

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年10月22日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	日本株式インデックス e
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

日本株式インデックスe

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。  
三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付又は信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。  
当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又は記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額（ ）とします。

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

### （５）【申込手数料】

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

申込手数料の詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

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

### （６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

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

**( 7 ) 【申込期間】**

2021年10月23日から2022年 4月22日までとします。

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

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

**( 9 ) 【払込期日】**

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

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

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

**( 11 ) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**( 12 ) 【その他】**

< 振替受益権について >

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

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

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受け付けを中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取消することができます。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グロ ー バ ル 日本	ファミ リーファ ンド ファン ド・オブ・ファ ンズ	あり ( ) なし	日経225 TOPIX その他 ( )	ブル・ベア 型 条件付運用 型 ロング・ ショート型/ 絶対収益追 求型 その他 ( )
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) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア				
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))	日々 その他 ( )	中南米 アフリカ 中近東 (中東)				
資産複合 ( ) 資産配分 固定型 資産配分 変更型		エマ ー ジ ング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

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

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

#### < 商品分類表定義 >

##### [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

ないファンドをいう。

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

#### [ 投資対象地域による区分 ]

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

#### [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

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

#### [ 独立した区分 ]

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

#### [ 補足分類 ]

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

#### < 属性区分表定義 >

#### [ 投資対象資産による属性区分 ]

##### (1)株式

一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

(2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

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

[ 決算頻度による属性区分 ]

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

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

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

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

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

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

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

[ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

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

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

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

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

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



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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

#### [ 特殊型 ]

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

< ファンドの特色 >

## 東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

### TOPIX（東証株価指数、配当込み）とは

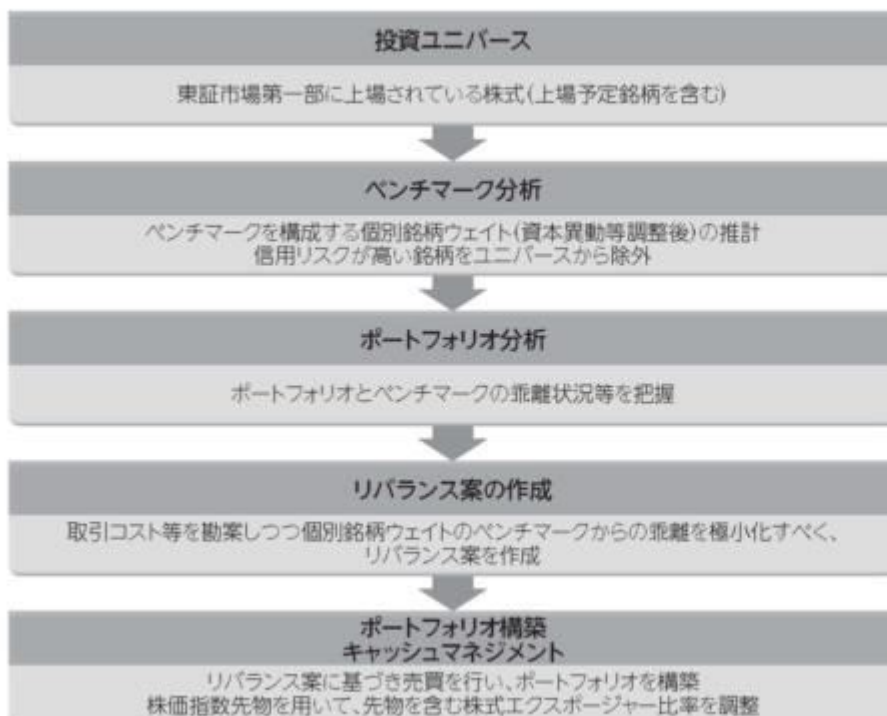
株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

### TOPIX（東証株価指数）の著作権等について

1. TOPIX（東証株価指数）の指数値及び同指数の商標は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利・ノウハウ及び同指数の商標に関する全ての権利は東証が有しています。
2. 東証は、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止又は同指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
3. 東証は、同指数の指数値及び同指数の商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
4. 東証は、同指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、東証は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
5. 当ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではありません。
6. 東証は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
7. 東証は、当社又は当ファンドの購入者のニーズを、同指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
8. 以上の項目に限らず、東証は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

2022年4月4日に東京証券取引所（以下「東証」といいます。）は、「市場第一部・市場第二部・マザーズ・JASDAQ（スタンダード・グロース）」の4つの市場区分を「プライム市場・スタンダード市場・グロース市場」の3つの市場区分に見直すこととしております。これに伴い東証の市場区分に関する記載内容を変更する予定です。詳細は日本取引所グループのホームページをご確認ください。

### マザーファンドの投資プロセス



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

### ファンドのしくみ

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



### 分配方針

- 年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。  
ただし、分配を行わないことがあります。
  - 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- ※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

### 主な投資制限

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

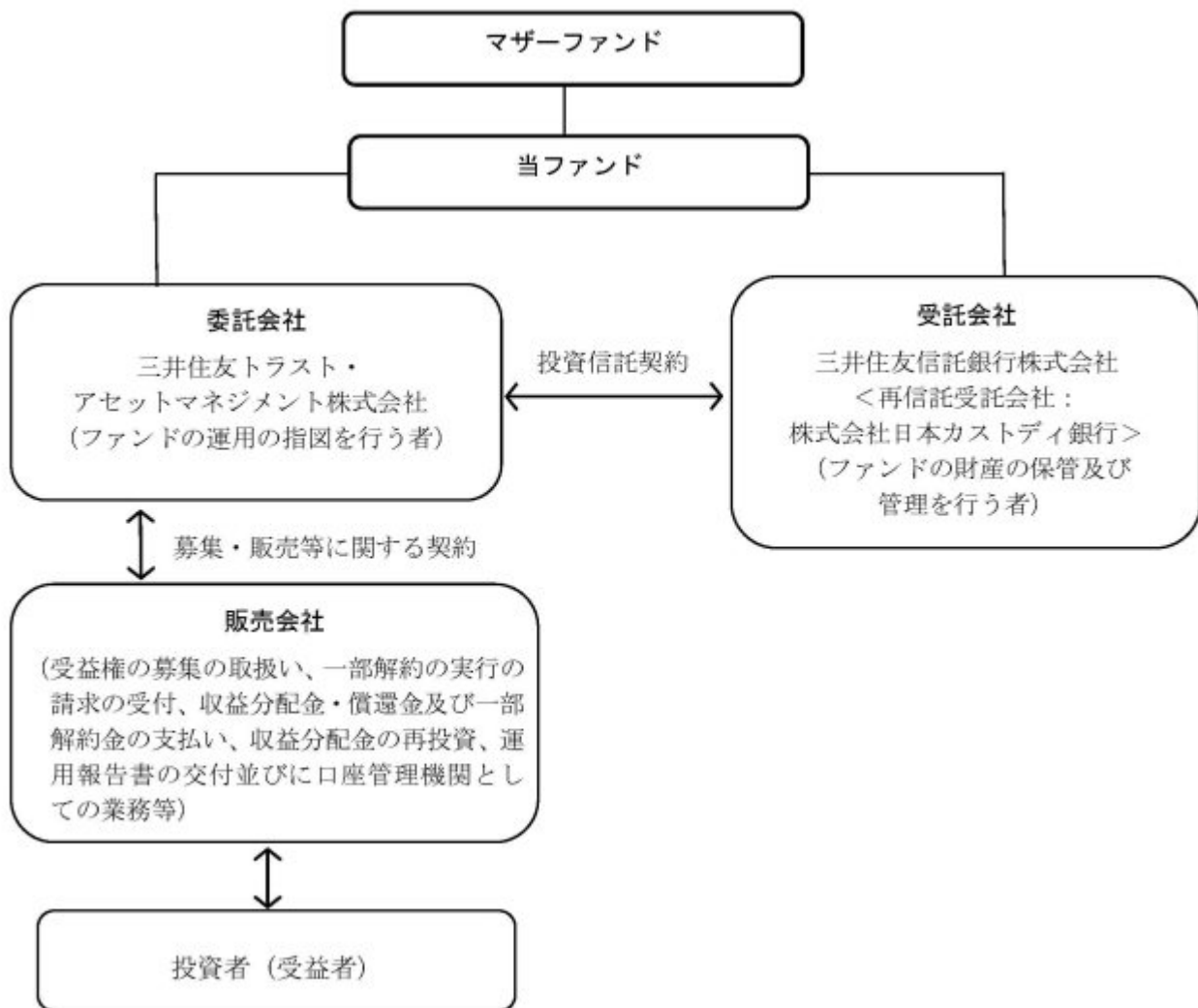
資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

## (2) 【ファンドの沿革】

2010年4月6日	信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始
2012年4月1日	当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継 当ファンドの名称をC M A M日本株式インデックスeから日本株式インデックスeに変更 当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンドに変更

## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2021年 8月31日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

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

ハ．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

#### 運用方針

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

#### 投資態度

- A．株式への**実質投資は、原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。**
- B．株式への**実質投資割合は、原則として高位（90%以上）とします。**
- C．運用の**効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。**このため、株式の組入総額と**株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。**
- D．株式以外の資産への**実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。**
- E．**資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。**
- F．国内において行われる**有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）**、**有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）**、**有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）**、**金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。**
- G．信託財産に属する**資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又は異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。**
- H．信託財産に属する**資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。**

### （2）【投資対象】

#### 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて**投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。**

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

#### 運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者と

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

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

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

#### 運用指図できる金融商品

A．委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

- 1．預金
- 2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形
- 5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6．外国の者に対する権利で上記5．の権利の性質を有するもの

#### B．金融商品による運用の特例

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

#### (参考)マザーファンドの概要

##### 「日本株式マザーファンド」の概要

#### 1．基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

#### 2．運用方法

##### (1) 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

株式への投資は、原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

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

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

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

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するためスワップ取引を行うことができます。

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

#### 3．投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

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

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

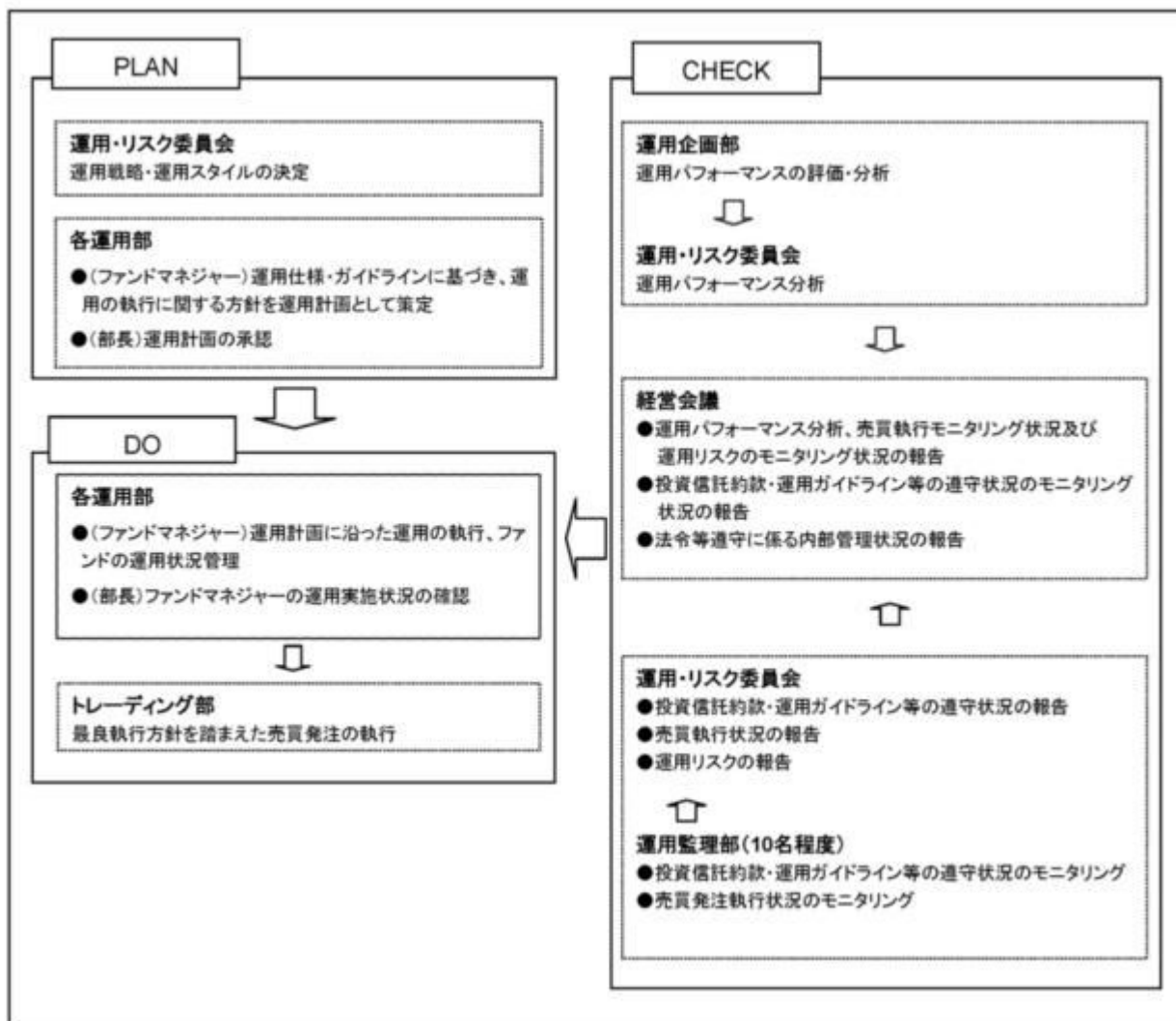
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

### （3）【運用体制】

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



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



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

#### （４）【配分方針】

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

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

#### （５）【投資制限】

##### <約款に定める投資制限>

##### A．株式への投資割合

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

##### B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

##### C．新株引受権証券等への投資割合

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

##### D．同一銘柄の株式への投資割合

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

##### E．同一銘柄の転換社債等への投資割合

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

##### F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

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

##### G．投資信託証券への投資割合

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

##### H．投資する株式等の範囲

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

- ロ．上記イ．の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- I．信用取引の指図範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- ロ．上記イ．の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- J．先物取引等の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
- ロ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- K．スワップ取引の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- L．金利先渡取引の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引を行うに当たり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- M．有価証券の貸付の指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式及び公社債を次の

- a．及びb．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
- a．株式の貸付は、貸付時点において貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- b．公社債の貸付は、貸付時点において貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ．a．及びb．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- N．公社債の空売りの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下記O．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- O．公社債の借入れの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うに当たり、担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ロ．上記イ．の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- P．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図
- 委託会社は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。
- Q．再投資の指図
- 委託会社は、上記P．の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。
- R．資金の借入れ
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並びに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、又は再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間又は受益者への解約代金支払開始日から

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

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

二．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

#### S．受託会社による資金の立替え

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

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

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

#### T．利害関係人等との取引等

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

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

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

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

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

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

### < 関連法令に基づく投資制限 >

イ．同一の法人の発行する株式への投資制限

（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）

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

## 3【投資リスク】

### （1）ファンドのリスク

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

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 株価変動リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 流動性リスク

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

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

### < その他の留意点 >

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

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

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

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

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

小さかった場合も同様です。

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

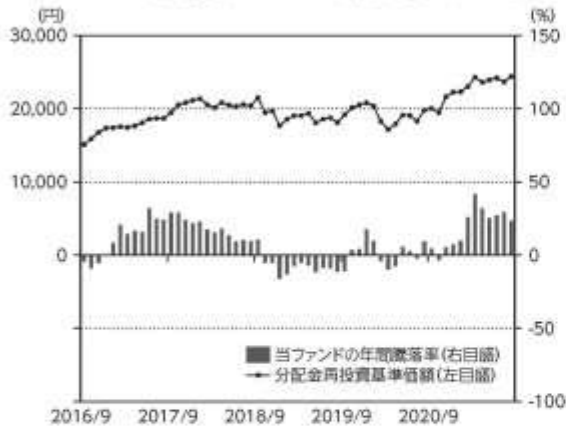
## （２）リスクの管理体制

### 委託会社におけるリスク管理体制

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

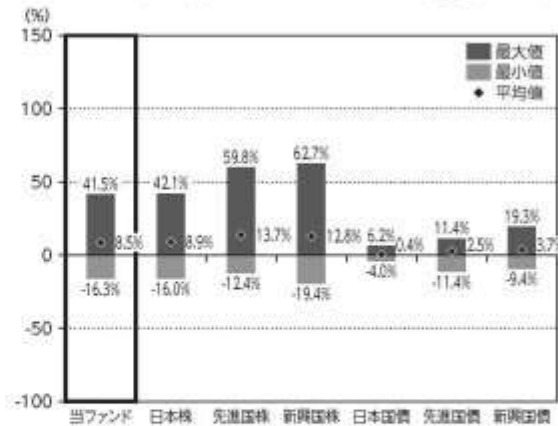
## 【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



- \*2016年9月～2021年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

## 各資産クラスの指数について

日本株 TOPIX (保証株価指数、配当込み)	TOPIX (保証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の専断的財産であり、指数の算出、他指数の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又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。
先進国株 MSCI コフサイインデックス (配当込み、円ベース)	MSCI コフサイインデックスとは、MSCI Inc. が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを測る株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
新興国株 MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCI エマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した世界の新興国株式市場の動きを測る株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの権限、販売等は行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、誤脱または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産権その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 JP Morgan Global Bond Index Emerging Markets (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、JP Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。JP Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, JP Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

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

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

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

2：収益分配金の受取方法により、「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

上記及びの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

##### (2)【換金（解約）手数料】

<解約手数料>

ありません。

<信託財産留保額>

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

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

##### (3)【信託報酬等】

信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.407%（税抜 0.37%）を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

委託会社	年率 0.154% (税抜 0.14%)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
販売会社	年率 0.209% (税抜 0.19%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価

受託会社	年率 0.044% （税抜 0.04%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の 実行の対価
------	----------------------	-----------------------------

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

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

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

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

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りです。



## 八．損益通算について

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

### ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。

ご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### 法人の受益者に対する課税

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

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

### 個別元本について

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

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

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

ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」についてをご参照ください。）

### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、

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

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

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

上記は、2021年 8月31日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

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

## 5【運用状況】

以下は、2021年8月31日現在の状況について記載してあります。

## 【日本株式インデックスe】

## (1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	3,261,777,611	99.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,622,859	0.05
合計(純資産総額)		3,263,400,470	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	1,484,988,669	2.0562	3,053,433,702	2.1965	3,261,777,611	99.95

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.95
合計	99.95

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

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3)【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額（円）		1万口当たりの純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第2期計算期間末 (2012年 1月23日)	620,369,491	620,369,491	7,945	7,945
第3期計算期間末 (2013年 1月22日)	1,128,738,085	1,128,738,085	9,645	9,645
第4期計算期間末 (2014年 1月22日)	1,983,846,830	1,986,659,151	14,108	14,128
第5期計算期間末 (2015年 1月22日)	2,628,205,398	2,628,205,398	15,330	15,330
第6期計算期間末 (2016年 1月22日)	2,788,622,197	2,788,622,197	15,397	15,397
第7期計算期間末 (2017年 1月23日)	3,085,536,364	3,085,536,364	17,278	17,278
第8期計算期間末 (2018年 1月22日)	3,693,207,038	3,693,207,038	21,960	21,960
第9期計算期間末 (2019年 1月22日)	3,084,912,224	3,084,912,224	18,398	18,398
第10期計算期間末 (2020年 1月22日)	3,237,052,965	3,237,052,965	21,047	21,047
第11期計算期間末 (2021年 1月22日)	3,165,869,473	3,165,869,473	22,864	22,864
2020年 8月末日	2,895,813,288		19,761	
9月末日	2,920,511,100		20,009	
10月末日	2,832,960,742		19,436	
11月末日	3,074,206,606		21,598	
12月末日	3,124,059,878		22,231	
2021年 1月末日	3,080,137,092		22,274	
2月末日	3,142,767,018		22,961	
3月末日	3,301,941,402		24,260	
4月末日	3,195,368,564		23,568	
5月末日	3,241,006,009		23,883	
6月末日	3,271,222,824		24,157	
7月末日	3,176,298,306		23,623	
8月末日	3,263,400,470		24,361	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第2期計算期間	2011年 1月25日～2012年 1月23日	0
第3期計算期間	2012年 1月24日～2013年 1月22日	0
第4期計算期間	2013年 1月23日～2014年 1月22日	20
第5期計算期間	2014年 1月23日～2015年 1月22日	0
第6期計算期間	2015年 1月23日～2016年 1月22日	0
第7期計算期間	2016年 1月23日～2017年 1月23日	0
第8期計算期間	2017年 1月24日～2018年 1月22日	0
第9期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月22日	0
第10期計算期間	2019年 1月23日～2020年 1月22日	0

第11期計算期間	2020年 1月23日～2021年 1月22日	0
----------	-------------------------	---

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第2期計算期間	2011年 1月25日～2012年 1月23日	16.5
第3期計算期間	2012年 1月24日～2013年 1月22日	21.4
第4期計算期間	2013年 1月23日～2014年 1月22日	46.5
第5期計算期間	2014年 1月23日～2015年 1月22日	8.7
第6期計算期間	2015年 1月23日～2016年 1月22日	0.4
第7期計算期間	2016年 1月23日～2017年 1月23日	12.2
第8期計算期間	2017年 1月24日～2018年 1月22日	27.1
第9期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月22日	16.2
第10期計算期間	2019年 1月23日～2020年 1月22日	14.4
第11期計算期間	2020年 1月23日～2021年 1月22日	8.6
第12期中間計算期間	2021年 1月23日～2021年 7月22日	3.5

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

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第2期計算期間	2011年 1月25日～2012年 1月23日	852,928,428	216,614,101	780,859,317
第3期計算期間	2012年 1月24日～2013年 1月22日	954,937,107	565,504,278	1,170,292,146
第4期計算期間	2013年 1月23日～2014年 1月22日	1,431,382,451	1,195,513,665	1,406,160,932
第5期計算期間	2014年 1月23日～2015年 1月22日	1,213,215,350	904,934,254	1,714,442,028
第6期計算期間	2015年 1月23日～2016年 1月22日	828,172,152	731,522,696	1,811,091,484
第7期計算期間	2016年 1月23日～2017年 1月23日	347,831,292	373,074,963	1,785,847,813
第8期計算期間	2017年 1月24日～2018年 1月22日	196,903,179	300,941,408	1,681,809,584
第9期計算期間	2018年 1月23日～2019年 1月22日	168,411,455	173,420,135	1,676,800,904
第10期計算期間	2019年 1月23日～2020年 1月22日	92,261,720	231,083,450	1,537,979,174
第11期計算期間	2020年 1月23日～2021年 1月22日	91,607,228	244,942,926	1,384,643,476
第12期中間計算期間	2021年 1月23日～2021年 7月22日	41,368,436	76,815,694	1,349,196,218

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

(参考)

日本株式マザーファンド

投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	292,780,284,560	99.21
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2,344,135,146	0.79
合計（純資産総額）		295,124,419,706	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	2,298,465,000	0.78

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

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,103,200	7,701.99	8,496,835,610	9,592.00	10,581,894,400	3.59
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	682,200	10,486.83	7,154,121,942	11,360.00	7,749,792,000	2.63
日本	株式	キーエンス	電気機器	106,900	57,596.84	6,157,102,197	66,130.00	7,069,297,000	2.40
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	848,000	8,767.49	7,434,834,624	6,181.00	5,241,488,000	1.78
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	745,500	4,691.58	3,497,579,928	6,500.00	4,845,750,000	1.64
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,347,500	485.64	3,568,277,078	594.40	4,367,354,000	1.48
日本	株式	ダイキン工業	機械	138,700	23,108.08	3,205,091,806	27,405.00	3,801,073,500	1.29
日本	株式	HOYA	精密機器	212,500	13,649.61	2,900,543,366	17,780.00	3,778,250,000	1.28
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,249,900	2,703.69	3,379,349,501	2,936.00	3,669,706,400	1.24
日本	株式	信越化学工業	化学	197,200	19,256.65	3,797,411,959	18,205.00	3,590,026,000	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	906,000	3,591.36	3,253,778,287	3,679.00	3,333,174,000	1.13
日本	株式	日本電産	電気機器	262,200	14,166.54	3,714,468,395	12,620.00	3,308,964,000	1.12
日本	株式	任天堂	その他製品	62,300	63,901.49	3,981,063,040	52,900.00	3,295,670,000	1.12
日本	株式	日立製作所	電気機器	523,600	4,399.13	2,303,387,297	6,085.00	3,186,106,000	1.08
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	63,800	43,604.39	2,781,960,265	47,240.00	3,013,912,000	1.02
日本	株式	村田製作所	電気機器	320,000	10,450.34	3,344,111,148	9,119.00	2,918,080,000	0.99

日本	株式	KDDI	情報・通信業	857,000	3,245.17	2,781,112,707	3,370.00	2,888,090,000	0.98
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	857,400	2,864.70	2,456,198,973	3,342.00	2,865,430,800	0.97
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	743,300	3,350.06	2,490,103,372	3,801.00	2,825,283,300	0.96
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	750,200	3,144.80	2,359,234,190	3,311.00	2,483,912,200	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	95,600	27,039.93	2,585,017,761	23,990.00	2,293,444,000	0.78
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,459,500	1,411.86	2,060,614,199	1,543.00	2,252,008,500	0.76
日本	株式	S M C	機械	31,900	68,192.40	2,175,337,831	70,510.00	2,249,269,000	0.76
日本	株式	第一三共	医薬品	855,800	3,552.69	3,040,396,116	2,614.50	2,237,489,100	0.76
日本	株式	三菱商事	卸売業	653,000	2,692.20	1,758,012,713	3,311.00	2,162,083,000	0.73
日本	株式	三井物産	卸売業	855,600	2,068.78	1,770,053,892	2,429.00	2,078,252,400	0.70
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	419,600	3,974.79	1,667,825,675	4,815.00	2,020,374,000	0.68
日本	株式	富士通	電気機器	98,000	17,005.48	1,666,537,691	20,300.00	1,989,400,000	0.67
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	353,700	5,417.81	1,916,281,519	5,377.00	1,901,844,900	0.64
日本	株式	デンソー	輸送用機器	239,800	6,062.52	1,453,794,318	7,710.00	1,848,858,000	0.63

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

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

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.18
		建設業	2.27
		食料品	3.41
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.06
		医薬品	5.20
		石油・石炭製品	0.39
		ゴム製品	0.70
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.89
		非鉄金属	0.69
		金属製品	0.62
		機械	5.59
		電気機器	18.22
		輸送用機器	7.70
		精密機器	2.98
		その他製品	2.20
電気・ガス業	1.17		

	陸運業	3.18
	海運業	0.52
	空運業	0.45
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	8.37
	卸売業	4.80
	小売業	4.40
	銀行業	4.87
	証券、商品先物取引業	0.73
	保険業	1.90
	その他金融業	1.13
	不動産業	1.94
	サービス業	5.90
	小計	99.21
合計		99.21

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

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	117	円	2,251,405,000	2,298,465,000	0.78

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

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

#### 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績


**運用実績**

 当初設定日：2010年4月6日  
 作成基準日：2021年8月31日
**基準価額・純資産の推移**

基準価額	24,361円
------	---------

純資産総額	32.63億円
-------	---------

**分配の推移**

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2017年1月	0円
2018年1月	0円
2019年1月	0円
2020年1月	0円
2021年1月	0円
設定来 分配金合計額	20円

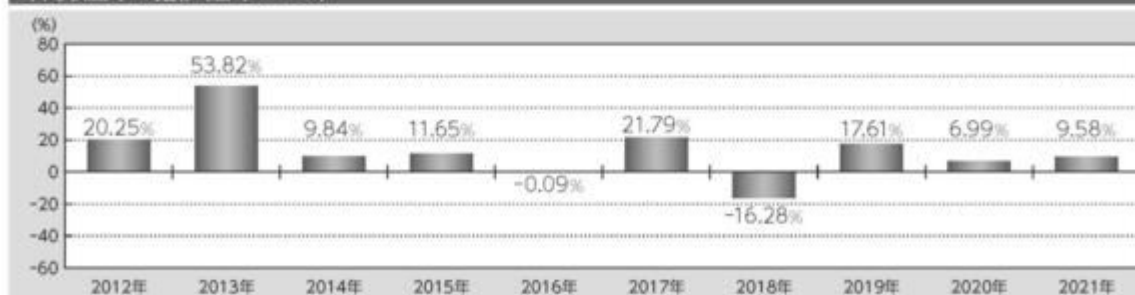
※基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。  
 ※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

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

**主要な資産の状況**

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	3.6%
ソニーグループ	日本	株式	電気機器	2.6%
キーエンス	日本	株式	電気機器	2.4%
ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1.8%
リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	1.6%
三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	1.5%
ダイキン工業	日本	株式	機械	1.3%
HOYA	日本	株式	精密機器	1.3%
日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	1.2%
信越化学工業	日本	株式	化学	1.2%

※実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

**年間収益率の推移(暦年ベース)**

※収益率は分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。  
 ※2021年は年初から作成基準日までの収益率です。

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

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

**第2【管理及び運営】****1【申込(販売)手続等】**

< 申込手続 >



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

#### < 申込コース >

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」（ ）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

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

#### < 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

#### < 申込単位 >

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

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の基準価額とします。

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

#### < 申込手数料 >

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

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

ありません。

#### < 申込受付の中止等 >

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

#### < その他 >

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

した旨の通知を行います。

#### < 問い合わせ先 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：https://www.smtam.jp/

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

#### < 一部解約手続 >

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

#### < 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

#### < 一部解約単位 >

販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 解約価額 >

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

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

#### < 一部解約代金の支払い >

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

#### < 受付不可日 >

ありません。

#### < 一部解約受付の中止等 >

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

一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場

合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記〈解約価額〉の規定に準じて計算された価額とします。

#### <一部解約の制限>

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

#### <その他>

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

#### <問い合わせ先>

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

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

##### <基準価額の算出頻度>

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

##### <主要な投資対象資産の評価方法>

マザーファンド受益証券の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法

国内上場株式

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

#### < 基準価額の照会方法 >

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

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （2）【保管】

該当事項はありません。

#### （3）【信託期間】

無期限とします。（2010年 4月 6日設定）

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

#### （4）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年1月23日から翌年1月22日までとすることを原則とします。

ただし、第1計算期間は2010年4月6日から2011年1月24日までとします。

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

#### （5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

##### (1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

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

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

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

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

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

##### (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

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

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

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

#### < 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >

##### (1) 投資信託約款の変更等

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

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

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

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

##### (2) 重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

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

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合は除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

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

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

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

上記からまでの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き > に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとしします。

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

#### < 運用報告書 >

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

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

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

#### < 公告 >

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### < 混蔵寄託 >

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

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

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

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

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

動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算

を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

#### 4【受益者の権利等】

##### (1)収益分配金に対する請求権

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

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

上記の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

上記に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

##### (2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

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

##### (3)換金（解約）請求権

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

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第11期計算期間(2020年1月23日から2021年1月22日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】



## 【日本株式インデックス e】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第10期 ( 2020年 1月22日現在 )	第11期 ( 2021年 1月22日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	10,121,848	8,747,958
親投資信託受益証券	3,235,442,942	3,164,283,156
未収入金	3,138,964	2,285,103
流動資産合計	3,248,703,754	3,175,316,217
資産合計	3,248,703,754	3,175,316,217
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,160,695	3,274,886
未払受託者報酬	692,291	658,347
未払委託者報酬	5,711,316	5,431,274
未払利息	5	3
その他未払費用	86,482	82,234
流動負債合計	11,650,789	9,446,744
負債合計	11,650,789	9,446,744
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,537,979,174	1,384,643,476
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	1,699,073,791	1,781,225,997
( 分配準備積立金 )	1,038,181,750	967,546,863
元本等合計	3,237,052,965	3,165,869,473
純資産合計	3,237,052,965	3,165,869,473
負債純資産合計	3,248,703,754	3,175,316,217

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期		第11期	
	自 2019年 1月23日	至 2020年 1月22日	自 2020年 1月23日	至 2021年 1月22日
営業収益				
受取利息		3		39
有価証券売買等損益		442,457,354		243,539,767
営業収益合計		442,457,357		243,539,806
営業費用				
支払利息		3,808		2,523
受託者報酬		1,358,573		1,264,331
委託者報酬		11,208,062		10,430,564
その他費用		169,736		157,927
営業費用合計		12,740,179		11,855,345
営業利益又は営業損失（ ）		429,717,178		231,684,461
経常利益又は経常損失（ ）		429,717,178		231,684,461
当期純利益又は当期純損失（ ）		429,717,178		231,684,461
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（ ）		28,450,306		35,200,930
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,408,111,320		1,699,073,791
剰余金増加額又は欠損金減少額		84,104,838		83,912,200
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		84,104,838		83,912,200
剰余金減少額又は欠損金増加額		194,409,239		268,645,385
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		194,409,239		268,645,385
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,699,073,791		1,781,225,997

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

## (貸借対照表に関する注記)

	第10期 (2020年 1月22日現在)	第11期 (2021年 1月22日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,537,979,174口	1,384,643,476口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.1047円 (21,047円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.2864円 (22,864円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自 2019年 1月23日 至 2020年 1月22日	第11期 自 2020年 1月23日 至 2021年 1月22日																																																												
<b>分配金の計算過程</b> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>70,676,828円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>869,651,361円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>967,504,922円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>1,907,833,111円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,537,979,174口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>12,404円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	70,676,828円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	869,651,361円	分配準備積立金額	D	967,504,922円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,907,833,111円	当ファンドの期末残存口数	F	1,537,979,174口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	12,404円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	<b>分配金の計算過程</b> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>59,378,348円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>29,818,083円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>839,616,714円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>878,350,432円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>1,807,163,577円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,384,643,476口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>13,051円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	59,378,348円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	29,818,083円	収益調整金額	C	839,616,714円	分配準備積立金額	D	878,350,432円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,807,163,577円	当ファンドの期末残存口数	F	1,384,643,476口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	13,051円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	70,676,828円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																																																											
収益調整金額	C	869,651,361円																																																											
分配準備積立金額	D	967,504,922円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,907,833,111円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,537,979,174口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	12,404円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	59,378,348円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	29,818,083円																																																											
収益調整金額	C	839,616,714円																																																											
分配準備積立金額	D	878,350,432円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,807,163,577円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,384,643,476口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	13,051円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円																																																											

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第11期 自 2020年 1月23日 至 2021年 1月22日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

	第11期 (2021年 1月22日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第10期	第11期
	自 2019年 1月23日 至 2020年 1月22日	自 2020年 1月23日 至 2021年 1月22日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,676,800,904円	1,537,979,174円
期中追加設定元本額	92,261,720円	91,607,228円
期中一部解約元本額	231,083,450円	244,942,926円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第10期 (2020年 1月22日現在)	第11期 (2021年 1月22日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	420,999,049	273,783,363
合計	420,999,049	273,783,363

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	1,538,973,375	3,164,283,156	
合計		1,538,973,375	3,164,283,156	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

### 日本株式マザーファンド

#### 貸借対照表

	2021年 1月22日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,321,081,697
株式	276,533,619,480
派生商品評価勘定	35,769,900
未収入金	66,137,250
未収配当金	350,030,063
差入委託証拠金	97,807,800
流動資産合計	279,404,446,190
資産合計	279,404,446,190
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,100
前受金	35,769,900
未払解約金	446,434,994
未払利息	1,035
流動負債合計	482,207,029
負債合計	482,207,029
純資産の部	
元本等	
元本	135,654,719,286
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	143,267,519,875
元本等合計	278,922,239,161
純資産合計	278,922,239,161
負債純資産合計	279,404,446,190

#### 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 1月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。  当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。
3. 収益及び費用の計上基準	(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。  (2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

	2021年 1月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	135,654,719,286口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.0561円 (1万口当たり純資産額) (20,561円)

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2021年 1月22日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

	2021年 1月22日現在
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<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。</p> <p>これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。</p> <p>また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。</p> <p>内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2021年 1月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>



## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2021年 1月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月23日
期首元本額	139,038,929,074円
期中追加設定元本額	17,267,602,546円
期中一部解約元本額	20,651,812,334円
期末元本額	135,654,719,286円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	626,336,325円
D C 日本株式インデックスファンド	314,313,884円
D C 日本株式インデックスファンド L	53,151,287,973円
D C 日本株式インデックスファンド A	902,954,069円
D C バランスファンド 3 0	2,229,972,152円
D C バランスファンド 5 0	3,439,883,370円
D C バランスファンド 7 0	1,925,713,950円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	570,311,445円
日本株式インデックス e	1,538,973,375円
インデックスコレクション（国内株式）	18,725,218,454円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	12,178,512,933円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	2,435,297,987円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	1,905,052,946円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,619,455,831円
日本株式パッシブファンド私募 A（適格機関投資家専用）	2,804,770,606円
日本株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	1,233,084,870円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	64,778,174円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	737,022,911円
V A バランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	87,152,076円
V A バランスファンド（株 5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	181,397,043円

区分	2021年 1月22日現在
V Aバランス株式30（適格機関投資家専用）	2,588,040円
V Aバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	448,988,590円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	982,619,835円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	528,109,116円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	9,002,120,410円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	811,914,642円
V Aバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	109,734,458円
V Aポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,435,179,355円
V Aポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	35,777,089円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	174,219,341円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,273,270,560円
V Aバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	67,546,320円
V Aバランス50-50（適格機関投資家専用）	72,164,982円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	28,803,354円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	738,287,744円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	337,369,764円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	5,620,128,796円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	103,477,154円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	44,139,272円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	10,041,429円
V Aバランス20-80（適格機関投資家専用）	152,599,543円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	4,149,118円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年 1月22日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	
株式		19,690,897,893
合計		19,690,897,893

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

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2021年 1月22日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,931,060,100	-	1,966,830,000	35,769,900

合計	1,931,060,100	-	1,966,830,000	35,769,900
----	---------------	---	---------------	------------

## (注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,100	3,085.00	15,733,500	
日本水産	146,100	437.00	63,845,700	
マルハニチロ	21,100	2,315.00	48,846,500	
雪国まいたけ	9,000	1,839.00	16,551,000	
カネコ種苗	4,400	1,534.00	6,749,600	
サカタのタネ	17,400	3,610.00	62,814,000	
ホクト	11,100	2,144.00	23,798,400	
ホクリヨウ	2,300	700.00	1,610,000	
住石ホールディングス	29,500	115.00	3,392,500	
日鉄鉱業	3,300	5,790.00	19,107,000	
三井松島ホールディングス	5,700	791.00	4,508,700	
国際石油開発帝石	537,200	622.00	334,138,400	
石油資源開発	19,100	2,041.00	38,983,100	
K&Oエナジーグループ	7,100	1,430.00	10,153,000	
ヒノキヤグループ	3,600	2,029.00	7,304,400	
ショーボンドホールディングス	22,700	4,705.00	106,803,500	
ミライト・ホールディングス	43,400	1,708.00	74,127,200	
タマホーム	7,900	1,906.00	15,057,400	
サンヨーホームズ	1,300	835.00	1,085,500	
日本アクア	5,800	612.00	3,549,600	
ファーストコーポレーション	4,500	703.00	3,163,500	
ベステラ	2,500	1,771.00	4,427,500	
TATERU	27,400	178.00	4,877,200	
キャンディル	2,500	536.00	1,340,000	
スペースバリューホールディングス	17,800	697.00	12,406,600	
ダイセキ環境ソリューション	2,800	771.00	2,158,800	
第一カッター興業	3,600	1,374.00	4,946,400	
安藤・間	87,000	745.00	64,815,000	

東急建設	42,800	514.00	21,999,200	
コムシスホールディングス	51,800	3,170.00	164,206,000	
ピーアールホールディングス	15,900	646.00	10,271,400	
高松コンストラクショングループ	9,100	2,059.00	18,736,900	
東建コーポレーション	4,500	8,000.00	36,000,000	
ソネック	1,500	853.00	1,279,500	
ヤマウラ	6,300	921.00	5,802,300	
大成建設	112,500	3,610.00	406,125,000	
大林組	337,400	933.00	314,794,200	
清水建設	342,300	787.00	269,390,100	
飛鳥建設	9,700	1,069.00	10,369,300	
長谷工コーポレーション	130,600	1,258.00	164,294,800	
松井建設	13,300	713.00	9,482,900	
銭高組	1,500	4,085.00	6,127,500	
鹿島建設	264,800	1,457.00	385,813,600	
不動テトラ	8,800	1,725.00	15,180,000	
大末建設	3,900	818.00	3,190,200	
鉄建建設	7,300	1,877.00	13,702,100	
西松建設	26,000	2,433.00	63,258,000	
三井住友建設	81,500	450.00	36,675,000	
大豊建設	8,000	3,715.00	29,720,000	
前田建設工業	84,500	903.00	76,303,500	
佐田建設	7,300	441.00	3,219,300	
ナカノフドー建設	9,200	403.00	3,707,600	
奥村組	15,900	2,635.00	41,896,500	
東鉄工業	14,500	2,750.00	39,875,000	
イチケン	2,400	1,886.00	4,526,400	
富士ピー・エス	5,000	595.00	2,975,000	
浅沼組	3,800	4,240.00	16,112,000	
戸田建設	140,100	726.00	101,712,600	
熊谷組	15,600	2,681.00	41,823,600	
北野建設	2,100	2,471.00	5,189,100	
植木組	1,500	2,707.00	4,060,500	
矢作建設工業	14,900	848.00	12,635,200	
ピーエス三菱	11,100	619.00	6,870,900	
日本ハウスホールディングス	23,000	330.00	7,590,000	
大東建託	36,800	9,540.00	351,072,000	
新日本建設	14,300	837.00	11,969,100	
N I P P O	27,900	2,703.00	75,413,700	
東亜道路工業	2,100	3,810.00	8,001,000	
前田道路	29,800	1,755.00	52,299,000	
日本道路	3,300	7,540.00	24,882,000	

東亜建設工業	10,500	2,143.00	22,501,500
日本国土開発	32,800	556.00	18,236,800
若築建設	6,100	1,233.00	7,521,300
東洋建設	37,800	495.00	18,711,000
五洋建設	133,700	918.00	122,736,600
世紀東急工業	16,200	818.00	13,251,600
福田組	3,900	5,170.00	20,163,000
住友林業	85,400	2,176.00	185,830,400
日本基礎技術	11,300	479.00	5,412,700
巴コーポレーション	15,000	399.00	5,985,000
大和ハウス工業	333,800	3,043.00	1,015,753,400
ライト工業	19,300	1,735.00	33,485,500
積水ハウス	365,900	2,128.50	778,818,150
日特建設	8,800	777.00	6,837,600
北陸電気工事	5,800	1,241.00	7,197,800
ユアテック	19,300	873.00	16,848,900
日本リーテック	7,100	2,486.00	17,650,600
四電工	1,800	2,599.00	4,678,200
中電工	13,600	2,164.00	29,430,400
関電工	48,000	911.00	43,728,000
きんでん	80,100	1,735.00	138,973,500
東京エネシス	11,200	995.00	11,144,000
トーエネック	3,400	3,640.00	12,376,000
住友電設	9,500	2,725.00	25,887,500
日本電設工業	18,500	2,047.00	37,869,500
協和エクシオ	51,200	2,798.00	143,257,600
新日本空調	8,900	2,142.00	19,063,800
九電工	23,700	3,225.00	76,432,500
三機工業	23,900	1,240.00	29,636,000
日揮ホールディングス	103,900	1,215.00	126,238,500
中外炉工業	3,600	1,670.00	6,012,000
ヤマト	10,800	714.00	7,711,200
太平電業	8,200	2,542.00	20,844,400
高砂熱学工業	25,800	1,601.00	41,305,800
三晃金属工業	1,500	2,854.00	4,281,000
朝日工業社	2,300	2,981.00	6,856,300
明星工業	21,800	814.00	17,745,200
大気社	16,400	2,875.00	47,150,000
ダイダン	8,100	2,950.00	23,895,000
日比谷総合設備	10,900	1,886.00	20,557,400
フィル・カンパニー	1,900	1,842.00	3,499,800
O S J Bホールディングス	53,200	276.00	14,683,200

東洋エンジニアリング	14,200	467.00	6,631,400
レイズネクスト	18,100	1,212.00	21,937,200
ニッポン	31,600	1,623.00	51,286,800
日清製粉グループ本社	122,000	1,645.00	200,690,000
日東富士製粉	800	6,680.00	5,344,000
昭和産業	9,900	3,050.00	30,195,000
鳥越製粉	9,600	860.00	8,256,000
中部飼料	13,200	1,428.00	18,849,600
フィード・ワン	14,500	853.00	12,368,500
東洋精糖	1,800	1,208.00	2,174,400
日本甜菜製糖	5,600	1,604.00	8,982,400
三井製糖	9,500	1,858.00	17,651,000
塩水港精糖	11,700	221.00	2,585,700
日新製糖	5,100	1,838.00	9,373,800
森永製菓	25,300	3,880.00	98,164,000
中村屋	2,800	3,850.00	10,780,000
江崎グリコ	29,700	4,485.00	133,204,500
名糖産業	5,200	1,422.00	7,394,400
井村屋グループ	6,100	2,532.00	15,445,200
不二家	6,900	2,224.00	15,345,600
山崎製パン	80,900	1,757.00	142,141,300
第一屋製パン	2,100	971.00	2,039,100
モロゾフ	1,800	5,740.00	10,332,000
亀田製菓	6,100	4,825.00	29,432,500
寿スピリッツ	10,400	5,520.00	57,408,000
カルビー	49,200	3,115.00	153,258,000
森永乳業	20,000	5,120.00	102,400,000
六甲バター	7,200	1,761.00	12,679,200
ヤクルト本社	74,300	5,470.00	406,421,000
明治ホールディングス	71,400	7,050.00	503,370,000
雪印メグミルク	26,000	2,231.00	58,006,000
プリマハム	16,900	3,145.00	53,150,500
日本ハム	41,300	4,275.00	176,557,500
林兼産業	3,600	593.00	2,134,800
丸大食品	11,500	1,691.00	19,446,500
S Foods	8,600	3,365.00	28,939,000
柿安本店	3,700	2,651.00	9,808,700
伊藤ハム米久ホールディングス	69,500	696.00	48,372,000
サッポロホールディングス	36,800	1,973.00	72,606,400
アサヒグループホールディングス	235,900	4,341.00	1,024,041,900
キリンホールディングス	457,900	2,311.00	1,058,206,900
宝ホールディングス	80,000	1,238.00	99,040,000

オエノンホールディングス	30,700	383.00	11,758,100	
養命酒製造	3,300	1,850.00	6,105,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	82,700	1,543.00	127,606,100	
サントリー 食品インターナショナル	72,200	3,635.00	262,447,000	
ダイドグループホールディングス	5,500	5,090.00	27,995,000	
伊藤園	32,800	6,430.00	210,904,000	
キーコーヒー	10,600	2,122.00	22,493,200	
ユニカフェ	3,200	995.00	3,184,000	
ジャパンフーズ	1,500	1,214.00	1,821,000	
日清オイリオグループ	13,900	3,030.00	42,117,000	
不二製油グループ本社	26,300	3,035.00	79,820,500	
かどや製油	1,200	3,960.00	4,752,000	
J - オイルミルズ	5,600	3,660.00	20,496,000	
キッコーマン	77,700	7,510.00	583,527,000	
味の素	238,400	2,457.00	585,748,800	
キューピー	60,100	2,265.00	136,126,500	
ハウス食品グループ本社	40,400	3,730.00	150,692,000	
カゴメ	44,100	3,385.00	149,278,500	
焼津水産化学工業	5,200	995.00	5,174,000	
アリアケジャパン	9,900	6,750.00	66,825,000	
ピエトロ	1,400	1,735.00	2,429,000	
エバラ食品工業	2,600	2,499.00	6,497,400	
やまみ	900	2,055.00	1,849,500	
ニチレイ	51,400	2,862.00	147,106,800	
東洋水産	55,500	5,140.00	285,270,000	
イトアンドホールディングス	3,700	1,823.00	6,745,100	
大冷	1,400	1,924.00	2,693,600	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,000	794.00	4,764,000	
日清食品ホールディングス	45,900	9,090.00	417,231,000	
永谷園ホールディングス	5,300	2,291.00	12,142,300	
一正蒲鉾	4,200	1,100.00	4,620,000	
フジッコ	11,700	2,031.00	23,762,700	
ロック・フィールド	11,600	1,490.00	17,284,000	
日本たばこ産業	578,900	2,048.00	1,185,587,200	
ケンコーマヨネーズ	6,100	1,759.00	10,729,900	
わらべや日洋ホールディングス	7,100	1,620.00	11,502,000	
なとり	6,000	1,875.00	11,250,000	
イフジ産業	1,900	868.00	1,649,200	
ピクルスコーポレーション	2,400	3,790.00	9,096,000	
北の達人コーポレーション	37,700	529.00	19,943,300	
ユーグレナ	46,700	845.00	39,461,500	
ミヨシ油脂	3,800	1,154.00	4,385,200	

理研ビタミン	10,200	1,345.00	13,719,000
片倉工業	14,300	1,350.00	19,305,000
グンゼ	7,800	3,295.00	25,701,000
東洋紡	41,900	1,338.00	56,062,200
ユニチカ	31,700	397.00	12,584,900
富士紡ホールディングス	5,200	4,240.00	22,048,000
倉敷紡績	10,600	1,818.00	19,270,800
シキボウ	5,500	1,026.00	5,643,000
日本毛織	35,000	942.00	32,970,000
トーア紡コーポレーション	4,200	467.00	1,961,400
帝国繊維	12,000	2,293.00	27,516,000
帝人	86,100	1,933.00	166,431,300
東レ	763,300	716.70	547,057,110
サカイオーベックス	2,900	1,943.00	5,634,700
住江織物	2,300	2,050.00	4,715,000
日本フェルト	6,700	426.00	2,854,200
イチカワ	1,700	1,268.00	2,155,600
日東製網	1,200	1,491.00	1,789,200
アツギ	8,900	487.00	4,334,300
ダイニック	4,000	774.00	3,096,000
セーレン	26,100	1,564.00	40,820,400
ソトー	4,300	815.00	3,504,500
東海染工	1,600	1,119.00	1,790,400
小松マテーレ	17,400	984.00	17,121,600
ワコールホールディングス	26,300	2,052.00	53,967,600
ホギメディカル	12,000	3,105.00	37,260,000
T S Iホールディングス	32,500	245.00	7,962,500
マツオカコーポレーション	3,100	1,996.00	6,187,600
ワールド	15,000	1,319.00	19,785,000
三陽商会	5,500	622.00	3,421,000
ナイガイ	4,200	330.00	1,386,000
オンワードホールディングス	63,800	240.00	15,312,000
ルックホールディングス	3,700	918.00	3,396,600
ゴールドウイン	19,000	6,340.00	120,460,000
デサント	20,600	1,771.00	36,482,600
キング	5,200	560.00	2,912,000
ヤマトインターナショナル	9,600	329.00	3,158,400
特種東海製紙	6,500	4,595.00	29,867,500
王子ホールディングス	440,400	643.00	283,177,200
日本製紙	46,600	1,240.00	57,784,000
三菱製紙	12,000	329.00	3,948,000
北越コーポレーション	62,800	429.00	26,941,200



中越パルプ工業	4,500	1,193.00	5,368,500
巴川製紙所	3,100	770.00	2,387,000
大王製紙	50,800	1,957.00	99,415,600
阿波製紙	2,700	444.00	1,198,800
レンゴー	99,600	857.00	85,357,200
トモク	6,500	1,810.00	11,765,000
ザ・パック	8,000	2,593.00	20,744,000
クラレ	165,900	1,106.00	183,485,400
旭化成	698,300	1,144.50	799,204,350
共和レザー	5,700	631.00	3,596,700
昭和電工	80,000	2,408.00	192,640,000
住友化学	774,000	473.00	366,102,000
住友精化	4,700	4,240.00	19,928,000
日産化学	58,100	5,930.00	344,533,000
ラサ工業	3,700	2,538.00	9,390,600
クレハ	9,000	6,750.00	60,750,000
多木化学	4,100	6,100.00	25,010,000
テイカ	7,700	1,472.00	11,334,400
石原産業	18,900	764.00	14,439,600
片倉コープアグリ	2,700	1,220.00	3,294,000
日本曹達	14,700	3,010.00	44,247,000
東ソー	162,900	1,765.00	287,518,500
トクヤマ	30,400	2,549.00	77,489,600
セントラル硝子	21,500	2,191.00	47,106,500
東亜合成	66,100	1,160.00	76,676,000
大阪ソーダ	10,700	2,598.00	27,798,600
関東電化工業	25,000	824.00	20,600,000
デンカ	38,400	4,105.00	157,632,000
信越化学工業	180,900	19,320.00	3,494,988,000
日本カーバイド工業	3,700	1,274.00	4,713,800
堺化学工業	6,800	2,010.00	13,668,000
第一稀元素化学工業	11,400	895.00	10,203,000
エア・ウォーター	98,000	1,749.00	171,402,000
日本酸素ホールディングス	101,200	2,041.00	206,549,200
日本化学工業	3,300	3,265.00	10,774,500
東邦アセチレン	1,600	1,420.00	2,272,000
日本パーカライズン	53,100	1,002.00	53,206,200
高圧ガス工業	16,700	783.00	13,076,100
チタン工業	1,300	1,880.00	2,444,000
四国化成工業	15,400	1,194.00	18,387,600
戸田工業	2,400	2,356.00	5,654,400
ステラ ケミファ	5,700	3,750.00	21,375,000

保土谷化学工業	3,900	5,440.00	21,216,000
日本触媒	16,400	5,750.00	94,300,000
大日精化工業	9,300	2,242.00	20,850,600
カネカ	27,300	3,545.00	96,778,500
三菱瓦斯化学	98,000	2,532.00	248,136,000
三井化学	97,800	2,986.00	292,030,800
J S R	98,200	3,250.00	319,150,000
東京応化工業	18,100	7,810.00	141,361,000
大阪有機化学工業	9,700	3,725.00	36,132,500
三菱ケミカルホールディングス	704,300	720.00	507,096,000
K Hネオケム	17,400	2,507.00	43,621,800
ダイセル	131,500	779.00	102,438,500
住友ベークライト	16,600	3,795.00	62,997,000
積水化学工業	222,800	2,016.00	449,164,800
日本ゼオン	95,000	1,540.00	146,300,000
アイカ工業	31,600	3,595.00	113,602,000
宇部興産	53,200	1,937.00	103,048,400
積水樹脂	19,000	2,072.00	39,368,000
タキロンシーアイ	22,800	642.00	14,637,600
旭有機材	6,000	1,494.00	8,964,000
ニチバン	5,500	1,670.00	9,185,000
リケンテクノス	25,700	458.00	11,770,600
大倉工業	5,000	1,903.00	9,515,000
積水化成品工業	14,100	537.00	7,571,700
群栄化学工業	2,400	2,403.00	5,767,200
タイガースポリマー	5,500	404.00	2,222,000
ミライアル	3,700	1,220.00	4,514,000
ダイキアクシス	3,700	1,127.00	4,169,900
ダイキョーニシカワ	22,200	784.00	17,404,800
竹本容器	3,800	920.00	3,496,000
森六ホールディングス	5,700	2,016.00	11,491,200
日本化薬	65,200	995.00	64,874,000
カーリットホールディングス	11,200	750.00	8,400,000
日本精化	8,500	1,384.00	11,764,000
扶桑化学工業	10,700	3,925.00	41,997,500
トリケミカル研究所	2,300	17,160.00	39,468,000
A D E K A	48,500	1,775.00	86,087,500
日油	39,700	4,990.00	198,103,000
新日本理化	17,400	280.00	4,872,000
ハリマ化成グループ	8,700	949.00	8,256,300
花王	257,600	7,685.00	1,979,656,000
第一工業製薬	3,900	4,110.00	16,029,000

石原ケミカル	2,900	2,099.00	6,087,100
日華化学	3,500	874.00	3,059,000
ニイタカ	2,200	2,818.00	6,199,600
三洋化成工業	6,300	5,390.00	33,957,000
有機合成薬品工業	8,100	314.00	2,543,400
大日本塗料	11,900	916.00	10,900,400
日本ペイントホールディングス	86,900	9,550.00	829,895,000
関西ペイント	118,400	2,982.00	353,068,800
神東塗料	8,300	209.00	1,734,700
中国塗料	30,000	979.00	29,370,000
日本特殊塗料	7,900	1,081.00	8,539,900
藤倉化成	14,200	499.00	7,085,800
太陽ホールディングス	7,700	6,550.00	50,435,000
D I C	44,500	2,523.00	112,273,500
サカタインクス	23,000	1,039.00	23,897,000
東洋インキＳＣホールディングス	22,300	1,854.00	41,344,200
T & K T O K A	8,200	813.00	6,666,600
富士フィルムホールディングス	206,200	6,287.00	1,296,379,400
資生堂	213,700	7,075.00	1,511,927,500
ライオン	139,900	2,372.00	331,842,800
高砂香料工業	6,700	2,472.00	16,562,400
マンダム	24,200	1,581.00	38,260,200
ミルボン	14,400	6,640.00	95,616,000
ファンケル	43,500	3,980.00	173,130,000
コーセー	20,200	16,620.00	335,724,000
コタ	6,200	1,448.00	8,977,600
シーボン	1,400	1,943.00	2,720,200
ポーラ・オルビスホールディングス	45,900	2,168.00	99,511,200
ノエビアホールディングス	9,100	4,605.00	41,905,500
アジュバンコスメジャパン	2,400	1,067.00	2,560,800
エステー	6,900	1,954.00	13,482,600
アグロ カネショウ	4,000	1,585.00	6,340,000
コニシ	17,700	1,556.00	27,541,200
長谷川香料	18,500	2,020.00	37,370,000
星光P M C	6,200	755.00	4,681,000
小林製薬	30,100	11,930.00	359,093,000
荒川化学工業	9,700	1,221.00	11,843,700
メック	7,400	2,331.00	17,249,400
日本高純度化学	3,000	2,700.00	8,100,000
タカラバイオ	28,200	2,835.00	79,947,000
J C U	13,000	3,945.00	51,285,000
新田ゼラチン	6,800	666.00	4,528,800

O A Tアグリオ	2,000	1,306.00	2,612,000	
デクセリアルズ	27,800	1,369.00	38,058,200	
アース製薬	8,100	6,050.00	49,005,000	
北興化学工業	10,000	1,279.00	12,790,000	
大成ラミック	3,500	2,903.00	10,160,500	
クミアイ化学工業	44,500	866.00	38,537,000	
日本農薬	19,200	485.00	9,312,000	
アキレス	7,400	1,453.00	10,752,200	
有沢製作所	16,100	976.00	15,713,600	
日東電工	74,200	9,370.00	695,254,000	
レック	11,500	1,312.00	15,088,000	
三光合成	12,300	466.00	5,731,800	
きもと	18,300	178.00	3,257,400	
藤森工業	9,700	4,640.00	45,008,000	
前澤化成工業	6,800	971.00	6,602,800	
未来工業	5,800	1,602.00	9,291,600	
ウェーブロックホールディングス	3,700	873.00	3,230,100	
J S P	6,300	1,734.00	10,924,200	
エフピコ	22,600	4,210.00	95,146,000	
天馬	7,200	2,116.00	15,235,200	
信越ポリマー	19,300	957.00	18,470,100	
東リ	26,800	244.00	6,539,200	
ニフコ	39,500	3,855.00	152,272,500	
バルカー	8,700	2,172.00	18,896,400	
ユニ・チャーム	228,100	4,923.00	1,122,936,300	
ショーエイコーポレーション	1,800	1,021.00	1,837,800	
協和キリン	108,200	2,778.00	300,579,600	
武田薬品工業	895,000	3,587.00	3,210,365,000	
アステラス製薬	932,700	1,685.00	1,571,599,500	
大日本住友製薬	79,700	1,511.00	120,426,700	
塩野義製薬	135,300	5,658.00	765,527,400	
わかもと製薬	12,800	245.00	3,136,000	
あすか製薬	12,200	1,533.00	18,702,600	
日本新薬	28,200	7,180.00	202,476,000	
バイオフェルミン製薬	1,800	2,460.00	4,428,000	
中外製薬	336,500	5,619.00	1,890,793,500	
科研製薬	18,400	4,065.00	74,796,000	
エーザイ	128,800	7,633.00	983,130,400	
ロート製薬	55,200	3,110.00	171,672,000	
小野薬品工業	247,000	3,055.00	754,585,000	
久光製薬	28,400	6,020.00	170,968,000	
持田製薬	14,900	3,880.00	57,812,000	

参天製薬	200,500	1,679.00	336,639,500
扶桑薬品工業	3,800	2,659.00	10,104,200
日本ケミファ	1,400	2,221.00	3,109,400
ツムラ	33,300	3,345.00	111,388,500
日医工	30,500	979.00	29,859,500
キッセイ薬品工業	19,000	2,213.00	42,047,000
生化学工業	20,900	1,000.00	20,900,000
栄研化学	18,900	1,983.00	37,478,700
日水製薬	4,500	994.00	4,473,000
鳥居薬品	6,700	3,175.00	21,272,500
JCRファーマ	30,300	2,461.00	74,568,300
東和薬品	13,800	1,921.00	26,509,800
富士製薬工業	7,300	1,213.00	8,854,900
沢井製薬	22,100	4,740.00	104,754,000
ゼリア新薬工業	19,500	1,907.00	37,186,500
第一三共	923,500	3,580.00	3,306,130,000
キョーリン製薬ホールディングス	23,700	1,914.00	45,361,800
大幸薬品	13,200	1,608.00	21,225,600
ダイト	6,900	3,575.00	24,667,500
大塚ホールディングス	223,600	4,413.00	986,746,800
大正製薬ホールディングス	22,700	6,780.00	153,906,000
ペプチドリーム	54,700	5,830.00	318,901,000
日本コークス工業	90,900	93.00	8,453,700
ニチレキ	12,700	1,494.00	18,973,800
ユシロ化学工業	6,000	1,090.00	6,540,000
ビーピー・カストロール	3,800	1,230.00	4,674,000
富士石油	28,700	193.00	5,539,100
MORESCO	3,900	1,107.00	4,317,300
出光興産	119,400	2,501.00	298,619,400
ENEOSホールディングス	1,618,200	433.00	700,680,600
コスモエネルギーホールディングス	31,100	2,305.00	71,685,500
横浜ゴム	62,300	1,729.00	107,716,700
TOYO TIRE	56,600	1,685.00	95,371,000
ブリヂストン	286,000	4,100.00	1,172,600,000
住友ゴム工業	96,600	1,017.00	98,242,200
藤倉コンポジット	9,400	388.00	3,647,200
オカモト	6,500	3,905.00	25,382,500
フコク	4,700	670.00	3,149,000
ニッタ	12,100	2,230.00	26,983,000
住友理工	20,800	581.00	12,084,800
三ツ星ベルト	14,200	1,670.00	23,714,000
バンドー化学	18,900	656.00	12,398,400

日東紡績	16,000	4,655.00	74,480,000
A G C	98,800	3,825.00	377,910,000
日本板硝子	51,500	476.00	24,514,000
石塚硝子	2,000	1,891.00	3,782,000
日本山村硝子	4,600	862.00	3,965,200
日本電気硝子	39,900	2,254.00	89,934,600
オハラ	4,300	1,827.00	7,856,100
住友大阪セメント	19,400	3,055.00	59,267,000
太平洋セメント	68,000	2,647.00	179,996,000
日本ヒューム	10,900	802.00	8,741,800
日本コンクリート工業	23,500	305.00	7,167,500
三谷セキサン	5,000	4,705.00	23,525,000
アジアパイルホールディングス	15,500	490.00	7,595,000
東海カーボン	105,300	1,485.00	156,370,500
日本カーボン	6,000	4,105.00	24,630,000
東洋炭素	6,400	2,036.00	13,030,400
ノリタケカンパニーリミテド	6,000	3,205.00	19,230,000
T O T O	76,900	6,000.00	461,400,000
日本碍子	129,200	1,748.00	225,841,600
日本特殊陶業	81,900	1,799.00	147,338,100
M A R U W A	4,100	11,520.00	47,232,000
品川リフラクトリーズ	2,900	2,796.00	8,108,400
黒崎播磨	2,200	4,840.00	10,648,000
ヨータイ	8,700	838.00	7,290,600
イソライト工業	5,700	550.00	3,135,000
東京窯業	14,000	342.00	4,788,000
ニッカトー	5,000	802.00	4,010,000
フジミインコーポレーテッド	9,600	4,450.00	42,720,000
クニミネ工業	4,400	1,248.00	5,491,200
エーアンドエーマテリアル	1,800	1,046.00	1,882,800
ニチアス	29,500	2,483.00	73,248,500
ニチハ	15,000	3,195.00	47,925,000
日本製鉄	476,100	1,305.50	621,548,550
神戸製鋼所	194,800	539.00	104,997,200
中山製鋼所	14,900	362.00	5,393,800
合同製鐵	5,700	2,042.00	11,639,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	287,300	995.00	285,863,500
東京製鐵	51,900	681.00	35,343,900
共英製鋼	12,000	1,399.00	16,788,000
大和工業	22,600	2,639.00	59,641,400
東京鐵鋼	4,400	2,075.00	9,130,000
大阪製鐵	5,700	1,257.00	7,164,900

淀川製鋼所	14,400	2,169.00	31,233,600
丸一鋼管	34,600	2,320.00	80,272,000
モリ工業	3,200	2,321.00	7,427,200
大同特殊鋼	17,400	4,265.00	74,211,000
日本高周波鋼業	4,100	352.00	1,443,200
日本冶金工業	8,800	1,782.00	15,681,600
山陽特殊製鋼	7,300	1,529.00	11,161,700
愛知製鋼	6,000	3,215.00	19,290,000
日立金属	114,600	1,677.00	192,184,200
日本金属	2,500	1,259.00	3,147,500
大太平洋金属	7,200	2,318.00	16,689,600
新日本電工	68,800	282.00	19,401,600
栗本鐵工所	5,300	1,652.00	8,755,600
虹技	1,600	1,100.00	1,760,000
三菱製鋼	7,900	635.00	5,016,500
日亜鋼業	15,700	296.00	4,647,200
日本精線	1,700	3,720.00	6,324,000
エンビプロ・ホールディングス	4,600	704.00	3,238,400
シンニッタン	16,800	206.00	3,460,800
新家工業	2,500	1,295.00	3,237,500
大紀アルミニウム工業所	17,600	770.00	13,552,000
日本軽金属ホールディングス	27,000	1,939.00	52,353,000
三井金属鉱業	28,700	3,950.00	113,365,000
東邦亜鉛	5,500	2,328.00	12,804,000
三菱マテリアル	70,300	2,302.00	161,830,600
住友金属鉱山	136,000	5,072.00	689,792,000
D O W Aホールディングス	26,900	4,035.00	108,541,500
古河機械金属	19,000	1,265.00	24,035,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,100	859.00	9,534,900
東邦チタニウム	19,100	919.00	17,552,900
U A C J	16,200	1,891.00	30,634,200
C Kサンエツ	2,200	3,770.00	8,294,000
古河電気工業	33,100	2,813.00	93,110,300
住友電気工業	397,800	1,449.50	576,611,100
フジクラ	128,500	481.00	61,808,500
昭和電線ホールディングス	12,400	1,751.00	21,712,400
東京特殊電線	1,600	2,415.00	3,864,000
タツタ電線	21,200	764.00	16,196,800
カナレ電気	1,800	1,701.00	3,061,800
平河ヒューテック	5,400	1,304.00	7,041,600
リョービ	13,100	1,241.00	16,257,100
アーレスティ	14,100	372.00	5,245,200

アサヒホールディングス	18,700	4,200.00	78,540,000
稲葉製作所	6,000	1,392.00	8,352,000
宮地エンジニアリンググループ	3,200	2,468.00	7,897,600
トーカロ	29,600	1,535.00	45,436,000
アルファC o	3,700	1,005.00	3,718,500
SUMCO	136,100	2,446.00	332,900,600
川田テクノロジーズ	2,200	4,295.00	9,449,000
RS Technologies	3,500	6,590.00	23,065,000
ジェイテックコーポレーション	700	3,830.00	2,681,000
信和	6,100	706.00	4,306,600
東洋製罐グループホールディングス	67,800	1,162.00	78,783,600
ホッカンホールディングス	5,800	1,443.00	8,369,400
コロナ	5,900	948.00	5,593,200
横河ブリッジホールディングス	19,800	2,061.00	40,807,800
駒井ハルテック	2,000	2,304.00	4,608,000
高田機工	1,000	2,548.00	2,548,000
三和ホールディングス	100,300	1,236.00	123,970,800
文化シャッター	31,300	930.00	29,109,000
三協立山	13,700	819.00	11,220,300
アルインコ	7,700	952.00	7,330,400
東洋シャッター	2,600	680.00	1,768,000
LIXIL	157,000	2,542.00	399,094,000
日本フィルコン	7,400	503.00	3,722,200
ノーリツ	22,100	1,540.00	34,034,000
長府製作所	10,800	2,068.00	22,334,400
リンナイ	20,700	11,240.00	232,668,000
ダイニチ工業	5,700	912.00	5,198,400
日東精工	13,400	450.00	6,030,000
三洋工業	1,400	1,859.00	2,602,600
岡部	21,600	766.00	16,545,600
ジーテクト	13,200	1,477.00	19,496,400
東プレ	19,800	1,494.00	29,581,200
高周波熱錬	20,500	485.00	9,942,500
東京製綱	7,600	1,372.00	10,427,200
サンコール	8,000	455.00	3,640,000
モリテック スチール	8,300	433.00	3,593,900
パイオラックス	15,700	1,533.00	24,068,100
エイチワン	10,400	742.00	7,716,800
日本発條	114,100	731.00	83,407,100
中央発條	1,300	2,790.00	3,627,000
アドバネクス	1,500	1,346.00	2,019,000
立川ブラインド工業	4,700	1,312.00	6,166,400



三益半導体工業	8,300	2,992.00	24,833,600
日本ドライケミカル	2,700	1,511.00	4,079,700
日本製鋼所	32,300	3,095.00	99,968,500
三浦工業	46,000	6,110.00	281,060,000
タクマ	36,100	2,109.00	76,134,900
ツガミ	22,100	1,797.00	39,713,700
オークマ	12,400	6,170.00	76,508,000
芝浦機械	12,100	2,381.00	28,810,100
アマダ	132,000	1,196.00	157,872,000
アイダエンジニアリング	28,000	975.00	27,300,000
滝澤鉄工所	3,400	1,002.00	3,406,800
F U J I	45,800	2,870.00	131,446,000
牧野フライス製作所	12,500	4,105.00	51,312,500
オーエスジー	52,500	1,927.00	101,167,500
ダイジェット工業	1,300	1,328.00	1,726,400
旭ダイヤモンド工業	28,200	468.00	13,197,600
D M G 森精機	67,400	1,623.00	109,390,200
ソディック	23,200	914.00	21,204,800
ディスコ	14,400	36,900.00	531,360,000
日東工器	5,900	1,723.00	10,165,700
日進工具	4,200	2,700.00	11,340,000
パンチ工業	9,700	441.00	4,277,700
富士ダイス	4,800	650.00	3,120,000
豊和工業	6,000	862.00	5,172,000
O K K	4,400	423.00	1,861,200
東洋機械金属	7,700	435.00	3,349,500
津田駒工業	2,000	902.00	1,804,000
エンシュウ	2,700	890.00	2,403,000
島精機製作所	16,800	1,861.00	31,264,800
オプトラン	13,400	2,270.00	30,418,000
N C ホールディングス	3,300	577.00	1,904,100
イワキポンプ	6,800	823.00	5,596,400
フリー	10,500	1,124.00	11,802,000
ヤマシンフィルタ	23,900	1,061.00	25,357,900
日阪製作所	13,200	851.00	11,233,200
やまびこ	20,700	1,346.00	27,862,200
平田機工	5,000	8,510.00	42,550,000
ペガサスミシン製造	11,000	334.00	3,674,000
マルマエ	4,000	1,350.00	5,400,000
タツモ	4,600	1,541.00	7,088,600
ナブテスコ	62,700	4,990.00	312,873,000
三井海洋開発	11,300	2,040.00	23,052,000

レオン自動機	10,500	1,160.00	12,180,000
S M C	33,800	68,240.00	2,306,512,000
ホソカワミクロン	3,800	6,370.00	24,206,000
ユニオンツール	4,000	3,135.00	12,540,000
オイレス工業	13,800	1,627.00	22,452,600
日精エー・エス・ビー機械	3,100	6,020.00	18,662,000
サトーホールディングス	15,200	2,200.00	33,440,000
技研製作所	9,400	4,835.00	45,449,000
日本エアーテック	3,500	1,502.00	5,257,000
カワタ	3,200	1,006.00	3,219,200
日精樹脂工業	9,100	922.00	8,390,200
オカダアイヨン	3,400	1,144.00	3,889,600
ワイエイシイホールディングス	4,600	1,088.00	5,004,800
小松製作所	487,300	2,986.50	1,455,321,450
住友重機械工業	61,600	3,000.00	184,800,000
日立建機	43,100	3,200.00	137,920,000
日工	14,900	715.00	10,653,500
巴工業	4,300	2,015.00	8,664,500
井関農機	10,800	1,370.00	14,796,000
T O W A	10,900	2,111.00	23,009,900
丸山製作所	2,300	1,587.00	3,650,100
北川鉄工所	4,900	1,349.00	6,610,100
ローツェ	4,700	8,680.00	40,796,000
タカキタ	3,800	704.00	2,675,200
クボタ	565,100	2,437.00	1,377,148,700
荏原実業	2,700	3,900.00	10,530,000
三菱化工機	3,700	3,435.00	12,709,500
月島機械	19,900	1,400.00	27,860,000
帝国電機製作所	8,900	1,197.00	10,653,300
新東工業	25,700	765.00	19,660,500
澁谷工業	9,400	3,495.00	32,853,000
アイチ コーポレーション	18,700	924.00	17,278,800
小森コーポレーション	27,400	700.00	19,180,000
鶴見製作所	8,300	1,846.00	15,321,800
住友精密工業	1,600	1,984.00	3,174,400
日本ギア工業	4,500	295.00	1,327,500
酒井重工業	2,100	2,150.00	4,515,000
荏原製作所	44,600	3,695.00	164,797,000
石井鐵工所	1,400	2,889.00	4,044,600
西島製作所	11,000	849.00	9,339,000
北越工業	11,100	1,031.00	11,444,100
ダイキン工業	137,100	23,135.00	3,171,808,500

オルガノ	3,900	6,810.00	26,559,000
トーヨーカネツ	4,700	2,565.00	12,055,500
栗田工業	58,200	4,445.00	258,699,000
椿本チエイン	15,400	2,700.00	41,580,000
大同工業	5,300	722.00	3,826,600
木村化工機	9,100	609.00	5,541,900
アネスト岩田	16,800	1,096.00	18,412,800
ダイフク	55,000	12,990.00	714,450,000
サムコ	2,700	3,990.00	10,773,000
加藤製作所	6,000	944.00	5,664,000
油研工業	1,900	1,569.00	2,981,100
タダノ	52,000	940.00	48,880,000
フジテック	39,100	2,337.00	91,376,700
C K D	29,500	2,607.00	76,906,500
キトー	8,200	1,535.00	12,587,000
平和	30,000	1,451.00	43,530,000
理想科学工業	9,500	1,379.00	13,100,500
S A N K Y O	24,000	2,878.00	69,072,000
日本金銭機械	12,000	510.00	6,120,000
マースグループホールディングス	6,900	1,518.00	10,474,200
フクシマガリレイ	6,600	4,360.00	28,776,000
オーイズミ	4,700	405.00	1,903,500
ダイコク電機	5,000	876.00	4,380,000
竹内製作所	18,000	2,441.00	43,938,000
アマノ	28,200	2,380.00	67,116,000
J U K I	15,000	531.00	7,965,000
蛇の目ミシン工業	9,900	792.00	7,840,800
マックス	16,500	1,441.00	23,776,500
グローリー	27,700	2,048.00	56,729,600
新晃工業	10,000	1,806.00	18,060,000
大和冷機工業	17,300	1,008.00	17,438,400
セガサミーホールディングス	106,700	1,711.00	182,563,700
日本ピストンリング	4,000	947.00	3,788,000
リケン	5,000	2,137.00	10,685,000
T P R	14,500	1,444.00	20,938,000
ツバキ・ナカシマ	20,600	1,263.00	26,017,800
ホシザキ	33,900	9,060.00	307,134,000
大豊工業	8,800	740.00	6,512,000
日本精工	202,600	948.00	192,064,800
N T N	249,000	266.00	66,234,000
ジェイテクト	103,300	873.00	90,180,900
不二越	10,000	4,510.00	45,100,000

日本トムソン	32,000	488.00	15,616,000
THK	67,100	3,570.00	239,547,000
ユーシン精機	8,400	986.00	8,282,400
前澤給装工業	3,900	2,200.00	8,580,000
イーグル工業	13,400	990.00	13,266,000
前澤工業	7,300	602.00	4,394,600
日本ピラー工業	10,900	1,640.00	17,876,000
キッツ	39,300	597.00	23,462,100
マキタ	140,300	5,000.00	701,500,000
日立造船	85,400	670.00	57,218,000
三菱重工業	180,300	3,126.00	563,617,800
IHI	77,500	1,977.00	153,217,500
スター精密	16,600	1,577.00	26,178,200
日清紡ホールディングス	65,900	777.00	51,204,300
イビデン	66,000	5,170.00	341,220,000
コニカミノルタ	236,500	423.00	100,039,500
ブラザー工業	131,600	2,337.00	307,549,200
ミネベアミツミ	200,000	2,321.00	464,200,000
日立製作所	516,900	4,358.00	2,252,650,200
三菱電機	1,075,700	1,633.50	1,757,155,950
富士電機	64,800	4,055.00	262,764,000
東洋電機製造	4,000	1,152.00	4,608,000
安川電機	115,800	5,710.00	661,218,000
シンフォニアテクノロジー	14,000	1,458.00	20,412,000
明電舎	19,800	2,420.00	47,916,000
オリジン	3,000	1,329.00	3,987,000
山洋電気	5,300	6,050.00	32,065,000
デンヨー	9,200	2,057.00	18,924,400
東芝テック	13,500	3,765.00	50,827,500
芝浦メカトロニクス	2,000	5,470.00	10,940,000
マブチモーター	29,900	4,160.00	124,384,000
日本電産	258,900	14,200.00	3,676,380,000
トレックス・セミコンダクター	6,600	1,418.00	9,358,800
東光高岳	6,300	1,602.00	10,092,600
ダイヘン	11,800	5,020.00	59,236,000
ヤーマン	17,800	1,904.00	33,891,200
JVCケンウッド	91,100	172.00	15,669,200
ミマキエンジニアリング	10,700	480.00	5,136,000
I-PEX	5,300	2,026.00	10,737,800
日新電機	25,300	1,351.00	34,180,300
大崎電気工業	21,500	590.00	12,685,000
オムロン	96,400	9,560.00	921,584,000

日東工業	15,800	2,041.00	32,247,800
I D E C	15,600	1,841.00	28,719,600
正興電機製作所	2,800	2,109.00	5,905,200
不二電機工業	2,200	1,311.00	2,884,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,100	3,235.00	116,783,500
サクサホールディングス	2,600	1,363.00	3,543,800
メルコホールディングス	3,900	3,460.00	13,494,000
テクノメディカ	2,800	1,587.00	4,443,600
日本電気	130,500	5,890.00	768,645,000
富士通	103,700	16,950.00	1,757,715,000
沖電気工業	43,800	1,062.00	46,515,600
岩崎通信機	4,700	842.00	3,957,400
電気興業	5,200	2,754.00	14,320,800
サンケン電気	11,800	5,130.00	60,534,000
ナカヨ	2,100	1,424.00	2,990,400
アイホン	6,100	1,622.00	9,894,200
ルネサスエレクトロニクス	462,600	1,308.00	605,080,800
セイコーエプソン	133,500	1,637.00	218,539,500
ワコム	72,900	999.00	72,827,100
アルバック	19,800	5,090.00	100,782,000
アクセル	5,100	756.00	3,855,600
E I Z O	8,400	3,680.00	30,912,000
日本信号	27,500	936.00	25,740,000
京三製作所	25,400	409.00	10,388,600
能美防災	14,500	2,211.00	32,059,500
ホーチキ	8,200	1,229.00	10,077,800
星和電機	6,100	643.00	3,922,300
エレコム	12,400	4,990.00	61,876,000
パナソニック	1,229,000	1,450.00	1,782,050,000
シャープ	124,500	2,156.00	268,422,000
アンリツ	69,300	2,688.00	186,278,400
富士通ゼネラル	29,200	2,630.00	76,796,000
ソニー	673,900	10,480.00	7,062,472,000
T D K	52,000	17,720.00	921,440,000
帝国通信工業	5,200	1,066.00	5,543,200
タムラ製作所	36,100	571.00	20,613,100
アルプスアルパイン	95,600	1,454.00	139,002,400
池上通信機	3,400	860.00	2,924,000
鈴木	5,800	1,165.00	6,757,000
日本トリム	1,600	4,380.00	7,008,000
ローランド ディー . ジー .	6,700	1,742.00	11,671,400
フォスター電機	11,300	1,461.00	16,509,300

S M K	2,800	3,070.00	8,596,000
ヨコオ	7,100	3,185.00	22,613,500
ホシデン	30,000	946.00	28,380,000
ヒロセ電機	16,600	15,420.00	255,972,000
日本航空電子工業	24,700	1,563.00	38,606,100
T O A	11,600	825.00	9,570,000
マクセルホールディングス	23,600	1,344.00	31,718,400
古野電気	14,400	1,127.00	16,228,800
ユニデンホールディングス	3,000	2,181.00	6,543,000
スミダコーポレーション	9,700	1,010.00	9,797,000
アイコム	6,000	2,764.00	16,584,000
リオン	4,700	3,405.00	16,003,500
本多通信工業	10,300	478.00	4,923,400
横河電機	98,700	2,261.00	223,160,700
新電元工業	3,800	2,878.00	10,936,400
アズビル	67,900	5,590.00	379,561,000
東亜ディーケーケー	5,900	825.00	4,867,500
日本光電工業	44,600	3,080.00	137,368,000
チノー	3,800	1,424.00	5,411,200
共和電業	11,500	389.00	4,473,500
日本電子材料	4,300	2,181.00	9,378,300
堀場製作所	21,300	6,850.00	145,905,000
アドバンテスト	80,000	9,120.00	729,600,000
小野測器	5,500	523.00	2,876,500
エスベック	9,800	1,998.00	19,580,400
キーエンス	97,500	57,650.00	5,620,875,000
日置電機	5,300	4,210.00	22,313,000
シスメックス	77,000	13,000.00	1,001,000,000
日本マイクロニクス	19,100	1,509.00	28,821,900
メガチップス	10,200	3,155.00	32,181,000
O B A R A G R O U P	6,400	4,150.00	26,560,000
澤藤電機	1,600	2,125.00	3,400,000
原田工業	5,700	855.00	4,873,500
コーセル	14,800	1,247.00	18,455,600
イリソ電子工業	9,200	4,720.00	43,424,000
オブテックスグループ	17,900	2,041.00	36,533,900
千代田インテグレ	4,900	1,785.00	8,746,500
アイ・オー・データ機器	4,000	1,020.00	4,080,000
レーザーテック	47,300	15,170.00	717,541,000
スタンレー電気	75,600	3,180.00	240,408,000
岩崎電気	4,600	1,422.00	6,541,200
ウシオ電機	59,800	1,394.00	83,361,200

岡谷電機産業	9,800	359.00	3,518,200
ヘリオス テクノ ホールディング	11,600	319.00	3,700,400
エノモト	3,600	1,660.00	5,976,000
日本セラミック	11,100	2,813.00	31,224,300
遠藤照明	6,400	513.00	3,283,200
古河電池	8,000	1,660.00	13,280,000
双信電機	6,400	445.00	2,848,000
山一電機	8,100	1,742.00	14,110,200
図研	7,200	2,831.00	20,383,200
日本電子	21,300	4,515.00	96,169,500
カシオ計算機	95,200	1,812.00	172,502,400
ファナック	101,200	27,070.00	2,739,484,000
日本シイエムケイ	26,600	417.00	11,092,200
エンプラス	5,600	4,030.00	22,568,000
大真空	4,200	2,522.00	10,592,400
ローム	44,800	11,660.00	522,368,000
浜松ホトニクス	77,300	6,400.00	494,720,000
三井ハイテック	12,000	4,380.00	52,560,000
新光電気工業	36,300	2,686.00	97,501,800
京セラ	151,400	6,864.00	1,039,209,600
太陽誘電	47,900	6,070.00	290,753,000
村田製作所	316,000	10,495.00	3,316,420,000
双葉電子工業	17,600	949.00	16,702,400
北陸電気工業	4,900	930.00	4,557,000
ニチコン	36,900	1,498.00	55,276,200
日本ケミコン	8,700	1,941.00	16,886,700
K O A	16,600	1,589.00	26,377,400
市光工業	17,000	687.00	11,679,000
小糸製作所	64,500	7,010.00	452,145,000
ミツバ	19,800	459.00	9,088,200
S C R E E Nホールディングス	18,700	8,420.00	157,454,000
キャノン電子	10,200	1,594.00	16,258,800
キャノン	534,600	2,192.00	1,171,843,200
リコー	273,800	750.00	205,350,000
象印マホービン	29,400	1,744.00	51,273,600
M U T O Hホールディングス	1,700	1,498.00	2,546,600
東京エレクトロン	68,300	43,510.00	2,971,733,000
トヨタ紡織	31,400	1,690.00	53,066,000
芦森工業	2,300	940.00	2,162,000
ユニプレス	20,900	984.00	20,565,600
豊田自動織機	87,100	8,540.00	743,834,000
モリタホールディングス	18,800	1,739.00	32,693,200

三櫻工業	13,700	945.00	12,946,500
デンソー	236,800	6,030.00	1,427,904,000
東海理化電機製作所	28,400	1,720.00	48,848,000
三井E & Sホールディングス	38,900	440.00	17,116,000
川崎重工業	83,700	2,404.00	201,214,800
名村造船所	34,600	184.00	6,366,400
日本車輛製造	3,900	2,540.00	9,906,000
三菱ロジスネクスト	14,200	1,209.00	17,167,800
近畿車輛	1,600	1,219.00	1,950,400
日産自動車	1,268,600	555.60	704,834,160
いすゞ自動車	311,700	968.00	301,725,600
トヨタ自動車	1,200,300	7,660.00	9,194,298,000
日野自動車	134,300	926.00	124,361,800
三菱自動車工業	398,200	237.00	94,373,400
エフテック	7,600	609.00	4,628,400
レシップホールディングス	4,200	500.00	2,100,000
G M B	2,000	984.00	1,968,000
ファルテック	2,000	679.00	1,358,000
武蔵精密工業	24,000	1,534.00	36,816,000
日産車体	21,000	873.00	18,333,000
新明和工業	29,000	908.00	26,332,000
極東開発工業	20,000	1,446.00	28,920,000
トピー工業	8,900	1,291.00	11,489,900
ティラド	3,900	1,358.00	5,296,200
曙ブレーキ工業	59,000	168.00	9,912,000
タチエス	17,700	1,098.00	19,434,600
N O K	57,900	1,234.00	71,448,600
フタバ産業	30,000	516.00	15,480,000
K Y B	12,000	2,324.00	27,888,000
大同メタル工業	20,700	514.00	10,639,800
プレス工業	53,500	309.00	16,531,500
ミクニ	13,900	273.00	3,794,700
太平洋工業	22,600	1,144.00	25,854,400
河西工業	14,700	396.00	5,821,200
アイシン精機	88,600	3,105.00	275,103,000
マツダ	316,500	775.00	245,287,500
今仙電機製作所	10,100	744.00	7,514,400
本田技研工業	847,000	2,851.50	2,415,220,500
スズキ	213,200	5,098.00	1,086,893,600
S U B A R U	334,000	2,043.00	682,362,000
安永	5,200	1,298.00	6,749,600
ヤマハ発動機	152,000	2,177.00	330,904,000



T B K	12,900	440.00	5,676,000
エクセディ	14,600	1,460.00	21,316,000
豊田合成	34,800	2,849.00	99,145,200
愛三工業	17,000	520.00	8,840,000
盟和産業	1,700	892.00	1,516,400
日本プラスト	8,500	490.00	4,165,000
ヨロズ	10,100	1,268.00	12,806,800
エフ・シー・シー	17,600	1,754.00	30,870,400
シマノ	40,300	26,265.00	1,058,479,500
テイ・エス テック	25,000	3,065.00	76,625,000
ジャムコ	5,400	657.00	3,547,800
テルモ	304,400	4,157.00	1,265,390,800
クリエートメディック	3,600	970.00	3,492,000
日機装	34,800	1,030.00	35,844,000
日本エム・ディ・エム	6,200	2,266.00	14,049,200
島津製作所	128,600	4,125.00	530,475,000
J M S	9,100	932.00	8,481,200
長野計器	7,800	985.00	7,683,000
ブイ・テクノロジー	5,000	6,190.00	30,950,000
東京計器	6,900	925.00	6,382,500
愛知時計電機	1,400	4,260.00	5,964,000
インターアクション	5,800	2,669.00	15,480,200
オーバル	9,700	353.00	3,424,100
東京精密	19,500	5,100.00	99,450,000
マニー	42,900	2,847.00	122,136,300
ニコン	164,300	813.00	133,575,900
トプコン	54,200	1,298.00	70,351,600
オリンパス	595,200	2,100.50	1,250,217,600
理研計器	9,500	3,030.00	28,785,000
タムロン	8,700	2,008.00	17,469,600
H O Y A	213,400	13,625.00	2,907,575,000
シード	4,600	599.00	2,755,400
ノーリツ鋼機	7,300	2,204.00	16,089,200
エー・アンド・デイ	9,800	1,289.00	12,632,200
朝日インテック	121,900	3,480.00	424,212,000
シチズン時計	126,100	307.00	38,712,700
リズム	3,400	685.00	2,329,000
大研医器	7,500	559.00	4,192,500
メニコン	15,200	6,780.00	103,056,000
シンシア	1,200	671.00	805,200
松風	4,900	1,700.00	8,330,000
セイコーホールディングス	15,200	1,332.00	20,246,400

ニプロ	74,500	1,208.00	89,996,000
中本パックス	2,700	1,618.00	4,368,600
スノーピーク	6,400	1,883.00	12,051,200
パラマウントベッドホールディングス	11,300	4,680.00	52,884,000
トランザクション	5,900	1,049.00	6,189,100
粧美堂	3,100	396.00	1,227,600
ニホンフラッシュ	10,000	1,348.00	13,480,000
前田工織	11,900	2,698.00	32,106,200
永大産業	14,100	282.00	3,976,200
アートネイチャー	11,500	647.00	7,440,500
バンダイナムコホールディングス	111,200	9,274.00	1,031,268,800
アイフィスジャパン	2,700	706.00	1,906,200
共立印刷	18,000	117.00	2,106,000
S H O E I	9,400	4,075.00	38,305,000
フランスベッドホールディングス	15,200	933.00	14,181,600
パイロットコーポレーション	19,000	2,978.00	56,582,000
萩原工業	6,000	1,479.00	8,874,000
トッパン・フォームズ	23,000	1,059.00	24,357,000
フジシールインターナショナル	24,100	1,914.00	46,127,400
タカラトミー	48,200	893.00	43,042,600
廣済堂	7,500	838.00	6,285,000
エステールホールディングス	2,900	603.00	1,748,700
タカノ	4,200	594.00	2,494,800
プロネクサス	9,200	1,041.00	9,577,200
ホクシン	6,600	112.00	739,200
ウッドワン	3,600	1,051.00	3,783,600
大建工業	7,200	1,718.00	12,369,600
凸版印刷	151,800	1,460.00	221,628,000
大日本印刷	140,800	1,836.00	258,508,800
共同印刷	3,300	3,565.00	11,764,500
N I S S H A	22,100	1,379.00	30,475,900
光村印刷	900	1,705.00	1,534,500
T A K A R A & C O M P A N Y	5,200	1,720.00	8,944,000
アシックス	95,100	1,786.00	169,848,600
ツツミ	3,400	1,894.00	6,439,600
小松ウオール工業	3,300	1,726.00	5,695,800
ヤマハ	64,000	5,980.00	382,720,000
河合楽器製作所	3,300	2,865.00	9,454,500
クリナップ	10,000	461.00	4,610,000
ピジョン	69,100	4,465.00	308,531,500
オリバー	2,300	2,467.00	5,674,100
兼松サステック	700	1,757.00	1,229,900

キングジム	8,900	858.00	7,636,200
リンテック	25,600	2,404.00	61,542,400
イトーキ	21,400	333.00	7,126,200
任天堂	66,000	63,920.00	4,218,720,000
三菱鉛筆	17,700	1,312.00	23,222,400
タカスタンダード	22,200	1,490.00	33,078,000
コクヨ	51,600	1,337.00	68,989,200
ナカバヤシ	10,600	612.00	6,487,200
グロープライド	4,800	4,435.00	21,288,000
オカムラ	37,500	917.00	34,387,500
美津濃	9,800	2,010.00	19,698,000
東京電力ホールディングス	858,700	409.00	351,208,300
中部電力	329,100	1,308.00	430,462,800
関西電力	407,600	1,054.50	429,814,200
中国電力	155,200	1,271.00	197,259,200
北陸電力	98,300	706.00	69,399,800
東北電力	268,700	902.00	242,367,400
四国電力	96,900	728.00	70,543,200
九州電力	221,700	1,004.00	222,586,800
北海道電力	100,700	418.00	42,092,600
沖縄電力	20,900	1,413.00	29,531,700
電源開発	85,600	1,763.00	150,912,800
エフオン	5,800	1,203.00	6,977,400
イーレックス	15,700	1,768.00	27,757,600
レノバ	18,100	4,450.00	80,545,000
東京瓦斯	206,900	2,298.50	475,559,650
大阪瓦斯	208,700	1,982.00	413,643,400
東邦瓦斯	52,900	6,310.00	333,799,000
北海道瓦斯	5,800	1,561.00	9,053,800
広島ガス	22,100	372.00	8,221,200
西部瓦斯	12,100	2,984.00	36,106,400
静岡ガス	30,500	984.00	30,012,000
メタウォーター	10,400	2,465.00	25,636,000
SBSホールディングス	8,000	2,400.00	19,200,000
東武鉄道	112,100	2,947.00	330,358,700
相鉄ホールディングス	34,400	2,420.00	83,248,000
東急	271,300	1,258.00	341,295,400
京浜急行電鉄	138,100	1,611.00	222,479,100
小田急電鉄	160,000	3,245.00	519,200,000
京王電鉄	55,800	8,240.00	459,792,000
京成電鉄	74,900	3,450.00	258,405,000
富士急行	14,700	4,800.00	70,560,000

新京成電鉄	2,800	2,170.00	6,076,000	
東日本旅客鉄道	189,300	6,760.00	1,279,668,000	
西日本旅客鉄道	95,900	5,368.00	514,791,200	
東海旅客鉄道	89,400	14,625.00	1,307,475,000	
西武ホールディングス	140,400	983.00	138,013,200	
鴻池運輸	17,100	1,001.00	17,117,100	
西日本鉄道	29,800	2,914.00	86,837,200	
ハマキョウレックス	8,300	2,975.00	24,692,500	
サカイ引越センター	5,700	5,070.00	28,899,000	
近鉄グループホールディングス	101,900	4,455.00	453,964,500	
阪急阪神ホールディングス	135,900	3,325.00	451,867,500	
南海電気鉄道	48,300	2,510.00	121,233,000	
京阪ホールディングス	45,400	4,925.00	223,595,000	
神戸電鉄	2,400	3,580.00	8,592,000	
名古屋鉄道	83,800	2,676.00	224,248,800	
山陽電気鉄道	7,300	1,950.00	14,235,000	
日本通運	35,300	7,240.00	255,572,000	
ヤマトホールディングス	168,700	2,580.00	435,246,000	
山九	28,300	3,965.00	112,209,500	
丸運	5,800	250.00	1,450,000	
丸全昭和運輸	8,300	3,375.00	28,012,500	
センコーグループホールディングス	56,200	986.00	55,413,200	
トナミホールディングス	2,400	5,410.00	12,984,000	
ニッコンホールディングス	36,500	2,108.00	76,942,000	
日本石油輸送	1,100	2,644.00	2,908,400	
福山通運	13,000	4,115.00	53,495,000	
セイノーホールディングス	76,300	1,389.00	105,980,700	
エスライン	3,100	886.00	2,746,600	
神奈川中央交通	2,500	3,835.00	9,587,500	
日立物流	18,700	3,070.00	57,409,000	
丸和運輸機関	21,500	2,243.00	48,224,500	
C & F ロジホールディングス	10,300	2,152.00	22,165,600	
九州旅客鉄道	89,300	2,148.00	191,816,400	
S Gホールディングス	213,900	2,804.00	599,775,600	
日本郵船	85,500	2,633.00	225,121,500	
商船三井	64,700	3,015.00	195,070,500	
川崎汽船	31,400	2,027.00	63,647,800	
N S ユナイテッド海運	6,200	1,485.00	9,207,000	
飯野海運	49,200	434.00	21,352,800	
共栄タンカー	2,700	900.00	2,430,000	
乾汽船	5,900	922.00	5,439,800	
日本航空	228,700	1,894.00	433,157,800	

ANAホールディングス	253,700	2,209.50	560,550,150
パスコ	2,000	1,372.00	2,744,000
トランコム	2,800	8,320.00	23,296,000
日新	8,800	1,254.00	11,035,200
三菱倉庫	32,300	3,090.00	99,807,000
三井倉庫ホールディングス	11,600	2,294.00	26,610,400
住友倉庫	36,600	1,274.00	46,628,400
澁澤倉庫	5,600	2,092.00	11,715,200
東陽倉庫	18,400	316.00	5,814,400
日本トランスシティ	22,400	514.00	11,513,600
ケイヒン	2,000	1,298.00	2,596,000
中央倉庫	6,200	1,125.00	6,975,000
川西倉庫	1,900	1,141.00	2,167,900
安田倉庫	8,400	954.00	8,013,600
ファイズホールディングス	2,200	1,123.00	2,470,600
東洋埠頭	3,100	1,397.00	4,330,700
宇徳	8,700	467.00	4,062,900
上組	56,800	1,850.00	105,080,000
サンリツ	2,400	698.00	1,675,200
キムラユニティー	2,700	1,080.00	2,916,000
キューソー流通システム	2,500	1,569.00	3,922,500
近鉄エクスプレス	21,600	2,640.00	57,024,000
東海運	5,800	311.00	1,803,800
エーアイティー	7,200	987.00	7,106,400
内外トランスライン	3,600	1,175.00	4,230,000
日本コンセプト	3,200	1,447.00	4,630,400
NEC ネットズエスアイ	30,000	1,920.00	57,600,000
クロスキャット	2,900	1,216.00	3,526,400
システナ	37,700	2,076.00	78,265,200
デジタルアーツ	5,200	10,690.00	55,588,000
日鉄ソリューションズ	15,900	3,200.00	50,880,000
キューブシステム	5,700	1,250.00	7,125,000
エイジア	2,000	1,935.00	3,870,000
コア	4,600	1,452.00	6,679,200
ラクーンホールディングス	5,300	1,808.00	9,582,400
ソリトンシステムズ	5,400	1,835.00	9,909,000
ソフトクリエイイトホールディングス	4,700	2,794.00	13,131,800
T I S	105,600	2,204.00	232,742,400
J N S ホールディングス	4,200	556.00	2,335,200
電算システム	4,000	3,175.00	12,700,000
グリー	65,000	586.00	38,090,000
コーエーテクモホールディングス	21,600	5,980.00	129,168,000

三菱総合研究所	4,600	4,300.00	19,780,000
電算	1,200	2,476.00	2,971,200
A G S	6,100	843.00	5,142,300
ファインデックス	9,000	1,114.00	10,026,000
ブレインパッド	2,800	4,195.00	11,746,000
K L a b	19,200	901.00	17,299,200
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	12,900	1,199.00	15,467,100
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	2,771.00	4,433,600
ネクソン	266,500	3,265.00	870,122,500
アイスタイル	29,900	416.00	12,438,400
エムアップホールディングス	3,100	2,533.00	7,852,300
エイチーム	7,400	1,139.00	8,428,600
エニグモ	10,100	1,257.00	12,695,700
テクノスジャパン	8,400	682.00	5,728,800
コロプラ	34,800	930.00	32,364,000
ブロードリーフ	52,600	636.00	33,453,600
クロス・マーケティンググループ	5,100	366.00	1,866,600
デジタルハーツホールディングス	5,700	1,378.00	7,854,600
システム情報	8,000	1,246.00	9,968,000
メディアドゥ	3,500	6,880.00	24,080,000
じげん	26,500	393.00	10,414,500
ブイキューブ	5,800	3,385.00	19,633,000
エンカレッジ・テクノロジー	2,500	700.00	1,750,000
サイバーリンクス	3,500	2,230.00	7,805,000
フィックスターズ	11,400	998.00	11,377,200
C A R T A H O L D I N G S	4,400	1,333.00	5,865,200
オブティム	5,600	3,265.00	18,284,000
セレス	3,500	2,518.00	8,813,000
S H I F T	4,700	13,150.00	61,805,000
ティーガイア	9,400	1,879.00	17,662,600
セック	1,600	2,820.00	4,512,000
日本アジアグループ	11,100	861.00	9,557,100
テクマトリックス	14,900	2,004.00	29,859,600
プロシップ	3,200	1,428.00	4,569,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	25,500	2,600.00	66,300,000
G M O ペイメントゲートウェイ	22,400	15,400.00	344,960,000
ザッパラス	4,800	509.00	2,443,200
システムリサーチ	2,900	1,757.00	5,095,300
インターネットイニシアティブ	31,300	2,222.00	69,548,600
さくらインターネット	11,500	743.00	8,544,500
ヴィンクス	3,100	1,180.00	3,658,000
G M O グローバルサイン・ホールディングス	2,400	9,320.00	22,368,000

S R Aホールディングス	5,700	2,511.00	14,312,700
システムインテグレータ	3,600	616.00	2,217,600
朝日ネット	7,700	879.00	6,768,300
e B A S E	12,700	1,057.00	13,423,900
アバント	10,200	1,230.00	12,546,000
アドソル日進	3,800	3,195.00	12,141,000
フリービット	5,600	983.00	5,504,800
コムチュア	11,900	2,998.00	35,676,200
サイバーコム	2,000	1,693.00	3,386,000
アステリア	6,600	1,053.00	6,949,800
アイル	6,000	1,481.00	8,886,000
マークラインズ	4,500	2,499.00	11,245,500
メディカル・データ・ビジョン	12,100	3,015.00	36,481,500
g u m i	13,700	872.00	11,946,400
ショーケース	2,400	1,001.00	2,402,400
モバイルファクトリー	2,500	1,102.00	2,755,000
テラスカイ	3,900	3,825.00	14,917,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,200	1,557.00	6,539,400
P C Iホールディングス	4,100	1,596.00	6,543,600
パイプドHD	1,400	1,596.00	2,234,400
アイビーシー	1,800	1,121.00	2,017,800
ネオジャパン	2,100	2,012.00	4,225,200
P R T I M E S	1,800	4,200.00	7,560,000
ランドコンピュータ	1,700	1,115.00	1,895,500
ダブルスタンダード	1,400	4,400.00	6,160,000
オープンドア	5,300	1,628.00	8,628,400
マイネット	3,500	922.00	3,227,000
アカツキ	3,800	4,740.00	18,012,000
ベネフィットジャパン	900	1,844.00	1,659,600
U b i c o mホールディングス	2,400	3,735.00	8,964,000
カナミックネットワーク	9,900	720.00	7,128,000
ノムラシステムコーポレーション	5,000	376.00	1,880,000
チェンジ	14,800	3,475.00	51,430,000
シンクロ・フード	4,900	328.00	1,607,200
オークネット	5,700	1,345.00	7,666,500
セグエグループ	2,800	1,324.00	3,707,200
エイトレッド	1,800	2,797.00	5,034,600
A O I T Y O H o l d i n g s	11,000	439.00	4,829,000
マクロミル	21,800	741.00	16,153,800
ビーグリー	2,100	1,750.00	3,675,000
オロ	3,400	4,080.00	13,872,000
ユーザーローカル	1,100	4,310.00	4,741,000

テモナ	2,400	1,027.00	2,464,800
ニーズウェル	2,200	678.00	1,491,600
サインポスト	2,500	963.00	2,407,500
ソルクシーズ	4,200	1,000.00	4,200,000
フェイス	3,900	812.00	3,166,800
プロトコーポレーション	9,600	1,057.00	10,147,200
ハイマックス	2,600	1,180.00	3,068,000
野村総合研究所	149,700	3,900.00	583,830,000
サイバネットシステム	7,600	997.00	7,577,200
C Eホールディングス	5,800	626.00	3,630,800
日本システム技術	1,800	1,580.00	2,844,000
インテージホールディングス	13,300	1,144.00	15,215,200
東邦システムサイエンス	2,900	930.00	2,697,000
ソースネクスト	50,600	285.00	14,421,000
インフォコム	11,600	3,420.00	39,672,000
HEROZ	1,500	2,748.00	4,122,000
ラクスル	8,500	4,220.00	35,870,000
F I G	12,000	265.00	3,180,000
システムサポート	2,500	1,553.00	3,882,500
イーソル	5,900	1,211.00	7,144,900
アルテリア・ネットワークス	11,800	1,585.00	18,703,000
E d u L a b	1,000	7,050.00	7,050,000
東海ソフト	900	1,205.00	1,084,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	1,900	1,961.00	3,725,900
東名	700	1,153.00	807,100
ヴィッツ	500	2,133.00	1,066,500
トピラシステムズ	1,100	1,391.00	1,530,100
L i n k - U	800	1,330.00	1,064,000
フォーカスシステムズ	6,700	942.00	6,311,400
クレスコ	6,500	1,296.00	8,424,000
フジ・メディア・ホールディングス	101,800	1,174.00	119,513,200
オービック	36,600	20,930.00	766,038,000
ジャストシステム	17,200	7,920.00	136,224,000
T D Cソフト	9,400	970.00	9,118,000
Zホールディングス	1,449,800	699.80	1,014,570,040
トレンドマイクロ	56,400	5,730.00	323,172,000
I Dホールディングス	4,100	1,209.00	4,956,900
日本オラクル	21,400	13,280.00	284,192,000
アルファシステムズ	3,300	3,555.00	11,731,500
フューチャー	12,800	1,775.00	22,720,000
C A C H o l d i n g s	7,000	1,372.00	9,604,000
S Bテクノロジー	3,800	3,450.00	13,110,000



トーセ	3,000	801.00	2,403,000
オービックビジネスコンサルタント	10,800	7,020.00	75,816,000
伊藤忠テクノソリューションズ	48,100	3,705.00	178,210,500
アイティフォー	12,900	929.00	11,984,100
東計電算	1,600	4,030.00	6,448,000
エクスネット	1,800	970.00	1,746,000
大塚商会	57,100	5,170.00	295,207,000
サイボウズ	12,400	2,759.00	34,211,600
電通国際情報サービス	13,100	3,830.00	50,173,000
A C C E S S	10,100	763.00	7,706,300
デジタルガレージ	19,000	3,880.00	73,720,000
E Mシステムズ	15,100	970.00	14,647,000
ウェザーニューズ	3,600	5,140.00	18,504,000
C I J	7,400	869.00	6,430,600
ビジネスエンジニアリング	1,200	3,180.00	3,816,000
日本エンタープライズ	11,400	224.00	2,553,600
WOWOW	5,100	2,841.00	14,489,100
スカラ	7,200	826.00	5,947,200
インテリジェント ウェイブ	6,400	727.00	4,652,800
I M A G I C A G R O U P	9,400	359.00	3,374,600
ネットワンシステムズ	40,300	3,820.00	153,946,000
システムソフト	24,300	92.00	2,235,600
アルゴグラフィックス	9,000	3,075.00	27,675,000
マーベラス	16,300	959.00	15,631,700
エイベックス	18,200	1,285.00	23,387,000
日本ユニシス	33,000	4,065.00	134,145,000
兼松エレクトロニクス	5,800	4,010.00	23,258,000
都築電気	3,400	1,603.00	5,450,200
T B S ホールディングス	64,300	1,941.00	124,806,300
日本テレビホールディングス	88,200	1,149.00	101,341,800
朝日放送グループホールディングス	10,700	699.00	7,479,300
テレビ朝日ホールディングス	29,100	1,859.00	54,096,900
スカパーJ S A Tホールディングス	69,700	471.00	32,828,700
テレビ東京ホールディングス	8,700	2,383.00	20,732,100
日本BS放送	3,700	1,153.00	4,266,100
ビジョン	13,200	923.00	12,183,600
スマートバリュー	2,900	924.00	2,679,600
ワイヤレスゲート	4,500	669.00	3,010,500
コネクシオ	6,100	1,384.00	8,442,400
クロップス	2,100	742.00	1,558,200
日本電信電話	1,411,000	2,699.50	3,808,994,500
K D D I	769,600	3,244.00	2,496,582,400

ソフトバンク	959,400	1,347.00	1,292,311,800
光通信	10,900	21,700.00	236,530,000
エムティーアイ	10,400	822.00	8,548,800
GMOインターネット	37,900	3,090.00	117,111,000
ファイバーゲート	3,500	2,121.00	7,423,500
アイドママーケティングコミュニケーション	3,500	430.00	1,505,000
KADOKAWA	28,500	3,485.00	99,322,500
学研ホールディングス	14,200	1,660.00	23,572,000
ゼンリン	21,200	1,171.00	24,825,200
昭文社ホールディングス	5,200	456.00	2,371,200
インプレスホールディングス	8,700	188.00	1,635,600
アイネット	5,500	1,565.00	8,607,500
松竹	7,000	14,300.00	100,100,000
東宝	62,300	3,970.00	247,331,000
東映	4,000	17,390.00	69,560,000
エヌ・ティ・ティ・データ	281,100	1,500.00	421,650,000
ピー・シー・エー	1,800	4,655.00	8,379,000
ビジネスブレイン太田昭和	3,700	1,600.00	5,920,000
D T S	23,700	2,111.00	50,030,700
スクウェア・エニックス・ホールディングス	45,000	5,930.00	266,850,000
シーイーシー	11,400	1,462.00	16,666,800
カプコン	49,800	7,140.00	355,572,000
アイ・エス・ビー	5,000	1,345.00	6,725,000
ジャステック	6,800	1,234.00	8,391,200
S C S K	24,400	5,530.00	134,932,000
日本システムウエア	3,600	2,148.00	7,732,800
アイネス	10,500	1,415.00	14,857,500
T K C	8,900	7,160.00	63,724,000
富士ソフト	11,300	5,170.00	58,421,000
N S D	34,000	2,037.00	69,258,000
コナミホールディングス	38,400	6,640.00	254,976,000
福井コンピュータホールディングス	4,200	3,760.00	15,792,000
J B C Cホールディングス	7,200	1,522.00	10,958,400
ミロク情報サービス	9,400	2,051.00	19,279,400
ソフトバンクグループ	837,500	8,800.00	7,370,000,000
ハウスイ	900	1,000.00	900,000
高千穂交易	4,100	1,196.00	4,903,600
オルバヘルスケアホールディングス	1,300	1,483.00	1,927,900
伊藤忠食品	2,600	5,300.00	13,780,000
エレマテック	9,900	993.00	9,830,700
J A L U X	3,000	1,373.00	4,119,000
あらた	8,400	4,680.00	39,312,000

トーメンデバイス	1,600	3,535.00	5,656,000
東京エレクトロン デバイス	3,800	3,390.00	12,882,000
フィールズ	8,100	480.00	3,888,000
双日	585,200	246.00	143,959,200
アルフレッサ ホールディングス	117,800	2,030.00	239,134,000
横浜冷凍	27,700	867.00	24,015,900
ラサ商事	5,600	901.00	5,045,600
アルコニックス	11,300	1,668.00	18,848,400
神戸物産	73,100	2,960.00	216,376,000
ハイパー	1,600	534.00	854,400
あい ホールディングス	15,100	2,029.00	30,637,900
ディーブイエックス	3,800	1,041.00	3,955,800
ダイワボウホールディングス	9,000	8,890.00	80,010,000
マクニカ・富士エレホールディングス	25,300	2,081.00	52,649,300
ラクト・ジャパン	4,600	2,662.00	12,245,200
グリムス	2,400	1,598.00	3,835,200
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,000	802.00	16,040,000
八洲電機	8,200	969.00	7,945,800
メディアスホールディングス	6,000	787.00	4,722,000
レスターホールディングス	11,000	2,141.00	23,551,000
ジューテックホールディングス	2,400	1,016.00	2,438,400
大光	4,500	662.00	2,979,000
O C H Iホールディングス	3,100	1,306.00	4,048,600
T O K A Iホールディングス	56,000	979.00	54,824,000
黒谷	2,900	760.00	2,204,000
C o m i n i x	1,900	757.00	1,438,300
三洋貿易	10,700	993.00	10,625,100
ビューティガレージ	1,700	2,453.00	4,170,100
ウイン・パートナーズ	7,700	1,101.00	8,477,700
ミタチ産業	3,200	597.00	1,910,400
シップヘルスケアホールディングス	17,000	6,020.00	102,340,000
明治電機工業	3,300	1,546.00	5,101,800
デリカフーズホールディングス	3,800	615.00	2,337,000
スターティアホールディングス	2,400	1,041.00	2,498,400
コメダホールディングス	23,100	1,896.00	43,797,600
ピーバンドットコム	1,100	1,122.00	1,234,200
アセンテック	2,300	1,899.00	4,367,700
富士興産	3,200	1,041.00	3,331,200
協栄産業	1,200	1,336.00	1,603,200
小野建	9,500	1,224.00	11,628,000
南陽	2,300	1,649.00	3,792,700
佐島電機	7,200	764.00	5,500,800

エコトレーディング	2,500	660.00	1,650,000
伯東	6,500	1,155.00	7,507,500
コンドーテック	8,200	1,053.00	8,634,600
中山福	6,100	557.00	3,397,700
ナガイレーベン	14,100	2,990.00	42,159,000
三菱食品	11,700	2,820.00	32,994,000
松田産業	7,700	1,902.00	14,645,400
第一興商	15,800	3,450.00	54,510,000
メディパルホールディングス	114,300	2,066.00	236,143,800
S P K	4,600	1,253.00	5,763,800
萩原電気ホールディングス	3,900	2,517.00	9,816,300
アズワン	6,900	16,250.00	112,125,000
スズデン	3,700	1,237.00	4,576,900
尾家産業	3,100	1,279.00	3,964,900
シモジマ	6,500	1,371.00	8,911,500
ドウシシャ	10,000	1,938.00	19,380,000
小津産業	2,300	1,904.00	4,379,200
高速	6,300	1,542.00	9,714,600
たけびし	3,700	1,571.00	5,812,700
リックス	2,400	1,536.00	3,686,400
丸文	9,400	538.00	5,057,200
ハピネット	8,900	1,618.00	14,400,200
橋本総業ホールディングス	2,100	2,540.00	5,334,000
日本ライフライン	31,400	1,501.00	47,131,400
タカショー	6,900	809.00	5,582,100
マルカ	3,400	1,902.00	6,466,800
I D O M	28,600	640.00	18,304,000
進和	6,300	2,101.00	13,236,300
エスケイジャパン	2,300	457.00	1,051,100
ダイトロン	4,500	1,639.00	7,375,500
シークス	13,500	1,524.00	20,574,000
田中商事	3,300	692.00	2,283,600
オーハシテクニカ	5,400	1,400.00	7,560,000
白銅	3,800	1,396.00	5,304,800
ダイコー通産	700	1,538.00	1,076,600
伊藤忠商事	741,000	3,143.00	2,328,963,000
丸紅	1,102,800	722.30	796,552,440
高島	1,700	1,648.00	2,801,600
長瀬産業	59,600	1,545.00	92,082,000
蝶理	6,800	1,525.00	10,370,000
豊田通商	118,300	4,350.00	514,605,000
三共生興	16,100	469.00	7,550,900

兼松	39,500	1,325.00	52,337,500
ツカモトコーポレーション	1,900	1,595.00	3,030,500
三井物産	917,300	2,059.50	1,889,179,350
日本紙パルプ商事	6,000	3,555.00	21,330,000
カメイ	13,800	1,180.00	16,284,000
東都水産	1,400	3,610.00	5,054,000
OUGホールディングス	1,700	2,791.00	4,744,700
スターゼン	3,900	4,240.00	16,536,000
山善	41,400	997.00	41,275,800
椿本興業	2,000	3,450.00	6,900,000
住友商事	668,500	1,417.00	947,264,500
内田洋行	4,200	4,125.00	17,325,000
三菱商事	694,700	2,683.50	1,864,227,450
第一実業	5,200	4,095.00	21,294,000
キャノンマーケティングジャパン	26,300	2,375.00	62,462,500
西華産業	6,000	1,344.00	8,064,000
佐藤商事	8,800	908.00	7,990,400
菱洋エレクトロ	10,700	3,400.00	36,380,000
東京産業	9,600	611.00	5,865,600
ユアサ商事	10,100	3,205.00	32,370,500
神鋼商事	2,700	1,872.00	5,054,400
トルク	6,400	243.00	1,555,200
阪和興業	19,800	2,784.00	55,123,200
正栄食品工業	6,900	3,700.00	25,530,000
カナデン	8,600	1,270.00	10,922,000
菱電商事	7,600	1,585.00	12,046,000
フルサト工業	5,900	1,314.00	7,752,600
岩谷産業	27,400	7,210.00	197,554,000
ナイス	4,500	1,604.00	7,218,000
昭光通商	3,400	638.00	2,169,200
ニチモウ	1,700	1,880.00	3,196,000
極東貿易	3,100	1,388.00	4,302,800
イワキ	14,000	680.00	9,520,000
三愛石油	26,100	1,102.00	28,762,200
稲畑産業	23,400	1,470.00	34,398,000
G S Iクレオス	2,600	1,911.00	4,968,600
明和産業	9,800	450.00	4,410,000
クワザワホールディングス	3,800	620.00	2,356,000
ヤマエ久野	7,700	1,047.00	8,061,900
ワキタ	22,600	983.00	22,215,800
東邦ホールディングス	34,000	1,951.00	66,334,000
サンゲツ	28,600	1,533.00	43,843,800

ミツウロコグループホールディングス	15,600	1,335.00	20,826,000
シナノンホールディングス	4,400	3,070.00	13,508,000
伊藤忠エネクス	23,500	1,016.00	23,876,000
サンリオ	29,800	1,542.00	45,951,600
サンワテクノス	7,500	1,050.00	7,875,000
リョーサン	11,700	1,989.00	23,271,300
新光商事	15,900	745.00	11,845,500
トーホー	4,800	1,828.00	8,774,400
三信電気	5,700	1,810.00	10,317,000
東陽テクニカ	11,400	1,187.00	13,531,800
モスフードサービス	13,900	3,060.00	42,534,000
加賀電子	10,600	2,328.00	24,676,800
ソーダニッカ	11,000	535.00	5,885,000
立花エレテック	7,800	1,591.00	12,409,800
フォーバル	4,700	791.00	3,717,700
PALTAC	17,000	5,650.00	96,050,000
三谷産業	14,000	432.00	6,048,000
西本Wismettacホールディングス	2,400	2,389.00	5,733,600
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,525.00	1,525,000
コア商事ホールディングス	2,000	1,363.00	2,726,000
国際紙パルプ商事	25,200	238.00	5,997,600
ヤマタネ	5,300	1,361.00	7,213,300
丸紅建材リース	1,000	1,700.00	1,700,000
日鉄物産	7,600	3,685.00	28,006,000
泉州電業	3,000	3,200.00	9,600,000
トラスコ中山	24,300	2,639.00	64,127,700
オートバックスセブン	39,300	1,410.00	55,413,000
モリト	7,800	609.00	4,750,200
加藤産業	15,300	3,450.00	52,785,000
北恵	2,700	889.00	2,400,300
イノテック	5,500	1,107.00	6,088,500
イエローハット	20,000	1,678.00	33,560,000
JKホールディングス	9,600	799.00	7,670,400
日伝	9,600	2,249.00	21,590,400
北沢産業	8,100	274.00	2,219,400
杉本商事	5,700	2,363.00	13,469,100
因幡電機産業	30,200	2,476.00	74,775,200
東テク	3,500	2,767.00	9,684,500
ミスミグループ本社	132,800	3,160.00	419,648,000
アルテック	7,900	283.00	2,235,700
タキヒヨー	3,200	1,839.00	5,884,800
蔵王産業	2,100	1,356.00	2,847,600

スズケン	44,900	4,020.00	180,498,000
ジェコス	7,300	959.00	7,000,700
グローセル	10,700	481.00	5,146,700
ローソン	26,800	4,890.00	131,052,000
サンエー	8,900	4,100.00	36,490,000
カワチ薬品	8,300	3,110.00	25,813,000
エービーシー・マート	16,600	5,900.00	97,940,000
ハードオフコーポレーション	4,500	753.00	3,388,500
アスクル	11,100	3,760.00	41,736,000
ゲオホールディングス	19,300	1,208.00	23,314,400
アダストリア	14,800	1,925.00	28,490,000
くら寿司	6,300	6,200.00	39,060,000
キャンドウ	5,200	1,873.00	9,739,600
パルグループホールディングス	11,000	1,475.00	16,225,000
エディオン	48,800	1,019.00	49,727,200
サーラコーポレーション	21,900	571.00	12,504,900
ワッツ	4,900	880.00	4,312,000
ハローズ	4,000	3,320.00	13,280,000
フジオフードグループ本社	8,900	1,193.00	10,617,700
あみやき亭	2,400	2,851.00	6,842,400
大黒天物産	2,600	5,870.00	15,262,000
ハニーズホールディングス	9,500	1,002.00	9,519,000
ファーマライズホールディングス	2,800	773.00	2,164,400
アルペン	8,200	2,394.00	19,630,800
ハブ	3,300	605.00	1,996,500
クオールホールディングス	15,800	1,149.00	18,154,200
ジinzホールディングス	5,600	6,710.00	37,576,000
ビックカメラ	63,000	1,135.00	71,505,000
D C Mホールディングス	65,100	1,066.00	69,396,600
Monotaro	75,400	5,200.00	392,080,000
東京一番フーズ	3,000	572.00	1,716,000
きちりホールディングス	3,100	573.00	1,776,300
アーランドサービスホールディングス	8,900	2,077.00	18,485,300
J．フロント リテイリング	126,800	851.00	107,906,800
ドトール・日レスホールディングス	15,400	1,559.00	24,008,600
マツモトキヨシホールディングス	43,800	4,280.00	187,464,000
broncoビリー	5,600	2,180.00	12,208,000
Z O Z O	72,900	2,994.00	218,262,600
トレジャー・ファクトリー	3,400	730.00	2,482,000
物語コーポレーション	2,800	11,040.00	30,912,000
ココカラファイン	11,100	7,220.00	80,142,000
三越伊勢丹ホールディングス	185,700	617.00	114,576,900

H a m e e	3,900	1,782.00	6,949,800
ウエルシアホールディングス	63,100	3,595.00	226,844,500
クリエイティブSDホールディングス	17,900	3,460.00	61,934,000
丸善CHIホールディングス	12,400	371.00	4,600,400
ティーライフ	1,700	1,155.00	1,963,500
チムニー	3,400	1,206.00	4,100,400
シュッピン	7,400	927.00	6,859,800
オイシックス・ラ・大地	10,500	3,295.00	34,597,500
ネクステージ	18,300	1,415.00	25,894,500
ジョイフル本田	31,200	1,415.00	44,148,000
鳥貴族	3,200	1,483.00	4,745,600
ホットランド	8,100	1,196.00	9,687,600
すかいらーくホールディングス	118,900	1,647.00	195,828,300
SFPホールディングス	6,200	1,326.00	8,221,200
綿半ホールディングス	8,100	1,378.00	11,161,800
ヨシックス	1,800	2,001.00	3,601,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	31,000	1,115.00	34,565,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,700	844.00	4,810,800
B E E N O S	5,000	2,393.00	11,965,000
あさひ	8,000	1,628.00	13,024,000
日本調剤	6,600	1,502.00	9,913,200
コスモス薬品	9,400	16,200.00	152,280,000
トーエル	5,400	820.00	4,428,000
オンリー	2,200	454.00	998,800
セブン&アイ・ホールディングス	414,500	3,950.00	1,637,275,000
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	56,900	715.00	40,683,500
ツルハホールディングス	23,100	14,110.00	325,941,000
サンマルクホールディングス	8,500	1,492.00	12,682,000
フェリシモ	2,500	1,335.00	3,337,500
トリドールホールディングス	26,400	1,474.00	38,913,600
T O K Y O B A S E	9,900	449.00	4,445,100
ウイルプラスホールディングス	1,600	777.00	1,243,200
J Mホールディングス	8,100	2,095.00	16,969,500
サツドラホールディングス	1,700	2,002.00	3,403,400
アレンザホールディングス	5,400	1,249.00	6,744,600
串カツ田中ホールディングス	2,900	1,565.00	4,538,500
パロックジャパンリミテッド	7,600	747.00	5,677,200
クスリのアオキホールディングス	9,500	8,560.00	81,320,000
力の源ホールディングス	4,800	572.00	2,745,600
スシローグローバルホールディングス	58,200	3,885.00	226,107,000
メディカルシステムネットワーク	10,500	628.00	6,594,000



はるやまホールディングス	5,200	680.00	3,536,000	
ノジマ	18,900	2,850.00	53,865,000	
カッパ・クリエイト	14,900	1,485.00	22,126,500	
ライトオン	7,900	612.00	4,834,800	
良品計画	140,800	2,378.00	334,822,400	
三城ホールディングス	11,900	314.00	3,736,600	
アドヴァン	16,400	1,150.00	18,860,000	
アルビス	4,100	2,416.00	9,905,600	
コナカ	12,500	308.00	3,850,000	
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,668.00	2,335,200	
G - 7ホールディングス	6,300	2,477.00	15,605,100	
イオン北海道	14,100	999.00	14,085,900	
コジマ	18,500	643.00	11,895,500	
ヒマラヤ	3,900	942.00	3,673,800	
コーナン商事	15,100	2,882.00	43,518,200	
エコス	4,000	1,880.00	7,520,000	
ワタミ	12,800	945.00	12,096,000	
マルシェ	3,200	493.00	1,577,600	
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	233,000	2,286.00	532,638,000	
西松屋チェーン	23,400	1,458.00	34,117,200	
ゼンショーホールディングス	50,800	2,828.00	143,662,400	
幸楽苑ホールディングス	6,700	1,656.00	11,095,200	
ハークスレイ	2,400	884.00	2,121,600	
サイゼリヤ	15,800	2,110.00	33,338,000	
V Tホールディングス	44,400	433.00	19,225,200	
魚力	3,000	1,790.00	5,370,000	
フジ・コーポレーション	2,900	2,104.00	6,101,600	
ユナイテッドアローズ	11,200	1,578.00	17,673,600	
ハイデイ日高	15,400	1,692.00	26,056,800	
京都きもの友禅	7,600	206.00	1,565,600	
コロナイド	35,200	1,766.00	62,163,200	
ピーシーデポコーポレーション	14,400	576.00	8,294,400	
壱番屋	7,500	5,090.00	38,175,000	
P L A N T	2,900	723.00	2,096,700	
スギホールディングス	21,200	7,180.00	152,216,000	
薬王堂ホールディングス	4,700	2,585.00	12,149,500	
スクロール	16,500	882.00	14,553,000	
ヨンドシーホールディングス	10,900	1,955.00	21,309,500	
木曽路	13,900	2,393.00	33,262,700	
S R Sホールディングス	12,700	823.00	10,452,100	
リテールパートナーズ	14,200	1,369.00	19,439,800	
ケーヨー	21,900	754.00	16,512,600	

上新電機	12,500	2,767.00	34,587,500
日本瓦斯	16,200	5,120.00	82,944,000
ロイヤルホールディングス	18,500	1,791.00	33,133,500
いなげや	13,200	1,757.00	23,192,400
鳥忠	20,000	5,480.00	109,600,000
チヨダ	11,300	882.00	9,966,600
ライフコーポレーション	8,100	3,255.00	26,365,500
リンガーハット	13,100	2,332.00	30,549,200
MrMaxHD	14,800	734.00	10,863,200
AOKIホールディングス	21,600	543.00	11,728,800
オークワ	16,700	1,268.00	21,175,600
コメリ	16,400	2,851.00	46,756,400
青山商事	22,200	653.00	14,496,600
しまむら	12,300	11,750.00	144,525,000
はせがわ	6,200	291.00	1,804,200
高島屋	77,300	940.00	72,662,000
松屋	21,500	810.00	17,415,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	50,300	704.00	35,411,200
近鉄百貨店	4,100	3,070.00	12,587,000
丸井グループ	97,200	1,791.00	174,085,200
アクシアル リテイリング	8,800	5,030.00	44,264,000
イオン	407,700	3,315.00	1,351,525,500
イズミ	21,600	3,705.00	80,028,000
平和堂	21,600	2,184.00	47,174,400
フジ	12,800	1,987.00	25,433,600
ヤオコー	12,000	6,670.00	80,040,000
ゼビオホールディングス	13,100	870.00	11,397,000
ケースホールディングス	102,400	1,428.00	146,227,200
Olympicグループ	5,700	901.00	5,135,700
日産東京販売ホールディングス	16,300	256.00	4,172,800
シルバーライフ	1,500	2,111.00	3,166,500
Genky DrugStores	4,700	3,985.00	18,729,500
ナルミヤ・インターナショナル	2,600	966.00	2,511,600
ブックオフグループホールディングス	6,200	832.00	5,158,400
ギフト	1,100	1,875.00	2,062,500
アインホールディングス	13,000	6,350.00	82,550,000
元気寿司	2,800	2,356.00	6,596,800
ヤマダホールディングス	323,200	539.00	174,204,800
アークランドサカモト	16,700	1,550.00	25,885,000
ニトリホールディングス	45,900	22,000.00	1,009,800,000
グルメ杵屋	7,800	972.00	7,581,600
愛眼	8,400	226.00	1,898,400

ケーユーホールディングス	5,800	803.00	4,657,400
吉野家ホールディングス	34,900	2,148.00	74,965,200
松屋フーズホールディングス	5,200	3,485.00	18,122,000
サガミホールディングス	14,300	1,169.00	16,716,700
関西スーパーマーケット	9,000	1,130.00	10,170,000
王将フードサービス	7,800	5,740.00	44,772,000
プレナス	12,000	1,916.00	22,992,000
ミニストップ	7,900	1,413.00	11,162,700
アークス	21,800	2,304.00	50,227,200
パローホールディングス	23,500	2,475.00	58,162,500
ベルク	5,300	5,820.00	30,846,000
大庄	5,900	969.00	5,717,100
ファーストリテイリング	14,200	91,820.00	1,303,844,000
サンドラッグ	39,900	4,100.00	163,590,000
サックスパー ホールディングス	9,300	561.00	5,217,300
ヤマザワ	2,600	1,719.00	4,469,400
やまや	2,200	2,183.00	4,802,600
ベルーナ	22,900	1,158.00	26,518,200
島根銀行	2,800	667.00	1,867,600
じもとホールディングス	7,200	805.00	5,796,000
めぶきフィナンシャルグループ	551,300	207.00	114,119,100
東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,300	1,115.00	15,944,500
九州フィナンシャルグループ	232,100	424.00	98,410,400
ゆうちょ銀行	300,600	886.00	266,331,600
富山第一銀行	25,300	286.00	7,235,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	606,000	387.00	234,522,000
西日本フィナンシャルホールディングス	70,600	646.00	45,607,600
関西みらいフィナンシャルグループ	62,300	520.00	32,396,000
三十三フィナンシャルグループ	9,800	1,260.00	12,348,000
第四北越フィナンシャルグループ	18,400	2,240.00	41,216,000
ひろぎんホールディングス	156,500	607.00	94,995,500
新生銀行	77,900	1,342.00	104,541,800
あおぞら銀行	63,200	1,961.00	123,935,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,257,700	483.00	3,505,469,100
りそなホールディングス	1,153,500	374.60	432,101,100
三井住友トラスト・ホールディングス	200,500	3,165.00	634,582,500
三井住友フィナンシャルグループ	733,800	3,339.00	2,450,158,200
千葉銀行	354,100	578.00	204,669,800
群馬銀行	203,800	317.00	64,604,600
武蔵野銀行	15,800	1,553.00	24,537,400
千葉興業銀行	29,100	245.00	7,129,500
筑波銀行	44,100	180.00	7,938,000

七十七銀行	35,800	1,346.00	48,186,800
青森銀行	8,200	2,371.00	19,442,200
秋田銀行	6,800	1,395.00	9,486,000
山形銀行	11,900	1,010.00	12,019,000
岩手銀行	7,000	1,946.00	13,622,000
東邦銀行	94,900	204.00	19,359,600
東北銀行	5,100	1,089.00	5,553,900
みちのく銀行	6,800	1,007.00	6,847,600
ふくおかフィナンシャルグループ	89,400	1,924.00	172,005,600
静岡銀行	258,400	767.00	198,192,800
十六銀行	13,300	1,882.00	25,030,600
スルガ銀行	108,500	316.00	34,286,000
八十二銀行	256,000	342.00	87,552,000
山梨中央銀行	12,300	797.00	9,803,100
大垣共立銀行	21,000	1,993.00	41,853,000
福井銀行	9,100	1,883.00	17,135,300
北國銀行	10,600	2,508.00	26,584,800
清水銀行	4,400	1,697.00	7,466,800
富山銀行	2,000	2,805.00	5,610,000
滋賀銀行	21,300	1,953.00	41,598,900
南都銀行	17,600	1,714.00	30,166,400
百五銀行	95,500	291.00	27,790,500
京都銀行	38,000	5,650.00	214,700,000
紀陽銀行	37,600	1,373.00	51,624,800
ほくほくフィナンシャルグループ	70,600	937.00	66,152,200
山陰合同銀行	62,900	485.00	30,506,500
中国銀行	91,300	818.00	74,683,400
鳥取銀行	3,600	1,119.00	4,028,400
伊予銀行	151,400	619.00	93,716,600
百十四銀行	11,300	1,472.00	16,633,600
四国銀行	16,100	667.00	10,738,700
阿波銀行	17,300	2,228.00	38,544,400
大分銀行	6,100	2,046.00	12,480,600
宮崎銀行	7,100	2,208.00	15,676,800
佐賀銀行	6,400	1,318.00	8,435,200
沖縄銀行	9,700	2,683.00	26,025,100
琉球銀行	24,500	741.00	18,154,500
セブン銀行	354,500	225.00	79,762,500
みずほフィナンシャルグループ	1,441,700	1,407.50	2,029,192,750
高知銀行	3,800	696.00	2,644,800
山口フィナンシャルグループ	132,400	600.00	79,440,000
長野銀行	3,500	1,260.00	4,410,000

名古屋銀行	7,900	2,661.00	21,021,900
北洋銀行	159,900	208.00	33,259,200
愛知銀行	3,800	2,886.00	10,966,800
中京銀行	4,400	1,933.00	8,505,200
大光銀行	3,600	1,272.00	4,579,200
愛媛銀行	14,800	965.00	14,282,000
トマト銀行	4,100	1,031.00	4,227,100
京葉銀行	45,200	405.00	18,306,000
栃木銀行	51,200	172.00	8,806,400
北日本銀行	3,300	1,893.00	6,246,900
東和銀行	18,600	666.00	12,387,600
福島銀行	10,000	209.00	2,090,000
大東銀行	5,500	636.00	3,498,000
トモニホールディングス	82,000	302.00	24,764,000
フィデアホールディングス	103,000	107.00	11,021,000
池田泉州ホールディングス	122,000	149.00	18,178,000
F P G	33,000	491.00	16,203,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	5,500	1,182.00	6,501,000
マーキュリアインベストメント	4,300	719.00	3,091,700
S B Iホールディングス	121,900	2,680.00	326,692,000
ジャフコ グループ	16,300	5,380.00	87,694,000
大和証券グループ本社	851,600	499.70	425,544,520
野村ホールディングス	1,867,100	562.60	1,050,430,460
岡三証券グループ	90,700	403.00	36,552,100
丸三証券	31,800	518.00	16,472,400
東洋証券	38,900	144.00	5,601,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	122,300	322.00	39,380,600
光世証券	2,700	647.00	1,746,900
水戸証券	31,200	266.00	8,299,200
いちよし証券	20,100	501.00	10,070,100
松井証券	60,800	820.00	49,856,000
マネックスグループ	78,100	487.00	38,034,700
極東証券	14,400	756.00	10,886,400
岩井コスモホールディングス	10,100	1,406.00	14,200,600
藍澤証券	19,200	789.00	15,148,800
マネーパートナーズグループ	11,900	214.00	2,546,600
スパークス・グループ	49,500	283.00	14,008,500
かんぽ生命保険	37,600	2,243.00	84,336,800
S O M P Oホールディングス	199,500	4,188.00	835,506,000
アニコム ホールディングス	35,300	1,147.00	40,489,100
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	277,400	3,135.00	869,649,000
第一生命ホールディングス	600,400	1,646.50	988,558,600

東京海上ホールディングス	375,100	5,423.00	2,034,167,300
T & Dホールディングス	317,100	1,272.00	403,351,200
アドバンスクリエイト	2,200	1,862.00	4,096,400
全国保証	29,900	4,540.00	135,746,000
イントラスト	3,800	815.00	3,097,000
日本モーゲージサービス	4,400	1,195.00	5,258,000
C a s a	3,800	998.00	3,792,400
アルヒ	16,900	1,713.00	28,949,700
プレミアグループ	5,800	2,427.00	14,076,600
クレディセゾン	74,400	1,215.00	90,396,000
芙蓉総合リース	11,100	7,190.00	79,809,000
みずほリース	16,400	3,240.00	53,136,000
東京センチュリー	21,400	9,040.00	193,456,000
日本証券金融	46,900	519.00	24,341,100
アイフル	162,100	261.00	42,308,100
リコーリース	8,400	3,100.00	26,040,000
イオンフィナンシャルサービス	65,000	1,299.00	84,435,000
アコム	213,400	468.00	99,871,200
ジャックス	11,800	1,912.00	22,561,600
オリエントコーポレーション	287,600	123.00	35,374,800
日立キャピタル	25,000	2,588.00	64,700,000
オリックス	658,300	1,734.00	1,141,492,200
三菱UFJリース	269,400	515.00	138,741,000
九州リースサービス	5,300	616.00	3,264,800
日本取引所グループ	304,500	2,672.00	813,624,000
イー・ギャランティ	12,200	2,291.00	27,950,200
アサックス	5,600	727.00	4,071,200
NECキャピタルソリューション	4,400	1,955.00	8,602,000
いちご	140,200	281.00	39,396,200
日本駐車場開発	115,200	138.00	15,897,600
スター・マイカ・ホールディングス	6,600	1,100.00	7,260,000
ADワークスグループ	20,100	155.00	3,115,500
ヒューリック	226,300	1,119.00	253,229,700
三栄建築設計	5,100	1,843.00	9,399,300
野村不動産ホールディングス	65,100	2,231.00	145,238,100
三重交通グループホールディングス	24,500	476.00	11,662,000
サムティ	16,000	1,650.00	26,400,000
ディア・ライフ	18,400	434.00	7,985,600
日本商業開発	7,600	1,700.00	12,920,000
ハウスコム	2,900	1,326.00	3,845,400
日本管理センター	6,900	1,189.00	8,204,100
サンセイランディック	5,100	737.00	3,758,700

フージャースホールディングス	21,100	683.00	14,411,300	
オープンハウス	33,800	4,205.00	142,129,000	
東急不動産ホールディングス	291,100	565.00	164,471,500	
飯田グループホールディングス	89,200	2,377.00	212,028,400	
イーランド	3,500	837.00	2,929,500	
ムゲンエステート	9,600	454.00	4,358,400	
ハウズドゥ	5,200	1,249.00	6,494,800	
シーアールイー	3,900	1,305.00	5,089,500	
グッドコムアセット	6,200	1,305.00	8,091,000	
ジェイ・エス・ビー	2,400	3,450.00	8,280,000	
テンポイノベーション	4,000	860.00	3,440,000	
パーク24	57,700	2,001.00	115,457,700	
パラカ	3,600	1,599.00	5,756,400	
三井不動産	516,400	2,036.00	1,051,390,400	
三菱地所	744,300	1,620.00	1,205,766,000	
平和不動産	19,900	3,690.00	73,431,000	
東京建物	105,800	1,455.00	153,939,000	
ダイビル	28,500	1,211.00	34,513,500	
京阪神ビルディング	17,800	1,725.00	30,705,000	
住友不動産	239,000	3,046.00	727,994,000	
テーオーシー	22,800	717.00	16,347,600	
東京楽天地	2,100	4,360.00	9,156,000	
スターツコーポレーション	15,000	2,759.00	41,385,000	
フジ住宅	14,600	637.00	9,300,200	
空港施設	13,600	475.00	6,460,000	
明和地所	8,300	581.00	4,822,300	
ゴールドクレスト	9,200	1,678.00	15,437,600	
エスリード	5,100	1,504.00	7,670,400	
日神グループホールディングス	19,100	423.00	8,079,300	
日本エスコン	19,200	794.00	15,244,800	
タカラレーベン	48,500	320.00	15,520,000	
A V A N T I A	7,700	854.00	6,575,800	
イオンモール	54,000	1,679.00	90,666,000	
毎日コムネット	4,800	672.00	3,225,600	
ファースト住建	5,900	1,062.00	6,265,800	
カチタス	26,700	3,305.00	88,243,500	
トーセイ	16,000	998.00	15,968,000	
穴吹興産	3,200	1,623.00	5,193,600	
サンフロンティア不動産	16,300	886.00	14,441,800	
エフ・ジェー・ネクスト	10,700	1,011.00	10,817,700	
インテリックス	3,000	571.00	1,713,000	
ランドビジネス	3,600	332.00	1,195,200	

サンネクスタグループ	4,900	950.00	4,655,000
グランディハウス	11,700	432.00	5,054,400
日本空港ビルデング	34,100	5,730.00	195,393,000
明豊ファシリティワークス	5,000	636.00	3,180,000
日本工営	7,000	2,761.00	19,327,000
LIFULL	36,400	367.00	13,358,800
ミクシィ	19,700	2,470.00	48,659,000
ジェイエイシーリクルートメント	7,000	1,871.00	13,097,000
日本M&Aセンター	78,700	5,850.00	460,395,000
メンバーズ	3,100	2,730.00	8,463,000
中広	2,000	320.00	640,000
UTグループ	16,200	3,370.00	54,594,000
アイティメディア	4,200	2,259.00	9,487,800
タケエイ	11,400	1,423.00	16,222,200
E・Jホールディングス	4,100	1,002.00	4,108,200
ビーネックスグループ	13,000	1,193.00	15,509,000
コシダカホールディングス	25,200	411.00	10,357,200
アルトナー	2,700	893.00	2,411,100
パソナグループ	11,200	1,880.00	21,056,000
CDS	2,700	1,358.00	3,666,600
リンクアンドモチベーション	18,900	558.00	10,546,200
GCA	13,700	700.00	9,590,000
エス・エム・エス	32,000	4,095.00	131,040,000
サニーサイドアップグループ	3,900	620.00	2,418,000
パーソルホールディングス	102,900	1,953.00	200,963,700
リニカル	5,200	762.00	3,962,400
クックパッド	32,900	308.00	10,133,200
アイ・ケイ・ケイ	5,300	598.00	3,169,400
学情	3,800	1,318.00	5,008,400
スタジオアリス	5,300	2,022.00	10,716,600
シミックホールディングス	5,200	1,491.00	7,753,200
エプコ	2,700	938.00	2,532,600
NJS	2,600	2,009.00	5,223,400
総合警備保障	40,900	5,200.00	212,680,000
カカクコム	76,000	2,984.00	226,784,000
アイロムグループ	3,700	1,800.00	6,660,000
セントケア・ホールディング	6,900	1,007.00	6,948,300
サイネックス	2,000	684.00	1,368,000
ルネサンス	5,900	910.00	5,369,000
ディップ	14,100	2,539.00	35,799,900
デジタルホールディングス	7,300	1,900.00	13,870,000
ツクイホールディングス	24,500	595.00	14,577,500



キャリアデザインセンター	2,500	913.00	2,282,500	
ベネフィット・ワン	37,500	3,075.00	115,312,500	
エムスリー	226,700	10,150.00	2,301,005,000	
ツカダ・グローバルホールディング	8,200	257.00	2,107,400	
アウトソーシング	59,000	1,344.00	79,296,000	
ウェルネット	10,800	453.00	4,892,400	
ワールドホールディングス	3,600	1,947.00	7,009,200	
ディー・エヌ・エー	43,600	1,934.00	84,322,400	
博報堂D Yホールディングス	143,100	1,471.00	210,500,100	
ぐるなび	18,300	535.00	9,790,500	
タカミヤ	11,200	538.00	6,025,600	
ジャパンベストレスキューシステム	8,100	847.00	6,860,700	
ファンコミュニケーションズ	28,700	405.00	11,623,500	
ライク	3,500	1,921.00	6,723,500	
ビジネス・ブレークスルー	4,700	461.00	2,166,700	
エスプール	26,600	914.00	24,312,400	
WDBホールディングス	4,800	2,619.00	12,571,200	
手間いらず	700	4,880.00	3,416,000	
ティア	6,500	412.00	2,678,000	
C D G	1,200	1,505.00	1,806,000	
バリューコマース	7,000	3,250.00	22,750,000	
インフォマート	104,200	928.00	96,697,600	
J Pホールディングス	32,900	288.00	9,475,200	
エコナックホールディングス	20,700	92.00	1,904,400	
E P Sホールディングス	14,100	1,019.00	14,367,900	
レッグス	2,700	1,640.00	4,428,000	
プレステージ・インターナショナル	38,700	915.00	35,410,500	
アミューズ	5,700	2,488.00	14,181,600	
ドリームインキュベータ	3,300	1,285.00	4,240,500	
クイック	6,600	1,064.00	7,022,400	
T A C	6,900	253.00	1,745,700	
電通グループ	115,600	3,130.00	361,828,000	
イオンファンタジー	4,000	2,169.00	8,676,000	
シーティーエス	11,800	922.00	10,879,600	
ネクシィーズグループ	3,400	880.00	2,992,000	
H . U . グループホールディングス	28,800	3,100.00	89,280,000	
アルプス技研	9,200	2,107.00	19,384,400	
ダイオーズ	2,200	947.00	2,083,400	
日本空調サービス	11,000	744.00	8,184,000	
オリエンタルランド	109,300	16,000.00	1,748,800,000	
ダスキン	25,600	2,834.00	72,550,400	
明光ネットワークジャパン	13,300	576.00	7,660,800	

ファルコホールディングス	5,800	1,651.00	9,575,800
ラウンドワン	28,900	850.00	24,565,000
リゾートトラスト	47,200	1,484.00	70,044,800
ビー・エム・エル	13,300	3,755.00	49,941,500
りらいあコミュニケーションズ	18,000	1,381.00	24,858,000
リソー教育	47,600	294.00	13,994,400
早稲田アカデミー	4,600	1,000.00	4,600,000
ユー・エス・エス	115,200	2,094.00	241,228,800
東京個別指導学院	3,900	640.00	2,496,000
サイバーエージェント	63,400	7,510.00	476,134,000
楽天	479,300	979.00	469,234,700
クリーク・アンド・リバー社	5,600	1,148.00	6,428,800
モーニングスター	11,600	473.00	5,486,800
テー・オー・ダブリュー	17,100	267.00	4,565,700
山田コンサルティンググループ	6,800	955.00	6,494,000
セントラルスポーツ	3,900	2,101.00	8,193,900
フルキャストホールディングス	9,100	1,637.00	14,896,700
エン・ジャパン	18,300	3,120.00	57,096,000
リソルホールディングス	1,200	3,815.00	4,578,000
テクノプロ・ホールディングス	20,500	8,560.00	175,480,000
アトラ	2,400	335.00	804,000
インターワークス	2,500	358.00	895,000
アイ・アールジャパンホールディングス	4,200	19,030.00	79,926,000
K e e P e r 技研	7,600	2,152.00	16,355,200
ファーストロジック	2,200	793.00	1,744,600
三機サービス	2,200	971.00	2,136,200
G u n o s y	6,600	744.00	4,910,400
デザインワン・ジャパン	3,900	215.00	838,500
イー・ガーディアン	4,600	3,085.00	14,191,000
リブセンス	6,400	243.00	1,555,200
ジャパンマテリアル	31,700	1,561.00	49,483,700
ベクトル	13,000	1,334.00	17,342,000
ウチヤマホールディングス	5,600	336.00	1,881,600
チャーム・ケア・コーポレーション	8,900	1,467.00	13,056,300
キャリアリンク	3,400	2,600.00	8,840,000
I B J	8,700	807.00	7,020,900
アサンテ	4,200	1,613.00	6,774,600
N・フィールド	7,300	864.00	6,307,200
バリューHR	4,200	1,755.00	7,371,000
M&Aキャピタルパートナーズ	8,400	5,280.00	44,352,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,000	2,010.00	8,040,000
E R Iホールディングス	3,200	621.00	1,987,200

アビスト	1,700	2,925.00	4,972,500
シグマクシス	7,200	1,776.00	12,787,200
ウィルグループ	6,900	1,007.00	6,948,300
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,800	290.00	4,582,000
メドピア	4,900	8,000.00	39,200,000
レアジョブ	1,000	2,386.00	2,386,000
リクルートホールディングス	736,400	4,670.00	3,438,988,000
エラン	14,300	1,626.00	23,251,800
土木管理総合試験所	5,600	339.00	1,898,400
ネットマーケティング	4,300	676.00	2,906,800
日本郵政	842,700	831.50	700,705,050
ベルシステム24ホールディングス	17,300	1,840.00	31,832,000
鎌倉新書	8,000	872.00	6,976,000
S MN	2,400	800.00	1,920,000
L I T A L I C O	3,600	3,795.00	13,662,000
グローバルキッズCOMPANY	2,100	939.00	1,971,900
エアトリ	5,500	1,424.00	7,832,000
アトラエ	3,200	2,745.00	8,784,000
ストライク	3,900	4,735.00	18,466,500
ソラスト	28,500	1,640.00	46,740,000
セラク	3,300	1,823.00	6,015,900
インソース	8,600	1,892.00	16,271,200
ベйкаレント・コンサルティング	6,200	18,980.00	117,676,000
Orchestra Holdings	2,200	2,064.00	4,540,800
アイモバイル	3,800	1,289.00	4,898,200
キャリアインデックス	4,500	562.00	2,529,000
MS - J a p a n	3,500	1,113.00	3,895,500
船場	2,200	865.00	1,903,000
グレイステクノロジー	4,800	6,230.00	29,904,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	23,700	2,638.00	62,520,600
フルテック	1,600	1,374.00	2,198,400
グリーンズ	2,600	449.00	1,167,400
GameWith	3,400	573.00	1,948,200
ソウルドアウト	2,600	1,517.00	3,944,200
MS&Consulting	2,200	558.00	1,227,600
エル・ティー・エス	800	4,010.00	3,208,000
ミダック	1,400	3,110.00	4,354,000
日総工産	7,100	792.00	5,623,200
キュービーネットホールディングス	4,400	1,381.00	6,076,400
R P Aホールディングス	8,100	611.00	4,949,100
スプリックス	3,200	780.00	2,496,000
マネジメントソリューションズ	5,100	1,954.00	9,965,400

プロレド・パートナーズ	1,400	3,695.00	5,173,000
テノ・ホールディングス	1,000	1,266.00	1,266,000
フロンティア・マネジメント	1,800	2,347.00	4,224,600
ピアラ	600	2,040.00	1,224,000
コプロ・ホールディングス	700	4,130.00	2,891,000
ギークス	1,200	1,451.00	1,741,200
カーブスホールディングス	28,500	787.00	22,429,500
フォーラムエンジニアリング	5,600	931.00	5,213,600
ダイレクトマーケティングミックス	4,100	3,600.00	14,760,000
アドバンテッジリスクマネジメント	5,500	635.00	3,492,500
リログループ	56,300	2,498.00	140,637,400
東祥	6,500	1,502.00	9,763,000
エイチ・アイ・エス	14,900	1,683.00	25,076,700
ラックランド	3,000	2,355.00	7,065,000
共立メンテナンス	17,100	3,340.00	57,114,000
イチネンホールディングス	11,700	1,256.00	14,695,200
建設技術研究所	6,700	2,465.00	16,515,500
スペース	6,900	789.00	5,444,100
長大	4,200	1,602.00	6,728,400
燦ホールディングス	4,600	1,140.00	5,244,000
スバル興業	600	8,990.00	5,394,000
東京テアトル	4,200	1,260.00	5,292,000
タナベ経営	2,100	1,342.00	2,818,200
ナガワ	3,300	9,840.00	32,472,000
東京都競馬	6,800	4,415.00	30,022,000
カナモト	18,200	2,292.00	41,714,400
西尾レントオール	9,600	2,235.00	21,456,000
トランス・コスモス	9,900	2,576.00	25,502,400
乃村工藝社	44,300	800.00	35,440,000
藤田観光	4,100	1,419.00	5,817,900
KNT-CTホールディングス	6,400	900.00	5,760,000
日本管財	11,100	2,017.00	22,388,700
トーカイ	10,000	1,990.00	19,900,000
セコム	109,100	9,478.00	1,034,049,800
セントラル警備保障	5,000	3,450.00	17,250,000
丹青社	19,600	761.00	14,915,600
メイテック	12,600	5,210.00	65,646,000
応用地質	12,100	1,311.00	15,863,100
船井総研ホールディングス	21,100	2,291.00	48,340,100
進学会ホールディングス	4,400	475.00	2,090,000
オオバ	7,500	736.00	5,520,000
いであ	2,600	1,758.00	4,570,800

学究社	3,100	1,324.00	4,104,400	
ベネッセホールディングス	34,300	2,009.00	68,908,700	
イオンディライト	12,700	2,697.00	34,251,900	
ナック	5,900	938.00	5,534,200	
ダイセキ	17,300	3,145.00	54,408,500	
ステップ	3,900	1,525.00	5,947,500	
合 計	112,452,700		276,533,619,480	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

**【中間財務諸表】**

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期中間計算期間(2021年1月23日から2021年7月22日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けておりません。

## 【日本株式インデックス e】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位：円 )

	第11期 ( 2021年 1月22日現在 )	第12期中間計算期間 ( 2021年 7月22日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	8,747,958	9,409,782
親投資信託受益証券	3,164,283,156	3,191,138,802
未収入金	2,285,103	7,738,019
流動資産合計	3,175,316,217	3,208,286,603
資産合計	3,175,316,217	3,208,286,603
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,274,886	8,730,582
未払受託者報酬	658,347	709,254
未払委託者報酬	5,431,274	5,851,313
未払利息	3	30
その他未払費用	82,234	88,597
流動負債合計	9,446,744	15,379,776
負債合計	9,446,744	15,379,776
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,384,643,476	1,349,196,218
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	1,781,225,997	1,843,710,609
( 分配準備積立金 )	967,546,863	914,560,608
元本等合計	3,165,869,473	3,192,906,827
純資産合計	3,165,869,473	3,192,906,827
負債純資産合計	3,175,316,217	3,208,286,603

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期中間計算期間 自 2020年 1月23日 至 2020年 7月22日	第12期中間計算期間 自 2021年 1月23日 至 2021年 7月22日
営業収益		
受取利息	16	-
有価証券売買等損益	287,878,951	118,047,984
営業収益合計	287,878,935	118,047,984
営業費用		
支払利息	1,373	1,057
受託者報酬	605,984	709,254
委託者報酬	4,999,290	5,851,313
その他費用	75,693	88,597
営業費用合計	5,682,340	6,650,221
営業利益又は営業損失（ ）	293,561,275	111,397,763
経常利益又は経常損失（ ）	293,561,275	111,397,763
中間純利益又は中間純損失（ ）	293,561,275	111,397,763
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	39,168,766	7,066,521
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,699,073,791	1,781,225,997
剰余金増加額又は欠損金減少額	45,443,076	57,048,462
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	45,443,076	57,048,462
剰余金減少額又は欠損金増加額	133,035,584	98,895,092
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	133,035,584	98,895,092
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,357,088,774	1,843,710,609



## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
-----------------	---------------------------------------

( 中間貸借対照表に関する注記 )

	第11期 (2021年 1月22日現在)	第12期中間計算期間 (2021年 7月22日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,384,643,476口	1,349,196,218口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.2864円 (22,864円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 2.3665円 (23,665円)

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

( 金融商品に関する注記 )

金融商品の時価等に関する事項

	第12期中間計算期間 (2021年 7月22日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第12期中間計算期間 (2021年 7月22日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第11期 自 2020年 1月23日 至 2021年 1月22日	第12期中間計算期間 自 2021年 1月23日 至 2021年 7月22日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,537,979,174円	1,384,643,476円
期中追加設定元本額	91,607,228円	41,368,436円
期中一部解約元本額	244,942,926円	76,815,694円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2021年 7月22日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,515,513,318
株式	282,384,294,880

	2021年 7月22日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	1,490,150
未収入金	614,785,668
未収配当金	357,834,225
前払金	41,219,800
差入委託証拠金	82,401,800
流動資産合計	284,997,539,841
資産合計	284,997,539,841
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	42,720,950
未払解約金	256,095,518
未払利息	2,546
流動負債合計	298,819,014
負債合計	298,819,014
純資産の部	
元本等	
元本	133,490,844,816
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	151,207,876,011
元本等合計	284,698,720,827
純資産合計	284,698,720,827
負債純資産合計	284,997,539,841

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2021年 7月22日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

	2021年 7月22日現在

（貸借対照表に関する注記）

	2021年 7月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	133,490,844,816口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.1327円 (1万口当たり純資産額) (21,327円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。  また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 元本の移動

区分	2021年 7月22日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月23日
期首元本額	135,654,719,286円
期中追加設定元本額	3,847,980,565円
期中一部解約元本額	6,011,855,035円
期末元本額	133,490,844,816円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	608,758,317円
D C 日本株式インデックスファンド	310,669,095円
D C 日本株式インデックスファンド L	53,666,944,553円
D C 日本株式インデックスファンド A	684,028,300円
D C バランスファンド 3 0	2,246,677,068円
D C バランスファンド 5 0	3,455,166,412円
D C バランスファンド 7 0	2,005,930,247円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	562,618,035円
日本株式インデックス e	1,496,290,525円
インデックスコレクション（国内株式）	19,108,408,096円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	11,796,841,894円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	2,435,497,235円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	2,089,731,500円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,495,601,815円
日本株式パッシブファンド私募 A（適格機関投資家専用）	2,771,689,897円
日本株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	1,099,026,692円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	55,303,682円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	656,120,165円
V A バランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	74,942,273円
V A バランスファンド（株 5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	140,588,631円
V A バランス株式 3 0（適格機関投資家専用）	719,719円
V A バランスファンド（株 6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	225,770,467円
バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	836,654,322円
バランス V A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	478,321,532円
バランス V A 5 0 L（適格機関投資家専用）	8,315,887,746円
バランス V A 7 5（適格機関投資家専用）	769,173,381円
V A バランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	84,709,104円
V A ポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	1,315,778,094円
V A ポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	31,151,710円
バランス V A 4 0（適格機関投資家専用）	164,102,041円

区分	2021年 7月22日現在
バランスファンドVA (適格機関投資家専用)	2,132,523,943円
VAバランスファンド2 (株40/100) (適格機関投資家専用)	60,522,719円
VAバランス50-50 (適格機関投資家専用)	63,211,619円
VAファンド25 (適格機関投資家専用)	26,502,259円
バランスファンドVA2 (適格機関投資家専用)	679,553,887円
バランスVA25L (適格機関投資家専用)	293,512,492円
バランスファンドVA3 (適格機関投資家専用)	4,973,038,527円
世界バランスVA25 (適格機関投資家専用)	91,887,183円
国内バランスVA30 (適格機関投資家専用)	39,202,435円
国内バランスVA25 (適格機関投資家専用)	8,477,312円
VAバランス20-80 (適格機関投資家専用)	134,816,334円
私募日本株式インデックスファンドAL (適格機関投資家専用)	4,493,558円

(デリバティブ取引に関する注記)

株式関連

(2021年 7月22日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,368,369,800	-	2,327,150,000	41,219,800
合計		2,368,369,800	-	2,327,150,000	41,219,800

(注)1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【日本株式インデックスe】

## 【純資産額計算書】

(2021年 8月31日現在)

資産総額	3,269,285,356円
負債総額	5,884,886円
純資産総額（ - ）	3,263,400,470円
発行済口数	1,339,580,259口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4361円
（1万口当たり純資産額）	（24,361円）

(参考)

## 日本株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2021年 8月31日現在)

資産総額	296,063,097,016円
負債総額	938,677,310円
純資産総額（ - ）	295,124,419,706円
発行済口数	134,360,353,261口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1965円
（1万口当たり純資産額）	（21,965円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

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

ません。

#### 受益権の譲渡

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

#### 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### 受益権の再分割

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

#### 償還金

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

#### 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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



## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1)資本金の額（2021年 8月31日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

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

##### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

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

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

#### [ D0（実行） ]

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

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

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

#### [ CHECK（検証・評価） ]

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

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

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

委託会社の機構は2021年10月22日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年8月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	538	14,713,325
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	77	281,704
単位型公社債投資信託	50	311,772
合計	665	15,306,802

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

- (2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 百万円 )

	前事業年度 ( 2020年3月31日 )	当事業年度 ( 2021年3月31日 )
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	24,869	21,589
金銭の信託	5,823	10,857
前払費用	348	397
未収委託者報酬	7,284	8,471
未収運用受託報酬	5,842	6,151
未収収益	190	177
その他	4,624	3,428
流動資産合計	48,983	51,072
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 256	1 301
器具備品	1 576	1 692
その他	1 0	1 0
有形固定資産合計	832	993
無形固定資産		
ソフトウェア	3,030	4,104
その他	40	41
無形固定資産合計	3,070	4,145
投資その他の資産		
投資有価証券	8,469	9,950
関係会社株式	5,636	5,636
繰延税金資産	700	311
その他	35	39
投資その他の資産合計	14,842	15,937
固定資産合計	18,745	21,077
資産合計	67,729	72,149

( 単位 : 百万円 )

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	38	44
未払金	7,988	7,572
未払収益分配金	0	0
未払手数料	3,355	4,154
その他未払金	4,632	3,417
未払費用	204	1,046
未払法人税等	897	517
賞与引当金	324	556
その他	1,070	818
流動負債合計	10,524	10,555
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	600	626
資産除去債務	132	133
その他	7	8
固定負債合計	740	768
負債合計	11,264	11,324
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
<b>資本剰余金</b>		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	305	500
<b>その他利益剰余金</b>		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	35,122	38,258
利益剰余金合計	37,528	40,858
株主資本合計	56,767	60,098
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額	587	791
金		
繰延ヘッジ損益	284	65
評価・換算差額等合計	302	726
純資産合計	56,464	60,824
負債・純資産合計	67,729	72,149

## (2) 【損益計算書】

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	34,967	37,224
運用受託報酬	11,091	10,982
その他営業収益	500	403
営業収益合計	46,559	48,611
営業費用		
支払手数料	15,998	17,936
広告宣伝費	331	203
公告費	0	-
調査費	5,018	5,064
調査費	788	898
委託調査費	4,217	4,154
図書費	11	11
営業雑経費	3,434	4,492
通信費	52	56
印刷費	470	449
協会費	53	58
諸会費	16	18
情報機器関連費	2,726	3,815
その他営業雑経費	114	93
営業費用合計	24,783	27,696
一般管理費		
給料	5,756	5,976
役員報酬	244	214
給料・手当	4,962	4,861
賞与	549	901
退職給付費用	118	170
福利費	535	608
交際費	14	1
旅費交通費	190	13
租税公課	344	315
不動産賃借料	269	276
寄付金	7	3
減価償却費	334	748
業務委託費	864	966
諸経費	750	848
一般管理費合計	9,185	9,929
営業利益	12,589	10,984

（単位：百万円）

前事業年度

当事業年度

(自 2019年4月1日  
至 2020年3月31日)(自 2020年4月1日  
至 2021年3月31日)

営業外収益		
受取利息	15	2
収益分配金	119	101
金銭の信託運用益	-	3,038
投資有価証券売却益	483	1
投資有価証券償還益	316	54
為替差益	273	-
デリバティブ利益	666	-
その他	30	45
営業外収益合計	1,906	3,243
営業外費用		
金銭の信託運用損	1,076	-
投資有価証券売却損	4	0
投資有価証券償還損	19	0
為替差損	-	158
デリバティブ費用	-	3,782
その他	19	5
営業外費用合計	1,118	3,946
経常利益	13,377	10,281
特別損失		
システム統合費用	149	110
特別損失合計	149	110
税引前当期純利益	13,227	10,170
法人税、住民税及び事業税	4,263	3,242
法人税等調整額	193	65
法人税等合計	4,070	3,177
当期純利益	9,157	6,993

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	-	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	393	133	526	50,442
当期変動額				
剰余金の配当				2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	980	151	829	829
当期変動額合計	980	151	829	6,022
当期末残高	587	284	302	56,464

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
当期純利益			6,993	6,993	6,993
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	194	-	3,136	3,330	3,330

当期末残高	500	2,100	38,258	40,858	60,098
-------	-----	-------	--------	--------	--------

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

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### (2) その他有価証券

##### 時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法によっております。（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 4. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

### 6. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

#### (2) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度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。

### 7. ヘッジ会計の会計処理

#### (1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

#### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

#### (3) ヘッジ方針

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

#### (4) ヘッジ有効性評価の方法

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



効性を判定しております。

#### 8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### 消費税等の会計処理

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。

#### 9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

#### 10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

## 注記事項

### （貸借対照表関係）

#### 1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
		百万円		百万円
建物	77	百万円	106	百万円
器具備品	285	〃	391	〃
その他	4	〃	4	〃
計	367	〃	503	〃

### （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

#### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

#### 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

#### 3. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

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

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

### 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

### 3. 剰余金の配当に関する事項

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

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

2021年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

（リ - ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

（金融商品関係）

#### 1. 金融商品の状況に関する事項

##### （1）金融商品に対する取組方針

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

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

##### （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

金銭の信託及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引によりリスクの軽減を図っております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針7.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

##### （3）金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

#### 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

#### 資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（注2）を参照ください）。

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	24,869	24,869	-
(2) 金銭の信託	5,823	5,823	-
(3) 未収委託者報酬	7,284	7,284	-
(4) 未収運用受託報酬	5,842	5,842	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	8,469	8,469	-
(6) 未払金	(7,988)	(7,988)	-
(7) デリバティブ取引（*2）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	6	6	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(114)	(114)	-
デリバティブ取引計	(107)	(107)	-

（\*1）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	21,589	21,589	-
(2) 金銭の信託	10,857	10,857	-
(3) 未収委託者報酬	8,471	8,471	-
(4) 未収運用受託報酬	6,151	6,151	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	9,950	9,950	-
(6) 未払金	(7,572)	(7,572)	-
(7) デリバティブ取引（*2）			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(357)	(357)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(73)	(73)	-
デリバティブ取引計	(431)	(431)	-

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金

現金及び預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 投資有価証券 その他有価証券

投資有価証券の時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(6) 未払金

未払金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

(単位:百万円)

区分	前事業年度 2020年3月31日	当事業年度 2021年3月31日
非上場株式	0	0

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	24,869	-	-	-
未収委託者報酬	7,284	-	-	-
未収運用受託報酬	5,842	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	9	5,605	-

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	21,589	-	-	-
未収委託者報酬	8,471	-	-	-
未収運用受託報酬	6,151	-	-	-

投資有価証券 投資信託	-	10	5,751	0
----------------	---	----	-------	---

## （有価証券関係）

## 1．子会社株式

前事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

当事業年度（2021年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

## 2．その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	891	806	84
小計	891	806	84
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	7,578	8,509	931
小計	7,578	8,509	931
合計	8,469	9,316	846

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額0百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:百万円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
109	1	0

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(2020年3月31日)

#### 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

##### (1) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	1,443	-	23	23
	英ポンド	79	-	1	1
	カナダドル	15	-	0	0
	スイスフラン	26	-	0	0
	香港ドル	247	-	4	4
	人民元	18	-	0	0
	ユーロ	223	-	2	2
合計		2,055	-	32	32

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

##### 2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

##### (2) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	8,412	-	358	358
合計		8,412	-	358	358

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

##### 2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

#### 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

##### (1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	種類	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券 子会社株式			
	米ドル		2,819	-	44
	英ポンド		2,660	-	67
	カナダドル		6	-	0
	スイスフラン		35	-	0
	香港ドル		71	-	1
	ユーロ		72	-	0
	合計		5,666	-	114

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

当事業年度（2021年3月31日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 株式関連

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

(注) 1. 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しています。

2. 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

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

(注) 1. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(退職給付関係)

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。当社が有する退職一時金制度は簡便法により、退職給付債務、退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

#### 2. 確定給付制度

##### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	537	600
退職給付費用	74	77
転籍者受入	-	18
退職給付の支払額	11	69
退職給付債務の期末残高	600	626

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

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626
退職給付引当金	600	626
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	600	626

##### (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度74百万円 当事業年度77百万円

#### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度44百万円、当事業年度92百万円であります。

#### 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。



## （税効果会計関係）

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	168	百万円	107	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	99	"	170	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	183	"	191	"
税務上の収益認識差額	-	"	71	"
有価証券評価差額	259	"	-	"
繰延ヘッジ損益	-	"	28	"
その他	151	"	123	"
繰延税金資産 合計	862	"	693	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	-	"	349	"
繰延ヘッジ損益	125	"	-	"
その他	35	"	32	"
繰延税金負債 合計	161	"	382	"
繰延税金資産の純額	700	"	311	"

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

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

## （資産除去債務関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## （セグメント情報等）

## [セグメント情報]

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

## [関連情報]

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

顧客の名称	営業収益
-------	------

三井住友信託銀行株式会社	9,649百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*1)	6,372百万円

(\*1)当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載してあります。

[ 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。

( 持分法損益等 )

該当事項はありません。

( 関連当事者情報 )

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

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

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
----	------------	-----	---------------	-----------	-------------------	-----------	-------	-----------	----	-----------

親会社 の子会 社	三井住 友信託 銀行(株)	東京都 千代田 区	342,037	信託業務 及び銀行 業務	-	営業上の 取引 役員の兼 任	運用受託報 酬	9,365	未収運用 受託報酬	5,402
							投信販売 代行手数料 等	9,124	未払 手数料	1,888

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

運用受託報酬

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

投信販売代行手数料等

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

(エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

前事業年度（2020年3月31日）

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

当事業年度（2021年3月31日）

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

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	18,821,541円72銭	20,274,967円09銭
1株当たり当期純利益金額	3,052,463円23銭	2,331,221円85銭

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	9,157百万円	6,993百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己又はその役員との取引

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

(2) 運用財産相互間の取引

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

(3) 通常の取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

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

(4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

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

(5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

2021年10月22日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2021年3月末日現在）

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

(2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2021年3月末日現在）	事業の内容
株式会社SBI証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	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。
aucacom証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

### (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

### (2)販売会社

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

## 3【資本関係】

### (1)受託会社

該当事項はありません。

### (2)販売会社

該当事項はありません。

#### (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2021年3月末日現在）

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

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

## 第3【その他】

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

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

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

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

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

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

- (6) 交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- (7) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9) 目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10) 有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

2021年6月2日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 藤 澤 孝 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 印  
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」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第35期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じ

て、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。



# 独立監査人の監査報告書

2021年3月22日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本株式インデックス e の2020年1月23日から2021年1月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日本株式インデックス e の2021年1月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2021年9月22日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子 印

## 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、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本株式インデックス e の2021年1月23日から2021年7月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、日本株式インデックス e の2021年7月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年1月23日から2021年7月22日まで）の損益の状況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、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、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。

## 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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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。
- ・ 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、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。