

【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】	2019年12月10日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【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】	MHAMスリーウェイオープン
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券の金額】	継続募集額(2019年12月11日から2020年6月10日まで) 2,000億円を上限とします。
【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】

MHAMスリーウェイオープン(以下「当ファンド」といいます。)

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」と称することがあります。）です。

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ることとし、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関(社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。)の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります(以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。)。委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社は、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。

また、当ファンドについて、委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供される予定の信用格付けはありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

2,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込日の基準価額 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て求めた金額(純資産総額)を計算日における受益権総口数で除した価額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示されることがあります。

基準価額については、販売会社または委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会
は下記においてできます。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

注：電話番号はコールセンターのものであります（以下同じ）。

電話によるお問い合わせは、営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。（以下同じ。）

（５）【申込手数料】

通常のお申込みのお取扱い

申込手数料は、取得申込金額（取得申込口数に発行価格を乗じた額）に、1.1%（税抜1.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。なお、申込手数料には、消費税ならびに地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）が課せられます。

確定拠出年金制度に基づくお申込みのお取扱い

無手数料とします。

申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。

「自動けいぞく投資コース」を選択された場合の収益分配金は、毎計算期末の翌営業日に原則として税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

上記にかかわらず、償還乗換優遇措置等の取扱いを行う販売会社では、一定の条件を満たした場合に申込手数料が割引、または無手数料となる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(6) 【申込単位】

申込単位は、各販売会社が定める単位とします。

「一般コース」および「自動けいぞく投資コース」による取得申込が可能です。販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。なお、「自動けいぞく投資コース」を選択されたお申込者は、収益分配金の再投資に際し、1口の整数倍をもって取得することができます。

申込単位および取扱コースについては、販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2019年12月11日から2020年6月10日まで

申込期間は上記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドの申込取扱場所(以下「販売会社」といいます。)については、下記の委託会社の照会先までお問い合わせください。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

(9) 【払込期日】

取得申込代金は、販売会社が定める期日までに、販売会社にお支払いいただきます。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、アセットマネジメントOne株式会社(「委託者」または「委託会社」といいます。)の指定する口座を經由して、みずほ信託銀行株式会社(「受託者」または「受託会社」といいます。)の指定するファンド口座(受託会社が再信託している場合は、当該再信託受託会社の指定するファンド口座)に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

取得申込代金はお申込みの販売会社にお支払いください。なお、払込取扱場所については、下記の委託会社の照会先までお問い合わせください。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

(1 1) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

投資信託振替制度における振替受益権について

当ファンドの受益権は、2007年1月4日より投資信託振替制度(以下「振替制度」といいます。)に移行しており、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

振替制度においては、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行われます。

確定拠出年金制度に基づくお申込みのお取扱い

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

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】

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をいいます。以下同じ。）に上場（これに準ずるものを含みます。）されている株式・公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、信託財産の安定的な成長を目標として運用を行います。

<ファンドの特色>

・わが国の3資産（株式・債券・短期金融資産）に分散投資します。

・「TAAモデル」の指示により、資産配分を行います。

TAA（タクティカル・アセット・アロケーション）とは、「戦術的資産配分」の意味で、株式や債券等の資産間における相対的な価値を判断し、割安と判断される資産への投資比率を上げ、割高と判断される資産への投資比率を下げる運用手法をいいます（以下同じ。）。

2,000億円を上限に信託金を追加することができます。なお、信託金の上限額については、受託会社と合意のうえ、変更することができます。

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法において、以下のように分類・区分されます。

<商品分類>

・商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉となる資産)
単位型	国内	株式
	海外	債券
追加型	内外	不動産投信
		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。

・商品分類定義

追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
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。
資産複合	目論見書又は投資信託約款において、「株式」、「債券」、「不動産投信」及び「その他資産」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。

<属性区分>

・属性区分表

投資対象資産 (実際の組入資産)	決算頻度	投資対象地域	投資形態
---------------------	------	--------	------

株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 () 不動産投信 その他資産 () 資産複合 (株式、債券、短期 金融資産、その他 資産(投資信託証 券(株式))) 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々 その他 ()	グローバル 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ ファンズ
-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-----------------------------------

(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。

・属性区分定義

資産複合 (株式、債券、短期金融資 産、その他資産(投資信 託証券(株式))) 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、括弧内の 記載はその該当複数資産を表す。 当ファンドでの株式への投資は、マザーファンド受益証券 (投資信託証券)を通じて行うことがあります。
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。
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。
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。

(注1) 商品分類および属性区分は、委託会社が目論見書または約款の記載内容等に基づいて分類して
います。

(注2) 当ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信
託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

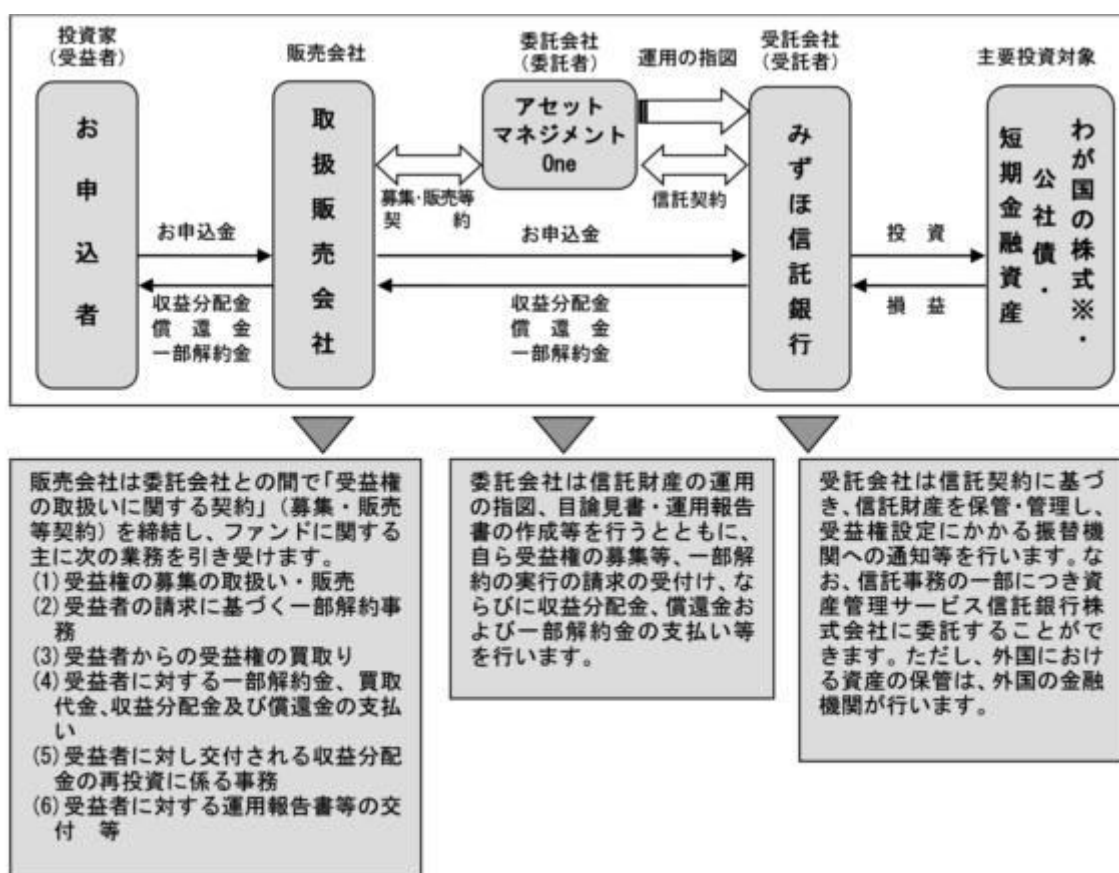
(2) 【ファンドの沿革】

1993年11月26日	信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
1998年11月30日	当ファンドの信託期間を無期限に変更 当ファンドの決算を年1回(9月10日)から年2回(3月10日および9月10日) に変更 当ファンドの投資対象に「富士TOPIXオープンマザーファンド」を追加
1998年12月1日	1口当たり元本額を1万円から1円に変更するための受益権分割を実施
2007年1月4日	投資信託振替制度へ移行

- 2007年7月1日 当ファンドの名称を「富士スリーウェイオープン」から「MHAMスリーウェイオープン」に変更
- 2016年10月1日 ファンドの委託会社としての業務をみずほ投信投資顧問株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継

（3）【ファンドの仕組み】

当ファンドの運営の仕組み



※ 主要投資対象の内、わが国の株式には、MHAM TOPIXマザーファンドを通じて投資を行う場合があります。

委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2019年9月30日現在）

委託会社の沿革

1985年7月1日 会社設立

1998年3月31日 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得

1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月1日	D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社(資産運用部門)が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

(2019年9月30日現在)

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 ¹	70.0% ²
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ²

1：A種種類株式(15,510株)を含みます。

2：普通株式のみの場合の所有比率は、株式会社みずほフィナンシャルグループ51.0%、第一生命ホールディングス株式会社49.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

この投資信託は、わが国の株式、債券および短期金融資産の組入比率の変更を、原則としてT A Aモデル(タクティカル・アセット・アロケーション・モデル)の指示により機動的に行い、信託財産の安定的な成長を目標として運用を行います。

運用方法

1. 主要投資対象

わが国の金融商品取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている株式、公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。なお、M H A M T O P I Xマザーファンド受益証券を組入れることもあります。

株式への投資は、M H A M T O P I Xマザーファンド受益証券への投資を通じて行う場合があります。M H A M T O P I Xマザーファンドは、東証株価指数(TOPIX)に連動する投資成果を目指します。

東証株価指数(TOPIX)とは、東京証券取引所第一部全銘柄を対象とした株価指数で、基準時(1968年1月4日終値)の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。

TOPIXは、機関投資家をはじめ、国内株式運用の実績を測る尺度として広く利用されています。

東証株価指数(TOPIX)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての

権利は、(株)東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、(株)東京証券取引所は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

2. 投資態度

- a. 景気指標、市場内部指標、価値指標等のファクターを取り入れたTAAモデルを活用することにより株式・債券・短期金融資産の割高・割安を的確に把握することを目指し、適切なアセット・アラケーションを行うことで安定した収益を追求します。

アラケーションとは、株式や債券等の各資産間の配分をいいます。

分散投資の効果

株式や債券などの異なる資産では、一般的にその値動きも異なります。当ファンドは、様々な景気・金利局面において異なる値動きをする資産を組み合わせ、組入比率を機動的に変更することで、安定的な収益の確保を目指します。

- b. 株式組入比率の上限を30%とし、株式運用部分はTOPIX(東証株価指数)を上回る投資成果を目標とする運用を行います。

ただし、MHAM TOPIXマザーファンド受益証券を組入れる場合は、TOPIX(東証株価指数)に連動する投資成果を目標とします。

株価指数先物取引を含む株式の実質組入比率は最大で信託財産の純資産総額の30%とし、株式のリスクを限定したうえで、安定的な運用成果を目指します。

- c. 債券運用部分は債券市中平均利回りにスライドした(債券市場全体の動きに沿った)投資成果を目指します。

- d. TAAモデルの指示により、有価証券の組入比率を変動させる場合、有価証券先物取引等も利用します。

有価証券先物取引等の詳細については、後記「(5) 投資制限 a. 約款で定める投資制限 有価証券先物取引等」をご参照ください。

- e. 市況動向やファンドの資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドの投資プロセス

当ファンドは、以下の投資プロセスにより運用を行います。

1. 運用方針についての考え方

「資産の配分方法は、運用成績を決定する重要な要素である。」との考え方にに基づき運用を行います。

2. モデルの指示に基づく一貫した投資手法

当ファンドは、投資情報の数理的分析等に基づくアセットマネジメントOne独自の投資モデル(TA

Aモデル)を採用しています。モデルの採用により、より効率的な運用・高度なリスクコントロールの追求が可能になるとともに、運用プロセス全体が明確になります。また、モデルを使ったシステム運用は、常に一貫した手法が用いられるため、運用手法・運用内容が運用担当者の主観や判断および交代などの影響を受けにくいことが特徴です。

3. 機動的なアロケーション変更

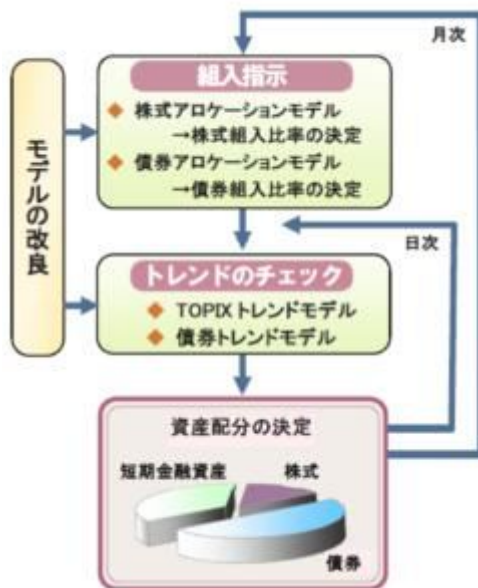
株式・債券の組入比率を月次で決定する2つのモデルに加え、さらに2種類のトレンドモデルを用いて日次で資産配分(アロケーション)の見直しを行うことで、より機動的な資産配分の変更を目指します。

トレンドとは、相場の上昇や下降等の傾向のことをいいます。

4. モデルの改良

モデルの構築には、様々な前提がおかれています。経済構造・市場構造の変化等により前提が崩れると予測される場合には、モデルの修正・改良が必要となります。アセットマネジメントOneでは、実際の運用を通じてモデルの機能を常にチェックし、適宜修正・改良を行っています。

T A Aモデルの構成



株式アロケーションモデル

景気指標および市場データ等を用いた分析により、株式の投資妙味を判断し、月次で株式の組入比率を決定します。

債券アロケーションモデル

景気指標および市場データ等を用いた分析により、債券の投資妙味を判断し、月次で債券の組入比率を決定します。

以上2種類のモデルにより、資産配分比率の月次の基本方針を決定します。

TOPIXトレンドモデル

主に市場データを基に株式市場の方向性とその強さ（トレンド）を統計的手法により分析し、日次で株式組入比率の調整を決定するモデルです。

債券トレンドモデル

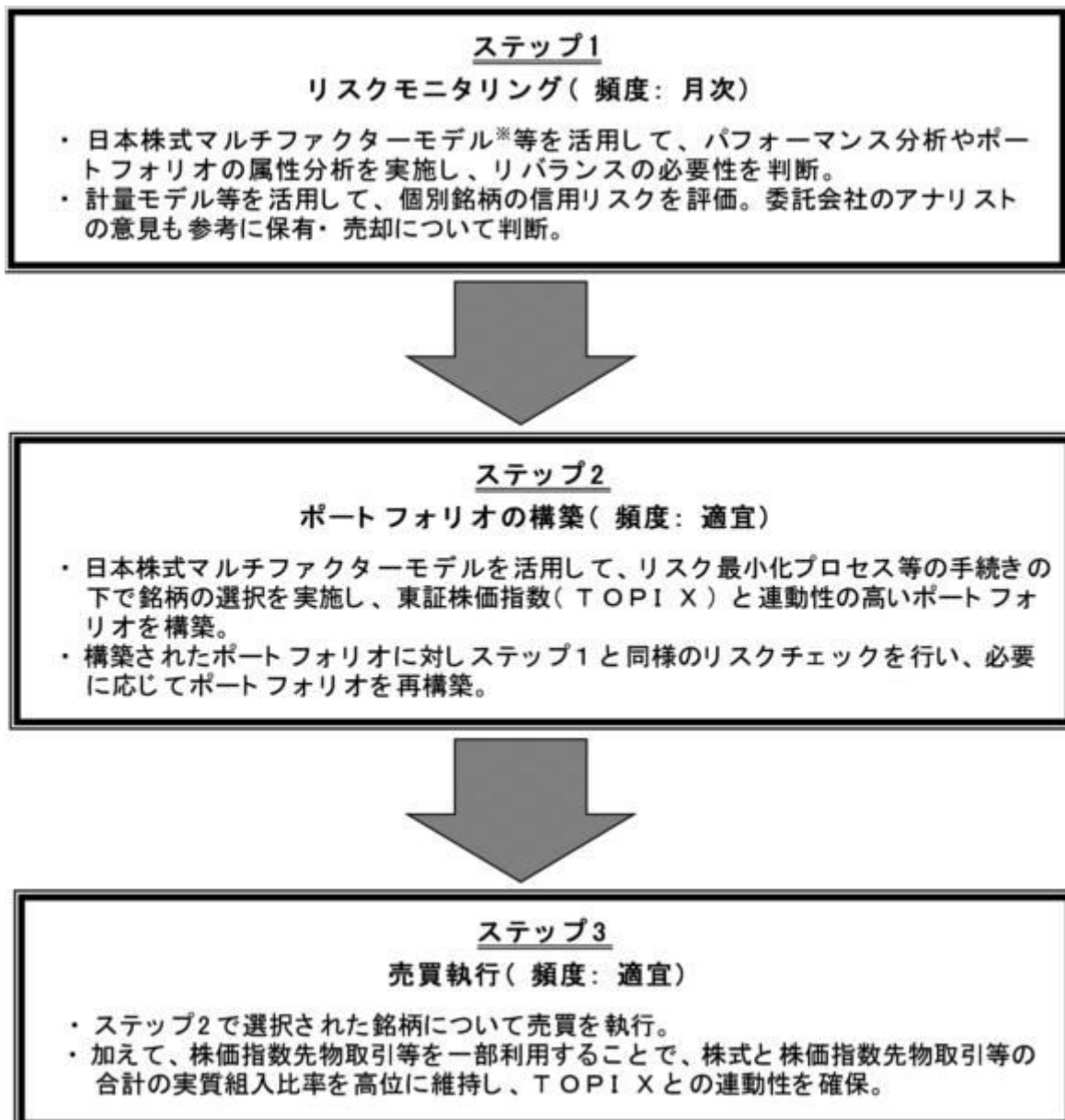
主に市場データを基に債券市場の方向性とその強さ（トレンド）を統計的手法により分析し、日次で債券組入比率の調整を決定するモデルです。

以上2種類のトレンドモデルにより、日次で資産配分比率の変更を行います。

モデルおよび使用するファクターについては、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

<MHAM TOPIXマザーファンドの投資プロセス>

当ファンドは、株式運用部分について、MHAM TOPIXマザーファンド受益証券を組入れる場合があります。MHAM TOPIXマザーファンドの具体的な投資プロセスは以下の通りです。



複数のリスクファクターによって株式リターンを分解・説明するモデルで、1988年に構築以来、随時改良を加えているアセットマネジメントOne独自のモデルです。これにより、TOPIX（東証株価指数）に連動する銘柄群を効率的に選び、定期的に銘柄群の見直しをすることによりTOPIX（東証株価指数）に対する連動性を高めます。

なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。また、使用するモデル等については、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

（２）【投資対象】

有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、アセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結されたMHAM TOPIXマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券および次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. コマーシャル・ペーパー
7. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券（両者および8.において同様の性質を有するものを総称して「新株引受権証券等」といいます。）
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前記1.から7.の証券または証書の性質を有するもの
9. 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

なお、前記1.の証券または証書および前記8.の証券または証書のうち前記1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前記2.から5.までの証券および前記8.の証券または証書のうち前記2.から5.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

金融商品の指図範囲

委託会社は、信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、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。）および抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）ならびに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。また、前記 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を以下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。

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

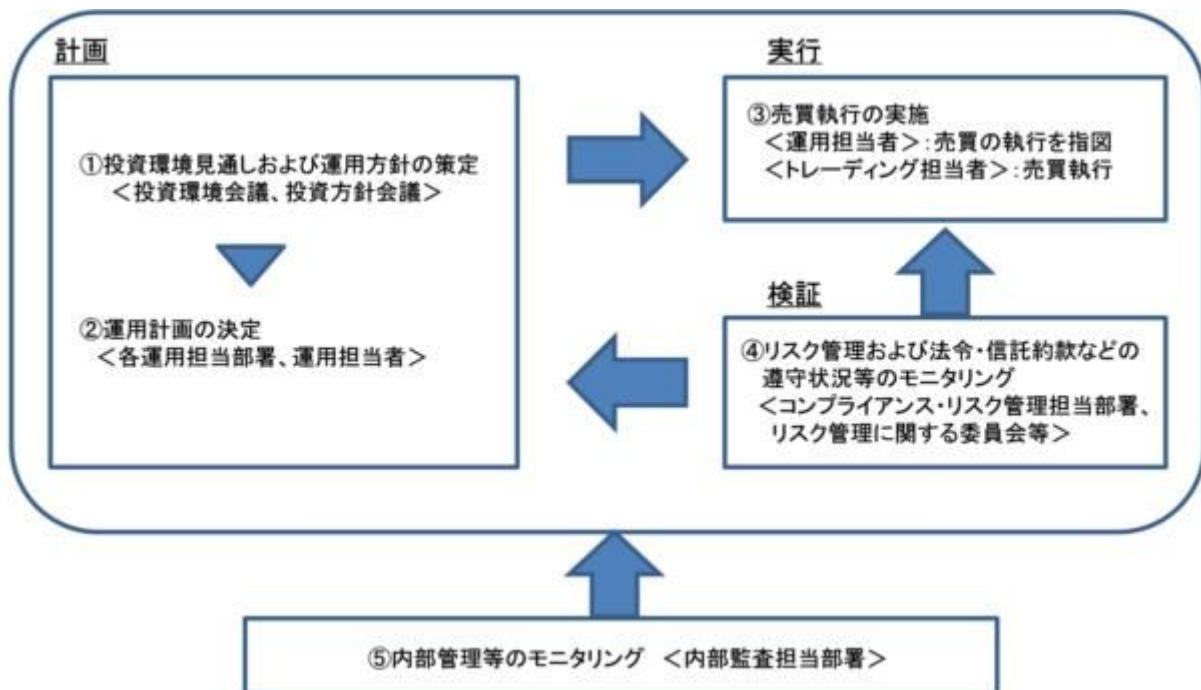
その他の投資対象

有価証券先物取引等

委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引(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および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引(以下「有価証券先物取引等」といいます。)を約款に規定する範囲で行うことができます。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見直しおよび運用方針の策定

経済環境見直し、資産別市場見直し、資産配分方針および資産別運用方針は月次で開催する「投資環境会議」および「投資方針会議」にて協議、策定致します。これらの会議は運用本部長・副本部長、運用グループ長等で構成されます。

運用計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

売買執行の実施

運用担当者は、売買計画に基づいて売買の執行を指図します。トレーディング担当者は、最良執行をめざして売買の執行を行います。

モニタリング

運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署(60~70人程度)は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施し、必要に応じて対応を指示します。

定期的に関催されるリスク管理に関する委員会等において運用リスク管理状況、運用実績、法令・信託約款などの遵守状況等について検証・報告を行います。

内部管理等のモニタリング

内部監査担当部署(10~20人程度)が運用、管理等に関する業務執行の適正性・妥当性・効率性等の観点からモニタリングを実施します。

b. ファンドの関係法人に関する管理

ファンドの関係法人である受託会社に対して、その業務に関する委託会社の管理担当部署は、内部統制に関する外部監査人による報告書等の定期的な提出を求め、必要に応じて具体的な事項に関するヒアリングを行う等の方法により、適切な業務執行体制にあることを確認します。

c. 運用体制に関する社内規則

運用体制に関する社内規則として運用管理規程および職務責任権限規程等を設けており、運用担当者の任務と権限の範囲を明示するほか、各投資対象の取り扱いに関して基準を設け、ファンドの商品性に則った適切な運用の実現を図ります。

また、売買執行、投資信託財産管理および法令遵守チェック等に関する各々の規程・内規を定めています。

運用体制は2019年9月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時(原則として毎年3月10日および9月10日。ただし、休業日の場合は翌日以降の最初の営業日)に、原則として次の通り収益分配を行います。

分配対象額の範囲は、配当等収益の他に売買益等も含め、その中から運用実績に応じて分配を行います。

分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。

将来の収益分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

収益分配金の支払い

1. 収益分配金は、原則として毎計算期間終了日から起算して5営業日までに販売会社において支払いが開始されます。

2. 自動けいぞく投資約款に基づく契約に基づいて収益分配金を再投資することにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に対し、お支払いします。

(5) 【投資制限】

a. 約款で定める投資制限

株式および新株引受権証券等(約款第21条、第22条および第23条)

1. 委託会社は、株式および新株引受権証券等への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図はしません。

「実質投資割合」とは、投資対象である当該資産につき、当ファンドの信託財産に属する当該資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該資産のうち当ファンドの信託財産に属するとみなした額との合計額の当ファンドの信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。(以下同じ。)

2. 委託会社は、新株引受権証券等への実質投資割合が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

3. 委託会社は、同一銘柄の株式への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

4. 委託会社は、同一銘柄の新株引受権証券等への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

5. 委託会社が投資することを指図する株式および新株引受権証券等は、わが国の証券取引所(「証券取引所」とは、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および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場(以下「取引所」といいます。))のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。)に上場(上場予定を含みます。)されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式および新株引受権証券等についてはこの限りではありません。

転換社債等(約款第26条)

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに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号および第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。(両者および前記(2)投資対象 有価証券の指図範囲8.において同様の性質を有するものを総称して「転換社債等」といいます。))への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図はしません。

信用リスク集中回避のための投資制限(約款第23条の1の2)

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

託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等(約款第23条の2)

委託会社は、デリバティブ取引等(デリバティブ取引とは、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、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買および商品投資等取引(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。))を含みます。以下「デリバティブ取引等」といいます(ただし、この信託において取引可能なものに限ります。以下同じ。))。について、一般社団法人投資信託協会の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。

有価証券先物取引等(約款第24条)

1. 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の証券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および有価証券オプション取引なら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次の範囲で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て取り扱うものとします(以下同じ。)

- a. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
- b. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに前記(2)投資対象 金融商品の指図範囲1.から4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
- c. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、この で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲とします。

2. 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびにこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、現物オプション取引は預金に限るものとします。

- a. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前記(2)投資対象 金融商品の指図範囲1.から4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
- b. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに前記(2)投資対象 金融商品の指図範囲1.から4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
- c. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つこの で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

公社債(約款第25条)

委託会社が投資することを指図する公社債のうち、外国または外国法人の発行する邦貨建公社債およびわが国またはわが国法人が外国において発行する邦貨建公社債については、証券取引所に上場（上場予定を含みます。）されている銘柄およびこれに準ずるものとします。ただし、社債権者割当または株主割当により取得する公社債については、この限りではありません。

資金の借入れ(約款第32条の2)

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用なら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、または再投資にかか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。
2. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、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また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、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
3. 収益分配金の再投資にかか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。
4. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

b. 法令で定める投資制限

同一の法人の発行する株式の取得割合（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

<参考> MHAM TOPIXマザーファンドの投資方針および主な投資制限

(1) 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX(東証株価指数)と連動する投資成果を目標として運用を行います。

(2) 運用方法

投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資態度

1. 現物株への投資よりTOPIX先物等を活用の方が有利と認められるときは、TOPIX先物等を

活用することがあります。

2. 株価指数等の先物取引を含む株式の実質組入比率は、原則信託財産の純資産総額の範囲内となるよう運用を行います。一時的に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。
3. 組入対象銘柄は、東京証券取引所第一部上場株式とします。ただし、流動性に著しく欠ける銘柄や信用リスクが高いと判断される銘柄等は組入れません。
4. 上記1.から3.について、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。
5. 国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
6. 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引および金利先渡取引を行うことができます。

(3) 運用制限

株式の組入比率には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

有価証券先物取引等は約款第15条の範囲で行います。

スワップ取引は約款第16条の範囲で行います。

金利先渡取引は約款第17条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3【投資リスク】

(1) 当ファンドにおける主として想定されるリスクと収益性に与える影響度合い

- ・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、ファンドの基準価額は変動します。したがって、元本や一定の投資成果が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。
- ・運用により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者の皆様に帰属します。
- ・投資信託は預金商品や保険商品ではなく、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
- ・登録金融機関が取扱う投資信託は、投資者保護基金の対象ではありません。
- ・投資信託は預貯金とは異なります。
- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

当ファンドにおいて主として想定されるリスクは以下の通りですが、基準価額の変動要因はこれらに限定されるものではありません。

株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

株価変動リスクとは、株式市場および投資先となっている企業の株価が下落するリスクをいいます。当ファンドが投資する企業の株価が下落した場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、当ファンドが投資する企業が業績悪化や倒産等に陥った場合には、当該企業の株価が大きく下落することや無くなることもあり、当ファンドの基準価額に大きな影響を及ぼすことがあります。

金利変動リスク

金利の上昇（公社債の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

金利変動リスクとは、金利変動により公社債の価格が下落するリスクをいいます。一般に金利が上昇した場合には、既に発行されて流通している公社債の価格は下落します。金利上昇は、当ファンドが投資する公社債の価格に影響を及ぼし、当ファンドの基準価額を下落させる要因となります。また、金利変動により株式市場と公社債市場の間で資金シフトが起こる場合があります。その場合、金利変動の影響は株式市場にも及びます。

信用リスク

投資する有価証券の発行者の財政難・経営不安・倒産等の発生は、基準価額の下落要因となります。

信用リスクとは、公社債等の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利息や償還金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る（債務不履行）リスクをいいます。一般に債務不履行が生じた場合、またはその可能性が高まった場合には、当該発行体が発行する公社債および短期金融商品（コマーシャル・ペーパー等）の価格は下落します。また、当該発行体が企業の場合には、一般にその企業の株価が下落する要因となります。当ファンドが投資する株式の発行企業や、公社債等の発行体がこうした状況に陥った場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。

流動性リスク

投資資産の市場規模が小さいことなどで希望する価格で売買できない場合は、基準価額の下落要因となります。

流動性リスクとは、有価証券を売却（または購入）しようとする際に、需要（または供給）がないため、有価証券を希望する時期に、希望する価格で売却（または購入）することができなくなるリスクをいいます。一般に規模が小さい市場での売買や、取引量の少ない有価証券の売買にあたっては、流動性リスクへの留意が特に必要とされます。また、一般に市場を取り巻く外部環境の急変があった場合には、市場実勢価格での売買ができなくなる可能性が高まります。当ファンドが投資する株式・公社債等の流動性が損なわれた場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

<その他>

- ・有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- ・当ファンドの株式運用部分として、MHAM TOPIXマザーファンド受益証券を組入れる場合があります。そのため、同マザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用に影響を受ける場合があります。
- ・当ファンドは、証券取引所における取引の停止等があるときには、一部解約の実行の請求の受け付け

中止すること、およびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことがあります。

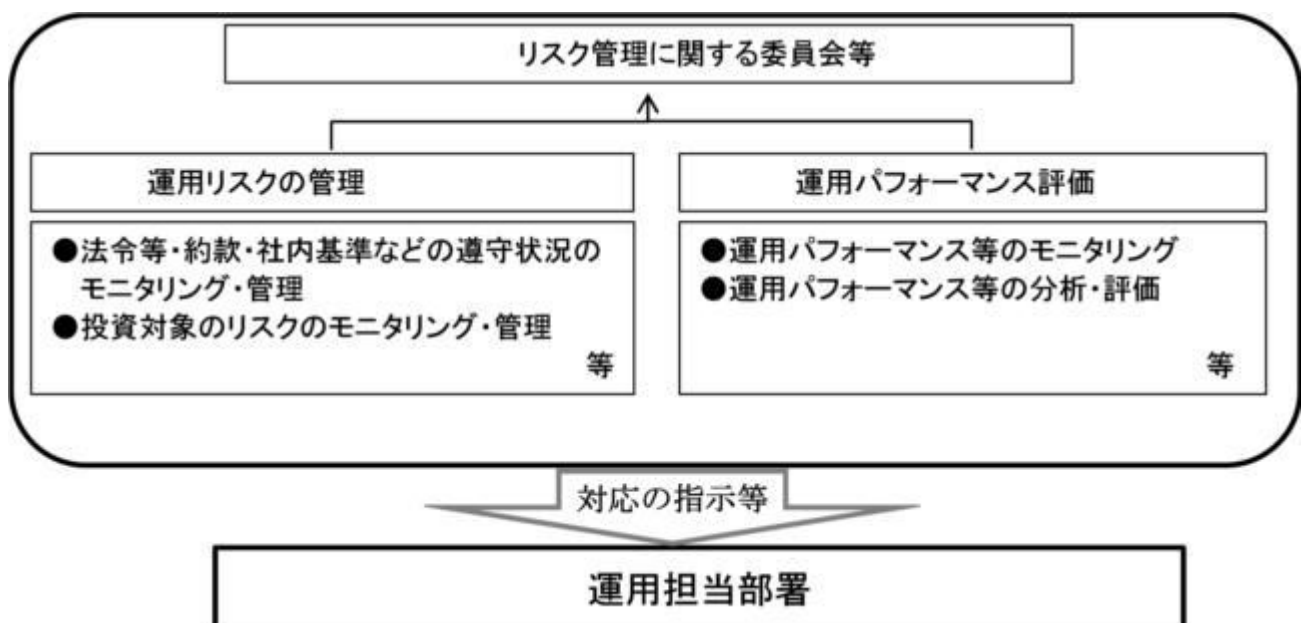
< 収益分配金に関する留意点 >

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

(2) リスク管理体制

委託会社におけるファンドの投資リスクに対する管理体制については、以下のとおりです。

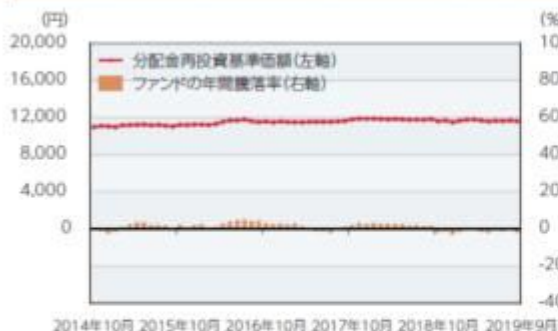
- ・ 運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・ 運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・ リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



リスク管理体制は2019年9月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

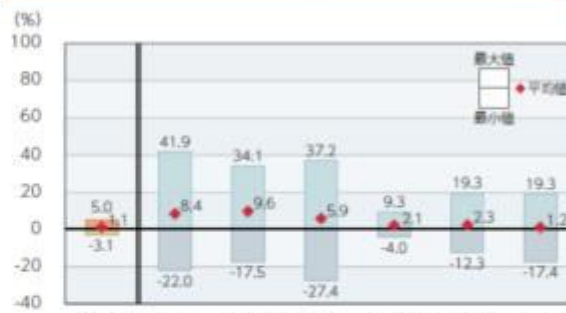


2014年10月 2015年10月 2016年10月 2017年10月 2018年10月 2019年9月

*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。なお、分配金再投資基準価額は、1999年1月4日の当ファンドの基準価額(9,967円)に合わせて指数化しています。

*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。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



2014年10月～2019年9月

*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと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。

*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利およ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」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利およ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」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。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、ファンドの運用成果等に関して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(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・デバースファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・デバースファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

通常のお申込みの場合

申込手数料は、取得申込金額（取得申込口数に発行価格を乗じた額）に、1.1%（税抜1.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。なお、申込手数料には消費税等相当額が課せられます。

確定拠出年金制度に基づくお申込みの場合

無手数料とします。

申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。

「自動けいぞく投資コース」における収益分配金は、毎計算期間末の翌営業日に原則として税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

上記にかかわらず、償還乗換優遇措置等の取扱いを行う販売会社では、一定の条件を満たした場合に申込手数料が割引、または無手数料となる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 申込手数料を対価とする役務の内容 >

商品や投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務手続き等にかかる費用の対価

(2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.935%（税抜0.85%）の率を乗じて得た額とします。

その配分（税抜）については、以下の通りとなります。

委託会社	販売会社	受託会社
0.40%	0.35%	0.10%

信託報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。なお、信託報酬にかかる消費税等相当額を、信託報酬支弁の時に信託財産中から支弁します。

$$\text{信託報酬} = \text{運用期間中の基準価額} \times \text{信託報酬率}$$

< 信託報酬等を対価とする役務の内容 >

委託会社	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

(4) 【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外国における資産の保管等に要する費用、受託会社の立替えた立替金の利息および資金の借入れを行った際の当該借入金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のときに、当該費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産中から支弁します。

当ファンドの組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、先物・オプション取引等に要する費用およびこれら手数料ならびに費用にかかる消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

上記 から の手数料等(借入金の利息および財務諸表の監査に要する費用を除きます。)については、当ファンドが投資対象とするマザーファンドにおいて発生する場合、マザーファンドの信託財産中から支弁されます。これらはマザーファンドの基準価額に反映されるため、結果として当ファンドの受益者が間接的に負担することとなります。

(5)【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%(所得税15.315%(復興特別所得税を含みます。))および地方税5%)の税率で源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税(配当控除の適用なし)のいずれかを選択することもできます。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

解約時および償還時の差益(譲渡益)については、譲渡所得として、20.315%(所得税15.315%(復興特別所得税を含みます。))および地方税5%)の税率での申告分離課税が適用されます。

原則として確定申告が必要ですが、特定口座(源泉徴収口座)を利用する場合、20.315%(所得税15.315%(復興特別所得税を含みます。))および地方税5%)の税率による源泉徴収が行われます。

解約価額および償還価額から取得費用(申込手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を含みます。)を控除した利益。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

解約(換金)時および償還時の差損(譲渡損)については、確定申告を行うことにより上場株式等(上場株式、上場投資信託(ETF)、上場不動産投資信託(REIT)、公募株式投資信託および特定公社債等(公募公社債投資信託を含みます。))など。以下同じ。)の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額(配当所得については申告分離課税を選択したものに限ります。)との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座(源泉徴収口座)をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います(確定申告不要)。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」および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およびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

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ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

2020年1月1日以降の分配時において、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。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記は、2019年9月末現在のものであります。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

課税上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。

個別元本方式について

受益者毎の信託時の受益権の価額等を当該受益者の元本とする個別元本方式は次のとおりです。

< 個別元本について >

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

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。

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「一般コース」と「自動けいぞく投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、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< 収益分配金の課税について >を参照。）

< 収益分配金の課税について >

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）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

収益分配の際、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また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、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。

なお、収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、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。

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

（1）【投資状況】

MHAMスリーウェイオープン

令和1年9月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	4,963,371,100	59.86
内 日本	4,963,371,100	59.86
親投資信託受益証券	1,647,825,195	19.87
内 日本	1,647,825,195	19.87
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,680,705,538	20.27
純資産総額	8,291,901,833	100.00

その他資産の投資状況

令和1年9月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	825,760,000	9.96
内 日本	825,760,000	9.96
債券先物取引（売建）	3,720,480,000	44.87
内 日本	3,720,480,000	44.87

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

（参考）MHAM TOPIXマザーファンド

令和1年9月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	48,960,795,990	97.49
内 日本	48,960,795,990	97.49
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,259,682,335	2.51
純資産総額	50,220,478,325	100.00

その他資産の投資状況

令和1年9月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	1,254,520,000	2.50
内 日本	1,254,520,000	2.50

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

MHAMスリーウェイオープン

令和1年9月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	MHAM TOPIXマ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	864,954,698	1.8514 1,601,463,623	1.9051 1,647,825,195	- -	19.87
2	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	600,000,000	102.89 617,394,000	103.07 618,474,000	0.1 2026/3/20	7.46
3	130回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証 券	600,000,000	100.91 605,490,000	100.96 605,766,000	0.1 2021/12/20	7.31
4	134回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証 券	400,000,000	101.37 405,488,000	101.49 405,992,000	0.1 2022/12/20	4.90
5	137回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証 券	300,000,000	101.73 305,199,000	101.85 305,556,000	0.1 2023/9/20	3.68
6	395回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証 券	300,000,000	100.45 301,377,000	100.47 301,422,000	0.1 2020/12/1	3.64
7	329回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	280,000,000	104.27 291,972,800	104.39 292,292,000	0.8 2023/6/20	3.53
8	71回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	200,000,000	112.18 224,372,000	112.23 224,464,000	2.2 2024/6/20	2.71
9	141回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	150,000,000	123.79 185,697,000	123.28 184,930,500	1.7 2032/12/20	2.23
10	100回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	140,000,000	121.70 170,380,000	121.71 170,401,000	2.2 2028/3/20	2.06
11	39回 利付国庫債券 (30年) 日本	国債証 券	100,000,000	139.21 139,210,000	137.71 137,714,000	1.9 2043/6/20	1.66
12	15回 利付国庫債券 (30年) 日本	国債証 券	100,000,000	137.33 137,337,000	136.59 136,593,000	2.5 2034/6/20	1.65
13	333回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	130,000,000	104.19 135,454,800	104.33 135,632,900	0.6 2024/3/20	1.64

14	142回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	100,000,000	125.13 125,138,000	124.61 124,618,000	1.8 2032/12/20	1.50
15	102回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	100,000,000	123.99 123,991,000	123.94 123,948,000	2.4 2028/6/20	1.49
16	145回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	100,000,000	124.35 124,355,000	123.82 123,829,000	1.7 2033/6/20	1.49
17	105回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	100,000,000	121.75 121,753,000	121.73 121,730,000	2.1 2028/9/20	1.47
18	97回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	100,000,000	120.65 120,655,000	120.65 120,659,000	2.2 2027/9/20	1.46
19	10回 利付国庫債券 (40年) 日本	国債証券	100,000,000	120.84 120,845,000	116.67 116,671,000	0.9 2057/3/20	1.41
20	10回 利付国庫債券 (30年) 日本	国債証券	100,000,000	115.89 115,891,000	115.43 115,434,000	1.1 2033/3/20	1.39
21	73回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	100,000,000	112.44 112,445,000	112.46 112,463,000	2 2024/12/20	1.36
22	53回 利付国庫債券 (30年) 日本	国債証券	100,000,000	109.21 109,215,000	107.27 107,279,000	0.6 2046/12/20	1.29
23	167回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	100,000,000	106.95 106,950,000	106.04 106,042,000	0.5 2038/12/20	1.28
24	156回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	100,000,000	105.90 105,908,000	105.28 105,286,000	0.4 2036/3/20	1.27
25	148回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	60,000,000	122.31 73,387,800	121.69 73,018,800	1.5 2034/3/20	0.88
26	7回 利付国庫債券(40年) 日本	国債証券	40,000,000	146.07 58,428,000	141.95 56,782,400	1.7 2054/3/20	0.68
27	140回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	20,000,000	123.50 24,701,800	123.00 24,601,000	1.7 2032/9/20	0.30
28	151回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	10,000,000	118.41 11,841,900	117.72 11,772,500	1.2 2034/12/20	0.14

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年9月30日現在

種類	投資比率(%)
----	---------

国債証券	59.86
親投資信託受益証券	19.87
合計	79.73

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）MHAM TOPIXマザーファンド

令和1年9月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	239,800	6,725.83 1,612,854,891	7,216.00 1,730,396,800	- -	3.45
2	ソニー 日本	株式 電気機器	144,600	5,297.71 766,049,650	6,347.00 917,776,200	- -	1.83
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	1,462,600	559.33 818,087,966	548.40 802,089,840	- -	1.60
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	144,400	4,836.18 698,344,779	5,156.00 744,526,400	- -	1.48
5	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	167,700	5,171.88 867,325,472	4,240.00 711,048,000	- -	1.42
6	キーエンス 日本	株式 電気機器	10,600	66,069.75 700,339,432	66,900.00 709,140,000	- -	1.41
7	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	188,100	4,398.94 827,442,312	3,690.00 694,089,000	- -	1.38
8	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	149,700	3,839.27 574,739,363	3,695.00 553,141,500	- -	1.10
9	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	181,600	2,986.99 542,438,240	2,798.50 508,207,600	- -	1.01
10	任天堂 日本	株式 その他製品	12,300	32,127.90 395,173,176	40,020.00 492,246,000	- -	0.98
11	KDDI 日本	株式 情報・通信業	173,200	2,645.63 458,224,350	2,825.00 489,290,000	- -	0.97
12	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	147,400	3,049.99 449,568,880	3,286.00 484,356,400	- -	0.96
13	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式	2,888,800	168.81	165.60	-	0.95

	日本	銀行業		487,659,675	478,385,280	-	
14	東京海上ホールディングス	株式	75,900	5,378.17	5,779.00	-	0.87
	日本	保険業		408,203,720	438,626,100	-	
15	信越化学工業	株式	37,200	9,424.02	11,560.00	-	0.86
	日本	化学		350,573,774	430,032,000	-	
16	東海旅客鉄道	株式	19,300	24,391.49	22,220.00	-	0.85
	日本	陸運業		470,755,928	428,846,000	-	
17	第一三共	株式	61,600	4,850.28	6,804.00	-	0.83
	日本	医薬品		298,777,316	419,126,400	-	
18	ファナック	株式	20,500	18,664.36	20,340.00	-	0.83
	日本	電気機器		382,619,420	416,970,000	-	
19	ダイキン工業	株式	29,400	12,839.22	14,180.00	-	0.83
	日本	機械		377,473,356	416,892,000	-	
20	花王	株式	51,600	8,555.87	7,984.00	-	0.82
	日本	化学		441,483,244	411,974,400	-	
21	オリエンタルランド	株式	24,300	13,009.04	16,440.00	-	0.80
	日本	サービス業		316,119,710	399,492,000	-	
22	三菱商事	株式	148,700	3,057.93	2,651.00	-	0.78
	日本	卸売業		454,714,262	394,203,700	-	
23	東日本旅客鉄道	株式	38,200	10,542.94	10,310.00	-	0.78
	日本	陸運業		402,740,340	393,842,000	-	
24	日立製作所	株式	97,000	3,496.75	4,023.00	-	0.78
	日本	電気機器		339,185,704	390,231,000	-	
25	HOYA	株式	43,300	7,416.85	8,819.00	-	0.76
	日本	精密機器		321,149,993	381,862,700	-	
26	日本電産	株式	25,900	13,470.46	14,520.00	-	0.75
	日本	電気機器		348,884,985	376,068,000	-	
27	資生堂	株式	42,800	7,915.40	8,629.00	-	0.74
	日本	化学		338,779,176	369,321,200	-	
28	NTTドコモ	株式	133,600	2,542.77	2,753.00	-	0.73
	日本	情報・通信業		339,715,315	367,800,800	-	
29	セブン&アイ・ホールディングス	株式	88,900	4,460.34	4,132.00	-	0.73
	日本	小売業		396,524,844	367,334,800	-	
30	村田製作所	株式	67,800	5,507.58	5,185.00	-	0.70
	日本	電気機器		373,413,988	351,543,000	-	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年9月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	97.49
合計	97.49

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

令和1年9月30日現在

業種	国内 / 外国	投資比率 (%)
電気機器	国内	13.70
情報・通信業		8.32
輸送用機器		7.66
化学		7.08
銀行業		5.73
医薬品		5.39
サービス業		5.07
機械		4.92
卸売業		4.73
小売業		4.68
陸運業		4.61
食料品		3.96
建設業		2.82
不動産業		2.48
保険業		2.26
その他製品		2.20
精密機器		2.19
電気・ガス業		1.61
その他金融業		1.10
ガラス・土石製品		0.80
証券、商品先物取引業		0.77
鉄鋼		0.75
ゴム製品		0.74
非鉄金属		0.73
繊維製品		0.64
金属製品		0.55
石油・石炭製品		0.55
空運業		0.51
鉱業		0.27
パルプ・紙		0.24
倉庫・運輸関連業		0.19
海運業		0.16
水産・農林業		0.10
合計	97.49	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

MHAMスリーウェイオープン

該当事項はありません。

(参考) MHAM TOPIXマザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

MHAMスリーウェイオープン

令和1年9月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物 0112月	買建	52	828,376,848	825,760,000	9.96
債券先物取引	大阪取引所	長国先 0112月	売建	24	3,699,340,928	3,720,480,000	44.87

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

(参考) MHAM TOPIXマザーファンド

令和1年9月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物 0112月	買建	79	1,253,989,896	1,254,520,000	2.50

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

MHAMスリーウェイオープン

直近日（令和1年9月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第28計算期間末 (平成22年 3月10日)	20,102	20,123	0.9257	0.9267
第29計算期間末 (平成22年 9月10日)	18,733	18,753	0.9105	0.9115
第30計算期間末 (平成23年 3月10日)	18,105	18,124	0.9348	0.9358
第31計算期間末 (平成23年 9月12日)	16,642	16,660	0.9096	0.9106
第32計算期間末 (平成24年 3月12日)	16,111	16,128	0.9317	0.9327

第33計算期間末 (平成24年 9月10日)	14,861	14,878	0.9115	0.9125
第34計算期間末 (平成25年 3月11日)	14,710	14,784	0.9872	0.9922
第35計算期間末 (平成25年 9月10日)	12,849	12,977	1.0023	1.0123
第36計算期間末 (平成26年 3月10日)	11,584	11,595	1.0001	1.0011
第37計算期間末 (平成26年 9月10日)	11,061	11,072	0.9947	0.9957
第38計算期間末 (平成27年 3月10日)	10,480	10,490	1.0087	1.0097
第39計算期間末 (平成27年 9月10日)	9,762	9,820	1.0024	1.0084
第40計算期間末 (平成28年 3月10日)	9,700	9,758	1.0090	1.0150
第41計算期間末 (平成28年 9月12日)	9,838	9,896	1.0257	1.0317
第42計算期間末 (平成29年 3月10日)	9,526	9,526	1.0258	1.0258
第43計算期間末 (平成29年 9月11日)	9,279	9,288	1.0305	1.0315
第44計算期間末 (平成30年 3月12日)	8,952	9,038	1.0417	1.0517
第45計算期間末 (平成30年 9月10日)	8,713	8,713	1.0288	1.0288
第46計算期間末 (平成31年 3月11日)	8,515	8,515	1.0330	1.0330
第47計算期間末 (令和1年9月10日)	8,354	8,354	1.0270	1.0270
平成30年9月末日	8,818	-	1.0431	-
10月末日	8,604	-	1.0218	-
11月末日	8,614	-	1.0296	-
12月末日	8,426	-	1.0121	-
平成31年1月末日	8,530	-	1.0269	-
2月末日	8,563	-	1.0357	-
3月末日	8,547	-	1.0369	-
4月末日	8,449	-	1.0294	-
令和1年5月末日	8,368	-	1.0193	-
6月末日	8,425	-	1.0263	-
7月末日	8,373	-	1.0243	-
8月末日	8,406	-	1.0306	-
9月末日	8,291	-	1.0230	-

【分配の推移】

MHAMスリーウェイオープン

	1口当たりの分配金（円）
第28計算期間	0.0010
第29計算期間	0.0010
第30計算期間	0.0010
第31計算期間	0.0010
第32計算期間	0.0010
第33計算期間	0.0010
第34計算期間	0.0050
第35計算期間	0.0100
第36計算期間	0.0010
第37計算期間	0.0010
第38計算期間	0.0010
第39計算期間	0.0060
第40計算期間	0.0060
第41計算期間	0.0060
第42計算期間	0.0000
第43計算期間	0.0010
第44計算期間	0.0100
第45計算期間	0.0000
第46計算期間	0.0000
第47計算期間	0.0000

【収益率の推移】

MHAMスリーウェイオープン

	収益率（％）
第28計算期間	2.12
第29計算期間	1.53
第30計算期間	2.78
第31計算期間	2.59
第32計算期間	2.54
第33計算期間	2.06
第34計算期間	8.85
第35計算期間	2.54
第36計算期間	0.12
第37計算期間	0.44
第38計算期間	1.51
第39計算期間	0.03
第40計算期間	1.26
第41計算期間	2.25
第42計算期間	0.01
第43計算期間	0.56

第44計算期間	2.06
第45計算期間	1.24
第46計算期間	0.41
第47計算期間	0.6

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 計算期間末が令和1年8月29日以前の収益率については、小数点第2位で表示しています。

(4) 【設定及び解約の実績】

MHAMスリーウェイオープン

	設定口数	解約口数
第28計算期間	553,644,690	1,473,917,240
第29計算期間	554,534,433	1,693,625,458
第30計算期間	513,047,715	1,720,625,364
第31計算期間	479,462,651	1,551,267,886
第32計算期間	442,676,695	1,446,032,847
第33計算期間	376,968,206	1,364,316,466
第34計算期間	369,488,222	1,773,844,457
第35計算期間	427,178,848	2,508,637,111
第36計算期間	417,035,300	1,653,362,434
第37計算期間	428,874,227	892,182,541
第38計算期間	294,952,276	1,024,842,529
第39計算期間	317,180,609	968,640,410
第40計算期間	442,473,798	566,960,043
第41計算期間	440,391,845	462,278,145
第42計算期間	497,804,047	804,194,658
第43計算期間	290,194,467	571,802,304
第44計算期間	275,168,842	685,083,990
第45計算期間	376,901,704	502,346,126
第46計算期間	221,128,589	446,507,337
第47計算期間	255,610,157	364,455,489

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

参考情報

データの基準日:2019年9月30日

基準価額・純資産の推移 (2009年9月30日～2019年9月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※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ものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:1993年11月26日)

※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。

分配の推移(税引前)

2017年 9月	10円
2018年 3月	100円
2018年 9月	0円
2019年 3月	0円
2019年 9月	0円
設定累計	1,960円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、国/地域を表します。

資産の状況

資産の種類	比率(%)
国債証券	59.86
内 日本	59.86
親投資信託受益証券	19.87
内 日本	19.87
コールローン、その他の資産(負債控除後)	20.27
合計(純資産総額)	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	9.96
債券先物取引(売建)	△44.87

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	利率(%)	償還日	比率(%)
1	MHAM TOPIXマザーファンド	親投資信託受益証券	-	-	19.87
2	342回 利付国庫債券(10年)	国債証券	0.1	2026/3/20	7.46
3	130回 利付国庫債券(5年)	国債証券	0.1	2021/12/20	7.31
4	134回 利付国庫債券(5年)	国債証券	0.1	2022/12/20	4.90
5	137回 利付国庫債券(5年)	国債証券	0.1	2023/9/20	3.68
6	395回 利付国庫債券(2年)	国債証券	0.1	2020/12/1	3.64
7	329回 利付国庫債券(10年)	国債証券	0.8	2023/6/20	3.53
8	71回 利付国庫債券(20年)	国債証券	2.2	2024/6/20	2.71
9	141回 利付国庫債券(20年)	国債証券	1.7	2032/12/20	2.23
10	100回 利付国庫債券(20年)	国債証券	2.2	2028/3/20	2.06

■MHAM TOPIXマザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、国/地域を表します。

資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	97.49
内 日本	97.49
コールローン、その他の資産(負債控除後)	2.51
合計(純資産総額)	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.50

株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	13.70
2	情報・通信業	8.32
3	輸送用機器	7.66
4	化学	7.08
5	銀行業	5.73

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	輸送用機器	3.45
2	ソニー	株式	電気機器	1.83
3	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	銀行業	1.60
4	日本電信電話	株式	情報・通信業	1.48
5	ソフトバンクグループ	株式	情報・通信業	1.42
6	キーエンス	株式	電気機器	1.41
7	武田薬品工業	株式	医薬品	1.38
8	三井住友フィナンシャルグループ	株式	銀行業	1.10
9	本田技研工業	株式	輸送用機器	1.01
10	任天堂	株式	その他製品	0.98

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2019年9月30日

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資率等をもとに計算したものです。
※2019年については年首から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はいくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- (1) 当ファンドのお申込みは、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後3時までにお買付けのお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日分のお申込みといたします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については翌営業日のお取扱いとなります。
- (2) 取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された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かかる口数の増加の記載また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かかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により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または記録をするため

社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。

- (3) お申込みには、収益の分配がなされた場合に分配金を受領する「一般コース」と、分配金は原則として税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資される「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があります。ただし、販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (4) 申込単位は各販売会社が定める単位とします。申込単位については、販売会社にお問い合わせください。
- (5) 取得申込者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (6) 取得申込みにかかる受益権の価額は、取得申込日の基準価額に、販売会社が別に定める申込手数料および申込手数料にかかる消費税等相当額を加算した価額とします。
- (7) 販売会社において金額買付（申込単位が金額にて表示されている場合）によるお申込みをされた場合、申込手数料および申込手数料にかかる消費税等相当額はお申込代金の中から差し引かれます。
- (8) 自動けいぞく投資約款に基づく契約に基づき、収益分配金を再投資する際は、1口単位で購入できるものとします。なお、その際の受益権の価額は、原則として各計算期間終了日の基準価額とします。
- (9) 当ファンドを確定拠出年金制度に基づき取得する場合には、確定拠出年金に係る法令・制度等の定めに従って取得申込み等の手続きが行われます。
- (10) 信託財産の効率的な運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合、証券取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付けを中止すること、およびすでに受付けた取得申込みの受付けを取り消すことができます。

2【換金（解約）手続等】

<一部解約（解約請求）>

- (1) 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に各販売会社が定める単位をもって解約を請求することができます。
解約単位は、販売会社にお問い合わせください。
- (2) 解約の請求を行う受益者は、振替制度にかかる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かかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。なお、解約の請求を受益者が行う際は、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。
- (3) 解約請求の受付けについては、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後3時までには解約のお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付けにかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日分のお申込みとします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については、翌営業日のお取扱いとなります。
- (4) 解約の価額は、解約請求受付日の基準価額とします。詳しくは、販売会社または委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	0120-104-694

電話によるお問い合わせは、営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。（以下同じ。）

- (5) 解約代金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、4営業日目から販売会社において受益者に支払われます。
- (6) 信託財産の資産管理を円滑に行うために、大口の解約請求には制限を設ける場合があります。また、信託財産の運用方針の維持および円滑な資金管理のため、当ファンドの残高や市場の流動性等に応じ、委託会社の判断により一日あたりの解約のお申込みの総額について制限を設ける場合があります。
- (7) 信託財産の効率的な運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合、証券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、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことができます。この場合、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、前記(4)の規定に準じた価額とします。

<受益権の買取り（買取請求）>

- (1) 販売会社は、受益者から受益権の買取りの請求があるときは、1口を最低単位として販売会社が個別に定める単位をもってその受益権を買取ります。なお、受益者が受益権の買取りを請求するときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。
- (2) 受益権の買取価額は、買取約定日の基準価額とします。
一定の要件を満たしている買取請求による換金の場合に限るものとします。なお、一定の要件を満たしていない場合には、買取約定日の基準価額から当該買取りを行う販売会社にかかる源泉徴収税額に相当する額を差し引いた金額となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (3) 販売会社は、証券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、委託会社との協議に基づいて受益権の買取りを中止することができます。この場合、受益者は買取中止以前に行った当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該受益権の買取価額は、買取中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取りの請求を受け付けたものとして、前記(2)の規定に準じて計算された価額とします。

(注) 税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
株式	計算日における取引所の最終相場
公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
マザーファンド受益証券	計算日の基準価額

当ファンドの基準価額は、委託会社の毎営業日(土曜日、日曜日、「国民の祝日に関する法律」に定める休日ならびに12月31日、1月2日および1月3日以外の日とします。)に計算されます。基準価額については、販売会社または委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。基準価額は1万口単位で表示されたものが発表されます。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

1993年11月26日から無期限とします。

(4)【計算期間】

毎年3月11日から9月10日までおよび9月11日から翌年3月10日までとすることを原則とします。ただし、第1期計算期間は1993年11月26日から1994年9月10日までとし、第2期計算期間から第5期計算期間は、それぞれ9月11日から翌年9月10日までとします。

上記の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日(以下「当該日」といいます。)が休業日のとき、計算期間終了日は、当該日の翌日以降の最初の営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

信託契約の解約

以下の場合には信託契約を解約し信託を終了することがあります。

1. 委託会社は、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき、もしくは信託契約の一部解約により、受益権の口数が当初設定口数の10分の1を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。
 - a. この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかる全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
 - b. 前記a.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一ヵ月を下らないものとします。
 - c. 前記b.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記1.の信託契約の解約をしません。
 - d. 委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全て

の受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

- e. 前記b.からd.までの規定は、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、前記b.の一定の期間が一ヵ月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
 - f. 前記1.に定める信託契約の解約を行う場合において、前記b.の期間内に異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。なお、買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社の協議により決定するものとします。
2. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
 3. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、この信託は、「信託約款の変更4.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
 4. 受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

1. 委託会社は、信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更できるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
2. 委託会社は、前記1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前記2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一ヵ月を下らないものとします。
4. 前記3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、この信託約款を変更しないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前記2.に定める変更を行う場合において、前記3.の期間内に異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。なお、買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社の協議により決定するものとします。
7. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記の規定にしたがいます。

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

1. 委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴ない、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。
2. 委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴ない、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

関係法人との契約の更改および受託会社の辞任または解任に伴う取扱い

1. 委託会社と販売会社との間の募集・販売等契約は、締結日から原則1年間とし、期間終了の3ヵ月前までに別段の意思表示のない時は、同一条件にて継続されます。
2. 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。また、受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は「信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託事務処理の再信託

受託会社は、当ファンドにかかる信託事務処理の一部について、資産管理サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<http://www.am-one.co.jp/>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

運用報告書

委託会社は、決算時および信託終了時に期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した「運用報告書」を作成します。

- ・ 交付運用報告書は、販売会社を通じて交付いたします。
- ・ 運用報告書(全体版)は、次のアドレスに掲載します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合には、交付いたします。

<http://www.am-one.co.jp/>

4【受益者の権利等】

受益者の主な権利の内容は次のとおりです。

なお、委託会社は2007年1月4日付約款変更以前の約款第7条第2項の規定に基づき、1998年12月1日付で1口当たり元本額を1万円から1円に変更するための受益権分割を実施しました。ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることによる差異を生じることはありません。

(1) 収益分配金請求権

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

受益者が収益分配金支払開始日から5年間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。

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

なお、「自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会

社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間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。

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

(3) 一部解約請求権

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ができます。

(4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者にかかる信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

MHAMスリーウェイオープン

(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)ならびに同規則第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47期計算期間の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【MHAMスリーウェイオープン】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第46期計算期間 (平成31年 3月11日現在)	第47期計算期間 (令和 1年 9月10日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,327,647,082	1,045,022,065
国債証券	5,589,733,300	5,702,218,000
親投資信託受益証券	1,604,404,469	1,601,463,623
派生商品評価勘定	4,475,464	529,622
未収入金	546,220	-
未収利息	12,808,385	13,514,169
前払金	-	20,730,000
前払費用	546,023	-
差入委託証拠金	46,275,000	45,570,000
流動資産合計	8,586,435,943	8,429,047,479
資産合計	8,586,435,943	8,429,047,479
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,688,134	24,482,400
前受金	9,720,000	-
未払解約金	11,911,563	11,478,431
未払受託者報酬	4,623,111	4,546,991
未払委託者報酬	34,673,286	34,102,400
未払利息	953	2,170
その他未払費用	75,205	73,594
流動負債合計	70,692,252	74,685,986
負債合計	70,692,252	74,685,986
純資産の部		
元本等		
元本	8,243,712,855	8,134,867,523
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	272,030,836	219,493,970
(分配準備積立金)	479,986,967	463,200,373
元本等合計	8,515,743,691	8,354,361,493
純資産合計	8,515,743,691	8,354,361,493
負債純資産合計	8,586,435,943	8,429,047,479

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第46期計算期間 (自 平成30年 9月11日 至 平成31年 3月11日)	第47期計算期間 (自 平成31年 3月12日 至 令和 1年 9月10日)
営業収益		
受取利息	20,673,378	22,321,701
有価証券売買等損益	13,961,502	109,543,854
派生商品取引等損益	67,166,806	142,497,260
営業収益合計	73,878,682	10,631,705
営業費用		
支払利息	1,058,095	410,636
受託者報酬	4,623,111	4,546,991
委託者報酬	34,673,286	34,102,400
その他費用	75,205	73,594
営業費用合計	40,429,697	39,133,621
営業利益又は営業損失()	33,448,985	49,765,326
経常利益又は経常損失()	33,448,985	49,765,326
当期純利益又は当期純損失()	33,448,985	49,765,326
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	1,513,908	2,269,347
期首剰余金又は期首欠損金()	244,301,003	272,030,836
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,632,274	6,958,193
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,632,274	6,958,193
剰余金減少額又は欠損金増加額	12,865,334	11,999,080
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,865,334	11,999,080
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	272,030,836	219,493,970

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第47期計算期間 (自 平成31年 3月12日 至 令和 1年 9月10日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 原則として時価で評価しております。 親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2 派生商品等の評価基準及び評価方法	先物取引 原則として時価で評価しております。
3 収益・費用の計上基準	有価証券売買等損益及び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)

第46期計算期間 (平成31年 3月11日現在)		第47期計算期間 (令和 1年 9月10日現在)	
1	計算期間末日における受益権の総数 8,243,712,855口	1	計算期間末日における受益権の総数 8,134,867,523口
2	計算期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産の額 1.0330円 (1万口当たり純資産の額) (10,330円)	2	計算期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産の額 1.0270円 (1万口当たり純資産の額) (10,270円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第46期計算期間 (自 平成30年 9月11日 至 平成31年 3月11日)	第47期計算期間 (自 平成31年 3月12日 至 令和 1年 9月10日)
1 分配金の計算過程	1 分配金の計算過程

<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(17,514,549円)、有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(306,467,890円)、分配準備積立金(462,472,418円)より、分配対象収益は786,454,857円(1万口当たり953円)ですが、当期の収益分配金につきましては、見送りとなりました。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,092,785円)、有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(317,063,140円)、分配準備積立金(459,107,588円)より、分配対象収益は780,263,513円(1万口当たり959円)ですが、当期の収益分配金につきましては、見送りとなりました。</p>
------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(金融商品に関する注記)

1.金融商品の状況に関する事項

項目	第46期計算期間 (自 平成30年 9月11日 至 平成31年 3月11日)	第47期計算期間 (自 平成31年 3月12日 至 令和 1年 9月10日)
1 金融商品に対する取組方針	<p>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項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。</p>	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。</p> <p>これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドは信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引及び、債券先物取引を行っており、当該デリバティブ取引は対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p>	同左

3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	同左
4 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については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第46期計算期間 (平成31年 3月11日現在)	第47期計算期間 (令和 1年 9月10日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

	<p>国債証券</p> <p>わが国の金融商品取引所または海外取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）（外貨建証券を除く）、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）または価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できない場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 原則として、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引</p> <p>先物取引</p> <p>デリバティブ取引等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</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務は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、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>国債証券</p> <p>同左</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>同左</p> <p>(2)デリバティブ取引</p> <p>先物取引</p> <p>同左</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>同左</p>
--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第46期計算期間(自 平成30年 9月11日 至 平成31年 3月11日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	75,881,300

親投資信託受益証券	89,695,802
合計	13,814,502

第47期計算期間(自 平成31年 3月12日 至 令和 1年 9月10日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	112,484,700
親投資信託受益証券	2,940,846
合計	109,543,854

(デリバティブ取引等に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(株式関連)

第46期計算期間(平成31年 3月11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				
	売建	1,480,164,220	-	1,485,325,000	5,160,780
合計		1,480,164,220	-	1,485,325,000	5,160,780

第47期計算期間(令和 1年 9月10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				
	売建	1,532,017,600	-	1,556,500,000	24,482,400
合計		1,532,017,600	-	1,556,500,000	24,482,400

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については、取引所の発表する計算日の清算値段により評価しております。

(債券関連)

第46期計算期間(平成31年 3月11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	債券先物取引				
	買建	763,701,890	-	763,650,000	51,890
合計		763,701,890	-	763,650,000	51,890

第47期計算期間(令和1年9月10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	債券先物取引				
	売建	155,199,622	-	154,670,000	529,622
合計		155,199,622	-	154,670,000	529,622

(注) 時価の算定方法

債券先物取引の時価の算定方法については、取引所の発表する計算日の清算値段により評価しております。

(関連当事者との取引に関する注記)

第46期計算期間 (自平成30年9月11日 至平成31年3月11日)	第47期計算期間 (自平成31年3月12日 至令和1年9月10日)
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

期別	第46期計算期間 (平成31年3月11日現在)	第47期計算期間 (令和1年9月10日現在)
項目		
期首元本額	8,469,091,603円	8,243,712,855円
期中追加設定元本額	221,128,589円	255,610,157円
期中一部解約元本額	446,507,337円	364,455,489円

(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

（令和 1年 9月10日現在）

種類	通貨	銘柄	券面総額・口数	評価額	備考
国債証券	日本・円	第395回利付国債（2年）	300,000,000	301,377,000	
		第130回利付国債（5年）	600,000,000	605,490,000	
		第134回利付国債（5年）	400,000,000	405,488,000	
		第137回利付国債（5年）	300,000,000	305,199,000	
		第7回利付国債（40年）	80,000,000	116,862,400	
		第10回利付国債（40年）	100,000,000	120,845,000	
		第329回利付国債（10年）	280,000,000	291,972,800	
		第333回利付国債（10年）	130,000,000	135,454,800	
		第342回利付国債（10年）	600,000,000	617,394,000	
		第10回利付国債（30年）	100,000,000	115,891,000	
		第15回利付国債（30年）	100,000,000	137,337,000	
		第39回利付国債（30年）	350,000,000	487,238,500	
		第53回利付国債（30年）	100,000,000	109,215,000	
		第71回利付国債（20年）	200,000,000	224,372,000	
		第73回利付国債（20年）	100,000,000	112,445,000	
		第97回利付国債（20年）	100,000,000	120,655,000	
		第100回利付国債（20年）	140,000,000	170,380,000	
		第102回利付国債（20年）	100,000,000	123,991,000	
		第105回利付国債（20年）	100,000,000	121,753,000	
		第140回利付国債（20年）	20,000,000	24,701,800	
		第141回利付国債（20年）	150,000,000	185,697,000	
		第142回利付国債（20年）	100,000,000	125,138,000	
		第145回利付国債（20年）	100,000,000	124,355,000	
		第148回利付国債（20年）	60,000,000	73,387,800	
第151回利付国債（20年）	10,000,000	11,841,900			
第156回利付国債（20年）	100,000,000	105,908,000			
第167回利付国債（20年）	400,000,000	427,828,000			
小計		銘柄数：27	5,120,000,000	5,702,218,000	

		組入時価比率：68.3%		78.1%
	合計			5,702,218,000
親投資信託受益証券	日本・円	MHAM TOPIXマザーファンド	864,954,698	1,601,463,623
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：19.2%	864,954,698	1,601,463,623 21.9%
	合計			1,601,463,623
合計				7,303,681,623

(注1) 比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

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

「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。

(参考)

当ファンドは、「MHAM TOPIXマザーファンド」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た「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。なお、同マザーファンドの状況は次の通りです。

MHAM TOPIXマザーファンド

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

(単位：円)

(令和1年9月10日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	629,549,570
株式	40,228,704,510
派生商品評価勘定	8,453,984
未収入金	181,209
未収配当金	21,304,624
差入委託証拠金	17,100,000

(令和 1年 9月10日現在)

流動資産合計	40,905,293,897
資産合計	40,905,293,897
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	336,296
前受金	6,800,000
未払解約金	53,928,100
未払利息	1,307
流動負債合計	61,065,703
負債合計	61,065,703
純資産の部	
元本等	
元本	22,060,032,800
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	18,784,195,394
元本等合計	40,844,228,194
純資産合計	40,844,228,194
負債純資産合計	40,905,293,897

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	(自 平成31年 3月12日 至 令和 1年 9月10日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。
2 派生商品等の評価基準及び評価方法	先物取引 原則として時価で評価しております。
3 収益・費用の計上基準	受取配当金 受取配当金は、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。 有価証券売買等損益及び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)

項目	(令和 1年 9月10日現在)	
1 計算期間末日における受益権の総数		22,060,032,800口
2 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産の額	1.8515円
	(1万口当たり純資産の額)	(18,515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

項目	(自 平成31年 3月12日 至 令和 1年 9月10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項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。 なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。 これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドは信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っており、当該デリバティブ取引は対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。 リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。
4 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1年 9月10日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>株式</p> <p>わが国の金融商品取引所または海外取引所に上場されている有価証券 当該有価証券については、原則として上記の取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できない場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>先物取引</p> <p>デリバティブ取引等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</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務は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、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(自 平成31年 3月12日 至 令和 1年 9月10日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	561,702,889
合計	561,702,889

(デリバティブ取引等に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(株式関連)

(令和 1年 9月10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	583,352,312	-	591,470,000	8,117,688
	合計	583,352,312	-	591,470,000	8,117,688

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については、取引所の発表する計算日の清算値段により評価しております。

(その他の注記)

項目	期別 (令和 1年 9月10日現在)
期首	平成31年 3月12日
親投資信託の期首における元本額	21,352,396,579円
期中追加設定元本額	2,320,539,495円
期中一部解約元本額	1,612,903,274円
期末元本額及びその内訳として当該親投資信託受益証券を投資対象とする委託者指図型投資信託ごとの元本額	
期末元本額	22,060,032,800円
MHAMスリーウェイオープン	864,954,698円
MHAM TOPIXオープン	4,401,944,176円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	12,457,456,901円
動的パッケージファンド<DC年金>	12,015,405円
コア資産形成ファンド	11,178,858円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	154,018,730円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	2,151,896,231円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,006,567,801円

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(令和 1年 9月10日現在)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	

日本・円	極洋	800	2,818.00	2,254,400
	日本水産	24,600	623.00	15,325,800
	マルハニチロ	3,500	2,697.00	9,439,500
	カネコ種苗	600	1,140.00	684,000
	サカタのタネ	2,900	3,675.00	10,657,500
	ホクト	2,000	1,918.00	3,836,000
	ホクリヨウ	300	602.00	180,600
	住石ホールディングス	5,500	134.00	737,000
	日鉄鉱業	500	4,015.00	2,007,500
	三井松島ホールディングス	1,100	1,211.00	1,332,100
	国際石油開発帝石	98,000	937.30	91,855,400
	石油資源開発	3,500	2,701.00	9,453,500
	K & Oエナジーグループ	1,200	1,337.00	1,604,400
	ヒノキヤグループ	600	1,852.00	1,111,200
	ショーボンドホールディングス	3,500	3,700.00	12,950,000
	ミライト・ホールディングス	6,900	1,593.00	10,991,700
	タマホーム	1,200	1,454.00	1,744,800
	サンヨーホームズ	400	637.00	254,800
	日本アクア	1,100	607.00	667,700
	ファーストコーポレーション	800	593.00	474,400
	ベストセラ	500	1,225.00	612,500
	TATERU	5,100	183.00	933,300
	スペースバリューホールディングス	3,100	473.00	1,466,300
	ダイセキ環境ソリューション	600	660.00	396,000
	第一カッター興業	300	1,599.00	479,700
	安藤・間	15,700	715.00	11,225,500
	東急建設	7,200	763.00	5,493,600
	コムシスホールディングス	8,700	2,904.00	25,264,800
	ミサワホーム	2,000	1,102.00	2,204,000
	ビーアールホールディングス	2,700	363.00	980,100
	高松コンストラクショングループ	1,500	2,356.00	3,534,000
	東建コーポレーション	800	6,300.00	5,040,000
	ソネック	200	879.00	175,800
	ヤマウラ	1,000	852.00	852,000
	大成建設	20,100	3,950.00	79,395,000
	大林組	60,600	1,018.00	61,690,800
	清水建設	61,800	936.00	57,844,800
	飛鳥建設	1,800	1,154.00	2,077,200
	長谷工コーポレーション	25,200	1,200.00	30,240,000
	松井建設	2,100	692.00	1,453,200
銭高組	200	3,915.00	783,000	
鹿島建設	47,300	1,365.00	64,564,500	

不動テトラ	1,400	1,147.00	1,605,800
大末建設	700	929.00	650,300
鉄建建設	1,200	2,640.00	3,168,000
西松建設	4,400	1,924.00	8,465,600
三井住友建設	14,600	553.00	8,073,800
大豊建設	1,400	2,664.00	3,729,600
前田建設工業	14,500	883.00	12,803,500
佐田建設	1,400	392.00	548,800
ナカノフード建設	1,600	434.00	694,400
奥村組	3,300	2,809.00	9,269,700
東鉄工業	2,400	3,150.00	7,560,000
イチケン	400	1,635.00	654,000
富士ピー・エス	1,000	490.00	490,000
浅沼組	700	3,620.00	2,534,000
戸田建設	23,500	600.00	14,100,000
熊谷組	2,900	3,000.00	8,700,000
青木あすなろ建設	1,000	1,208.00	1,208,000
北野建設	400	2,326.00	930,400
植木組	200	2,360.00	472,000
矢作建設工業	2,700	679.00	1,833,300
ピーエス三菱	2,200	671.00	1,476,200
日本ハウスホールディングス	3,900	475.00	1,852,500
大東建託	7,200	14,090.00	101,448,000
新日本建設	2,300	749.00	1,722,700
N I P P O	5,400	1,878.00	10,141,200
東亜道路工業	400	3,235.00	1,294,000
前田道路	6,300	2,423.00	15,264,900
日本道路	500	6,140.00	3,070,000
東亜建設工業	1,800	1,311.00	2,359,800
日本国土開発	3,300	553.00	1,824,900
若築建設	1,000	1,495.00	1,495,000
東洋建設	7,600	436.00	3,313,600
五洋建設	24,200	573.00	13,866,600
世紀東急工業	3,000	688.00	2,064,000
福田組	700	3,860.00	2,702,000
住友林業	14,400	1,361.00	19,598,400
日本基礎技術	2,400	321.00	770,400
巴コーポレーション	2,700	404.00	1,090,800
大和ハウス工業	55,900	3,390.00	189,501,000
ライト工業	3,900	1,359.00	5,300,100
積水ハウス	61,800	1,989.50	122,951,100
日特建設	1,700	628.00	1,067,600

北陸電気工事	900	867.00	780,300
ユアテック	3,300	654.00	2,158,200
四電工	300	2,716.00	814,800
中電工	2,600	2,266.00	5,891,600
関電工	9,200	927.00	8,528,400
きんでん	13,500	1,571.00	21,208,500
東京エネシス	2,100	882.00	1,852,200
トーエネック	500	3,235.00	1,617,500
住友電設	1,400	1,975.00	2,765,000
日本電設工業	3,400	2,143.00	7,286,200
協和エクシオ	7,900	2,573.00	20,326,700
新日本空調	1,600	1,748.00	2,796,800
九電工	4,000	3,330.00	13,320,000
三機工業	4,600	1,252.00	5,759,200
日揮	17,600	1,358.00	23,900,800
中外炉工業	600	1,455.00	873,000
ヤマト	1,800	650.00	1,170,000
太平電業	1,400	2,360.00	3,304,000
高砂熱学工業	4,900	1,723.00	8,442,700
三晃金属工業	200	2,347.00	469,400
朝日工業社	400	2,864.00	1,145,600
明星工業	3,700	720.00	2,664,000
大気社	2,800	3,160.00	8,848,000
ダイダン	1,300	2,001.00	2,601,300
日比谷総合設備	1,800	1,906.00	3,430,800
東芝プラントシステム	4,400	1,751.00	7,704,400
OSJBホールディングス	9,000	233.00	2,097,000
レイズネクスト	3,600	1,173.00	4,222,800
日本製粉	5,700	1,666.00	9,496,200
日清製粉グループ本社	20,400	1,968.00	40,147,200
日東富士製粉	100	6,540.00	654,000
昭和産業	1,600	3,100.00	4,960,000
鳥越製粉	1,500	824.00	1,236,000
中部飼料	2,200	1,144.00	2,516,800
フィード・ワン	12,600	156.00	1,965,600
東洋精糖	200	1,046.00	209,200
日本甜菜製糖	900	1,769.00	1,592,100
三井製糖	1,500	2,240.00	3,360,000
塩水港精糖	2,300	208.00	478,400
日新製糖	800	1,940.00	1,552,000
森永製菓	4,500	5,060.00	22,770,000
中村屋	400	4,285.00	1,714,000

江崎グリコ	5,500	4,660.00	25,630,000
名糖産業	800	1,271.00	1,016,800
井村屋グループ	800	2,068.00	1,654,400
不二家	1,100	1,988.00	2,186,800
山崎製パン	13,600	1,844.00	25,078,400
第一屋製パン	500	929.00	464,500
モロゾフ	300	4,685.00	1,405,500
亀田製菓	1,100	4,740.00	5,214,000
寿スピリッツ	1,900	6,470.00	12,293,000
カルビー	8,300	3,265.00	27,099,500
森永乳業	3,600	4,335.00	15,606,000
六甲バター	1,200	1,633.00	1,959,600
ヤクルト本社	13,400	6,030.00	80,802,000
明治ホールディングス	12,800	7,490.00	95,872,000
雪印メグミルク	4,400	2,447.00	10,766,800
プリマハム	2,600	2,165.00	5,629,000
日本ハム	7,500	4,175.00	31,312,500
丸大食品	2,000	2,135.00	4,270,000
S Foods	1,600	3,060.00	4,896,000
伊藤ハム米久ホールディングス	11,800	654.00	7,717,200
サッポロホールディングス	6,200	2,537.00	15,729,400
アサヒグループホールディングス	37,900	5,103.00	193,403,700
キリンホールディングス	76,700	2,095.00	160,686,500
宝ホールディングス	13,600	1,051.00	14,293,600
オエノンホールディングス	4,900	369.00	1,808,100
養命酒製造	500	1,900.00	950,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	12,700	2,368.00	30,073,600
サントリー食品インターナショナル	12,100	4,665.00	56,446,500
ダイドーグループホールディングス	1,100	4,385.00	4,823,500
伊藤園	5,500	4,935.00	27,142,500
キーコーヒー	1,800	2,150.00	3,870,000
ユニカフェ	600	976.00	585,600
ジャパンフーズ	300	1,198.00	359,400
日清オイリオグループ	2,300	3,340.00	7,682,000
不二製油グループ本社	4,400	2,966.00	13,050,400
かどや製油	200	3,525.00	705,000
J - オイルミルズ	900	4,040.00	3,636,000
キッコーマン	12,000	4,895.00	58,740,000
味の素	40,000	1,887.00	75,480,000
キューピー	10,100	2,513.00	25,381,300
ハウス食品グループ本社	6,800	3,925.00	26,690,000
カゴメ	7,300	2,711.00	19,790,300

焼津水産化学工業	800	1,042.00	833,600
アリアケジャパン	1,700	8,060.00	13,702,000
ピエトロ	300	1,609.00	482,700
エバラ食品工業	500	2,041.00	1,020,500
やまみ	100	1,975.00	197,500
ニチレイ	9,400	2,381.00	22,381,400
東洋水産	9,300	4,355.00	40,501,500
イトアンド	700	1,722.00	1,205,400
大冷	200	2,045.00	409,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	500	824.00	412,000
日清食品ホールディングス	7,700	7,490.00	57,673,000
永谷園ホールディングス	1,000	2,073.00	2,073,000
一正蒲鉾	700	1,082.00	757,400
フジッコ	1,900	1,897.00	3,604,300
ロック・フィールド	2,000	1,371.00	2,742,000
日本たばこ産業	104,500	2,274.50	237,685,250
ケンコーマヨネーズ	1,000	2,143.00	2,143,000
わらべや日洋ホールディングス	1,300	1,757.00	2,284,100
なとり	1,000	1,569.00	1,569,000
イフジ産業	300	716.00	214,800
ピククルスコーポレーション	400	2,404.00	961,600
北の達人コーポレーション	7,100	731.00	5,190,100
ユーグレナ	7,700	885.00	6,814,500
ミヨシ油脂	700	1,100.00	770,000
理研ビタミン	800	3,435.00	2,748,000
片倉工業	2,600	1,213.00	3,153,800
ゲンゼ	1,200	4,450.00	5,340,000
東洋紡	7,600	1,418.00	10,776,800
ユニチカ	5,700	333.00	1,898,100
富士紡ホールディングス	900	2,692.00	2,422,800
倉敷紡績	1,700	2,109.00	3,585,300
シキボウ	900	924.00	831,600
日本毛織	5,900	932.00	5,498,800
トーア紡コーポレーション	700	500.00	350,000
ダイドーリミテッド	3,000	268.00	804,000
帝国繊維	2,000	1,710.00	3,420,000
帝人	14,400	1,995.00	28,728,000
東レ	137,400	777.80	106,869,720
サカイオーベックス	400	1,655.00	662,000
住江織物	500	2,934.00	1,467,000
日本フェルト	800	459.00	367,200
イチカワ	100	1,366.00	136,600

日東製網	200	1,484.00	296,800
アツギ	1,300	815.00	1,059,500
ダイニツク	500	700.00	350,000
セーレン	4,300	1,254.00	5,392,200
ソトー	600	979.00	587,400
東海染工	200	1,139.00	227,800
小松マテーレ	2,900	752.00	2,180,800
ワコールホールディングス	5,000	2,569.00	12,845,000
ホギメディカル	2,200	2,974.00	6,542,800
クラウドシアホールディングス	600	488.00	292,800
T S Iホールディングス	6,600	558.00	3,682,800
マツオカコーポレーション	600	2,029.00	1,217,400
ワールド	2,300	2,420.00	5,566,000
三陽商会	1,000	1,346.00	1,346,000
ナイガイ	900	346.00	311,400
オンワードホールディングス	11,000	523.00	5,753,000
ルックホールディングス	600	1,034.00	620,400
ゴールドウイン	1,600	16,450.00	26,320,000
デサント	4,300	1,449.00	6,230,700
キング	800	545.00	436,000
ヤマトインターナショナル	1,100	401.00	441,100
特種東海製紙	1,100	3,740.00	4,114,000
王子ホールディングス	79,900	511.00	40,828,900
日本製紙	8,600	1,824.00	15,686,400
三菱製紙	3,300	480.00	1,584,000
北越コーポレーション	11,900	555.00	6,604,500
中越パルプ工業	800	1,512.00	1,209,600
大王製紙	8,700	1,373.00	11,945,100
阿波製紙	500	401.00	200,500
レンゴー	18,300	774.00	14,164,200
トーモク	1,100	1,545.00	1,699,500
ザ・パック	1,300	3,435.00	4,465,500
クラレ	27,900	1,295.00	36,130,500
旭化成	125,600	1,014.00	127,358,400
共和レザー	900	735.00	661,500
昭和電工	12,500	2,988.00	37,350,000
住友化学	139,100	500.00	69,550,000
住友精化	900	3,420.00	3,078,000
日産化学	10,800	4,495.00	48,546,000
ラサ工業	700	1,243.00	870,100
クレハ	1,600	6,120.00	9,792,000
多木化学	500	4,815.00	2,407,500

テイカ	1,400	1,924.00	2,693,600
石原産業	3,500	922.00	3,227,000
片倉コープアグリ	500	1,065.00	532,500
日本曹達	2,800	2,561.00	7,170,800
東ソー	27,300	1,438.00	39,257,400
トクヤマ	5,100	2,379.00	12,132,900
セントラル硝子	3,800	2,318.00	8,808,400
東亜合成	11,000	1,111.00	12,221,000
大阪ソーダ	1,900	2,495.00	4,740,500
関東電化工業	4,200	745.00	3,129,000
デンカ	6,900	2,918.00	20,134,200
信越化学工業	31,100	11,285.00	350,963,500
日本カーバイド工業	600	1,221.00	732,600
堺化学工業	1,200	2,447.00	2,936,400
第一稀元素化学工業	1,900	837.00	1,590,300
エア・ウォーター	14,500	1,857.00	26,926,500
大陽日酸	14,500	2,075.00	30,087,500
日本化学工業	600	2,285.00	1,371,000
東邦アセチレン	200	1,221.00	244,200
日本パーカライジング	9,700	1,180.00	11,446,000
高圧ガス工業	2,700	786.00	2,122,200
チタン工業	200	2,589.00	517,800
四国化成工業	2,900	1,081.00	3,134,900
戸田工業	400	2,072.00	828,800
ステラ ケミファ	1,000	2,670.00	2,670,000
保土谷化学工業	600	2,973.00	1,783,800
日本触媒	3,000	6,390.00	19,170,000
大日精化工業	1,400	2,967.00	4,153,800
カネカ	4,600	3,365.00	15,479,000
三菱瓦斯化学	17,900	1,360.00	24,344,000
三井化学	16,000	2,383.00	38,128,000
J S R	17,800	1,788.00	31,826,400
東京応化工業	3,000	4,000.00	12,000,000
大阪有機化学工業	1,600	976.00	1,561,600
三菱ケミカルホールディングス	117,900	804.10	94,803,390
K Hネオケム	3,100	2,188.00	6,782,800
ダイセル	26,100	874.00	22,811,400
住友ベークライト	3,100	4,085.00	12,663,500
積水化学工業	38,000	1,647.00	62,586,000
日本ゼオン	16,000	1,291.00	20,656,000
アイカ工業	5,300	3,080.00	16,324,000
宇部興産	8,900	2,174.00	19,348,600

積水樹脂	2,900	2,020.00	5,858,000
タキロンシーアイ	3,800	626.00	2,378,800
旭有機材	1,200	1,275.00	1,530,000
日立化成	8,200	3,425.00	28,085,000
ニチバン	900	1,548.00	1,393,200
リケンテクノス	4,900	471.00	2,307,900
大倉工業	800	1,578.00	1,262,400
積水化成品工業	2,700	732.00	1,976,400
群栄化学工業	400	2,317.00	926,800
タイガースポリマー	700	535.00	374,500
ミライアル	600	1,268.00	760,800
ダイキアクシス	600	764.00	458,400
ダイキョーニシカワ	3,700	771.00	2,852,700
竹本容器	700	865.00	605,500
森六ホールディングス	900	2,511.00	2,259,900
日本化薬	11,100	1,241.00	13,775,100
カーリットホールディングス	2,000	571.00	1,142,000
日本精化	1,300	1,168.00	1,518,400
扶桑化学工業	1,800	2,316.00	4,168,800
トリケミカル研究所	400	6,230.00	2,492,000
A D E K A	8,700	1,324.00	11,518,800
日油	6,600	3,485.00	23,001,000
新日本理化	3,400	184.00	625,600
ハリマ化成グループ	1,400	1,219.00	1,706,600
花王	43,800	7,637.00	334,500,600
第一工業製薬	700	2,751.00	1,925,700
石原ケミカル	500	1,636.00	818,000
日華化学	600	768.00	460,800
ニイタカ	300	1,444.00	433,200
三洋化成工業	1,200	4,955.00	5,946,000
有機合成薬品工業	1,900	222.00	421,800
大日本塗料	2,000	1,075.00	2,150,000
日本ペイントホールディングス	14,600	5,140.00	75,044,000
関西ペイント	19,900	2,272.00	45,212,800
神東塗料	1,500	163.00	244,500
中国塗料	5,800	854.00	4,953,200
日本特殊塗料	1,300	1,051.00	1,366,300
藤倉化成	2,300	539.00	1,239,700
太陽ホールディングス	1,500	3,390.00	5,085,000
D I C	7,500	2,920.00	21,900,000
サカタインクス	3,900	1,073.00	4,184,700
東洋インキS Cホールディングス	3,700	2,330.00	8,621,000

T & K TOKA	1,300	941.00	1,223,300
富士フイルムホールディングス	37,400	4,678.00	174,957,200
資生堂	35,800	8,337.00	298,464,600
ライオン	23,400	2,010.00	47,034,000
高砂香料工業	1,200	2,639.00	3,166,800
マンダム	4,100	2,611.00	10,705,100
ミルボン	2,400	4,920.00	11,808,000
ファンケル	8,000	2,595.00	20,760,000
コーセー	3,100	17,960.00	55,676,000
コタ	1,000	1,165.00	1,165,000
シーボン	300	2,380.00	714,000
ポーラ・オルビスホールディングス	7,700	2,462.00	18,957,400
ノエビアホールディングス	1,700	5,560.00	9,452,000
アジュバンコスメジャパン	500	925.00	462,500
エステー	1,300	1,569.00	2,039,700
アグロ カネショウ	600	1,437.00	862,200
コニシ	3,200	1,493.00	4,777,600
長谷川香料	2,400	2,029.00	4,869,600
星光PMC	1,100	755.00	830,500
小林製薬	5,100	7,880.00	40,188,000
荒川化学工業	1,600	1,377.00	2,203,200
メック	1,300	1,384.00	1,799,200
日本高純度化学	500	2,409.00	1,204,500
タカラバイオ	4,700	2,234.00	10,499,800
JCU	2,300	1,911.00	4,395,300
新田ゼラチン	1,200	638.00	765,600
OATアグリオ	300	1,427.00	428,100
デクセリアルズ	4,700	753.00	3,539,100
アース製薬	1,400	5,080.00	7,112,000
北興化学工業	1,800	472.00	849,600
大成ラミック	600	2,792.00	1,675,200
クミアイ化学工業	7,500	924.00	6,930,000
日本農薬	3,500	478.00	1,673,000
アキレス	1,300	1,689.00	2,195,700
有沢製作所	2,900	1,030.00	2,987,000
日東電工	12,400	5,310.00	65,844,000
レック	1,900	954.00	1,812,600
三光合成	2,200	350.00	770,000
きもと	3,500	176.00	616,000
藤森工業	1,600	2,949.00	4,718,400
前澤化成工業	1,100	1,135.00	1,248,500
未来工業	1,000	1,876.00	1,876,000

ウェブロックホールディングス	500	735.00	367,500
J S P	1,100	1,783.00	1,961,300
エフピコ	2,000	6,610.00	13,220,000
天馬	1,200	1,952.00	2,342,400
信越ポリマー	3,400	752.00	2,556,800
東リ	4,600	248.00	1,140,800
ニフコ	7,200	2,536.00	18,259,200
バルカー	1,500	2,270.00	3,405,000
ユニ・チャーム	34,800	3,256.00	113,308,800
ショーエイコーポレーション	200	743.00	148,600
協和キリン	18,200	1,978.00	35,999,600
武田薬品工業	157,400	3,629.00	571,204,600
アステラス製薬	158,700	1,535.50	243,683,850
大日本住友製薬	13,400	1,826.00	24,468,400
塩野義製薬	23,000	5,783.00	133,009,000
田辺三菱製薬	18,900	1,223.00	23,114,700
わかもと製薬	2,900	243.00	704,700
あすか製薬	2,300	1,027.00	2,362,100
日本新薬	4,700	8,540.00	40,138,000
ビオフェルミン製薬	300	2,125.00	637,500
中外製薬	18,800	7,670.00	144,196,000
科研製薬	3,100	5,060.00	15,686,000
エーザイ	21,600	5,378.00	116,164,800
ロート製薬	9,300	2,690.00	25,017,000
小野薬品工業	42,600	1,961.00	83,538,600
久光製薬	5,300	4,480.00	23,744,000
持田製薬	2,700	4,025.00	10,867,500
参天製薬	33,600	1,814.00	60,950,400
扶桑薬品工業	600	1,904.00	1,142,400
日本ケミファ	300	2,795.00	838,500
ツムラ	5,600	2,966.00	16,609,600
日医工	4,800	1,213.00	5,822,400
キッセイ薬品工業	3,200	2,506.00	8,019,200
生化学工業	3,500	1,084.00	3,794,000
栄研化学	3,200	1,625.00	5,200,000
日水製薬	700	1,198.00	838,600
鳥居薬品	1,200	2,800.00	3,360,000
J C Rファーマ	1,300	7,430.00	9,659,000
東和薬品	2,600	2,414.00	6,276,400
富士製薬工業	1,200	1,301.00	1,561,200
沢井製薬	3,700	5,660.00	20,942,000
ゼリア新薬工業	3,600	1,884.00	6,782,400

第一三共	51,600	6,712.00	346,339,200
キョーリン製薬ホールディングス	4,000	1,754.00	7,016,000
大幸薬品	800	2,246.00	1,796,800
ダイト	1,000	2,841.00	2,841,000
大塚ホールディングス	34,300	4,460.00	152,978,000
大正製薬ホールディングス	3,800	7,440.00	28,272,000
ペプチドリーム	9,100	5,140.00	46,774,000
日本コークス工業	15,800	86.00	1,358,800
ニチレキ	2,300	1,041.00	2,394,300
ユシロ化学工業	900	1,324.00	1,191,600
ビーピー・カストロール	600	1,338.00	802,800
富士石油	4,800	244.00	1,171,200
MORESCO	700	1,308.00	915,600
出光興産	20,800	3,060.00	63,648,000
JXTGホールディングス	303,600	473.80	143,845,680
コスモエネルギーホールディングス	5,200	2,104.00	10,940,800
横浜ゴム	10,500	2,134.00	22,407,000
TOYO TIRE	10,400	1,381.00	14,362,400
ブリヂストン	55,300	4,116.00	227,614,800
住友ゴム工業	16,300	1,261.00	20,554,300
藤倉コンポジット	1,700	424.00	720,800
オカモト	1,200	4,055.00	4,866,000
フコク	900	687.00	618,300
ニッタ	2,000	2,832.00	5,664,000
住友理工	3,700	835.00	3,089,500
三ツ星ベルト	2,300	1,761.00	4,050,300
バンドー化学	3,400	862.00	2,930,800
日東紡績	2,700	3,120.00	8,424,000
AGC	17,800	3,255.00	57,939,000
日本板硝子	9,000	656.00	5,904,000
石塚硝子	300	1,928.00	578,400
日本山村硝子	600	1,236.00	741,600
日本電気硝子	7,200	2,417.00	17,402,400
オハラ	700	1,488.00	1,041,600
住友大阪セメント	3,600	4,625.00	16,650,000
太平洋セメント	11,400	2,843.00	32,410,200
日本ヒューム	1,800	687.00	1,236,600
日本コンクリート工業	4,100	243.00	996,300
三谷セキサン	800	2,969.00	2,375,200
アジアパイルホールディングス	2,600	507.00	1,318,200
東海カーボン	18,900	1,119.00	21,149,100
日本カーボン	900	3,870.00	3,483,000

東洋炭素	1,100	2,223.00	2,445,300
ノリタケカンパニーリミテド	1,100	3,955.00	4,350,500
TOTO	13,900	3,960.00	55,044,000
日本碍子	22,100	1,520.00	33,592,000
日本特殊陶業	15,300	1,968.00	30,110,400
MARUWA	600	6,560.00	3,936,000
品川リフラクトリーズ	500	2,633.00	1,316,500
黒崎播磨	400	5,610.00	2,244,000
ヨータイ	1,600	582.00	931,200
イソライト工業	900	440.00	396,000
東京窯業	2,400	290.00	696,000
ニッカトー	800	665.00	532,000
フジインコーポレーテッド	1,600	2,496.00	3,993,600
クニミネ工業	800	877.00	701,600
エーアンドエーマテリアル	400	993.00	397,200
ニチアス	4,900	1,841.00	9,020,900
ニチハ	2,500	2,838.00	7,095,000
日本製鉄	82,600	1,542.50	127,410,500
神戸製鋼所	33,200	591.00	19,621,200
中山製鋼所	2,600	442.00	1,149,200
合同製鐵	900	2,178.00	1,960,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	48,100	1,335.50	64,237,550
東京製鐵	9,600	835.00	8,016,000
共英製鋼	2,000	1,931.00	3,862,000
大和工業	3,800	2,724.00	10,351,200
東京鐵鋼	800	1,226.00	980,800
大阪製鐵	1,100	1,335.00	1,468,500
淀川製鋼所	2,300	1,874.00	4,310,200
丸一鋼管	6,300	2,690.00	16,947,000
モリ工業	500	1,841.00	920,500
大同特殊鋼	2,900	4,295.00	12,455,500
日本高周波鋼業	1,000	411.00	411,000
日本冶金工業	15,100	232.00	3,503,200
山陽特殊製鋼	2,300	1,455.00	3,346,500
愛知製鋼	1,000	3,200.00	3,200,000
日立金属	19,300	1,217.00	23,488,100
日本金属	500	803.00	401,500
大平洋金属	1,300	2,245.00	2,918,500
新日本電工	11,900	167.00	1,987,300
栗本鐵工所	900	1,455.00	1,309,500
虹技	300	1,231.00	369,300
三菱製鋼	1,400	1,122.00	1,570,800

日亜鋼業	2,600	287.00	746,200
日本精線	300	2,471.00	741,300
エンビプロ・ホールディングス	700	599.00	419,300
シンニッタン	2,600	448.00	1,164,800
新家工業	300	1,393.00	417,900
大紀アルミニウム工業所	2,900	739.00	2,143,100
日本軽金属ホールディングス	48,700	194.00	9,447,800
三井金属鉱業	4,900	2,433.00	11,921,700
東邦亜鉛	1,000	2,035.00	2,035,000
三菱マテリアル	11,800	2,739.00	32,320,200
住友金属鉱山	24,400	3,334.00	81,349,600
DOWAホールディングス	4,200	3,510.00	14,742,000
古河機械金属	3,000	1,391.00	4,173,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,100	1,665.00	3,496,500
東邦チタニウム	3,300	818.00	2,699,400
UACJ	2,800	1,762.00	4,933,600
CKサンエツ	300	2,839.00	851,700
古河電気工業	5,200	2,488.00	12,937,600
住友電気工業	66,600	1,335.50	88,944,300
フジクラ	22,000	379.00	8,338,000
昭和電線ホールディングス	2,200	799.00	1,757,800
東京特殊電線	200	1,847.00	369,400
タツタ電線	3,600	463.00	1,666,800
カナレ電気	300	1,774.00	532,200
平河ヒューテック	700	1,080.00	756,000
リョービ	2,200	1,709.00	3,759,800
アーレスティ	2,300	548.00	1,260,400
アサヒホールディングス	3,300	2,311.00	7,626,300
稲葉製作所	1,100	1,399.00	1,538,900
宮地エンジニアリンググループ	600	1,518.00	910,800
トーカロ	4,600	867.00	3,988,200
アルファCo	600	1,173.00	703,800
SUMCO	21,400	1,469.00	31,436,600
川田テクノロジーズ	400	6,420.00	2,568,000
RS Technologies	500	3,405.00	1,702,500
信和	900	978.00	880,200
東洋製罐グループホールディングス	11,400	1,634.00	18,627,600
ホッカンホールディングス	800	1,497.00	1,197,600
コロナ	900	1,024.00	921,600
横河ブリッジホールディングス	3,300	1,571.00	5,184,300
駒井ハルテック	300	1,494.00	448,200
高田機工	100	2,494.00	249,400

三和ホールディングス	18,400	1,205.00	22,172,000
文化シャッター	5,300	910.00	4,823,000
三協立山	2,600	1,173.00	3,049,800
アルインコ	1,400	931.00	1,303,400
東洋シャッター	500	677.00	338,500
LIXILグループ	26,400	1,781.00	47,018,400
日本ファイルコン	1,300	490.00	637,000
ノーリツ	3,800	1,248.00	4,742,400
長府製作所	1,800	2,249.00	4,048,200
リンナイ	3,200	7,000.00	22,400,000
ダイニチ工業	900	616.00	554,400
日東精工	2,400	539.00	1,293,600
三洋工業	200	1,796.00	359,200
岡部	3,700	828.00	3,063,600
ジーテクト	1,900	1,625.00	3,087,500
中国工業	600	571.00	342,600
東プレ	3,300	1,712.00	5,649,600
高周波熱錬	3,300	838.00	2,765,400
東京製網	1,200	934.00	1,120,800
サンコール	1,100	468.00	514,800
モリテック スチール	1,600	339.00	542,400
パイオラックス	2,800	1,847.00	5,171,600
エイチワン	1,800	659.00	1,186,200
日本発條	17,900	819.00	14,660,100
中央発條	100	2,780.00	278,000
アドバネクス	300	1,681.00	504,300
立川ブラインド工業	700	1,358.00	950,600
三益半導体工業	1,600	1,818.00	2,908,800
日本ドライケミカル	500	1,109.00	554,500
日本製鋼所	5,400	2,117.00	11,431,800
三浦工業	7,700	3,120.00	24,024,000
タクマ	6,500	1,210.00	7,865,000
ツガミ	4,100	964.00	3,952,400
オークマ	2,300	5,670.00	13,041,000
東芝機械	2,000	2,234.00	4,468,000
アマダホールディングス	26,800	1,171.00	31,382,800
アイダエンジニアリング	4,900	838.00	4,106,200
滝澤鉄工所	500	1,292.00	646,000
F U J I	7,100	1,550.00	11,005,000
牧野フライス製作所	2,100	4,715.00	9,901,500
オーエスジー	8,200	2,160.00	17,712,000
ダイジェット工業	200	1,466.00	293,200

旭ダイヤモンド工業	5,000	645.00	3,225,000
D M G 森精機	11,400	1,554.00	17,715,600
ソディック	4,200	784.00	3,292,800
ディスコ	2,400	19,740.00	47,376,000
日東工器	1,000	2,110.00	2,110,000
日進工具	500	1,924.00	962,000
パンチ工業	1,300	508.00	660,400
富士ダイス	800	577.00	461,600
豊和工業	1,100	754.00	829,400
O K K	700	725.00	507,500
東洋機械金属	1,300	568.00	738,400
津田駒工業	400	1,307.00	522,800
島精機製作所	2,500	2,555.00	6,387,500
オプトラン	2,000	3,210.00	6,420,000
N C ホールディングス	700	457.00	319,900
イワキポンプ	800	952.00	761,600
フリュー	1,400	936.00	1,310,400
ヤマシンフィルタ	3,100	713.00	2,210,300
日阪製作所	2,200	854.00	1,878,800
やまびこ	3,500	1,045.00	3,657,500
平田機工	800	6,690.00	5,352,000
ペガサスミシン製造	1,700	497.00	844,900
マルマエ	700	872.00	610,400
タツモ	800	1,131.00	904,800
ナプテスコ	10,500	3,290.00	34,545,000
三井海洋開発	1,900	2,596.00	4,932,400
レオン自動機	1,700	1,532.00	2,604,400
S M C	5,300	44,560.00	236,168,000
ヤマハモーターロボティクスホールディング グ	1,700	420.00	714,000
ホソカワミクロン	600	3,840.00	2,304,000
ユニオンツール	700	3,230.00	2,261,000
オイレス工業	2,500	1,589.00	3,972,500
日精エー・エス・ビー機械	600	3,360.00	2,016,000
サトーホールディングス	2,200	2,739.00	6,025,800
技研製作所	1,600	3,435.00	5,496,000
日本エアーテック	500	576.00	288,000
カワタ	500	955.00	477,500
日精樹脂工業	1,500	1,000.00	1,500,000
オカダアイオン	600	1,150.00	690,000
ワイエイシイホールディングス	700	676.00	473,200
小松製作所	81,600	2,414.00	196,982,400
住友重機械工業	10,300	3,265.00	33,629,500

日立建機	7,300	2,474.00	18,060,200
日工	400	3,175.00	1,270,000
巴工業	800	2,329.00	1,863,200
井関農機	1,900	1,415.00	2,688,500
TOWA	1,600	771.00	1,233,600
丸山製作所	400	1,169.00	467,600
北川鉄工所	800	1,968.00	1,574,400
ローツェ	800	2,314.00	1,851,200
タカキタ	600	531.00	318,600
クボタ	96,600	1,570.50	151,710,300
荏原実業	500	2,082.00	1,041,000
三菱化工機	700	1,773.00	1,241,100
月島機械	3,600	1,328.00	4,780,800
帝国電機製作所	1,300	1,151.00	1,496,300
東京機械製作所	1,000	367.00	367,000
新東工業	4,200	930.00	3,906,000
澁谷工業	1,600	2,727.00	4,363,200
アイチ コーポレーション	3,100	667.00	2,067,700
小森コーポレーション	4,600	1,115.00	5,129,000
鶴見製作所	1,400	1,994.00	2,791,600
住友精密工業	300	2,957.00	887,100
日本ギア工業	600	490.00	294,000
酒井重工業	300	2,679.00	803,700
荏原製作所	8,000	2,680.00	21,440,000
石井鐵工所	300	1,996.00	598,800
西島製作所	1,800	1,028.00	1,850,400
北越工業	1,900	1,220.00	2,318,000
ダイキン工業	24,600	13,750.00	338,250,000
オルガノ	600	4,515.00	2,709,000
トーヨーカネツ	700	1,828.00	1,279,600
栗田工業	9,800	2,877.00	28,194,600
椿本チエイン	2,400	3,385.00	8,124,000
大同工業	900	810.00	729,000
木村化工機	1,600	381.00	609,600
アネスト岩田	2,800	903.00	2,528,400
ダイフク	9,900	5,270.00	52,173,000
サムコ	600	828.00	496,800
加藤製作所	900	1,832.00	1,648,800
油研工業	300	1,610.00	483,000
タダノ	8,800	1,011.00	8,896,800
フジテック	6,500	1,304.00	8,476,000
C K D	5,100	1,258.00	6,415,800

キトー	1,400	1,538.00	2,153,200
平和	5,000	2,101.00	10,505,000
理想科学工業	1,600	1,713.00	2,740,800
SANKYO	4,500	3,685.00	16,582,500
日本金銭機械	2,100	936.00	1,965,600
マースグループホールディングス	1,100	1,873.00	2,060,300
福島工業	1,100	3,075.00	3,382,500
オーイズミ	900	413.00	371,700
ダイコク電機	800	1,524.00	1,219,200
竹内製作所	3,000	1,666.00	4,998,000
アマノ	5,100	3,210.00	16,371,000
JUKI	2,600	896.00	2,329,600
蛇の目ミシン工業	1,700	394.00	669,800
マックス	2,700	1,765.00	4,765,500
グローリー	5,000	3,015.00	15,075,000
新晃工業	1,700	1,709.00	2,905,300
大和冷機工業	2,600	1,072.00	2,787,200
セガサミーホールディングス	17,900	1,491.00	26,688,900
日本ピストンリング	600	1,293.00	775,800
リケン	800	3,700.00	2,960,000
T P R	2,400	1,759.00	4,221,600
ツバキ・ナカシマ	3,700	1,670.00	6,179,000
ホシザキ	5,300	7,780.00	41,234,000
大豊工業	1,500	800.00	1,200,000
日本精工	37,200	966.00	35,935,200
NTN	39,600	317.00	12,553,200
ジェイテクト	17,400	1,262.00	21,958,800
不二越	1,700	4,590.00	7,803,000
日本トムソン	5,500	461.00	2,535,500
THK	10,600	2,800.00	29,680,000
ユーシン精機	1,500	1,025.00	1,537,500
前澤給装工業	600	1,957.00	1,174,200
イーグル工業	2,300	1,025.00	2,357,500
前澤工業	1,300	335.00	435,500
日本ピラー工業	1,800	1,194.00	2,149,200
キッツ	7,300	707.00	5,161,100
マキタ	22,000	3,275.00	72,050,000
日立造船	14,900	339.00	5,051,100
三菱重工業	30,200	4,201.00	126,870,200
I H I	13,900	2,336.00	32,470,400
スター精密	2,900	1,554.00	4,506,600
日清紡ホールディングス	12,100	842.00	10,188,200

イビデン	11,100	2,104.00	23,354,400
コニカミノルタ	39,500	780.00	30,810,000
ブラザー工業	23,500	1,907.00	44,814,500
ミネベアミツミ	33,500	1,815.00	60,802,500
日立製作所	81,200	3,989.00	323,906,800
三菱電機	180,300	1,379.00	248,633,700
富士電機	11,700	3,260.00	38,142,000
東洋電機製造	700	1,517.00	1,061,900
安川電機	20,900	3,870.00	80,883,000
シンフォニアテクノロジー	2,500	1,214.00	3,035,000
明電舎	3,600	1,833.00	6,598,800
オリジン	500	1,402.00	701,000
山洋電気	900	4,640.00	4,176,000
デンヨー	1,600	1,647.00	2,635,200
東芝テック	2,300	3,120.00	7,176,000
芝浦メカトロニクス	300	2,918.00	875,400
マブチモーター	5,000	3,960.00	19,800,000
日本電産	21,700	14,290.00	310,093,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,000	790.00	790,000
トレックス・セミコンダクター	800	1,173.00	938,400
東光高岳	900	1,116.00	1,004,400
ダブル・スコープ	2,500	614.00	1,535,000
ダイヘン	2,000	3,185.00	6,370,000
ヤーマン	2,600	826.00	2,147,600
JVCケンウッド	14,100	306.00	4,314,600
ミマキエンジニアリング	1,700	513.00	872,100
第一精工	700	2,341.00	1,638,700
日新電機	4,200	1,304.00	5,476,800
大崎電気工業	3,700	658.00	2,434,600
オムロン	19,200	5,810.00	111,552,000
日東工業	2,900	2,014.00	5,840,600
I D E C	2,400	1,891.00	4,538,400
正興電機製作所	400	716.00	286,400
不二電機工業	300	1,201.00	360,300
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6,500	1,846.00	11,999,000
サクサホールディングス	400	1,775.00	710,000
メルコホールディングス	800	2,695.00	2,156,000
テクノメディカ	400	2,089.00	835,600
日本電気	23,400	4,470.00	104,598,000
富士通	17,400	8,448.00	146,995,200
沖電気工業	7,900	1,447.00	11,431,300
岩崎通信機	900	779.00	701,100

電気興業	1,000	2,918.00	2,918,000
サンケン電気	2,200	2,035.00	4,477,000
ナカヨ	300	1,633.00	489,900
アイホン	1,000	1,588.00	1,588,000
ルネサスエレクトロニクス	85,800	678.00	58,172,400
セイコーエプソン	22,400	1,511.00	33,846,400
ワコム	13,200	347.00	4,580,400
アルバック	3,600	4,405.00	15,858,000
アクセル	900	638.00	574,200
E I Z O	1,600	3,660.00	5,856,000
日本信号	4,600	1,192.00	5,483,200
京三製作所	3,900	357.00	1,392,300
能美防災	2,400	2,116.00	5,078,400
ホーチキ	1,200	1,400.00	1,680,000
星和電機	1,000	509.00	509,000
エレコム	1,700	4,175.00	7,097,500
パナソニック	206,300	881.40	181,832,820
シャープ	18,000	1,226.00	22,068,000
アンリツ	11,700	1,897.00	22,194,900
富士通ゼネラル	5,500	1,759.00	9,674,500
ソニー	121,000	6,369.00	770,649,000
T D K	9,400	9,280.00	87,232,000
帝国通信工業	500	1,100.00	550,000
タムラ製作所	7,000	575.00	4,025,000
アルプスアルパイン	18,800	1,934.00	36,359,200
池上通信機	700	1,027.00	718,900
日本電波工業	2,100	452.00	949,200
鈴木	1,000	625.00	625,000
日本トリム	300	4,450.00	1,335,000
ローランド ディー . ジー .	1,000	1,995.00	1,995,000
フォスター電機	2,100	1,857.00	3,899,700
S M K	500	2,754.00	1,377,000
ヨコオ	1,300	2,784.00	3,619,200
ホシデン	5,400	1,033.00	5,578,200
ヒロセ電機	2,600	13,370.00	34,762,000
日本航空電子工業	4,200	1,499.00	6,295,800
T O A	2,000	1,223.00	2,446,000
マクセルホールディングス	3,900	1,556.00	6,068,400
古野電気	2,400	942.00	2,260,800
ユニデンホールディングス	500	1,791.00	895,500
スミダコーポレーション	1,400	1,014.00	1,419,600
アイコム	1,000	2,164.00	2,164,000

リオン	800	2,202.00	1,761,600
本多通信工業	1,600	479.00	766,400
船井電機	2,000	549.00	1,098,000
横河電機	18,100	1,970.00	35,657,000
新電元工業	700	3,305.00	2,313,500
アズビル	11,400	2,835.00	32,319,000
東亜ディーケーケー	900	831.00	747,900
日本光電工業	8,000	2,937.00	23,496,000
チノー	600	1,361.00	816,600
共和電業	2,000	410.00	820,000
日本電子材料	900	511.00	459,900
堀場製作所	3,600	5,980.00	21,528,000
アドバンテスト	12,300	4,410.00	54,243,000
小野測器	900	492.00	442,800
エスベック	1,600	1,878.00	3,004,800
キーエンス	8,800	65,070.00	572,616,000
日置電機	900	3,320.00	2,988,000
シスメックス	14,100	6,844.00	96,500,400
日本マイクロニクス	3,200	860.00	2,752,000
メガチップス	1,500	1,617.00	2,425,500
OBARA GROUP	900	3,635.00	3,271,500
澤藤電機	200	1,698.00	339,600
原田工業	800	829.00	663,200
コーセル	2,400	1,081.00	2,594,400
イリソ電子工業	1,700	4,945.00	8,406,500
オプテックスグループ	3,000	1,557.00	4,671,000
千代田インテグレ	800	2,053.00	1,642,400
アイ・オー・データ機器	700	883.00	618,100
レーザーテック	3,700	6,310.00	23,347,000
スタンレー電気	12,700	2,722.00	34,569,400
岩崎電気	700	1,180.00	826,000
ウシオ電機	10,400	1,513.00	15,735,200
岡谷電機産業	1,500	374.00	561,000
ヘリオス テクノ ホールディング	1,700	549.00	933,300
エノモト	400	924.00	369,600
日本セラミック	1,800	2,740.00	4,932,000
遠藤照明	900	657.00	591,300
古河電池	1,300	585.00	760,500
双信電機	1,000	448.00	448,000
山一電機	1,300	1,195.00	1,553,500
図研	1,200	1,857.00	2,228,400
日本電子	3,600	2,417.00	8,701,200

カシオ計算機	16,000	1,579.00	25,264,000
ファナック	17,100	19,470.00	332,937,000
日本シイエムケイ	4,700	562.00	2,641,400
エンプラス	900	3,345.00	3,010,500
大真空	700	1,000.00	700,000
ローム	8,600	8,280.00	71,208,000
浜松ホトニクス	12,900	3,755.00	48,439,500
三井ハイテック	2,100	1,386.00	2,910,600
新光電気工業	6,200	889.00	5,511,800
京セラ	27,500	6,681.00	183,727,500
太陽誘電	8,100	2,260.00	18,306,000
村田製作所	56,800	4,867.00	276,445,600
双葉電子工業	2,900	1,318.00	3,822,200
北陸電気工業	800	993.00	794,400
ニチコン	5,800	925.00	5,365,000
日本ケミコン	1,300	1,469.00	1,909,700
K O A	2,800	1,312.00	3,673,600
市光工業	2,700	834.00	2,251,800
小糸製作所	10,800	5,150.00	55,620,000
ミツバ	3,600	579.00	2,084,400
S C R E E Nホールディングス	3,100	6,310.00	19,561,000
キャノン電子	1,900	1,812.00	3,442,800
キャノン	97,000	2,858.00	277,226,000
リコー	54,300	1,004.00	54,517,200
象印マホービン	5,300	1,369.00	7,255,700
M U T O Hホールディングス	300	1,614.00	484,200
東京エレクトロン	12,000	20,375.00	244,500,000
トヨタ紡織	6,400	1,497.00	9,580,800
芦森工業	400	1,357.00	542,800
ユニプレス	3,500	1,767.00	6,184,500
豊田自動織機	14,500	6,090.00	88,305,000
モリタホールディングス	3,100	1,680.00	5,208,000
三櫻工業	3,100	527.00	1,633,700
デンソー	39,700	4,659.00	184,962,300
東海理化電機製作所	4,800	1,796.00	8,620,800
三井E & Sホールディングス	6,900	892.00	6,154,800
川崎重工業	14,100	2,260.00	31,866,000
名村造船所	5,800	264.00	1,531,200
日本車輛製造	700	2,379.00	1,665,300
三菱ロジスネクスト	2,200	1,110.00	2,442,000
近畿車輛	400	1,284.00	513,600
日産自動車	212,700	697.50	148,358,250

いすゞ自動車	57,100	1,195.00	68,234,500
トヨタ自動車	200,700	7,183.00	1,441,628,100
日野自動車	22,700	908.00	20,611,600
三菱自動車工業	67,100	482.00	32,342,200
エフテック	1,500	706.00	1,059,000
レシップホールディングス	800	779.00	623,200
GMB	400	759.00	303,600
ファルテック	500	724.00	362,000
武蔵精密工業	4,400	1,318.00	5,799,200
日産車体	3,800	933.00	3,545,400
新明和工業	7,600	1,328.00	10,092,800
極東開発工業	3,600	1,229.00	4,424,400
日信工業	3,400	1,424.00	4,841,600
トピー工業	1,500	1,974.00	2,961,000
ティラド	700	1,799.00	1,259,300
タチエス	3,100	1,258.00	3,899,800
NOK	9,800	1,588.00	15,562,400
フタバ産業	5,200	732.00	3,806,400
KYB	1,900	3,025.00	5,747,500
大同メタル工業	3,100	638.00	1,977,800
プレス工業	9,000	473.00	4,257,000
ミクニ	2,400	314.00	753,600
太平洋工業	3,800	1,516.00	5,760,800
ケーヒン	4,200	1,597.00	6,707,400
河西工業	2,300	792.00	1,821,600
アイシン精機	14,900	3,455.00	51,479,500
マツダ	56,900	974.80	55,466,120
今仙電機製作所	1,700	866.00	1,472,200
本田技研工業	152,000	2,791.00	424,232,000
スズキ	33,000	4,221.00	139,293,000
SUBARU	56,000	3,014.00	168,784,000
安永	900	1,311.00	1,179,900
ヤマハ発動機	23,500	1,865.00	43,827,500
ショーワ	4,300	1,424.00	6,123,200
TBK	2,100	396.00	831,600
エクセディ	2,500	2,092.00	5,230,000
豊田合成	5,900	2,118.00	12,496,200
愛三工業	2,900	790.00	2,291,000
盟和産業	200	1,045.00	209,000
日本プラスト	1,500	691.00	1,036,500
ヨロズ	1,800	1,290.00	2,322,000
エフ・シー・シー	3,200	2,031.00	6,499,200

シマノ	6,800	15,730.00	106,964,000
テイ・エス テック	4,200	3,080.00	12,936,000
ジャムコ	900	1,482.00	1,333,800
テルモ	51,000	3,101.00	158,151,000
クリエートメディック	600	906.00	543,600
日機装	5,500	1,151.00	6,330,500
島津製作所	23,200	2,662.00	61,758,400
JMS	1,500	624.00	936,000
長野計器	1,400	703.00	984,200
ブイ・テクノロジー	800	5,420.00	4,336,000
東京計器	1,200	882.00	1,058,400
愛知時計電機	200	3,930.00	786,000
インターアクション	1,000	1,979.00	1,979,000
オーバル	2,000	225.00	450,000
東京精密	3,300	3,165.00	10,444,500
マニー	7,200	2,462.00	17,726,400
ニコン	31,500	1,382.00	43,533,000
トプコン	9,800	1,400.00	13,720,000
オリンパス	107,500	1,395.00	149,962,500
理研計器	1,500	1,945.00	2,917,500
タムロン	1,500	2,254.00	3,381,000
HOYA	36,300	8,962.00	325,320,600
シード	800	874.00	699,200
ノーリツ鋼機	1,400	1,897.00	2,655,800
エー・アンド・デイ	1,700	711.00	1,208,700
朝日インテック	15,300	2,430.00	37,179,000
シチズン時計	20,100	533.00	10,713,300
リズム時計工業	600	899.00	539,400
大研医器	1,500	527.00	790,500
メニコン	2,500	3,835.00	9,587,500
シンシア	200	637.00	127,400
松風	900	1,485.00	1,336,500
セイコーホールディングス	2,800	2,307.00	6,459,600
ニプロ	12,500	1,167.00	14,587,500
中本パックス	500	1,395.00	697,500
スノーピーク	800	1,289.00	1,031,200
パラマウントベッドホールディングス	2,100	4,050.00	8,505,000
トランザクション	1,200	1,039.00	1,246,800
SHO-BI	700	378.00	264,600
ニホンフラッシュ	800	2,365.00	1,892,000
前田工織	2,000	1,421.00	2,842,000
永大産業	2,300	323.00	742,900

アートネイチャー	2,000	645.00	1,290,000
バンダイナムコホールディングス	18,600	6,190.00	115,134,000
アイフィスジャパン	500	712.00	356,000
共立印刷	3,700	148.00	547,600
SHOEI	900	4,480.00	4,032,000
フランスベッドホールディングス	2,600	1,011.00	2,628,600
パイロットコーポレーション	3,100	3,730.00	11,563,000
萩原工業	1,000	1,447.00	1,447,000
トッパン・フォームズ	4,000	928.00	3,712,000
フジシールインターナショナル	4,000	2,773.00	11,092,000
タカラトミー	7,600	1,133.00	8,610,800
廣済堂	1,700	699.00	1,188,300
エステールホールディングス	500	620.00	310,000
アーク	7,800	91.00	709,800
タカノ	600	751.00	450,600
プロネクサス	1,500	1,062.00	1,593,000
ホクシン	1,900	144.00	273,600
ウッドワン	500	1,024.00	512,000
大建工業	1,300	1,877.00	2,440,100
凸版印刷	26,800	1,821.00	48,802,800
大日本印刷	25,400	2,435.00	61,849,000
共同印刷	500	2,647.00	1,323,500
NISSHA	3,800	981.00	3,727,800
光村印刷	100	1,690.00	169,000
宝印刷	800	1,622.00	1,297,600
アシックス	15,000	1,521.00	22,815,000
ツツミ	600	2,014.00	1,208,400
小松ウオール工業	500	1,884.00	942,000
ヤマハ	10,700	4,645.00	49,701,500
河合楽器製作所	600	2,873.00	1,723,800
クリナップ	1,800	572.00	1,029,600
ビジョン	10,900	4,220.00	45,998,000
兼松サステック	100	1,770.00	177,000
キングジム	1,600	855.00	1,368,000
リンテック	4,300	2,117.00	9,103,100
イトーキ	4,000	417.00	1,668,000
任天堂	10,300	41,660.00	429,098,000
三菱鉛筆	3,000	1,703.00	5,109,000
タカラスタンダード	3,700	1,668.00	6,171,600
コクヨ	8,600	1,440.00	12,384,000
ナカバヤシ	1,700	513.00	872,100
グローブライド	900	2,852.00	2,566,800

オカムラ	6,300	1,088.00	6,854,400
美津濃	1,800	2,642.00	4,755,600
東京電力ホールディングス	144,000	511.00	73,584,000
中部電力	55,000	1,507.00	82,885,000
関西電力	73,400	1,278.50	93,841,900
中国電力	25,000	1,352.00	33,800,000
北陸電力	18,200	672.00	12,230,400
東北電力	42,200	1,041.00	43,930,200
四国電力	16,400	1,013.00	16,613,200
九州電力	37,300	1,015.00	37,859,500
北海道電力	17,200	569.00	9,786,800
沖縄電力	3,300	1,636.00	5,398,800
電源開発	14,300	2,429.00	34,734,700
エフオン	900	720.00	648,000
イーレックス	3,100	1,069.00	3,313,900
レノバ	3,000	839.00	2,517,000
東京瓦斯	35,400	2,581.00	91,367,400
大阪瓦斯	35,000	1,885.00	65,975,000
東邦瓦斯	8,900	3,885.00	34,576,500
北海道瓦斯	900	1,496.00	1,346,400
広島ガス	3,500	330.00	1,155,000
西部瓦斯	2,000	2,253.00	4,506,000
静岡ガス	5,100	849.00	4,329,900
メタウォーター	900	3,565.00	3,208,500
SBSホールディングス	1,600	1,501.00	2,401,600
東武鉄道	19,000	3,345.00	63,555,000
相鉄ホールディングス	6,200	2,810.00	17,422,000
東急	49,000	1,899.00	93,051,000
京浜急行電鉄	24,800	1,921.00	47,640,800
小田急電鉄	29,000	2,402.00	69,658,000
京王電鉄	10,100	6,370.00	64,337,000
京成電鉄	13,500	4,125.00	55,687,500
富士急行	2,500	4,385.00	10,962,500
新京成電鉄	400	2,022.00	808,800
東日本旅客鉄道	32,000	9,989.00	319,648,000
西日本旅客鉄道	16,100	9,049.00	145,688,900
東海旅客鉄道	16,100	20,785.00	334,638,500
西武ホールディングス	22,400	1,819.00	40,745,600
鴻池運輸	2,900	1,656.00	4,802,400
西日本鉄道	5,100	2,400.00	12,240,000
ハマキョウレックス	1,400	3,590.00	5,026,000
サカイ引越センター	900	6,040.00	5,436,000

近鉄グループホールディングス	17,100	5,270.00	90,117,000
阪急阪神ホールディングス	22,700	4,085.00	92,729,500
南海電気鉄道	7,700	2,711.00	20,874,700
京阪ホールディングス	7,600	4,495.00	34,162,000
神戸電鉄	500	3,985.00	1,992,500
名古屋鉄道	14,100	3,180.00	44,838,000
山陽電気鉄道	1,400	2,126.00	2,976,400
日本通運	6,600	5,660.00	37,356,000
ヤマトホールディングス	30,100	1,864.00	56,106,400
山九	4,700	5,320.00	25,004,000
丸運	1,100	261.00	287,100
丸全昭和運輸	1,400	3,050.00	4,270,000
センコーグループホールディングス	9,500	839.00	7,970,500
トナミホールディングス	400	4,605.00	1,842,000
ニッコンホールディングス	6,400	2,423.00	15,507,200
日本石油輸送	200	2,870.00	574,000
福山通運	2,200	3,735.00	8,217,000
セイノーホールディングス	12,900	1,381.00	17,814,900
エスライン	500	811.00	405,500
神奈川中央交通	400	3,825.00	1,530,000
日立物流	3,800	3,235.00	12,293,000
丸和運輸機関	900	5,090.00	4,581,000
C & F ロジホールディングス	1,700	1,193.00	2,028,100
九州旅客鉄道	14,300	3,225.00	46,117,500
S Gホールディングス	16,100	2,821.00	45,418,100
日本郵船	14,600	1,771.00	25,856,600
商船三井	10,100	2,808.00	28,360,800
川崎汽船	5,600	1,285.00	7,196,000
N S ユナイテッド海運	900	2,329.00	2,096,100
飯野海運	8,000	338.00	2,704,000
共栄タンカー	100	1,340.00	134,000
乾汽船	1,500	951.00	1,426,500
日本航空	31,200	3,408.00	106,329,600
A N Aホールディングス	31,200	3,640.00	113,568,000
パスコ	500	893.00	446,500
トランコム	500	5,840.00	2,920,000
日新	1,500	1,469.00	2,203,500
三菱倉庫	6,000	2,673.00	16,038,000
三井倉庫ホールディングス	2,300	1,632.00	3,753,600
住友倉庫	6,200	1,417.00	8,785,400
澁澤倉庫	900	1,897.00	1,707,300
東陽倉庫	2,900	305.00	884,500

日本トランスシティ	3,700	450.00	1,665,000
ケイヒン	300	1,210.00	363,000
中央倉庫	900	1,027.00	924,300
川西倉庫	300	1,049.00	314,700
安田倉庫	1,400	915.00	1,281,000
ファイズ	300	758.00	227,400
東洋埠頭	500	1,318.00	659,000
宇徳	1,500	501.00	751,500
上組	10,600	2,470.00	26,182,000
サンリツ	200	647.00	129,400
キムラユニティー	400	1,014.00	405,600
キューソー流通システム	500	1,788.00	894,000
近鉄エクスプレス	3,300	1,487.00	4,907,100
東海運	1,400	282.00	394,800
エーアイテイー	1,100	915.00	1,006,500
内外トランスライン	600	1,232.00	739,200
日本コンセプト	500	1,346.00	673,000
NECネットエスアイ	2,000	2,803.00	5,606,000
クロスキャット	500	997.00	498,500
システナ	6,300	1,492.00	9,399,600
デジタルアーツ	900	7,260.00	6,534,000
日鉄ソリューションズ	2,700	3,565.00	9,625,500
キューブシステム	1,100	770.00	847,000
エイジア	400	1,211.00	484,400
コア	800	1,323.00	1,058,400
ソリトンシステムズ	800	1,025.00	820,000
ソフトクリエイトホールディングス	800	1,704.00	1,363,200
T I S	5,900	6,240.00	36,816,000
ネオス	700	749.00	524,300
電算システム	700	2,920.00	2,044,000
グリー	12,400	475.00	5,890,000
コーエーテクモホールディングス	3,600	2,226.00	8,013,600
三菱総合研究所	800	3,480.00	2,784,000
ボルテージ	400	500.00	200,000
電算	200	2,021.00	404,200
A G S	1,000	663.00	663,000
ファインデックス	1,500	998.00	1,497,000
ブレインパッド	300	6,760.00	2,028,000
K L a b	3,400	1,244.00	4,229,600
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,400	997.00	2,392,800
イーブックイニシアティブジャパン	300	1,763.00	528,900
ネクソン	50,200	1,401.00	70,330,200

アイスタイル	4,600	715.00	3,289,000
エムアップ	600	1,902.00	1,141,200
エイチーム	1,200	1,120.00	1,344,000
エニグモ	1,300	1,200.00	1,560,000
テクノスジャパン	1,500	505.00	757,500
コロプラ	5,800	684.00	3,967,200
ブロードリーフ	8,900	557.00	4,957,300
クロス・マーケティンググループ	1,000	328.00	328,000
デジタルハーツホールディングス	900	931.00	837,900
システム情報	900	1,023.00	920,700
メディアドゥホールディングス	600	3,580.00	2,148,000
じげん	2,600	575.00	1,495,000
ブイキューブ	1,200	424.00	508,800
エンカレッジ・テクノロジー	300	739.00	221,700
サイバーリンクス	300	1,056.00	316,800
フィックスターズ	1,900	1,538.00	2,922,200
CARTA HOLDINGS	900	989.00	890,100
オプティム	800	2,781.00	2,224,800
セレス	600	1,274.00	764,400
ティーガイア	1,300	2,176.00	2,828,800
セック	300	3,065.00	919,500
豆蔵ホールディングス	1,200	1,628.00	1,953,600
テクマトリックス	1,300	2,277.00	2,960,100
プロシップ	500	1,137.00	568,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,300	2,310.00	9,933,000
GMOペイメントゲートウェイ	2,900	7,820.00	22,678,000
ザッパラス	1,400	342.00	478,800
システムリサーチ	200	3,915.00	783,000
インターネットイニシアティブ	2,900	2,433.00	7,055,700
さくらインターネット	2,100	605.00	1,270,500
ヴィンクス	500	1,244.00	622,000
GMOクラウド	300	2,568.00	770,400
SRAホールディングス	900	2,537.00	2,283,300
Minorisソリューションズ	300	1,829.00	548,700
システムインテグレータ	600	653.00	391,800
朝日ネット	1,600	677.00	1,083,200
eBASE	1,100	1,006.00	1,106,600
アバント	600	1,924.00	1,154,400
アドソル日進	600	2,078.00	1,246,800
フリービット	1,100	1,132.00	1,245,200
コムチュア	1,000	3,825.00	3,825,000
サイバーコム	300	1,654.00	496,200

アステリア	1,200	612.00	734,400
マークライズ	900	1,814.00	1,632,600
メディカル・データ・ビジョン	1,300	1,059.00	1,376,700
gumi	2,400	649.00	1,557,600
ショーケース	500	708.00	354,000
モバイルファクトリー	400	1,610.00	644,000
テラスカイ	300	1,839.00	551,700
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	800	1,542.00	1,233,600
P C Iホールディングス	400	2,056.00	822,400
パイブドHD	300	1,258.00	377,400
アイビーシー	300	1,047.00	314,100
ネオジャパン	300	1,021.00	306,300
P R T I M E S	200	2,884.00	576,800
ランドコンピュータ	300	1,017.00	305,100
ダブルスタンダード	200	4,420.00	884,000
オーブンドア	900	2,166.00	1,949,400
マイネット	600	483.00	289,800
アカツキ	600	7,100.00	4,260,000
ベネフィットジャパン	200	1,484.00	296,800
U b i c o mホールディングス	300	1,564.00	469,200
L I N E	4,100	4,075.00	16,707,500
カナミックネットワーク	1,200	550.00	660,000
ノムラシステムコーポレーション	400	469.00	187,600
チェンジ	400	2,114.00	845,600
シンクロ・フード	800	490.00	392,000
オークネット	1,100	1,258.00	1,383,800
セグエグループ	200	1,348.00	269,600
エイトレッド	200	1,670.00	334,000
A O I T Y O H o l d i n g s	1,800	634.00	1,141,200
マクロミル	3,200	948.00	3,033,600
ビーグリー	400	900.00	360,000
オロ	500	2,669.00	1,334,500
テモナ	300	642.00	192,600
ニーズウェル	200	707.00	141,400
サインポスト	300	2,274.00	682,200
ソルクシーズ	800	902.00	721,600
フェイス	800	741.00	592,800
プロトコーポレーション	1,600	1,219.00	1,950,400
ハイマックス	200	1,820.00	364,000
野村総合研究所	33,800	2,166.00	73,210,800
サイバネットシステム	1,300	610.00	793,000
C E ホールディングス	600	1,012.00	607,200

日本システム技術	300	1,220.00	366,000
インテージホールディングス	2,300	915.00	2,104,500
東邦システムサイエンス	500	977.00	488,500
ソースネクスト	6,900	461.00	3,180,900
インフォコム	1,900	2,434.00	4,624,600
F I G	2,000	300.00	600,000
アルテリア・ネットワークス	2,000	1,391.00	2,782,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,707.00	682,800
フォーカスシステムズ	1,200	833.00	999,600
クレスコ	500	3,375.00	1,687,500
フジ・メディア・ホールディングス	18,400	1,428.00	26,275,200
オービック	6,100	11,850.00	72,285,000
ジャストシステム	2,500	3,555.00	8,887,500
T D C ソフト	1,500	724.00	1,086,000
ヤフー	116,000	289.00	33,524,000
トレンドマイクロ	7,900	5,060.00	39,974,000
I D ホールディングス	700	1,202.00	841,400
日本オラクル	3,600	9,060.00	32,616,000
アルファシステムズ	600	2,711.00	1,626,600
フューチャー	2,100	1,738.00	3,649,800
C A C H o l d i n g s	1,200	1,331.00	1,597,200
ソフトバンク・テクノロジー	800	2,020.00	1,616,000
トーセ	500	812.00	406,000
オービックビジネスコンサルタント	1,800	4,240.00	7,632,000
伊藤忠テクノソリューションズ	8,100	2,860.00	23,166,000
アイティフォー	2,200	842.00	1,852,400
東計電算	200	3,005.00	601,000
エクスネット	400	979.00	391,600
大塚商会	9,600	3,945.00	37,872,000
サイボウズ	2,100	984.00	2,066,400
ソフトブレーン	1,100	580.00	638,000
電通国際情報サービス	1,100	3,370.00	3,707,000
デジタルガレージ	3,500	3,505.00	12,267,500
E M システムズ	1,500	1,907.00	2,860,500
ウェザーニューズ	600	3,190.00	1,914,000
C I J	1,400	821.00	1,149,400
東洋ビジネスエンジニアリング	200	2,639.00	527,800
日本エンタープライズ	2,300	170.00	391,000
WOWOW	900	2,558.00	2,302,200
スカラ	1,300	991.00	1,288,300
インテリジェント ウェイブ	700	791.00	553,700
I M A G I C A G R O U P	1,600	468.00	748,800

ネットワークシステムズ	6,300	2,749.00	17,318,700
システムソフト	4,700	107.00	502,900
アルゴグラフィックス	1,500	2,572.00	3,858,000
マーベラス	2,800	806.00	2,256,800
エイベックス	3,100	1,263.00	3,915,300
日本ユニシス	5,500	3,225.00	17,737,500
兼松エレクトロニクス	900	2,996.00	2,696,400
東京放送ホールディングス	11,800	1,727.00	20,378,600
日本テレビホールディングス	16,300	1,395.00	22,738,500
朝日放送グループホールディングス	1,800	706.00	1,270,800
テレビ朝日ホールディングス	4,900	1,717.00	8,413,300
スカパーJ S A Tホールディングス	11,900	432.00	5,140,800
テレビ東京ホールディングス	1,500	2,139.00	3,208,500
日本BS放送	700	1,052.00	736,400
ビジョン	600	4,915.00	2,949,000
スマートバリュー	600	725.00	435,000
USEN-NEXT HOLDINGS	700	835.00	584,500
コネクシオ	1,300	1,380.00	1,794,000
クロップス	400	603.00	241,200
日本電信電話	120,900	5,126.00	619,733,400
KDDI	145,000	2,796.00	405,420,000
ソフトバンク	187,600	1,502.50	281,869,000
光通信	2,100	24,110.00	50,631,000
NTTドコモ	111,900	2,751.00	307,836,900
エムティーアイ	1,800	675.00	1,215,000
GMOインターネット	7,100	1,842.00	13,078,200
ファイバーゲート	400	1,627.00	650,800
アйдママーケティングコミュニケーション	500	537.00	268,500
KADOKAWA	5,200	1,510.00	7,852,000
学研ホールディングス	600	5,280.00	3,168,000
ゼンリン	3,600	1,835.00	6,606,000
昭文社	1,300	364.00	473,200
インプレスホールディングス	1,800	141.00	253,800
アイネット	1,000	1,360.00	1,360,000
松竹	1,200	12,530.00	15,036,000
東宝	11,700	4,415.00	51,655,500
東映	700	15,000.00	10,500,000
エヌ・ティ・ティ・データ	47,200	1,374.00	64,852,800
ピー・シー・エー	200	3,730.00	746,000
ビジネスブレイン太田昭和	300	2,508.00	752,400
D T S	4,000	2,209.00	8,836,000

スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,300	4,125.00	34,237,500
シーイーシー	1,900	2,232.00	4,240,800
カプコン	7,600	2,709.00	20,588,400
アイ・エス・ビー	400	1,516.00	606,400
ジャステック	1,200	1,066.00	1,279,200
S C S K	4,700	5,130.00	24,111,000
日本システムウエア	600	2,411.00	1,446,600
アイネス	2,300	1,075.00	2,472,500
T K C	1,500	4,450.00	6,675,000
富士ソフト	2,300	4,510.00	10,373,000
N S D	2,900	3,070.00	8,903,000
コナミホールディングス	7,200	4,880.00	35,136,000
福井コンピュータホールディングス	600	2,144.00	1,286,400
J B C C ホールディングス	1,400	1,551.00	2,171,400
ミロク情報サービス	1,700	2,782.00	4,729,400
ソフトバンクグループ	140,400	4,711.00	661,424,400
ハウスイ	500	797.00	398,500
高千穂交易	700	1,070.00	749,000
伊藤忠食品	500	4,155.00	2,077,500
エレマテック	1,700	987.00	1,677,900
J A L U X	500	2,304.00	1,152,000
あらた	1,300	3,745.00	4,868,500
トーメンデバイス	300	2,336.00	700,800
東京エレクトロン デバイス	700	2,053.00	1,437,100
フィールズ	1,800	493.00	887,400
双日	98,000	343.00	33,614,000
アルフレッサ ホールディングス	19,700	2,432.00	47,910,400
横浜冷凍	5,000	1,034.00	5,170,000
ラサ商事	800	812.00	649,600
ラクーンホールディングス	900	618.00	556,200
アルコニックス	1,900	1,216.00	2,310,400
神戸物産	3,100	5,020.00	15,562,000
あい ホールディングス	2,600	1,746.00	4,539,600
ディービーエックス	800	782.00	625,600
ダイワボウホールディングス	1,600	4,225.00	6,760,000
マクニカ・富士エレホールディングス	4,900	1,450.00	7,105,000
ラクト・ジャパン	700	3,545.00	2,481,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,400	1,035.00	3,519,000
八洲電機	1,400	886.00	1,240,400
メディアスホールディングス	1,100	661.00	727,100
レスターホールディングス	2,000	1,759.00	3,518,000
ジュテックホールディングス	400	940.00	376,000

大光	800	650.00	520,000
OCHIホールディングス	500	1,152.00	576,000
TOKAIホールディングス	9,300	1,012.00	9,411,600
黒谷	500	422.00	211,000
Cominix	300	783.00	234,900
三洋貿易	900	2,198.00	1,978,200
ビューティガレージ	300	1,849.00	554,700
ウイン・パートナーズ	1,100	1,065.00	1,171,500
ミタチ産業	600	665.00	399,000
シップヘルスケアホールディングス	3,700	4,655.00	17,223,500
明治電機工業	500	1,348.00	674,000
デリカフーズホールディングス	600	719.00	431,400
スターティアホールディングス	400	519.00	207,600
コメダホールディングス	4,100	1,954.00	8,011,400
富士興産	800	719.00	575,200
協栄産業	200	1,316.00	263,200
小野建	1,600	1,330.00	2,128,000
南陽	300	1,562.00	468,600
佐鳥電機	1,400	784.00	1,097,600
エコートレーディング	800	518.00	414,400
伯東	1,200	1,156.00	1,387,200
コンドーテック	1,300	892.00	1,159,600
中山福	1,100	510.00	561,000
ナガイレーベン	2,500	2,170.00	5,425,000
三菱食品	2,000	2,607.00	5,214,000
松田産業	1,300	1,433.00	1,862,900
第一興商	2,600	4,785.00	12,441,000
メディパルホールディングス	19,200	2,350.00	45,120,000
SPK	300	2,424.00	727,200
萩原電気ホールディングス	600	2,726.00	1,635,600
アズワン	1,300	8,800.00	11,440,000
スズデン	600	1,348.00	808,800
尾家産業	700	1,151.00	805,700
シモジマ	1,100	1,089.00	1,197,900
ドウシシャ	1,700	1,763.00	2,997,100
小津産業	500	1,770.00	885,000
高速	1,000	1,241.00	1,241,000
たけびし	600	1,296.00	777,600
リックス	300	1,504.00	451,200
丸文	1,700	568.00	965,600
ハピネット	1,600	1,274.00	2,038,400
橋本総業ホールディングス	400	1,510.00	604,000

日本ライフライン	5,200	1,720.00	8,944,000
タカショー	1,200	456.00	547,200
エクセル	700	1,110.00	777,000
マルカ	600	1,976.00	1,185,600
I D O M	6,300	423.00	2,664,900
日本エム・ディ・エム	1,000	1,722.00	1,722,000
進和	1,000	2,117.00	2,117,000
エスケイジャパン	500	415.00	207,500
ダイترون	700	1,249.00	874,300
シークス	2,300	1,451.00	3,337,300
田中商事	500	626.00	313,000
オーハシテクニカ	1,000	1,397.00	1,397,000
白銅	500	1,303.00	651,500
伊藤忠商事	124,100	2,232.50	277,053,250
丸紅	175,000	725.40	126,945,000
高島	300	1,574.00	472,200
長瀬産業	10,000	1,507.00	15,070,000
蝶理	1,100	1,722.00	1,894,200
豊田通商	19,800	3,585.00	70,983,000
三共生興	2,900	495.00	1,435,500
兼松	7,100	1,235.00	8,768,500
ツカモトコーポレーション	300	1,020.00	306,000
三井物産	146,000	1,788.00	261,048,000
日本紙パルプ商事	1,000	3,835.00	3,835,000
日立ハイテクノロジーズ	5,400	5,910.00	31,914,000
カメイ	2,300	1,075.00	2,472,500
東都水産	300	2,566.00	769,800
O U Gホールディングス	300	2,637.00	791,100
スターゼン	700	4,090.00	2,863,000
山善	7,000	949.00	6,643,000
椿本興業	400	3,390.00	1,356,000
住友商事	104,700	1,711.00	179,141,700
内田洋行	800	3,685.00	2,948,000
三菱商事	124,400	2,757.00	342,970,800
第一実業	800	2,876.00	2,300,800
キャノンマーケティングジャパン	5,100	2,174.00	11,087,400
西華産業	1,100	1,291.00	1,420,100
佐藤商事	1,500	819.00	1,228,500
菱洋エレクトロ	1,800	1,808.00	3,254,400
東京産業	2,000	478.00	956,000
ユアサ商事	1,800	3,120.00	5,616,000
神鋼商事	400	2,280.00	912,000

小林産業	1,200	272.00	326,400
阪和興業	3,100	3,020.00	9,362,000
正栄食品工業	1,100	3,145.00	3,459,500
カナデン	1,500	1,279.00	1,918,500
菱電商事	1,400	1,613.00	2,258,200
フルサト工業	900	1,416.00	1,274,400
岩谷産業	4,000	3,570.00	14,280,000
昭光通商	1,100	618.00	679,800
極東貿易	500	1,743.00	871,500
イワキ	2,400	487.00	1,168,800
三愛石油	4,900	1,026.00	5,027,400
稲畑産業	4,300	1,317.00	5,663,100
G S Iクレオス	500	1,035.00	517,500
明和産業	1,800	595.00	1,071,000
クワザワ	1,000	412.00	412,000
ワキタ	3,800	1,068.00	4,058,400
東邦ホールディングス	5,300	2,493.00	13,212,900
サンゲツ	5,200	2,029.00	10,550,800
ミツウロコグループホールディングス	2,300	937.00	2,155,100
シナネンホールディングス	800	1,708.00	1,366,400
伊藤忠エネクス	4,100	845.00	3,464,500
サンリオ	5,500	2,047.00	11,258,500
サンワテクノス	1,200	794.00	952,800
リョーサン	2,000	2,702.00	5,404,000
新光商事	1,700	1,864.00	3,168,800
トーホー	1,000	1,688.00	1,688,000
三信電気	1,200	1,494.00	1,792,800
東陽テクニカ	2,100	1,067.00	2,240,700
モスフードサービス	2,400	2,423.00	5,815,200
加賀電子	1,800	1,754.00	3,157,200
ソーダニッカ	2,000	525.00	1,050,000
立花エレテック	1,300	1,570.00	2,041,000
フォーバル	800	944.00	755,200
P A L T A C	3,200	5,060.00	16,192,000
三谷産業	2,200	289.00	635,800
太平洋興発	700	759.00	531,300
西本Wismettacホールディングス	300	3,250.00	975,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	300	1,253.00	375,900
国際紙パルプ商事	4,200	306.00	1,285,200
ヤマタネ	900	1,322.00	1,189,800
丸紅建材リース	100	1,686.00	168,600
日鉄物産	1,300	4,260.00	5,538,000

泉州電業	500	2,572.00	1,286,000
トラスコ中山	3,700	2,453.00	9,076,100
オートバックスセブン	7,100	1,798.00	12,765,800
モリト	1,200	761.00	913,200
加藤産業	2,800	3,185.00	8,918,000
北恵	500	929.00	464,500
イノテック	1,000	880.00	880,000
イエローハット	3,300	1,544.00	5,095,200
J Kホールディングス	1,700	524.00	890,800
日伝	1,400	1,957.00	2,739,800
北沢産業	1,800	262.00	471,600
杉本商事	800	2,056.00	1,644,800
因幡電機産業	2,500	4,700.00	11,750,000
東テク	600	2,004.00	1,202,400
ミスミグループ本社	22,300	2,490.00	55,527,000
アルテック	1,700	203.00	345,100
タキヒヨー	600	1,741.00	1,044,600
蔵王産業	200	1,374.00	274,800
スズケン	8,100	5,700.00	46,170,000
ジェコス	1,200	859.00	1,030,800
グローセル	2,000	406.00	812,000
ローソン	4,500	5,560.00	25,020,000
サンエー	1,300	4,610.00	5,993,000
カワチ薬品	1,400	2,012.00	2,816,800
エービーシー・マート	2,800	6,890.00	19,292,000
ハードオフコーポレーション	600	716.00	429,600
アスクル	1,900	2,932.00	5,570,800
ゲオホールディングス	2,700	1,345.00	3,631,500
アダストリア	2,500	2,311.00	5,777,500
ジーフット	1,200	618.00	741,600
シー・ヴィ・エス・バイエリア	300	676.00	202,800
くら寿司	900	4,455.00	4,009,500
キャンドゥ	900	1,625.00	1,462,500
パルグループホールディングス	900	3,295.00	2,965,500
エディオン	7,500	1,050.00	7,875,000
サーラコーポレーション	3,600	604.00	2,174,400
ワッツ	900	624.00	561,600
ハローズ	700	2,100.00	1,470,000
フジオフードシステム	700	2,712.00	1,898,400
あみやき亭	400	3,390.00	1,356,000
ひらまつ	3,600	338.00	1,216,800
大黒天物産	400	3,250.00	1,300,000

ハニーズホールディングス	1,600	1,468.00	2,348,800
ファーマライズホールディングス	500	557.00	278,500
アルペン	1,400	1,645.00	2,303,000
ハブ	600	1,167.00	700,200
クオールホールディングス	2,600	1,442.00	3,749,200
ジンスホールディングス	900	6,340.00	5,706,000
ビックカメラ	10,600	1,072.00	11,363,200
DCMホールディングス	9,500	1,040.00	9,880,000
ベッパーフードサービス	1,400	1,584.00	2,217,600
MonotaRO	12,600	2,584.00	32,558,400
東京一番フーズ	400	611.00	244,400
DDホールディングス	800	1,449.00	1,159,200
きちりホールディングス	500	735.00	367,500
アークランドサービスホールディングス	1,300	1,930.00	2,509,000
J.フロント リテイリング	22,700	1,288.00	29,237,600
ドトール・日レスホールディングス	3,100	2,046.00	6,342,600
マツモトキヨシホールディングス	7,300	3,935.00	28,725,500
ブロンコビリー	900	2,304.00	2,073,600
ZOZO	19,200	2,112.00	40,550,400
トレジャー・ファクトリー	500	1,230.00	615,000
物語コーポレーション	400	9,650.00	3,860,000
ココカラファイン	2,000	5,920.00	11,840,000
三越伊勢丹ホールディングス	33,400	851.00	28,423,400
Hamee	500	725.00	362,500
ウエルシアホールディングス	4,700	5,460.00	25,662,000
クリエイトSDホールディングス	2,600	2,408.00	6,260,800
丸善CHIホールディングス	2,200	380.00	836,000
ミサワ	500	447.00	223,500
ティーライフ	300	834.00	250,200
チムニー	500	2,440.00	1,220,000
シュッピン	1,200	885.00	1,062,000
ネクステージ	2,500	1,104.00	2,760,000
ジョイフル本田	5,200	1,327.00	6,900,400
鳥貴族	600	2,120.00	1,272,000
麒麟堂ホールディングス	700	1,944.00	1,360,800
ホットランド	1,100	1,152.00	1,267,200
すかいらーくホールディングス	19,900	1,876.00	37,332,400
SFPホールディングス	800	2,057.00	1,645,600
綿半ホールディングス	700	2,150.00	1,505,000
ヨシックス	300	3,160.00	948,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,300	960.00	5,088,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	900	696.00	626,400

B E E N O S	600	1,249.00	749,400
あさひ	1,500	1,231.00	1,846,500
日本調剤	600	3,720.00	2,232,000
コスモス薬品	800	21,510.00	17,208,000
トーエル	800	689.00	551,200
オンリー	300	775.00	232,500
セブン&アイ・ホールディングス	74,400	3,986.00	296,558,400
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4,800	1,620.00	7,776,000
ツルハホールディングス	3,900	11,360.00	44,304,000
サンマルクホールディングス	1,400	2,446.00	3,424,400
フェリシモ	400	990.00	396,000
トリドールホールディングス	2,200	2,508.00	5,517,600
T O K Y O B A S E	1,600	875.00	1,400,000
ウイルプラスホールディングス	300	772.00	231,600
ジャパンミート	900	2,102.00	1,891,800
サツドラホールディングス	300	1,725.00	517,500
デファクトスタンダード	400	307.00	122,800
アレンザホールディングス	1,000	792.00	792,000
串カツ田中ホールディングス	300	2,087.00	626,100
パロックジャパンリミテッド	1,500	989.00	1,483,500
クスリのアオキホールディングス	1,800	8,200.00	14,760,000
力の源ホールディングス	700	867.00	606,900
スシローグローバルホールディングス	1,900	6,810.00	12,939,000
L I X I L ビバ	1,500	1,519.00	2,278,500
メディカルシステムネットワーク	2,000	510.00	1,020,000
はるやまホールディングス	700	797.00	557,900
ノジマ	3,100	1,787.00	5,539,700
カップ・クリエイト	2,600	1,408.00	3,660,800
ライトオン	1,400	659.00	922,600
ジーンズメイト	600	317.00	190,200
良品計画	25,000	1,989.00	49,725,000
三城ホールディングス	2,300	308.00	708,400
アドヴァン	2,600	1,145.00	2,977,000
アルビス	700	2,405.00	1,683,500
コナカ	1,900	435.00	826,500
ハウス オブ ローゼ	200	1,589.00	317,800
G - 7ホールディングス	500	3,190.00	1,595,000
イオン北海道	1,900	731.00	1,388,900
コジマ	3,200	461.00	1,475,200
ヒマラヤ	700	795.00	556,500
コーナン商事	2,300	2,403.00	5,526,900
エコス	700	1,588.00	1,111,600

ワタミ	2,400	1,454.00	3,489,600
マルシェ	700	779.00	545,300
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	42,400	1,689.00	71,613,600
西松屋チェーン	4,000	915.00	3,660,000
ゼンショーホールディングス	8,600	2,396.00	20,605,600
幸楽苑ホールディングス	1,100	2,432.00	2,675,200
ハークスレイ	200	1,022.00	204,400
サイゼリヤ	2,900	2,627.00	7,618,300
V Tホールディングス	8,100	455.00	3,685,500
魚力	500	1,540.00	770,000
フジ・コーポレーション	500	2,137.00	1,068,500
ユナイテッドアローズ	2,000	3,200.00	6,400,000
ハイデイ日高	2,500	2,078.00	5,195,000
京都きもの友禅	1,800	343.00	617,400
コロワイド	5,900	2,123.00	12,525,700
ピーシーデポコーポレーション	2,400	507.00	1,216,800
壱番屋	1,200	5,040.00	6,048,000
P L A N T	500	719.00	359,500
スギホールディングス	3,900	5,620.00	21,918,000
薬王堂ホールディングス	800	2,500.00	2,000,000
スクロール	2,900	332.00	962,800
ヨンドシーホールディングス	2,000	2,641.00	5,282,000
ファミリーマート	19,900	2,637.00	52,476,300
木曽路	2,200	2,637.00	5,801,400
S R Sホールディングス	2,200	1,038.00	2,283,600
千趣会	4,000	299.00	1,196,000
タカキュー	2,100	175.00	367,500
ケーヨー	3,400	476.00	1,618,400
上新電機	2,100	1,985.00	4,168,500
日本瓦斯	2,800	3,045.00	8,526,000
ロイヤルホールディングス	3,100	2,585.00	8,013,500
東天紅	100	1,236.00	123,600
いなげや	2,000	1,572.00	3,144,000
島忠	3,700	2,583.00	9,557,100
チヨダ	1,800	1,574.00	2,833,200
ライフコーポレーション	1,400	2,126.00	2,976,400
リンガーハット	2,200	2,499.00	5,497,800
M r M a x H D	2,400	441.00	1,058,400
テンアライド	2,000	444.00	888,000
A O K Iホールディングス	3,500	1,081.00	3,783,500
オークワ	2,500	1,147.00	2,867,500
コメリ	2,800	2,222.00	6,221,600

青山商事	3,100	1,931.00	5,986,100
しまむら	2,100	8,250.00	17,325,000
はせがわ	1,100	405.00	445,500
高島屋	14,100	1,239.00	17,469,900
松屋	3,700	800.00	2,960,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	9,200	1,187.00	10,920,400
近鉄百貨店	700	3,010.00	2,107,000
パルコ	1,700	1,269.00	2,157,300
丸井グループ	15,000	2,193.00	32,895,000
アクシアル リテイリング	1,400	3,910.00	5,474,000
イオン	68,400	1,953.00	133,585,200
イズミ	3,600	4,135.00	14,886,000
平和堂	3,600	2,031.00	7,311,600
フジ	2,200	1,842.00	4,052,400
ヤオコー	2,000	4,755.00	9,510,000
ゼビオホールディングス	2,200	1,160.00	2,552,000
ケーズホールディングス	18,400	1,156.00	21,270,400
Olympicグループ	1,300	610.00	793,000
日産東京販売ホールディングス	2,600	282.00	733,200
Genky DrugStores	900	2,154.00	1,938,600
総合メディカルホールディングス	1,600	1,542.00	2,467,200
ブックオフグループホールディングス	900	1,174.00	1,056,600
アインホールディングス	2,400	5,940.00	14,256,000
元気寿司	500	2,825.00	1,412,500
ヤマダ電機	54,200	498.00	26,991,600
アークランドサカモト	2,900	1,277.00	3,703,300
ニトリホールディングス	7,700	15,145.00	116,616,500
グルメ杵屋	1,300	1,180.00	1,534,000
愛眼	1,500	242.00	363,000
ケーユーホールディングス	700	800.00	560,000
吉野家ホールディングス	6,200	2,255.00	13,981,000
松屋フーズホールディングス	800	3,870.00	3,096,000
サガミホールディングス	2,400	1,357.00	3,256,800
関西スーパーマーケット	1,300	1,101.00	1,431,300
王将フードサービス	1,300	7,040.00	9,152,000
ブレナス	2,000	1,744.00	3,488,000
ミニストップ	1,600	1,413.00	2,260,800
アークス	3,300	2,215.00	7,309,500
パローホールディングス	3,800	1,812.00	6,885,600
藤久	400	723.00	289,200
ベルク	900	5,050.00	4,545,000
大庄	1,000	1,562.00	1,562,000

ファーストリテイリング	2,400	65,570.00	157,368,000
サンドラッグ	6,700	3,290.00	22,043,000
サックスパー ホールディングス	1,500	907.00	1,360,500
ヤマザワ	400	1,632.00	652,800
やまや	300	2,326.00	697,800
ペルーナ	4,300	721.00	3,100,300
島根銀行	500	722.00	361,000
じもとホールディングス	12,300	98.00	1,205,400
めぶきフィナンシャルグループ	92,500	254.00	23,495,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,400	1,370.00	3,288,000
九州フィナンシャルグループ	29,400	422.00	12,406,800
ゆうちょ銀行	50,400	1,036.00	52,214,400
富山第一銀行	4,000	288.00	1,152,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	111,700	395.00	44,121,500
西日本フィナンシャルホールディングス	11,100	696.00	7,725,600
関西みらいフィナンシャルグループ	8,400	722.00	6,064,800
三十三フィナンシャルグループ	1,500	1,654.00	2,481,000
第四北越フィナンシャルグループ	3,000	2,562.00	7,686,000
新生銀行	13,200	1,526.00	20,143,200
あおぞら銀行	9,900	2,580.00	25,542,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,224,200	545.80	668,168,360
りそなホールディングス	195,300	447.90	87,474,870
三井住友トラスト・ホールディングス	35,000	3,758.00	131,530,000
三井住友フィナンシャルグループ	125,300	3,657.00	458,222,100
千葉銀行	61,600	561.00	34,557,600
群馬銀行	36,100	353.00	12,743,300
武蔵野銀行	2,600	1,824.00	4,742,400
千葉興業銀行	5,300	304.00	1,611,200
筑波銀行	8,100	177.00	1,433,700
七十七銀行	5,600	1,456.00	8,153,600
青森銀行	1,400	2,530.00	3,542,000
秋田銀行	1,000	1,935.00	1,935,000
山形銀行	2,100	1,464.00	3,074,400
岩手銀行	1,200	2,372.00	2,846,400
東邦銀行	16,300	248.00	4,042,400
東北銀行	600	986.00	591,600
みちのく銀行	1,200	1,593.00	1,911,600
ふくおかフィナンシャルグループ	15,700	1,964.00	30,834,800
静岡銀行	44,400	772.00	34,276,800
十六銀行	2,400	2,249.00	5,397,600
スルガ銀行	19,000	438.00	8,322,000
八十二銀行	43,200	416.00	17,971,200

山梨中央銀行	2,200	1,019.00	2,241,800
大垣共立銀行	3,800	2,297.00	8,728,600
福井銀行	1,500	1,327.00	1,990,500
北國銀行	1,800	2,401.00	4,321,800
清水銀行	700	1,873.00	1,311,100
富山銀行	300	2,350.00	705,000
滋賀銀行	3,600	2,374.00	8,546,400
南都銀行	2,800	2,351.00	6,582,800
百五銀行	15,800	337.00	5,324,600
京都銀行	6,400	4,075.00	26,080,000
紀陽銀行	6,300	1,535.00	9,670,500
ほくほくフィナンシャルグループ	11,800	1,000.00	11,800,000
広島銀行	26,500	510.00	13,515,000
山陰合同銀行	10,400	614.00	6,385,600
中国銀行	15,600	929.00	14,492,400
鳥取銀行	400	1,374.00	549,600
伊予銀行	23,900	526.00	12,571,400
百十四銀行	1,800	2,047.00	3,684,600
四国銀行	2,400	938.00	2,251,200
阿波銀行	2,700	2,279.00	6,153,300
大分銀行	1,000	2,862.00	2,862,000
宮崎銀行	1,100	2,354.00	2,589,400
佐賀銀行	900	1,444.00	1,299,600
沖縄銀行	1,600	3,190.00	5,104,000
琉球銀行	4,200	1,083.00	4,548,600
セブン銀行	60,500	286.00	17,303,000
みずほフィナンシャルグループ	2,417,900	164.20	397,019,180
高知銀行	600	770.00	462,000
山口フィナンシャルグループ	22,200	708.00	15,717,600
長野銀行	500	1,597.00	798,500
名古屋銀行	1,400	3,010.00	4,214,000
北洋銀行	27,000	222.00	5,994,000
愛知銀行	600	3,450.00	2,070,000
中京銀行	800	2,139.00	1,711,200
大光銀行	500	1,622.00	811,000
愛媛銀行	2,400	1,118.00	2,683,200
トマト銀行	400	1,041.00	416,400
京葉銀行	7,700	606.00	4,666,200
栃木銀行	10,200	179.00	1,825,800
北日本銀行	500	1,735.00	867,500
東和銀行	3,000	724.00	2,172,000
福島銀行	2,500	219.00	547,500

大東銀行	800	579.00	463,200
トモニホールディングス	13,600	326.00	4,433,600
フィデアホールディングス	17,300	118.00	2,041,400
池田泉州ホールディングス	19,400	188.00	3,647,200
F P G	5,600	1,102.00	6,171,200
マーキュリアインベストメント	800	749.00	599,200
S B Iホールディングス	21,200	2,373.00	50,307,600
ジャフコ	2,900	4,020.00	11,658,000
大和証券グループ本社	142,500	496.00	70,680,000
野村ホールディングス	313,800	456.30	143,186,940
岡三証券グループ	15,500	363.00	5,626,500
丸三証券	5,500	506.00	2,783,000
東洋証券	6,900	147.00	1,014,300
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	21,800	304.00	6,627,200
光世証券	700	570.00	399,000
水戸証券	5,500	195.00	1,072,500
いちよし証券	3,700	654.00	2,419,800
松井証券	8,800	904.00	7,955,200
だいこう証券ビジネス	800	533.00	426,400
マネックスグループ	16,700	327.00	5,460,900
極東証券	2,400	830.00	1,992,000
岩井コスモホールディングス	1,700	1,102.00	1,873,400
藍澤證券	3,200	710.00	2,272,000
マネーパートナーズグループ	2,200	273.00	600,600
スパークス・グループ	7,200	248.00	1,785,600
かんぽ生命保険	6,400	1,638.00	10,483,200
S O M P Oホールディングス	31,300	4,534.00	141,914,200
アニコム ホールディングス	1,500	3,850.00	5,775,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	46,500	3,464.00	161,076,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	14,700	2,378.00	34,956,600
第一生命ホールディングス	100,700	1,554.50	156,538,150
東京海上ホールディングス	63,500	5,735.00	364,172,500
T & Dホールディングス	55,200	1,121.00	61,879,200
アドバンスクリエイト	400	1,830.00	732,000
全国保証	5,000	4,025.00	20,125,000
ジェイリース	600	305.00	183,000
イントラスト	500	646.00	323,000
日本モーゲージサービス	300	1,063.00	318,900
C a s a	800	1,221.00	976,800
アルヒ	1,600	2,174.00	3,478,400
プレミアグループ	1,000	1,866.00	1,866,000

クレディセゾン	12,500	1,274.00	15,925,000
芙蓉総合リース	2,000	6,330.00	12,660,000
興銀リース	3,300	2,838.00	9,365,400
東京センチュリー	3,600	5,200.00	18,720,000
日本証券金融	7,800	505.00	3,939,000
アイフル	27,500	245.00	6,737,500
リコーリース	1,400	3,435.00	4,809,000
イオンフィナンシャルサービス	11,400	1,660.00	18,924,000
アコム	36,000	401.00	14,436,000
ジャックス	2,000	2,295.00	4,590,000
オリエントコーポレーション	48,900	140.00	6,846,000
日立キャピタル	4,200	2,214.00	9,298,800
アプラスフィナンシャル	9,900	73.00	722,700
オリックス	118,500	1,665.50	197,361,750
三菱UFJリース	40,100	620.00	24,862,000
九州リースサービス	700	595.00	416,500
日本取引所グループ	48,000	1,796.00	86,208,000
イー・ギャランティ	1,700	1,288.00	2,189,600
アサックス	700	594.00	415,800
NECキャピタルソリューション	700	2,094.00	1,465,800
いちご	22,700	446.00	10,124,200
日本駐車場開発	19,800	174.00	3,445,200
スター・マイカ・ホールディングス	1,000	1,836.00	1,836,000
ヒューリック	38,142	1,040.00	39,667,680
三栄建築設計	700	1,457.00	1,019,900
野村不動産ホールディングス	11,900	2,303.00	27,405,700
三重交通グループホールディングス	3,700	540.00	1,998,000
サムティ	2,500	1,866.00	4,665,000
ディア・ライフ	2,300	520.00	1,196,000
コーセーアールイー	500	674.00	337,000
エー・ディー・ワークス	56,200	34.00	1,910,800
日本商業開発	1,100	1,482.00	1,630,200
プレサンスコーポレーション	2,800	1,604.00	4,491,200
ユニゾホールディングス	2,700	4,285.00	11,569,500
THEグローバル社	1,000	426.00	426,000
日本管理センター	1,200	1,350.00	1,620,000
サンセイランディック	600	801.00	480,600
エストラスト	300	736.00	220,800
フージャースホールディングス	3,900	624.00	2,433,600
オープンハウス	2,600	5,230.00	13,598,000
東急不動産ホールディングス	48,300	653.00	31,539,900
飯田グループホールディングス	14,900	1,718.00	25,598,200

イーグランド	300	698.00	209,400
ムゲンエステート	1,300	609.00	791,700
ビーロット	400	1,629.00	651,600
ファーストブラザーズ	400	1,052.00	420,800
ハウスドゥ	1,000	1,585.00	1,585,000
シーアールイー	500	1,017.00	508,500
プロパティエージェント	300	1,186.00	355,800
ケイアイスター不動産	500	1,965.00	982,500
アグレ都市デザイン	500	429.00	214,500
グッドコムアセット	400	1,651.00	660,400
ジェイ・エス・ビー	200	4,205.00	841,000
テンポイノベーション	200	1,608.00	321,600
グローバル・リンク・マネジメント	300	577.00	173,100
パーク24	9,600	2,319.00	22,262,400
パラカ	500	2,102.00	1,051,000
三井不動産	94,900	2,511.50	238,341,350
三菱地所	125,300	2,033.50	254,797,550
平和不動産	3,300	2,495.00	8,233,500
東京建物	19,600	1,380.00	27,048,000
ダイビル	5,400	1,054.00	5,691,600
京阪神ビルディング	3,200	1,202.00	3,846,400
住友不動産	40,100	3,901.00	156,430,100
テオーシー	4,300	798.00	3,431,400
東京楽天地	300	5,500.00	1,650,000
スターツコーポレーション	2,400	2,435.00	5,844,000
フジ住宅	2,300	683.00	1,570,900
空港施設	2,200	527.00	1,159,400
明和地所	1,000	529.00	529,000
ゴールドクレスト	1,400	2,074.00	2,903,600
日本エスリード	700	1,603.00	1,122,100
日神不動産	2,600	442.00	1,149,200
日本エスコン	3,200	760.00	2,432,000
タカラレーベン	8,200	404.00	3,312,800
サンヨーハウジング名古屋	1,100	880.00	968,000
イオンモール	9,000	1,711.00	15,399,000
毎日コムネット	400	725.00	290,000
ファースト住建	800	1,269.00	1,015,200
カチタス	2,000	4,265.00	8,530,000
トーセイ	2,500	1,255.00	3,137,500
穴吹興産	200	2,779.00	555,800
サンフロンティア不動産	2,500	1,239.00	3,097,500
エフ・ジェー・ネクスト	1,500	1,031.00	1,546,500

インテリックス	600	728.00	436,800
日本社宅サービス	500	1,002.00	501,000
グランディハウス	1,600	462.00	739,200
日本空港ビルデング	5,700	4,275.00	24,367,500
日本工営	1,200	2,824.00	3,388,800
L I F U L L	6,100	635.00	3,873,500
ジェイエイシーリクルートメント	1,200	1,928.00	2,313,600
日本M&Aセンター	12,800	3,065.00	39,232,000
メンバーズ	600	1,842.00	1,105,200
中広	300	604.00	181,200
アイティメディア	400	669.00	267,600
タケエイ	1,800	932.00	1,677,600
E・Jホールディングス	200	1,233.00	246,600
トラスト・テック	1,900	1,198.00	2,276,200
コシダカホールディングス	4,200	1,610.00	6,762,000
アルトナー	400	759.00	303,600
パソナグループ	2,100	1,507.00	3,164,700
C D S	400	1,305.00	522,000
リンクアンドモチベーション	3,800	595.00	2,261,000
G C A	2,100	721.00	1,514,100
エス・エム・エス	6,300	2,600.00	16,380,000
サニーサイドアップ	400	935.00	374,000
パーソルホールディングス	17,200	2,116.00	36,395,200
リニカル	1,000	1,009.00	1,009,000
クックパッド	6,300	291.00	1,833,300
エスクリ	500	830.00	415,000
アイ・ケイ・ケイ	900	689.00	620,100
学情	600	1,222.00	733,200
スタジオアリス	900	1,925.00	1,732,500
シミックホールディングス	1,000	1,669.00	1,669,000
N J S	400	1,599.00	639,600
総合警備保障	6,800	5,350.00	36,380,000
カカクコム	12,900	2,524.00	32,559,600
アイロムグループ	700	1,650.00	1,155,000
セントケア・ホールディング	1,300	512.00	665,600
サイネックス	300	624.00	187,200
ルネサンス	1,000	1,579.00	1,579,000
ディップ	2,800	2,535.00	7,098,000
オプトホールディング	1,000	1,435.00	1,435,000
新日本科学	2,400	684.00	1,641,600
ツクイ	4,200	438.00	1,839,600
キャリアデザインセンター	400	1,302.00	520,800

ベネフィット・ワン	4,800	1,847.00	8,865,600
エムスリー	36,300	2,390.00	86,757,000
ツカダ・グローバルホールディング	1,200	577.00	692,400
プラス	300	629.00	188,700
アウトソーシング	9,800	992.00	9,721,600
ウェルネット	1,700	709.00	1,205,300
ワールドホールディングス	600	1,582.00	949,200
ディー・エヌ・エー	9,300	1,948.00	18,116,400
博報堂DYホールディングス	24,000	1,584.00	38,016,000
ぐるなび	2,600	694.00	1,804,400
タカミヤ	1,800	639.00	1,150,200
ジャパンベストレスキューシステム	1,200	1,135.00	1,362,000
ファンコミュニケーションズ	4,800	547.00	2,625,600
ライク	700	1,707.00	1,194,900
ビジネス・ブレークスルー	800	359.00	287,200
WDBホールディングス	800	2,566.00	2,052,800
ティア	1,100	619.00	680,900
CDG	200	1,423.00	284,600
バリューコマース	1,000	1,657.00	1,657,000
インフォマート	9,500	1,574.00	14,953,000
J Pホールディングス	5,100	275.00	1,402,500
E P Sホールディングス	2,600	1,312.00	3,411,200
レグス	400	1,720.00	688,000
プレステージ・インターナショナル	3,200	1,799.00	5,756,800
アミューズ	1,000	2,597.00	2,597,000
ドリームインキュベータ	600	1,290.00	774,000
クイック	1,100	1,307.00	1,437,700
TAC	1,400	197.00	275,800
ケネディクス	16,400	544.00	8,921,600
電通	17,800	3,740.00	66,572,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	700	1,153.00	807,100
ぴあ	500	4,115.00	2,057,500
イオンファンタジー	600	2,807.00	1,684,200
シーティーエス	1,900	700.00	1,330,000
ネクシィーズグループ	600	1,858.00	1,114,800
みらかホールディングス	4,900	2,440.00	11,956,000
アルプス技研	1,500	1,473.00	2,209,500
ダイオーズ	400	1,453.00	581,200
日本空調サービス	1,800	702.00	1,263,600
オリエンタルランド	20,300	15,355.00	311,706,500
ダスキン	4,400	2,776.00	12,214,400
明光ネットワークジャパン	2,200	896.00	1,971,200

ファルコホールディングス	900	1,632.00	1,468,800
田谷	900	614.00	552,600
ラウンドワン	5,400	1,573.00	8,494,200
リゾートトラスト	7,400	1,658.00	12,269,200
ビー・エム・エル	2,200	2,972.00	6,538,400
ワタベウェディング	400	562.00	224,800
りらいあコミュニケーションズ	3,200	1,332.00	4,262,400
リソー教育	8,700	454.00	3,949,800
早稲田アカデミー	500	801.00	400,500
ユー・エス・エス	21,000	2,020.00	42,420,000
東京個別指導学院	600	943.00	565,800
サイバーエージェント	9,900	4,165.00	41,233,500
楽天	80,400	1,026.00	82,490,400
クリーク・アンド・リバー社	1,000	1,154.00	1,154,000
テー・オー・ダブリュー	1,400	703.00	984,200
山田コンサルティンググループ	800	1,652.00	1,321,600
セントラルスポーツ	600	3,095.00	1,857,000
フルキャストホールディングス	1,700	1,964.00	3,338,800
エン・ジャパン	2,500	3,780.00	9,450,000
リソルホールディングス	200	4,035.00	807,000
テクノプロ・ホールディングス	3,500	6,030.00	21,105,000
アトラ	500	509.00	254,500
インターワークス	400	555.00	222,000
アイ・アールジャパンホールディングス	700	3,465.00	2,425,500
Keepers 技研	600	1,345.00	807,000
ファーストロジック	400	640.00	256,000
三機サービス	400	926.00	370,400
Gunosy	1,200	1,446.00	1,735,200
デザインワン・ジャパン	500	284.00	142,000
イー・ガーディアン	900	1,732.00	1,558,800
リブセンス	1,300	257.00	334,100
ジャパンマテリアル	4,700	1,171.00	5,503,700
ベクトル	2,200	953.00	2,096,600
ウチヤマホールディングス	1,000	500.00	500,000
チャーム・ケア・コーポレーション	600	1,892.00	1,135,200
ライクキッズネクスト	400	896.00	358,400
キャリアリンク	700	589.00	412,300
I B J	1,200	1,090.00	1,308,000
アサンテ	700	1,970.00	1,379,000
N・フィールド	1,200	619.00	742,800
バリューHR	300	2,815.00	844,500
M&Aキャピタルパートナーズ	600	6,190.00	3,714,000

ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,476.00	1,033,200
ERIホールディングス	600	784.00	470,400
アビスト	300	2,656.00	796,800
シグマクシス	800	1,295.00	1,036,000
ウィルグループ	1,100	842.00	926,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,400	226.00	542,400
リクルートホールディングス	123,400	3,175.00	391,795,000
エラン	1,000	1,823.00	1,823,000
土木管理総合試験所	800	421.00	336,800
ネットマーケティング	700	626.00	438,200
日本郵政	141,000	999.00	140,859,000
ベルシステム24ホールディングス	2,900	1,576.00	4,570,400
鎌倉新書	1,300	1,613.00	2,096,900
ソネット・メディア・ネットワークス	200	615.00	123,000
一蔵	200	603.00	120,600
LITALICO	400	1,882.00	752,800
グローバルキッズCOMPANY	300	866.00	259,800
エボラブルアジア	800	1,993.00	1,594,400
アトラエ	400	2,476.00	990,400
ストライク	700	2,552.00	1,786,400
ソラスト	4,200	1,238.00	5,199,600
セラク	600	701.00	420,600
インソース	800	2,330.00	1,864,000
ベイカレント・コンサルティング	1,200	4,610.00	5,532,000
Orchestra Holdings	300	1,039.00	311,700
アイモバイル	600	740.00	444,000
キャリアインデックス	600	447.00	268,200
MS-Japan	700	1,376.00	963,200
船場	300	902.00	270,600
グレイステクノロジー	600	2,888.00	1,732,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,400	2,554.00	3,575,600
フルテック	200	1,230.00	246,000
グリーンズ	700	1,353.00	947,100
ツナググループ・ホールディングス	300	580.00	174,000
ソウルドアウト	300	1,380.00	414,000
MS&Consulting	300	917.00	275,100
日総工産	1,200	1,044.00	1,252,800
キュービーネットホールディングス	1,100	2,147.00	2,361,700
RPAホールディングス	700	1,612.00	1,128,400
スプリックス	600	1,479.00	887,400
アドバンテッジリスクマネジメント	700	784.00	548,800
リログループ	9,400	2,547.00	23,941,800

東祥	1,100	2,251.00	2,476,100
エイチ・アイ・エス	2,700	2,689.00	7,260,300
ラックランド	400	2,281.00	912,400
共立メンテナンス	2,600	4,205.00	10,933,000
イチネンホールディングス	1,700	1,076.00	1,829,200
建設技術研究所	1,200	1,561.00	1,873,200
スペース	1,000	1,235.00	1,235,000
長大	700	964.00	674,800
燦ホールディングス	300	2,103.00	630,900
スバル興業	100	6,570.00	657,000
東京テアトル	700	1,369.00	958,300
タナベ経営	300	1,262.00	378,600
ナガワ	500	5,060.00	2,530,000
よみうりランド	400	4,525.00	1,810,000
東京都競馬	1,100	3,215.00	3,536,500
常磐興産	700	1,694.00	1,185,800
カナモト	2,800	2,611.00	7,310,800
東京ドーム	6,500	977.00	6,350,500
西尾レントオール	1,800	2,802.00	5,043,600
トランス・コスモス	1,900	2,508.00	4,765,200
乃村工藝社	8,000	1,331.00	10,648,000
藤田観光	800	2,688.00	2,150,400
KNT - CTホールディングス	1,000	1,442.00	1,442,000
日本管財	1,800	1,880.00	3,384,000
トーカイ	1,700	2,306.00	3,920,200
白洋舎	200	2,781.00	556,200
セコム	18,300	9,149.00	167,426,700
セントラル警備保障	800	5,300.00	4,240,000
丹青社	3,200	1,255.00	4,016,000
メイテック	2,100	5,260.00	11,046,000
応用地質	1,900	1,070.00	2,033,000
船井総研ホールディングス	3,500	2,319.00	8,116,500
進学会ホールディングス	500	477.00	238,500
オオバ	1,400	601.00	841,400
いであ	300	1,108.00	332,400
学究社	500	1,220.00	610,000
ベネッセホールディングス	6,400	2,731.00	17,478,400
イオンディライト	2,100	3,275.00	6,877,500
ナック	1,200	922.00	1,106,400
ニチイ学館	2,500	1,613.00	4,032,500
ダイセキ	2,900	2,665.00	7,728,500
ステップ	500	1,405.00	702,500

小計	銘柄数：2,098 組入時価比率：98.5%	21,201,142		40,228,704,510 100.0%	
合計		21,201,142		40,228,704,510	

(注1) 比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(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

「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

MHAMスリーウェイオープン

令和1年9月30日現在

資産総額	8,330,120,470円
負債総額	38,218,637円
純資産総額（ - ）	8,291,901,833円
発行済数量	8,105,865,941口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0230円

（参考）MHAM TOPIXマザーファンド

令和1年9月30日現在

資産総額	50,236,089,121円
負債総額	15,610,796円
純資産総額（ - ）	50,220,478,325円
発行済数量	26,360,782,581口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9051円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを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。

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

委託会社は、社振法に定めるところにしたがい、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。

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金およ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したがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2019年9月30日現在）

資本金の額	20億円
発行する株式総数	100,000株 (普通株式 上限100,000株、A種種類株式 上限30,000株)
発行済株式総数	40,000株 (普通株式24,490株、A種種類株式15,510株)
種類株式の発行が可能	

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2019年9月30日現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

取締役は株主総会で選任されます。取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、その選任後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の終結の時までとし、任期の満了前に退任した取締役（監査等委員である取締役を除く。）の補欠として選任された取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、現任取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期の満了の時までとします。

また、監査等委員である取締役の任期は、その選任後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の終結の時までとし、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の時までとします。

取締役会は、決議によって代表取締役を選定します。代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、原則として取締役社長が招集します。取締役会の議長は、原則として取締役社長があたります。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、議決に加わることができる取締役の過半数が出席し、出席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

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

経済環境見直し、資産別市場見直し、資産配分方針および資産別運用方針は月次で開催する「投資環境会議」および「投資方針会議」にて協議、策定致します。これらの会議は運用本部長・副本部長、運用グループ長等で構成されます。

2. 運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

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、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）ならびにその受益証券（受益権）の募集又は私募（第二種金融商品取引業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っています。

2019年9月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,184,021,420,937
追加型株式投資信託	866	13,707,188,049,398
単位型公社債投資信託	40	109,914,896,574
単位型株式投資信託	167	1,264,802,784,203
合計	1,099	16,265,927,151,112

3【委託会社等の経理状況】

- 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」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）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第34期事業年度（自2018年4月1日至2019年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：千円）

	第33期 （2018年3月31日現在）	第34期 （2019年3月31日現在）
（資産の部）		
流動資産		
現金・預金	49,071,217	41,087,475
金銭の信託	12,083,824	18,773,228
有価証券	-	153,518

未収委託者報酬		11,769,015		12,438,085
未収運用受託報酬		4,574,225		3,295,109
未収投資助言報酬		341,689		327,064
未収収益		59,526		56,925
前払費用		569,431		573,874
その他		427,238		491,914
	流動資産計	78,896,169		77,197,195
固定資産				
有形固定資産		1,643,826		1,461,316
建物	1	1,156,953	1	1,096,916
器具備品	1	476,504	1	364,399
建設仮勘定		10,368		-
無形固定資産		1,934,700		2,411,540
ソフトウェア		1,026,319		885,545
ソフトウェア仮勘定		904,389		1,522,040
電話加入権		3,931		3,931
電信電話専用施設利用権		60		23
投資その他の資産		8,270,313		9,269,808
投資有価証券		1,721,433		1,611,931
関係会社株式		3,229,196		4,499,196
長期差入保証金		1,518,725		1,312,328
繰延税金資産		1,699,533		1,748,459
その他		101,425		97,892
	固定資産計	11,848,840		13,142,665
資産合計		90,745,010		90,339,861

(単位：千円)

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,003,550	2,183,889
未払金	5,081,728	5,697,942
未払収益分配金	1,031	1,053
未払償還金	57,275	48,968
未払手数料	4,629,133	4,883,723
その他未払金	394,288	764,196
未払費用	7,711,038	6,724,986
未払法人税等	5,153,972	3,341,238
未払消費税等	1,660,259	576,632
賞与引当金	1,393,911	1,344,466

役員賞与引当金	49,986	48,609
本社移転費用引当金	156,587	-
流動負債計	22,211,034	19,917,766
固定負債		
退職給付引当金	1,637,133	1,895,158
時効後支払損引当金	199,026	177,851
固定負債計	1,836,160	2,073,009
負債合計	24,047,195	21,990,776
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	44,349,855	45,949,372
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	44,226,562	45,826,079
別途積立金	24,580,000	31,680,000
研究開発積立金	300,000	-
運用責任準備積立金	200,000	-
繰越利益剰余金	19,146,562	14,146,079
株主資本計	65,902,812	67,502,329
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	795,002	846,755
評価・換算差額等計	795,002	846,755
純資産合計	66,697,815	68,349,085
負債・純資産合計	90,745,010	90,339,861

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第33期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	84,705,447	84,812,585
運用受託報酬	19,124,427	16,483,356
投資助言報酬	1,217,672	1,235,553
その他営業収益	117,586	113,622
営業収益計	105,165,133	102,645,117
営業費用		
支払手数料	37,242,284	36,100,556
広告宣伝費	379,873	387,028
公告費	1,485	375

調査費	23,944,438		24,389,003	
調査費	10,677,166		9,956,757	
委託調査費	13,267,272		14,432,246	
委託計算費	1,073,938		936,075	
営業雑経費	1,215,963		1,254,114	
通信費	48,704		47,007	
印刷費	947,411		978,185	
協会費	64,331		63,558	
諸会費	22,412		22,877	
支払販売手数料	133,104		142,485	
営業費用計		63,857,984		63,067,153
一般管理費				
給料	11,304,873		10,859,354	
役員報酬	189,022		189,198	
給料・手当	9,565,921		9,098,957	
賞与	1,549,929		1,571,197	
交際費	58,863		60,115	
寄付金	5,150		7,255	
旅費交通費	395,605		361,479	
租税公課	625,498		588,172	
不動産賃借料	1,534,255		1,511,876	
退職給付費用	595,876		521,184	
固定資産減価償却費	1,226,472		590,667	
福利厚生費	49,797		45,292	
修繕費	4,620		16,247	
賞与引当金繰入額	1,393,911		1,344,466	
役員賞与引当金繰入額	49,986		48,609	
機器リース料	148		130	
事務委託費	3,037,804		3,302,806	
事務用消耗品費	144,804		131,074	
器具備品費	5,253		8,112	
諸経費	149,850		188,367	
一般管理費計		20,582,772		19,585,212
営業利益		20,724,376		19,992,752

(単位：千円)

	第33期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	1,430		1,749	
受取配当金	74,278		73,517	
時効成立分配金・償還金	256		8,582	
為替差益	8,530		-	
投資信託解約益	236,398		-	
投資信託償還益	93,177		-	
受取負担金	-		177,066	
雑収入	10,306		24,919	
時効後支払損引当金戻入額	17,429		19,797	
営業外収益計		441,807		305,633
営業外費用				
為替差損	-		17,542	
投資信託解約損	4,138		-	
投資信託償還損	17,065		-	
金銭の信託運用損	99,303		175,164	

雑損失		-		5,659	
営業外費用計			120,507		198,365
経常利益			21,045,676		20,100,019
特別利益					
固定資産売却益		1		-	
投資有価証券売却益		479,323		353,644	
関係会社株式売却益	1	1,492,680		-	
本社移転費用引当金戻入額		138,294		-	
その他特別利益		350		-	
特別利益計			2,110,649		353,644
特別損失					
固定資産除却損	2	36,992		19,121	
固定資産売却損		134		-	
退職給付制度終了損		690,899		-	
システム移行損失		76,007		-	
その他特別損失		50		-	
特別損失計			804,083		19,121
税引前当期純利益			22,352,243		20,434,543
法人税、住民税及び事業税			6,951,863		6,386,793
法人税等調整額			249,832		71,767
法人税等合計			6,702,031		6,315,026
当期純利益			15,650,211		14,119,516

(3) 【株主資本等変動計算書】

第33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350
当期変動額									
剰余金の配当									3,200,000
当期純利益									15,650,211
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	-	12,450,211
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465
当期変動額					

剰余金の配当	3,200,000	3,200,000			3,200,000
当期純利益	15,650,211	15,650,211			15,650,211
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)		-	277,137	277,137	277,137
当期変動額合計	12,450,211	12,450,211	277,137	277,137	12,727,349
当期末残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562
当期変動額									
剰余金の配当									12,520,000
当期純利益									14,119,516
別途積立金 の積立						7,100,000			
研究開発 積立金の取崩							300,000		
運用責任準備 積立金の取崩								200,000	
繰越利益剰余金 の取崩									6,600,000
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	7,100,000	300,000	200,000	5,000,483
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	-	-	14,146,079

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815
当期変動額					
剰余金の配当	12,520,000	12,520,000			12,520,000
当期純利益	14,119,516	14,119,516			14,119,516
別途積立金 の積立	7,100,000	7,100,000			7,100,000

研究開発 積立金の取崩	300,000	300,000			300,000
運用責任準備 積立金の取崩	200,000	200,000			200,000
繰越利益剰余金 の取崩	6,600,000	6,600,000			6,600,000
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)		-	51,753	51,753	51,753
当期変動額合計	1,599,516	1,599,516	51,753	51,753	1,651,270
当期末残高	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(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 （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） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p>
4. 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、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。</p>
6. 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き方式によっております。

表示方法の変更

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）
<p>「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。</p> <p>この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」842,996千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,699,533千円に含めて表示しております。</p>

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

（千円）

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
建物	140,580	229,897
器具備品	847,466	927,688

（損益計算書関係）

1. 関係会社に対する事項

（千円）

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
関係会社株式売却益	1,492,680	-

2. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
建物	298	1,550
器具備品	8,217	439
ソフトウェア	28,472	17,130
電話加入権	3	-

(株主資本等変動計算書関係)

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	24,490	-	-	24,490
A種種類株式	15,510	-	-	15,510
合計	40,000	-	-	40,000

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2017年6月21日 定時株主総会	普通株式	3,200,000	80,000	2017年3月31日	2017年6月22日
	A種種類 株式				

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

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月20日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018年6月21日
	A種種 類株式					

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	24,490	-	-	24,490
A種種類株式	15,510	-	-	15,510

合計	40,000	-	-	40,000
----	--------	---	---	--------

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月20日 定時株主総会	普通株式	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018年6月21日
	A種種類 株式				

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

2019年6月20日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の 原資	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月20日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21日
	A種種類 株式					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業を営んでおります。資金運用については、短期的な預金等に限定しております。

当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するため、当該投資信託を特定金外信託を通じて、または直接保有しております。なお、特定金外信託を通じて行っているデリバティブ取引は後述するリスクを低減する目的で行っております。当該デリバティブ取引は、実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

金銭の信託の主な内容は、当社運用ファンドの安定運用を主な目的として資金投入した投資信託及びデリバティブ取引であります。金銭の信託に含まれる投資信託は為替及び市場価格の変動リスクに晒されておりますが、デリバティブ取引（為替予約取引、株価指数先物取引及び債券先物取引）を利用して一部リスクを低減しております。

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、相手先の信用リスクに晒されております。

有価証券及び投資有価証券は、主にその他有価証券（投資信託）、業務上の関係を有する企業の株式であり、発行体の信用リスクや市場価格の変動リスクに晒されております。

営業債務である未払手数料は、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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

預金の預入先については、余資運用規程に従い、格付けの高い預入先に限定することにより、リスクの軽減を図っております。

営業債権の相手先の信用リスクに関しては、当社の信用リスク管理の基本方針に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行うとともに、主な相手先の信用状況を把握する体制としています。

有価証券及び投資有価証券の発行体の信用リスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しています。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

組織規程における分掌業務の定めに基づき、リスク管理担当所管にて、取引残高、損益及びリスク量等の実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。

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

取引実行担当所管からの報告に基づき、資金管理担当所管が資金繰りを確認するとともに、十分な手許流動性を維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、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変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

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含まれておりません(注2)参照)。

第33期(2018年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	49,071,217	49,071,217	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	12,083,824	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	11,769,015	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	4,574,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	1,448,968	1,448,968	-
資産計	78,947,251	78,947,251	-
(1) 未払手数料	4,629,133	4,629,133	-
負債計	4,629,133	4,629,133	-

第34期(2019年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	41,087,475	41,087,475	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	18,773,228	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	12,438,085	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	3,295,109	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	1,488,684	1,488,684	-
資産計	77,082,582	77,082,582	-
(1) 未払手数料	4,883,723	4,883,723	-
負債計	4,883,723	4,883,723	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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。

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(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) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっておりません。

負債

(1) 未払手数料

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。

(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

(千円)

区分	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
非上場株式	272,464	276,764
関係会社株式	3,229,196	4,499,196

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積も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) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積も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、記載しておりません。

(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

第33期(2018年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	49,071,217	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	3,995	-	-

第34期(2019年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	41,087,475	-	-	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	153,518	1,995	996	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第33期の貸借対照表計上額3,229,196千円、第34期の貸借対照表計上額4,499,196千円)は、市場価格がなく、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、記載しておりません。

2. 其他有価証券

第33期(2018年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 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			
株式	1,267,157	146,101	1,121,055
投資信託	177,815	153,000	24,815
小計	1,444,972	299,101	1,145,870
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,995	4,000	4
小計	3,995	4,000	4
合計	1,448,968	303,101	1,145,866

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額272,464千円)については、市場価格がなく、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。

第34期(2019年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 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			
株式	1,326,372	111,223	1,215,148
投資信託	158,321	153,000	5,321
小計	1,484,694	264,223	1,220,470
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,990	4,000	9
小計	3,990	4,000	9
合計	1,488,684	268,223	1,220,460

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額276,674千円)については、市場価格がなく、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. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第33期(自2017年4月1日至2018年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	544,326	479,323	-
投資信託	2,480,288	329,576	21,204

(注) 投資信託の「売却額」、「売却益の合計額」及び「売却損の合計額」は、解約又は償還によるものであります。

第34期(自2018年4月1日至2019年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
----	-------------	-----------------	-----------------

株式	394,222	353,644	-
投資信託	-	-	-

(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(非積立型制度であります)を採用しております。確定拠出型の制度としては確定拠出年金制度を採用しております。

なお、当社は2017年10月1日付で、確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行するとともに、退職一時金制度を改定しました。

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

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,718,372	2,154,607
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
数理計算上の差異の発生額	61,792	10,147
退職給付の支払額	111,758	158,018
確定拠出制度への移行に伴う減少額	1,316,796	-
退職一時金制度改定に伴う増加額	526,345	-
その他	-	438
退職給付債務の期末残高	2,154,607	2,289,044

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
年金資産の期首残高	1,363,437	-
期待運用収益	17,042	-
事業主からの拠出額	36,672	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	1,417,152	-
年金資産の期末残高	-	-

(3) 退職給付債務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

(千円)

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,154,607	2,289,044
未積立退職給付債務	2,154,607	2,289,044
未認識数理計算上の差異	204,636	150,568
未認識過去勤務費用	312,836	243,317
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,637,133	1,895,158
退職給付引当金	1,637,133	1,895,158
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,637,133	1,895,158

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
期待運用収益	17,042	-
数理計算上の差異の費用処理額	88,417	43,920
過去勤務費用の費用処理額	39,611	69,519
退職一時金制度改定に伴う費用処理額	70,560	-
その他	1,620	3,640
確定給付制度に係る退職給付費用	456,577	411,963
制度移行に伴う損失(注)	690,899	-

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 数理計算上の計算基礎に関する事項
 主要な数理計算上の計算基礎

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	1.00% ~ 4.42%

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	300,927	-
退職給付費用	53,156	-
制度への拠出額	35,640	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	391,600	-
退職一時金制度改定に伴う振替額	108,189	-
退職給付引当金の期末残高	-	-

(2) 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 53,156千円 当事業年度 - 千円

4. 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86,141千円、当事業年度104,720千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	290,493	173,805
未払事業所税	11,683	10,915
賞与引当金	426,815	411,675
未払法定福利費	81,186	80,253

未払給与	9,186	7,961
受取負担金	-	138,994
運用受託報酬	-	102,490
資産除去債務	90,524	10,152
減価償却超過額(一括償却資産)	11,331	4,569
減価償却超過額	176,791	125,839
繰延資産償却超過額(税法上)	34,977	135,542
退職給付引当金	501,290	580,297
時効後支払損引当金	60,941	54,458
ゴルフ会員権評価損	13,173	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
本社移転費用引当金	47,947	-
その他	29,193	29,494
繰延税金資産小計	1,981,254	2,069,527
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,981,254	2,069,527
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	281,720	321,067
繰延税金負債合計	281,720	321,067
繰延税金資産の純額	1,699,533	1,748,459

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要な項目別の内訳

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。

(企業結合等関係)

当社(以下「AMOne」という)は、2016年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」という)、みずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」という)、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」という)及び新光投信株式会社(以下「新光投信」という)(以下総称して「統合4社」という)間の「統合契約書」に基づき、2016年10月1日付で統合いたしました。

1. 結合当事企業

結合当事企業	DIAM	MHAM	TB	新光投信
事業の内容	投資運用業務、投資助言・代理業務	投資運用業務、投資助言・代理業務	信託業務、銀行業務、投資運用業務	投資運用業務、投資助言・代理業務

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

当社は、株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という）及び第一生命ホールディングス株式会社（以下「第一生命」という）の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、MHFGと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

会社名	DIAM (存続会社)	MHAM (消滅会社)
合併比率(*)	1	0.0154

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社であるMHFGに対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないA種種類株式15,510株を交付しました。

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率	50.00%
MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率	20.00%
MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率	70.00%

なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるMHFGが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212,500千円
取得原価		144,212,500千円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん	金額	76,224,837千円
b. 発生原因		被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。
c. のれんの償却方法及び償却期間		20年間の均等償却

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額	資産合計	40,451,657千円
	うち現金・預金	11,605,537千円
	うち金銭の信託	11,792,364千円

b.負債の額	負債合計	9,256,209千円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539,592千円

(注) 顧客関連資産に配分された金額及びそれに係る繰延税金負債は、資産の額及び負債の額には含まれておりません。

(4) のれん以外の無形固定資産に配分された金額及び主要な種類別の内訳並びに全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

a.無形固定資産に配分された金額	53,030,000千円
b.主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030,000千円
c.全体及び主要な種類別の加重平均償却期間	
顧客関連資産	16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	114,270,495千円	104,326,078千円
資産合計	114,270,495千円	104,326,078千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	13,059,836千円	10,571,428千円
負債合計	13,059,836千円	10,571,428千円
純資産	101,210,659千円	93,754,650千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。

のれん	70,507,975千円	66,696,733千円
顧客関連資産	45,200,838千円	39,959,586千円

(2) 損益計算書項目

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	9,012,128千円	9,043,138千円
経常利益	9,012,128千円	9,043,138千円
税引前当期純利益	9,012,128千円	9,091,728千円
当期純利益	7,419,617千円	7,489,721千円
1株当たり当期純利益	185,490円43銭	187,243円04銭

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

のれんの償却額	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,233,360千円	5,241,252千円

(資産除去債務関係)

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金(敷金)が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用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。

2. 関連情報

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)及び第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(1) サービスごとの情報

サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額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。

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

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,470,802	未払 手数料	894,336
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	9,079,083	未払 手数料	1,549,208

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	6,048,352	未払手数料	915,980
								子会社株式の取得	1,270,000	-	-
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251億円	証券業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	10,215,017	未払手数料	1,670,194

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 子会社株式の取得は、独立した第三者機関により算定された価格を基礎として協議の上、合理的に決定しております。

(注3) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

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

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	1,667,445円37銭	1,708,727円13銭
1株当たり当期純利益金額	391,255円29銭	352,987円92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、潜在株式が存在していないため記載しておりません。

(注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。

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株

(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

(注1) A種種類株式は、剰余金の配当請求権及び残余財産分配請求権について普通株式と同等の権利を有しているため、1株当たり情報の算定上、普通株式に含めて計算しています。

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) 自己また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、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。
- (2) 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、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。
- (3) 通常の見積り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(4)(5)において同じ。)または子法人等(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または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等また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) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等また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、また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、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

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】

名称	資本金の額 単位：百万円	事業の内容
----	-----------------	-------

(1) 受託会社	みずほ信託銀行株式会社	247,369	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を行っています。	
(2) 販売会社	みずほ証券株式会社 ¹	125,167	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。	
	SMBC日興証券株式会社	10,000		
	株式会社SBI証券	48,323		
	OKB証券株式会社 ¹	1,500		
	auカブコム証券株式会社	7,196		
	フィデリティ証券株式会社	9,257		
	マネックス証券株式会社	12,200		
	丸國證券株式会社	601		
	丸三証券株式会社	10,000		
	楽天証券株式会社	7,495		
	ワイエム証券株式会社	1,270		
	株式会社みずほ銀行	1,404,065		銀行法に基づき監督官庁の免許を受け、銀行業を営んでいます。
	株式会社池田泉州銀行	61,385		
	株式会社大垣共立銀行	46,773		
	株式会社北九州銀行	10,000		
	株式会社きらぼし銀行	43,734		
	株式会社きらやか銀行	22,700		
	株式会社四国銀行	25,000		
	株式会社十八銀行	24,404		
	株式会社荘内銀行	8,500		
	株式会社親和銀行	36,878		
	株式会社常陽銀行	85,113		
	株式会社千葉興業銀行	62,120		
	株式会社北越銀行	24,538		
	株式会社北都銀行 ¹	12,500	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を行っています。	
	株式会社北陸銀行	140,409		
	株式会社北海道銀行	93,524		
株式会社宮崎銀行	14,697			
株式会社もみじ銀行	10,000			
株式会社山口銀行	10,005			
みずほ信託銀行株式会社 ¹	247,369	信用金庫法に基づき金融業務を営んでおります。		
信金中央金庫 ²	690,998			
第一生命保険株式会社	60,000	保険業法に基づき生命保険業務を営んでおります。		

(注)資本金の額：2019年3月末日現在

- みずほ証券株式会社、OKB証券株式会社、株式会社北都銀行およびみずほ信託銀行株式会社は、新規の受益権の取得のお申込みの取扱いは行いません。なお、アセットマネジメントOne株式会社においても新規の受益権の取得のお申込みの取扱いは行いません。
- 信金中央金庫は「出資金」の合計額を表示しています。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの受託会社として、信託財産を保管・管理し、受益権設定にかかる振替機関への通知等を行います。

(2) 販売会社

ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、販売、一部解約の実行の請求の受付けならびに収益分配金、償還金および一部解約金の支払い等を行います。

3【資本関係】

該当事項はありません。

（持株比率5%以上を記載します。）

<参考：再信託受託会社の概要>

名称：資産管理サービス信託銀行株式会社

業務の概要：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：原信託契約にかかる信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（資産管理サービス信託銀行株式会社）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)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載する場合があります。また、以下の内容を記載することがあります。

- ・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
- ・委託会社の金融商品取引業者登録番号
- ・詳細情報の入手方法
委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など
請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
- ・目論見書の使用開始日
- ・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
- ・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
- ・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

(2)有価証券届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」に記載の内容について、投資家の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関する箇所に記載することがあります。また、第二部「ファンド情報」第1「ファンドの状況」5「運用状況」について、有価証券届出書提出後の随時入手可能な直近の情報および同情報についての表での表示に加えて、グラフで表示した情報を目論見書に記載することがあります。

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

(4)目論見書は電子媒体等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。

(5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。

(6)投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

2019年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 湯原 尚 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山野 浩 印

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」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第34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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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、アセットマネジメントOne株式会社の2019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すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

令和1年10月25日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

山野 浩 印

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MHAMスリーウェイオープンの平成31年3月12日から令和1年9月10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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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、MHAMスリーウェイオープンの令和1年9月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

アセットマネジメントOne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、当社が監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2.XBRLデータは監査の対象には含まれていません。