資産の状況

(マザーファンドのデータを表示しています。)

＜銘柄別投資比率＞

国/地域名	種類	銘柄名	投資比率
1 日本	株式	トヨタ自動車	5.14%
2 日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	2.30%
3 日本	株式	ソニーグループ	2.27%
4 日本	株式	東京エレクトロン	2.07%
5 日本	株式	三菱商事	1.75%
6 日本	株式	キーエンス	1.72%
7 日本	株式	日立製作所	1.66%
8 日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	1.54%
9 日本	株式	信越化学工業	1.46%
10 日本	株式	三井物産	1.39%

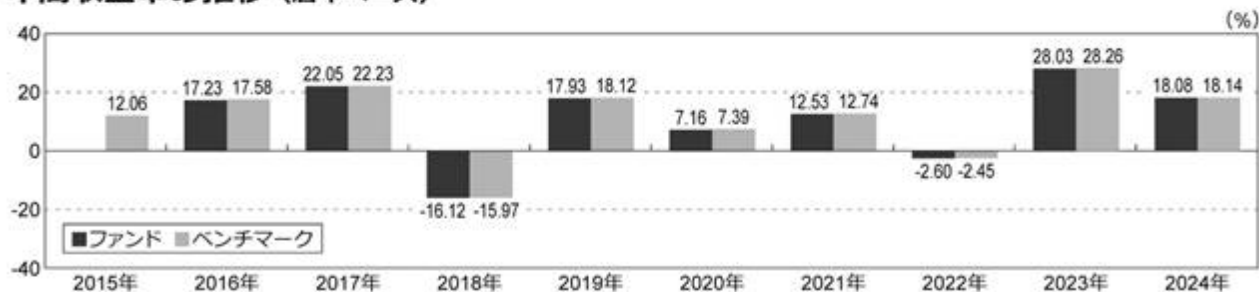
(注) 投資比率は、マザーファンド純資産総額に対する各評価金額の比率で、上位10銘柄について記載しています。

＜業種別投資比率＞

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

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

年間収益率の推移 (暦年ベース)



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

※2024年のファンドとベンチマークの年間収益率は年初から3月末までで算出しています。

※年間収益率の推移は、税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- 1) 当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社に所定の方法で取引口座を開設のうえ、当ファンドの取得申込みを行ってください。
- 2) 当ファンドには、「分配金再投資コース」と「分配金受取コース」があります。なお、取扱い可能なコースおよびコース名については異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。その際、「分配金再投資コース」をお申し込みいただく方は、ご購入に際して、当ファンドに係る「自動けいぞく投資契約」（別の名称で同様の内容を有する契約を含みます。）を販売会社との間で結んでいただきます。ただし、「分配金再投資コース」を申し込まれた場合でも、分配金を定期的に受け取る旨の契約を締結することもできます。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- 3) 当ファンドの取得申込みの申込締切時間は、原則として販売会社の営業日の午後3時までとし、この受付時刻を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、2024年11月5日より東京証券取引所の取引時間が午後3時30分までに変更される予定です。これにより、ファンドの申込締切時間が変更される場合があります。詳しくは販売会社にお問合せください。
- 4) 申込単位（購入単位）は、販売会社が定める単位にて受付けます。
- 5) 取得申込価額（購入価額）は、取得申込受付日の基準価額です。基準価額は、販売会社または委託会社においてご確認いただけます。基準価額の照会方法については、後記「3 資産管理等の概要（1）資産の評価 3）基準価額の公表」をご参照ください。
- 6) 取得申込代金（購入代金）は、購入価額に取得申込の口数を乗じて得た金額に申込手数料（購入時手数料）および当該手数料に係る消費税等相当額を加えた金額です。
- 7) 購入代金は販売会社が定める期日までにお支払いください。
- 8) 購入時手数料は前記「4 手数料等及び税金（1）申込手数料」をご参照ください。
- 9) 購入申込不可日はありません。
- 10) 取引所における取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更、クーデター等政変、テロリズム、戦争、天災地変等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）があるときは、委託会社の判断により、受益権の取得申込の受付を中止することおよび既に受付けた受益権の取得申込の受け取りを中止することがあります。
- 11) 当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社に取得申込と同時にまたはあらかじめ、当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。販売会社は、当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

2【換金（解約）手続等】

- 1) 受益者（当ファンドの受益権を取得した者）は、自己に帰属する受益権につき、取得申込みを行った販売会社を通じ、委託会社に一部解約の実行の請求を行うことにより、当ファンドを換金することができます。
- 2) 当ファンドの換金申込みの申込締切時間は、原則として販売会社の営業日の午後3時までとし、この受付時刻を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、2024年11月5日より東京証券取引所の取引時間が午後3時30分までに変更される予定です。これにより、ファンドの申込締切時間が変更される場合があります。詳しくは販売会社にお問合せください。
- 3) 解約単位（換金単位）は、販売会社が定める単位にて受付けます。
- 4) 解約価額（換金価額）は、換金申込受付日の基準価額です。換金価額は、販売会社または委託会社においてご確認いただけます。換金価額の照会方法については、後記「3 資産管理等の概要（1）資産の評価 3）基準価額の公表」をご参照ください。

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

1) 基準価額の算出方法

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

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

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

< 主要投資対象の評価方法 >

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

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

2) 基準価額の算出頻度

基準価額は原則として委託会社の営業日において日々算出されます。

3) 基準価額の公表

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

委託会社に対する照会は下記においてできます。

<照会先>

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03 - 4530 - 7333

(受付時間：原則として委託会社の営業日午前9時～午後5時)

ホームページアドレス：www.ssga.com/jp

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

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

(5) 【その他】

1) 信託契約の解約

- (a) 委託会社は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することによりこの信託の受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合または下回ることが明らかとなった場合、もしくはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- (b) 委託会社は、上記(a)の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドに係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- (c) 上記(b)の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本(c)において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (d) 上記(b)の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行います。
- (e) 上記(b)から上記(d)までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記(b)から上記(d)までに規定するこの信託契約の解約の手続を行うことが困難な場合には適用しません。

2) 信託契約に関する監督官庁の命令

- (a) 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
 - (b) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後記 6) の規定にしたがいます。
- 3) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い
- (a) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。
 - (b) 上記 (a) の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、後記 6) の書面決議が否決となる場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- 4) 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い
- (a) 委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。
 - (b) 委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。
- 5) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い
- (a) 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、後記 6) の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとしします。
 - (b) 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- 6) 信託約款の変更等
- (a) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本 6) に定める以外の方法によって変更することができないものとしします。
 - (b) 委託会社は、上記 (a) の事項(信託約款の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合の事項にあってはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドに係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
 - (c) 上記 (b) の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本 (c) において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
 - (d) 上記 (b) の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の 3分の2 以上にあたる多数をもって行います。

- (e) 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- (f) 上記(b)から上記(e)までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (g) 上記(a)から上記(f)までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

7) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

8) 運用報告書の交付

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

- (a) 交付運用報告書は、知っている受益者に対して販売会社を通じて交付されます。
- (b) 運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページ（www.ssga.com/jp）に掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、販売会社を通じて交付されます。

9) 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

10) 関係法人との契約の更改に関する手続き等

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

4【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。

受益者の有する主な権利は次の通りです。

分配金請求権

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

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

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

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

償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後1ヶ月以内の委託会社の指定する日から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。

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

一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」の記載をご参照ください。

書面決議における議決権

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

帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間（2023年3月7日から2024年3月5日まで）の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ステート・ストリート日本株式インデックス・オープン

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 (2023年3月6日現在)	第8期 (2024年3月5日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	147,816	674,042
コール・ローン	25,384,408	38,368,288
親投資信託受益証券	12,212,521,157	15,154,759,427
未収入金	15,900,000	40,100,000
流動資産合計	12,253,953,381	15,233,901,757
資産合計	12,253,953,381	15,233,901,757
負債の部		
流動負債		
未払解約金	28,351,938	67,808,336
未払受託者報酬	2,063,734	2,349,266
未払委託者報酬	9,630,738	7,359,387
未払利息	67	103
その他未払費用	687,857	783,067
流動負債合計	40,734,334	78,300,159
負債合計	40,734,334	78,300,159
純資産の部		
元本等		
元本	6,834,794,674	6,204,798,078
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,378,424,373	8,950,803,520
（分配準備積立金）	1,599,149,632	4,003,710,910
元本等合計	12,213,219,047	15,155,601,598
純資産合計	12,213,219,047	15,155,601,598
負債純資産合計	12,253,953,381	15,233,901,757

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期	第8期
	自 2022年3月8日 至 2023年3月6日	自 2023年3月7日 至 2024年3月5日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,988,355,454	4,317,248,270
営業収益合計	1,988,355,454	4,317,248,270
営業費用		
支払利息	30,350	32,968
受託者報酬	4,317,298	4,415,101
委託者報酬	20,147,314	16,999,848
その他費用	1,439,279	1,471,942
営業費用合計	25,934,241	22,919,859
営業利益又は営業損失（ ）	1,962,421,213	4,294,328,411
経常利益又は経常損失（ ）	1,962,421,213	4,294,328,411
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,962,421,213	4,294,328,411
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	472,746,055	1,135,962,894
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	4,407,495,524	5,378,424,373
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,534,357,297	3,795,200,309
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	1,534,357,297	3,795,200,309
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,053,103,606	3,381,186,679
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	2,053,103,606	3,381,186,679
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,378,424,373	8,950,803,520

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

第7期 (2023年3月6日現在)	第8期 (2024年3月5日現在)
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	第7期 (2023年3月6日現在)	第8期 (2024年3月5日現在)
1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	8,242,506,024円 2,307,955,686円 3,715,667,036円	6,834,794,674円 3,426,684,132円 4,056,680,728円
2 受益権の総数	6,834,794,674口	6,204,798,078口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第7期 自 2022年3月8日 至 2023年3月6日	第8期 自 2023年3月7日 至 2024年3月5日
1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（307,509,309円）、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（563,827,927円）、収益調整金（3,779,274,741円）及び分配準備積立金（727,812,396円）より分配対象収益は5,378,424,373円（1万口当たり7,869円）ですが、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（295,241,581円）、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（2,863,123,936円）、収益調整金（4,947,092,610円）及び分配準備積立金（845,345,393円）より分配対象収益は8,950,803,520円（1万口当たり14,425円）ですが、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

--	--

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第7期 (2023年3月6日現在)	第8期 (2024年3月5日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
---------------------------	--	----

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	第7期 (2023年3月6日現在)	第8期 (2024年3月5日現在)
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額	当計算期間の損益に 含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,631,556,040	3,377,714,599
合 計	1,631,556,040	3,377,714,599

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

該当する事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第7期 (2023年3月6日現在)	第8期 (2024年3月5日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7869円 (17,869円)	2.4426円 (24,426円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託 受益証券	日本株式インデックス・マザー ファンド	2,997,084,827	15,154,759,427	
合 計		2,997,084,827	15,154,759,427	

(注) 親投資信託受益証券における券面総額は、証券数です。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当する事項はありません。

<参考>

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

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「日本株式インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

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

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
-------------------	---

2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

（2023年3月6日現在）	（2024年3月5日現在）
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。	同左

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（2023年3月6日現在）	（2024年3月5日現在）
1 期首元本額	25,300,275,343円	14,558,908,008円
期中追加設定元本額	1,657,681,729円	2,185,943,329円
期中一部解約元本額	12,399,049,064円	4,967,539,461円
元本の内訳		
ファンド名		
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	68,981,331円	53,886,760円
日本株式インデックス・ファンド（年金1）＜適格機関投資家限定＞	710,654,042円	666,372,134円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	2,898,566円	839,684円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	23,988,398円	13,040,589円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	95,561円	79,230円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	2,369,752円	785,686円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	4,168,214円	2,571,702円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	4,005,086,693円	3,164,567,945円
日本株式インデックス・ファンドVA1＜適格機関投資家限定＞	254,435,197円	256,396,367円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	2,111,954円	1,804,583円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	524,962,098円	343,219,708円

バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	435,713,404円	331,404,255円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	31,673,865円	21,356,478円
日本株式インデックス・ファンドM<適格機関投資家限定>	73,098,076円	71,318,276円
日本株式インデックス・ファンドS<適格機関投資家限定>	76,775,165円	74,782,260円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	94,542,489円	60,772,701円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	1,423,723,607円	1,082,086,300円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	193,801,129円	125,825,994円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	942,430,300円	675,613,760円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	31,132,700円	22,962,049円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	9,828,013円	7,219,369円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	14,088,522円	11,116,907円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	5,225,456円	3,485,215円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	339,407,323円	241,054,524円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	1,174,704円	773,576円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	2,163,323円	1,062,669円
日本株式インデックス・ファンドVA2<適格機関投資家限定>	41,848,936円	46,907,714円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	200,452,844円	145,603,727円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	879,179,744円	625,986,247円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド(ステイブル)年金<適格機関投資家限定>	68,530,913円	55,548,166円
フレックス資産配分戦略ファンド<適格機関投資家限定>	430,650,499円	403,673,754円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド(ステイブル)<適格機関投資家限定>	45,838,046円	52,570,779円
ステート・ストリート日本株式インデックス・オープン	3,308,102,272円	2,997,084,827円
ステート・ストリートTOPIXインデックス・オープン	円	534,288円
世界バランス40VA<適格機関投資家限定>	2,753,384円	1,814,418円

世界バランス60VA<適格機関投資家限定>	3,682,872円	1,544,249円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	194,223円	105,025円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	289,049,365円	203,220,820円
グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定>	10,430,102円	5,248,840円
グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定>	3,664,926円	3,070,301円
計	14,558,908,008円	11,777,311,876円
2 受益権の総数	14,558,908,008口	11,777,311,876口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

区分	(2023年3月6日現在)	(2024年3月5日現在)
----	---------------	---------------

1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありませ	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。	同左

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	(2023年3月6日現在)	(2024年3月5日現在)
	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	6,220,285,630	14,234,701,828
合計	6,220,285,630	14,234,701,828

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までを指しております。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

(単位：円)

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

(単位：円)

区 分	種 類	(2024年3月5日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX（先物）	1,997,260,000		1,999,480,000	2,220,000
	合 計	1,997,260,000		1,999,480,000	2,220,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
このような時価が発表されていない場合には、最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
5. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	(2023年3月6日現在)	(2024年3月5日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.6917円 (36,917円)	5.0565円 (50,565円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

銘 柄	株 数	評 価 額		備 考
		単 価 (円)	金 額 (円)	
極洋	800	3,530.00	2,824,000	
ニッスイ	20,700	937.80	19,412,460	
マル八二チロ	3,000	2,851.00	8,553,000	
雪国まいたけ	1,700	1,010.00	1,717,000	
カネコ種苗	800	1,401.00	1,120,800	
サカタのタネ	2,300	3,675.00	8,452,500	
ホクト	1,700	1,794.00	3,049,800	
ホクリヨウ	200	1,056.00	211,200	
ショーボンドホールディングス	2,800	6,182.00	17,309,600	
ミライト・ワン	6,800	1,862.00	12,661,600	
タマホーム	1,300	4,175.00	5,427,500	

サンヨーホームズ	100	762.00	76,200
日本アクア	500	1,014.00	507,000
ファーストコーポレーション	400	799.00	319,600
ベステラ	400	1,139.00	455,600
Robot Home	4,600	157.00	722,200
キャンディル	600	574.00	344,400
住石ホールディングス	2,100	4,165.00	8,746,500
日鉄鉱業	800	5,090.00	4,072,000
三井松島ホールディングス	1,100	3,215.00	3,536,500
INPEX	69,900	2,109.00	147,419,100
石油資源開発	2,400	6,020.00	14,448,000
K&Oエナジーグループ	1,000	2,390.00	2,390,000
ダイセキ環境ソリューション	300	980.00	294,000
第一カッター興業	700	1,489.00	1,042,300
明豊ファシリティワークス	400	897.00	358,800
安藤・間	12,000	1,227.00	14,724,000
東急建設	6,200	819.00	5,077,800
コムシスホールディングス	6,600	3,380.00	22,308,000
ピーアールホールディングス	3,700	375.00	1,387,500
高松コンストラクショングループ	1,500	2,896.00	4,344,000
東建コーポレーション	600	9,500.00	5,700,000
ソネック	200	931.00	186,200
ヤマウラ	1,000	1,521.00	1,521,000
オリエンタル白石	7,400	388.00	2,871,200
大成建設	13,600	5,090.00	69,224,000
大林組	51,900	1,757.00	91,188,300
清水建設	41,100	916.20	37,655,820
飛島建設	1,400	1,500.00	2,100,000
長谷工コーポレーション	13,300	1,848.00	24,578,400
松井建設	1,400	858.00	1,201,200
銭高組	100	4,200.00	420,000
鹿島建設	32,200	2,938.00	94,603,600
不動テトラ	1,100	2,232.00	2,455,200
大末建設	400	1,591.00	636,400
鉄建建設	1,000	2,461.00	2,461,000
西松建設	2,700	4,545.00	12,271,500
三井住友建設	11,100	421.00	4,673,100
大豊建設	500	3,200.00	1,600,000
佐田建設	600	723.00	433,800
ナカノフドー建設	800	683.00	546,400
奥村組	2,300	5,070.00	11,661,000
東鉄工業	1,900	3,000.00	5,700,000
イチケン	300	2,477.00	743,100
富士ピー・エス	400	454.00	181,600
浅沼組	1,100	4,335.00	4,768,500
戸田建設	19,600	994.20	19,486,320
熊谷組	2,400	3,890.00	9,336,000
北野建設	200	3,230.00	646,000

植木組	400	1,726.00	690,400
矢作建設工業	1,900	1,523.00	2,893,700
ピーエス三菱	2,100	1,048.00	2,200,800
日本ハウスホールディングス	3,400	312.00	1,060,800
大東建託	5,400	17,480.00	94,392,000
新日本建設	2,300	1,408.00	3,238,400
東亜道路工業	600	6,500.00	3,900,000
日本道路	1,500	2,013.00	3,019,500
東亜建設工業	1,100	5,030.00	5,533,000
日本国土開発	4,400	522.00	2,296,800
若築建設	500	3,315.00	1,657,500
東洋建設	3,800	1,401.00	5,323,800
五洋建設	20,500	773.60	15,858,800
世紀東急工業	2,000	1,918.00	3,836,000
福田組	600	5,340.00	3,204,000
日本ドライケミカル	300	2,623.00	786,900
住友林業	12,500	4,267.00	53,337,500
日本基礎技術	800	490.00	392,000
巴コーポレーション	1,500	657.00	985,500
大和ハウス工業	40,200	4,344.00	174,628,800
ライト工業	2,900	1,868.00	5,417,200
積水ハウス	44,100	3,375.00	148,837,500
日特建設	1,300	1,159.00	1,506,700
北陸電気工事	900	1,183.00	1,064,700
ユアテック	3,400	1,329.00	4,518,600
日本リーテック	1,300	1,242.00	1,614,600
四電工	700	4,015.00	2,810,500
中電工	2,200	2,900.00	6,380,000
関電工	9,000	1,749.00	15,741,000
きんでん	10,200	2,576.50	26,280,300
東京エネシス	1,700	1,116.00	1,897,200
トーエネック	500	5,070.00	2,535,000
住友電設	1,400	3,140.00	4,396,000
日本電設工業	2,700	1,992.00	5,378,400
エクシオグループ	7,100	3,178.00	22,563,800
新日本空調	800	2,919.00	2,335,200
九電工	3,100	5,721.00	17,735,100
三機工業	3,100	1,987.00	6,159,700
日揮ホールディングス	14,300	1,383.50	19,784,050
中外炉工業	400	2,988.00	1,195,200
ヤマト	800	962.00	769,600
太平電業	900	4,360.00	3,924,000
高砂熱学工業	3,900	4,345.00	16,945,500
三晃金属工業	100	5,060.00	506,000
NEC ネットズエスアイ	5,700	2,606.00	14,854,200
朝日工業社	600	3,065.00	1,839,000
明星工業	2,600	1,226.00	3,187,600
大気社	1,700	4,655.00	7,913,500

ダイダン	1,800	1,867.00	3,360,600
日比谷総合設備	1,000	2,644.00	2,644,000
ニッポン	4,300	2,342.00	10,070,600
日清製粉グループ本社	13,400	2,032.00	27,228,800
日東富士製粉	300	5,360.00	1,608,000
昭和産業	1,400	3,410.00	4,774,000
鳥越製粉	1,100	694.00	763,400
中部飼料	2,300	1,225.00	2,817,500
フィード・ワン	2,200	1,023.00	2,250,600
東洋精糖	200	2,484.00	496,800
日本甜菜製糖	900	2,094.00	1,884,600
DM三井製糖ホールディングス	1,400	3,250.00	4,550,000
塩水港精糖	1,400	300.00	420,000
ウェルネオシュガー	800	2,331.00	1,864,800
L I F U L L	6,000	164.00	984,000
M I X I	3,200	2,476.00	7,923,200
ジェイエイシーリクルートメント	5,600	743.00	4,160,800
日本M&Aセンターホールディングス	24,100	963.30	23,215,530
メンバーズ	600	850.00	510,000
中広	500	410.00	205,000
UTグループ	2,000	3,670.00	7,340,000
アイティメディア	700	1,946.00	1,362,200
ケアネット	2,700	676.00	1,825,200
E・Jホールディングス	800	1,672.00	1,337,600
オープンアップグループ	4,500	2,033.00	9,148,500
コシダカホールディングス	4,500	915.00	4,117,500
アルトナー	300	2,586.00	775,800
パソナグループ	1,800	2,848.00	5,126,400
C D S	300	1,709.00	512,700
リンクアンドモチベーション	4,400	607.00	2,670,800
エス・エム・エス	5,300	2,476.00	13,122,800
サニーサイドアップグループ	300	723.00	216,900
パーソルホールディングス	154,700	209.90	32,471,530
リニカル	600	386.00	231,600
クックパッド	4,500	123.00	553,500
エスクリ	300	306.00	91,800
アイ・ケイ・ケイホールディングス	400	763.00	305,200
森永製菓	6,200	2,647.50	16,414,500
中村屋	400	3,130.00	1,252,000
江崎グリコ	4,200	4,424.00	18,580,800
名糖産業	600	1,839.00	1,103,400
井村屋グループ	900	2,448.00	2,203,200
不二家	1,100	2,451.00	2,696,100
山崎製パン	9,700	3,628.00	35,191,600
第一屋製パン	500	724.00	362,000
モロゾフ	500	4,255.00	2,127,500
亀田製菓	800	4,325.00	3,460,000
寿スピリッツ	6,800	1,858.00	12,634,400

カルビー	6,600	3,219.00	21,245,400
森永乳業	5,100	3,042.00	15,514,200
六甲バター	1,200	1,331.00	1,597,200
ヤクルト本社	20,800	3,153.00	65,582,400
明治ホールディングス	17,900	3,329.00	59,589,100
雪印メグミルク	3,500	2,204.00	7,714,000
プリマハム	1,900	2,259.00	4,292,100
日本ハム	6,300	5,307.00	33,434,100
林兼産業	300	565.00	169,500
丸大食品	1,400	1,623.00	2,272,200
S Foods	1,600	3,045.00	4,872,000
柿安本店	500	2,646.00	1,323,000
伊藤ハム米久ホールディングス	2,200	4,145.00	9,119,000
学情	800	1,802.00	1,441,600
スタジオアリス	900	2,041.00	1,836,900
クロスキャット	1,000	1,922.00	1,922,000
エプロ	500	850.00	425,000
システナ	23,400	284.00	6,645,600
N J S	400	2,804.00	1,121,600
デジタルアーツ	1,000	4,380.00	4,380,000
日鉄ソリューションズ	2,500	5,030.00	12,575,000
総合警備保障	25,300	823.20	20,826,960
キューブシステム	1,000	1,093.00	1,093,000
いちご	16,500	395.00	6,517,500
日本駐車場開発	14,900	185.00	2,756,500
コア	700	1,833.00	1,283,100
カカクコム	10,000	1,643.00	16,430,000
アイロムグループ	700	1,832.00	1,282,400
セントケア・ホールディング	1,300	888.00	1,154,400
サイネックス	400	852.00	340,800
ルネサンス	1,400	1,040.00	1,456,000
ディップ	2,400	2,579.00	6,189,600
S B Sホールディングス	1,300	2,323.00	3,019,900
デジタルホールディングス	800	1,137.00	909,600
新日本科学	1,400	1,578.00	2,209,200
キャリアデザインセンター	300	1,703.00	510,900
ベネフィット・ワン	5,200	2,169.50	11,281,400
エムスリー	30,100	2,087.50	62,833,750
ツカダ・グローバルホールディング	1,100	407.00	447,700
プラス	200	684.00	136,800
アウトソーシング	9,700	1,748.00	16,955,600
ウェルネット	1,100	539.00	592,900
ワールドホールディングス	600	2,424.00	1,454,400
ディー・エヌ・エー	5,600	1,338.50	7,495,600
博報堂DYホールディングス	19,300	1,335.00	25,765,500
ぐるなび	3,100	267.00	827,700
タカミヤ	2,300	542.00	1,246,600
ファンコミュニケーションズ	2,100	399.00	837,900

ライク	700	1,557.00	1,089,900
A o b a - B B T	600	393.00	235,800
エスプール	4,600	310.00	1,426,000
W D Bホールディングス	900	2,187.00	1,968,300
手間いらず	300	2,732.00	819,600
ティア	1,100	455.00	500,500
C D G	100	1,247.00	124,700
アドウェイズ	2,300	463.00	1,064,900
バリューコマース	1,400	1,095.00	1,533,000
インフォマート	15,600	425.00	6,630,000
サッポロホールディングス	4,800	6,345.00	30,456,000
アサヒグループホールディングス	33,700	5,128.00	172,813,600
麒麟ホールディングス	60,800	2,045.50	124,366,400
宝ホールディングス	9,900	1,200.00	11,880,000
オエノンホールディングス	4,700	337.00	1,583,900
養命酒製造	600	1,886.00	1,131,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	11,400	1,996.00	22,754,400
ライフドリンク カンパニー	200	4,560.00	912,000
サントリー食品インターナショナル	10,300	4,740.00	48,822,000
ダイドーグループホールディングス	1,600	2,804.00	4,486,400
伊藤園	4,900	3,800.00	18,620,000
キーコーヒー	1,600	2,034.00	3,254,400
ユニカフェ	400	906.00	362,400
ジャパンフーズ	100	1,419.00	141,900
日清オイリオグループ	2,000	5,160.00	10,320,000
不二製油グループ本社	3,400	2,377.50	8,083,500
かどや製油	100	3,875.00	387,500
J - オイルミルズ	1,700	1,932.00	3,284,400
ローソン	3,300	10,275.00	33,907,500
サンエー	1,200	4,510.00	5,412,000
カワチ薬品	1,200	2,722.00	3,266,400
エービーシー・マート	6,800	2,611.00	17,754,800
ハードオフコーポレーション	600	1,707.00	1,024,200
高千穂交易	400	3,840.00	1,536,000
アスクル	3,800	2,083.00	7,915,400
ゲオホールディングス	1,600	1,875.00	3,000,000
アダストリア	1,900	3,400.00	6,460,000
ジーフット	500	282.00	141,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	100	684.00	68,400
オルバヘルスケアホールディングス	200	1,895.00	379,000
伊藤忠食品	300	7,510.00	2,253,000
くら寿司	1,800	4,005.00	7,209,000
キャンドゥ	600	2,617.00	1,570,200
エレマテック	1,500	1,864.00	2,796,000
I Kホールディングス	800	375.00	300,000
パルグループホールディングス	3,000	2,243.00	6,729,000
エディオン	6,100	1,522.00	9,284,200
あらた	2,400	3,195.00	7,668,000

サーラコーポレーション	3,200	795.00	2,544,000
ワッツ	700	607.00	424,900
トーメンデバイス	200	5,760.00	1,152,000
ハローズ	700	4,440.00	3,108,000
J Pホールディングス	3,800	462.00	1,755,600
フジオフードグループ本社	1,700	1,330.00	2,261,000
あみやき亭	400	4,580.00	1,832,000
東京エレクトロン デバイス	1,600	7,860.00	12,576,000
ひらまつ	2,800	246.00	688,800
円谷フィールズホールディングス	2,600	1,498.00	3,894,800
双日	17,400	3,899.00	67,842,600
アルフレッサ ホールディングス	15,700	2,210.00	34,697,000
大黒天物産	500	9,600.00	4,800,000
ハニーズホールディングス	1,400	1,653.00	2,314,200
ファーマライズホールディングス	200	658.00	131,600
キッコーマン	9,700	10,040.00	97,388,000
味の素	34,700	5,546.00	192,446,200
ブルドックソース	800	2,129.00	1,703,200
キューピー	7,800	2,775.00	21,645,000
ハウス食品グループ本社	5,000	3,053.00	15,265,000
カゴメ	6,200	3,331.00	20,652,200
焼津水産化学工業	500	1,348.00	674,000
アリアケジャパン	1,400	5,110.00	7,154,000
ピエトロ	100	1,830.00	183,000
エバラ食品工業	300	2,956.00	886,800
やまみ	100	3,640.00	364,000
ニチレイ	6,700	3,761.00	25,198,700
横浜冷凍	4,200	1,062.00	4,460,400
東洋水産	7,400	8,888.00	65,771,200
イートアンドホールディングス	800	2,030.00	1,624,000
大冷	100	1,930.00	193,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	600	1,238.00	742,800
日清食品ホールディングス	15,400	4,271.00	65,773,400
永谷園ホールディングス	700	2,207.00	1,544,900
一正蒲鉾	300	744.00	223,200
フジッコ	1,600	1,926.00	3,081,600
ロック・フィールド	1,600	1,639.00	2,622,400
日本たばこ産業	88,700	3,872.00	343,446,400
ケンコーマヨネーズ	1,100	2,031.00	2,234,100
わらべや日洋ホールディングス	900	2,698.00	2,428,200
なとり	1,000	2,136.00	2,136,000
イフジ産業	200	1,600.00	320,000
ファーマフーズ	2,400	923.00	2,215,200
北の達人コーポレーション	7,200	202.00	1,454,400
ユーグレナ	8,900	611.00	5,437,900
紀文食品	1,300	1,242.00	1,614,600
ピクルスホールディングス	1,000	1,171.00	1,171,000
スター・マイカ・ホールディングス	1,500	520.00	780,000

S R Eホールディングス	600	3,860.00	2,316,000
A Dワークスグループ	2,200	239.00	525,800
片倉工業	1,300	1,777.00	2,310,100
グンゼ	1,100	5,520.00	6,072,000
ヒューリック	34,000	1,486.50	50,541,000
神栄	100	1,642.00	164,200
ラサ商事	500	1,953.00	976,500
アルペン	1,200	1,937.00	2,324,400
ハブ	400	745.00	298,000
ラクーンホールディングス	1,400	600.00	840,000
クオールホールディングス	2,100	1,651.00	3,467,100
アルコニックス	2,000	1,404.00	2,808,000
神戸物産	12,100	3,808.00	46,076,800
ソリトンシステムズ	700	1,347.00	942,900
ジーンズホールディングス	1,000	4,085.00	4,085,000
ビックカメラ	8,300	1,256.00	10,424,800
D C Mホールディングス	8,200	1,389.00	11,389,800
ペッパーフードサービス	2,800	124.00	347,200
ハイパー	600	303.00	181,800
M o n o t a R O	22,200	1,414.00	31,390,800
東京一番フーズ	100	519.00	51,900
D Dグループ	700	1,262.00	883,400
あい ホールディングス	2,500	2,322.00	5,805,000
ディービーエックス	400	1,053.00	421,200
きちりホールディングス	300	913.00	273,900
J . フロント リテイリング	17,900	1,520.50	27,216,950
ドトール・日レスホールディングス	2,700	2,021.00	5,456,700
マツキヨココカラ&カンパニー	28,500	2,372.00	67,602,000
ブロンコピリー	1,000	3,370.00	3,370,000
Z O Z O	10,000	3,608.00	36,080,000
トレジャー・ファクトリー	800	1,407.00	1,125,600
物語コーポレーション	2,600	4,540.00	11,804,000
三越伊勢丹ホールディングス	26,400	2,208.50	58,304,400
東洋紡	6,300	1,107.00	6,974,100
ユニチカ	5,600	164.00	918,400
富士紡ホールディングス	700	4,375.00	3,062,500
日清紡ホールディングス	11,200	1,238.00	13,865,600
倉敷紡績	1,100	3,185.00	3,503,500
ダイワボウホールディングス	6,900	2,582.00	17,815,800
シキボウ	700	1,207.00	844,900
日東紡績	1,900	6,100.00	11,590,000
トヨタ紡織	6,200	2,433.00	15,084,600
マクニカホールディングス	3,700	8,370.00	30,969,000
H a m e e	500	1,067.00	533,500
マーケットエンタープライズ	200	804.00	160,800
ラクト・ジャパン	700	2,218.00	1,552,600
ウエルシアホールディングス	8,100	2,759.50	22,351,950
クリエイトS Dホールディングス	2,600	3,195.00	8,307,000

グリムス	700	2,069.00	1,448,300
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,000	1,260.00	2,520,000
八洲電機	1,500	1,549.00	2,323,500
メディアスホールディングス	1,200	723.00	867,600
レスターホールディングス	1,400	2,938.00	4,113,200
ジオリーブグループ	400	1,349.00	539,600
丸善C H Iホールディングス	1,400	334.00	467,600
大光	500	630.00	315,000
O C H Iホールディングス	100	1,715.00	171,500
T O K A Iホールディングス	8,400	1,009.00	8,475,600
黒谷	700	599.00	419,300
ミサワ	500	615.00	307,500
ティーライフ	200	1,370.00	274,000
C o m i n i x	200	848.00	169,600
エー・ピーホールディングス	100	985.00	98,500
三洋貿易	2,000	1,231.00	2,462,000
チムニー	400	1,433.00	573,200
シュッピン	1,300	1,129.00	1,467,700
ビューティガレージ	600	2,354.00	1,412,400
オイシックス・ラ・大地	2,000	1,329.00	2,658,000
ウイン・パートナーズ	1,200	1,274.00	1,528,800
ネクステージ	3,500	2,465.00	8,627,500
ジョイフル本田	4,500	2,067.00	9,301,500
鳥貴族ホールディングス	600	4,500.00	2,700,000
ホットランド	1,300	1,808.00	2,350,400
すかいらーくホールディングス	21,400	2,228.00	47,679,200
S F Pホールディングス	1,000	1,935.00	1,935,000
綿半ホールディングス	1,100	1,495.00	1,644,500
日本毛織	4,100	1,360.00	5,576,000
ダイトウボウ	1,000	93.00	93,000
トーア紡コーポレーション	300	430.00	129,000
ダイドーリミテッド	1,200	684.00	820,800
ヨシックスホールディングス	200	2,945.00	589,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	4,500	956.00	4,302,000
野村不動産ホールディングス	8,100	3,803.00	30,804,300
三重交通グループホールディングス	3,500	602.00	2,107,000
サムティ	2,300	2,440.00	5,612,000
ディア・ライフ	2,600	931.00	2,420,600
コーセーアールイー	500	876.00	438,000
地主	1,100	2,146.00	2,360,600
プレサンスコーポレーション	2,300	1,669.00	3,838,700
フィル・カンパニー	500	777.00	388,500
T H E グローバル社	400	412.00	164,800
ハウスコム	400	964.00	385,600
J P M C	1,000	1,192.00	1,192,000
サンセイランディック	300	997.00	299,100
エストラスト	100	645.00	64,500
フージャースホールディングス	2,200	1,066.00	2,345,200

オープンハウスグループ	5,300	4,549.00	24,109,700
東急不動産ホールディングス	43,800	1,003.50	43,953,300
飯田グループホールディングス	13,900	1,906.00	26,493,400
イーランド	200	1,588.00	317,600
ムゲンエステート	800	1,411.00	1,128,800
帝国繊維	1,800	2,190.00	3,942,000
日本コークス工業	14,200	120.00	1,704,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,000	567.00	567,000
ミタチ産業	400	1,231.00	492,400
B E E N O S	700	1,891.00	1,323,700
あさひ	1,400	1,290.00	1,806,000
日本調剤	1,200	1,415.00	1,698,000
コスモス薬品	1,300	13,990.00	18,187,000
シップヘルスケアホールディングス	5,600	2,195.00	12,292,000
トーエル	500	795.00	397,500
ソフトクリエイティブホールディングス	1,400	1,850.00	2,590,000
セブン&アイ・ホールディングス	162,000	2,178.00	352,836,000
クリエイティブ・レストランズ・ホールディング	10,500	1,022.00	10,731,000
明治電機工業	600	1,514.00	908,400
ツルハホールディングス	3,300	11,240.00	37,092,000
デリカフーズホールディングス	500	585.00	292,500
スターティアホールディングス	200	1,494.00	298,800
サンマルクホールディングス	1,400	2,189.00	3,064,600
フェリシモ	400	913.00	365,200
トリドールホールディングス	4,400	4,172.00	18,356,800
帝人	14,200	1,264.50	17,955,900
東レ	99,400	686.10	68,198,340
クラレ	21,600	1,474.50	31,849,200
旭化成	100,400	1,057.50	106,173,000
T O K Y O B A S E	1,600	294.00	470,400
稲葉製作所	800	1,490.00	1,192,000
宮地エンジニアリンググループ	800	4,255.00	3,404,000
トーカロ	4,400	1,728.00	7,603,200
アルファC o	400	1,636.00	654,400
S U M C O	27,100	2,529.00	68,535,900
川田テクノロジーズ	400	9,290.00	3,716,000
R S T e c h n o l o g i e s	1,000	2,947.00	2,947,000
ジェイテックコーポレーション	100	2,010.00	201,000
信和	600	749.00	449,400
ビーロッド	700	948.00	663,600
ファーストブラザーズ	100	1,250.00	125,000
A n d D o ホールディングス	1,000	1,138.00	1,138,000
シーアールイー	800	1,311.00	1,048,800
ケイアイスター不動産	700	3,505.00	2,453,500
アグレ都市デザイン	200	1,669.00	333,800
グッドコムアセット	1,400	750.00	1,050,000
ジェイ・エス・ビー	800	2,624.00	2,099,200
ロードスターキャピタル	1,000	2,187.00	2,187,000

テンポイノベーション	500	908.00	454,000
グローバル・リンク・マネジメント	100	2,681.00	268,100
フェイスネットワーク	400	1,498.00	599,200
霞ヶ関キャピタル	400	14,360.00	5,744,000
住江織物	200	2,450.00	490,000
日本フェルト	600	434.00	260,400
イチカワ	200	1,810.00	362,000
エコナックホールディングス	2,200	136.00	299,200
日東製網	100	1,635.00	163,500
芦森工業	200	2,848.00	569,600
アツギ	500	603.00	301,500
ウイルプラスホールディングス	100	1,001.00	100,100
J Mホールディングス	1,100	2,453.00	2,698,300
コメダホールディングス	3,800	2,683.00	10,195,400
サツドラホールディングス	400	830.00	332,000
アレンザホールディングス	1,100	1,047.00	1,151,700
串カツ田中ホールディングス	500	1,708.00	854,000
パロックジャパンリミテッド	1,000	769.00	769,000
クスリのアオキホールディングス	4,700	3,100.00	14,570,000
ダイニック	300	749.00	224,700
共和レザー	700	846.00	592,200
ピーバンドットコム	400	388.00	155,200
力の源ホールディングス	600	1,563.00	937,800
FOOD & LIFE COMPANIE	8,300	2,995.00	24,858,500
アセンテック	400	712.00	284,800
セーレン	2,800	2,449.00	6,857,200
ソトー	400	690.00	276,000
東海染工	300	812.00	243,600
小松マテーレ	2,000	755.00	1,510,000
ワコールホールディングス	3,000	3,631.00	10,893,000
ホギメディカル	2,000	3,650.00	7,300,000
クラウディアホールディングス	100	384.00	38,400
T S Iホールディングス	4,900	653.00	3,199,700
マツオカコーポレーション	400	1,552.00	620,800
ワールド	2,100	1,879.00	3,945,900
T I S	16,200	3,390.00	54,918,000
テクミラホールディングス	800	472.00	377,600
グリー	5,000	472.00	2,360,000
GMOペパボ	300	1,411.00	423,300
コーエーテクモホールディングス	9,300	1,755.50	16,326,150
三菱総合研究所	700	5,030.00	3,521,000
ボルテージ	900	265.00	238,500
電算	200	1,497.00	299,400
A G S	400	899.00	359,600
ファインデックス	1,200	1,231.00	1,477,200
ブレインパッド	1,200	1,634.00	1,960,800
K L a b	3,700	350.00	1,295,000
ポールトゥウィンホールディングス	3,000	513.00	1,539,000

ネクソン	33,200	2,466.50	81,887,800
アイスタイル	4,700	509.00	2,392,300
エムアップホールディングス	2,100	1,127.00	2,366,700
エイチーム	1,300	563.00	731,900
エニグモ	2,200	364.00	800,800
テクノスジャパン	900	623.00	560,700
e n i s h	800	300.00	240,000
コロプラ	5,600	548.00	3,068,800
オルトプラス	500	137.00	68,500
ブロードリーフ	6,900	599.00	4,133,100
クロス・マーケティンググループ	700	543.00	380,100
デジタルハーツホールディングス	900	925.00	832,500
メディアドゥ	700	1,288.00	901,600
じげん	4,900	575.00	2,817,500
ブイキューブ	2,100	312.00	655,200
エンカレッジ・テクノロジー	500	625.00	312,500
サイバーリンクス	600	897.00	538,200
ディー・エル・イー	700	185.00	129,500
フィックスターズ	1,800	2,016.00	3,628,800
CARTA HOLDINGS	800	1,438.00	1,150,400
オプティム	1,400	1,183.00	1,656,200
セレス	800	1,687.00	1,349,600
S H I F T	1,000	26,560.00	26,560,000
特種東海製紙	700	3,860.00	2,702,000
ティーガイア	1,500	2,064.00	3,096,000
セック	200	4,845.00	969,000
テクマトリックス	2,800	1,939.00	5,429,200
プロシップ	700	1,497.00	1,047,900
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,800	2,125.50	8,076,900
GMOペイメントゲートウェイ	3,000	10,205.00	30,615,000
ザッパラス	200	437.00	87,400
システムリサーチ	500	3,270.00	1,635,000
インターネットイニシアティブ	7,100	2,745.00	19,489,500
さくらインターネット	1,600	9,850.00	15,760,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	2,724.00	1,362,000
S R Aホールディングス	800	3,935.00	3,148,000
システムインテグレータ	800	409.00	327,200
朝日ネット	1,800	620.00	1,116,000
e B A S E	2,400	753.00	1,807,200
アバントグループ	1,800	1,319.00	2,374,200
アドソル日進	700	1,676.00	1,173,200
ODKソリューションズ	600	624.00	374,400
フリービット	700	1,640.00	1,148,000
コムチュア	2,100	2,046.00	4,296,600
アステリア	1,500	664.00	996,000
アイル	700	3,870.00	2,709,000
王子ホールディングス	61,700	591.30	36,483,210
日本製紙	8,300	1,127.00	9,354,100

三菱製紙	1,600	564.00	902,400
北越コーポレーション	7,200	1,473.00	10,605,600
中越パルプ工業	400	1,829.00	731,600
巴川コーポレーション	100	869.00	86,900
大王製紙	6,500	1,142.00	7,423,000
阿波製紙	300	451.00	135,300
マークライنز	900	3,125.00	2,812,500
メディカル・データ・ビジョン	1,800	567.00	1,020,600
g u m i	2,300	397.00	913,100
ショーケース	600	331.00	198,600
モバイルファクトリー	400	764.00	305,600
テラスカイ	700	1,526.00	1,068,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	900	1,861.00	1,674,900
P C Iホールディングス	400	941.00	376,400
アイビーシー	200	426.00	85,200
ネオジャパン	700	1,083.00	758,100
P R T I M E S	400	1,930.00	772,000
ラクス	7,000	2,202.50	15,417,500
ランドコンピュータ	600	850.00	510,000
ダブルスタンダード	600	1,818.00	1,090,800
オーブンドア	1,200	710.00	852,000
マイネット	900	354.00	318,600
アカツキ	700	2,419.00	1,693,300
ベネフィットジャパン	200	1,264.00	252,800
U b i c o mホールディングス	500	1,280.00	640,000
カナミックネットワーク	2,200	507.00	1,115,400
ノムラシステムコーポレーション	2,400	117.00	280,800
レンゴー	13,400	1,088.00	14,579,200
トーモク	800	2,427.00	1,941,600
ザ・パック	1,100	3,560.00	3,916,000
チェンジホールディングス	3,300	1,408.00	4,646,400
シンクロ・フード	800	665.00	532,000
オークネット	600	2,216.00	1,329,600
キャピタル・アセット・プランニング	100	749.00	74,900
セグエグループ	900	675.00	607,500
エイトレッド	200	1,432.00	286,400
マクロミル	2,900	711.00	2,061,900
ビーグリー	100	1,120.00	112,000
オロ	600	2,701.00	1,620,600
ユーザーローカル	600	2,513.00	1,507,800
テモナ	500	231.00	115,500
ニーズウェル	600	1,127.00	676,200
マネーフォワード	3,300	6,678.00	22,037,400
サインポスト	600	596.00	357,600
レゾナック・ホールディングス	14,300	3,625.00	51,837,500
住友化学	109,900	304.00	33,409,600
住友精化	700	5,050.00	3,535,000
日産化学	7,000	6,069.00	42,483,000

ラサ工業	700	2,605.00	1,823,500
クレハ	3,200	2,628.00	8,409,600
多木化学	600	3,555.00	2,133,000
テイカ	1,100	1,581.00	1,739,100
石原産業	2,400	1,518.00	3,643,200
片倉コープアグリ	300	1,038.00	311,400
日本曹達	1,700	6,050.00	10,285,000
東ソー	19,800	2,024.50	40,085,100
トクヤマ	4,800	2,489.00	11,947,200
セントラル硝子	1,500	2,833.00	4,249,500
東亜合成	7,400	1,472.50	10,896,500
大阪ソーダ	1,000	11,070.00	11,070,000
関東電化工業	2,800	1,004.00	2,811,200
Sun Asterisk	900	955.00	859,500
デンカ	5,400	2,411.00	13,019,400
イビデン	7,800	7,252.00	56,565,600
信越化学工業	133,400	6,588.00	878,839,200
日本カーバイド工業	500	1,899.00	949,500
プラスアルファ・コンサルティング	800	2,491.00	1,992,800
電算システムホールディングス	600	2,637.00	1,582,200
堺化学工業	1,200	1,969.00	2,362,800
第一稀元素化学工業	1,500	931.00	1,396,500
エア・ウォーター	14,000	2,312.00	32,368,000
日本酸素ホールディングス	14,400	4,821.00	69,422,400
日本化学工業	600	2,377.00	1,426,200
東邦アセチレン	1,500	396.00	594,000
日本パーカライジング	6,500	1,240.00	8,060,000
高圧ガス工業	2,500	856.00	2,140,000
チタン工業	200	1,070.00	214,000
四国化成ホールディングス	1,800	1,852.00	3,333,600
戸田工業	400	1,711.00	684,400
ステラ ケミファ	800	3,835.00	3,068,000
保土谷化学工業	500	3,595.00	1,797,500
日本触媒	2,100	5,610.00	11,781,000
大日精化工業	1,000	2,730.00	2,730,000
カネカ	3,700	3,631.00	13,434,700
協和キリン	17,900	2,941.00	52,643,900
Appier Group	5,000	1,813.00	9,065,000
三菱瓦斯化学	11,000	2,540.00	27,940,000
三井化学	12,200	4,184.00	51,044,800
J S R	16,200	4,255.00	68,931,000
東京応化工業	7,100	4,678.00	33,213,800
大阪有機化学工業	1,300	3,290.00	4,277,000
三菱ケミカルグループ	108,500	852.70	92,517,950
KHネオケム	2,200	2,201.00	4,842,200
ビジョナル	1,100	8,390.00	9,229,000
ダイセル	19,000	1,493.00	28,367,000
住友ベークライト	2,100	9,010.00	18,921,000

積水化学工業	29,800	2,109.00	62,848,200
日本ゼオン	10,100	1,253.00	12,655,300
アイカ工業	3,700	3,634.00	13,445,800
UBE	7,000	2,534.50	17,741,500
積水樹脂	2,200	2,521.00	5,546,200
タキロンシーアイ	3,600	638.00	2,296,800
旭有機材	1,000	4,525.00	4,525,000
ニチバン	700	1,888.00	1,321,600
リケンテクノス	3,100	949.00	2,941,900
大倉工業	800	3,140.00	2,512,000
積水化成品工業	2,600	470.00	1,222,000
群栄化学工業	400	3,620.00	1,448,000
タイガースポリマー	400	1,124.00	449,600
ミライアル	400	1,622.00	648,800
ダイキアクシス	700	700.00	490,000
ダイキョーニシカワ	3,700	751.00	2,778,700
竹本容器	700	776.00	543,200
森六ホールディングス	700	2,700.00	1,890,000
恵和	1,200	1,115.00	1,338,000
日本化薬	11,300	1,269.50	14,345,350
カーリットホールディングス	1,400	1,031.00	1,443,400
ソルクシーズ	800	335.00	268,000
CLホールディングス	600	1,028.00	616,800
プレステージ・インターナショナル	7,000	641.00	4,487,000
フェイス	200	457.00	91,400
プロトコーポレーション	1,600	1,318.00	2,108,800
ハイマックス	500	1,408.00	704,000
アミューズ	900	1,494.00	1,344,600
野村総合研究所	32,900	4,431.00	145,779,900
ドリームインキュベータ	500	2,936.00	1,468,000
クイック	1,100	2,401.00	2,641,100
TAC	300	191.00	57,300
CEホールディングス	400	529.00	211,600
日本システム技術	400	4,005.00	1,602,000
電通グループ	15,000	3,934.00	59,010,000
インテージホールディングス	1,800	1,897.00	3,414,600
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	1,054.00	527,000
東邦システムサイエンス	400	1,310.00	524,000
びあ	600	3,090.00	1,854,000
イオンファンタジー	500	2,272.00	1,136,000
ソースネクスト	6,100	136.00	829,600
シーティーエス	1,800	740.00	1,332,000
NEXYZ Group	300	611.00	183,300
インフォコム	1,900	2,230.00	4,237,000
メディカルシステムネットワーク	1,400	630.00	882,000
日本精化	1,000	2,675.00	2,675,000
扶桑化学工業	1,500	5,170.00	7,755,000
トリケミカル研究所	1,800	4,715.00	8,487,000

シンプレクス・ホールディングス	2,300	2,760.00	6,348,000
HEROZ	500	2,014.00	1,007,000
ラクスル	3,500	1,116.00	3,906,000
メルカリ	7,200	2,018.50	14,533,200
I P S	400	2,390.00	956,000
F I G	1,600	310.00	496,000
システムサポート	600	1,936.00	1,161,600
A D E K A	5,100	3,168.00	16,156,800
日油	4,500	6,633.00	29,848,500
ミヨシ油脂	200	1,290.00	258,000
新日本理化	1,300	205.00	266,500
ハリマ化成グループ	1,000	916.00	916,000
イーソル	1,200	889.00	1,066,800
東海ソフト	100	1,175.00	117,500
ウイングアーク1 s t	1,500	2,965.00	4,447,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン	400	1,123.00	449,200
サーバーワークス	300	4,155.00	1,246,500
東名	100	2,386.00	238,600
ヴィッツ	200	766.00	153,200
トピラシステムズ	500	863.00	431,500
S a n s a n	4,800	1,762.00	8,457,600
L i n k - Uグループ	100	680.00	68,000
ギフティ	1,400	1,334.00	1,867,600
花王	33,600	5,746.00	193,065,600
第一工業製薬	700	3,410.00	2,387,000
石原ケミカル	700	1,867.00	1,306,900
日華化学	200	914.00	182,800
ニイタカ	200	1,901.00	380,200
三洋化成工業	900	4,215.00	3,793,500
メドレー	2,000	4,880.00	9,760,000
ベース	600	3,380.00	2,028,000
J M D C	2,600	3,627.00	9,430,200
武田薬品工業	131,800	4,343.00	572,407,400
アステラス製薬	130,400	1,636.00	213,334,400
住友ファーマ	11,500	358.00	4,117,000
塩野義製薬	18,700	7,815.00	146,140,500
わかもと製薬	800	200.00	160,000
日本新薬	3,900	4,512.00	17,596,800
中外製薬	46,600	6,317.00	294,372,200
科研製薬	2,500	3,554.00	8,885,000
エーザイ	18,100	6,094.00	110,301,400
理研ビタミン	1,300	2,491.00	3,238,300
ロート製薬	14,400	2,993.50	43,106,400
小野薬品工業	31,500	2,409.50	75,899,250
久光製薬	3,300	3,780.00	12,474,000
有機合成薬品工業	1,300	328.00	426,400
持田製薬	1,700	3,225.00	5,482,500
参天製薬	27,000	1,473.00	39,771,000

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

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

コニカミノルタ	33,200	490.90	16,297,880
資生堂	31,000	4,125.00	127,875,000
ライオン	19,400	1,319.00	25,588,600
高砂香料工業	1,100	3,345.00	3,679,500
マンダム	3,300	1,310.00	4,323,000
ミルボン	2,000	3,128.00	6,256,000
ファンケル	6,500	1,990.50	12,938,250
コーセー	3,000	7,904.00	23,712,000
コタ	1,300	1,614.00	2,098,200
シーボン	100	1,491.00	149,100
ポーラ・オルビスホールディングス	7,600	1,441.00	10,951,600
ノエビアホールディングス	1,300	5,120.00	6,656,000
アジュバンホールディングス	300	959.00	287,700
新日本製薬	900	1,632.00	1,468,800
I - n e	300	1,815.00	544,500
アクシージア	700	839.00	587,300
エステー	1,300	1,550.00	2,015,000
アグロ カネショウ	700	1,214.00	849,800
コニシ	4,400	1,508.00	6,635,200
長谷川香料	2,800	3,025.00	8,470,000
小林製薬	4,300	5,866.00	25,223,800
荒川化学工業	1,200	1,127.00	1,352,400
メック	1,200	4,510.00	5,412,000
日本高純度化学	400	2,886.00	1,154,400
タカラバイオ	3,900	989.00	3,857,100
J C U	1,600	4,150.00	6,640,000
新田ゼラチン	700	716.00	501,200
O A T アグリオ	300	1,715.00	514,500
デクセリアルズ	3,700	6,127.00	22,669,900
アース製薬	1,300	4,135.00	5,375,500
北興化学工業	1,400	1,270.00	1,778,000
大成ラミック	500	2,983.00	1,491,500
クミアイ化学工業	6,200	824.00	5,108,800
日本農薬	2,600	710.00	1,846,000
富士興産	200	2,066.00	413,200
ニチレキ	2,000	2,438.00	4,876,000
ユシロ化学工業	700	2,211.00	1,547,700
ビーピー・カストロール	300	937.00	281,100
富士石油	3,300	340.00	1,122,000
M O R E S C O	400	1,375.00	550,000
出光興産	82,400	972.20	80,109,280
E N E O Sホールディングス	235,200	654.50	153,938,400
コスモエネルギーホールディングス	4,400	6,787.00	29,862,800
A N Y C O L O R	1,600	3,095.00	4,952,000
テスホールディングス	3,600	459.00	1,652,400
インフロニア・ホールディングス	16,700	1,550.00	25,885,000
横浜ゴム	7,500	3,899.00	29,242,500
T O Y O T I R E	8,500	2,691.00	22,873,500

ブリヂストン	43,600	6,335.00	276,206,000
住友ゴム工業	14,500	1,749.50	25,367,750
藤倉コンポジット	1,100	1,399.00	1,538,900
オカモト	700	4,800.00	3,360,000
アキレス	1,000	1,593.00	1,593,000
フコク	900	1,655.00	1,489,500
ニッタ	1,500	3,710.00	5,565,000
クリエートメディック	600	958.00	574,800
住友理工	2,300	1,263.00	2,904,900
三ツ星ベルト	1,800	4,800.00	8,640,000
バンドー化学	2,100	1,752.00	3,679,200
A G C	13,200	5,286.00	69,775,200
日本板硝子	6,900	511.00	3,525,900
石塚硝子	200	2,838.00	567,600
有沢製作所	2,700	1,157.00	3,123,900
日本山村硝子	300	1,502.00	450,600
日本電気硝子	6,000	3,819.00	22,914,000
オハラ	800	1,259.00	1,007,200
住友大阪セメント	2,400	3,655.00	8,772,000
太平洋セメント	8,800	3,209.00	28,239,200
リソルホールディングス	100	5,720.00	572,000
日本ヒューム	1,400	892.00	1,248,800
日本コンクリート工業	2,900	410.00	1,189,000
三谷セキサン	600	5,560.00	3,336,000
アジアパイルホールディングス	2,000	775.00	1,550,000
東海カーボン	13,600	968.00	13,164,800
日本カーボン	800	5,300.00	4,240,000
東洋炭素	1,100	7,770.00	8,547,000
ノリタケカンパニーリミテド	800	8,420.00	6,736,000
T O T O	9,800	4,180.00	40,964,000
日本碍子	17,200	1,946.00	33,471,200
日本特殊陶業	12,400	4,634.00	57,461,600
ダントーホールディングス	600	981.00	588,600
M A R U W A	500	33,850.00	16,925,000
品川リフラクトリーズ	1,800	1,927.00	3,468,600
黒崎播磨	300	14,180.00	4,254,000
ヨータイ	800	1,461.00	1,168,800
東京窯業	900	470.00	423,000
ニッカトー	800	585.00	468,000
フジインコーポレーテッド	4,000	3,895.00	15,580,000
クニミネ工業	200	1,027.00	205,400
エーアンドエーマテリアル	300	1,320.00	396,000
ニチアス	3,700	3,965.00	14,670,500
日本製鉄	68,500	3,775.00	258,587,500
神戸製鋼所	30,700	2,031.00	62,351,700
中山製鋼所	3,100	938.00	2,907,800
合同製鐵	800	5,910.00	4,728,000
J F E ホールディングス	42,500	2,518.50	107,036,250

東京製鐵	4,200	1,682.00	7,064,400
共英製鋼	1,700	2,406.00	4,090,200
大和工業	2,900	8,368.00	24,267,200
東京鐵鋼	700	5,590.00	3,913,000
大阪製鐵	800	2,191.00	1,752,800
淀川製鋼所	1,700	4,545.00	7,726,500
中部鋼板	1,000	2,502.00	2,502,000
丸一鋼管	4,600	3,922.00	18,041,200
モリ工業	300	5,610.00	1,683,000
大同特殊鋼	9,600	1,829.00	17,558,400
日本高周波鋼業	100	620.00	62,000
日本冶金工業	1,100	4,820.00	5,302,000
山陽特殊製鋼	1,500	2,236.00	3,354,000
愛知製鋼	900	3,765.00	3,388,500
日本金属	100	855.00	85,500
ミガロホールディングス	200	1,760.00	352,000
大平洋金属	1,300	1,382.00	1,796,600
新日本電工	8,000	301.00	2,408,000
栗本鐵工所	700	3,540.00	2,478,000
虹技	100	1,503.00	150,300
日本鑄鉄管	300	1,140.00	342,000
日本製鋼所	4,100	2,902.00	11,898,200
三菱製鋼	1,000	1,459.00	1,459,000
日亜鋼業	1,100	341.00	375,100
日本精線	200	6,390.00	1,278,000
エンビプロ・ホールディングス	800	527.00	421,600
大紀アルミニウム工業所	1,800	1,202.00	2,163,600
日本軽金属ホールディングス	4,500	1,754.00	7,893,000
三井金属鉱業	4,400	4,375.00	19,250,000
東邦亜鉛	1,100	1,010.00	1,111,000
三菱マテリアル	10,900	2,633.00	28,699,700
住友金属鉱山	17,700	3,973.00	70,322,100
DOWAホールディングス	3,800	5,187.00	19,710,600
古河機械金属	2,000	1,768.00	3,536,000
エス・サイエンス	5,700	26.00	148,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,600	2,620.00	6,812,000
東邦チタニウム	3,100	1,626.00	5,040,600
UACJ	2,100	4,075.00	8,557,500
CKサンエツ	400	3,815.00	1,526,000
古河電気工業	5,100	2,948.50	15,037,350
住友電気工業	57,200	2,224.00	127,212,800
フジクラ	18,000	1,967.50	35,415,000
SWCC	1,800	3,510.00	6,318,000
タツタ電線	2,700	700.00	1,890,000
カナレ電気	100	1,786.00	178,600
平河ヒューテック	1,100	1,353.00	1,488,300
いよぎんホールディングス	17,300	1,135.50	19,644,150
しずおかフィナンシャルグループ	32,400	1,479.00	47,919,600

ちゅうぎんフィナンシャルグループ	12,200	1,169.00	14,261,800	
楽天銀行	5,000	2,975.00	14,875,000	
京都フィナンシャルグループ	18,500	2,742.50	50,736,250	
リョービ	1,600	2,725.00	4,360,000	
アーレスティ	1,100	797.00	876,700	
A R Eホールディングス	5,700	1,901.00	10,835,700	
東洋製罐グループホールディングス	9,100	2,450.00	22,295,000	
ホッカンホールディングス	900	1,956.00	1,760,400	
コロナ	1,100	964.00	1,060,400	
横河ブリッジホールディングス	2,400	2,870.00	6,888,000	
駒井ハルテック	300	2,020.00	606,000	
高田機工	100	3,505.00	350,500	
三和ホールディングス	15,300	2,504.50	38,318,850	
文化シャッター	4,100	1,569.00	6,432,900	
三協立山	1,900	863.00	1,639,700	
アルインコ	1,400	1,060.00	1,484,000	
東洋シャッター	600	714.00	428,400	
L I X I L	23,800	1,880.50	44,755,900	
日本ファイルコン	300	538.00	161,400	
ノーリツ	2,500	1,690.00	4,225,000	
長府製作所	1,600	2,110.00	3,376,000	
リンナイ	7,500	3,457.00	25,927,500	
ユニプレス	2,800	1,110.00	3,108,000	
ダイニチ工業	700	712.00	498,400	
日東精工	2,500	605.00	1,512,500	
三洋工業	100	3,435.00	343,500	
岡部	2,900	731.00	2,119,900	
ジーテクト	1,900	2,061.00	3,915,900	
東プレ	2,600	2,455.00	6,383,000	
高周波熱錬	2,300	1,052.00	2,419,600	
東京製綱	900	1,478.00	1,330,200	
サンコール	1,300	488.00	634,400	
モリテック スチール	900	253.00	227,700	
パイオラックス	2,000	2,744.00	5,488,000	
エイチワン	1,900	681.00	1,293,900	
日本発條	13,400	1,447.00	19,389,800	
中央発條	1,000	844.00	844,000	
アドバネクス	200	1,025.00	205,000	
三浦工業	6,200	2,923.00	18,122,600	
タクマ	5,000	1,879.00	9,395,000	
テクノプロ・ホールディングス	8,900	2,971.00	26,441,900	
アトラグループ	700	177.00	123,900	
アイ・アールジャパンホールディングス	900	1,333.00	1,199,700	
K e e P e r 技研	900	5,250.00	4,725,000	
ファーストロジック	100	484.00	48,400	
三機サービス	300	1,397.00	419,100	
G u n o s y	1,100	673.00	740,300	
デザインワン・ジャパン	600	131.00	78,600	

イー・ガーディアン	600	1,372.00	823,200
リブセンス	500	229.00	114,500
ジャパンマテリアル	4,600	2,579.00	11,863,400
ベクトル	1,800	1,164.00	2,095,200
ウチャマホールディングス	200	387.00	77,400
チャーム・ケア・コーポレーション	1,500	1,378.00	2,067,000
キャリアリンク	500	2,690.00	1,345,000
I B J	1,000	575.00	575,000
アサンテ	900	1,668.00	1,501,200
バリューHR	1,300	1,280.00	1,664,000
M & Aキャピタルパートナーズ	1,200	2,603.00	3,123,600
ライドオンエクスプレスホールディングス	800	1,094.00	875,200
E R Iホールディングス	200	1,852.00	370,400
アビスト	200	3,215.00	643,000
シグマクシス・ホールディングス	2,000	1,757.00	3,514,000
ウィルグループ	1,500	1,118.00	1,677,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,800	138.00	248,400
メドピア	1,500	723.00	1,084,500
レアジョブ	200	857.00	171,400
リクルートホールディングス	113,000	6,299.00	711,787,000
エラン	1,900	986.00	1,873,400
ツガミ	3,200	1,174.00	3,756,800
オークマ	1,300	7,086.00	9,211,800
芝浦機械	1,500	3,550.00	5,325,000
アマダ	23,800	1,696.50	40,376,700
アイダエンジニアリング	3,400	847.00	2,879,800
F U J I	7,000	2,711.00	18,977,000
牧野フライス製作所	1,600	6,000.00	9,600,000
オーエスジー	6,500	2,072.50	13,471,250
ダイジェット工業	100	853.00	85,300
旭ダイヤモンド工業	3,500	910.00	3,185,000
D M G 森精機	9,000	3,657.00	32,913,000
ソディック	3,900	714.00	2,784,600
ディスコ	7,200	53,450.00	384,840,000
日東工器	800	1,985.00	1,588,000
日進工具	1,300	991.00	1,288,300
パンチ工業	1,000	443.00	443,000
富士ダイス	600	698.00	418,800
土木管理総合試験所	1,200	331.00	397,200
日本郵政	179,000	1,454.00	260,266,000
ベルシステム24ホールディングス	1,600	1,610.00	2,576,000
鎌倉新書	1,100	607.00	667,700
S M N	400	365.00	146,000
一蔵	400	608.00	243,200
グローバルキッズCOMPANY	400	671.00	268,400
エアトリ	1,100	1,345.00	1,479,500
アトラエ	900	433.00	389,700
ストライク	700	5,300.00	3,710,000

ソラスト	4,500	501.00	2,254,500
セラク	600	1,112.00	667,200
インソース	3,200	916.00	2,931,200
豊田自動織機	12,700	15,535.00	197,294,500
豊和工業	600	782.00	469,200
石川製作所	300	1,217.00	365,100
リケンNPR	1,700	2,977.00	5,060,900
東洋機械金属	900	744.00	669,600
津田駒工業	100	383.00	38,300
エンシュウ	400	686.00	274,400
島精機製作所	2,300	1,366.00	3,141,800
オプトラン	2,400	2,057.00	4,936,800
NCホールディングス	300	1,621.00	486,300
イワキポンプ	1,000	2,650.00	2,650,000
フリー	1,400	1,180.00	1,652,000
ヤマシンフィルタ	3,800	398.00	1,512,400
日阪製作所	1,700	1,025.00	1,742,500
やまびこ	2,400	1,904.00	4,569,600
野村マイクロ・サイエンス	500	21,170.00	10,585,000
平田機工	700	8,290.00	5,803,000
PEGASUS	2,100	489.00	1,026,900
マルマエ	800	2,332.00	1,865,600
タツモ	900	4,110.00	3,699,000
ナプテスコ	9,400	2,466.50	23,185,100
三井海洋開発	2,000	3,200.00	6,400,000
レオン自動機	1,800	1,411.00	2,539,800
SMC	4,500	91,220.00	410,490,000
ホソカワミクロン	1,000	4,740.00	4,740,000
ユニオンツール	700	4,050.00	2,835,000
瑞光	1,200	1,602.00	1,922,400
オイレス工業	2,000	2,119.00	4,238,000
日精エー・エス・ビー機械	600	4,640.00	2,784,000
サトーホールディングス	2,100	2,267.00	4,760,700
技研製作所	1,400	2,011.00	2,815,400
日本エアーテック	900	1,162.00	1,045,800
カワタ	300	1,055.00	316,500
日精樹脂工業	1,000	1,149.00	1,149,000
オカダアイオン	400	2,983.00	1,193,200
ワイエイシイホールディングス	400	2,424.00	969,600
小松製作所	70,200	4,531.00	318,076,200
住友重機械工業	8,800	4,548.00	40,022,400
日立建機	5,900	4,523.00	26,685,700
日工	2,300	783.00	1,800,900
巴工業	600	3,915.00	2,349,000
井関農機	1,500	982.00	1,473,000
TOWA	1,700	10,400.00	17,680,000
丸山製作所	200	2,275.00	455,000
北川鉄工所	600	1,549.00	929,400

シンニッタン	1,000	287.00	287,000
ローツェ	800	22,500.00	18,000,000
タカキタ	200	489.00	97,800
クボタ	78,500	2,230.00	175,055,000
荏原実業	800	3,365.00	2,692,000
東洋エンジニアリング	2,100	920.00	1,932,000
三菱化工機	600	4,105.00	2,463,000
月島ホールディングス	1,900	1,483.00	2,817,700
帝国電機製作所	1,000	2,686.00	2,686,000
東京機械製作所	300	441.00	132,300
新東工業	3,100	1,166.00	3,614,600
澁谷工業	1,400	3,100.00	4,340,000
アイチ コーポレーション	2,000	1,106.00	2,212,000
小森コーポレーション	3,900	1,278.00	4,984,200
鶴見製作所	1,100	3,650.00	4,015,000
日本ギア工業	200	623.00	124,600
酒井重工業	200	6,530.00	1,306,000
荏原製作所	6,200	13,220.00	81,964,000
石井鐵工所	100	2,749.00	274,900
西島製作所	1,200	2,770.00	3,324,000
北越工業	1,600	2,234.00	3,574,400
ダイキン工業	17,900	21,165.00	378,853,500
オルガノ	1,800	8,040.00	14,472,000
トーヨーカネツ	500	4,465.00	2,232,500
栗田工業	8,400	6,275.00	52,710,000
椿本チエイン	2,100	4,950.00	10,395,000
大同工業	400	758.00	303,200
日機装	3,600	1,238.00	4,456,800
木村化工機	1,200	707.00	848,400
レイズネクスト	2,000	2,272.00	4,544,000
アネスト岩田	2,300	1,343.00	3,088,900
ダイフク	25,200	3,456.00	87,091,200
サムコ	400	5,640.00	2,256,000
加藤製作所	600	1,456.00	873,600
油研工業	200	2,377.00	475,400
タダノ	8,500	1,266.50	10,765,250
フジテック	3,500	3,782.00	13,237,000
C K D	4,100	3,500.00	14,350,000
平和	4,400	2,026.00	8,914,400
理想科学工業	1,200	3,260.00	3,912,000
SANKYO	17,000	1,677.50	28,517,500
日本金銭機械	1,800	1,321.00	2,377,800
マースグループホールディングス	700	3,225.00	2,257,500
フクシマガリレイ	1,000	5,580.00	5,580,000
オーイズミ	900	398.00	358,200
ダイコク電機	700	3,960.00	2,772,000
竹内製作所	2,700	5,650.00	15,255,000
アマノ	4,200	3,638.00	15,279,600

JUKI	2,900	525.00	1,522,500
サンデン	1,900	162.00	307,800
ジャノメ	1,700	677.00	1,150,900
ブラザー工業	20,000	2,594.50	51,890,000
マックス	2,100	3,110.00	6,531,000
モリタホールディングス	2,700	1,613.00	4,355,100
グローリー	3,600	2,906.50	10,463,400
新晃工業	1,500	3,240.00	4,860,000
大和冷機工業	2,200	1,428.00	3,141,600
セガサミーホールディングス	13,300	1,801.50	23,959,950
T P R	1,900	2,176.00	4,134,400
ツバキ・ナカシマ	3,200	740.00	2,368,000
ホシザキ	8,800	5,064.00	44,563,200
大豊工業	1,300	895.00	1,163,500
日本精工	27,600	821.80	22,681,680
NTN	32,100	317.60	10,194,960
ジェイテクト	13,200	1,422.50	18,777,000
不二越	1,100	3,405.00	3,745,500
ミネベアミツミ	26,000	3,172.00	82,472,000
日本トムソン	3,900	650.00	2,535,000
THK	8,600	3,441.00	29,592,600
ユーシン精機	1,600	675.00	1,080,000
前澤給装工業	1,100	1,296.00	1,425,600
イーグル工業	1,600	1,772.00	2,835,200
前澤工業	400	1,084.00	433,600
日本ピラー工業	1,400	5,890.00	8,246,000
キッツ	4,900	1,290.00	6,321,000
日立製作所	72,100	13,310.00	959,651,000
三菱電機	166,900	2,432.50	405,984,250
富士電機	9,100	9,239.00	84,074,900
東洋電機製造	300	1,072.00	321,600
安川電機	16,200	6,585.00	106,677,000
シンフォニアテクノロジー	1,600	2,789.00	4,462,400
明電舎	2,700	2,753.00	7,433,100
オリジン	300	1,234.00	370,200
山洋電気	600	6,850.00	4,110,000
デンヨー	1,100	2,380.00	2,618,000
PHCホールディングス	3,000	1,217.00	3,651,000
KOKUSAI ELECTRIC	5,800	4,650.00	26,970,000
ソシオネクスト	10,800	4,000.00	43,200,000
ベイカレント・コンサルティング	11,200	3,156.00	35,347,200
Orchestra Holdings	400	1,021.00	408,400
アイモバイル	2,400	461.00	1,106,400
キャリアインデックス	600	178.00	106,800
MS - Japan	500	1,180.00	590,000
船場	100	1,266.00	126,600
ジャパンエレベーターサービスホールディン	4,900	2,340.00	11,466,000
フルテック	100	1,100.00	110,000

グリーンズ	400	2,066.00	826,400
ツナググループ・ホールディングス	400	714.00	285,600
GameWith	700	304.00	212,800
MS&Consulting	100	590.00	59,000
ウェルビー	600	1,085.00	651,000
エル・ティー・エス	200	2,661.00	532,200
ミダックホールディングス	900	1,474.00	1,326,600
キュービーネットホールディングス	900	1,223.00	1,100,700
RPAホールディングス	2,200	283.00	622,600
三櫻工業	2,400	1,095.00	2,628,000
マキタ	17,100	3,914.00	66,929,400
東芝テック	2,000	3,080.00	6,160,000
芝浦メカトロニクス	800	6,710.00	5,368,000
マブチモーター	7,300	2,656.50	19,392,450
ニデック	33,100	5,664.00	187,478,400
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	600	354.00	212,400
トレックス・セミコンダクター	800	1,812.00	1,449,600
東光高岳	1,000	2,457.00	2,457,000
ダブル・スコープ	4,600	718.00	3,302,800
宮越ホールディングス	800	1,266.00	1,012,800
ダイヘン	1,500	8,490.00	12,735,000
ヤーマン	2,800	990.00	2,772,000
JVCケンウッド	11,700	843.00	9,863,100
ミマキエンジニアリング	1,500	1,081.00	1,621,500
I-PEX	1,000	1,824.00	1,824,000
大崎電気工業	3,700	652.00	2,412,400
オムロン	11,400	5,583.00	63,646,200
日東工業	2,000	4,455.00	8,910,000
IDEC	2,300	2,794.00	6,426,200
正興電機製作所	300	1,223.00	366,900
不二電機工業	200	1,130.00	226,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,800	2,834.00	16,437,200
サクサホールディングス	300	3,245.00	973,500
メルコホールディングス	400	3,185.00	1,274,000
テクノメディカ	500	1,781.00	890,500
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	600	655.00	393,000
日本電気	19,700	10,260.00	202,122,000
富士通	13,800	24,530.00	338,514,000
沖電気工業	6,700	1,084.00	7,262,800
岩崎通信機	600	641.00	384,600
電気興業	700	2,070.00	1,449,000
サンケン電気	1,400	8,226.00	11,516,400
ナカヨ	300	1,165.00	349,500
アイホン	800	2,901.00	2,320,800
ルネサスエレクトロニクス	97,700	2,753.50	269,016,950
セイコーエプソン	19,200	2,445.00	46,944,000
ワコム	11,200	640.00	7,168,000
アルバック	3,500	9,742.00	34,097,000

アクセル	600	2,074.00	1,244,400
E I Z O	1,100	5,170.00	5,687,000
ジャパンディスプレイ	62,800	21.00	1,318,800
日本信号	3,300	1,002.00	3,306,600
京三製作所	3,500	476.00	1,666,000
能美防災	2,000	2,241.00	4,482,000
ホーチキ	1,200	2,213.00	2,655,600
星和電機	400	523.00	209,200
エレコム	3,500	1,542.00	5,397,000
パナソニック ホールディングス	176,800	1,452.00	256,713,600
シャープ	25,100	817.00	20,506,700
アンリツ	10,500	1,293.00	13,576,500
富士通ゼネラル	4,200	1,976.50	8,301,300
ソニーグループ	105,000	12,950.00	1,359,750,000
T D K	23,700	8,198.00	194,292,600
帝国通信工業	700	1,899.00	1,329,300
タムラ製作所	5,800	544.00	3,155,200
アルプスアルパイン	13,300	1,111.50	14,782,950
池上通信機	600	799.00	479,400
日本電波工業	1,700	1,420.00	2,414,000
鈴木	1,000	1,170.00	1,170,000
メイコー	1,500	5,040.00	7,560,000
日本トリム	400	3,640.00	1,456,000
ローランド ディー . ジー .	900	5,010.00	4,509,000
フォスター電機	1,000	1,184.00	1,184,000
S M K	400	2,482.00	992,800
ヨコオ	1,300	1,590.00	2,067,000
ティアック	3,000	99.00	297,000
ホシデン	3,500	1,965.00	6,877,500
ヒロセ電機	2,200	15,500.00	34,100,000
日本航空電子工業	3,500	2,711.00	9,488,500
T O A	1,800	1,120.00	2,016,000
マクセル	3,300	1,560.00	5,148,000
古野電気	1,900	2,225.00	4,227,500
スミダコーポレーション	1,900	1,167.00	2,217,300
アイコム	600	3,335.00	2,001,000
リオン	600	2,951.00	1,770,600
横河電機	16,300	3,342.00	54,474,600
新電元工業	500	3,120.00	1,560,000
アズビル	10,200	4,236.00	43,207,200
東亜ディーケーケー	500	969.00	484,500
日本光電工業	6,300	4,140.00	26,082,000
チノー	600	2,431.00	1,458,600
共和電業	700	420.00	294,000
日本電子材料	1,000	3,305.00	3,305,000
堀場製作所	2,800	15,375.00	43,050,000
アドバンテスト	42,500	7,185.00	305,362,500
小野測器	600	591.00	354,600

エスベック	1,200	2,858.00	3,429,600
キーエンス	14,900	74,880.00	1,115,712,000
日置電機	700	6,740.00	4,718,000
シスメックス	12,800	8,249.00	105,587,200
日本マイクロニクス	2,600	8,280.00	21,528,000
メガチップス	1,200	4,250.00	5,100,000
OBARA GROUP	800	3,760.00	3,008,000
IMAGICA GROUP	1,600	720.00	1,152,000
澤藤電機	100	1,308.00	130,800
デンソー	122,300	2,801.50	342,623,450
原田工業	600	751.00	450,600
コーセル	1,700	1,588.00	2,699,600
イリソ電子工業	1,300	2,964.00	3,853,200
オプテックスグループ	2,800	1,842.00	5,157,600
千代田インテグレ	600	2,607.00	1,564,200
レーザーテック	6,800	41,440.00	281,792,000
スタンレー電気	9,500	2,613.00	24,823,500
ウシオ電機	7,500	2,077.50	15,581,250
岡谷電機産業	1,300	272.00	353,600
ヘリオス テクノ ホールディング	1,100	602.00	662,200
エノモト	400	1,603.00	641,200
日本セラミック	1,300	2,617.00	3,402,100
遠藤照明	300	1,509.00	452,700
古河電池	1,200	983.00	1,179,600
双信電機	900	292.00	262,800
山一電機	1,300	2,314.00	3,008,200
図研	1,300	4,765.00	6,194,500
日本電子	3,700	6,705.00	24,808,500
カシオ計算機	10,600	1,177.50	12,481,500
ファナック	72,300	4,534.00	327,808,200
日本シイエムケイ	3,300	605.00	1,996,500
エンプラス	400	8,610.00	3,444,000
大真空	2,100	843.00	1,770,300
ローム	27,400	2,534.00	69,431,600
浜松ホトニクス	11,900	5,380.00	64,022,000
三井ハイテック	1,300	8,541.00	11,103,300
新光電気工業	5,200	5,685.00	29,562,000
京セラ	92,100	2,189.00	201,606,900
協栄産業	100	3,010.00	301,000
太陽誘電	7,200	3,336.00	24,019,200
村田製作所	135,100	3,005.00	405,975,500
双葉電子工業	2,900	511.00	1,481,900
日東電工	9,600	13,990.00	134,304,000
北陸電気工業	300	1,430.00	429,000
東海理化電機製作所	4,100	2,437.00	9,991,700
ニチコン	3,800	1,241.00	4,715,800
日本ケミコン	1,700	1,388.00	2,359,600
K O A	2,300	1,506.00	3,463,800

三井E & S	7,600	2,390.00	18,164,000
日立造船	13,100	1,255.00	16,440,500
三菱重工業	26,200	12,300.00	322,260,000
川崎重工業	12,100	4,324.00	52,320,400
I H I	11,100	3,513.00	38,994,300
名村造船所	3,700	2,330.00	8,621,000
サノヤスホールディングス	1,400	149.00	208,600
スプリックス	300	813.00	243,900
マネジメントソリューションズ	700	2,865.00	2,005,500
プロレド・パートナーズ	600	385.00	231,000
and factory	300	312.00	93,600
テノ・ホールディングス	300	480.00	144,000
フロンティア・マネジメント	300	1,809.00	542,700
ピアラ	200	325.00	65,000
コプロ・ホールディングス	400	1,802.00	720,800
ギークス	400	465.00	186,000
アンビスホールディングス	1,600	2,327.00	3,723,200
カーブスホールディングス	4,000	726.00	2,904,000
フォーラムエンジニアリング	1,800	1,000.00	1,800,000
Fast Fitness Japan	500	944.00	472,000
日本車輛製造	400	2,400.00	960,000
三菱ロジスネクスト	2,500	1,806.00	4,515,000
近畿車輛	100	2,468.00	246,800
一家ホールディングス	400	713.00	285,200
フルサト・マルカホールディングス	1,500	2,219.00	3,328,500
ヤマエグループホールディングス	900	2,609.00	2,348,100
ジャパクラフトホールディングス	600	164.00	98,400
F P G	4,900	1,883.00	9,226,700
島根銀行	700	536.00	375,200
じもとホールディングス	500	675.00	337,500
全国保証	3,800	5,361.00	20,371,800
めぶきフィナンシャルグループ	72,200	469.70	33,912,340
ジャパンインベストメントアドバイザー	2,600	860.00	2,236,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,800	4,610.00	8,298,000
九州フィナンシャルグループ	28,100	1,140.00	32,034,000
かんぽ生命保険	14,800	2,870.00	42,476,000
ゆうちょ銀行	160,400	1,625.00	260,650,000
あんしん保証	1,300	250.00	325,000
富山第一銀行	4,500	947.00	4,261,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	78,200	759.80	59,416,360
ジェイリース	600	1,313.00	787,800
西日本フィナンシャルホールディングス	8,200	1,902.00	15,596,400
イントラスト	400	787.00	314,800
日本モーゲージサービス	600	533.00	319,800
C a s a	300	823.00	246,900
S B Iアルヒ	1,300	933.00	1,212,900
プレミアグループ	2,400	1,870.00	4,488,000
日産自動車	200,200	578.50	115,815,700

いすゞ自動車	43,100	2,094.00	90,251,400
トヨタ自動車	815,300	3,729.00	3,040,253,700
日野自動車	22,100	491.40	10,859,940
三菱自動車工業	57,600	468.70	26,997,120
エフテック	800	730.00	584,000
レシップホールディングス	400	695.00	278,000
GMB	100	1,122.00	112,200
ファルテック	100	542.00	54,200
武蔵精密工業	3,600	1,630.00	5,868,000
日産車体	1,700	969.00	1,647,300
新明和工業	4,400	1,202.00	5,288,800
極東開発工業	2,500	2,435.00	6,087,500
トピー工業	1,200	3,055.00	3,666,000
ティラド	300	3,880.00	1,164,000
曙ブレーキ工業	11,400	116.00	1,322,400
タチエス	2,600	1,998.00	5,194,800
NOK	5,700	2,055.00	11,713,500
フタバ産業	4,300	1,061.00	4,562,300
カヤバ	1,400	5,130.00	7,182,000
市光工業	2,500	553.00	1,382,500
大同メタル工業	3,200	566.00	1,811,200
プレス工業	6,000	668.00	4,008,000
ミクニ	1,300	472.00	613,600
太平洋工業	3,500	1,477.00	5,169,500
河西工業	1,100	234.00	257,400
アイシン	11,400	5,859.00	66,792,600
マツダ	49,000	1,755.50	86,019,500
今仙電機製作所	1,000	642.00	642,000
本田技研工業	362,100	1,798.50	651,236,850
スズキ	27,200	6,594.00	179,356,800
SUBARU	45,900	3,348.00	153,673,200
安永	300	723.00	216,900
ヤマハ発動機	64,000	1,362.00	87,168,000
小糸製作所	15,300	1,915.00	29,299,500
TBK	1,000	403.00	403,000
エクセディ	2,500	2,997.00	7,492,500
ミツバ	2,700	1,442.00	3,893,400
豊田合成	4,300	3,085.00	13,265,500
愛三工業	2,400	1,562.00	3,748,800
盟和産業	100	1,021.00	102,100
日本プラスト	600	562.00	337,200
ヨロズ	1,400	991.00	1,387,400
エフ・シー・シー	2,600	2,103.00	5,467,800
新家工業	100	4,025.00	402,500
シマノ	6,000	20,365.00	122,190,000
テイ・エス テック	5,200	1,910.50	9,934,600
三十三フィナンシャルグループ	1,300	1,987.00	2,583,100
第四北越フィナンシャルグループ	2,300	4,340.00	9,982,000

ひろぎんホールディングス	20,700	1,053.50	21,807,450
マーキュリアホールディングス	400	999.00	399,600
おきなわフィナンシャルグループ	1,200	2,570.00	3,084,000
ダイレクトマーケティングミックス	2,100	284.00	596,400
ポピンズ	200	1,370.00	274,000
LITALICO	1,100	2,045.00	2,249,500
コンフィデンス・インターワークス	100	1,652.00	165,200
十六フィナンシャルグループ	1,900	4,425.00	8,407,500
北國フィナンシャルホールディングス	1,500	4,695.00	7,042,500
ネットプロテクションズホールディングス	5,500	190.00	1,045,000
プロクレアホールディングス	1,700	1,890.00	3,213,000
FPパートナー	300	7,310.00	2,193,000
あいちフィナンシャルグループ	2,200	2,688.00	5,913,600
ジャムコ	500	1,270.00	635,000
小野建	1,700	1,801.00	3,061,700
はるやまホールディングス	500	629.00	314,500
南陽	200	2,754.00	550,800
ノジマ	4,500	1,686.00	7,587,000
佐鳥電機	800	2,547.00	2,037,600
カップ・クリエイト	2,400	1,650.00	3,960,000
エコートレーディング	100	1,207.00	120,700
伯東	900	5,900.00	5,310,000
コンドーテック	1,100	1,332.00	1,465,200
中山福	1,000	358.00	358,000
ライトオン	900	412.00	370,800
ナガイレーベン	1,900	2,242.00	4,259,800
三菱食品	1,400	5,430.00	7,602,000
良品計画	17,100	2,383.00	40,749,300
パリミキホールディングス	1,400	409.00	572,600
松田産業	1,300	2,325.00	3,022,500
第一興商	6,000	1,914.00	11,484,000
メディパルホールディングス	16,200	2,241.00	36,304,200
アドヴァングループ	1,600	1,214.00	1,942,400
SPK	800	2,018.00	1,614,400
萩原電気ホールディングス	700	4,660.00	3,262,000
アルビス	600	2,622.00	1,573,200
アズワン	2,400	5,002.00	12,004,800
スズデン	500	2,214.00	1,107,000
尾家産業	300	1,707.00	512,100
シモジマ	1,200	1,300.00	1,560,000
ドウシシャ	1,500	2,119.00	3,178,500
小津産業	200	1,699.00	339,800
コナカ	1,300	413.00	536,900
高速	900	2,427.00	2,184,300
ハウス オブ ローゼ	100	1,633.00	163,300
G-7ホールディングス	1,700	1,322.00	2,247,400
たけびし	700	1,971.00	1,379,700
イオン北海道	4,500	881.00	3,964,500

コジマ	2,900	735.00	2,131,500
ヒマラヤ	300	917.00	275,100
コーナン商事	2,000	3,970.00	7,940,000
ネットワンシステムズ	6,000	2,646.00	15,876,000
エコス	700	2,231.00	1,561,700
ワタミ	1,600	992.00	1,587,200
マルシェ	700	237.00	165,900
リックス	300	3,985.00	1,195,500
システムソフト	6,200	60.00	372,000
パン・パシフィック・インターナショナルホ	31,600	3,464.00	109,462,400
丸文	1,400	1,496.00	2,094,400
西松屋チェーン	3,200	2,216.00	7,091,200
ゼンショーホールディングス	8,000	6,408.00	51,264,000
ハピネット	1,300	3,130.00	4,069,000
幸楽苑ホールディングス	1,300	1,384.00	1,799,200
ハークスレイ	300	951.00	285,300
橋本総業ホールディングス	800	1,416.00	1,132,800
日本ライフライン	4,800	1,283.00	6,158,400
サイゼリヤ	2,300	4,740.00	10,902,000
タカショー	1,400	515.00	721,000
V Tホールディングス	6,400	518.00	3,315,200
アルゴグラフィックス	1,300	4,180.00	5,434,000
魚力	600	2,342.00	1,405,200
I D O M	4,200	896.00	3,763,200
日本エム・ディ・エム	1,200	689.00	826,800
ポプラ	700	260.00	182,000
フジ・コーポレーション	800	1,912.00	1,529,600
ユナイテッドアローズ	1,900	1,730.00	3,287,000
進和	1,000	2,412.00	2,412,000
エスケイジャパン	200	706.00	141,200
ダイترون	700	3,260.00	2,282,000
ハイデイ日高	2,400	2,574.00	6,177,600
シークス	2,300	1,616.00	3,716,800
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i	500	149.00	74,500
コロワイド	6,700	2,184.50	14,636,150
田中商事	200	849.00	169,800
オーハシテクニカ	800	1,767.00	1,413,600
壱番屋	6,000	1,205.00	7,230,000
白銅	400	2,566.00	1,026,400
トップカルチャー	400	160.00	64,000
P L A N T	200	1,724.00	344,800
スギホールディングス	9,300	2,337.50	21,738,750
ダイコー通産	300	1,261.00	378,300
薬王堂ホールディングス	700	2,787.00	1,950,900
島津製作所	19,700	4,118.00	81,124,600
J M S	1,700	519.00	882,300
クボテック	300	231.00	69,300
長野計器	1,200	2,439.00	2,926,800

ブイ・テクノロジー	800	2,603.00	2,082,400
スター精密	2,700	1,762.00	4,757,400
東京計器	1,300	2,504.00	3,255,200
愛知時計電機	600	2,434.00	1,460,400
インターアクション	800	1,252.00	1,001,600
オーバル	1,200	585.00	702,000
東京精密	3,000	11,695.00	35,085,000
マニー	5,900	2,103.00	12,407,700
ニコン	21,400	1,550.00	33,170,000
トプコン	7,100	1,763.50	12,520,850
オリンパス	91,200	2,148.50	195,943,200
理研計器	1,000	7,710.00	7,710,000
S C R E E Nホールディングス	5,100	19,445.00	99,169,500
キヤノン電子	1,600	2,460.00	3,936,000
タムロン	900	6,580.00	5,922,000
HOYA	29,200	19,855.00	579,766,000
シード	600	686.00	411,600
ノーリツ鋼機	1,400	3,210.00	4,494,000
A & Dホロンホールディングス	2,100	2,476.00	5,199,600
朝日インテック	18,100	3,089.00	55,910,900
キヤノン	74,100	4,390.00	325,299,000
リコー	37,100	1,276.00	47,339,600
シチズン時計	13,500	1,017.00	13,729,500
リズム	100	4,025.00	402,500
大研医器	1,000	554.00	554,000
メニコン	5,100	1,691.50	8,626,650
シンシア	400	500.00	200,000
KYORITSU	2,600	189.00	491,400
中本パックス	400	1,643.00	657,200
スノーピーク	2,300	1,245.00	2,863,500
パラマウントベッドホールディングス	3,000	2,504.00	7,512,000
トランザクション	1,000	2,446.00	2,446,000
粧美堂	400	653.00	261,200
ニホンフラッシュ	1,700	972.00	1,652,400
前田工織	1,200	3,430.00	4,116,000
永大産業	2,200	287.00	631,400
アートネイチャー	1,200	768.00	921,600
フルヤ金属	400	10,170.00	4,068,000
バンダイナムコホールディングス	40,600	2,913.50	118,288,100
アイフィスジャパン	300	618.00	185,400
S H O E I	3,300	2,136.00	7,048,800
フランスベッドホールディングス	1,800	1,282.00	2,307,600
マーベラス	2,700	718.00	1,938,600
パイロットコーポレーション	2,100	3,805.00	7,990,500
萩原工業	1,000	1,489.00	1,489,000
エイベックス	2,500	1,284.00	3,210,000
フジシールインターナショナル	2,900	2,018.00	5,852,200
タカラトミー	6,700	2,637.50	17,671,250

広済堂ホールディングス	3,500	625.00	2,187,500
エステールホールディングス	400	650.00	260,000
レック	2,200	1,105.00	2,431,000
タカノ	400	1,032.00	412,800
三光合成	2,300	671.00	1,543,300
プロネクサス	1,300	1,235.00	1,605,500
ホクシン	200	121.00	24,200
ウッドワン	300	1,048.00	314,400
きもと	1,400	216.00	302,400
TOPPANホールディングス	18,200	3,450.00	62,790,000
大日本印刷	16,200	4,268.00	69,141,600
共同印刷	400	3,285.00	1,314,000
NISSHA	2,700	1,537.00	4,149,900
光村印刷	100	1,593.00	159,300
藤森工業	1,100	3,910.00	4,301,000
ヴィア・ホールディングス	2,400	131.00	314,400
TAKARA & COMPANY	900	2,761.00	2,484,900
前澤化成工業	1,100	1,653.00	1,818,300
未来工業	600	4,970.00	2,982,000
アシックス	12,600	6,558.00	82,630,800
ツツミ	300	2,085.00	625,500
ウェーブロックホールディングス	300	679.00	203,700
JSP	1,200	2,227.00	2,672,400
ニチハ	1,900	3,375.00	6,412,500
ローランド	1,100	4,525.00	4,977,500
エフピコ	2,800	2,684.00	7,515,200
小松ウオール工業	600	3,355.00	2,013,000
ヤマハ	9,300	3,148.00	29,276,400
河合楽器製作所	400	3,335.00	1,334,000
クリナップ	1,300	758.00	985,400
ピジョン	9,400	1,527.00	14,353,800
天馬	1,100	2,365.00	2,601,500
キングジム	1,200	872.00	1,046,400
象印マホービン	4,000	1,396.00	5,584,000
リンテック	2,900	3,115.00	9,033,500
信越ポリマー	3,100	1,576.00	4,885,600
東リ	1,400	401.00	561,400
イトーキ	3,000	1,642.00	4,926,000
任天堂	93,700	8,390.00	786,143,000
三菱鉛筆	2,100	2,479.00	5,205,900
松風	600	2,727.00	1,636,200
タカラスタンダード	3,100	1,832.00	5,679,200
コクヨ	6,000	2,368.00	14,208,000
ナカバヤシ	1,700	533.00	906,100
ニフコ	4,400	3,710.00	16,324,000
立川ブラインド工業	900	1,492.00	1,342,800
グローブライド	1,400	1,985.00	2,779,000
オカムラ	4,400	2,140.00	9,416,000

バルカー	1,300	4,825.00	6,272,500
MUTOHホールディングス	200	2,249.00	449,800
伊藤忠商事	105,600	6,666.00	703,929,600
丸紅	131,000	2,512.00	329,072,000
スクロール	2,600	930.00	2,418,000
高島	800	1,363.00	1,090,400
ヨンドシーホールディングス	1,400	1,918.00	2,685,200
三陽商会	500	2,522.00	1,261,000
長瀬産業	7,100	2,478.50	17,597,350
ナイガイ	1,200	261.00	313,200
蝶理	900	3,155.00	2,839,500
豊田通商	13,800	10,160.00	140,208,000
オンワードホールディングス	9,000	497.00	4,473,000
三共生興	2,000	774.00	1,548,000
兼松	6,500	2,548.00	16,562,000
美津濃	1,400	5,330.00	7,462,000
ツカモトコーポレーション	200	1,270.00	254,000
ルックホールディングス	400	2,482.00	992,800
三井物産	118,400	6,816.00	807,014,400
日本紙パルプ商事	800	5,110.00	4,088,000
東京エレクトロン	31,400	39,450.00	1,238,730,000
カメイ	1,800	1,955.00	3,519,000
東都水産	100	6,180.00	618,000
OUGホールディングス	200	2,556.00	511,200
スターゼン	1,100	2,818.00	3,099,800
セイコーグループ	2,100	3,725.00	7,822,500
山善	4,600	1,316.00	6,053,600
椿本興業	300	7,090.00	2,127,000
住友商事	95,100	3,582.00	340,648,200
BIPROGY	4,800	4,568.00	21,926,400
内田洋行	600	7,010.00	4,206,000
三菱商事	301,700	3,287.00	991,687,900
第一実業	1,500	2,137.00	3,205,500
キヤノンマーケティングジャパン	3,600	4,366.00	15,717,600
西華産業	700	3,230.00	2,261,000
佐藤商事	1,000	1,779.00	1,779,000
菱洋エレクトロ	1,500	4,050.00	6,075,000
東京産業	1,800	713.00	1,283,400
ユアサ商事	1,200	5,060.00	6,072,000
神鋼商事	400	7,170.00	2,868,000
トルク	400	296.00	118,400
阪和興業	2,800	5,700.00	15,960,000
正栄食品工業	1,100	4,670.00	5,137,000
カナデン	1,100	1,548.00	1,702,800
RYODEN	1,200	2,595.00	3,114,000
ニプロ	12,300	1,227.00	15,092,100
岩谷産業	3,600	7,751.00	27,903,600
ナイス	400	1,550.00	620,000

ニチモウ	400	2,147.00	858,800
極東貿易	1,000	2,185.00	2,185,000
アステナホールディングス	2,800	473.00	1,324,400
三愛オブリ	3,900	1,983.00	7,733,700
稲畑産業	3,100	3,190.00	9,889,000
G S Iクレオス	800	2,362.00	1,889,600
明和産業	1,900	655.00	1,244,500
クワザワホールディングス	300	889.00	266,700
キムラタン	14,500	18.00	261,000
ゴールドウイン	2,600	8,832.00	22,963,200
ユニ・チャーム	31,000	4,879.00	151,249,000
デザート	2,500	3,390.00	8,475,000
キング	300	702.00	210,600
ワキタ	2,700	1,553.00	4,193,100
ヤマトインターナショナル	900	297.00	267,300
東邦ホールディングス	4,300	3,200.00	13,760,000
サンゲツ	3,600	3,365.00	12,114,000
ミツウロコグループホールディングス	2,100	1,420.00	2,982,000
シナネンホールディングス	400	4,380.00	1,752,000
伊藤忠エネクス	3,800	1,516.00	5,760,800
サンリオ	4,400	8,723.00	38,381,200
サンワテクノス	900	2,388.00	2,149,200
リョーサン	1,100	5,240.00	5,764,000
新光商事	2,100	1,211.00	2,543,100
トーヨー	700	2,925.00	2,047,500
三信電気	700	2,271.00	1,589,700
東陽テクニカ	1,700	1,488.00	2,529,600
モスフードサービス	2,300	3,495.00	8,038,500
加賀電子	1,400	6,490.00	9,086,000
三益半導体工業	1,400	3,270.00	4,578,000
都築電気	900	2,464.00	2,217,600
ソーダニッカ	1,300	1,233.00	1,602,900
立花エレテック	1,100	3,170.00	3,487,000
木曽路	2,300	2,669.00	6,138,700
S R Sホールディングス	2,500	1,191.00	2,977,500
千趣会	3,700	281.00	1,039,700
タカキュー	3,300	67.00	221,100
リテールパートナーズ	2,300	1,681.00	3,866,300
上新電機	1,500	2,349.00	3,523,500
日本瓦斯	8,300	2,401.00	19,928,300
ロイヤルホールディングス	2,700	2,391.00	6,455,700
東天紅	300	846.00	253,800
いなげや	1,400	1,304.00	1,825,600
チヨダ	1,500	877.00	1,315,500
ライフコーポレーション	1,600	3,660.00	5,856,000
リンガーハット	2,100	2,302.00	4,834,200
MrMaxHD	1,800	602.00	1,083,600
テンアライド	1,400	315.00	441,000

AOKIホールディングス	3,300	1,104.00	3,643,200
オークワ	2,200	828.00	1,821,600
コメリ	2,500	3,340.00	8,350,000
青山商事	3,500	1,636.00	5,726,000
しまむら	3,700	7,816.00	28,919,200
はせがわ	500	348.00	174,000
高島屋	10,800	2,262.00	24,429,600
松屋	2,500	968.00	2,420,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,900	1,764.00	12,171,600
近鉄百貨店	600	2,392.00	1,435,200
丸井グループ	10,400	2,386.00	24,814,400
クレディセゾン	9,200	2,976.50	27,383,800
アクシアル リテイリング	1,000	3,945.00	3,945,000
井筒屋	500	345.00	172,500
イオン	53,300	3,538.00	188,575,400
イズミ	2,800	3,433.00	9,612,400
フォーバル	700	1,233.00	863,100
平和堂	2,600	1,943.00	5,051,800
フジ	2,400	1,832.00	4,396,800
ヤオコー	1,800	8,444.00	15,199,200
ゼビオホールディングス	2,400	967.00	2,320,800
ケーズホールディングス	11,000	1,276.00	14,036,000
PALTAC	2,100	4,177.00	8,771,700
三谷産業	2,800	396.00	1,108,800
Olympicグループ	300	507.00	152,100
日産東京販売ホールディングス	1,800	522.00	939,600
あおぞら銀行	10,500	2,524.00	26,502,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	890,600	1,596.50	1,421,842,900
りそなホールディングス	170,100	864.90	147,119,490
三井住友トラスト・ホールディングス	52,400	3,188.00	167,051,200
三井住友フィナンシャルグループ	104,000	8,623.00	896,792,000
千葉銀行	40,600	1,227.00	49,816,200
群馬銀行	28,200	812.50	22,912,500
武蔵野銀行	2,100	2,869.00	6,024,900
千葉興業銀行	2,400	998.00	2,395,200
筑波銀行	6,700	287.00	1,922,900
七十七銀行	4,200	3,900.00	16,380,000
秋田銀行	1,100	2,109.00	2,319,900
山形銀行	1,800	1,167.00	2,100,600
岩手銀行	900	2,681.00	2,412,900
東邦銀行	12,400	346.00	4,290,400
東北銀行	500	1,235.00	617,500
ふくおかフィナンシャルグループ	12,700	4,025.00	51,117,500
スルガ銀行	12,700	783.00	9,944,100
八十二銀行	31,200	929.90	29,012,880
山梨中央銀行	1,700	1,858.00	3,158,600
大垣共立銀行	2,700	2,186.00	5,902,200
福井銀行	1,200	1,872.00	2,246,400

清水銀行	600	1,592.00	955,200
富山銀行	100	1,828.00	182,800
滋賀銀行	2,400	4,105.00	9,852,000
南都銀行	2,300	2,859.00	6,575,700
百五銀行	13,600	654.00	8,894,400
紀陽銀行	5,200	1,828.00	9,505,600
ほくほくフィナンシャルグループ	9,000	1,772.50	15,952,500
山陰合同銀行	9,000	1,172.00	10,548,000
鳥取銀行	400	1,473.00	589,200
百十四銀行	1,500	2,844.00	4,266,000
四国銀行	2,000	1,149.00	2,298,000
阿波銀行	2,000	2,738.00	5,476,000
大分銀行	800	2,791.00	2,232,800
宮崎銀行	800	2,822.00	2,257,600
佐賀銀行	900	2,023.00	1,820,700
琉球銀行	3,200	1,153.00	3,689,600
セブン銀行	45,400	296.50	13,461,100
みずほフィナンシャルグループ	197,400	2,878.00	568,117,200
高知銀行	300	1,003.00	300,900
山口フィナンシャルグループ	14,200	1,547.00	21,967,400
芙蓉総合リース	1,300	13,255.00	17,231,500
みずほリース	2,400	5,400.00	12,960,000
東京センチュリー	10,800	1,576.00	17,020,800
SBIホールディングス	21,400	3,968.00	84,915,200
日本証券金融	5,300	1,658.00	8,787,400
アイフル	21,200	407.00	8,628,400
日本アジア投資	800	230.00	184,000
名古屋銀行	1,000	6,510.00	6,510,000
北洋銀行	21,800	420.00	9,156,000
大光銀行	300	1,445.00	433,500
愛媛銀行	1,900	1,139.00	2,164,100
トマト銀行	300	1,288.00	386,400
京葉銀行	6,300	747.00	4,706,100
栃木銀行	7,900	345.00	2,725,500
北日本銀行	600	2,284.00	1,370,400
東和銀行	2,800	686.00	1,920,800
福島銀行	1,300	264.00	343,200
大東銀行	400	770.00	308,000
リコーリース	1,400	5,130.00	7,182,000
イオンフィナンシャルサービス	8,300	1,285.00	10,665,500
アコム	25,800	389.90	10,059,420
ジャックス	1,500	5,420.00	8,130,000
オリエントコーポレーション	4,700	1,068.00	5,019,600
オリックス	87,700	3,184.00	279,236,800
三菱HCキャピタル	65,000	1,045.00	67,925,000
ジャフコグループ	4,500	1,731.00	7,789,500
九州リースサービス	400	1,495.00	598,000
トモニホールディングス	13,600	413.00	5,616,800

大和証券グループ本社	113,000	1,124.00	127,012,000
野村ホールディングス	245,400	906.70	222,504,180
岡三証券グループ	12,700	789.00	10,020,300
丸三証券	4,700	1,025.00	4,817,500
東洋証券	3,600	388.00	1,396,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	17,100	600.00	10,260,000
光世証券	100	764.00	76,400
水戸証券	4,100	498.00	2,041,800
いちよし証券	3,100	815.00	2,526,500
松井証券	7,400	845.00	6,253,000
SOMPOホールディングス	22,000	9,052.00	199,144,000
日本取引所グループ	38,100	4,102.00	156,286,200
マネックスグループ	14,200	947.00	13,447,400
極東証券	2,000	1,088.00	2,176,000
岩井コスモホールディングス	1,800	2,295.00	4,131,000
アイザワ証券グループ	2,000	1,180.00	2,360,000
フィデアホールディングス	1,600	1,610.00	2,576,000
池田泉州ホールディングス	20,200	387.00	7,817,400
アニコムホールディングス	4,800	571.00	2,740,800
MS&ADインシュアランスグループホール	32,700	7,586.00	248,062,200
マネーパートナーズグループ	700	297.00	207,900
スパークス・グループ	1,600	1,900.00	3,040,000
小林洋行	1,300	269.00	349,700
第一生命ホールディングス	71,300	3,591.00	256,038,300
東京海上ホールディングス	144,500	4,408.00	636,956,000
アドバンテッジリスクマネジメント	400	404.00	161,600
イー・ギャランティ	2,300	1,900.00	4,370,000
アサックス	600	749.00	449,400
NECキャピタルソリューション	800	3,765.00	3,012,000
T&Dホールディングス	39,200	2,683.00	105,173,600
アドバンスクリエイト	900	1,003.00	902,700
三井不動産	67,500	4,220.00	284,850,000
三菱地所	95,400	2,428.50	231,678,900
平和不動産	2,300	3,765.00	8,659,500
東京建物	12,700	2,192.00	27,838,400
京阪神ビルディング	2,700	1,449.00	3,912,300
住友不動産	21,100	4,476.00	94,443,600
太平洋興発	200	828.00	165,600
テーオーシー	2,900	657.00	1,905,300
レオパレス21	15,100	451.00	6,810,100
スターツコーポレーション	2,100	2,967.00	6,230,700
フジ住宅	1,700	721.00	1,225,700
空港施設	2,000	599.00	1,198,000
明和地所	700	1,089.00	762,300
ゴールドクレスト	1,200	2,250.00	2,700,000
リログループ	7,600	1,182.00	8,983,200
エスリード	700	3,370.00	2,359,000
日神グループホールディングス	2,600	510.00	1,326,000

日本エスコン	2,900	1,013.00	2,937,700
MIRARTHホールディングス	6,800	484.00	3,291,200
AVANTIA	500	846.00	423,000
イオンモール	7,500	1,724.50	12,933,750
毎日コムネット	400	770.00	308,000
ファースト住建	300	1,105.00	331,500
ランド	110,100	7.00	770,700
カチタス	3,900	2,013.00	7,850,700
東祥	1,300	765.00	994,500
トーセイ	2,400	1,993.00	4,783,200
穴吹興産	200	2,062.00	412,400
サンフロンティア不動産	2,200	1,638.00	3,603,600
FJネクストホールディングス	1,600	1,185.00	1,896,000
インテリックス	600	539.00	323,400
ランドビジネス	200	264.00	52,800
サンネクスタグループ	300	954.00	286,200
グランディハウス	700	646.00	452,200
東武鉄道	16,300	3,892.00	63,439,600
相鉄ホールディングス	5,300	2,749.00	14,569,700
東急	41,500	1,931.50	80,157,250
京浜急行電鉄	18,300	1,309.50	23,963,850
小田急電鉄	24,500	2,094.00	51,303,000
京王電鉄	7,100	4,148.00	29,450,800
京成電鉄	9,500	6,941.00	65,939,500
富士急行	1,800	3,900.00	7,020,000
東日本旅客鉄道	27,300	8,788.00	239,912,400
西日本旅客鉄道	17,600	6,213.00	109,348,800
東海旅客鉄道	57,100	3,794.00	216,637,400
西武ホールディングス	17,900	2,164.00	38,735,600
鴻池運輸	2,600	1,804.00	4,690,400
西日本鉄道	3,900	2,382.00	9,289,800
ハマキョウレックス	1,300	3,715.00	4,829,500
サカイ引越センター	1,600	2,550.00	4,080,000
近鉄グループホールディングス	14,800	4,601.00	68,094,800
阪急阪神ホールディングス	19,700	4,409.00	86,857,300
南海電気鉄道	6,600	3,063.00	20,215,800
京阪ホールディングス	8,100	3,431.00	27,791,100
神戸電鉄	500	2,832.00	1,416,000
名古屋鉄道	15,200	2,127.50	32,338,000
山陽電気鉄道	1,100	2,133.00	2,346,300
アルプス物流	1,100	2,507.00	2,757,700
トランコム	400	6,120.00	2,448,000
ヤマトホールディングス	18,900	2,182.00	41,239,800
山九	3,700	5,206.00	19,262,200
日新	1,100	2,875.00	3,162,500
丸運	700	276.00	193,200
丸全昭和運輸	900	4,380.00	3,942,000
センコーグループホールディングス	7,700	1,067.00	8,215,900

トナミホールディングス	300	4,355.00	1,306,500
ニッコンホールディングス	4,700	3,005.00	14,123,500
日本石油輸送	100	2,850.00	285,000
福山通運	1,700	3,940.00	6,698,000
セイノーホールディングス	8,300	2,094.00	17,380,200
エスライングループ本社	500	890.00	445,000
神奈川中央交通	500	3,040.00	1,520,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	3,900	1,462.00	5,701,800
C & F ロジホールディングス	1,600	1,880.00	3,008,000
日本郵船	42,400	4,634.00	196,481,600
商船三井	32,100	5,029.00	161,430,900
川崎汽船	11,900	7,174.00	85,370,600
N S ユナイテッド海運	800	5,210.00	4,168,000
明海グループ	900	870.00	783,000
飯野海運	5,400	1,280.00	6,912,000
共栄タンカー	100	1,146.00	114,600
九州旅客鉄道	10,400	3,534.00	36,753,600
S G ホールディングス	24,800	1,861.00	46,152,800
N I P P O N E X P R E S S ホールディン	5,000	7,657.00	38,285,000
I D & E ホールディングス	1,000	3,765.00	3,765,000
日本航空	36,300	2,726.50	98,971,950
A N A ホールディングス	40,200	3,182.00	127,916,400
ビーウィズ	300	2,139.00	641,700
パスコ	200	1,874.00	374,800
T R E ホールディングス	2,800	1,241.00	3,474,800
人・夢・技術グループ	600	1,704.00	1,022,400
西本W i s m e t t a c ホールディングス	400	5,910.00	2,364,000
シルバーライフ	500	838.00	419,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	2,548.00	509,600
G e n k y D r u g S t o r e s	700	6,290.00	4,403,000
コア商事ホールディングス	800	724.00	579,200
K P P グループホールディングス	4,100	677.00	2,775,700
ナルミヤ・インターナショナル	100	1,162.00	116,200
ブックオフグループホールディングス	900	1,290.00	1,161,000
ギフトホールディングス	600	2,900.00	1,740,000
三菱倉庫	3,600	4,607.00	16,585,200
三井倉庫ホールディングス	1,400	4,620.00	6,468,000
住友倉庫	4,000	2,530.00	10,120,000
澁澤倉庫	600	2,997.00	1,798,200
ヤマタネ	700	2,667.00	1,866,900
東陽倉庫	300	1,508.00	452,400
乾汽船	1,700	1,002.00	1,703,400
日本トランスシティ	3,300	614.00	2,026,200
ケイヒン	300	1,975.00	592,500
中央倉庫	800	1,144.00	915,200
川西倉庫	300	1,214.00	364,200
安田倉庫	1,100	1,222.00	1,344,200
ファイズホールディングス	100	1,180.00	118,000

N I S S Oホールディングス	1,500	813.00	1,219,500
大栄環境	2,700	2,749.00	7,422,300
日本管財ホールディングス	1,600	2,547.00	4,075,200
東洋埠頭	200	1,371.00	274,200
上組	6,800	3,317.00	22,555,600
サンリツ	200	777.00	155,400
キムラユニティー	600	1,591.00	954,600
キューソー流通システム	400	998.00	399,200
東海運	1,000	300.00	300,000
エーアイティー	1,000	1,738.00	1,738,000
内外トランスライン	600	2,345.00	1,407,000
ショーエイコーポレーション	700	620.00	434,000
日本コンセプト	600	1,839.00	1,103,400
T B Sホールディングス	7,400	4,053.00	29,992,200
日本テレビホールディングス	13,100	2,130.00	27,903,000
朝日放送グループホールディングス	1,400	687.00	961,800
テレビ朝日ホールディングス	3,600	1,929.00	6,944,400
スカパーJ S A Tホールディングス	11,400	952.00	10,852,800
テレビ東京ホールディングス	1,000	2,931.00	2,931,000
日本B S放送	500	890.00	445,000
ビジョン	2,300	1,152.00	2,649,600
スマートバリュー	100	415.00	41,500
U S E N - N E X T H O L D I N G S	1,600	4,405.00	7,048,000
ワイヤレスゲート	1,100	212.00	233,200
日本通信	15,900	214.00	3,402,600
クロップス	300	1,003.00	300,900
日本電信電話	4,429,700	180.70	800,446,790
K D D I	115,100	4,506.00	518,640,600
ソフトバンク	239,700	1,953.00	468,134,100
光通信	1,500	27,465.00	41,197,500
エムティーアイ	1,000	760.00	760,000
G M Oインターネットグループ	5,500	2,871.00	15,790,500
ファイバーゲート	1,000	1,000.00	1,000,000
アйдママーケティングコミュニケーション	200	233.00	46,600
K A D O K A W A	7,800	2,805.50	21,882,900
学研ホールディングス	2,400	950.00	2,280,000
ゼンリン	2,400	837.00	2,008,800
昭文社ホールディングス	400	385.00	154,000
インプレスホールディングス	900	170.00	153,000
東京電力ホールディングス	133,500	772.00	103,062,000
中部電力	54,600	1,880.00	102,648,000
関西電力	57,200	1,925.00	110,110,000
中国電力	25,700	1,012.00	26,008,400
北陸電力	15,000	707.60	10,614,000
東北電力	38,900	1,003.50	39,036,150
四国電力	13,700	1,089.50	14,926,150
九州電力	34,100	1,242.00	42,352,200
北海道電力	14,200	682.80	9,695,760

沖縄電力	3,600	1,107.00	3,985,200
電源開発	12,100	2,465.00	29,826,500
エフオン	1,200	405.00	486,000
イーレックス	2,900	708.00	2,053,200
レノバ	3,900	1,101.00	4,293,900
東京瓦斯	31,300	3,351.00	104,886,300
大阪瓦斯	30,000	3,042.00	91,260,000
東邦瓦斯	6,400	2,965.50	18,979,200
北海道瓦斯	1,000	2,258.00	2,258,000
広島ガス	3,800	378.00	1,436,400
西部ガスホールディングス	1,600	1,869.00	2,990,400
静岡ガス	3,200	924.00	2,956,800
メタウォーター	1,900	2,249.00	4,273,100
M & A 総研ホールディングス	700	6,980.00	4,886,000
アイネット	1,000	2,173.00	2,173,000
松竹	800	10,225.00	8,180,000
東宝	8,200	4,845.00	39,729,000
エイチ・アイ・エス	4,400	1,677.00	7,378,800
東映	500	19,820.00	9,910,000
ラックランド	600	2,276.00	1,365,600
NTTデータグループ	38,800	2,495.00	96,806,000
共立メンテナンス	2,400	6,132.00	14,716,800
イチネンホールディングス	1,800	1,638.00	2,948,400
建設技術研究所	800	5,750.00	4,600,000
スペース	1,000	988.00	988,000
アインホールディングス	2,100	4,546.00	9,546,600
燦ホールディングス	1,400	1,030.00	1,442,000
ピー・シー・エー	1,000	1,673.00	1,673,000
スバル興業	500	3,100.00	1,550,000
東京テアトル	400	1,125.00	450,000
タナベコンサルティンググループ	300	1,049.00	314,700
ビジネスブレイン太田昭和	600	2,263.00	1,357,800
ナガワ	500	7,590.00	3,795,000
東京都競馬	1,300	4,075.00	5,297,500
常磐興産	400	1,246.00	498,400
カナモト	2,300	2,874.00	6,610,200
D T S	3,100	4,020.00	12,462,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,800	6,133.00	41,704,400
シーイーシー	1,900	1,824.00	3,465,600
カプコン	13,300	5,962.00	79,294,600
ニシオホールディングス	1,400	3,895.00	5,453,000
アイ・エス・ピー	900	1,367.00	1,230,300
アゴーラ ホスピタリティー グループ	9,000	81.00	729,000
日本空港ビルデング	5,100	5,649.00	28,809,900
トランス・コスモス	1,900	3,020.00	5,738,000
乃村工藝社	7,000	845.00	5,915,000
ジャステック	900	1,373.00	1,235,700
S C S K	10,400	2,812.00	29,244,800

藤田観光	600	5,840.00	3,504,000
KNT - CTホールディングス	1,000	1,200.00	1,200,000
トーカイ	1,300	2,165.00	2,814,500
白洋舎	100	2,696.00	269,600
セコム	15,500	11,355.00	176,002,500
NSW	600	3,245.00	1,947,000
セントラル警備保障	900	2,504.00	2,253,600
アイネス	1,100	1,618.00	1,779,800
丹青社	3,300	800.00	2,640,000
メイテックグループホールディングス	5,500	3,067.00	16,868,500
TKC	2,300	3,670.00	8,441,000
富士ソフト	3,000	6,270.00	18,810,000
応用地質	1,400	2,253.00	3,154,200
船井総研ホールディングス	3,100	2,488.00	7,712,800
NSD	5,300	2,854.00	15,126,200
進学会ホールディングス	200	269.00	53,800
丸紅建材リース	100	2,987.00	298,700
オオバ	700	978.00	684,600
コナミグループ	5,600	10,180.00	57,008,000
いであ	200	2,296.00	459,200
学究社	600	2,066.00	1,239,600
ベネッセホールディングス	5,100	2,580.00	13,158,000
イオンディライト	1,600	3,380.00	5,408,000
ナック	1,800	570.00	1,026,000
福井コンピュータホールディングス	900	2,619.00	2,357,100
ダイセキ	3,100	3,735.00	11,578,500
ステップ	700	2,001.00	1,400,700
泉州電業	800	4,250.00	3,400,000
元気寿司	900	3,600.00	3,240,000
トラスコ中山	3,300	2,232.00	7,365,600
ヤマダホールディングス	48,000	430.00	20,640,000
オートバックスセブン	5,400	1,627.50	8,788,500
モリト	1,200	1,422.00	1,706,400
アークランズ	4,600	1,621.00	7,456,600
ニトリホールディングス	5,700	22,680.00	129,276,000
グルメ杵屋	1,200	1,115.00	1,338,000
愛眼	1,300	187.00	243,100
ケーユーホールディングス	600	1,182.00	709,200
吉野家ホールディングス	5,700	3,243.00	18,485,100
加藤産業	1,900	4,650.00	8,835,000
北恵	200	855.00	171,000
イノテック	900	2,056.00	1,850,400
イエローハット	2,600	1,890.00	4,914,000
松屋フーズホールディングス	700	5,880.00	4,116,000
JBC Cホールディングス	1,000	3,600.00	3,600,000
JKホールディングス	1,300	1,031.00	1,340,300
サガミホールディングス	2,400	1,513.00	3,631,200
日伝	1,000	2,686.00	2,686,000

関西フードマーケット	1,000	1,585.00	1,585,000	
ミロク情報サービス	1,500	1,888.00	2,832,000	
北沢産業	500	346.00	173,000	
杉本商事	800	2,236.00	1,788,800	
因幡電機産業	4,000	3,515.00	14,060,000	
王将フードサービス	1,200	7,770.00	9,324,000	
ミニストップ	1,200	1,530.00	1,836,000	
アークス	2,800	3,010.00	8,428,000	
パローホールディングス	3,000	2,390.00	7,170,000	
東テク	500	7,180.00	3,590,000	
ミスミグループ本社	23,600	2,258.00	53,288,800	
アルテック	1,000	272.00	272,000	
ベルク	800	6,150.00	4,920,000	
大庄	700	1,268.00	887,600	
タキヒヨー	300	1,163.00	348,900	
ファーストリテイリング	7,100	44,280.00	314,388,000	
ソフトバンクグループ	73,500	9,008.00	662,088,000	
蔵王産業	200	2,567.00	513,400	
スズケン	5,900	4,471.00	26,378,900	
サンドラッグ	5,300	4,582.00	24,284,600	
サックスパー ホールディングス	1,500	875.00	1,312,500	
ジェコス	1,000	1,122.00	1,122,000	
ヤマザワ	100	1,252.00	125,200	
やまや	100	3,330.00	333,000	
ベルーナ	4,000	611.00	2,444,000	
合 計	23,202,300		57,233,358,650	

株式以外の有価証券

該当する事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等関係に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

(2024年3月29日現在)

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

<参考情報>

親投資信託受益証券（日本株式インデックス・マザーファンド）

(2024年3月29日現在)

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

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

(1) 受益証券の名義書換等

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。したがって該当事項はありません。

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

(2) 受益者等名簿の閉鎖の時期

該当事項はありません。

(3) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(4) 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容

< 受益権の譲渡 >

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みません。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

< 受益権の譲渡の対抗要件 >

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

(5) その他内国投資信託受益証券事務に関し投資者に示すことが必要な事項

< 受益権の再分割 >

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

< 償還金 >

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された

受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。)に支払います。

< 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて >

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（本書提出日現在）

資本金の額

委託会社の資本金の額は金3億1千万円です。

発行する株式の総数

委託会社の発行する株式の総数は6,200株です。

発行済株式の総数

委託会社の発行済株式総数は6,200株です。

最近5年間における主な資本金の額の増減

該当事項はありません。

(2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

投資運用の意思決定機構

1) 運用基本方針の決定

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

2) 運用実施計画の作成

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

3) 運用の実行

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

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また金融商品取引法に定める投資助言業、第一種金融商品取引業及び第二種金融商品取引業を行っています。

2024年3月末現在、委託会社の運用する証券投資信託は、123本であり、その純資産総額は3,598,216百万円です（親投資信託を除く、公募投資信託および私募投資信託の合計値です。）。

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（以下「委託会社」といいます）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規制」（昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という）ならびに同規則第38条第1項及び第57条第1項の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期事業年度（2022年4月1日から2023年3月31日まで）の財務諸表ならびに第27期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

1. 財務諸表

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

資本金	310,000			310,000		
利益剰余金						
利益準備金	77,500			77,500		
その他利益剰余金						
別途積立金	31,620			31,620		
繰越利益剰余金	6,450,484			6,784,466		
純資産合計		6,869,604	87.1		7,203,586	88.5
負債・純資産合計		7,884,475	100.0		8,140,419	100.0

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

雑収入		881		106	
営業外収益計		1,913	0.0	136,383	2.5
営業外費用					
移転価格調整金	1	363,220		-	
為替差損		214		1,046	
有価証券運用損		1		-	
雑損失		329		73	
営業外費用計		363,766	6.3	1,119	0.0
経常利益		1,357,491	23.5	1,790,188	32.6
特別利益					
事業再構築費用戻入		7,084		-	
特別利益計		7,084	0.1	-	0.0
特別損失					
事務処理損失		146		4,303	
固定資産除却損		2,326		-	
特別損失計		2,472	0.0	4,303	0.1
税引前当期純利益		1,362,102	23.6	1,785,884	32.5
法人税,住民税及び事業税		261,905	4.5	324,907	5.9
法人税等調整額		261,874	4.5	288,994	5.3
当期純利益		838,322	14.5	1,171,982	21.3

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

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

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	有価証券 売買目的有価証券 決算期末日の市場価格等に基づく時価法（取得原価は移動平均法により算定）を採用しております。
--------------------	---

2. 固定資産の減価償却方法	有形固定資産 リース資産以外の有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下の通りであります 器具備品 3～7年
3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当期に負担すべき金額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、必要額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異 発生の翌事業年度に一括損益処理しております。</p>
5. 収益の計上方法	<p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託約款に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資信託約款毎に、日々の純資産総額に信託報酬率を乗じた金額で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問収入 投資顧問収入は、投資顧問契約に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資顧問契約毎に計算基礎額に投資顧問料率を乗じた金額で収益を認識しております。</p>
6. その他 財務諸表作成のための重要な事項	消費税等の処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

会計方針の変更

（時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用）

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

会計上の見積りに関する注記

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

繰延税金資産 1,537,341千円

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

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

注記事項

（貸借対照表関係）

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

（損益計算書関係）

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1. 発行済株式の総数に関する事項

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

2. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

（決議）	株式の種類	配当金の総額	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2021年6月24日 定時株主総会	普通株式	479,000千円	77,258.06円	2021年3月31日	2021年6月25日

3. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が当事業年度の末日後となるもの

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式の総数に関する事項

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

2. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

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

3. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が当事業年度の末日後となるもの

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年3月31日現在

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

2023年3月31日現在

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

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

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

2022年3月31日現在

前項にて注記を省略しているため、記載を省略しております。

2023年3月31日現在

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

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

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

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

（有価証券関係）

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

（デリバティブ取引関係）

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

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

	前事業年度	
	自	至
	2021年4月 1日	2022年3月31日
退職給付債務の期首残高	450,505	
勤務費用	58,354	
利息費用	-	
数理計算上の差異の発生額	10,018	
退職給付の支払額	18,668	
退職給付債務の期末残高	480,173	

(単位：千円)

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

3．年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

5．退職給付費用の内訳

(単位：千円)

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

(単位：千円)

	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	<u>43,071</u>
(1)勤務費用	53,150
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益	2,979
(4)過去勤務費用の費用処理額	0

(5) 数理計算上の差異の費用処理額	7,098
(6) その他	-

6．年金資産に関する事項

前事業年度（2022年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定） 98.1%

その他 1.9%

合計 100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

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

当事業年度（2023年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定） 98.2%

その他 1.8%

合計 100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

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

7．退職給付債務等の計算基礎に関する事項

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

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

8．確定拠出制度

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は18,980千円であります。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は18,410千円であります。

（税効果会計関係）

前事業年度	当事業年度
自 2021年4月 1日	自 2022年4月 1日
至 2022年3月31日	至 2023年3月31日

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：千円)		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：千円)	
繰延税金資産		繰延税金資産	
賞与引当金繰入超過額	19,674	賞与引当金繰入超過額	22,144
退職給付引当金	27,681	退職給付引当金	25,052
(注) 繰越欠損金	1,727,082	(注) 繰越欠損金	1,453,659
その他	51,898	その他	36,485
繰延税金資産 合計	1,826,336	繰延税金資産 合計	1,537,341
繰延税金負債との相殺	-	繰延税金負債との相殺	-
繰延税金資産の純額	1,826,336	繰延税金資産の純額	1,537,341

(注) 税務上の繰越欠損金及びその繰延税金資産の繰越期限別の金額

前事業年度（2022年3月31日現在）

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

(*1) 税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額であります。

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

当事業年度（2023年3月31日現在）

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

(*1) 税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額であります。

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

前事業年度（2022年3月31日現在）	当事業年度（2023年3月31日現在）
---------------------	---------------------

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異の原因となった主要な項目別内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異の原因となった主要な項目別内訳	
法定実効税率	30.6%	法定実効税率	30.6%
交際費等永久に損金に 算入されない項目	8.0%	交際費等永久に損金に 算入されない項目	3.1%
その他	0.2%	その他	0.6%
税効果会計適用後の 法人税等の負担率	38.4%	税効果会計適用後の 法人税等の負担率	34.3%
	=====		=====

（資産除去債務関係）

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

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

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

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

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

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

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

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

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

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

（収益認識関係）

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

(1) 収益の分解情報

損益計算書に記載のとおりです。

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

重要な会計方針「5.収益の計上方法」に記載のとおりです。

(3) 当期及び翌期以降の収益の金額を理解するための情報

重要性が乏しいため、注記を省略しております。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

(1) 収益の分解情報

損益計算書に記載のとおりです。

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

重要な会計方針「5.収益の計上方法」に記載のとおりです。

(3) 当期及び翌期以降の収益の金額を理解するための情報

重要性が乏しいため、注記を省略しております。

（セグメント情報）

1. セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

2. セグメント関連情報

1. 商品及びサービスに関する情報

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

2. 地域に関する情報

営業収益

本邦に所在している顧客への収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

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

有形固定資産

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

3. 主要な顧客に関する情報

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

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

該当事項はありません。

(2) 同一の親会社を持つ会社

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日													
種 類	会社等の 名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の内容 又は 職業	議決権の所 有(被所有) 割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)		
						役員の 兼任等	事業上の関係						
同一の親 会社を持 つ会社	ステート・ス トリート・バン ク・アソシ エーツ・トラ スト・カンパ ニー	米国 マサチューセツ 州ボストン 市	29百万 米ドル	銀行、投資 顧問、投資 信託委託業 務、及びそ れらの関連 業務	なし	なし	助言などの投 資顧問サービ スの提供並び に受入れ	ソフトウェア使 用料の支払	351,919	前払金	598		
								投資顧問料の支 払	221,949				
								ソフトウェア の使用契約	396,782			未払金	28,457
								人件費等及び 事務手数料の 支払	85,395				
							移転価格調整金 の支払	363,220					
	ステート・ス トリート信託 銀行株式 会社	東京都港 区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理 の事務サービ スの受入れ	投資信託計理業 務委託	38,999	前払金	119,051		
							兼職社員の人 件費支払等	人件費等の支払	127,476				
	ステート・ス トリート・グ ローバル・ア ドバイザー ズ・ユナイ テッド・キング ダム	英国 ロンドン	62百万ポ ンド	投資顧問、 投資信託委 託業務	なし	なし	投資顧問サー ビスの受入れ	投資顧問料の支 払	19,193	-	-		
	ステート・ス トリート・グ ローバル・ア ドバイザー ズ・シンガ ポール	シンガポ ール シンガポ ール 市	136万シ ンガポ ール ドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サー ビスの受入れ 及びETF商品 の紹介	紹介料の受取 投資顧問料の支 払	264 24,400	-	-		

(注) 上記の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には、消費税等が含まれております。

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

当事業年度 自 2022年4月1日 至 2023年3月31日												
種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権の有(被所有)割合	関連当事者との関係 役員の兼任等	事業上の関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)	
同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ	ソフトウェア使用料の支払	295,434	前払金	3,388	
								投資顧問料の支払	232,843			
								ソフトウェアの使用契約	175,762	未払金		24,509
								人件費等及び事務手数料の受取	12,389			
							移転価格調整金の受取	131,841				
ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ	投資信託計理業務委託	39,303	前払金	229,512		
							兼職社員の人件費支払等	127,670				
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・リミテッド・キングダム	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ	投資顧問料の支払	19,754	-	-		
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ及びETF商品の紹介	紹介料の受取	250	-	-		
							投資顧問料の支払	22,792				

(注) 上記の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には、消費税等が含まれております。

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

ステート・ストリート・コーポレーション（ニューヨーク証券取引所に上場）
 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インク（非上場）
 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インターナショナル・ホールディングス（非上場）
 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ジャパン・ホールディングス合同会社（非上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

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

(注) 1株当たり当期純利益の算定基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

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

当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

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

その他有価証券評価差額金	4,421		
純資産合計		7,854,940	88.0
負債・純資産合計		8,923,103	100.0

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

期 別	第27期中間会計期間		
	自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日		
科 目	金 額		構成比
			%
営業収益			
委託者報酬		1,435,040	
投資顧問収入		1,434,219	
その他営業収益	1	63,660	
営業収益計		2,932,920	100.0
営業費用・一般管理費			
営業費用		1,028,805	
支払手数料	427,673		
その他営業費用	601,131		
一般管理費	2	967,219	
営業費用・一般管理費計		1,996,024	68.1
営業利益		936,895	31.9
営業外収益	1	69,185	2.4
営業外費用		4,146	0.1
経常利益		1,001,933	34.2
特別利益		0	0.0
特別損失		0	0.0
税引前中間純利益		1,001,933	34.2
法人税,住民税及び事業税		215,714	7.4
法人税等調整額		139,286	4.7
中間純利益		646,932	22.1

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

(単位：千円)

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

[重要な会計方針]

	<p>第27期中間会計期間 自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日</p>
1. 資産の評価基準及び評価方法	<p>有価証券 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（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法を採用しております。</p>
2. 固定資産の減価償却方法	<p>有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 器具備品 3～7年</p>
3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	<p>外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当中間会計期間に負担すべき金額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。 数理計算上の差異 発生の翌事業年度に一括費用処理しております。</p>
5. 収益の計上方法	<p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託約款に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資信託約款毎に、日々の純資産総額に信託報酬率を乗じた金額で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問収入 投資顧問収入は、投資顧問契約に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資顧問契約毎に、計算基礎額に投資顧問料率を乗じた金額で収益を認識しております。</p>
6. その他	<p>消費税等の処理方法</p>

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。
------------------------	--------------------------------

注記事項

（中間貸借対照表関係）

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

（中間損益計算書関係）

第27期中間会計期間 自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日	
1. 移転価格調整金の取り扱いに係る注記	
当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当中間会計期間にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた事務手数料調整額63,545千円は、中間損益計算書のその他営業収益に、移転価格調整額66,918千円は、中間損益計算書の営業外収益に含まれております。	
2. 減価償却実施額	
有形固定資産	320千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

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

（金融商品関係）

第27期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)

1. 金融商品の時価等に関する事項

	中間貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
投資有価証券	26,352	26,352	-
資産計	26,352	26,352	-

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券	-	26,352	-	26,352
其他有価証券	-	26,352	-	26,352
資産計	-	26,352	-	26,352

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

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

（有価証券関係）

第27期中間会計期間末
(2023年9月30日現在)

其他有価証券

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

（資産除去債務関係）

第27期中間会計期間末
(2023年9月30日現在)

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

(デリバティブ取引関係)

第27期中間会計期間末
(2023年9月30日現在)

当社はデリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第27期中間会計期間末
(2023年9月30日現在)

(セグメント情報)

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

(セグメント関連情報)

1. 商品およびサービスごとの情報

単一の商品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦に所在している顧客への収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しています。なお、委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、集計対象より除いております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

該当事項はありません。

(収益認識関係)

第27期中間会計期間
自 2023年4月 1日
至 2023年9月30日

(1) 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次のとおりです。

委託者報酬	1,435,040千円
投資顧問収入	1,434,219千円
その他営業収益	63,660千円
合計	2,932,920千円

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

重要な会計方針「5. 収益の計上方法」に記載のとおりです。

(3) 当期及び翌期以降の収益の金額を理解するための情報

重要性が乏しいため、注記を省略しております。

(1株当たり情報)

第27期中間会計期間

自 2023年4月 1日

至 2023年9月30日

1株当たり純資産額 1,266,925円84銭

1株当たり中間純利益 104,343円97銭

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

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

(重要な後発事象)

第27期中間会計期間

自 2023年4月 1日

至 2023年9月30日

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称

三井住友信託銀行株式会社

資本金の額

342,037百万円（2023年3月末現在）

事業の内容

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

（参考）再信託受託会社

名 称：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2023年3月末現在）

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

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2023年3月末)	事業の内容
松井証券株式会社	11,945百万円	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。
楽天証券株式会社	19,495百万円	

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

当ファンドの販売会社として受益権の募集の取扱い等を行います。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

当計算期間において提出された、ファンドに係る金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる書類は以下の通りです。

書類名	提出年月日
有価証券報告書	2023年 6月5日
有価証券届出書	2023年 6月5日
半期報告書	2023年12月5日
有価証券届出書の訂正届出書	2023年12月5日

独立監査人の監査報告書

2023年6月22日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第26期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2024年5月17日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太
業務執行社員**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているステート・ストリート日本株式インデックス・オープンの2023年3月7日から2024年3月5日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ステート・ストリート日本株式インデックス・オープンの2024年3月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月22日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

稲葉 宏和

中間監査意見

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

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的

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

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

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

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

監査人は、監査役に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。