

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2022年1月12日提出
<b>【発行者名】</b>	アセットマネジメントOne株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 菅野 暁
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	酒井 隆
<b>【電話番号】</b>	03-6774-5100
<b>【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】</b>	D I A M国内株式パッシブ・ファンド
<b>【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】</b>	1兆円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	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】

DIAM国内株式パッシブ・ファンド  
（以下「ファンド」または「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】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）  
信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。  
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ており、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（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、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）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（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（以下、「委託会社」といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

お申込日の基準価額 とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金の再投資を行う場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の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基準価額で表示することがあります。）

#### < 基準価額の照会方法等 >

基準価額は、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

- ・計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

### （５）【申込手数料】

ありません。

( 6 ) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる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。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金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場合は、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

( 7 ) 【申込期間】

継続申込期間：2022年1月13日から2022年7月12日まで

継続申込期間は、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】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

( 9 ) 【払込期日】

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに、買付代金を販売会社に支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

( 10 ) 【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社の定める方法により、販売会社を買付代金を支払うものとします。

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

( 11 ) 【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

( 12 ) 【その他】

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく

投資コース」を取得申込者が選択した場合には、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、受益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。販売会社までお問い合わせください。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後2時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続が完了したものを当日のお申込みとします。

委託会社は、金融商品取引所等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、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、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き換えに、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。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

#### 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に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。

ファンドの収益分配金、償還金、解約代金は、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。

#### （参考）

##### 投資信託振替制度

投資信託振替制度とは、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するものです。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ので、受益証券は発行されません。

## 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】

当ファンドは、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

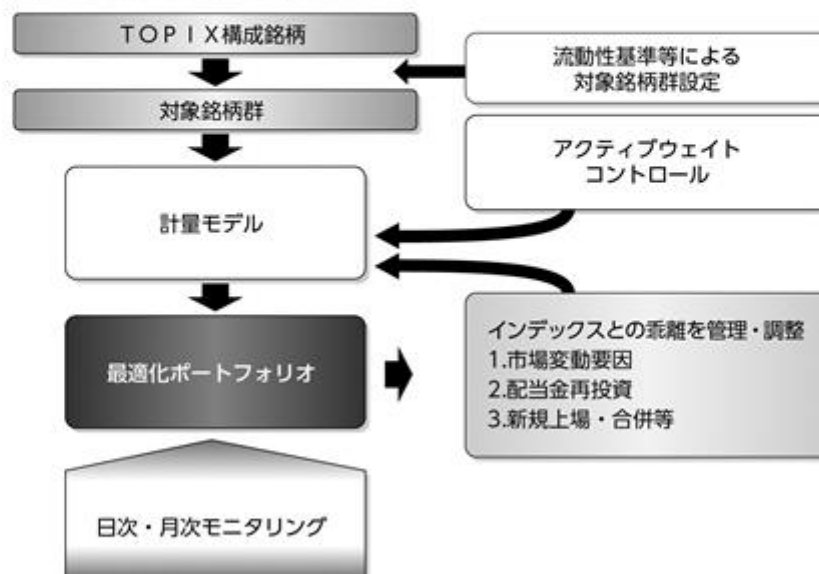
当ファンドの信託金の限度額は、5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

#### <ファンドの特色>

**1** 主に「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」に投資を行い、「東証株価指数(TOPIX) (配当込み)」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

**2** 流動性基準等により投資対象銘柄群を設定し、インデックス(東証株価指数(TOPIX) (配当込み))とポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。

※組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。



**3** 原則として、マザーファンドの組入比率は高位を維持します。

### ■ 分配方針

年1回の決算時(毎年10月12日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の利子配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

- 将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- 分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

## 指数の著作権等

東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）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㈱東京証券取引所が有しています。

㈱東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

㈱東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（TOPIX）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

㈱東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドは、㈱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ありません。

㈱東京証券取引所は、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

㈱東京証券取引所は、委託会社または国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数（TOPIX）の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資する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、責任を負いません。

東証株価指数（TOPIX）は、東証市場再編に伴い、2022年4月4日付で指数の算出要領が変更される予定です。

## 商品分類表

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

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
国内	目論見書また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います。
株式	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいいます。

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回  年4回	グローバル ( )  日本		日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)	北米  欧州  アジア  オセアニア	ファミリー ファンド	TOPIX
不動産投信  その他資産 (投資信託証券 (株式))	日々  その他 ( )	中南米  アフリカ  中近東 (中東)	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 ( )
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。



## 属性区分定義

その他資産 (投資信託証券 (株式))	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として株式へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。 (注)商品分類表の投資対象資産は株式に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産(投資信託証券(株式))に分類されます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
日本	目論見書また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います。
ファミリー ファンド	目論見書また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います。

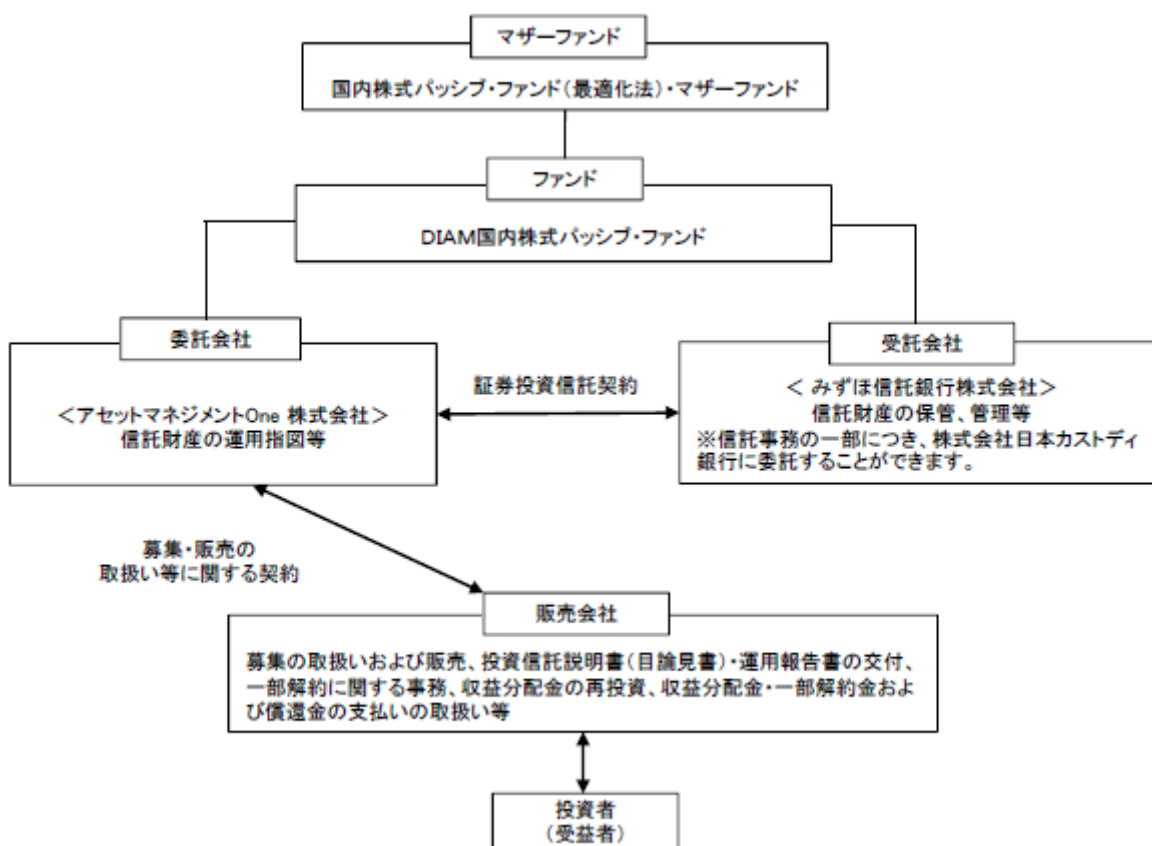
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。  
上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ  
(<https://www.toushin.or.jp/>)でご覧いただけます。

## (2) 【ファンドの沿革】

2009年1月30日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

2021年1月13日 信託報酬率(税抜)を「年率0.45%」から「年率0.25%」に引き下げ

## (3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

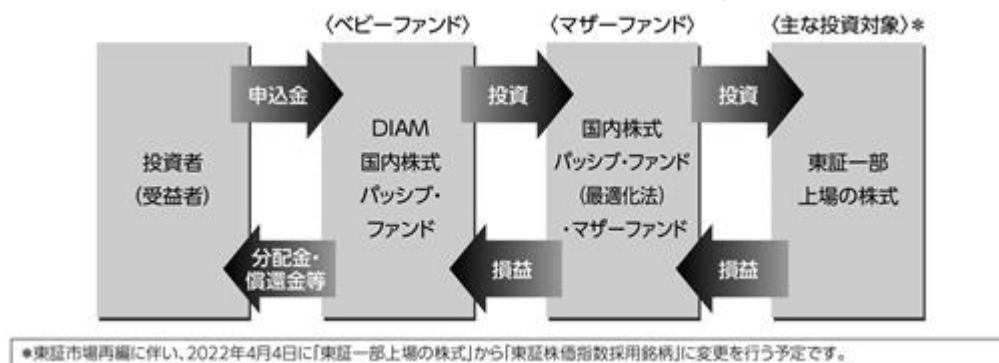
委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンドの受益証券に投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。



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（2021年10月29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「DIAM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

(2021年10月29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 <sup>1</sup>	70.0% <sup>2</sup>
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% <sup>2</sup>

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】

## &lt;基本方針&gt;

この投資信託は、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## &lt;投資対象&gt;

この投資信託は、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。

## &lt;投資態度&gt;

主として「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券に投資し、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持します。

ただし、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

当ファンドが対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、上記 1ファンドの性格 (1)ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>をご参照ください。

## (2) 【投資対象】

## 投資の対象とする資産の種類(約款第15条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1.次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条および第23条に定めるものに限ります。)

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

## 有価証券の指図範囲(約款第16条第1項)

委託会社は、信託金を、主として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国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドの受益証券のほか、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が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)

6.資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)

7.投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。)

8.特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)

9.協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)

10.資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)

11.コマーシャル・ペーパー

12.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

13.外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.~12.の証券または証書の性質を有するもの

14.投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。)

15. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
16. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
17. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをい、有価証券に係るものに限ります。）
18. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 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。）
21. 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。）
22. 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
23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの  
 なお、1.の証券または証書、13.ならびに18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券および13.ならびに18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

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

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

(参考) 当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式 <sup>*</sup> を主要投資対象とします。

投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式<sup>*</sup>に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</li> <li>3. 株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li> <li>4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</li> <li>5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</li> </ol> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>*東証市場再編に伴い、投資対象に関する記載を変更する約款変更を予定しております。約款変更日の2022年4月4日に「東京証券取引所第1部に上場されている株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている(または採用予定の)銘柄」に変更を行う予定です。</p> </div>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>2. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>3. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>4. 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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

## (3) 【運用体制】

## a. ファンドの運用体制



## 投資環境見通しおよび運用方針の策定

経済環境見通し、資産別市場見通し、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（人数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(人数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2021年10月29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10月12日。休業日の場合は翌営業日。)に、以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。

3) 留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

収益の分配方式

a. 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理するものとします。

- 1) 信託財産に属する配当等収益(配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。)とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。)との合計額から、諸経費、監査費用および当該監査費用に係る消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。



- 2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、監査報酬および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
  - 3) 上記1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産に係る配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### 収益分配金の支払い

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ません。)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。

「分配金自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は税引後無手数料で再投資されますが、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。

#### (5)【投資制限】

- 1) マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)
  - 2) 株式への実質投資割合には制限を設けません。(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)
  - 3) 外貨建資産への投資は行ないません。(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)
  - 4) 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、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)
- 5) 投資する株式等の範囲(約款第19条)
- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずるものとして市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
  - b. 上記a.の規定にかかわらず、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとし、

## 6) 信用取引の指図範囲(約款第20条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- b. 上記a.の信用取引の指図は、次の1.~6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.~6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券
  4. 売出しにより取得する株券
  5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(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。))の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
  6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(5.に定めるものを除きます。))の行使により取得可能な株券

## 7) 先物取引等の運用指図(約款第21条)

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(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。))および外国の取引所におけるわが国の有価証券にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。))。
- b. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

## 8) スワップ取引の運用指図(約款第22条)

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。))を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。

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

9) 金利先渡取引の運用指図(約款第23条)

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

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

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

d. 委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

10) デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第23条の2)

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、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ないものとします。

11) 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第24条)

a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1)~2)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

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

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

b. 上記a. 1)~2)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

c. 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

12) 資金の借入れ(約款第30条)

a. 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。

b. 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、資金借入れ額は借入指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

c. 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、資金借入れ額は収益分配金の再投資額を限度とします。

d. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

### 3【投資リスク】

#### <基準価額の主な変動要因>

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。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### (1) 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。

株式の価格は、国内外の政治・経済情勢、発行会社の業績・財務状況、または市場の需給や流動性等の影響を受けます。当ファンドは実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。

#### (2) 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。

当ファンドが実質的に投資する株式の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

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。

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、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。

受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、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。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。

分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、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。

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起り、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に連動する投資成果をめざして運用を行いますが、当該インデックス構成全銘柄を組入れない場合があること、資金流入から組入株式の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と当該インデックスが乖離する場合があります。

資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

委託会社は、金融商品取引所等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、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができます。

当ファンドは、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、受益者のため有利と認められる場合、対象インデックスが改廃された場合、その他やむを得ない事情がある場合、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了(繰上償還)する場合があります。

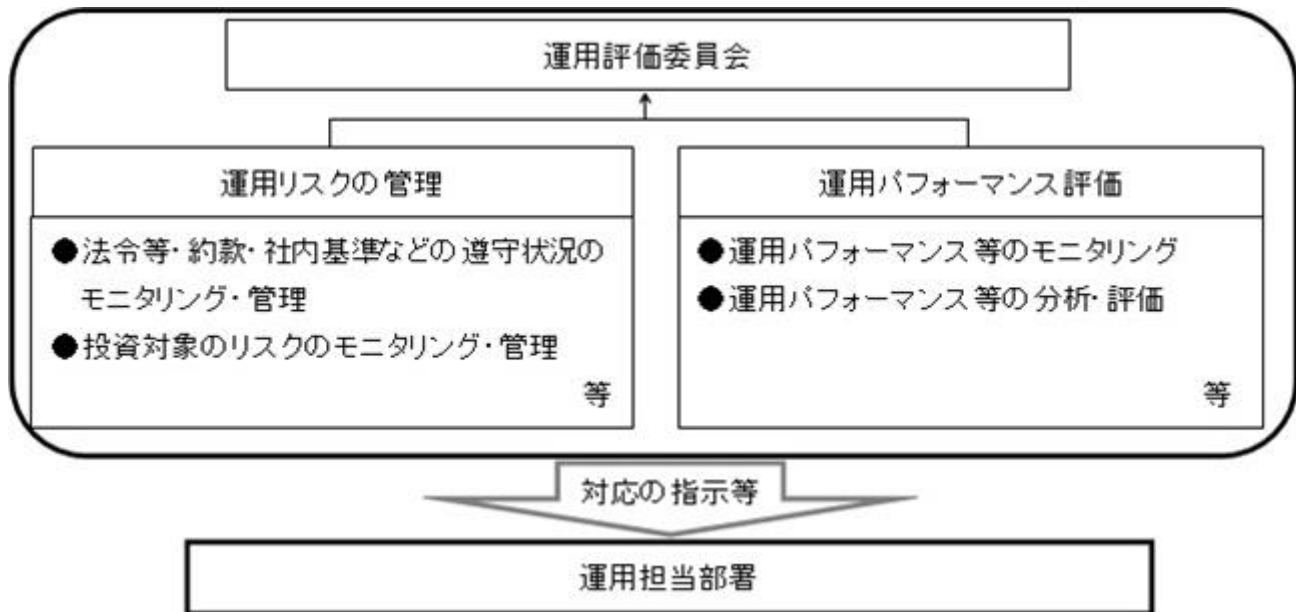
#### 注意事項

- イ．当ファンドは、実質的に株式等の値動きのある有価証券に投資しますので、基準価額は変動します。
- ロ．投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ハ．投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ニ．投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

### <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。
- ・運用評価委員会：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、運用評価委員会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2021年10月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### 流動性リスク管理体制

委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

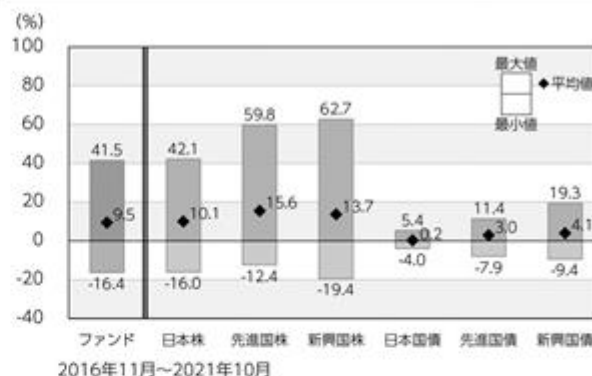
流動性リスク管理体制は2022年1月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## ＜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



### 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



\*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。

\*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。

\*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。

\*すべ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、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケットベンチマークです。同指数は、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は、株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・ディバシファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバシファイド」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。

\*東証株価指数(TOPIX)は、東証市場再編に伴い、2022年4月4日付で指数の算出要領が変更される予定です。



## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

## (3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.275%（税抜0.25%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.20%	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	年率0.02%	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	年率0.03%	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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## (4)【その他の手数料等】

## 1. 信託財産留保額

ありません。

## 2. その他の費用

その他費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (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、）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。

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

上記は、2021年10月末現在のものです。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、「分配金受取コース」と「分配金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】

2021年10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	16,699,866,628	99.99
内 日本	16,699,866,628	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,382,841	0.01
純資産総額	16,701,249,469	100.00

(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。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2021年10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	460,231,302,040	96.83
内 日本	460,231,302,040	96.83
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	15,070,912,630	3.17
純資産総額	475,302,214,670	100.00

その他資産の投資状況

2021年10月29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)	16,159,175,000	3.40
内 日本	16,159,175,000	3.40

(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】

2021年10月29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	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	5,048,022,075	3.2775 16,544,917,611	3.3082 16,699,866,628	- -	99.99

(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

2021年10月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

(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)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2021年10月29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	8,502,300	1,773.41 15,078,146,889	2,006.50 17,059,864,950	- -	3.59
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	1,051,500	11,866.41 12,477,539,151	13,140.00 13,816,710,000	- -	2.91
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	152,100	58,581.74 8,910,282,721	68,510.00 10,420,371,000	- -	2.19
4	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,237,300	5,777.42 7,148,407,348	7,572.00 9,368,835,600	- -	1.97
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	10,616,900	583.54 6,195,403,511	622.50 6,609,020,250	- -	1.39
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,926,600	2,895.68 5,578,829,160	3,188.00 6,142,000,800	- -	1.29
7	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	987,600	8,293.53 8,190,694,590	6,164.00 6,087,566,400	- -	1.28
8	信越化学工業 日本	株式 化学	282,300	18,452.03 5,209,010,223	20,255.00 5,717,986,500	- -	1.20
9	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	106,500	45,389.86 4,834,020,306	52,850.00 5,628,525,000	- -	1.18
10	HOYA 日本	株式 精密機器	327,500	14,539.90 4,761,819,270	16,725.00 5,477,437,500	- -	1.15
11	日本電産 日本	株式 電気機器	435,000	13,151.70 5,720,993,013	12,570.00 5,467,950,000	- -	1.15
12	ダイキン工業 日本	株式 機械	213,800	23,406.17 5,004,239,383	24,890.00 5,321,482,000	- -	1.12
13	日立製作所 日本	株式 電気機器	807,300	5,637.46 4,551,122,792	6,554.00 5,291,044,200	- -	1.11
14	任天堂 日本	株式 その他製品	94,700	59,802.34 5,663,282,042	50,200.00 4,753,940,000	- -	1.00
15	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,238,800	3,201.27 3,965,743,992	3,612.00 4,474,545,600	- -	0.94
16	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,321,500	3,256.36 4,303,288,789	3,349.00 4,425,703,500	- -	0.93
17	村田製作所 日本	株式 電気機器	493,000	9,051.58 4,462,431,099	8,653.00 4,265,929,000	- -	0.90

18	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,145,900	3,777.26 4,328,371,926	3,721.00 4,263,893,900	- -	0.90
19	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,200,800	3,470.91 4,167,872,966	3,528.00 4,236,422,400	- -	0.89
20	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,319,300	3,640.52 4,802,939,111	3,203.00 4,225,717,900	- -	0.89
21	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,494,900	1,489.02 3,714,967,322	1,554.50 3,878,322,050	- -	0.82
22	第一三共 日本	株式 医薬品	1,319,100	2,920.54 3,852,496,544	2,867.00 3,781,859,700	- -	0.80
23	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,156,300	3,230.55 3,735,489,620	3,242.00 3,748,724,600	- -	0.79
24	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	189,500	17,322.41 3,282,597,902	17,940.00 3,399,630,000	- -	0.72
25	S M C 日本	株式 機械	49,200	65,332.99 3,214,383,405	67,940.00 3,342,648,000	- -	0.70
26	三井物産 日本	株式 卸売業	1,283,700	2,284.96 2,933,210,584	2,592.00 3,327,350,400	- -	0.70
27	ファナック 日本	株式 電気機器	147,300	26,437.90 3,894,303,120	22,310.00 3,286,263,000	- -	0.69
28	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	545,300	5,579.87 3,042,704,171	5,998.00 3,270,709,400	- -	0.69
29	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	2,117,200	1,568.32 3,320,467,596	1,505.00 3,186,386,000	- -	0.67
30	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	646,800	4,605.22 2,978,658,667	4,782.00 3,092,997,600	- -	0.65

（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

2021年10月29日現在

種類	投資比率（％）
株式	96.83
合計	96.83

（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

2021年10月29日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
電気機器	国内	18.13
情報・通信業		8.16
輸送用機器		7.73
化学		6.73
サービス業		6.38
機械		5.26
卸売業		4.90

医薬品	4.77
銀行業	4.52
小売業	4.22
食料品	3.30
陸運業	3.03
精密機器	2.78
建設業	2.23
その他製品	2.10
不動産業	1.93
保険業	1.90
その他金融業	1.12
電気・ガス業	1.02
鉄鋼	0.78
ガラス・土石製品	0.77
証券、商品先物取引業	0.73
非鉄金属	0.69
ゴム製品	0.67
金属製品	0.60
繊維製品	0.46
海運業	0.44
空運業	0.41
石油・石炭製品	0.41
鉱業	0.21
パルプ・紙	0.21
倉庫・運輸関連業	0.17
水産・農林業	0.09
合計	96.83

（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】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・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】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2021年10月29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 0312月	買建	811	16,370,722,630	16,159,175,000	3.40

（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】

直近日(2021年10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4計算期間末 (2012年10月12日)	1,188	1,188	0.9615	0.9615
第5計算期間末 (2013年10月15日)	1,832	1,832	1.6235	1.6235
第6計算期間末 (2014年10月14日)	2,347	2,347	1.6680	1.6680
第7計算期間末 (2015年10月13日)	3,717	3,717	2.0908	2.0908
第8計算期間末 (2016年10月12日)	3,124	3,124	1.8950	1.8950
第9計算期間末 (2017年10月12日)	5,490	5,490	2.4352	2.4352
第10計算期間末 (2018年10月12日)	5,758	5,758	2.4781	2.4781
第11計算期間末 (2019年10月15日)	7,445	7,445	2.4073	2.4073
第12計算期間末 (2020年10月12日)	8,368	8,368	2.4889	2.4889
第13計算期間末 (2021年10月12日)	16,499	16,499	3.0559	3.0559
2020年10月末日	8,006	-	2.3915	-
11月末日	8,927	-	2.6572	-
12月末日	9,184	-	2.7348	-
2021年1月末日	9,250	-	2.7401	-
2月末日	9,488	-	2.8253	-
3月末日	9,783	-	2.9856	-
4月末日	13,493	-	2.9005	-
5月末日	13,779	-	2.9395	-
6月末日	14,008	-	2.9734	-
7月末日	13,813	-	2.9082	-
8月末日	14,366	-	2.9993	-
9月末日	16,826	-	3.1297	-
10月末日	16,701	-	3.0843	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000



第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第4計算期間	2.9
第5計算期間	68.9
第6計算期間	2.7
第7計算期間	25.3
第8計算期間	9.4
第9計算期間	28.5
第10計算期間	1.8
第11計算期間	2.9
第12計算期間	3.4
第13計算期間	22.8

(注) 収益率は期間騰落率です。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第4計算期間	330,350,174	235,209,696
第5計算期間	548,351,616	655,828,394
第6計算期間	796,957,698	518,389,663
第7計算期間	1,112,887,322	742,283,812
第8計算期間	1,141,968,717	1,270,849,953
第9計算期間	1,114,201,443	508,681,373
第10計算期間	1,049,666,198	980,435,336
第11計算期間	1,644,306,045	875,365,431
第12計算期間	1,205,686,297	936,032,169
第13計算期間	2,521,321,530	484,284,923

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2021年10月29日

## 基準価額・純資産の推移 (2011年10月31日～2021年10月29日)



※基準価額は1万円当たり・信託報酬控除後の価額です。  
 ※分配金再投資基準価額は、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:2009年1月30日)

## 分配の推移(税引前)

年次	分配金 (円)
2017年10月	0円
2018年10月	0円
2019年10月	0円
2020年10月	0円
2021年10月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たりです。

## 主要な資産の状況

## ■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	99.99

## ■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・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	96.83
内 日本	96.83
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.17
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)	3.40

## 株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	18.13
2	情報・通信業	8.16
3	輸送用機器	7.73
4	化学	6.73
5	サービス業	6.38

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.59
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.91
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	2.19
4	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.97
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.39
6	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.29
7	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.28
8	信越化学工業	株式	日本	化学	1.20
9	東京エレクトロン	株式	日本	電気機器	1.18
10	HOYA	株式	日本	精密機器	1.15

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。  
 ※2021年については年年初から基準日までの収益率を表示しています。

○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。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合には、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

また、受益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。販売会社までお問い合わせください。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後2時までにお申込みが行われ、かつ、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のお申込みとします。

委託会社は、金融商品取引所等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、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、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き換えに、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。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

- ・お申込価額

お申込日の基準価額 とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金の再投資を行う場合は、各計算期間終了日の基準価額となります。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の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基準価額で表示することがあります。）

#### < 基準価額の照会方法等 >

基準価額は、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されま  
す。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

#### ・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。

お申込みになる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。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金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場合は1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

#### ・ お申込手数料

ありません。

#### ・ 払込期日

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うもの  
とします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委  
託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部に  
ついて委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払い込まれます。

## 2【換金（解約）手続等】

- ・ 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し解約の請求をすることができます。受益  
者が解約の請求をするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。委託会社  
は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後2時までに行われ、かつ、解約の受付  
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のお申込みとします。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に  
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き換えに、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。

委託会社は、金融商品取引所等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、解  
約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことができます。解  
約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回で  
きます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、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解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の基準価額とします。

解約価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して4営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

基準価額とは、純資産総額（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したがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）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
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

## (2)【保管】

該当事項はありません。

## (3)【信託期間】

信託期間は、2009年1月30日から原則として無期限です。ただし、下記「(5)その他 イ.償還規定」の場合には信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

## (4)【計算期間】

- a. 計算期間は、原則として毎年10月13日から翌年10月12日までとします。
- b. 上記a.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「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

## (5)【その他】

## イ.償還規定

- a. 委託会社は、受益権総口数が10億口を下回ることとなった場合、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場合、対象インデックスが改廃の場合またはやむを得ない事情が発生した場合には、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。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出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。
- f. 委託会社は、監督官庁より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。

- g. 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、下記「ロ. 信託約款の変更等b.」の書面決議が否決された場合を除き、その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。
- h. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を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、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。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。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

#### ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、この信託約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、上記a.の事項(上記a.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

- f. 上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a.からf.の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁より信託約款の変更の命令を受けたときは、上記a.からg.の規定にしたがい信託約款を変更します。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

#### 八．関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として期間満了の3カ月前までに当事者間の別段の意思表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

#### 二．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、委託会社のホームページに掲載します。

(URL <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て行います。

#### ホ．運用報告書

・委託会社は、毎年10月12日(休業日の場合は翌営業日とします。)および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

・運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の請求があった場合には、これを交付します。

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



#### 4【受益者の権利等】

##### (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、委託会社が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ます。）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、「分配金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、委託会社が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ます。）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】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（2）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間（2020年10月13日から2021年10月12日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【DIAM国内株式パッシブ・ファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第12期 2020年10月12日現在	第13期 2021年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	19,072,510	21,011,972
親投資信託受益証券	8,367,711,177	16,498,743,372
未収入金	4,899,000	15,864,000
流動資産合計	8,391,682,687	16,535,619,344
<b>資産合計</b>	<b>8,391,682,687</b>	<b>16,535,619,344</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	4,670,397	15,630,530
未払受託者報酬	1,214,525	2,400,565
未払委託者報酬	17,003,845	17,604,428
その他未払費用	58,152	113,532
流動負債合計	22,946,919	35,749,055
<b>負債合計</b>	<b>22,946,919</b>	<b>35,749,055</b>
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,362,379,516	5,399,416,123
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	5,006,356,252	11,100,454,166
(分配準備積立金)	833,461,456	2,529,300,129
元本等合計	8,368,735,768	16,499,870,289
<b>純資産合計</b>	<b>8,368,735,768</b>	<b>16,499,870,289</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>8,391,682,687</b>	<b>16,535,619,344</b>

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第12期		第13期	
	自	2019年10月16日 至 2020年10月12日	自	2020年10月13日 至 2021年10月12日
<b>営業収益</b>				
受取利息		-		55
有価証券売買等損益		599,254,690		1,987,915,195
営業収益合計		599,254,690		1,987,915,250
<b>営業費用</b>				
支払利息		4,537		2,440
受託者報酬		2,265,014		3,943,084
委託者報酬		31,711,333		33,801,635
その他費用		109,918		186,451
営業費用合計		34,090,802		37,933,610
営業利益又は営業損失( )		565,163,888		1,949,981,640
経常利益又は経常損失( )		565,163,888		1,949,981,640
当期純利益又は当期純損失( )		565,163,888		1,949,981,640
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( )		92,096,201		152,830,550
期首剰余金又は期首欠損金( )		4,352,378,200		5,006,356,252
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,493,894,780		5,049,902,967
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		1,493,894,780		5,049,902,967
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,312,984,415		752,956,143
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,312,984,415		752,956,143
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( )		5,006,356,252		11,100,454,166

## (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13期	
	自 2020年10月13日	至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第12期	第13期
	2020年10月12日現在	2021年10月12日現在
1. 期首元本額	3,092,725,388円	3,362,379,516円
期中追加設定元本額	1,205,686,297円	2,521,321,530円
期中一部解約元本額	936,032,169円	484,284,923円
2. 受益権の総数	3,362,379,516口	5,399,416,123口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第12期	第13期
	自 2019年10月16日 至 2020年10月12日	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(143,836,894円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(230,560,521円)、信託約款に規定される収益調整金(4,172,894,796円)及び分配準備積立金(459,064,041円)より分配対象収益は5,006,356,252円(1万口当たり14,889.32円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(256,459,608円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(1,540,691,482円)、信託約款に規定される収益調整金(8,571,154,037円)及び分配準備積立金(732,149,039円)より分配対象収益は11,100,454,166円(1万口当たり20,558.61円)であります。分配を行っておりません。

(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12期	第13期
	自 2019年10月16日 至 2020年10月12日	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。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。	同左
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。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 2020年10月12日現在	第13期 2021年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（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、帳簿価額は時価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。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。	同左

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第12期 2020年10月12日現在	第13期 2021年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	504,313,148	1,856,864,660
合計	504,313,148	1,856,864,660

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第12期 2020年10月12日現在	第13期 2021年10月12日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.4889円 (24,889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

2021年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	5,034,248,733	16,498,743,372	
親投資信託受益証券	合計	5,034,248,733	16,498,743,372	
合計			16,498,743,372	

(注) 親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

当ファンドは、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。



## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2021年10月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,922,264,359
株式	393,970,303,892
派生商品評価勘定	31,479,690
未収入金	118,518
未収配当金	3,032,262,349
前払金	166,605,000
差入委託証拠金	500,775,000
流動資産合計	409,623,808,808
資産合計	
409,623,808,808	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	327,120,280
未払金	3,036,120,800
未払解約金	46,464,000
流動負債合計	3,409,705,080
負債合計	
3,409,705,080	
純資産の部	
元本等	
元本	123,946,519,436
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	282,267,584,292
元本等合計	406,214,103,728
純資産合計	
406,214,103,728	
負債純資産合計	
409,623,808,808	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、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によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年10月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	103,987,218,101円
同期中追加設定元本額	116,999,484,109円
同期中一部解約元本額	97,040,182,774円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	561,857,238円
MHAM TOPIXオープン	2,749,814,990円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	6,946,116,960円
One DC 国内株式インデックスファンド	18,753,272,622円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	5,034,248,733円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	3,107,252円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	15,992,312円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	24,043,922円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	27,708,305円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	22,925,295円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	14,937,281円
たわらノーロード TOPIX	1,154,781,700円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	884,832,430円
たわらノーロード バランス(堅実型)	34,840,129円
たわらノーロード バランス(標準型)	214,963,931円
たわらノーロード バランス(積極型)	324,990,223円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	2,355,551円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	153,283,083円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	362,997,603円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	249,784,584円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	348,979,582円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	596,652円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,321,858円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	27,745,345円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,177,945円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	14,796,859円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,715,172,036円
Oneグローバルバランス	849,790円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,005,576,019円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,356,969,121円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,600,891,042円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	329,247,832円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,119,171,723円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,105,859,591円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	30,491,676円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,039,594,009円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	18,322,288円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	300,531,320円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	290,196,282円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	509,702,481円
投資のソムリエ	13,735,449,310円
クルーズコントロール	447,221,358円
投資のソムリエ<DC年金>	705,563,618円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	309,774,130円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	467,634,686円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	5,165,969円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	14,325,482円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	465,273,541円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,329,670,789円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	30,274,942円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	15,919,305円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,513,567円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	82,589,091円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	313,231,871円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,937,528,751円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	274,725,574円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	24,125,782円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	11,650,379円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	9,475,742円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	66,571,718円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	88,239円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	8,037,090円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	8,249,170円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	49,670,055円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	4,987,983円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	7,724,239円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	76,105,700円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-05(適格機関投資家限定)	92,904,195円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	87,374,839円

マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-07(適格機関投資家限定)	153,321,837円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-08(適格機関投資家限定)	108,179,975円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	7,816,733円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-09(適格機関投資家限定)	107,219,213円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	375,904,829円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	33,379,034円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	453,183,766円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	13,237,790円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	4,158,490円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	57,243,911円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	100,764,524円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,689,400円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	26,891,974円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,197,353円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,909,569円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	9,796,825円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	35,283,314円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	558,463,697円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	627,985,207円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,791,577,060円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	33,967,787円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	31,287,117円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	296,087,798円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	74,456,576円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,490,280円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	345,020,586円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	20,831,595円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	70,439,520円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	167,926,953円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	264,490,165円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	38,217,340円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	17,685,439円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	291,737,796円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	936,557,239円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,240,495,959円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	49,936,951円
動的パッケージファンド<DC年金>	18,453,224円

コア資産形成ファンド	14,049,505円
MHAMトピックスファンド	696,649,474円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	67,262,280円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	2,659,425,997円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,185,970,644円
計	123,946,519,436円
2. 受益権の総数	123,946,519,436口

## (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 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び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。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。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、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動による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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(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、帳簿価額は時価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。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
----------------------------	--

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年10月12日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	9,236,170,351	
合計	9,236,170,351	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2021年2月9日から2021年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2021年10月12日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	12,593,455,000	-		295,435,000
合計	12,593,455,000	-		295,435,000

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

- 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。  
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年10月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.2773円 (32,773円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年10月12日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	

極洋	6,400	3,010.00	19,264,000
日本水産	182,400	622.00	113,452,800
マルハニチロ	30,800	2,610.00	80,388,000
ハウスイ	700	944.00	660,800
雪国まいたけ	16,200	1,491.00	24,154,200
カネコ種苗	5,100	1,440.00	7,344,000
サカタのタネ	23,600	3,440.00	81,184,000
ホクト	16,700	1,958.00	32,698,600
ホクリヨウ	2,900	769.00	2,230,100
ヒノキヤグループ	4,400	2,172.00	9,556,800
ショーボンドホールディングス	28,100	4,845.00	136,144,500
ミライト・ホールディングス	68,000	2,169.00	147,492,000
タマホーム	11,800	2,500.00	29,500,000
サンヨーホームズ	2,500	727.00	1,817,500
日本アクア	7,600	580.00	4,408,000
ファーストコーポレーション	6,100	815.00	4,971,500
ベステラ	3,700	1,446.00	5,350,200
Robot Home	33,400	278.00	9,285,200
キャンディル	3,500	530.00	1,855,000
スペースバリューホールディングス	23,900	852.00	20,362,800
住石ホールディングス	31,000	162.00	5,022,000
日鉄鉱業	4,400	6,590.00	28,996,000
三井松島ホールディングス	8,000	1,499.00	11,992,000
I N P E X	789,200	982.00	774,994,400
石油資源開発	25,600	2,262.00	57,907,200
K & O エナジーグループ	9,800	1,608.00	15,758,400
ダイセキ環境ソリューション	3,600	1,944.00	6,998,400
第一カッター興業	4,800	1,263.00	6,062,400
明豊ファシリティワークス	7,800	891.00	6,949,800
安藤・間	126,300	791.00	99,903,300
東急建設	57,300	804.00	46,069,200
コムシスホールディングス	69,700	2,898.00	201,990,600
ピーアールホールディングス	26,100	441.00	11,510,100
高松コンストラクショングループ	12,600	2,015.00	25,389,000
東建コーポレーション	6,000	9,420.00	56,520,000
ソネック	1,900	1,072.00	2,036,800
ヤマウラ	8,700	912.00	7,934,400
オリエンタル白石	64,700	278.00	17,986,600
大成建設	141,500	3,625.00	512,937,500
大林組	454,800	944.00	429,331,200
清水建設	426,000	844.00	359,544,000
飛島建設	13,200	1,087.00	14,348,400
長谷工コーポレーション	148,900	1,477.00	219,925,300
松井建設	18,000	736.00	13,248,000
銭高組	1,700	4,045.00	6,876,500
鹿島建設	333,200	1,447.00	482,140,400
不動テトラ	11,100	1,757.00	19,502,700
大末建設	5,800	945.00	5,481,000
鉄建建設	9,400	1,824.00	17,145,600
西松建設	32,400	3,500.00	113,400,000

三井住友建設	110,300	511.00	56,363,300
大豊建設	9,900	3,760.00	37,224,000
佐田建設	7,500	484.00	3,630,000
ナカノフドー建設	11,400	347.00	3,955,800
奥村組	25,000	2,995.00	74,875,000
東鉄工業	19,800	2,510.00	49,698,000
イチケン	3,200	1,944.00	6,220,800
富士ピー・エス	6,100	562.00	3,428,200
浅沼組	5,400	4,565.00	24,651,000
戸田建設	189,200	758.00	143,413,600
熊谷組	21,100	2,851.00	60,156,100
北野建設	3,000	2,204.00	6,612,000
植木組	4,100	1,491.00	6,113,100
矢作建設工業	20,400	782.00	15,952,800
ピーエス三菱	14,800	676.00	10,004,800
日本ハウスホールディングス	30,500	433.00	13,206,500
大東建託	49,600	12,840.00	636,864,000
新日本建設	19,800	860.00	17,028,000
N I P P O	37,500	4,065.00	152,437,500
東亜道路工業	2,800	5,000.00	14,000,000
日本道路	4,400	8,170.00	35,948,000
東亜建設工業	12,100	2,467.00	29,850,700
日本国土開発	45,000	603.00	27,135,000
若築建設	8,000	2,029.00	16,232,000
東洋建設	50,600	593.00	30,005,800
五洋建設	193,000	767.00	148,031,000
世紀東急工業	21,900	835.00	18,286,500
福田組	4,800	4,810.00	23,088,000
日本ドライケミカル	3,400	2,135.00	7,259,000
住友林業	116,200	2,116.00	245,879,200
日本基礎技術	13,600	546.00	7,425,600
巴コーポレーション	20,200	454.00	9,170,800
大和ハウス工業	419,800	3,721.00	1,562,075,800
ライト工業	26,000	1,993.00	51,818,000
積水ハウス	493,100	2,384.50	1,175,796,950
日特建設	11,500	707.00	8,130,500
北陸電気工事	8,000	1,242.00	9,936,000
ユアテック	26,100	711.00	18,557,100
日本リーテック	9,600	1,506.00	14,457,600
四電工	4,800	1,637.00	7,857,600
中電工	21,300	2,270.00	48,351,000
関電工	74,200	914.00	67,818,800
きんでん	92,700	1,886.00	174,832,200
東京エネシス	15,200	1,053.00	16,005,600
トーエネック	4,700	3,535.00	16,614,500
住友電設	12,900	2,181.00	28,134,900
日本電設工業	25,100	1,887.00	47,363,700
エクシオグループ	68,700	2,662.00	182,879,400
新日本空調	12,000	2,327.00	27,924,000
日本工営	8,100	3,305.00	26,770,500



九電工	31,900	3,610.00	115,159,000
三機工業	32,100	1,474.00	47,315,400
日揮ホールディングス	151,900	1,077.00	163,596,300
中外炉工業	4,900	1,710.00	8,379,000
ヤマト	14,600	739.00	10,789,400
太平電業	10,200	2,775.00	28,305,000
高砂熱学工業	41,100	2,169.00	89,145,900
三晃金属工業	1,800	2,499.00	4,498,200
NECネットエスアイ	46,700	2,016.00	94,147,200
朝日工業社	2,300	3,275.00	7,532,500
明星工業	29,800	724.00	21,575,200
大気社	22,200	3,295.00	73,149,000
ダイダン	10,200	2,526.00	25,765,200
日比谷総合設備	14,800	1,900.00	28,120,000
ニッポン	42,900	1,641.00	70,398,900
日清製粉グループ本社	164,500	1,845.00	303,502,500
日東富士製粉	1,600	3,205.00	5,128,000
昭和産業	12,800	2,819.00	36,083,200
鳥越製粉	13,200	751.00	9,913,200
中部飼料	17,700	1,123.00	19,877,100
フィード・ワン	19,900	748.00	14,885,200
東洋精糖	1,900	1,193.00	2,266,700
日本甜菜製糖	7,900	1,642.00	12,971,800
DM三井製糖ホールディングス	11,900	2,032.00	24,180,800
塩水港精糖	16,100	223.00	3,590,300
日新製糖	7,400	1,692.00	12,520,800
LIFULL	43,800	359.00	15,724,200
ミクシィ	35,100	2,581.00	90,593,100
ジェイエイシーリクルートメント	11,000	2,210.00	24,310,000
日本M&Aセンターホールディングス	227,000	3,260.00	740,020,000
メンバーズ	4,600	3,030.00	13,938,000
中広	1,300	393.00	510,900
UTグループ	20,000	3,415.00	68,300,000
アイティメディア	4,800	2,274.00	10,915,200
E・Jホールディングス	7,100	1,344.00	9,542,400
夢真ビーネックスグループ	36,800	1,381.00	50,820,800
コシダカホールディングス	36,600	665.00	24,339,000
アルトナー	3,200	861.00	2,755,200
パソナグループ	14,900	3,280.00	48,872,000
CDS	2,600	1,582.00	4,113,200
リンクアンドモチベーション	30,300	1,070.00	32,421,000
エス・エム・エス	47,000	4,070.00	191,290,000
サニーサイドアップグループ	4,600	771.00	3,546,600
パーソルホールディングス	138,400	2,804.00	388,073,600
リニカル	7,700	755.00	5,813,500
クックパッド	42,300	243.00	10,278,900
エスクリ	4,000	584.00	2,336,000
アイ・ケイ・ケイ	7,000	695.00	4,865,000
森永製菓	34,200	4,060.00	138,852,000
中村屋	2,700	3,780.00	10,206,000

江崎グリコ	40,100	4,160.00	166,816,000	
名糖産業	6,400	1,710.00	10,944,000	
井村屋グループ	8,400	2,246.00	18,866,400	
不二家	8,500	2,382.00	20,247,000	
山崎製パン	109,000	1,900.00	207,100,000	
第一屋製パン	3,400	780.00	2,652,000	
モロゾフ	1,900	5,410.00	10,279,000	
亀田製菓	8,400	4,555.00	38,262,000	
寿スピリッツ	14,000	7,080.00	99,120,000	
カルビー	66,300	2,692.00	178,479,600	
森永乳業	26,900	6,490.00	174,581,000	
六甲バター	10,700	1,637.00	17,515,900	
ヤクルト本社	100,100	5,700.00	570,570,000	
明治ホールディングス	96,200	7,180.00	690,716,000	
雪印メグミルク	35,100	2,203.00	77,325,300	
プリマハム	20,500	2,742.00	56,211,000	
日本ハム	55,600	4,000.00	222,400,000	
林兼産業	4,000	586.00	2,344,000	
丸大食品	14,400	1,717.00	24,724,800	
S Foods	13,100	2,931.00	38,396,100	
柿安本店	5,100	2,650.00	13,515,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	94,200	708.00	66,693,600	
学情	5,400	1,254.00	6,771,600	
スタジオアリス	6,900	2,190.00	15,111,000	
クロスキャット	3,300	1,273.00	4,200,900	
シミックホールディングス	7,700	1,468.00	11,303,600	
エブコ	3,000	836.00	2,508,000	
システナ	50,500	2,068.00	104,434,000	
NJS	3,000	2,044.00	6,132,000	
デジタルアーツ	8,300	8,950.00	74,285,000	
日鉄ソリューションズ	20,500	3,575.00	73,287,500	
総合警備保障	55,100	4,940.00	272,194,000	
キューブシステム	7,000	1,002.00	7,014,000	
いちご	159,400	366.00	58,340,400	
WOW WORLD	4,500	1,791.00	8,059,500	
日本駐車場開発	155,000	154.00	23,870,000	
コア	5,600	1,500.00	8,400,000	
カカクコム	102,200	3,810.00	389,382,000	
アイロムグループ	4,900	2,002.00	9,809,800	
セントケア・ホールディング	10,200	886.00	9,037,200	
サイネックス	2,500	660.00	1,650,000	
ルネサンス	8,500	1,174.00	9,979,000	
ディップ	21,600	4,200.00	90,720,000	
SBSホールディングス	10,700	4,080.00	43,656,000	
デジタルホールディングス	9,400	1,796.00	16,882,400	
新日本科学	17,500	910.00	15,925,000	
キャリアデザインセンター	3,300	1,130.00	3,729,000	
ベネフィット・ワン	50,300	5,770.00	290,231,000	
エムスリー	244,300	7,163.00	1,749,920,900	
ツカダ・グローバルホールディング	10,600	340.00	3,604,000	

プラス	1,700	737.00	1,252,900	
アウトソーシング	79,100	1,954.00	154,561,400	
ウェルネット	13,700	520.00	7,124,000	
ワールドホールディングス	5,400	2,912.00	15,724,800	
ディー・エヌ・エー	58,400	2,130.00	124,392,000	
博報堂DYホールディングス	192,800	1,808.00	348,582,400	
ぐるなび	23,800	538.00	12,804,400	
タカミヤ	17,100	458.00	7,831,800	
ジャパンベストレスキューシステム	9,900	1,146.00	11,345,400	
ファンコミュニケーションズ	34,900	452.00	15,774,800	
ライク	3,600	1,821.00	6,555,600	
ビジネス・ブレークスルー	5,700	428.00	2,439,600	
エスプール	38,700	1,184.00	45,820,800	
WDBホールディングス	6,200	3,390.00	21,018,000	
手間いらず	1,900	5,980.00	11,362,000	
ティア	8,000	488.00	3,904,000	
CDG	1,400	1,522.00	2,130,800	
アドウェイズ	23,300	767.00	17,871,100	
バリューコマース	10,700	4,600.00	49,220,000	
インフォマート	151,400	1,015.00	153,671,000	
サッポロホールディングス	49,700	2,567.00	127,579,900	
アサヒグループホールディングス	342,200	5,453.00	1,866,016,600	
麒麟ホールディングス	534,800	2,076.50	1,110,512,200	
宝ホールディングス	107,700	1,569.00	168,981,300	
オエノンホールディングス	42,000	371.00	15,582,000	
養命酒製造	4,700	1,848.00	8,685,600	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	102,100	1,622.00	165,606,200	
サントリー食品インターナショナル	97,300	4,570.00	444,661,000	
ダイドーグループホールディングス	8,200	5,620.00	46,084,000	
伊藤園	44,100	7,100.00	313,110,000	
キーコーヒー	14,400	2,197.00	31,636,800	
ユニカフェ	4,600	1,064.00	4,894,400	
ジャパンフーズ	1,700	1,220.00	2,074,000	
日清オイリオグループ	18,300	3,030.00	55,449,000	
不二製油グループ本社	35,600	2,626.00	93,485,600	
かどや製油	1,100	4,135.00	4,548,500	
J-オイルミルズ	13,800	1,827.00	25,212,600	
ローソン	36,200	5,310.00	192,222,000	
サンエー	10,900	4,035.00	43,981,500	
カワチ薬品	9,900	2,251.00	22,284,900	
エービーシー・マート	22,300	6,040.00	134,692,000	
ハードオフコーポレーション	6,400	778.00	4,979,200	
高千穂交易	5,200	1,170.00	6,084,000	
アスクル	23,000	1,610.00	37,030,000	
ゲオホールディングス	19,000	1,220.00	23,180,000	
アダストリア	19,700	1,917.00	37,764,900	
ジーフット	10,600	399.00	4,229,400	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,200	403.00	886,600	
オルパヘルスケアホールディングス	1,800	1,555.00	2,799,000	

伊藤忠食品	3,200	5,190.00	16,608,000	
くら寿司	14,800	3,570.00	52,836,000	
キャンドウ	6,800	1,905.00	12,954,000	
エレマテック	11,500	1,105.00	12,707,500	
アイケイ	4,000	533.00	2,132,000	
パルグループホールディングス	12,400	1,699.00	21,067,600	
JALUX	4,000	1,719.00	6,876,000	
エディオン	60,500	1,084.00	65,582,000	
あらた	11,400	4,175.00	47,595,000	
サーラコーポレーション	29,400	621.00	18,257,400	
ワッツ	6,800	876.00	5,956,800	
トーメンデバイス	1,800	5,000.00	9,000,000	
ハローズ	5,700	2,780.00	15,846,000	
J Pホールディングス	39,000	258.00	10,062,000	
フジオフードグループ本社	12,100	1,367.00	16,540,700	
あみやき亭	3,200	2,995.00	9,584,000	
東京エレクトロン デバイス	4,600	6,860.00	31,556,000	
ひらまつ	25,700	216.00	5,551,200	
フィールズ	12,300	518.00	6,371,400	
双日	157,400	1,977.00	311,179,800	
アルフレッサ ホールディングス	148,000	1,613.00	238,724,000	
大黒天物産	4,500	6,650.00	29,925,000	
ハニーズホールディングス	11,100	1,021.00	11,333,100	
ファーマライズホールディングス	3,700	779.00	2,882,300	
キッコーマン	104,700	8,720.00	912,984,000	
味の素	346,000	3,303.00	1,142,838,000	
ブルドックソース	6,400	2,265.00	14,496,000	
キュービー	81,000	2,490.00	201,690,000	
ハウス食品グループ本社	54,400	3,345.00	181,968,000	
カゴメ	55,300	2,851.00	157,660,300	
焼津水産化学工業	5,400	996.00	5,378,400	
アリアケジャパン	13,300	7,010.00	93,233,000	
ピエトロ	1,300	1,781.00	2,315,300	
エバラ食品工業	2,600	2,500.00	6,500,000	
やまみ	1,200	2,148.00	2,577,600	
ニチレイ	69,300	2,887.00	200,069,100	
横浜冷凍	41,900	881.00	36,913,900	
東洋水産	74,900	4,850.00	363,265,000	
イトアンドホールディングス	4,900	2,384.00	11,681,600	
大冷	1,800	1,930.00	3,474,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,100	732.00	5,929,200	
日清食品ホールディングス	57,100	8,760.00	500,196,000	
永谷園ホールディングス	7,500	2,084.00	15,630,000	
一正蒲鉾	5,800	921.00	5,341,800	
フジッコ	16,200	1,907.00	30,893,400	
ロック・フィールド	15,500	1,744.00	27,032,000	
日本たばこ産業	780,400	2,230.00	1,740,292,000	
ケンコーマヨネーズ	9,000	1,535.00	13,815,000	
わらべや日洋ホールディングス	9,400	2,305.00	21,667,000	
なとり	8,400	1,931.00	16,220,400	

イフジ産業	2,600	922.00	2,397,200
ピククルスコーポレーション	6,800	1,819.00	12,369,200
ファーマフーズ	13,600	2,589.00	35,210,400
北の達人コーポレーション	50,400	431.00	21,722,400
ユージェナ	73,800	848.00	62,582,400
紀文食品	8,400	1,272.00	10,684,800
スター・マイカ・ホールディングス	7,700	1,386.00	10,672,200
S R Eホールディングス	2,100	6,940.00	14,574,000
A Dワークスグループ	29,500	160.00	4,720,000
片倉工業	17,300	1,726.00	29,859,800
グンゼ	10,400	4,205.00	43,732,000
ヒューリック	303,400	1,152.00	349,516,800
神栄	3,100	1,025.00	3,177,500
ラサ商事	7,800	941.00	7,339,800
アルペン	10,800	2,830.00	30,564,000
ハブ	4,400	767.00	3,374,800
ラクーンホールディングス	10,200	1,574.00	16,054,800
クオールホールディングス	19,100	1,425.00	27,217,500
アルコニックス	15,100	1,697.00	25,624,700
神戸物産	110,700	3,645.00	403,501,500
ソリトンシステムズ	6,900	1,428.00	9,853,200
ジinzホールディングス	9,700	7,040.00	68,288,000
ビックカメラ	84,900	1,032.00	87,616,800
D C Mホールディングス	88,200	1,103.00	97,284,600
ペッパーフードサービス	19,100	397.00	7,582,700
ハイパー	2,200	549.00	1,207,800
M o n o t a R O	180,300	2,528.00	455,798,400
東京一番フーズ	4,100	585.00	2,398,500
D Dホールディングス	7,300	514.00	3,752,200
あいホールディングス	20,400	2,157.00	44,002,800
ディーブイエックス	4,400	1,065.00	4,686,000
きちりホールディングス	3,700	631.00	2,334,700
アークランドサービスホールディングス	10,800	2,288.00	24,710,400
J . フロント リテイリング	170,300	1,017.00	173,195,100
ドトール・日レスホールディングス	22,600	1,734.00	39,188,400
マツキヨココカラ&カンパニー	80,520	5,560.00	447,691,200
ブロンコビリー	8,100	2,478.00	20,071,800
Z O Z O	84,000	4,070.00	341,880,000
トレジャー・ファクトリー	3,900	944.00	3,681,600
物語コーポレーション	7,600	7,380.00	56,088,000
三越伊勢丹ホールディングス	249,500	802.00	200,099,000
東洋紡	56,100	1,356.00	76,071,600
ユニチカ	41,300	364.00	15,033,200
富士紡ホールディングス	6,900	3,960.00	27,324,000
日清紡ホールディングス	88,400	880.00	77,792,000
倉敷紡績	12,300	1,905.00	23,431,500
ダイワボウホールディングス	64,900	1,924.00	124,867,600
シキボウ	8,100	931.00	7,541,100
日東紡績	21,600	3,345.00	72,252,000

トヨタ紡織	42,100	2,066.00	86,978,600
マクニカ・富士エレホールディングス	34,000	2,468.00	83,912,000
H a m e e	3,500	1,444.00	5,054,000
マーケットエンタープライズ	500	731.00	365,500
ラクト・ジャパン	5,700	2,782.00	15,857,400
ウエルシアホールディングス	75,500	4,130.00	311,815,000
クリエイトSDホールディングス	21,100	3,670.00	77,437,000
グリムス	4,100	3,050.00	12,505,000
パイタルケーエスケー・ホールディングス	24,800	757.00	18,773,600
八洲電機	11,200	958.00	10,729,600
メディアスホールディングス	8,200	888.00	7,281,600
レスターホールディングス	15,100	1,859.00	28,070,900
ジューテックホールディングス	3,400	1,110.00	3,774,000
丸善CHIホールディングス	20,400	372.00	7,588,800
大光	6,000	698.00	4,188,000
OCHIホールディングス	3,900	1,266.00	4,937,400
TOKAIホールディングス	69,100	883.00	61,015,300
黒谷	3,700	642.00	2,375,400
ミサワ	2,600	664.00	1,726,400
ティーライフ	1,900	1,425.00	2,707,500
Cominix	1,900	722.00	1,371,800
エー・ピーホールディングス	2,100	464.00	974,400
三洋貿易	14,200	1,127.00	16,003,400
チムニー	4,400	1,456.00	6,406,400
シュッピン	9,600	1,221.00	11,721,600
ビューティガレージ	2,600	3,710.00	9,646,000
オイシックス・ラ・大地	18,700	4,550.00	85,085,000
ウイン・パートナーズ	10,700	966.00	10,336,200
ネクステージ	28,600	2,006.00	57,371,600
ジョイフル本田	41,800	1,572.00	65,709,600
鳥貴族ホールディングス	5,100	2,003.00	10,215,300
ホットランド	10,700	1,363.00	14,584,100
すかいらーくホールディングス	184,200	1,586.00	292,141,200
SFPホールディングス	7,000	1,439.00	10,073,000
綿半ホールディングス	10,800	1,225.00	13,230,000
日本毛織	43,000	946.00	40,678,000
ダイトウボウ	21,600	99.00	2,138,400
トーア紡コーポレーション	4,500	427.00	1,921,500
ダイドーリミテッド	18,500	170.00	3,145,000
ヨシックスホールディングス	2,700	2,178.00	5,880,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	41,600	1,038.00	43,180,800
三栄建築設計	5,600	2,018.00	11,300,800
野村不動産ホールディングス	82,000	2,789.00	228,698,000
三重交通グループホールディングス	29,200	543.00	15,855,600
サムティ	20,300	2,346.00	47,623,800
ディア・ライフ	18,300	581.00	10,632,300
コーセーアールイー	4,300	668.00	2,872,400
日本商業開発	9,100	1,736.00	15,797,600

プレサンスコーポレーション	23,500	1,871.00	43,968,500
フィル・カンパニー	2,500	3,045.00	7,612,500
THEグローバル社	9,200	211.00	1,941,200
ハウスコム	1,300	1,285.00	1,670,500
日本管理センター	7,000	1,192.00	8,344,000
サンセイランディック	3,900	827.00	3,225,300
エストラスト	1,400	652.00	912,800
フージャースホールディングス	23,100	661.00	15,269,100
オープンハウス	45,300	6,960.00	315,288,000
東急不動産ホールディングス	388,500	674.00	261,849,000
飯田グループホールディングス	119,200	2,757.00	328,634,400
イーグランド	2,600	1,515.00	3,939,000
ムゲンエステート	9,700	485.00	4,704,500
帝国繊維	16,100	1,988.00	32,006,800
日本コークス工業	120,400	156.00	18,782,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,100	1,312.00	10,627,200
ミタチ産業	3,800	875.00	3,325,000
B E E N O S	7,200	2,931.00	21,103,200
あさひ	10,500	1,318.00	13,839,000
日本調剤	8,700	1,600.00	13,920,000
コスモス薬品	14,400	17,550.00	252,720,000
シップヘルスケアホールディングス	50,300	2,820.00	141,846,000
トーエル	7,100	842.00	5,978,200
ソフトクリエイイトホールディングス	5,800	3,290.00	19,082,000
オンリー	2,900	770.00	2,233,000
セブン&アイ・ホールディングス	558,500	4,755.00	2,655,667,500
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	76,600	922.00	70,625,200
明治電機工業	3,400	1,322.00	4,494,800
ツルハホールディングス	31,100	13,790.00	428,869,000
デリカフーズホールディングス	6,100	631.00	3,849,100
スターティアホールディングス	3,600	1,454.00	5,234,400
サンマルクホールディングス	11,200	1,586.00	17,763,200
フェリシモ	3,000	1,447.00	4,341,000
トリドールホールディングス	35,300	2,661.00	93,933,300
帝人	133,600	1,579.00	210,954,400
東レ	1,028,100	725.70	746,092,170
クラレ	207,900	1,068.00	222,037,200
旭化成	941,100	1,184.00	1,114,262,400
T O K Y O B A S E	15,900	689.00	10,955,100
稲葉製作所	8,000	1,332.00	10,656,000
宮地エンジニアリンググループ	4,500	2,597.00	11,686,500
トーカロ	37,000	1,238.00	45,806,000
アルファ	5,000	1,206.00	6,030,000
S U M C O	182,800	2,162.00	395,213,600
川田テクノロジーズ	2,900	3,910.00	11,339,000
R S T e c h n o l o g i e s	4,600	5,580.00	25,668,000
ジェイテックコーポレーション	1,500	2,136.00	3,204,000
信和	7,500	721.00	5,407,500
ピーロット	9,400	548.00	5,151,200

ファーストブラザーズ	3,300	1,015.00	3,349,500
ハウスドゥ	7,000	1,002.00	7,014,000
シーアールイー	3,600	1,941.00	6,987,600
プロパティエージェント	2,500	2,638.00	6,595,000
ケイアイスター不動産	4,800	5,960.00	28,608,000
アグレ都市デザイン	3,700	1,386.00	5,128,200
グッドコムアセット	6,200	1,394.00	8,642,800
ジェイ・エス・ビー	2,800	2,898.00	8,114,400
テンポイノベーション	3,700	950.00	3,515,000
グローバル・リンク・マネジメント	2,200	1,099.00	2,417,800
フェイスネットワーク	1,100	1,260.00	1,386,000
住江織物	2,300	1,850.00	4,255,000
日本フェルト	6,200	450.00	2,790,000
イチカワ	1,400	1,331.00	1,863,400
エコナックホールディングス	23,100	92.00	2,125,200
日東製網	1,400	1,470.00	2,058,000
芦森工業	2,600	1,029.00	2,675,400
アツギ	11,000	637.00	7,007,000
ウイルプラスホールディングス	2,100	1,031.00	2,165,100
J Mホールディングス	9,800	1,932.00	18,933,600
コメダホールディングス	31,000	2,103.00	65,193,000
サツドラホールディングス	1,700	2,248.00	3,821,600
アレンザホールディングス	10,900	1,251.00	13,635,900
串カツ田中ホールディングス	3,600	2,260.00	8,136,000
バロックジャパンリミテッド	9,900	874.00	8,652,600
クスリのアオキホールディングス	14,200	7,370.00	104,654,000
ダイニック	4,000	738.00	2,952,000
共和レザー	7,700	685.00	5,274,500
ピーバンドットコム	1,700	676.00	1,149,200
力の源ホールディングス	6,900	611.00	4,215,900
FOOD & LIFE COMPANIES	83,500	4,950.00	413,325,000
アセンテック	3,200	1,265.00	4,048,000
セーレン	34,900	2,126.00	74,197,400
ソトー	6,700	857.00	5,741,900
東海染工	1,400	1,134.00	1,587,600
小松マテーレ	23,300	916.00	21,342,800
ワコールホールディングス	35,500	2,302.00	81,721,000
ホギメディカル	19,100	3,130.00	59,783,000
クラウディアホールディングス	2,600	283.00	735,800
T S Iホールディングス	42,600	359.00	15,293,400
マツオカコーポレーション	4,500	1,401.00	6,304,500
ワールド	18,500	1,354.00	25,049,000
T I S	142,000	2,941.00	417,622,000
J N Sホールディングス	9,500	543.00	5,158,500
グリー	86,200	838.00	72,235,600
G M Oペパボ	1,800	2,790.00	5,022,000
コーエーテクモホールディングス	37,800	5,010.00	189,378,000
三菱総合研究所	5,900	4,355.00	25,694,500
ボルテージ	3,000	448.00	1,344,000



電算	1,100	2,337.00	2,570,700
A G S	6,800	871.00	5,922,800
ファインデックス	11,600	965.00	11,194,000
ブレインパッド	3,600	5,410.00	19,476,000
K L a b	25,800	657.00	16,950,600
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	18,700	1,030.00	19,261,000
イーブックイニシアティブジャパン	2,500	4,900.00	12,250,000
ネクソン	320,400	1,854.00	594,021,600
アイスタイル	42,700	419.00	17,891,300
エムアップホールディングス	4,400	3,445.00	15,158,000
エイチーム	9,700	1,599.00	15,510,300
エニグモ	13,200	1,143.00	15,087,600
テクノスジャパン	10,700	591.00	6,323,700
e n i s h	8,600	433.00	3,723,800
コロプラ	46,800	822.00	38,469,600
オルトプラス	10,800	407.00	4,395,600
ブロードリーフ	69,500	555.00	38,572,500
クロス・マーケティンググループ	7,300	837.00	6,110,100
デジタルハーツホールディングス	7,900	1,889.00	14,923,100
システム情報	10,000	936.00	9,360,000
メディアドゥ	5,400	4,330.00	23,382,000
じげん	34,700	408.00	14,157,600
ブイキューブ	14,100	1,572.00	22,165,200
エンカレッジ・テクノロジー	2,500	604.00	1,510,000
サイバーリンクス	6,600	1,350.00	8,910,000
ディー・エル・イー	10,900	285.00	3,106,500
フィックスターズ	14,600	761.00	11,110,600
C A R T A H O L D I N G S	5,500	2,354.00	12,947,000
オブティム	9,800	1,961.00	19,217,800
セレス	5,300	2,841.00	15,057,300
S H I F T	7,200	21,850.00	157,320,000
特種東海製紙	8,800	4,425.00	38,940,000
ティーガイア	15,200	2,046.00	31,099,200
セック	1,900	2,304.00	4,377,600
テクマトリックス	21,800	1,797.00	39,174,600
プロシップ	3,800	1,733.00	6,585,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	38,600	2,064.00	79,670,400
G M O ペイメントゲートウェイ	27,500	13,750.00	378,125,000
ザッパラス	10,300	532.00	5,479,600
システムリサーチ	3,800	1,903.00	7,231,400
インターネットイニシアティブ	37,700	3,805.00	143,448,500
さくらインターネット	14,500	604.00	8,758,000
ヴィンクス	3,600	957.00	3,445,200
G M O グローバルサイン・ホールディングス	3,100	4,470.00	13,857,000
S R A ホールディングス	7,300	2,818.00	20,571,400
システムインテグレータ	3,600	626.00	2,253,600
朝日ネット	11,000	728.00	8,008,000

e B A S E	16,600	803.00	13,329,800
アバント	16,200	1,565.00	25,353,000
アドソル日進	4,700	2,143.00	10,072,100
ODKソリューションズ	7,200	704.00	5,068,800
フリービット	8,200	1,299.00	10,651,800
コムチュア	12,900	2,889.00	37,268,100
サイバーコム	2,300	1,225.00	2,817,500
アステリア	12,900	708.00	9,133,200
アイル	7,800	1,759.00	13,720,200
王子ホールディングス	639,100	563.00	359,813,300
日本製紙	62,900	1,225.00	77,052,500
三菱製紙	21,500	361.00	7,761,500
北越コーポレーション	101,400	734.00	74,427,600
中越パルプ工業	5,400	1,196.00	6,458,400
巴川製紙所	4,700	868.00	4,079,600
大王製紙	68,500	2,017.00	138,164,500
阿波製紙	4,200	388.00	1,629,600
マークライnz	7,100	3,030.00	21,513,000
メディカル・データ・ビジョン	17,800	1,458.00	25,952,400
g u m i	19,400	850.00	16,490,000
ショーケース	2,600	604.00	1,570,400
モバイルファクトリー	2,800	1,063.00	2,976,400
テラスカイ	4,400	1,972.00	8,676,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,900	1,687.00	9,953,300
P C Iホールディングス	6,000	1,038.00	6,228,000
パイブドHD	4,100	2,797.00	11,467,700
アイビーシー	2,100	930.00	1,953,000
ネオジャパン	2,500	1,380.00	3,450,000
P R T I M E S	3,700	3,095.00	11,451,500
ラクス	42,600	3,230.00	137,598,000
ランドコンピュータ	2,550	802.00	2,045,100
ダブルスタンダード	3,500	3,565.00	12,477,500
オーブンドア	8,400	2,646.00	22,226,400
マイネット	4,700	655.00	3,078,500
アカツキ	5,500	3,190.00	17,545,000
ベネフィットジャパン	1,000	2,523.00	2,523,000
U b i c o mホールディングス	4,500	2,657.00	11,956,500
カナミックネットワーク	15,000	620.00	9,300,000
ノムラシステムコーポレーション	6,600	291.00	1,920,600
レンゴー	146,500	863.00	126,429,500
トーモク	8,800	1,953.00	17,186,400
ザ・バック	10,800	2,906.00	31,384,800
チェンジ	26,000	2,212.00	57,512,000
シンクロ・フード	7,800	385.00	3,003,000
オークネット	7,700	2,209.00	17,009,300
キャピタル・アセット・プランニング	2,600	901.00	2,342,600
セグエグループ	3,200	781.00	2,499,200
エイトレッド	2,500	2,359.00	5,897,500
マクロミル	28,900	816.00	23,582,400

ビーグリー	3,100	1,600.00	4,960,000
オロ	4,300	3,600.00	15,480,000
ユーザーローカル	4,000	1,792.00	7,168,000
テモナ	2,700	747.00	2,016,900
ニーズウェル	2,500	683.00	1,707,500
マネーフォワード	21,500	7,700.00	165,550,000
サインポスト	3,300	1,127.00	3,719,100
昭和電工	123,000	2,724.00	335,052,000
住友化学	1,117,300	574.00	641,330,200
住友精化	7,000	3,400.00	23,800,000
日産化学	77,200	6,360.00	490,992,000
ラサ工業	4,500	1,802.00	8,109,000
クレハ	12,100	7,240.00	87,604,000
多木化学	5,500	6,320.00	34,760,000
テイカ	10,600	1,302.00	13,801,200
石原産業	25,200	1,210.00	30,492,000
片倉コープアグリ	2,600	1,185.00	3,081,000
日本曹達	19,400	3,410.00	66,154,000
東ソー	219,400	2,010.00	440,994,000
トクヤマ	42,100	2,113.00	88,957,300
セントラル硝子	27,300	2,079.00	56,756,700
東亜合成	80,900	1,284.00	103,875,600
大阪ソーダ	14,600	2,610.00	38,106,000
関東電化工業	33,600	978.00	32,860,800
デンカ	51,800	3,850.00	199,430,000
イビデン	69,600	5,750.00	400,200,000
信越化学工業	262,500	19,030.00	4,995,375,000
日本カーバイド工業	5,200	1,364.00	7,092,800
電算システムホールディングス	5,600	2,593.00	14,520,800
堺化学工業	9,900	2,288.00	22,651,200
第一稀元素化学工業	14,000	1,440.00	20,160,000
エア・ウォーター	144,700	1,707.00	247,002,900
日本酸素ホールディングス	117,000	2,719.00	318,123,000
日本化学工業	3,900	2,863.00	11,165,700
東邦アセチレン	2,100	1,255.00	2,635,500
日本パーカライジング	72,100	1,104.00	79,598,400
高圧ガス工業	22,700	763.00	17,320,100
チタン工業	1,700	1,831.00	3,112,700
四国化成工業	18,700	1,395.00	26,086,500
戸田工業	2,900	3,010.00	8,729,000
ステラ ケミファ	7,700	2,858.00	22,006,600
保土谷化学工業	4,100	5,020.00	20,582,000
日本触媒	25,800	5,780.00	149,124,000
大日精化工業	11,800	2,646.00	31,222,800
カネカ	36,700	4,480.00	164,416,000
協和キリン	170,100	3,685.00	626,818,500
三菱瓦斯化学	142,200	2,222.00	315,968,400
三井化学	122,400	3,580.00	438,192,000
J S R	142,400	3,830.00	545,392,000
東京応化工業	24,300	6,450.00	156,735,000

大阪有機化学工業	12,000	3,345.00	40,140,000
三菱ケミカルホールディングス	949,000	983.10	932,961,900
KHネオケム	23,400	3,020.00	70,668,000
ダイセル	191,000	870.00	166,170,000
住友ベークライト	22,400	4,890.00	109,536,000
積水化学工業	297,300	1,854.00	551,194,200
日本ゼオン	128,000	1,499.00	191,872,000
アイカ工業	39,600	3,570.00	141,372,000
宇部興産	71,800	2,196.00	157,672,800
積水樹脂	21,600	2,074.00	44,798,400
タキロンシーアイ	30,800	608.00	18,726,400
旭有機材	8,100	1,400.00	11,340,000
ニチバン	7,600	1,789.00	13,596,400
リケンテクノス	34,500	555.00	19,147,500
大倉工業	7,200	2,161.00	15,559,200
積水化成成品工業	19,400	583.00	11,310,200
群栄化学工業	3,200	3,070.00	9,824,000
タイガースポリマー	8,000	421.00	3,368,000
ミライアル	4,400	1,461.00	6,428,400
ダイキアクシス	5,300	967.00	5,125,100
ダイキョーニシカワ	30,100	651.00	19,595,100
竹本容器	5,100	912.00	4,651,200
森六ホールディングス	7,800	2,024.00	15,787,200
恵和	3,600	4,495.00	16,182,000
日本化薬	87,900	1,210.00	106,359,000
カーリットホールディングス	13,700	769.00	10,535,300
ソルクシーズ	11,000	518.00	5,698,000
レグス	3,500	1,724.00	6,034,000
プレステージ・インターナショナル	51,800	757.00	39,212,600
フェイス	4,000	709.00	2,836,000
プロトコーポレーション	16,800	1,477.00	24,813,600
ハイマックス	3,700	1,148.00	4,247,600
アミューズ	7,600	2,293.00	17,426,800
野村総合研究所	246,900	4,000.00	987,600,000
ドリームインキュベータ	4,100	827.00	3,390,700
サイバネットシステム	9,200	636.00	5,851,200
クイック	8,400	1,366.00	11,474,400
TAC	7,100	239.00	1,696,900
CEホールディングス	7,000	561.00	3,927,000
日本システム技術	3,200	1,850.00	5,920,000
電通グループ	142,800	4,185.00	597,618,000
インテージホールディングス	17,500	1,681.00	29,417,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,200	1,284.00	7,960,800
東邦システムサイエンス	3,300	1,030.00	3,399,000
ぴあ	3,900	4,210.00	16,419,000
イオンファンタジー	5,200	1,856.00	9,651,200
ソースネクスト	65,600	229.00	15,022,400
シーティーエス	15,600	789.00	12,308,400
ネクシィーズグループ	4,700	904.00	4,248,800
インフォコム	12,800	2,324.00	29,747,200

メディカルシステムネットワーク	12,200	670.00	8,174,000
日本精化	10,200	2,148.00	21,909,600
扶桑化学工業	11,200	4,940.00	55,328,000
トリケミカル研究所	13,100	3,140.00	41,134,000
HEROZ	3,900	1,924.00	7,503,600
ラクスル	15,400	5,650.00	87,010,000
I P S	3,200	2,072.00	6,630,400
F I G	14,000	283.00	3,962,000
システムサポート	3,900	1,336.00	5,210,400
A D E K A	65,200	2,338.00	152,437,600
日油	53,400	6,030.00	322,002,000
ミヨシ油脂	5,700	1,335.00	7,609,500
新日本理化	22,400	317.00	7,100,800
ハリマ化成グループ	10,900	868.00	9,461,200
イーソル	8,400	889.00	7,467,600
アルテリア・ネットワークス	15,300	1,647.00	25,199,100
E D U L A B	1,200	2,668.00	3,201,600
東海ソフト	1,900	1,195.00	2,270,500
ウイングアーク1 s t	7,900	2,347.00	18,541,300
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,900	1,760.00	6,864,000
サーバーワークス	1,300	4,105.00	5,336,500
東名	700	1,200.00	840,000
ヴィッツ	1,200	1,622.00	1,946,400
トピラシステムズ	2,500	1,196.00	2,990,000
S a n s a n	12,600	12,070.00	152,082,000
L i n k - U	2,300	1,208.00	2,778,400
ギフトィ	12,300	4,020.00	49,446,000
花王	320,800	6,586.00	2,112,788,800
第一工業製薬	4,800	3,050.00	14,640,000
石原ケミカル	7,100	1,363.00	9,677,300
日華化学	4,700	973.00	4,573,100
ニイタカ	2,900	2,255.00	6,539,500
三洋化成工業	8,500	5,640.00	47,940,000
ベース	2,600	4,620.00	12,012,000
武田薬品工業	1,206,000	3,241.00	3,908,646,000
アステラス製薬	1,256,800	1,953.50	2,455,158,800
大日本住友製薬	107,400	1,888.00	202,771,200
塩野義製薬	182,200	7,560.00	1,377,432,000
わかもと製薬	16,800	338.00	5,678,400
日本新薬	41,100	8,830.00	362,913,000
中外製薬	453,300	3,916.00	1,775,122,800
科研製薬	24,800	4,380.00	108,624,000
エーザイ	160,100	7,956.00	1,273,755,600
理研ビタミン	13,700	1,810.00	24,797,000
ロート製薬	69,100	3,360.00	232,176,000
小野薬品工業	332,900	2,414.00	803,620,600
久光製薬	42,200	3,975.00	167,745,000
有機合成薬品工業	10,300	325.00	3,347,500
持田製薬	20,200	3,240.00	65,448,000

参天製薬	252,200	1,496.00	377,291,200
扶桑薬品工業	4,600	2,464.00	11,334,400
日本ケミファ	1,300	2,172.00	2,823,600
ツムラ	48,300	3,365.00	162,529,500
日医工	40,900	897.00	36,687,300
テルモ	444,400	4,974.00	2,210,445,600
H・U・グループホールディングス	38,700	2,824.00	109,288,800
キッセイ薬品工業	25,600	2,400.00	61,440,000
生化学工業	25,600	1,024.00	26,214,400
栄研化学	25,400	1,912.00	48,564,800
日水製薬	5,600	977.00	5,471,200
鳥居薬品	8,200	2,961.00	24,280,200
JCRファーマ	40,800	2,800.00	114,240,000
東和薬品	20,800	3,320.00	69,056,000
富士製薬工業	9,100	1,126.00	10,246,600
ゼリア新薬工業	26,400	2,028.00	53,539,200
第一三共	1,139,000	2,930.50	3,337,839,500
キョーリン製薬ホールディングス	31,900	1,778.00	56,718,200
大幸薬品	21,700	884.00	19,182,800
ダイト	9,200	3,140.00	28,888,000
大塚ホールディングス	301,300	4,786.00	1,442,021,800
大正製薬ホールディングス	35,800	6,340.00	226,972,000
ペプチドリーム	76,000	2,700.00	205,200,000
大日本塗料	16,300	859.00	14,001,700
日本ペイントホールディングス	533,400	1,180.00	629,412,000
関西ペイント	159,500	2,641.00	421,239,500
神東塗料	10,400	192.00	1,996,800
中国塗料	31,000	883.00	27,373,000
日本特殊塗料	10,700	1,022.00	10,935,400
藤倉化成	19,300	532.00	10,267,600
太陽ホールディングス	20,900	2,686.00	56,137,400
D I C	60,100	3,105.00	186,610,500
サカタインクス	28,500	1,129.00	32,176,500
東洋インキS Cホールディングス	30,200	2,027.00	61,215,400
T & K T O K A	10,400	806.00	8,382,400
アルプス技研	12,200	2,074.00	25,302,800
サニックス	21,100	331.00	6,984,100
ダイオーズ	3,200	1,002.00	3,206,400
日本空調サービス	14,400	815.00	11,736,000
オリエンタルランド	147,300	17,790.00	2,620,467,000
フォーカスシステムズ	8,800	984.00	8,659,200
ダスキン	32,100	2,676.00	85,899,600
パーク24	76,600	1,822.00	139,565,200
明光ネットワークジャパン	15,800	646.00	10,206,800
ファルコホールディングス	6,600	1,715.00	11,319,000
クレスコ	10,800	1,951.00	21,070,800
フジ・メディア・ホールディングス	147,500	1,175.00	173,312,500
秀英予備校	6,600	417.00	2,752,200
田谷	1,900	559.00	1,062,100
ラウンドワン	47,100	1,455.00	68,530,500

リゾートトラスト	63,400	2,046.00	129,716,400
オービック	44,700	21,030.00	940,041,000
ジャストシステム	20,200	5,690.00	114,938,000
TDCソフト	14,500	1,309.00	18,980,500
Zホールディングス	1,953,500	692.20	1,352,212,700
ビー・エム・エル	17,700	4,015.00	71,065,500
トレンドマイクロ	75,900	6,120.00	464,508,000
りらいあコミュニケーションズ	21,000	1,198.00	25,158,000
IDホールディングス	7,500	926.00	6,945,000
リソー教育	69,500	466.00	32,387,000
日本オラクル	28,800	10,150.00	292,320,000
早稲田アカデミー	5,700	995.00	5,671,500
アルファシステムズ	3,400	4,285.00	14,569,000
フューチャー	15,500	2,739.00	42,454,500
CAC Holdings	8,400	1,619.00	13,599,600
SBテクノロジー	4,900	2,809.00	13,764,100
トーセ	3,700	774.00	2,863,800
ユー・エス・エス	155,100	1,768.00	274,216,800
オービックビジネスコンサルタント	13,500	5,750.00	77,625,000
伊藤忠テクノソリューションズ	64,500	3,500.00	225,750,000
アイティフォー	17,300	836.00	14,462,800
東京個別指導学院	11,900	649.00	7,723,100
東計電算	2,100	4,730.00	9,933,000
サイバーエージェント	341,000	2,106.00	718,146,000
楽天グループ	710,500	1,108.00	787,234,000
エクスネット	6,200	1,012.00	6,274,400
クリーク・アンド・リバー社	7,100	1,868.00	13,262,800
モーニングスター	19,700	517.00	10,184,900
テー・オー・ダブリュー	23,800	341.00	8,115,800
大塚商会	76,800	5,560.00	427,008,000
サイボウズ	18,700	2,350.00	43,945,000
山田コンサルティンググループ	8,000	1,103.00	8,824,000
セントラルスポーツ	5,100	2,411.00	12,296,100
バラカ	3,700	1,631.00	6,034,700
電通国際情報サービス	20,500	3,960.00	81,180,000
ACCESS	17,400	911.00	15,851,400
デジタルガレージ	23,500	4,910.00	115,385,000
イーエムシステムズ	23,200	762.00	17,678,400
ウェザーニューズ	4,200	6,660.00	27,972,000
C I J	8,800	849.00	7,471,200
ビジネスエンジニアリング	1,900	3,475.00	6,602,500
日本エンタープライズ	12,900	202.00	2,605,800
WOWOW	6,900	2,431.00	16,773,900
スカラ	15,700	730.00	11,461,000
インテリジェント ウェイブ	7,800	603.00	4,703,400
フルキャストホールディングス	11,700	2,600.00	30,420,000
エン・ジャパン	24,600	4,325.00	106,395,000
あすか製薬ホールディングス	16,300	1,004.00	16,365,200
サワイグループホールディングス	31,700	5,150.00	163,255,000
富士フイルムホールディングス	254,800	8,919.00	2,272,561,200

コニカミノルタ	293,800	619.00	181,862,200
資生堂	270,000	7,419.00	2,003,130,000
ライオン	175,000	1,846.00	323,050,000
高砂香料工業	9,100	2,901.00	26,399,100
マンダム	30,400	1,567.00	47,636,800
ミルボン	17,800	6,560.00	116,768,000
ファンケル	52,700	3,690.00	194,463,000
コーセー	27,200	13,560.00	368,832,000
コタ	9,100	1,560.00	14,196,000
シーボン	1,400	1,852.00	2,592,800
ポーラ・オルビスホールディングス	61,900	2,462.00	152,397,800
ノエビアホールディングス	12,300	5,320.00	65,436,000
アジュバンホールディングス	3,300	1,180.00	3,894,000
新日本製薬	3,900	1,815.00	7,078,500
エステー	9,500	1,705.00	16,197,500
アグロ カネショウ	5,000	1,475.00	7,375,000
コニシ	23,900	1,801.00	43,043,900
長谷川香料	25,000	2,687.00	67,175,000
星光PMC	8,200	800.00	6,560,000
小林製薬	40,600	8,590.00	348,754,000
荒川化学工業	12,300	1,233.00	15,165,900
メック	10,800	2,885.00	31,158,000
日本高純度化学	3,900	2,896.00	11,294,400
タカラバイオ	37,900	2,883.00	109,265,700
JCU	16,300	4,165.00	67,889,500
新田ゼラチン	9,900	625.00	6,187,500
OATアグリオ	2,900	2,149.00	6,232,100
デクセリアルズ	40,300	2,079.00	83,783,700
アース製薬	11,900	6,660.00	79,254,000
北興化学工業	13,300	1,024.00	13,619,200
大成ラミック	4,100	2,732.00	11,201,200
クミアイ化学工業	54,300	849.00	46,100,700
日本農薬	26,200	521.00	13,650,200
富士興産	5,900	969.00	5,717,100
ニチレキ	17,200	1,333.00	22,927,600
ユシロ化学工業	8,300	1,172.00	9,727,600
ビービー・カストロール	5,300	1,425.00	7,552,500
富士石油	34,000	298.00	10,132,000
MORESCO	5,300	1,245.00	6,598,500
出光興産	160,900	3,300.00	530,970,000
ENEOSホールディングス	2,181,300	463.80	1,011,686,940
コスモエネルギーホールディングス	45,700	2,573.00	117,586,100
テスホールディングス	8,200	2,102.00	17,236,400
インフロニア・ホールディングス	177,764	928.00	164,964,992
横浜ゴム	83,900	2,059.00	172,750,100
TOYO TIRE	76,300	1,934.00	147,564,200
ブリヂストン	417,500	5,326.00	2,223,605,000
住友ゴム工業	130,100	1,466.00	190,726,600
藤倉コンポジット	12,000	772.00	9,264,000
オカモト	8,700	4,055.00	35,278,500



アキレス	10,200	1,299.00	13,249,800
フコク	6,000	1,027.00	6,162,000
ニッタ	15,100	2,625.00	39,637,500
クリエートメディック	4,600	982.00	4,517,200
住友理工	28,200	739.00	20,839,800
三ツ星ベルト	17,700	1,989.00	35,205,300
パンドー化学	25,600	880.00	22,528,000
A G C	133,000	5,900.00	784,700,000
日本板硝子	73,500	567.00	41,674,500
石塚硝子	2,300	2,088.00	4,802,400
有沢製作所	19,800	875.00	17,325,000
日本山村硝子	6,600	898.00	5,926,800
日本電気硝子	58,200	2,760.00	160,632,000
オハラ	5,700	1,394.00	7,945,800
住友大阪セメント	26,100	3,395.00	88,609,500
太平洋セメント	82,300	2,434.00	200,318,200
リソルホールディングス	1,900	4,025.00	7,647,500
日本ヒューム	13,900	751.00	10,438,900
日本コンクリート工業	30,900	301.00	9,300,900
三谷セキサン	6,800	7,220.00	49,096,000
アジアパイルホールディングス	22,700	465.00	10,555,500
東海カーボン	121,200	1,394.00	168,952,800
日本カーボン	7,500	4,185.00	31,387,500
東洋炭素	9,400	2,850.00	26,790,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,000	4,790.00	38,320,000
T O T O	103,500	5,290.00	547,515,000
日本碍子	159,700	1,893.00	302,312,100
日本特殊陶業	110,200	1,737.00	191,417,400
ダントーホールディングス	9,600	261.00	2,505,600
M A R U W A	5,000	10,450.00	52,250,000
品川リフラクトリーズ	3,300	3,870.00	12,771,000
黒崎播磨	2,400	4,540.00	10,896,000
ヨータイ	10,300	1,260.00	12,978,000
イソライト工業	5,900	875.00	5,162,500
東京窯業	19,000	324.00	6,156,000
ニッカトー	6,700	799.00	5,353,300
フジインコーポレーテッド	11,600	6,390.00	74,124,000
クニミネ工業	4,600	1,099.00	5,055,400
エーアンドエーマテリアル	2,600	976.00	2,537,600
ニチアス	36,600	2,557.00	93,586,200
日本製鉄	684,200	1,969.00	1,347,189,800
神戸製鋼所	261,900	669.00	175,211,100
中山製鋼所	19,700	427.00	8,411,900
合同製鐵	7,900	1,534.00	12,118,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	414,500	1,691.00	700,919,500
東京製鐵	55,700	1,078.00	60,044,600
共英製鋼	16,300	1,396.00	22,754,800
大和工業	30,500	3,480.00	106,140,000
東京鐵鋼	5,500	1,554.00	8,547,000

大阪製鐵	8,000	1,124.00	8,992,000	
淀川製鋼所	19,000	2,380.00	45,220,000	
丸一鋼管	46,800	2,566.00	120,088,800	
モリ工業	4,300	2,391.00	10,281,300	
大同特殊鋼	23,500	4,690.00	110,215,000	
日本高周波鋼業	4,400	401.00	1,764,400	
日本冶金工業	11,100	2,598.00	28,837,800	
山陽特殊製鋼	17,200	1,762.00	30,306,400	
愛知製鋼	8,200	2,691.00	22,066,200	
日立金属	135,200	2,155.00	291,356,000	
日本金属	3,500	1,002.00	3,507,000	
大平洋金属	9,700	2,051.00	19,894,700	
新日本電工	91,800	335.00	30,753,000	
栗本鐵工所	6,700	1,657.00	11,101,900	
虹 技	1,400	1,090.00	1,526,000	
日本鑄鉄管	1,500	1,299.00	1,948,500	
日本製鋼所	43,400	2,945.00	127,813,000	
三菱製鋼	10,400	1,143.00	11,887,200	
日亜鋼業	22,000	293.00	6,446,000	
日本精線	2,000	4,730.00	9,460,000	
エンビプロ・ホールディングス	7,700	2,330.00	17,941,000	
大紀アルミニウム工業所	21,400	1,897.00	40,595,800	
日本軽金属ホールディングス	39,300	1,968.00	77,342,400	
三井金属鉱業	38,600	3,165.00	122,169,000	
東邦亜鉛	7,900	2,855.00	22,554,500	
三菱マテリアル	94,900	2,224.00	211,057,600	
住友金属鉱山	183,200	4,275.00	783,180,000	
DOWAホールディングス	36,300	4,375.00	158,812,500	
古河機械金属	24,200	1,212.00	29,330,400	
エス・サイエンス	67,700	33.00	2,234,100	
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,000	801.00	12,015,000	
東邦チタニウム	25,600	1,224.00	31,334,400	
UACJ	21,800	2,836.00	61,824,800	
CKサンエツ	2,300	2,948.00	6,780,400	
古河電気工業	44,500	2,449.00	108,980,500	
住友電気工業	500,400	1,530.00	765,612,000	
フジクラ	172,800	656.00	113,356,800	
昭和電線ホールディングス	13,800	2,135.00	29,463,000	
東京特殊電線	1,700	2,797.00	4,754,900	
タツタ電線	25,200	528.00	13,305,600	
カナレ電気	2,500	1,709.00	4,272,500	
平河ヒューテック	8,100	1,171.00	9,485,100	
リョービ	17,700	1,236.00	21,877,200	
アーレスティ	17,100	441.00	7,541,100	
アサヒホールディングス	53,700	2,157.00	115,830,900	
東洋製罐グループホールディングス	91,100	1,382.00	125,900,200	
ホッカンホールディングス	7,500	1,458.00	10,935,000	
コロナ	9,000	912.00	8,208,000	
横河ブリッジホールディングス	24,600	2,341.00	57,588,600	
駒井ハルテック	2,800	1,682.00	4,709,600	

高田機工	800	2,712.00	2,169,600
三和ホールディングス	135,100	1,376.00	185,897,600
文化シャッター	42,000	1,123.00	47,166,000
三協立山	18,600	762.00	14,173,200
アルインコ	9,600	989.00	9,494,400
東洋シャッター	2,600	663.00	1,723,800
L I X I L	197,400	2,924.00	577,197,600
日本フィルコン	9,600	546.00	5,241,600
ノーリツ	27,400	1,829.00	50,114,600
長府製作所	14,800	2,043.00	30,236,400
リンナイ	27,900	11,440.00	319,176,000
ユニプレス	23,800	927.00	22,062,600
ダイニチ工業	6,800	779.00	5,297,200
日東精工	17,700	646.00	11,434,200
三洋工業	1,400	1,876.00	2,626,400
岡部	30,000	680.00	20,400,000
ジーテクト	17,700	1,418.00	25,098,600
東プレ	26,700	1,292.00	34,496,400
高周波熱錬	27,500	612.00	16,830,000
東京製綱	10,100	906.00	9,150,600
サンコール	12,300	446.00	5,485,800
モリテックスチール	10,900	437.00	4,763,300
パイオラックス	21,600	1,567.00	33,847,200
エイチワン	13,800	752.00	10,377,600
日本発条	143,000	848.00	121,264,000
中央発條	6,800	1,036.00	7,044,800
アドバネクス	1,800	1,341.00	2,413,800
三浦工業	62,100	4,235.00	262,993,500
タクマ	48,600	1,470.00	71,442,000
テクノプロ・ホールディングス	82,800	3,620.00	299,736,000
アトラグループ	2,700	313.00	845,100
インターワークス	3,900	405.00	1,579,500
アイ・アールジャパンホールディングス	5,500	11,610.00	63,855,000
K e e P e r 技研	8,800	3,430.00	30,184,000
ファーストロジック	2,500	799.00	1,997,500
三機サービス	2,600	1,101.00	2,862,600
G u n o s y	8,300	685.00	5,685,500
デザインワン・ジャパン	3,900	270.00	1,053,000
イー・ガーディアン	5,400	3,055.00	16,497,000
リブセンス	7,000	211.00	1,477,000
ジャパンマテリアル	42,700	1,392.00	59,438,400
ベクトル	17,000	1,117.00	18,989,000
ウチヤマホールディングス	6,300	374.00	2,356,200
チャーム・ケア・コーポレーション	11,000	1,742.00	19,162,000
キャリアリンク	5,100	1,572.00	8,017,200
I B J	12,300	1,091.00	13,419,300
アサンテ	4,800	1,737.00	8,337,600
バリューHR	5,400	1,717.00	9,271,800
M & A キャピタルパートナーズ	11,400	6,100.00	69,540,000

ライドオンエクスプレスホールディングス	5,200	1,506.00	7,831,200	
E R Iホールディングス	4,800	1,430.00	6,864,000	
アビスト	2,100	2,866.00	6,018,600	
シグマクシス・ホールディングス	7,500	2,704.00	20,280,000	
ウィルグループ	10,000	1,299.00	12,990,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	20,100	217.00	4,361,700	
メドピア	10,600	3,575.00	37,895,000	
レアジョブ	2,500	1,315.00	3,287,500	
リクルートホールディングス	992,100	7,097.00	7,040,933,700	
エラン	18,800	1,188.00	22,334,400	
ツガミ	29,500	1,508.00	44,486,000	
オークマ	16,700	5,300.00	88,510,000	
芝浦機械	14,800	2,622.00	38,805,600	
アマダ	210,100	1,128.00	236,992,800	
アイダエンジニアリング	37,600	979.00	36,810,400	
滝澤鉄工所	4,400	1,122.00	4,936,800	
F U J I	57,200	2,562.00	146,546,400	
牧野フライス製作所	16,800	3,990.00	67,032,000	
オーエスジー	66,400	1,779.00	118,125,600	
ダイジェット工業	1,100	1,195.00	1,314,500	
旭ダイヤモンド工業	37,600	669.00	25,154,400	
D M G森精機	85,000	1,916.00	162,860,000	
ソディック	31,800	844.00	26,839,200	
ディスコ	19,600	28,930.00	567,028,000	
日東工器	7,000	1,931.00	13,517,000	
日進工具	11,400	1,376.00	15,686,400	
パンチ工業	11,900	617.00	7,342,300	
富士ダイス	7,100	645.00	4,579,500	
土木管理総合試験所	6,200	350.00	2,170,000	
ネットマーケティング	6,100	510.00	3,111,000	
日本郵政	1,048,700	937.70	983,365,990	
ベルシステム24ホールディングス	23,300	1,656.00	38,584,800	
鎌倉新書	13,700	905.00	12,398,500	
S M N	2,900	725.00	2,102,500	
一蔵	1,900	540.00	1,026,000	
グローバルキッズCOMPANY	2,300	840.00	1,932,000	
エアトリ	8,900	4,120.00	36,668,000	
アトラエ	9,600	2,412.00	23,155,200	
ストライク	5,100	4,135.00	21,088,500	
ソラスト	33,900	1,383.00	46,883,700	
セラク	5,500	2,202.00	12,111,000	
インソース	13,300	2,186.00	29,073,800	
豊田自動織機	117,300	9,050.00	1,061,565,000	
豊和工業	7,900	811.00	6,406,900	
O K K	5,400	307.00	1,657,800	
石川製作所	3,700	1,536.00	5,683,200	
東洋機械金属	10,700	522.00	5,585,400	
津田駒工業	2,600	857.00	2,228,200	
エンシュウ	2,600	740.00	1,924,000	

島精機製作所	21,100	2,191.00	46,230,100
オプトラン	18,000	2,225.00	40,050,000
NCホールディングス	5,400	1,175.00	6,345,000
イワキ	9,400	934.00	8,779,600
フリー	13,800	1,633.00	22,535,400
ヤマシンフィルタ	28,800	608.00	17,510,400
日阪製作所	18,100	844.00	15,276,400
やまびこ	27,800	1,197.00	33,276,600
野村マイクロ・サイエンス	3,000	4,450.00	13,350,000
平田機工	6,800	6,650.00	45,220,000
ペガサスマシン製造	14,600	476.00	6,949,600
マルマエ	6,000	1,900.00	11,400,000
タツモ	6,700	1,515.00	10,150,500
ナプテスコ	81,700	3,865.00	315,770,500
三井海洋開発	15,300	1,942.00	29,712,600
レオン自動機	14,100	1,453.00	20,487,300
S M C	42,400	62,110.00	2,633,464,000
ホソカワミクロン	10,100	3,130.00	31,613,000
ユニオンツール	5,300	3,595.00	19,053,500
オイレス工業	20,500	1,647.00	33,763,500
日精エー・エス・ビー機械	4,800	3,775.00	18,120,000
サトーホールディングス	18,800	2,531.00	47,582,800
技研製作所	12,600	4,480.00	56,448,000
日本エアータック	6,400	1,233.00	7,891,200
カワタ	3,800	1,126.00	4,278,800
日精樹脂工業	11,000	1,089.00	11,979,000
オカダアイヨン	4,300	1,318.00	5,667,400
ワイエイシーホールディングス	5,500	868.00	4,774,000
小松製作所	656,800	2,699.00	1,772,703,200
住友重機械工業	83,000	2,919.00	242,277,000
日立建機	67,800	3,190.00	216,282,000
日工	21,600	657.00	14,191,200
巴工業	5,700	2,502.00	14,261,400
井関農機	13,300	1,577.00	20,974,100
T O W A	13,400	2,289.00	30,672,600
丸山製作所	2,600	1,515.00	3,939,000
北川鉄工所	6,400	1,567.00	10,028,800
シンニッタン	17,300	237.00	4,100,100
ローツェ	6,300	9,160.00	57,708,000
タカキタ	5,100	657.00	3,350,700
クボタ	707,000	2,322.00	1,641,654,000
荏原実業	6,600	2,765.00	18,249,000
東洋エンジニアリング	18,800	884.00	16,619,200
三菱化工機	4,500	2,409.00	10,840,500
月島機械	27,000	1,122.00	30,294,000
帝国電機製作所	10,200	1,404.00	14,320,800
東京機械製作所	5,600	2,000.00	11,200,000
新東工業	34,900	748.00	26,105,200
澁谷工業	12,800	2,964.00	37,939,200
アイチコーポレーション	25,000	762.00	19,050,000

小森コーポレーション	37,200	792.00	29,462,400	
鶴見製作所	11,300	1,709.00	19,311,700	
住友精密工業	2,100	2,300.00	4,830,000	
日本ギア工業	6,700	307.00	2,056,900	
酒井重工業	2,500	2,549.00	6,372,500	
荏原製作所	60,200	5,640.00	339,528,000	
石井鐵工所	1,300	2,979.00	3,872,700	
西島製作所	14,600	878.00	12,818,800	
北越工業	15,100	943.00	14,239,300	
ダイキン工業	184,600	24,395.00	4,503,317,000	
オルガノ	4,600	6,380.00	29,348,000	
トーヨーカネツ	5,400	2,692.00	14,536,800	
栗田工業	78,400	5,250.00	411,600,000	
椿本チエイン	20,800	3,335.00	69,368,000	
大同工業	6,900	1,031.00	7,113,900	
日機装	43,500	975.00	42,412,500	
木村化工機	11,700	713.00	8,342,100	
レイズネクスト	25,300	1,210.00	30,613,000	
アネスト岩田	24,600	908.00	22,336,800	
ダイフク	79,700	9,820.00	782,654,000	
サムコ	3,600	2,701.00	9,723,600	
加藤製作所	8,100	849.00	6,876,900	
油研工業	1,900	1,741.00	3,307,900	
タダノ	69,900	1,133.00	79,196,700	
フジテック	49,900	2,532.00	126,346,800	
C K D	33,600	2,111.00	70,929,600	
キトー	12,200	1,542.00	18,812,400	
平和	40,600	2,076.00	84,285,600	
理想科学工業	10,600	2,330.00	24,698,000	
SANKYO	34,500	2,771.00	95,599,500	
日本金銭機械	15,900	738.00	11,734,200	
マースグループホールディングス	9,600	1,620.00	15,552,000	
フクシマガリレイ	10,000	4,680.00	46,800,000	
オーイズミ	6,300	384.00	2,419,200	
ダイコク電機	6,600	1,209.00	7,979,400	
竹内製作所	24,200	2,696.00	65,243,200	
アマノ	38,000	2,625.00	99,750,000	
JUKI	20,100	819.00	16,461,900	
サンデンホールディングス	20,600	290.00	5,974,000	
ジャノメ	13,000	740.00	9,620,000	
ブラザー工業	177,100	2,347.00	415,653,700	
マックス	19,400	1,758.00	34,105,200	
モリタホールディングス	23,600	1,461.00	34,479,600	
グローリー	37,300	2,376.00	88,624,800	
新晃工業	13,400	2,054.00	27,523,600	
大和冷機工業	21,200	1,247.00	26,436,400	
セガサミーホールディングス	131,800	1,564.00	206,135,200	
日本ピストンリング	5,000	1,371.00	6,855,000	
リケン	6,700	2,733.00	18,311,100	
T P R	19,600	1,465.00	28,714,000	

ツバキ・ナカシマ	31,700	1,477.00	46,820,900
ホシザキ	42,400	9,670.00	410,008,000
大豊工業	11,600	825.00	9,570,000
日本精工	297,800	776.00	231,092,800
NTN	335,200	256.00	85,811,200
ジェイテクト	139,100	1,005.00	139,795,500
不二越	12,300	4,175.00	51,352,500
ミネベアミツミ	249,800	2,745.00	685,701,000
日本トムソン	39,300	525.00	20,632,500
THK	84,200	2,352.00	198,038,400
ユーシン精機	10,000	765.00	7,650,000
前澤給装工業	10,300	1,020.00	10,506,000
イーグル工業	17,900	1,212.00	21,694,800
前澤工業	8,100	774.00	6,269,400
日本ピラー工業	14,500	2,437.00	35,336,500
キッツ	48,800	739.00	36,063,200
日立製作所	696,800	6,529.00	4,549,407,200
東芝	286,800	4,905.00	1,406,754,000
三菱電機	1,449,800	1,527.00	2,213,844,600
富士電機	87,300	4,775.00	416,857,500
東洋電機製造	5,800	1,097.00	6,362,600
安川電機	156,000	4,850.00	756,600,000
シンフォニアテクノロジー	18,700	1,143.00	21,374,100
明電舎	24,500	2,385.00	58,432,500
オリジン	4,200	1,297.00	5,447,400
山洋電気	7,000	6,290.00	44,030,000
デンヨー	12,400	2,006.00	24,874,400
ベイカレント・コンサルティング	9,100	46,250.00	420,875,000
Orchestra Holdings	3,300	4,140.00	13,662,000
アイモバイル	5,000	1,435.00	7,175,000
キャリアインデックス	6,900	934.00	6,444,600
MS-Japan	5,400	995.00	5,373,000
船場	1,800	800.00	1,440,000
グレイステクノロジー	13,700	1,071.00	14,672,700
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	39,700	2,403.00	95,399,100
フルテック	2,100	1,434.00	3,011,400
グリーンズ	4,900	549.00	2,690,100
ツナググループ・ホールディングス	2,700	377.00	1,017,900
GAMewith	3,900	512.00	1,996,800
ソウルドアウト	3,300	1,580.00	5,214,000
MS&Consulting	2,100	732.00	1,537,200
ウェルビー	5,000	1,545.00	7,725,000
エル・ティー・エス	1,700	3,300.00	5,610,000
ミダックホールディングス	5,900	5,290.00	31,211,000
日総工産	10,600	724.00	7,674,400
キュービーネットホールディングス	6,200	1,838.00	11,395,600
RPAホールディングス	16,200	572.00	9,266,400
三櫻工業	19,800	1,029.00	20,374,200

マキタ	189,100	5,610.00	1,060,851,000	
東芝テック	15,600	4,675.00	72,930,000	
芝浦メカトロニクス	2,500	6,340.00	15,850,000	
マブチモーター	34,000	3,775.00	128,350,000	
日本電産	348,900	11,825.00	4,125,742,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,900	642.00	5,071,800	
トレックス・セミコンダクター	7,800	2,382.00	18,579,600	
東光高岳	7,200	1,463.00	10,533,600	
ダブル・スコープ	41,500	842.00	34,943,000	
宮越ホールディングス	5,200	1,169.00	6,078,800	
ダイヘン	15,800	4,500.00	71,100,000	
ヤーマン	23,500	1,201.00	28,223,500	
JVCケンウッド	124,000	205.00	25,420,000	
ミマキエンジニアリング	12,900	941.00	12,138,900	
I - P E X	6,700	1,986.00	13,306,200	
日新電機	34,100	1,298.00	44,261,800	
大崎電気工業	28,700	547.00	15,698,900	
オムロン	120,600	10,140.00	1,222,884,000	
日東工業	21,300	1,677.00	35,720,100	
I D E C	19,300	2,034.00	39,256,200	
正興電機製作所	4,400	1,384.00	6,089,600	
不二電機工業	2,600	1,271.00	3,304,600	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	52,000	2,518.00	130,936,000	
サクサホールディングス	3,000	1,430.00	4,290,000	
メルコホールディングス	4,900	4,570.00	22,393,000	
テクノメディカ	3,400	1,598.00	5,433,200	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,300	2,160.00	9,288,000	
日本電気	184,100	6,040.00	1,111,964,000	
富士通	130,400	19,775.00	2,578,660,000	
沖電気工業	58,900	956.00	56,308,400	
岩崎通信機	7,000	895.00	6,265,000	
電気興業	7,000	2,459.00	17,213,000	
サンケン電気	16,900	5,410.00	91,429,000	
ナカヨ	2,100	1,417.00	2,975,700	
アイホン	8,100	2,347.00	19,010,700	
ルネサスエレクトロニクス	784,300	1,285.00	1,007,825,500	
セイコーエプソン	179,800	2,193.00	394,301,400	
ワコム	104,800	710.00	74,408,000	
アルバック	26,600	6,070.00	161,462,000	
アクセル	6,000	703.00	4,218,000	
E I Z O	12,300	4,315.00	53,074,500	
ジャパンディスプレイ	494,200	36.00	17,791,200	
日本信号	34,000	950.00	32,300,000	
京三製作所	31,000	468.00	14,508,000	
能美防災	19,300	2,036.00	39,294,800	
ホーチキ	10,800	1,191.00	12,862,800	
星和電機	6,600	516.00	3,405,600	
エレコム	33,300	1,781.00	59,307,300	
パナソニック	1,545,800	1,380.00	2,133,204,000	



シャープ	192,800	1,371.00	264,328,800
アンリツ	87,100	1,951.00	169,932,100
富士通ゼネラル	44,200	2,810.00	124,202,000
ソニーグループ	908,000	12,330.00	11,195,640,000
T D K	210,000	3,705.00	778,050,000
帝国通信工業	6,200	1,323.00	8,202,600
タムラ製作所	51,800	726.00	37,606,800
アルプスアルパイン	118,500	1,138.00	134,853,000
池上通信機	4,900	789.00	3,866,100
日本電波工業	13,800	885.00	12,213,000
鈴木	6,300	869.00	5,474,700
メイコー	10,800	2,873.00	31,028,400
日本トリム	3,100	3,510.00	10,881,000
ローランド ディー・ジー・	8,500	2,886.00	24,531,000
フォスター電機	14,800	915.00	13,542,000
S M K	3,800	2,169.00	8,242,200
ヨコオ	11,800	2,375.00	28,025,000
ティアック	8,100	122.00	988,200
ホシデン	37,800	949.00	35,872,200
ヒロセ電機	22,400	17,580.00	393,792,000
日本航空電子工業	33,300	1,603.00	53,379,900
T O A	17,300	809.00	13,995,700
マクセル	28,800	1,323.00	38,102,400
古野電気	18,600	1,232.00	22,915,200
ユニデンホールディングス	3,300	3,095.00	10,213,500
スミダコーポレーション	13,500	1,229.00	16,591,500
アイコム	6,100	2,361.00	14,402,100
リオン	6,000	2,423.00	14,538,000
本多通信工業	11,500	453.00	5,209,500
横河電機	145,100	2,072.00	300,647,200
新電元工業	5,500	3,660.00	20,130,000
アズビル	98,000	4,390.00	430,220,000
東亜ディーケーケー	7,300	860.00	6,278,000
日本光電工業	59,900	3,530.00	211,447,000
チノー	4,700	1,419.00	6,669,300
共和電業	14,500	389.00	5,640,500
日本電子材料	5,800	1,755.00	10,179,000
堀場製作所	26,800	7,550.00	202,340,000
アドバンテスト	107,700	8,740.00	941,298,000
小野測器	4,700	519.00	2,439,300
エスベック	12,900	2,254.00	29,076,600
キーエンス	142,300	64,820.00	9,223,886,000
日置電機	7,000	9,080.00	63,560,000
シスメックス	113,100	13,595.00	1,537,594,500
日本マイクロニクス	25,200	1,307.00	32,936,400
メガチップス	14,500	3,390.00	49,155,000
O B A R A G R O U P	7,000	3,600.00	25,200,000
I M A G I C A G R O U P	12,100	523.00	6,328,300
澤藤電機	1,500	2,046.00	3,069,000
デンソー	319,200	7,532.00	2,404,214,400

原田工業	5,500	951.00	5,230,500
コーセル	17,500	900.00	15,750,000
イリソ電子工業	12,200	4,405.00	53,741,000
オブテックスグループ	23,800	1,436.00	34,176,800
千代田インテグレ	6,100	2,131.00	12,999,100
アイ・オー・データ機器	5,300	928.00	4,918,400
レーザーテック	63,600	23,230.00	1,477,428,000
スタンレー電気	101,600	2,741.00	278,485,600
岩崎電気	5,200	2,072.00	10,774,400
ウシオ電機	74,300	2,049.00	152,240,700
岡谷電機産業	9,900	345.00	3,415,500
ヘリオス テクノ ホールディング	14,100	325.00	4,582,500
エノモト	3,800	1,773.00	6,737,400
日本セラミック	13,600	2,904.00	39,494,400
遠藤照明	7,500	1,146.00	8,595,000
古河電池	10,300	1,557.00	16,037,100
双信電機	6,700	759.00	5,085,300
山一電機	9,400	1,606.00	15,096,400
図研	9,400	4,020.00	37,788,000
日本電子	27,400	7,930.00	217,282,000
カシオ計算機	116,600	1,621.00	189,008,600
ファナック	127,200	22,800.00	2,900,160,000
日本シイエムケイ	31,300	421.00	13,177,300
エンプラス	6,600	3,010.00	19,866,000
大真空	4,800	4,055.00	19,464,000
ローム	60,300	9,660.00	582,498,000
浜松ホトニクス	104,000	6,400.00	665,600,000
三井ハイテック	14,200	7,140.00	101,388,000
新光電気工業	48,600	3,555.00	172,773,000
京セラ	221,000	6,673.00	1,474,733,000
協栄産業	1,700	1,373.00	2,334,100
太陽誘電	64,400	6,040.00	388,976,000
村田製作所	425,800	8,577.00	3,652,086,600
双葉電子工業	25,400	753.00	19,126,200
日東電工	87,600	7,770.00	680,652,000
北陸電気工業	5,500	1,015.00	5,582,500
東海理化電機製作所	38,300	1,635.00	62,620,500
ニチコン	45,400	1,024.00	46,489,600
日本ケミコン	14,600	1,989.00	29,039,400
K O A	20,000	1,616.00	32,320,000
三井E & Sホールディングス	55,800	541.00	30,187,800
日立造船	114,500	844.00	96,638,000
三菱重工業	227,800	3,010.00	685,678,000
川崎重工業	113,300	2,583.00	292,653,900
I H I	97,400	2,801.00	272,817,400
名村造船所	42,500	238.00	10,115,000
サノヤスホールディングス	17,200	133.00	2,287,600
スプリックス	3,600	1,138.00	4,096,800
マネジメントソリューションズ	7,100	3,700.00	26,270,000
プロレド・パートナーズ	2,800	1,489.00	4,169,200

and factory	2,500	473.00	1,182,500	
テノ・ホールディングス	4,500	944.00	4,248,000	
フロンティア・マネジメント	3,400	989.00	3,362,600	
ピアラ	2,000	735.00	1,470,000	
コプロ・ホールディングス	1,600	1,209.00	1,934,400	
ギークス	2,100	1,432.00	3,007,200	
カーブスホールディングス	37,900	958.00	36,308,200	
フォーラムエンジニアリング	9,600	945.00	9,072,000	
日本車輛製造	5,400	2,070.00	11,178,000	
三菱ロジスネクスト	19,200	1,085.00	20,832,000	
近畿車輛	1,800	1,089.00	1,960,200	
一家ホールディングス	2,800	572.00	1,601,600	
フルサト・マルカホールディングス	13,647	1,938.00	26,447,886	
ヤマエグループホールディングス	10,400	1,084.00	11,273,600	
F P G	47,800	711.00	33,985,800	
島根銀行	4,700	584.00	2,744,800	
じもとホールディングス	10,000	670.00	6,700,000	
全国保証	37,200	5,320.00	197,904,000	
めぶきフィナンシャルグループ	741,700	246.00	182,458,200	
ジャパンインベストメントアドバイザ	11,000	1,312.00	14,432,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,700	1,566.00	27,718,200	
九州フィナンシャルグループ	292,300	400.00	116,920,000	
かんぽ生命保険	177,300	1,987.00	352,295,100	
ゆうちょ銀行	405,800	954.00	387,133,200	
あんしん保証	4,200	317.00	1,331,400	
富山第一銀行	34,500	296.00	10,212,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	870,600	471.00	410,052,600	
ジェイリース	5,600	2,190.00	12,264,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	93,500	709.00	66,291,500	
イントラスト	3,700	789.00	2,919,300	
日本モーゲージサービス	7,200	1,050.00	7,560,000	
C A S A	3,600	952.00	3,427,200	
アルヒ	21,000	1,303.00	27,363,000	
プレミアグループ	7,200	3,335.00	24,012,000	
日産自動車	1,709,600	578.20	988,490,720	
いすゞ自動車	384,700	1,560.00	600,132,000	
トヨタ自動車	7,341,800	2,002.50	14,701,954,500	
日野自動車	180,900	1,110.00	200,799,000	
三菱自動車工業	536,100	332.00	177,985,200	
エフテック	10,000	631.00	6,310,000	
レシップホールディングス	5,800	572.00	3,317,600	
G M B	4,500	889.00	4,000,500	
ファルテック	2,600	713.00	1,853,800	
武蔵精密工業	32,100	1,978.00	63,493,800	
日産車体	21,500	798.00	17,157,000	
新明和工業	41,100	946.00	38,880,600	
極東開発工業	25,000	1,631.00	40,775,000	

トピー工業	12,000	1,218.00	14,616,000
ティラド	4,400	3,075.00	13,530,000
曙ブレーキ工業	79,000	220.00	17,380,000
タチエス	22,200	1,324.00	29,392,800
NOK	70,100	1,306.00	91,550,600
フタバ産業	36,300	479.00	17,387,700
KYB	16,100	3,095.00	49,829,500
市光工業	19,600	575.00	11,270,000
大同メタル工業	30,100	601.00	18,090,100
プレス工業	71,200	335.00	23,852,000
ミクニ	18,500	324.00	5,994,000
太平洋工業	30,200	1,170.00	35,334,000
河西工業	19,900	360.00	7,164,000
アイシン	106,100	4,145.00	439,784,500
マツダ	454,600	996.00	452,781,600
今仙電機製作所	12,800	684.00	8,755,200
本田技研工業	1,141,300	3,440.00	3,926,072,000
スズキ	287,300	5,011.00	1,439,660,300
SUBARU	415,500	2,178.50	905,166,750
安永	7,000	1,191.00	8,337,000
ヤマハ発動機	189,100	3,200.00	605,120,000
小糸製作所	86,900	6,560.00	570,064,000
TBK	17,800	408.00	7,262,400
エクセディ	19,700	1,750.00	34,475,000
ミツバ	26,400	635.00	16,764,000
豊田合成	46,900	2,281.00	106,978,900
愛三工業	22,400	824.00	18,457,600
盟和産業	1,800	1,026.00	1,846,800
日本プラスト	11,900	648.00	7,711,200
ヨロズ	12,500	1,198.00	14,975,000
エフ・シー・シー	23,800	1,647.00	39,198,600
新家工業	3,400	1,687.00	5,735,800
シマノ	58,400	30,270.00	1,767,768,000
テイ・エス テック	67,500	1,492.00	100,710,000
三十三フィナンシャルグループ	12,300	1,414.00	17,392,200
第四北越フィナンシャルグループ	23,300	2,629.00	61,255,700
ひろぎんホールディングス	211,000	649.00	136,939,000
マーキュリアホールディングス	4,800	743.00	3,566,400
おきなわフィナンシャルグループ	13,000	2,500.00	32,500,000
ダイレクトマーケティングミックス	7,400	4,180.00	30,932,000
ポピンズホールディングス	3,200	3,360.00	10,752,000
LITALICO	11,100	3,200.00	35,520,000
十六フィナンシャルグループ	17,800	2,138.00	38,056,400
北國フィナンシャルホールディングス	13,300	2,053.00	27,304,900
ジャムコ	8,400	1,039.00	8,727,600
小野建	12,800	1,608.00	20,582,400
はるやまホールディングス	7,200	580.00	4,176,000
南陽	2,300	1,922.00	4,420,600
ノジマ	25,400	2,866.00	72,796,400
佐鳥電機	9,200	931.00	8,565,200

カッパ・クリエイト	20,100	1,359.00	27,315,900
エコートレーディング	2,900	636.00	1,844,400
伯東	8,500	1,816.00	15,436,000
コンドーテック	11,500	973.00	11,189,500
中山福	8,000	413.00	3,304,000
ライトオン	10,700	695.00	7,436,500
ナガイレベン	19,000	2,320.00	44,080,000
三菱食品	15,700	2,910.00	45,687,000
良品計画	164,200	2,260.00	371,092,000
三城ホールディングス	16,600	260.00	4,316,000
松田産業	10,300	3,255.00	33,526,500
第一興商	27,100	4,055.00	109,890,500
メディバルホールディングス	143,100	2,070.00	296,217,000
アドヴァングループ	14,900	948.00	14,125,200
S P K	6,100	1,391.00	8,485,100
萩原電気ホールディングス	5,300	2,106.00	11,161,800
アルビス	4,700	2,347.00	11,030,900
アズワン	10,200	15,160.00	154,632,000
スズデン	5,100	1,508.00	7,690,800
尾家産業	3,300	1,100.00	3,630,000
シモジマ	8,800	1,145.00	10,076,000
ドウシシャ	13,600	1,685.00	22,916,000
小津産業	2,600	1,923.00	4,999,800
コナカ	16,300	342.00	5,574,600
高速	7,700	1,537.00	11,834,900
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,665.00	2,164,500
G - 7ホールディングス	14,700	2,125.00	31,237,500
たけびし	5,100	1,466.00	7,476,600
イオン北海道	18,800	1,152.00	21,657,600
コジマ	24,300	600.00	14,580,000
ヒマラヤ	4,700	1,018.00	4,784,600
コーナン商事	20,200	3,480.00	70,296,000
ネットワンシステムズ	58,000	3,490.00	202,420,000
エコス	5,200	1,972.00	10,254,400
ワタミ	18,600	1,021.00	18,990,600
マルシェ	3,900	478.00	1,864,200
リックス	2,500	1,500.00	3,750,000
システムソフト	38,600	148.00	5,712,800
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	285,400	2,488.00	710,075,200
丸文	12,700	730.00	9,271,000
西松屋チェーン	31,100	1,439.00	44,752,900
ゼンショーホールディングス	76,700	2,608.00	200,033,600
ハビネット	11,900	1,488.00	17,707,200
幸楽苑ホールディングス	9,100	1,490.00	13,559,000
ハークスレイ	6,000	481.00	2,886,000
橋本総業ホールディングス	2,800	2,138.00	5,986,400
日本ライフライン	46,300	1,295.00	59,958,500
サイゼリヤ	21,100	2,738.00	57,771,800
タカショー	10,700	818.00	8,752,600

VTホールディングス	53,300	518.00	27,609,400
アルゴグラフィックス	11,100	3,155.00	35,020,500
魚力	4,400	2,024.00	8,905,600
IDOM	47,800	877.00	41,920,600
日本エム・ディ・エム	8,300	2,133.00	17,703,900
ポブラ	3,700	217.00	802,900
フジ・コーポレーション	7,600	1,194.00	9,074,400
ユナイテッドアローズ	16,200	2,047.00	33,161,400
進和	8,600	2,276.00	19,573,600
エスケイジャパン	7,600	553.00	4,202,800
ダイترون	5,900	2,125.00	12,537,500
ハイデイ日高	20,600	1,666.00	34,319,600
シークス	20,500	1,184.00	24,272,000
YU-WA CREATION HOLDINGS	9,100	251.00	2,284,100
コロワイド	53,600	1,697.00	90,959,200
ピーシーデポコーポレーション	16,600	446.00	7,403,600
田中商事	3,400	662.00	2,250,800
オーハシテクニカ	7,500	1,514.00	11,355,000
壱番屋	10,200	4,545.00	46,359,000
白銅	5,000	3,105.00	15,525,000
トップカルチャー	5,400	337.00	1,819,800
PLANT	3,700	746.00	2,760,200
スギホールディングス	28,400	7,890.00	224,076,000
ダイコー通産	1,200	1,195.00	1,434,000
薬王堂ホールディングス	6,200	2,396.00	14,855,200
島津製作所	186,500	4,620.00	861,630,000
JMS	12,200	782.00	9,540,400
クボテック	3,400	303.00	1,030,200
長野計器	10,400	1,355.00	14,092,000
ブイ・テクノロジー	6,800	4,500.00	30,600,000
スター精密	22,400	1,506.00	33,734,400
東京計器	9,300	1,016.00	9,448,800
愛知時計電機	1,300	4,675.00	6,077,500
インターアクション	7,200	2,511.00	18,079,200
オーバル	12,600	258.00	3,250,800
東京精密	24,500	4,250.00	104,125,000
マニー	57,700	1,991.00	114,880,700
ニコン	221,400	1,244.00	275,421,600
トプコン	73,000	1,849.00	134,977,000
オリンパス	760,100	2,357.00	1,791,555,700
理研計器	12,800	2,969.00	38,003,200
SCREENホールディングス	25,100	9,030.00	226,653,000
キャノン電子	13,600	1,607.00	21,855,200
タムロン	11,200	2,474.00	27,708,800
HOYA	282,800	16,720.00	4,728,416,000
シード	5,800	678.00	3,932,400
ノーリツ鋼機	13,000	2,280.00	29,640,000
エー・アンド・デイ	12,000	996.00	11,952,000
朝日インテック	158,900	2,818.00	447,780,200

キヤノン	720,200	2,742.50	1,975,148,500	
リコー	368,500	1,170.00	431,145,000	
シチズン時計	183,500	503.00	92,300,500	
リズム	4,300	1,476.00	6,346,800	
大研医器	11,700	589.00	6,891,300	
メニコン	44,500	3,990.00	177,555,000	
シンシア	1,300	585.00	760,500	
中本パックス	3,400	1,743.00	5,926,200	
スノーピーク	9,400	4,625.00	43,475,000	
パラマウントベッドホールディングス	27,900	2,104.00	58,701,600	
トランザクション	7,800	1,105.00	8,619,000	
粧美堂	5,300	415.00	2,199,500	
ニホンフラッシュ	12,400	1,079.00	13,379,600	
前田工織	15,900	3,145.00	50,005,500	
永大産業	20,000	298.00	5,960,000	
アートネイチャー	14,000	727.00	10,178,000	
バンダイナムコホールディングス	119,800	8,107.00	971,218,600	
アイフィスジャパン	3,600	695.00	2,502,000	
共立印刷	24,400	168.00	4,099,200	
SHOEI	13,500	4,695.00	63,382,500	
フランスベッドホールディングス	19,000	910.00	17,290,000	
マーベラス	22,500	699.00	15,727,500	
パイロットコーポレーション	24,500	4,150.00	101,675,000	
萩原工業	9,400	1,562.00	14,682,800	
エイベックス	24,300	1,530.00	37,179,000	
トッパン・フォームズ	26,000	1,016.00	26,416,000	
フジシールインターナショナル	29,800	2,429.00	72,384,200	
タカラトミー	64,900	1,074.00	69,702,600	
広済堂ホールディングス	9,900	1,107.00	10,959,300	
エステールホールディングス	4,200	659.00	2,767,800	
レック	17,300	1,088.00	18,822,400	
タカノ	5,000	743.00	3,715,000	
三光合成	14,800	454.00	6,719,200	
プロネクサス	11,500	1,048.00	12,052,000	
ホクシン	9,600	169.00	1,622,400	
ウッドワン	4,700	1,147.00	5,390,900	
大建工業	9,700	2,217.00	21,504,900	
きもと	21,100	240.00	5,064,000	
凸版印刷	220,400	1,827.00	402,670,800	
大日本印刷	171,300	2,743.00	469,875,900	
共同印刷	4,400	2,616.00	11,510,400	
N I S S H A	29,600	1,707.00	50,527,200	
光村印刷	800	1,573.00	1,258,400	
藤森工業	13,000	4,620.00	60,060,000	
ヴィア・ホールディングス	18,600	189.00	3,515,400	
TAKARA & COMPANY	7,100	1,761.00	12,503,100	
前澤化成工業	9,100	1,257.00	11,438,700	
未来工業	5,400	1,603.00	8,656,200	
アシックス	128,100	2,518.00	322,555,800	
ツツミ	3,600	2,205.00	7,938,000	

ウェーブロックホールディングス	4,900	673.00	3,297,700	
J S P	8,800	1,604.00	14,115,200	
ニチハ	20,200	3,050.00	61,610,000	
ローランド	10,100	5,310.00	53,631,000	
エフピコ	26,700	3,855.00	102,928,500	
小松ウオール工業	4,500	1,890.00	8,505,000	
ヤマハ	86,300	6,970.00	601,511,000	
河合楽器製作所	4,000	3,430.00	13,720,000	
クリナップ	13,500	548.00	7,398,000	
ビジョン	87,600	2,640.00	231,264,000	
天馬	10,900	2,723.00	29,680,700	
兼松サステック	700	1,784.00	1,248,800	
キングジム	11,900	866.00	10,305,400	
象印マホービン	39,200	1,546.00	60,603,200	
リンテック	31,300	2,450.00	76,685,000	
信越ポリマー	22,700	987.00	22,404,900	
東リ	38,600	238.00	9,186,800	
イトーキ	26,700	377.00	10,065,900	
任天堂	82,900	51,450.00	4,265,205,000	
三菱鉛筆	24,000	1,365.00	32,760,000	
松風	6,700	1,996.00	13,373,200	
タカラスタンダード	30,000	1,536.00	46,080,000	
コクヨ	69,500	1,800.00	125,100,000	
ナカバヤシ	14,800	578.00	8,554,400	
ニフコ	53,200	3,570.00	189,924,000	
立川ブラインド工業	6,400	1,267.00	8,108,800	
グローブライト	14,000	3,980.00	55,720,000	
オカムラ	49,700	1,514.00	75,245,800	
バルカー	11,800	2,115.00	24,957,000	
M U T O Hホールディングス	1,300	1,623.00	2,109,900	
伊藤忠商事	998,600	3,288.00	3,283,396,800	
丸紅	1,407,600	956.10	1,345,806,360	
スクロール	21,200	884.00	18,740,800	
高島	1,800	1,900.00	3,420,000	
ヨンドシーホールディングス	13,100	1,732.00	22,689,200	
三陽商会	7,300	921.00	6,723,300	
長瀬産業	78,600	1,897.00	149,104,200	
ナイガイ	4,300	330.00	1,419,000	
蝶理	9,200	1,822.00	16,762,400	
豊田通商	143,400	4,895.00	701,943,000	
オンワードホールディングス	84,800	323.00	27,390,400	
三共生興	21,900	554.00	12,132,600	
兼松	57,000	1,365.00	77,805,000	
美津濃	14,300	2,575.00	36,822,500	
ツカモトコーポレーション	1,900	1,366.00	2,595,400	
ルックホールディングス	4,400	1,366.00	6,010,400	
三井物産	1,108,200	2,597.00	2,877,995,400	
日本紙パルプ商事	7,600	3,770.00	28,652,000	
東京エレクトロン	84,900	46,530.00	3,950,397,000	
カメイ	18,600	1,200.00	22,320,000	



東都水産	1,500	5,400.00	8,100,000	
OUGホールディングス	2,300	2,751.00	6,327,300	
スターゼン	10,600	2,134.00	22,620,400	
セイコーホールディングス	20,500	2,281.00	46,760,500	
山善	55,800	1,053.00	58,757,400	
椿本興業	2,200	3,820.00	8,404,000	
住友商事	901,300	1,625.00	1,464,612,500	
日本ユニシス	49,200	2,983.00	146,763,600	
内田洋行	6,000	4,975.00	29,850,000	
三菱商事	869,200	3,703.00	3,218,647,600	
第一実業	6,400	5,050.00	32,320,000	
キャノンマーケティングジャパン	35,500	2,492.00	88,466,000	
西華産業	7,600	1,632.00	12,403,200	
佐藤商事	11,900	1,220.00	14,518,000	
菱洋エレクトロ	10,900	2,309.00	25,168,100	
東京産業	12,200	690.00	8,418,000	
ユアサ商事	14,600	2,999.00	43,785,400	
神鋼商事	3,100	3,445.00	10,679,500	
トルク	6,300	227.00	1,430,100	
阪和興業	28,500	3,290.00	93,765,000	
正栄食品工業	9,300	4,070.00	37,851,000	
カナデン	12,000	1,004.00	12,048,000	
菱電商事	10,400	1,704.00	17,721,600	
ニプロ	108,100	1,139.00	123,125,900	
岩谷産業	34,200	6,730.00	230,166,000	
ナイス	5,600	1,640.00	9,184,000	
ニチモウ	2,100	1,995.00	4,189,500	
極東貿易	4,500	2,500.00	11,250,000	
アステナホールディングス	19,700	607.00	11,957,900	
兼松エレクトロニクス	7,900	3,720.00	29,388,000	
三愛石油	35,100	1,438.00	50,473,800	
稲畑産業	34,300	1,696.00	58,172,800	
G S Iクレオス	6,800	1,003.00	6,820,400	
明和産業	12,900	778.00	10,036,200	
クワザワホールディングス	4,800	659.00	3,163,200	
キムラタン	76,100	23.00	1,750,300	
ゴールドウイン	23,500	6,750.00	158,625,000	
ユニ・チャーム	279,500	4,636.00	1,295,762,000	
デサント	24,200	3,875.00	93,775,000	
キング	7,700	542.00	4,173,400	
ワキタ	28,100	1,016.00	28,549,600	
ヤマトインターナショナル	12,800	322.00	4,121,600	
東邦ホールディングス	45,900	1,795.00	82,390,500	
サンゲツ	38,100	1,557.00	59,321,700	
ミツウロコグループホールディングス	21,000	1,366.00	28,686,000	
シナネンホールディングス	5,200	3,545.00	18,434,000	
伊藤忠エネクス	31,600	1,045.00	33,022,000	
サンリオ	40,100	2,486.00	99,688,600	
サンワテクノス	9,300	1,483.00	13,791,900	
リョーサン	15,800	2,186.00	34,538,800	

新光商事	19,600	843.00	16,522,800
トーヨー	6,600	1,577.00	10,408,200
三信電気	7,700	1,620.00	12,474,000
東陽テクニカ	13,800	1,107.00	15,276,600
モスフードサービス	20,200	3,185.00	64,337,000
加賀電子	12,900	2,863.00	36,932,700
三益半導体工業	11,300	2,270.00	25,651,000
都築電気	6,300	1,686.00	10,621,800
ソーダニッカ	13,500	625.00	8,437,500
立花エレテック	11,100	1,486.00	16,494,600
木曽路	18,600	2,153.00	40,045,800
S R S ホールディングス	19,300	762.00	14,706,600
千趣会	25,700	389.00	9,997,300
タカキュー	11,100	130.00	1,443,000
リテールパートナーズ	17,300	1,171.00	20,258,300
ケーヨー	26,300	807.00	21,224,100
上新電機	16,400	2,412.00	39,556,800
日本瓦斯	69,200	1,456.00	100,755,200
ロイヤルホールディングス	24,500	2,100.00	51,450,000
東天紅	700	1,128.00	789,600
いなげや	16,000	1,343.00	21,488,000
チヨダ	14,200	770.00	10,934,000
ライフコーポレーション	13,300	3,920.00	52,136,000
リンガーハット	17,600	2,316.00	40,761,600
MrMaxHD	19,600	638.00	12,504,800
テンアライド	14,100	313.00	4,413,300
AOKIホールディングス	27,400	701.00	19,207,400
オークワ	22,400	1,123.00	25,155,200
コメリ	22,100	2,641.00	58,366,100
青山商事	31,500	788.00	24,822,000
しまむら	16,600	9,400.00	156,040,000
はせがわ	5,800	261.00	1,513,800
高島屋	103,700	1,198.00	124,232,600
松屋	31,000	997.00	30,907,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	67,400	901.00	60,727,400
近鉄百貨店	5,500	2,545.00	13,997,500
丸井グループ	120,600	2,150.00	259,290,000
クレディセゾン	83,300	1,505.00	125,366,500
アクシアル リテイリング	11,900	3,620.00	43,078,000
井筒屋	7,100	302.00	2,144,200
イオン	549,400	2,625.50	1,442,449,700
イズミ	29,000	3,460.00	100,340,000
フォーバル	5,100	1,108.00	5,650,800
平和堂	26,400	1,999.00	52,773,600
フジ	17,200	2,023.00	34,795,600
ヤオコー	16,200	6,480.00	104,976,000
ゼビオホールディングス	17,000	1,064.00	18,088,000
ケーズホールディングス	121,300	1,192.00	144,589,600
PALTAC	22,900	5,070.00	116,103,000
三谷産業	18,700	374.00	6,993,800

Olympicグループ	7,500	751.00	5,632,500
日産東京販売ホールディングス	21,600	244.00	5,270,400
新生銀行	116,400	1,897.00	220,810,800
あおぞら銀行	85,100	2,759.00	234,790,900
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,779,300	661.00	6,464,117,300
りそなホールディングス	1,591,300	455.90	725,473,670
三井住友トラスト・ホールディングス	270,300	3,904.00	1,055,251,200
三井住友フィナンシャルグループ	989,400	3,940.00	3,898,236,000
千葉銀行	477,100	751.00	358,302,100
群馬銀行	294,000	372.00	109,368,000
武蔵野銀行	21,300	1,828.00	38,936,400
千葉興業銀行	35,800	279.00	9,988,200
筑波銀行	58,600	177.00	10,372,200
七十七銀行	44,900	1,272.00	57,112,800
青森銀行	11,200	2,136.00	23,923,200
秋田銀行	8,700	1,460.00	12,702,000
山形銀行	16,100	836.00	13,459,600
岩手銀行	9,600	1,686.00	16,185,600
東邦銀行	128,800	212.00	27,305,600
東北銀行	6,800	1,008.00	6,854,400
みちのく銀行	9,300	882.00	8,202,600
ふくおかフィナンシャルグループ	129,000	2,144.00	276,576,000
静岡銀行	348,200	945.00	329,049,000
スルガ銀行	124,800	435.00	54,288,000
八十二銀行	322,200	404.00	130,168,800
山梨中央銀行	16,800	855.00	14,364,000
大垣共立銀行	28,400	1,963.00	55,749,200
福井銀行	12,400	1,456.00	18,054,400
清水銀行	6,000	1,599.00	9,594,000
富山銀行	2,100	2,129.00	4,470,900
滋賀銀行	28,800	1,967.00	56,649,600
南都銀行	20,900	2,032.00	42,468,800
百五銀行	129,700	333.00	43,190,100
京都銀行	51,200	5,160.00	264,192,000
紀陽銀行	50,700	1,545.00	78,331,500
ほくほくフィナンシャルグループ	95,300	858.00	81,767,400
山陰合同銀行	90,200	567.00	51,143,400
中国銀行	123,400	852.00	105,136,800
鳥取銀行	4,400	1,110.00	4,884,000
伊予銀行	190,000	582.00	110,580,000
百十四銀行	15,300	1,538.00	23,531,400
四国銀行	20,500	747.00	15,313,500
阿波銀行	22,100	2,136.00	47,205,600
大分銀行	8,300	1,895.00	15,728,500
宮崎銀行	9,000	2,110.00	18,990,000
佐賀銀行	8,100	1,485.00	12,028,500
琉球銀行	31,000	773.00	23,963,000
セブン銀行	477,200	248.00	118,345,600
みずほフィナンシャルグループ	1,942,900	1,587.00	3,083,382,300
高知銀行	4,600	797.00	3,666,200

山口フィナンシャルグループ	178,900	668.00	119,505,200	
芙蓉総合リース	15,000	7,710.00	115,650,000	
みずほリース	22,100	3,585.00	79,228,500	
東京センチュリー	33,300	6,250.00	208,125,000	
SBIホールディングス	176,200	2,950.00	519,790,000	
日本証券金融	60,100	846.00	50,844,600	
アイフル	238,900	382.00	91,259,800	
日本アジア投資	11,300	239.00	2,700,700	
長野銀行	4,600	1,127.00	5,184,200	
名古屋銀行	11,500	2,595.00	29,842,500	
北洋銀行	215,500	247.00	53,228,500	
愛知銀行	4,700	3,640.00	17,108,000	
中京銀行	5,400	1,390.00	7,506,000	
大光銀行	3,900	1,371.00	5,346,900	
愛媛銀行	20,400	791.00	16,136,400	
トマト銀行	5,700	1,060.00	6,042,000	
京葉銀行	61,500	443.00	27,244,500	
栃木銀行	68,300	181.00	12,362,300	
北日本銀行	4,400	1,576.00	6,934,400	
東和銀行	25,200	531.00	13,381,200	
福島銀行	15,600	253.00	3,946,800	
大東銀行	6,600	695.00	4,587,000	
リコーリース	11,300	3,735.00	42,205,500	
イオンフィナンシャルサービス	87,400	1,531.00	133,809,400	
アコム	282,300	410.00	115,743,000	
ジャックス	15,600	3,045.00	47,502,000	
オリエントコーポレーション	385,500	165.00	63,607,500	
オリックス	867,900	2,153.00	1,868,588,700	
三菱HCキャピタル	494,900	590.00	291,991,000	
ジャフコグループ	18,100	6,980.00	126,338,000	
九州リースサービス	7,300	612.00	4,467,600	
トモニホールディングス	110,600	328.00	36,276,800	
大和証券グループ本社	1,071,000	670.80	718,426,800	
野村ホールディングス	2,182,700	555.30	1,212,053,310	
岡三証券グループ	122,300	392.00	47,941,600	
丸三証券	42,200	621.00	26,206,200	
東洋証券	45,400	169.00	7,672,600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	152,200	407.00	61,945,400	
光世証券	3,300	594.00	1,960,200	
水戸証券	37,700	299.00	11,272,300	
いちよし証券	28,200	666.00	18,781,200	
松井証券	70,400	824.00	58,009,600	
SOMPOホールディングス	252,000	5,013.00	1,263,276,000	
日本取引所グループ	386,200	2,776.50	1,072,284,300	
マネックスグループ	127,600	648.00	82,684,800	
極東証券	19,100	802.00	15,318,200	
岩井コスモホールディングス	14,400	1,397.00	20,116,800	
アイザワ証券グループ	25,500	1,017.00	25,933,500	
フィデアホールディングス	13,500	1,225.00	16,537,500	

池田泉州ホールディングス	162,700	168.00	27,333,600	
アニコムホールディングス	40,000	903.00	36,120,000	
MS&ADインシュアランスグループ ホールディングス	347,300	3,771.00	1,309,668,300	
マネーパートナーズグループ	14,300	218.00	3,117,400	
スパークス・グループ	65,500	272.00	17,816,000	
小林洋行	3,300	266.00	877,800	
第一生命ホールディングス	703,500	2,493.00	1,753,825,500	
東京海上ホールディングス	470,800	6,130.00	2,886,004,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	6,800	1,034.00	7,031,200	
イー・ギャランティ	16,700	2,379.00	39,729,300	
アサックス	7,900	702.00	5,545,800	
NECキャピタルソリューション	5,800	2,074.00	12,029,200	
T&Dホールディングス	427,000	1,564.00	667,828,000	
アドバンスクリエイト	6,700	1,057.00	7,081,900	
三井不動産	651,500	2,568.50	1,673,377,750	
三菱地所	939,500	1,706.50	1,603,256,750	
平和不動産	24,500	3,560.00	87,220,000	
東京建物	141,000	1,657.00	233,637,000	
ダイビル	36,200	1,521.00	55,060,200	
京阪神ビルディング	24,600	1,395.00	34,317,000	
住友不動産	321,500	4,043.00	1,299,824,500	
太平洋興発	5,700	691.00	3,938,700	
テオーシー	26,300	645.00	16,963,500	
東京楽天地	2,200	4,010.00	8,822,000	
レオパレス21	118,100	250.00	29,525,000	
スターツコーポレーション	17,000	2,660.00	45,220,000	
フジ住宅	16,700	693.00	11,573,100	
空港施設	14,500	568.00	8,236,000	
明和地所	6,700	613.00	4,107,100	
ゴールドクレスト	12,900	1,651.00	21,297,900	
リログループ	75,700	2,306.00	174,564,200	
エスリード	5,500	1,640.00	9,020,000	
日神グループホールディングス	21,200	516.00	10,939,200	
日本エスコン	26,600	807.00	21,466,200	
タカラレーベン	59,700	319.00	19,044,300	
A V A N T I A	7,400	871.00	6,445,400	
イオンモール	71,800	1,667.00	119,690,600	
毎日コムネット	3,900	788.00	3,073,200	
ファースト住建	5,500	1,316.00	7,238,000	
ランド	764,100	12.00	9,169,200	
カチタス	35,400	3,995.00	141,423,000	
東祥	8,600	1,857.00	15,970,200	
トーセイ	19,700	1,175.00	23,147,500	
穴吹興産	3,100	2,019.00	6,258,900	
サンフロンティア不動産	17,200	1,073.00	18,455,600	
FJネクストホールディングス	14,000	1,018.00	14,252,000	
インテリックス	2,900	734.00	2,128,600	
ランドビジネス	6,100	269.00	1,640,900	
サンネクスタグループ	4,700	1,000.00	4,700,000	

グランディハウス	9,100	486.00	4,422,600
東武鉄道	151,100	2,820.00	426,102,000
相鉄ホールディングス	49,800	2,138.00	106,472,400
東急	365,600	1,585.00	579,476,000
京浜急行電鉄	186,100	1,280.00	238,208,000
小田急電鉄	232,200	2,403.00	557,976,600
京王電鉄	81,000	5,580.00	451,980,000
京成電鉄	108,600	3,530.00	383,358,000
富士急行	19,800	4,445.00	88,011,000
新京成電鉄	3,800	2,065.00	7,847,000
東日本旅客鉄道	255,100	7,354.00	1,876,005,400
西日本旅客鉄道	161,700	5,487.00	887,247,900
東海旅客鉄道	120,500	17,115.00	2,062,357,500
西武ホールディングス	174,400	1,292.00	225,324,800
鴻池運輸	23,300	1,225.00	28,542,500
西日本鉄道	40,300	2,708.00	109,132,400
ハマキョウレックス	11,300	3,235.00	36,555,500
サカイ引越センター	6,800	4,710.00	32,028,000
近鉄グループホールディングス	137,400	3,605.00	495,327,000
阪急阪神ホールディングス	183,200	3,400.00	622,880,000
南海電気鉄道	65,100	2,276.00	148,167,600
京阪ホールディングス	61,200	2,948.00	180,417,600
神戸電鉄	3,500	3,400.00	11,900,000
名古屋鉄道	112,900	1,920.00	216,768,000
山陽電気鉄道	10,000	1,955.00	19,550,000
アルプス物流	9,700	1,017.00	9,864,900
トランコム	4,200	8,520.00	35,784,000
日本通運	47,600	7,500.00	357,000,000
ヤマトホールディングス	192,400	2,778.00	534,487,200
山九	35,300	5,080.00	179,324,000
日新	11,100	1,609.00	17,859,900
丸運	8,500	268.00	2,278,000
丸全昭和運輸	11,200	3,385.00	37,912,000
センコーグループホールディングス	75,900	1,000.00	75,900,000
トナミホールディングス	2,900	4,690.00	13,601,000
ニッコンホールディングス	46,400	2,204.00	102,265,600
日本石油輸送	1,000	2,691.00	2,691,000
福山通運	17,600	4,675.00	82,280,000
セイノーホールディングス	103,000	1,337.00	137,711,000
エスライン	3,300	917.00	3,026,100
神奈川中央交通	3,700	3,415.00	12,635,500
日立物流	28,300	4,730.00	133,859,000
丸和運輸機関	29,000	1,537.00	44,573,000
C & F ロジホールディングス	13,900	1,607.00	22,337,300
日本郵船	114,700	7,670.00	879,749,000
商船三井	81,300	6,960.00	565,848,000
川崎汽船	42,200	5,250.00	221,550,000
NSユナイテッド海運	6,300	3,870.00	24,381,000
明治海運	14,300	795.00	11,368,500
飯野海運	63,100	548.00	34,578,800

共栄タンカー	2,500	1,019.00	2,547,500	
九州旅客鉄道	105,900	2,620.00	277,458,000	
S Gホールディングス	259,400	2,908.00	754,335,200	
日本航空	334,200	2,548.00	851,541,600	
A N Aホールディングス	370,300	2,764.00	1,023,509,200	
パスコ	2,500	1,521.00	3,802,500	
T R Eホールディングス	19,792	1,537.00	30,420,304	
人・夢・技術グループ	6,200	2,002.00	12,412,400	
西本W i s m e t t a cホールディングス	3,200	3,595.00	11,504,000	
シルバーライフ	2,800	1,515.00	4,242,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	2,054.00	2,464,800	
Genky Drug Stores	6,200	5,170.00	32,054,000	
コア商事ホールディングス	10,600	719.00	7,621,400	
国際紙パルプ商事	29,700	367.00	10,899,900	
ナルミヤ・インターナショナル	2,600	1,037.00	2,696,200	
ブックオフグループホールディングス	8,400	971.00	8,156,400	
ギフト	3,500	2,917.00	10,209,500	
三菱倉庫	47,600	3,170.00	150,892,000	
三井倉庫ホールディングス	14,500	2,320.00	33,640,000	
住友倉庫	48,600	1,818.00	88,354,800	
澁澤倉庫	7,700	2,129.00	16,393,300	
ヤマタネ	6,300	1,578.00	9,941,400	
東陽倉庫	23,600	328.00	7,740,800	
乾汽船	9,300	2,309.00	21,473,700	
日本トランスシティ	30,300	590.00	17,877,000	
ケイヒン	1,900	1,433.00	2,722,700	
中央倉庫	8,900	981.00	8,730,900	
川西倉庫	2,600	1,155.00	3,003,000	
安田倉庫	12,000	971.00	11,652,000	
ファイズホールディングス	2,200	710.00	1,562,000	
東洋埠頭	3,300	1,454.00	4,798,200	
宇徳	10,100	525.00	5,302,500	
上組	75,600	2,271.00	171,687,600	
サンリツ	2,600	809.00	2,103,400	
キムラユニティー	3,900	1,441.00	5,619,900	
キューソー流通システム	3,600	1,833.00	6,598,800	
近鉄エクスプレス	25,900	2,705.00	70,059,500	
東海運	8,800	335.00	2,948,000	
エーアイティー	8,600	1,154.00	9,924,400	
内外トランスライン	5,100	2,083.00	10,623,300	
ショーエイコーポレーション	2,900	806.00	2,337,400	
日本コンセプト	4,300	1,800.00	7,740,000	
T B Sホールディングス	94,300	1,727.00	162,856,100	
日本テレビホールディングス	118,700	1,280.00	151,936,000	
朝日放送グループホールディングス	14,600	721.00	10,526,600	
テレビ朝日ホールディングス	43,800	1,780.00	77,964,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	93,200	444.00	41,380,800	
テレビ東京ホールディングス	10,300	2,195.00	22,608,500	
日本B S放送	4,800	1,112.00	5,337,600	

ビジョン	24,000	1,419.00	34,056,000
スマートバリュー	3,400	652.00	2,216,800
USEN-NEXT HOLDINGS	13,400	3,425.00	45,895,000
ワイヤレスゲート	5,400	396.00	2,138,400
コネクシオ	8,200	1,574.00	12,906,800
日本通信	124,600	202.00	25,169,200
クロップス	2,600	983.00	2,555,800
日本電信電話	1,663,700	3,098.00	5,154,142,600
KDDI	1,140,700	3,671.00	4,187,509,700
ソフトバンク	1,292,500	1,517.00	1,960,722,500
光通信	16,700	17,750.00	296,425,000
エムティーアイ	13,300	744.00	9,895,200
GMOインターネット	50,200	2,846.00	142,869,200
ファイバーゲート	4,400	1,415.00	6,226,000
アйдママーケティングコミュニケーション	3,200	376.00	1,203,200
KADOKAWA	36,800	6,050.00	222,640,000
学研ホールディングス	19,900	1,120.00	22,288,000
ゼンリン	25,800	1,009.00	26,032,200
昭文社ホールディングス	4,800	498.00	2,390,400
インプレスホールディングス	16,700	267.00	4,458,900
東京電力ホールディングス	1,228,500	360.00	442,260,000
中部電力	443,700	1,301.00	577,253,700
関西電力	549,200	1,084.00	595,332,800
中国電力	209,200	994.00	207,944,800
北陸電力	132,500	594.00	78,705,000
東北電力	339,500	788.00	267,526,000
四国電力	120,600	759.00	91,535,400
九州電力	320,100	841.00	269,204,100
北海道電力	135,200	522.00	70,574,400
沖縄電力	28,400	1,436.00	40,782,400
電源開発	115,200	1,608.00	185,241,600
エフオン	10,800	850.00	9,180,000
イーレックス	21,200	2,493.00	52,851,600
レノバ	24,700	4,340.00	107,198,000
東京瓦斯	277,900	1,935.50	537,875,450
大阪瓦斯	262,600	1,956.00	513,645,600
東邦瓦斯	71,200	3,970.00	282,664,000
北海道瓦斯	8,000	1,513.00	12,104,000
広島ガス	30,900	373.00	11,525,700
西部ガスホールディングス	16,400	2,320.00	38,048,000
静岡ガス	37,400	1,278.00	47,797,200
メタウォーター	16,400	1,828.00	29,979,200
アイネット	7,000	1,261.00	8,827,000
松竹	9,400	12,130.00	114,022,000
東宝	83,900	5,120.00	429,568,000
エイチ・アイ・エス	30,600	2,654.00	81,212,400
東映	4,600	21,590.00	99,314,000
ラックランド	3,900	2,837.00	11,064,300



エヌ・ティ・ティ・データ	378,300	2,142.00	810,318,600
共立メンテナンス	22,900	4,230.00	96,867,000
イチネンホールディングス	14,500	1,298.00	18,821,000
建設技術研究所	8,200	2,565.00	21,033,000
スペース	10,200	926.00	9,445,200
アインホールディングス	20,800	6,310.00	131,248,000
燦ホールディングス	5,900	1,457.00	8,596,300
ピー・シー・エー	7,600	1,828.00	13,892,800
スバル興業	800	8,100.00	6,480,000
東京テアトル	5,600	1,243.00	6,960,800
タナベ経営	5,000	739.00	3,695,000
ビジネスブレイン太田昭和	6,600	1,801.00	11,886,600
ナガワ	4,400	12,510.00	55,044,000
東京都競馬	10,300	4,380.00	45,114,000
常磐興産	5,700	1,431.00	8,156,700
カナモト	24,500	2,552.00	62,524,000
D T S	29,200	2,488.00	72,649,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	60,700	5,990.00	363,593,000
シーイーシー	14,800	1,296.00	19,180,800
カブコン	121,800	2,997.00	365,034,600
西尾レントオール	12,800	2,794.00	35,763,200
アイ・エス・ビー	9,800	1,232.00	12,073,600
アゴーラ ホスピタリティグループ	79,300	25.00	1,982,500
日本空港ビルデング	49,700	5,590.00	277,823,000
トランス・コスモス	13,100	3,550.00	46,505,000
乃村工藝社	59,300	1,038.00	61,553,400
ジャステック	8,100	1,257.00	10,181,700
S C S K	98,300	2,283.00	224,418,900
藤田観光	5,900	2,492.00	14,702,800
K N T - C Tホールディングス	7,300	1,728.00	12,614,400
日本管財	14,700	2,700.00	39,690,000
トーカイ	13,400	2,174.00	29,131,600
白洋舎	1,100	2,008.00	2,208,800
セコム	136,600	8,098.00	1,106,186,800
日本システムウエア	4,400	2,380.00	10,472,000
セントラル警備保障	6,700	2,845.00	19,061,500
アイネス	13,500	1,561.00	21,073,500
丹青社	25,900	925.00	23,957,500
メイテック	16,700	6,240.00	104,208,000
T K C	23,900	3,305.00	78,989,500
富士ソフト	15,100	5,650.00	85,315,000
応用地質	15,500	1,559.00	24,164,500
船井総研ホールディングス	28,300	2,950.00	83,485,000
N S D	45,300	1,926.00	87,247,800
進学会ホールディングス	7,400	412.00	3,048,800
丸紅建材リース	1,000	1,838.00	1,838,000
オオバ	9,700	817.00	7,924,900
コナミホールディングス	51,600	6,270.00	323,532,000

いであ	3,600	1,992.00	7,171,200
学究社	3,900	1,391.00	5,424,900
ベネッセホールディングス	50,800	2,494.00	126,695,200
イオンディライト	17,000	3,470.00	58,990,000
ナック	7,200	970.00	6,984,000
福井コンピュータホールディングス	7,100	4,050.00	28,755,000
ダイセキ	27,700	5,120.00	141,824,000
ステップ	5,000	1,878.00	9,390,000
日鉄物産	10,300	5,090.00	52,427,000
泉州電業	3,900	4,495.00	17,530,500
元気寿司	3,900	2,758.00	10,756,200
トラスコ中山	29,700	2,730.00	81,081,000
ヤマダホールディングス	478,400	461.00	220,542,400
オートバックスセブン	51,500	1,520.00	78,280,000
モリト	10,400	669.00	6,957,600
アークランドサカモト	22,300	1,686.00	37,597,800
ニトリホールディングス	56,600	20,345.00	1,151,527,000
グルメ杵屋	10,700	979.00	10,475,300
愛眼	8,500	220.00	1,870,000
ケーユーホールディングス	7,500	1,074.00	8,055,000
吉野家ホールディングス	46,900	2,119.00	99,381,100
加藤産業	20,800	3,315.00	68,952,000
北恵	3,600	1,039.00	3,740,400
イノテック	8,000	1,316.00	10,528,000
イエローハット	26,800	1,914.00	51,295,200
松屋フーズホールディングス	7,000	3,660.00	25,620,000
JBCホールディングス	9,300	1,560.00	14,508,000
JKホールディングス	13,100	806.00	10,558,600
サガミホールディングス	21,900	1,002.00	21,943,800
日伝	11,900	2,236.00	26,608,400
関西スーパーマーケット	10,600	1,915.00	20,299,000
ミロク情報サービス	13,900	1,692.00	23,518,800
北沢産業	8,100	250.00	2,025,000
杉本商事	7,200	2,430.00	17,496,000
因幡電機産業	38,200	2,666.00	101,841,200
王将フードサービス	9,500	5,990.00	56,905,000
プレナス	16,000	2,093.00	33,488,000
ミニストップ	10,800	1,388.00	14,990,400
アークス	27,300	2,211.00	60,360,300
バローホールディングス	29,200	2,401.00	70,109,200
東テク	4,400	2,581.00	11,356,400
ミスミグループ本社	179,100	4,535.00	812,218,500
藤久	3,300	771.00	2,544,300
アルテック	9,800	315.00	3,087,000
ベルク	7,100	5,580.00	39,618,000
大庄	7,800	1,013.00	7,901,400
タキヒヨー	4,700	1,796.00	8,441,200
ファーストリテイリング	19,000	71,110.00	1,351,090,000
ソフトバンクグループ	1,128,500	6,261.00	7,065,538,500
蔵王産業	2,100	1,740.00	3,654,000

スズケン	60,500	3,220.00	194,810,000	
サンドラッグ	53,700	3,445.00	184,996,500	
サックスパー ホールディングス	12,300	567.00	6,974,100	
ジェコス	10,500	875.00	9,187,500	
ヤマザワ	2,900	1,711.00	4,961,900	
やまや	3,000	2,411.00	7,233,000	
グローセル	16,000	407.00	6,512,000	
ベルーナ	30,500	833.00	25,406,500	
合計	159,150,973		393,970,303,892	

(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)」にて記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2021年10月29日現在

資産総額	16,705,927,116円
負債総額	4,677,647円
純資産総額( - )	16,701,249,469円
発行済数量	5,414,967,306口
1口当たり純資産額( / )	3.0843円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2021年10月29日現在

資産総額	484,778,073,320円
負債総額	9,475,858,650円
純資産総額( - )	475,302,214,670円
発行済数量	143,675,610,760口
1口当たり純資産額( / )	3.3082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(2021年10月29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(2021年10月29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. 投資環境見通しおよび運用方針の策定

経済環境見通し、資産別市場見通し、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。

2021年10月29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	1,389,726,868,805
追加型株式投資信託	831	15,977,901,845,268
単位型公社債投資信託	28	60,426,385,134
単位型株式投資信託	220	1,327,861,039,257
合計	1,105	18,755,916,138,464



### 3【委託会社等の経理状況】

- 1．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。  
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第37期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第36期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第37期事業年度の中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第36期事業年度（自2020年4月1日至2021年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受け、第37期中間会計期間（自2021年4月1日至2021年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	32,932,013	36,734,502
金銭の信託	28,548,165	25,670,526
有価証券	996	-
未収委託者報酬	11,487,393	16,804,456
未収運用受託報酬	4,674,225	5,814,654
未収投資助言報酬	331,543	317,567
未収収益	11,674	7,412
前払費用	480,129	724,591
その他	2,815,351	2,419,487
流動資産計	81,281,494	88,493,198
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 1,006,793	1 915,815
器具備品	1 270,768	1 202,902
建設仮勘定	894	609
無形固定資産		
ソフトウェア	3,299,065	2,878,179
ソフトウェア仮勘定	221,784	1,109,723
電話加入権	3,931	3,931
投資その他の資産		
投資有価証券	261,361	261,360
関係会社株式	5,299,196	5,299,196
長期差入保証金	1,302,402	1,324,203
繰延税金資産	2,508,004	3,676,823
その他	111,162	591,970
固定資産計	14,285,364	16,264,717
資産合計	95,566,859	104,757,915

(単位:千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	3,702,906	3,730,283
未払金	4,803,140	7,337,541
未払収益分配金	966	846
未払償還金	9,999	9,999
未払手数料	4,582,140	6,889,193
その他未払金	210,034	437,502
未払費用	6,673,320	9,713,972
未払法人税等	4,090,268	4,199,922
未払消費税等	1,338,183	2,106,617
賞与引当金	1,373,328	1,789,597
役員賞与引当金	65,290	76,410
流動負債計	22,046,438	28,954,345
固定負債		
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
時効後支払損引当金	174,139	157,945
固定負債計	2,293,087	2,450,431
負債合計	24,339,526	31,404,777
(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	49,674,383	51,800,187
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	49,551,090	51,676,893
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	17,871,090	19,996,893
株主資本計	71,227,341	73,353,144
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	7	6
評価・換算差額等計	7	6
純資産合計	71,227,333	73,353,137
負債・純資産合計	95,566,859	104,757,915

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	84,426,075		89,905,293	
運用受託報酬	16,912,305		17,640,234	
投資助言報酬	1,208,954		1,103,477	
その他営業収益	68,156		781,735	
営業収益計		102,615,492		109,430,741
営業費用				
支払手数料	34,980,736		37,003,102	
広告宣伝費	340,791		424,598	
公告費	375		400	
調査費	25,132,268		30,794,092	
調査費	10,586,542		11,302,420	
委託調査費	14,545,725		19,491,671	
委託計算費	698,723		543,135	
営業雑経費	990,002		938,891	
通信費	44,209		46,358	
印刷費	738,330		680,272	
協会費	71,386		71,361	
諸会費	22,790		23,936	
支払販売手数料	113,286		116,962	
営業費用計		62,142,897		69,704,220
一般管理費				
給料	10,817,861		10,586,117	
役員報酬	174,795		163,394	
給料・手当	9,087,800		9,030,562	
賞与	1,555,264		1,392,160	
交際費	40,436		8,168	
寄付金	8,906		7,757	
旅費交通費	320,037		50,081	
租税公課	651,265		912,570	
不動産賃借料	1,479,503		1,499,753	
退職給付費用	505,189		524,845	
固定資産減価償却費	882,526		1,078,185	
福利厚生費	44,352		44,004	
修繕費	1,843		777	
賞与引当金繰入額	1,373,328		1,789,597	
役員賞与引当金繰入額	65,290		76,410	
機器リース料	233		208	
事務委託費	3,625,424		3,793,883	
事務用消耗品費	104,627		68,534	
器具備品費	1,620		548	
諸経費	197,094		152,830	
一般管理費計		20,119,543		20,594,276
営業利益		20,353,050		19,132,244

(単位:千円)

	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	4,440		27,079	
受取配当金	11,185		2,356	
時効成立分配金・償還金	49,164		362	
投資信託償還益	5,528		-	
為替差益	-		7,314	
金銭の信託運用益	-		1,229,697	
受取負担金	297,886		-	
雑収入	7,394		13,505	
時効後支払損引当金戻入額	3,473		13,011	
営業外収益計		379,073		1,293,326
営業外費用				
為替差損	19,750		-	
投資信託償還損	1		3	
金銭の信託運用損	169,505		-	
システム解約料	31,680		-	
早期割増退職金	-		48,755	
雑損失	104		5	
営業外費用計		221,042		48,764
経常利益		20,511,082		20,376,806
特別利益				
投資有価証券売却益	1,169,758		-	
特別利益計		1,169,758		-
特別損失				
固定資産除却損	1 16,085		1 1,511	
特別損失計		16,085		1,511
税引前当期純利益		21,664,754		20,375,294
法人税、住民税及び事業税		7,045,579		7,418,311
法人税等調整額		385,835		1,168,820
法人税等合計		6,659,743		6,249,491
当期純利益		15,005,011		14,125,803

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		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	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	31,680,000	14,146,079	45,949,372	67,502,329
当期変動額									
剰余金の配当							11,280,000	11,280,000	11,280,000
当期純利益							15,005,011	15,005,011	15,005,011
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,725,011	3,725,011	3,725,011
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	846,755	846,755	68,349,085
当期変動額			
剰余金の配当			11,280,000
当期純利益			15,005,011
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	846,763	846,763	846,763
当期変動額合計	846,763	846,763	2,878,247
当期末残高	7	7	71,227,333

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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				株主資本 合計
		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		利益剰余金 合計	
						別途 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	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341
当期変動額									
剰余金の配当							12,000,000	12,000,000	12,000,000
当期純利益							14,125,803	14,125,803	14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,125,803	2,125,803	2,125,803
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	19,996,893	51,800,187	73,353,144

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	7	7	71,227,333
当期変動額			
剰余金の配当			12,000,000
当期純利益			14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	1	1	1
当期変動額合計	1	1	2,125,804
当期末残高	6	6	73,353,137

## 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>
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。



(未適用の会計基準等)

## 1. 収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)

### (1) 概要

国際会計基準審議会(IASB)及び米国財務会計基準審議会(FASB)は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、2014年5月に「顧客との契約から生じる収益」(IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic 606)を公表しており、IFRS第15号は2018年1月1日以後開始する事業年度から、Topic 606は2017年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわせない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

### (2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

## 2. 時価の算定に関する会計基準等

- ・「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)

### (1) 概要

国際会計基準審議会(IASB)及び米国財務会計基準審議会(FASB)が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス(国際財務報告基準(IFRS)においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」)を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされています。

### (2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

**注記事項**

(貸借対照表関係)

## 1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
建物	320,020	407,133
器具備品	949,984	978,763

(損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第35期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)	第36期 (自2020年4月1日 至2021年3月31日)
建物	-	944
器具備品	9,609	566
ソフトウエア	6,475	-

(株主資本等変動計算書関係)

第35期(自2019年4月1日至2020年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019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

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
2020年6月17日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種 類株式					

## 第36期(自2020年4月1日至2021年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18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  
2021年6月16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
2021年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2021年3月31日	2021年6月17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あります。

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あります。

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あります。

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35期(2020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	32,932,013	32,932,013	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	28,548,165	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	11,487,393	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	4,674,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	2,988	2,988	-
資産計	77,644,787	77,644,787	-
(1) 未払手数料	4,582,140	4,582,140	-
負債計	4,582,140	4,582,140	-

第36期(2021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	36,734,502	36,734,502	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	25,670,526	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	16,804,456	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	5,814,654	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	1,990	1,990	-
資産計	85,026,130	85,026,130	-
(1) 未払手数料	6,889,193	6,889,193	-
負債計	6,889,193	6,889,193	-

## (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、投資信託は基準価額によっております。

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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
非上場株式	259,369	259,369
関係会社株式	5,299,196	5,299,196

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35期(2020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	32,932,013	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	996	994	997	-

## 第36期(2021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	36,734,502	-	-	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1,990	-	-

## (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35期の貸借対照表計上額5,299,196千円、第36期の貸借対照表計上額5,299,196千円)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、記載していません。

## 2. その他有価証券

第35期(2020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	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計			
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	2,988	3,000	11
小計	2,988	3,000	11
合計	2,988	3,000	11

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額259,369千円)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36期(2021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	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計			
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	1,990	2,000	9
小計	1,990	2,000	9
合計	1,990	2,000	9

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額259,369千円)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35期（自 2019年4月1日 至 2020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	1,298,377	1,169,758	-
投資信託	159,526	5,528	1

## 第36期（自 2020年4月1日 至 2021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)
投資信託	996	-	3

（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、償還によるものであります。

## （退職給付関係）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度（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。

## 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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,289,044	2,422,901
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の発生額	18,448	4,319
退職給付の支払額	187,749	245,143
過去勤務費用の発生額	-	1,567
その他	1,476	1,567
退職給付債務の期末残高	2,422,901	2,479,619

## (2) 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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未積立退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未認識数理計算上の差異	130,155	84,264
未認識過去勤務費用	173,798	102,868
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486



## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の費用処理額	38,861	41,571
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,362
その他	11,303	7,720
確定給付制度に係る退職給付費用	401,711	409,394

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、当事業年度において48,755千円を営業外費用に計上しております。

## (4) 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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021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% ~ 3.76%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度103,477千円、当事業年度100,806千円であります。

## (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35期	第36期
	(2020年3月31日現在)	(2021年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	221,053	260,377
未払事業所税	10,778	10,711
賞与引当金	420,513	547,974
未払法定福利費	78,439	92,748
未払給与	10,410	8,535
受取負担金	47,781	-
運用受託報酬	331,395	1,410,516
資産除去債務	14,116	18,079
減価償却超過額(一括償却資産)	50,942	25,808
減価償却超過額	82,684	51,986
繰延資産償却超過額(税法上)	323,132	301,965
退職給付引当金	648,821	701,959
時効後支払損引当金	53,321	48,362
ゴルフ会員権評価損	7,360	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
その他	11,532	5,283
その他有価証券評価差額金	3	2
繰延税金資産小計	2,508,004	3,676,823
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,508,004	3,676,823
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	2,508,004	3,676,823

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IA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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	94,605,736千円	84,609,003千円
資産合計	94,605,736千円	84,609,003千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	8,278,713千円	5,570,814千円
負債合計	8,278,713千円	5,570,814千円
純資産	86,327,023千円	79,038,188千円

(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	62,885,491千円	59,074,249千円
顧客関連資産	34,810,031千円	29,793,358千円

## (2) 損益計算書項目

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	8,954,439千円	8,823,626千円
経常利益	8,954,439千円	8,823,626千円
税引前当期純利益	9,111,312千円	8,823,626千円
当期純利益	7,536,465千円	7,288,834千円
1株当たり当期純利益	188,411円64銭	182,220円85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	5,149,555千円	5,016,672千円

(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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)及び第36期(自 2020年4月1日 至 2021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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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	5,793,912	未払 手数料	1,112,061
	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	10,294,840	未払 手数料	1,231,431

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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	6,435,839	未払 手数料	1,457,765
	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	12,767,199	未払 手数料	2,524,882

## 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) 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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	1,780,683円32銭	1,833,828円44銭
1株当たり当期純利益金額	375,125円27銭	353,145円08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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
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	15,005,011千円	14,125,803千円
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。



## (1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		28,648
金銭の信託		25,866
未収委託者報酬		18,882
未収運用受託報酬		2,911
未収投資助言報酬		319
未収収益		15
前払費用		996
その他		2,470
	流動資産計	80,112
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	792
器具備品	1	184
無形固定資産		
ソフトウェア		4,193
ソフトウェア仮勘定		3,475
電話加入権		714
電話加入権		3
投資その他の資産		
投資有価証券		10,724
関係会社株式		261
長期差入保証金		5,299
繰延税金資産		1,273
繰延税金資産		3,311
その他		578
	固定資産計	15,895
資産合計		96,007

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,845
未払金	7,922
未払収益分配金	0
未払償還金	9
未払手数料	7,759
その他未払金	153
未払費用	7,337
未払法人税等	3,423
未払消費税等	1,234
契約負債	20
賞与引当金	836
役員賞与引当金	33
	流動負債計
	22,653
固定負債	
退職給付引当金	2,391
時効後支払損引当金	147
	固定負債計
	2,538
負債合計	25,192
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	19,552
資本準備金	2,428
その他資本剰余金	17,124
利益剰余金	49,261
利益準備金	123
その他利益剰余金	49,138
別途積立金	31,680
繰越利益剰余金	17,458
	株主資本計
	70,814
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	0
	評価・換算差額等計
	0
純資産合計	70,814
負債・純資産合計	96,007

## (2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	54,995	
運用受託報酬	7,193	
投資助言報酬	569	
その他営業収益	6	
		営業収益計 62,765
営業費用		
支払手数料	22,800	
広告宣伝費	126	
公告費	0	
調査費	17,656	
調査費	4,722	
委託調査費	12,934	
委託計算費	281	
営業雑経費	437	
通信費	17	
印刷費	315	
協会費	33	
諸会費	17	
支払販売手数料	52	
		営業費用計 41,301
一般管理費		
給料	4,865	
役員報酬	82	
給料・手当	4,565	
賞与	217	
交際費	1	
寄付金	4	
旅費交通費	13	
租税公課	292	
不動産賃借料	892	
退職給付費用	248	
固定資産減価償却費	1 670	
福利厚生費	16	
修繕費	0	
賞与引当金繰入額	836	
役員賞与引当金繰入額	33	
機器リース料	0	
事務委託費	1,971	
事務用消耗品費	26	
器具備品費	0	
諸経費	99	
		一般管理費計 9,973
営業利益		11,490

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	7	
受取配当金	548	
時効成立分配金・償還金	0	
時効後支払損引当金戻入額	10	
為替差益	26	
金銭の信託運用益	288	
雑収入	2	
営業外収益計		884
経常利益		12,374
特別損失		
固定資産除却損	5	
ゴルフ会員権売却損	3	
オフィス再編費用	5	
特別損失計		13
税引前中間純利益		12,360
法人税、住民税及び事業税		3,254
法人税等調整額		364
法人税等合計		3,619
中間純利益		8,741

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

(単位:百万円)

	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	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996
当中間期変動額							
剰余金の配当							11,280
中間純利益							8,741
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	2,538
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	17,458

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金 合計	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	
当期首残高	51,800	73,353	0	0	73,353
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,280	11,280			11,280
中間純利益	8,741	8,741			8,741
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額 合計	2,538	2,538	0	0	2,538
当中間期末残高	49,261	70,814	0	0	70,814

## 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：中間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、平成28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。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年</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）に基づく定額法によっております。</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、中間決算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中間会計期間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中間会計期間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当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、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。 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、それぞれ発生の日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>

6. 重要な収益及び費用の計上基準	<p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年1回受取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(2) 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(3) 投資助言報酬 投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
7. 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。

## 会計上の見積りの変更

## 第37期中間会計期間

(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

当社は、当中間会計期間において、新しい働き方を踏まえたオフィスレイアウトの見直しを決定しました。これに伴い、当中間会計期間において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産の見積耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。また、本社オフィスの不動産賃借契約に伴う原状回復義務として認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積の変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ124百万円減少しております。

## (会計方針の変更)

## 1. 収益認識に関する会計基準等の適用

「収益認識基準に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。当該会計方針の変更による影響はありません。

## 2. 時価の算定に関する会計基準等の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することといたしました。当該会計方針の変更による影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うことといたしました。

## 注記事項

## (中間貸借対照表関係)

項目	第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	520百万円
	器具備品	1,004百万円

## (中間損益計算書関係)

項目	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1.減価償却実施額	有形固定資産	156百万円
	無形固定資産	514百万円



(中間株主資本等変動計算書関係)

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30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)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)
普通株式	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 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
2021年6月16日 定時株主総会	普通株式	11,280	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種類 株式				

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの  
該当事項はありません。

（金融商品関係）

第37期中間会計期間末（2021年9月30日現在）

### 1. 金融商品の時価等に関する事項

2021年9月30日における中間貸借対照表計上額、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。

	中間貸借対照表計上額 （百万円）	時価 （百万円）	差額 （百万円）
(1) 金銭の信託	25,866	25,866	-
(2) 投資有価証券 その他有価証券	1	1	-
資産計	25,868	25,868	-

（注）現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び未払手数料は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しております。

### 2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	-	5,844	-	5,844
投資有価証券	-	-	-	-
その他有価証券	-	-	-	-
資産計	-	5,844	-	5,844

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日。以下、「時価算定適用指針」という）第26項に従い、経過措置を適用した投資信託は上表には含めておりません。中間貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託20,021百万円、投資有価証券1百万円となります。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

#### 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、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。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と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) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号2020年3月31日)第5項に従い、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券(その他有価証券)	
非上場株式	259
関係会社株式	
非上場株式	5,299

(有価証券関係)

第37期中間会計期間末

(2021年9月30日現在)

1. 子会社株式

関係会社株式(中間貸借対照表計上額5,299百万円)で市場価格のあるものはありません。

2. その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額(百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額259百万円)については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

## （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IA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) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2021年4月1日から2021年9月30日まで

## (2) 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 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

## (3) 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 76,224百万円

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

## (4) 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 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

(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。

## (5) 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 53,030百万円

## b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

## 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

流動資産	- 百万円
固定資産	80,759百万円
資産合計	80,759百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	5,228百万円
負債合計	5,228百万円
純資産	75,530百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額57,168百万円及び顧客関連資産の金額27,484百万円が含まれております。

## (2) 損益計算書項目

営業収益	- 百万円
営業利益	4,214百万円
経常利益	4,214百万円
税引前中間純利益	4,214百万円
中間純利益	3,507百万円
1株当たり中間純利益	87,690円34銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額2,309百万円が含まれております。

## (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。

## （収益認識関係）

## 1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第37期中間会計期間  
（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

委託者報酬	54,819百万円
運用受託報酬	7,193百万円
投資助言報酬	569百万円
成功報酬（注）	175百万円
その他営業収益	6百万円
合計	62,765百万円

（注）成功報酬は、中間損益計算書において委託者報酬に含めて表示しております。

## 2. 収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は「重要な会計方針 6.重要な収益及び費用の計上基準」に記載の通りであります。

## （セグメント情報等）

第37期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

## 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

## （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。

## （1株当たり情報）

第37期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）	
1株当たり純資産額	1,770,364円46銭
1株当たり中間純利益金額	218,536円02銭

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

1株当たり中間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37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
中間純利益金額	8,741百万円
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中間純利益金額	8,741百万円
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
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

(注) 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) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(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】

#### (1)受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2021年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2)販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名 称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
水戸証券株式会社	12,272	「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おります。

(注) 資本金の額は2021年3月末日現在

### 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2) 信託財産の計算
- (3) 信託財産に関する報告書の作成
- (4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集販売の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する一部解約金、収益分配金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付
- (7) その他上記に付帯する業務

### 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。

### 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

2021年5月26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  
東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 丘本 正彦 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬 印

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

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

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以上

---

(注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) X B R 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

2021年11月19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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAM国内株式パッシブ・ファンドの2020年10月13日から2021年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DIAM国内株式パッシブ・ファンドの2021年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2021年11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

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	丘本 正彦 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	長谷川 敬 印

#### 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 中間監査意見の根拠

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

#### 中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

#### 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。



- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

#### 利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。