

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年5月6日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	One DC 国内株式インデックスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

One DC 国内株式インデックスファンド

(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。

「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。)

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

#### <基準価額の照会方法等>

基準価額は、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)

### (5)【申込手数料】

ありません。

( 6 ) 【申込単位】

1円以上1円単位（当初元本1口 = 1円）

ただし、収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位

( 7 ) 【申込期間】

継続申込期間：2022年5月7日から2022年11月7日まで

ただし、お申込みの取扱いは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。

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

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。

( 1 0 ) 【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

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）

( 1 1 ) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

( 1 2 ) 【その他】

お申込みの方法

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」に従って分配金累積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は、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。

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3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。また、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、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当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口座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係る口座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、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。

#### 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、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、1兆円とします。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)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。

#### 指数の著作権等

東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。

JPX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東証株価指数(TOPIX)にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または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。

JPX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、JPX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。

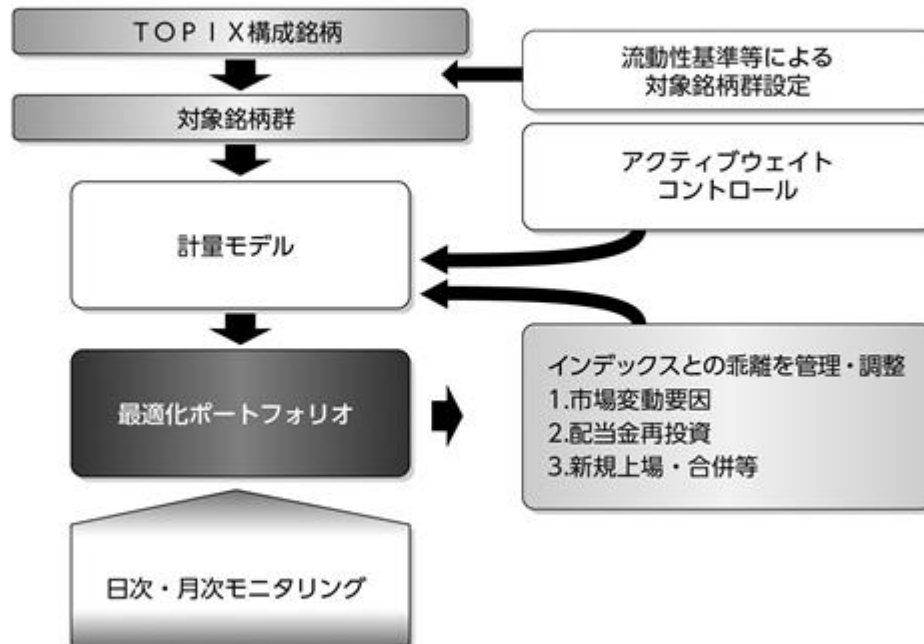
本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。

JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。

JPXは、当社または本件商品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および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、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

**2** 流動性基準等により投資対象銘柄を設定し、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。



**3** 株式（株価指数先物取引を含みます。）の実質組入比率は、原則として高位を維持します。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。株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。

## ■ 分配方針

年1回の決算時（毎年2月7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。

## 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。



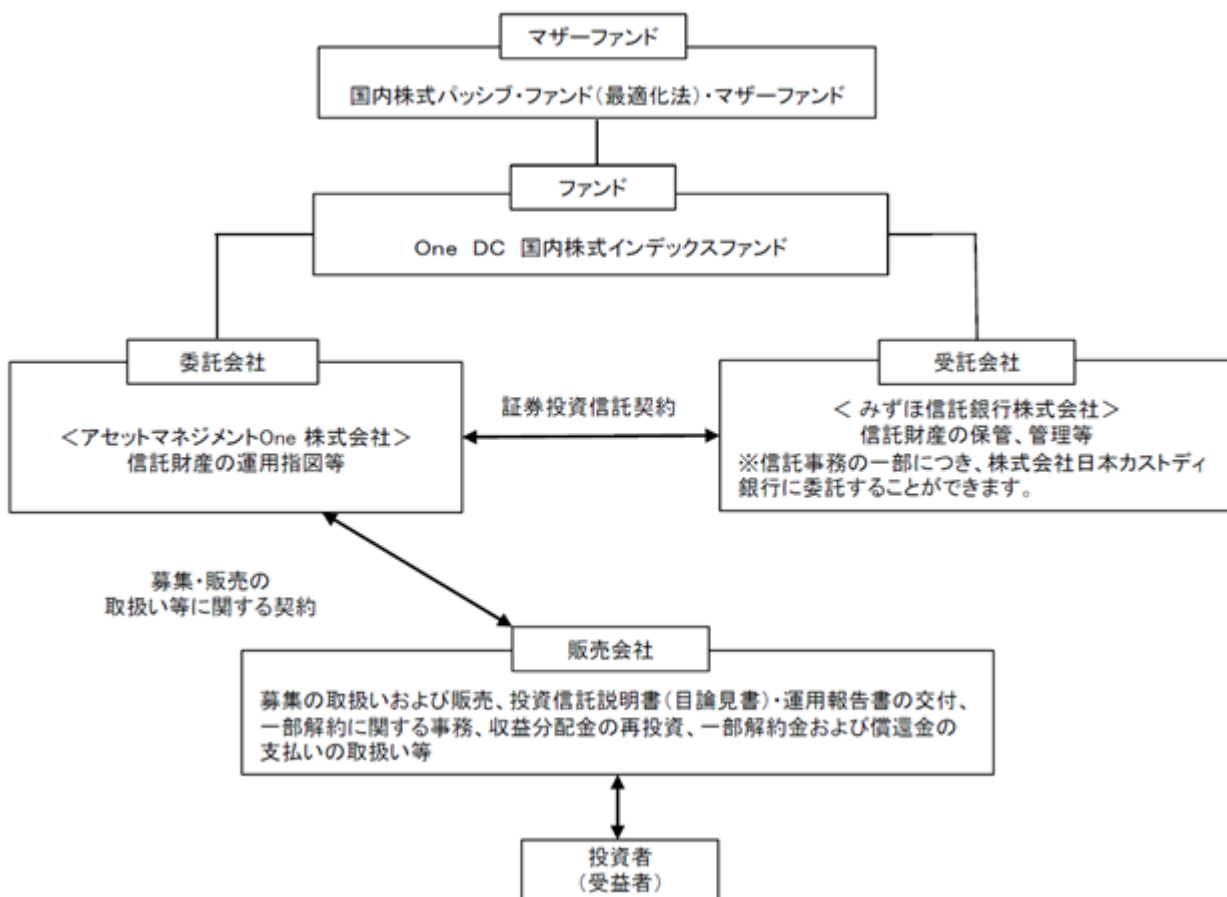
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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】

2007年9月27日	信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
2014年8月29日	信託報酬率の変更
2015年8月28日	信託報酬率の変更
2019年4月1日	信託報酬率の変更
2019年10月1日	ファンドの名称を「DIAM DC 国内株式インデックスファンド」から「One DC 国内株式インデックスファンド」に変更 信託報酬率の変更

## （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

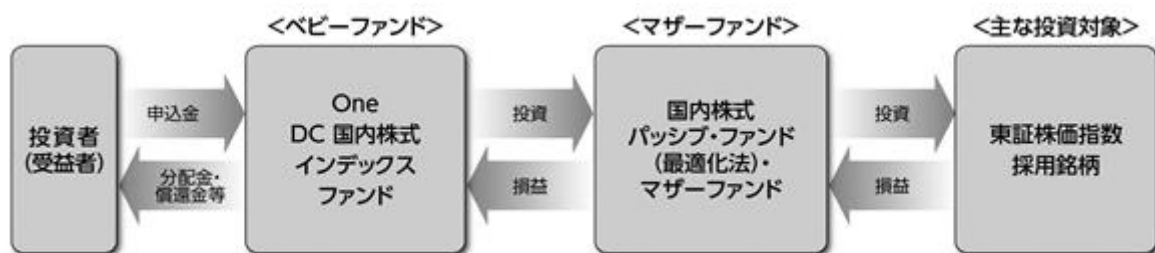
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約事務、収益分配金の再投資、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います。



## 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

## 資本金の額

20億円（2022年2月28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ルユ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月1日	D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

## 大株主の状況

（2022年2月28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】

#### イ．基本方針

この投資信託は、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。

#### ロ．投資対象

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。

#### ハ．投資態度

- ・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）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・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。
- ・株式（株価指数先物取引を含みます。）の実質組入比率は、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。
- ・株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。

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】

#### 1.投資の対象とする資産（約款第16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。

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

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22条、第23条に定めるものに限りません。)

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

b.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

## 2. 有価証券の指図範囲 (約款第17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
- 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) 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1)~10)の証券または証書の性質を有するもの
- 12) 外国貸付債権信託受益権(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。)
- 13) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。)
- 14) 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。)
- 15) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 16) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
- 17) 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。)
- 18) 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
- 19) 外国の者に対する権利で18)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、11)ならびに14)の証券または証書のうち1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券および11)ならびに14)の証券または証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

## 3. 金融商品の指図範囲（約款第17条第2項）

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

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

4. 上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3.の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。（約款第17条第3項）

## （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

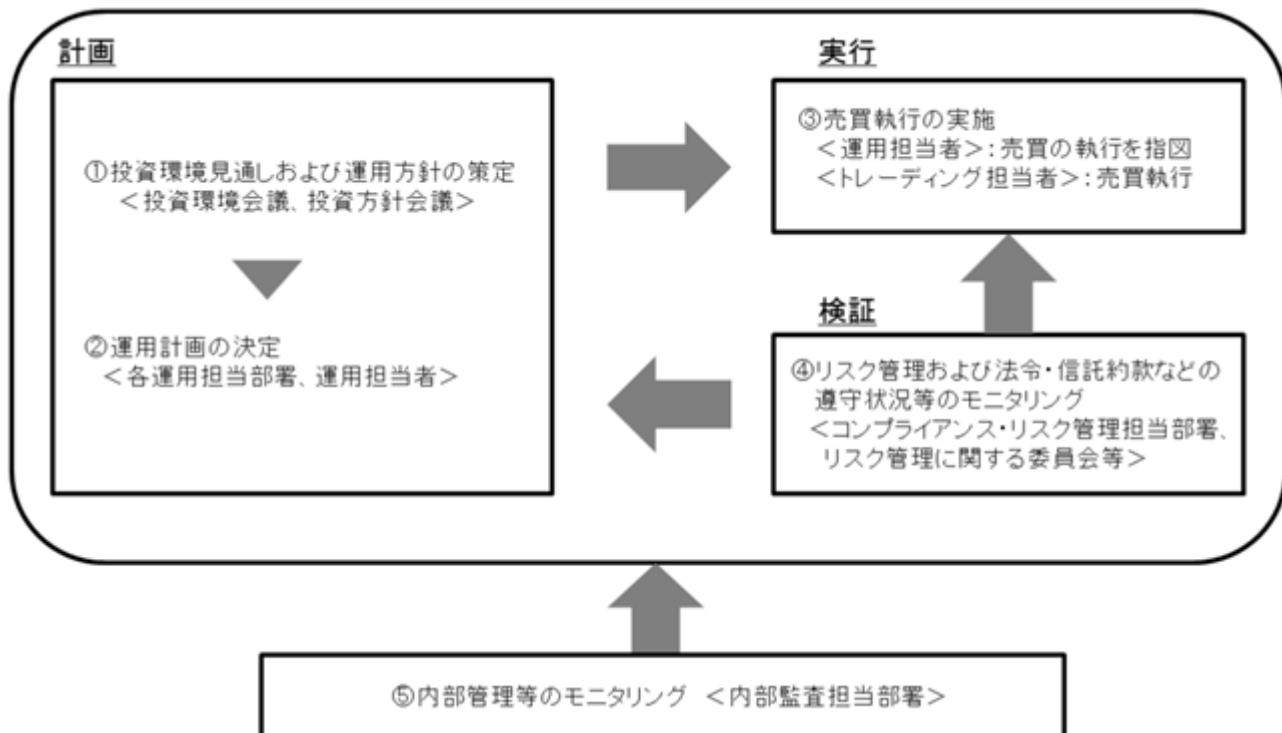
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」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>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
---------------	---

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。

定期的に行わ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2022年2月28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2月7日。ただし、休業日の場合は翌営業日。)に、原則として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ことがあります。

##### 3) 留保金の運用方針

留保金の運用については、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

1) 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 信託財産に属する配当等収益(利子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、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、監査報酬および当該監査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、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、監査報酬および当該監査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かか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。

2) 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。

##### 収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資されます。

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

## (5) 【投資制限】

## 1) 株式への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

## 2) 外貨建資産への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

## 3) マザーファンドの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)

## 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20条)

(a) 委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

(b) 上記(a)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

## 6) 信用取引の指図範囲(約款第21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、当該売付の決済については、株券の引き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.~5.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.~5.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

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. 売り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

## 7) 先物取引等の運用指図(約款第22条)

(a) 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(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。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8

項第3号八に掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)

(b) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

(c) 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、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

8) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第23条)

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

(b) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当該ファンドの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) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、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、金利先渡取引および為替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。

9) 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。

10) 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)で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、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。

11) 特別な場合の外貨建資産への投資制限(約款第26条)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

12) 外貨為替予約の指図および範囲(約款第27条)

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引を指図することができます。

(b) 上記(a)の予約取引の指図は、信託財産に属する為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドに信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に

属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

- (c) 上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

### 13) 資金の借入れ(約款第34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を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資に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、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金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。

### 14) 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の議決権(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、当該株式の議決権の総数に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、当該株式を投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図してはなりません。

## 3【投資リスク】

### (1) 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。

### 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。

当ファンドは実質的に株式に投資します。株式の価格は一般に大きく変動します。株式市場全体の価格変動あるいは個別銘柄の価格変動により当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

#### 信用リスク

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

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。

#### (2)その他の留意点

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

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、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。当該インデックス採用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。

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・解約があった場合、資金変動が起こり、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、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。

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、外国為替取引の停止、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るものとします。

当ファンドは、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は、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、実質的に株式など値動きのある有価証券(外貨建資産へ投資する場合には為替リスクもあります。)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、これによる損失は購入者が負担することとなります。

## &lt;リスク管理体制&gt;

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。



- ・流動性リスク管理：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。

リスク管理体制は2022年2月28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>

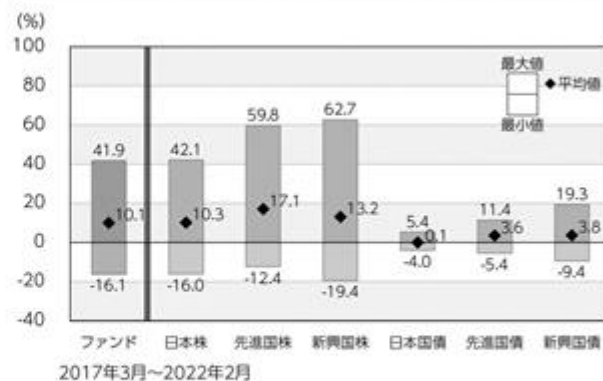
### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



\*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。

### 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



\*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く網羅し、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。同指数の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPX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・ディバーシファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」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。



## 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0.154%（税抜0.14%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.06%	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0.06%	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0.02%	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、毎年8月7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】

## イ. 信託財産留保額

ありません。

## ロ. 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、毎年8月7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係る手数料・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関する費用は、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係る手数料・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関する費用は、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。

##### 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。

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

上記は、2022年2月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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】

2022年2月28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	63,922,668,632	100.00
内 日本	63,922,668,632	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,408,559	0.00
純資産総額	63,925,077,191	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

2022年2月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	374,673,987,260	97.98
内 日本	374,673,987,260	97.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,711,212,557	2.02
純資産総額	382,385,199,817	100.00

その他資産の投資状況

2022年2月28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)	4,916,600,000	1.29
内 日本	4,916,600,000	1.29

(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】

2022年2月28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	20,445,440,151	3.1895 65,211,679,174	3.1265 63,922,668,632	- -	100.00

(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

2022年2月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

(注) 投資比率は、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

2022年2月28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	7,360,200	2,272.85 16,728,689,870	2,138.50 15,739,787,700	- -	4.12
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	909,900	12,683.72 11,540,922,384	11,810.00 10,745,919,000	- -	2.81
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	131,600	58,956.23 7,758,640,331	53,780.00 7,077,448,000	- -	1.85
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,982,900	741.61 6,661,863,670	712.80 6,403,011,120	- -	1.67
5	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,070,500	5,690.95 6,092,169,455	4,819.00 5,158,739,500	- -	1.35
6	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	92,200	55,500.72 5,117,167,176	55,770.00 5,141,994,000	- -	1.34
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,490,800	3,342.60 4,983,162,560	3,293.00 4,909,204,400	- -	1.28
8	任天堂 日本	株式 その他製品	82,000	58,436.53 4,791,796,122	58,020.00 4,757,640,000	- -	1.24
9	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	854,500	5,366.22 4,585,437,226	5,125.00 4,379,312,500	- -	1.15
10	信越化学工業 日本	株式 化学	244,400	18,987.59 4,640,567,334	17,670.00 4,318,548,000	- -	1.13
11	HOYA 日本	株式 精密機器	283,500	15,526.27 4,401,697,601	14,855.00 4,211,392,500	- -	1.10
12	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,071,900	3,964.68 4,249,741,149	3,871.00 4,149,324,900	- -	1.09
13	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	991,400	4,339.93 4,302,611,903	4,121.00 4,085,559,400	- -	1.07
14	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,143,400	3,428.68 3,920,362,616	3,525.00 4,030,485,000	- -	1.05
15	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,141,500	3,452.34 3,940,852,660	3,501.00 3,996,391,500	- -	1.05
16	日立製作所 日本	株式 電気機器	698,600	5,910.73 4,129,242,279	5,650.00 3,947,090,000	- -	1.03
17	ダイキン工業 日本	株式 機械	185,200	22,392.63 4,147,115,145	21,205.00 3,927,166,000	- -	1.03

18	KDDI	日本	株式 情報・通 信業	1,039,000	3,747.82 3,893,993,436	3,756.00 3,902,484,000	- -	1.02
19	伊藤忠商事	日本	株式 卸売業	1,000,500	3,737.07 3,738,945,299	3,743.00 3,744,871,500	- -	0.98
20	日本電産	日本	株式 電気機器	376,500	10,018.85 3,772,098,400	9,883.00 3,720,949,500	- -	0.97
21	オリエンタルランド	日本	株式 サービス 業	164,100	21,081.40 3,459,458,180	21,130.00 3,467,433,000	- -	0.91
22	村田製作所	日本	株式 電気機器	426,600	8,254.88 3,521,535,496	7,787.00 3,321,934,200	- -	0.87
23	第一三共	日本	株式 医薬品	1,141,300	2,368.55 2,703,226,300	2,793.50 3,188,221,550	- -	0.83
24	三井物産	日本	株式 卸売業	1,110,700	2,973.23 3,302,374,901	2,865.50 3,182,710,850	- -	0.83
25	ソフトバンク	日本	株式 情報・通 信業	2,158,600	1,442.23 3,113,199,584	1,450.50 3,131,049,300	- -	0.82
26	セブン&アイ・ホールディ ングス	日本	株式 小売業	559,700	5,781.21 3,235,747,977	5,591.00 3,129,282,700	- -	0.82
27	東京海上ホールディングス	日本	株式 保険業	471,800	7,088.84 3,344,516,332	6,574.00 3,101,613,200	- -	0.81
28	SMC	日本	株式 機械	42,500	64,133.99 2,725,694,666	68,050.00 2,892,125,000	- -	0.76
29	みずほフィナンシャルグ ループ	日本	株式 銀行業	1,831,900	1,621.29 2,970,055,061	1,525.00 2,793,647,500	- -	0.73
30	ファナック	日本	株式 電気機器	127,500	22,371.69 2,852,390,604	21,155.00 2,697,262,500	- -	0.71

(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

2022年2月28日現在

種類	投資比率(%)
株式	97.98
合計	97.98

(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

2022年2月28日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	17.29
輸送用機器		8.33
情報・通信業		7.90
化学		6.49
サービス業		5.61
卸売業		5.60
銀行業		5.32
機械		5.13

医薬品	4.94
小売業	4.29
食料品	3.37
陸運業	3.02
精密機器	2.59
その他製品	2.35
建設業	2.27
保険業	2.14
不動産業	1.93
電気・ガス業	1.15
その他金融業	1.12
鉄鋼	0.85
非鉄金属	0.81
証券、商品先物取引業	0.77
ガラス・土石製品	0.76
ゴム製品	0.66
海運業	0.63
金属製品	0.59
繊維製品	0.45
石油・石炭製品	0.44
空運業	0.42
鉱業	0.28
パルプ・紙	0.21
倉庫・運輸関連業	0.18
水産・農林業	0.09
合計	97.98

（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

2022年2月28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 0403月	買建	260	5,060,438,080	4,916,600,000	1.29

（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(2022年2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6計算期間末 (2013年2月7日)	4,521	4,521	0.6603	0.6603
第7計算期間末 (2014年2月7日)	6,573	6,573	0.8241	0.8241
第8計算期間末 (2015年2月9日)	8,261	8,261	1.0056	1.0056
第9計算期間末 (2016年2月8日)	11,225	11,225	0.9911	0.9911
第10計算期間末 (2017年2月7日)	13,968	13,968	1.1107	1.1107
第11計算期間末 (2018年2月7日)	22,544	22,544	1.3067	1.3067
第12計算期間末 (2019年2月7日)	30,214	30,214	1.1958	1.1958
第13計算期間末 (2020年2月7日)	37,717	37,717	1.3513	1.3513
第14計算期間末 (2021年2月8日)	49,849	49,849	1.5351	1.5351
第15計算期間末 (2022年2月7日)	65,141	65,141	1.5668	1.5668
2021年2月末日	48,621	-	1.4881	-
3月末日	52,800	-	1.5727	-
4月末日	51,834	-	1.5280	-
5月末日	53,452	-	1.5487	-
6月末日	56,613	-	1.5667	-
7月末日	56,274	-	1.5325	-
8月末日	58,746	-	1.5807	-
9月末日	62,205	-	1.6496	-
10月末日	62,930	-	1.6258	-
11月末日	61,541	-	1.5668	-
12月末日	66,137	-	1.6210	-
2022年1月末日	63,787	-	1.5426	-
2月末日	63,925	-	1.5357	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
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
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第6計算期間	28.2
第7計算期間	24.8
第8計算期間	22.0
第9計算期間	1.4
第10計算期間	12.1
第11計算期間	17.6
第12計算期間	8.5
第13計算期間	13.0
第14計算期間	13.6
第15計算期間	2.1

(注) 収益率は期間騰落率です。

## (4) 【設定及び解約の実績】

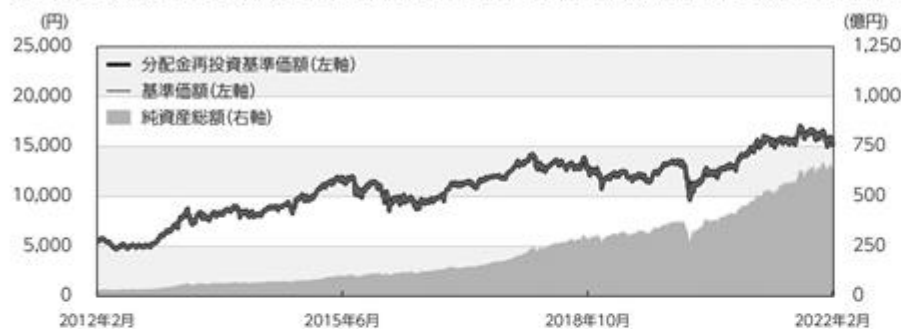
	設定口数	解約口数
第6計算期間	3,710,441,727	2,345,929,733
第7計算期間	6,733,843,082	5,604,546,552
第8計算期間	5,119,097,831	4,880,240,628
第9計算期間	8,364,610,514	5,254,249,325
第10計算期間	7,572,230,014	6,321,925,379
第11計算期間	11,590,956,335	6,914,819,396
第12計算期間	14,073,136,483	6,058,109,779
第13計算期間	10,454,492,002	7,809,755,170
第14計算期間	13,421,884,000	8,860,777,863
第15計算期間	16,850,759,487	7,748,660,236

(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:2022年2月28日

## 基準価額・純資産の推移 (2012年2月29日～2022年2月28日)



## 分配の推移 (税引前)

年次	分配額 (円)
2018年 2月	0円
2019年 2月	0円
2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
2022年 2月	0円
設定未累計	0円

\*分配金は1万口当たりです。

\*基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

\*分配金再投資基準価額は、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:2007年9月27日)

## 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	100.00

## ■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	97.98
内 日本	97.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.02
合計(純資産総額)	100.00

## 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	4.12
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.81
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.85
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.67
5	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.35
6	東京エレクトロン	株式	日本	電気機器	1.34
7	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.28
8	任天堂	株式	日本	その他製品	1.24
9	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.15
10	信越化学工業	株式	日本	化学	1.13

## 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)	1.29

## 株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	17.29
2	輸送用機器	8.33
3	情報・通信業	7.90
4	化学	6.49
5	サービス業	5.61

## 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。

\*2022年については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】

#### お申込みの方法

- ・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、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。
- ・当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」に従って分配金累積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は、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。
- ・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3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。
- ・委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、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係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係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。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（発行価格）

お申込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。）

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

#### < 基準価額の照会方法等 >

基準価額は、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

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

ただし、収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位

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）に払込まれます。

## 2【換金（解約）手続等】

### 解約のお申込み方法

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に1口単位をもって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3時までに行われ、かつ、解約の受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

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係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、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、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5営業日目から販売会社の営業所等においてお支払いします。

**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
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

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2007年9月27日から無期限です。

下記(5)イ.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2月8日から翌年2月7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るものとします。

(5)【その他】

イ. 償還規定

- a. 委託会社は、信託終了前にこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、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ときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- b. 委託会社は上記a.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- c. 上記a.につき、上記b.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- d. 委託会社は信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- e. 上記b.～d.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- 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き継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

- 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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更」の規定に従い、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. 上記b.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

#### ロ.信託約款の変更

- 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ができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a.~e.の規定に従います。
- g. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

#### ハ.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ヵ月前までに、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2月7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】

### 収益分配金請求権

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付され、販売会社により自動的に再投資されます。

販売会社は、累積投資約款に基づき、毎計算期間の末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計算期間の末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てします。)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けを行います。当該売付け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。

### 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、委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。)に、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。



#### 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。

#### 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15期計算期間(2021年2月9日から2022年2月7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】

## 【One DC 国内株式インデックスファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 2021年2月8日現在	第15期 2022年2月7日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	158,721,109	145,933,648
親投資信託受益証券	49,848,126,418	65,139,109,229
未収入金	23,068,000	-
流動資産合計	50,029,915,527	65,285,042,877
資産合計	50,029,915,527	65,285,042,877
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	146,083,004	95,190,877
未払受託者報酬	4,799,305	6,848,859
未払委託者報酬	28,796,086	41,093,304
その他未払費用	250,214	320,496
流動負債合計	179,928,609	143,453,536
負債合計	179,928,609	143,453,536
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	32,473,165,156	41,575,264,407
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,376,821,762	23,566,324,934
（分配準備積立金）	9,729,009,068	8,953,582,578
元本等合計	49,849,986,918	65,141,589,341
純資産合計	49,849,986,918	65,141,589,341
負債純資産合計	50,029,915,527	65,285,042,877

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第14期 自 2020年2月8日 至 2021年2月8日	第15期 自 2021年2月9日 至 2022年2月7日
<b>営業収益</b>		
受取利息	149	472
有価証券売買等損益	6,653,227,821	951,671,811
営業収益合計	6,653,227,970	951,672,283
<b>営業費用</b>		
支払利息	54,424	34,662
受託者報酬	8,635,870	12,741,495
委託者報酬	51,815,709	76,449,382
その他費用	466,995	607,914
営業費用合計	60,972,998	89,833,453
営業利益又は営業損失( )	6,592,254,972	861,838,830
経常利益又は経常損失( )	6,592,254,972	861,838,830
当期純利益又は当期純損失( )	6,592,254,972	861,838,830
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( )	388,632,356	360,838,678
期首剰余金又は期首欠損金( )	9,805,325,888	17,376,821,762
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,423,346,502	9,893,720,432
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	3,423,346,502	9,893,720,432
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,832,737,956	4,205,217,412
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,832,737,956	4,205,217,412
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( )	17,376,821,762	23,566,324,934

## (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15期	
	自 2021年2月9日	至 2022年2月7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。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月7日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2021年2月8日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第14期	第15期
	2021年2月8日現在	2022年2月7日現在
1. 期首元本額	27,912,059,019円	32,473,165,156円
期中追加設定元本額	13,421,884,000円	16,850,759,487円
期中一部解約元本額	8,860,777,863円	7,748,660,236円
2. 受益権の総数	32,473,165,156口	41,575,264,407口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第14期	第15期
	自 2020年2月8日 至 2021年2月8日	自 2021年2月9日 至 2022年2月7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(855,898,824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(6,124,988,504円)、信託約款に規定される収益調整金(18,047,633,321円)及び分配準備積立金(2,748,121,740円)より分配対象収益は27,776,642,389円(1万口当たり8,553.72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(1,090,468,661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(0円)、信託約款に規定される収益調整金(27,732,115,185円)及び分配準備積立金(7,863,113,917円)より分配対象収益は36,685,697,763円(1万口当たり8,823.92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14期	第15期
	自 2020年2月8日 至 2021年2月8日	自 2021年2月9日 至 2022年2月7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。	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。運用評価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	第14期 2021年2月8日現在	第15期 2022年2月7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14期 2021年2月8日現在	第15期 2022年2月7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	6,660,165,898	899,766,148
合計	6,660,165,898	899,766,148

（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14期 2021年2月8日現在	第15期 2022年2月7日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5351円 (15,351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

2022年2月7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	20,422,344,253	65,139,109,229	
親投資信託受益証券	合計	20,422,344,253	65,139,109,229	
合計			65,139,109,229	

（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)

2022年2月7日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,420,891,042
株式	387,140,847,090
派生商品評価勘定	62,018,090
未収配当金	655,237,202
差入委託証拠金	491,970,000
流動資産合計	399,770,963,424
資産合計	
399,770,963,424	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	50,774,550
前受金	50,045,700
未払金	909,720
未払解約金	2,332,618,000
流動負債合計	2,434,347,970
負債合計	
2,434,347,970	
純資産の部	
元本等	
元本	124,570,625,521
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	272,765,989,933
元本等合計	397,336,615,454
純資産合計	
397,336,615,454	
負債純資産合計	
399,770,963,424	



## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年2月9日 至 2022年2月7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	2022年2月7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	102,105,610,506円
同期中追加設定元本額	163,179,331,486円
同期中一部解約元本額	140,714,316,471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	2,725,686,605円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	7,087,968,915円
One DC 国内株式インデックスファンド	20,422,344,253円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,704,569,337円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	3,424,028円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	23,972,661円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	78,308,323円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	28,249,023円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	21,103,225円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	15,896,115円
たわらノーロード TOPIX	1,306,069,812円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,033,861,326円
たわらノーロード バランス(堅実型)	40,906,841円
たわらノーロード バランス(標準型)	262,619,504円
たわらノーロード バランス(積極型)	394,664,404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)	3,669,806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)	174,139,046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)	434,342,242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)	283,511,087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)	405,598,982円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	705,164円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,916,286円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	36,588,931円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,020,593円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	19,092,798円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	34,009,153,068円
Oneグローバルバランス	5,199,858円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,065,319,872円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,512,005,009円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,794,173,475円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	343,318,358円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,113,385,483円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,115,312,187円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	30,317,366円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,055,563,450円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	18,529,124円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	304,544,955円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	306,459,778円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	545,764,310円
投資のソムリエ	13,743,021,171円
クルーズコントロール	128,837,057円
投資のソムリエ<DC年金>	831,424,634円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	337,759,108円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	549,884,906円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,701,235円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	5,513,567円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	559,030,369円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,846,898,552円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	41,503,360円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	20,515,309円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,618,660円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	146,712,017円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	348,653,940円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,393,008,159円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	279,145,423円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	42,977,458円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	17,916,384円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	15,092,602円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	105,875,155円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	985,477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)	22,944,960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)	23,431,080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)	21,508,092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)	14,273,870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)	22,637,856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)	193,585,816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)	41,677,610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)	84,110,969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)	68,984,011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)	47,924,787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)	22,733,018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)	49,987,822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)2021-12(適格機関投資家限定)	70,694,127円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	329,597,803円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	34,825,039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)	116,640,502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)	39,121,859円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(F O F s用)(適格機関投資家専用)	7,907,522円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	57,045,218円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	101,888,672円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,956,036円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	26,722,846円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,712,676円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,338,373円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	7,152,634円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	34,835,196円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	557,427,217円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	634,827,723円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,809,585,772円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	31,302,882円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	31,388,733円
D I A M 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)	301,727,428円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	74,733,048円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,406,645円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	349,638,985円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	20,826,049円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	73,311,471円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	173,199,524円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	237,769,545円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	38,321,734円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	18,177,991円
D I A M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
D I A M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
D I A M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>	19,960,341円
コア資産形成ファンド	13,478,680円
MHAMトピックスファンド	692,612,483円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	65,067,902円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	2,686,127,829円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,050,559,819円
計	124,570,625,521円
2. 受益権の総数	124,570,625,521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 2021年2月9日 至 2022年2月7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。運用評価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	2022年2月7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。
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	2022年2月7日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	6,054,696,446	
合計	6,054,696,446	

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	2022年2月7日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超	時価(円)	
市場取引 先物取引 買建	10,024,034,200	-	10,035,450,000	11,415,800
合計	10,024,034,200	-	10,035,450,000	11,415,800

## (注)時価の算定方法

## 株価指数先物取引

1. 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。
2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。  
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (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)

	2022年2月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.1896円 (31,896円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

2022年2月7日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	7,200	3,170.00	22,824,000	
日本水産	199,700	520.00	103,844,000	

マルハニチロ	31,400	2,499.00	78,468,600
ハウスイ	600	836.00	501,600
雪国まいたけ	14,800	1,207.00	17,863,600
カネコ種苗	4,900	1,512.00	7,408,800
サカタのタネ	24,000	3,275.00	78,600,000
ホクト	17,000	1,960.00	33,320,000
ホクリヨウ	3,400	695.00	2,363,000
ヒノキヤグループ	4,500	2,065.00	9,292,500
ショーボンドホールディングス	28,500	5,050.00	143,925,000
ミライト・ホールディングス	64,400	1,883.00	121,265,200
タマホーム	12,100	2,456.00	29,717,600
サンヨーホームズ	2,500	731.00	1,827,500
日本アクア	8,100	626.00	5,070,600
ファーストコーポレーション	6,400	696.00	4,454,400
ベステラ	4,000	1,256.00	5,024,000
Robot Home	33,300	223.00	7,425,900
キャンディル	3,800	490.00	1,862,000
住石ホールディングス	35,100	136.00	4,773,600
日鉄鉱業	4,600	6,190.00	28,474,000
三井松島ホールディングス	8,300	1,523.00	12,640,900
I N P E X	800,900	1,174.00	940,256,600
石油資源開発	23,500	2,849.00	66,951,500
K & O エナジーグループ	9,900	1,540.00	15,246,000
ダイセキ環境ソリューション	3,900	1,168.00	4,555,200
第一カッター興業	5,100	1,385.00	7,063,500
明豊ファシリティワークス	6,600	732.00	4,831,200
安藤・間	99,100	873.00	86,514,300
東急建設	58,500	686.00	40,131,000
コムシスホールディングス	64,400	2,728.00	175,683,200
ビーアールホールディングス	27,100	357.00	9,674,700
高松コンストラクショングループ	12,600	2,005.00	25,263,000
東建コーポレーション	5,500	9,210.00	50,655,000
ソネック	2,300	1,029.00	2,366,700
ヤマウラ	10,300	989.00	10,186,700
オリエンタル白石	67,800	241.00	16,339,800
大成建設	133,200	3,815.00	508,158,000
大林組	460,900	942.00	434,167,800
清水建設	431,800	783.00	338,099,400
飛鳥建設	12,300	1,070.00	13,161,000
長谷工コーポレーション	137,300	1,458.00	200,183,400
松井建設	18,400	711.00	13,082,400
銭高組	1,700	4,020.00	6,834,000
鹿島建設	337,900	1,379.00	465,964,100
不動テトラ	9,800	1,559.00	15,278,200
大末建設	5,000	1,336.00	6,680,000
鉄建建設	10,300	1,825.00	18,797,500
西松建設	28,000	3,735.00	104,580,000
三井住友建設	103,800	428.00	44,426,400
大豊建設	6,800	3,690.00	25,092,000
佐田建設	10,200	468.00	4,773,600

ナカノフドー建設	10,900	343.00	3,738,700	
奥村組	27,100	3,195.00	86,584,500	
東鉄工業	21,500	2,441.00	52,481,500	
イチケン	3,500	1,884.00	6,594,000	
富士ピー・エス	5,900	490.00	2,891,000	
浅沼組	5,200	5,410.00	28,132,000	
戸田建設	191,400	744.00	142,401,600	
熊谷組	23,500	2,972.00	69,842,000	
北野建設	2,900	2,136.00	6,194,400	
植木組	4,100	1,482.00	6,076,200	
矢作建設工業	20,500	763.00	15,641,500	
ピーエス三菱	15,400	620.00	9,548,000	
日本ハウスホールディングス	31,700	453.00	14,360,100	
大東建託	47,200	13,480.00	636,256,000	
新日本建設	19,900	754.00	15,004,600	
東亜道路工業	2,600	5,020.00	13,052,000	
日本道路	4,600	8,300.00	38,180,000	
東亜建設工業	11,500	2,429.00	27,933,500	
日本国土開発	45,500	530.00	24,115,000	
若築建設	7,700	1,716.00	13,213,200	
東洋建設	51,700	578.00	29,882,600	
五洋建設	182,700	639.00	116,745,300	
世紀東急工業	22,400	815.00	18,256,000	
福田組	5,000	4,390.00	21,950,000	
日本ドライケミカル	3,800	1,743.00	6,623,400	
住友林業	118,000	2,039.00	240,602,000	
日本基礎技術	12,700	628.00	7,975,600	
巴コーポレーション	20,700	486.00	10,060,200	
大和ハウス工業	425,600	3,389.00	1,442,358,400	
ライト工業	29,000	1,851.00	53,679,000	
積水ハウス	500,000	2,329.00	1,164,500,000	
日特建設	9,800	714.00	6,997,200	
北陸電気工事	9,800	823.00	8,065,400	
ユアテック	26,500	697.00	18,470,500	
日本リーテック	9,600	1,403.00	13,468,800	
四電工	5,200	1,608.00	8,361,600	
中電工	21,300	2,123.00	45,219,900	
関電工	75,200	870.00	65,424,000	
きんでん	103,100	1,615.00	166,506,500	
東京エネシス	15,500	970.00	15,035,000	
トーエネック	4,700	3,215.00	15,110,500	
住友電設	11,500	2,225.00	25,587,500	
日本電設工業	25,400	1,462.00	37,134,800	
エクシオグループ	69,800	2,327.00	162,424,600	
新日本空調	12,200	2,032.00	24,790,400	
日本工営	8,300	3,015.00	25,024,500	
九電工	35,600	3,075.00	109,470,000	
三機工業	30,200	1,418.00	42,823,600	
日揮ホールディングス	141,900	1,134.00	160,914,600	
中外炉工業	4,700	1,609.00	7,562,300	

ヤマト	13,800	709.00	9,784,200
太平電業	10,400	2,769.00	28,797,600
高砂熱学工業	41,700	1,897.00	79,104,900
三晃金属工業	1,700	2,492.00	4,236,400
N E C ネットズエスアイ	47,800	1,732.00	82,789,600
朝日工業社	3,300	2,892.00	9,543,600
明星工業	29,900	702.00	20,989,800
大気社	22,600	2,822.00	63,777,200
ダイダン	10,300	2,258.00	23,257,400
日比谷総合設備	14,900	1,890.00	28,161,000
ニッポン	43,500	1,677.00	72,949,500
日清製粉グループ本社	167,000	1,636.00	273,212,000
日東富士製粉	1,600	3,995.00	6,392,000
昭和産業	14,300	2,670.00	38,181,000
鳥越製粉	13,700	647.00	8,863,900
中部飼料	16,700	1,017.00	16,983,900
フィード・ワン	20,200	718.00	14,503,600
東洋精糖	1,800	1,025.00	1,845,000
日本甜菜製糖	8,100	1,696.00	13,737,600
D M 三井製糖ホールディングス	13,700	2,013.00	27,578,100
塩水港精糖	19,900	214.00	4,258,600
日新製糖	7,600	1,730.00	13,148,000
L I F U L L	43,000	231.00	9,933,000
ミクシィ	32,100	2,358.00	75,691,800
ジェイエイシーリクルートメント	11,500	2,020.00	23,230,000
日本M&Aセンターホールディングス	230,500	1,727.00	398,073,500
メンバーズ	4,200	2,811.00	11,806,200
中広	1,200	385.00	462,000
UTグループ	20,300	3,515.00	71,354,500
アイティメディア	6,700	1,641.00	10,994,700
E・Jホールディングス	7,500	1,146.00	8,595,000
夢真ビーネックスグループ	45,700	1,668.00	76,227,600
コシダカホールディングス	37,500	643.00	24,112,500
アルトナー	3,600	889.00	3,200,400
パソナグループ	15,300	2,503.00	38,295,900
C D S	2,500	1,578.00	3,945,000
リンクアンドモチベーション	31,000	470.00	14,570,000
エス・エム・エス	47,800	3,190.00	152,482,000
サニーサイドアップグループ	5,100	729.00	3,717,900
パーソルホールディングス	140,500	2,970.00	417,285,000
リニカル	8,100	683.00	5,532,300
クックパッド	44,100	262.00	11,554,200
エスクリ	6,200	344.00	2,132,800
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,700	584.00	3,912,800
森永製菓	34,800	3,690.00	128,412,000
中村屋	2,600	3,350.00	8,710,000
江崎グリコ	40,700	3,780.00	153,846,000
名糖産業	6,900	1,661.00	11,460,900
井村屋グループ	8,600	2,229.00	19,169,400
不二家	8,500	2,279.00	19,371,500



山崎製パン	110,700	1,625.00	179,887,500
第一屋製パン	3,500	531.00	1,858,500
モロゾフ	3,700	2,750.00	10,175,000
亀田製菓	8,600	3,915.00	33,669,000
寿スピリッツ	14,300	5,480.00	78,364,000
カルビー	67,300	2,449.00	164,817,700
森永乳業	27,400	5,460.00	149,604,000
六甲バター	11,000	1,480.00	16,280,000
ヤクルト本社	109,400	5,790.00	633,426,000
明治ホールディングス	97,600	7,220.00	704,672,000
雪印メグミルク	35,600	2,062.00	73,407,200
プリマハム	18,600	2,409.00	44,807,400
日本ハム	56,500	4,210.00	237,865,000
林兼産業	3,800	505.00	1,919,000
丸大食品	14,800	1,524.00	22,555,200
S Foods	13,300	3,265.00	43,424,500
柿安本店	5,200	2,611.00	13,577,200
伊藤ハム米久ホールディングス	95,700	672.00	64,310,400
学情	5,600	985.00	5,516,000
スタジオアリス	6,400	2,154.00	13,785,600
クロスキャット	3,900	1,651.00	6,438,900
シミックホールディングス	8,000	1,566.00	12,528,000
エプコ	3,300	708.00	2,336,400
システナ	205,800	360.00	74,088,000
NJS	2,900	1,970.00	5,713,000
デジタルアーツ	7,900	6,520.00	51,508,000
日鉄ソリューションズ	20,900	3,605.00	75,344,500
総合警備保障	55,900	4,080.00	228,072,000
キューブシステム	7,500	931.00	6,982,500
いちご	161,700	274.00	44,305,800
WOW WORLD	2,200	1,181.00	2,598,200
日本駐車場開発	158,000	136.00	21,488,000
コア	6,400	1,545.00	9,888,000
カカクコム	103,100	2,520.00	259,812,000
アイロムグループ	5,000	1,999.00	9,995,000
セントケア・ホールディング	9,100	773.00	7,034,300
サイネックス	2,500	607.00	1,517,500
ルネサンス	9,800	1,071.00	10,495,800
ディップ	24,700	3,335.00	82,374,500
SBSホールディングス	11,000	3,270.00	35,970,000
デジタルホールディングス	9,600	1,329.00	12,758,400
新日本科学	17,100	1,676.00	28,659,600
キャリアデザインセンター	3,600	1,165.00	4,194,000
ベネフィット・ワン	51,200	2,999.00	153,548,800
エムスリー	247,900	4,206.00	1,042,667,400
ツカダ・グローバルホールディング	8,500	280.00	2,380,000
プラス	2,200	633.00	1,392,600
アウトソーシング	80,500	1,348.00	108,514,000
ウェルネット	14,300	438.00	6,263,400
ワールドホールディングス	5,600	2,408.00	13,484,800

ディー・エヌ・エー	53,600	1,787.00	95,783,200
博報堂DYホールディングス	195,600	1,790.00	350,124,000
ぐるなび	22,900	381.00	8,724,900
タカミヤ	17,600	405.00	7,128,000
ジャパンベストレスキューシステム	9,400	916.00	8,610,400
ファンコミュニケーションズ	35,100	378.00	13,267,800
ライク	3,800	1,791.00	6,805,800
ビジネス・ブレークスルー	5,500	419.00	2,304,500
エスプール	39,700	991.00	39,342,700
WDBホールディングス	6,600	2,805.00	18,513,000
手間いらず	1,800	4,720.00	8,496,000
ティア	8,700	437.00	3,801,900
CDG	1,400	1,366.00	1,912,400
アドウェイズ	20,900	759.00	15,863,100
バリューコマース	11,200	3,485.00	39,032,000
インフォマート	153,900	636.00	97,880,400
サッポロホールディングス	50,400	2,235.00	112,644,000
アサヒグループホールディングス	347,200	4,770.00	1,656,144,000
麒麟ホールディングス	542,400	1,882.00	1,020,796,800
宝ホールディングス	100,400	1,114.00	111,845,600
オエノンホールディングス	43,000	338.00	14,534,000
養命酒製造	5,100	1,761.00	8,981,100
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	103,700	1,367.00	141,757,900
サントリー食品インターナショナル	98,700	4,490.00	443,163,000
ダイドーグループホールディングス	7,700	4,850.00	37,345,000
伊藤園	45,000	6,220.00	279,900,000
キーコーヒー	14,800	2,063.00	30,532,400
ユニカフェ	5,000	958.00	4,790,000
ジャパンフーズ	1,700	1,206.00	2,050,200
日清オイリオグループ	18,700	3,010.00	56,287,000
不二製油グループ本社	32,000	2,330.00	74,560,000
かどや製油	1,100	4,010.00	4,411,000
J-オイルミルズ	14,200	1,692.00	24,026,400
ローソン	32,100	4,805.00	154,240,500
サンエー	11,000	4,085.00	44,935,000
カワチ薬品	11,300	2,352.00	26,577,600
エービーシー・マート	22,700	5,200.00	118,040,000
ハードオフコーポレーション	6,900	771.00	5,319,900
高千穂交易	5,900	1,595.00	9,410,500
アスクル	32,700	1,659.00	54,249,300
ゲオホールディングス	19,400	1,157.00	22,445,800
アダストリア	15,500	1,750.00	27,125,000
ジーフット	10,000	317.00	3,170,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,300	378.00	869,400
オルパヘルスケアホールディングス	1,700	1,472.00	2,502,400
伊藤忠食品	3,000	4,945.00	14,835,000
くら寿司	15,100	3,650.00	55,115,000
キャンドウ	5,300	2,034.00	10,780,200
エレマテック	11,700	1,051.00	12,296,700

アイケイ	4,000	386.00	1,544,000
パルグループホールディングス	12,600	1,657.00	20,878,200
JALUX	4,100	2,558.00	10,487,800
エディオン	66,300	1,115.00	73,924,500
あらた	11,600	3,850.00	44,660,000
サーラコーポレーション	29,600	634.00	18,766,400
ワッツ	7,200	689.00	4,960,800
トーメンデバイス	2,400	6,420.00	15,408,000
ハローズ	6,700	2,821.00	18,900,700
J Pホールディングス	35,700	231.00	8,246,700
フジオフードグループ本社	12,300	1,350.00	16,605,000
あみやき亭	3,400	2,900.00	9,860,000
東京エレクトロン デバイス	4,200	5,390.00	22,638,000
ひらまつ	30,800	189.00	5,821,200
フィールズ	12,600	505.00	6,363,000
双日	159,900	1,916.00	306,368,400
アルフレッサ ホールディングス	160,800	1,697.00	272,877,600
大黒天物産	4,700	4,770.00	22,419,000
ハニーズホールディングス	11,500	1,033.00	11,879,500
ファーマライズホールディングス	4,000	715.00	2,860,000
キッコーマン	106,300	8,770.00	932,251,000
味の素	325,900	3,239.00	1,055,590,100
ブルドックソース	6,400	1,957.00	12,524,800
キュービー	77,600	2,397.00	186,007,200
ハウス食品グループ本社	55,300	2,921.00	161,531,300
カゴメ	56,000	2,890.00	161,840,000
焼津水産化学工業	5,100	907.00	4,625,700
アリアケジャパン	13,500	5,750.00	77,625,000
ピエトロ	1,200	1,794.00	2,152,800
エバラ食品工業	2,500	2,830.00	7,075,000
やまみ	1,700	1,771.00	3,010,700
ニチレイ	67,300	2,616.00	176,056,800
横浜冷凍	41,400	863.00	35,728,200
東洋水産	71,000	4,820.00	342,220,000
イトアンドホールディングス	5,700	2,300.00	13,110,000
大冷	2,000	1,908.00	3,816,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,900	507.00	4,005,300
日清食品ホールディングス	57,900	8,960.00	518,784,000
永谷園ホールディングス	6,900	1,951.00	13,461,900
一正蒲鉾	6,200	776.00	4,811,200
フジッコ	13,800	1,949.00	26,896,200
ロック・フィールド	16,000	1,544.00	24,704,000
日本たばこ産業	791,400	2,340.00	1,851,876,000
ケンコーマヨネーズ	8,500	1,355.00	11,517,500
わらべや日洋ホールディングス	9,600	1,900.00	18,240,000
なとり	8,100	2,000.00	16,200,000
イフジ産業	2,500	940.00	2,350,000
ピククルスコーポレーション	7,200	1,586.00	11,419,200
ファーマフーズ	14,000	1,632.00	22,848,000
北の達人コーポレーション	51,400	218.00	11,205,200

ユーグレナ	75,000	730.00	54,750,000
紀文食品	8,600	952.00	8,187,200
スター・マイカ・ホールディングス	8,000	1,257.00	10,056,000
S R Eホールディングス	3,500	4,090.00	14,315,000
A Dワークスグループ	30,000	140.00	4,200,000
片倉工業	13,800	2,398.00	33,092,400
グンゼ	9,600	3,855.00	37,008,000
ヒューリック	346,100	1,081.00	374,134,100
神栄	2,000	897.00	1,794,000
ラサ商事	8,200	1,036.00	8,495,200
アルペン	11,200	2,142.00	23,990,400
ハブ	4,800	591.00	2,836,800
ラクーンホールディングス	10,300	1,196.00	12,318,800
クオールホールディングス	17,800	1,334.00	23,745,200
アルコニックス	15,400	1,354.00	20,851,600
神戸物産	112,500	3,525.00	396,562,500
ソリトンシステムズ	7,300	1,274.00	9,300,200
ジーンズホールディングス	9,900	6,720.00	66,528,000
ビックカメラ	85,700	1,030.00	88,271,000
D C Mホールディングス	89,300	1,104.00	98,587,200
ペッパーフードサービス	19,700	352.00	6,934,400
ハイパー	2,300	479.00	1,101,700
M o n o t a R O	183,100	1,841.00	337,087,100
東京一番フーズ	4,000	593.00	2,372,000
D Dホールディングス	7,700	567.00	4,365,900
あい ホールディングス	20,600	1,779.00	36,647,400
ディーブイエックス	4,800	1,040.00	4,992,000
きちりホールディングス	4,100	355.00	1,455,500
アークランドサービスホールディングス	10,800	2,197.00	23,727,600
J . フロント リテイリング	172,800	1,076.00	185,932,800
ドトール・日レスホールディングス	25,000	1,605.00	40,125,000
マツキヨココカラ&カンパニー	89,100	4,080.00	363,528,000
ブロンコビリー	8,300	2,225.00	18,467,500
Z O Z O	99,800	3,070.00	306,386,000
トレジャー・ファクトリー	4,300	951.00	4,089,300
物語コーポレーション	7,200	6,280.00	45,216,000
三越伊勢丹ホールディングス	253,300	934.00	236,582,200
東洋紡	56,900	1,305.00	74,254,500
ユニチカ	39,200	305.00	11,956,000
富士紡ホールディングス	6,400	3,795.00	24,288,000
日清紡ホールディングス	89,800	989.00	88,812,200
倉敷紡績	12,300	1,917.00	23,579,100
ダイワボウホールディングス	70,400	1,642.00	115,596,800
シキボウ	7,900	917.00	7,244,300
日東紡績	22,000	2,939.00	64,658,000
トヨタ紡織	60,000	2,180.00	130,800,000
マクニカ・富士エレホールディングス	34,500	2,697.00	93,046,500
H a m e e	3,800	1,082.00	4,111,600
マーケットエンタープライズ	1,100	782.00	860,200

ラクト・ジャパン	5,000	1,979.00	9,895,000
ウエルシアホールディングス	76,600	3,130.00	239,758,000
クリエイトSDホールディングス	21,300	3,145.00	66,988,500
グリムス	6,600	2,126.00	14,031,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25,200	805.00	20,286,000
八洲電機	11,000	957.00	10,527,000
メディアスホールディングス	8,500	889.00	7,556,500
レスターホールディングス	13,800	1,952.00	26,937,600
ジューテックホールディングス	3,600	1,163.00	4,186,800
丸善CHIホールディングス	18,900	365.00	6,898,500
大光	6,800	674.00	4,583,200
OCHIホールディングス	3,600	1,321.00	4,755,600
TOKAIホールディングス	70,400	898.00	63,219,200
黒谷	4,000	637.00	2,548,000
ミサワ	3,000	655.00	1,965,000
ティーライフ	2,000	1,315.00	2,630,000
Cominix	1,800	732.00	1,317,600
エー・ビーホールディングス	2,200	439.00	965,800
三洋貿易	14,700	1,034.00	15,199,800
チムニー	4,600	1,163.00	5,349,800
シュッピン	12,000	1,079.00	12,948,000
ビューティガレージ	2,500	3,120.00	7,800,000
オイシックス・ラ・大地	20,800	2,557.00	53,185,600
ウイン・パートナーズ	10,900	993.00	10,823,700
ネクステージ	29,300	2,932.00	85,907,600
ジョイフル本田	42,400	1,525.00	64,660,000
鳥貴族ホールディングス	5,300	1,833.00	9,714,900
ホットランド	11,000	1,279.00	14,069,000
すかいらーくホールディングス	186,900	1,501.00	280,536,900
SFPホールディングス	7,200	1,415.00	10,188,000
綿半ホールディングス	11,000	1,299.00	14,289,000
日本毛織	43,400	897.00	38,929,800
ダイトウボウ	23,800	89.00	2,118,200
トーア紡コーポレーション	4,300	408.00	1,754,400
ダイドーリミテッド	20,500	140.00	2,870,000
ヨシックスホールディングス	2,900	2,156.00	6,252,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	42,300	1,080.00	45,684,000
三栄建築設計	5,900	1,622.00	9,569,800
野村不動産ホールディングス	75,000	2,781.00	208,575,000
三重交通グループホールディングス	29,900	455.00	13,604,500
サムティ	23,400	2,131.00	49,865,400
ディア・ライフ	18,900	532.00	10,054,800
コーセーアールイー	4,600	584.00	2,686,400
地主	9,200	1,753.00	16,127,600
プレサンスコーポレーション	18,900	2,044.00	38,631,600
フィル・カンパニー	2,800	1,131.00	3,166,800
THEグローバル社	9,100	174.00	1,583,400
ハウスコム	1,200	1,213.00	1,455,600

日本管理センター	7,000	974.00	6,818,000
サンセイランディック	4,600	808.00	3,716,800
エストラスト	1,400	593.00	830,200
フージャースホールディングス	18,800	684.00	12,859,200
オープンハウスグループ	46,100	5,680.00	261,848,000
東急不動産ホールディングス	426,900	650.00	277,485,000
飯田グループホールディングス	121,000	2,454.00	296,934,000
イーグランド	2,500	1,386.00	3,465,000
ムゲンエステート	9,400	488.00	4,587,200
帝国繊維	16,300	2,013.00	32,811,900
日本コークス工業	123,800	140.00	17,332,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,600	1,067.00	8,109,200
ミタチ産業	4,000	901.00	3,604,000
B E E N O S	7,500	1,827.00	13,702,500
あさひ	12,000	1,426.00	17,112,000
日本調剤	8,800	1,464.00	12,883,200
コスモス薬品	14,700	14,100.00	207,270,000
シップヘルスケアホールディングス	46,500	2,571.00	119,551,500
トーエル	6,800	862.00	5,861,600
ソフトクリエイティブホールディングス	6,400	3,770.00	24,128,000
セブン&アイ・ホールディングス	566,600	5,794.00	3,282,880,400
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	77,100	760.00	58,596,000
明治電機工業	4,700	1,225.00	5,757,500
ツルハホールディングス	31,600	9,120.00	288,192,000
デリカフーズホールディングス	6,000	537.00	3,222,000
スターティアホールディングス	3,400	762.00	2,590,800
サンマルクホールディングス	11,500	1,590.00	18,285,000
フェリシモ	3,400	1,286.00	4,372,400
トリドールホールディングス	35,900	2,331.00	83,682,900
帝人	135,400	1,384.00	187,393,600
東レ	1,042,500	670.80	699,309,000
クラレ	210,400	1,035.00	217,764,000
旭化成	954,100	1,116.00	1,064,775,600
T O K Y O B A S E	13,200	448.00	5,913,600
稲葉製作所	8,300	1,285.00	10,665,500
宮地エンジニアリンググループ	4,600	3,180.00	14,628,000
トーカロ	37,600	1,320.00	49,632,000
アルファ	4,800	1,103.00	5,294,400
S U M C O	223,900	1,984.00	444,217,600
川田テクノロジーーズ	3,000	3,970.00	11,910,000
R S T e c h n o l o g i e s	4,700	5,650.00	26,555,000
ジェイテックコーポレーション	1,600	1,581.00	2,529,600
信和	9,100	829.00	7,543,900
ビーロッド	9,900	478.00	4,732,200
ファーストブラザーズ	3,500	813.00	2,845,500
A n d D o ホールディングス	7,200	854.00	6,148,800
シーアールイー	4,000	1,712.00	6,848,000
プロパティエージェンツ	1,700	1,590.00	2,703,000
ケイアイスター不動産	6,600	6,950.00	45,870,000

アグレ都市デザイン	2,500	1,202.00	3,005,000
グッドコムアセット	6,400	1,101.00	7,046,400
ジェイ・エス・ビー	3,000	2,947.00	8,841,000
テンポイノベーション	4,100	857.00	3,513,700
グローバル・リンク・マネジメント	2,700	845.00	2,281,500
フェイスネットワーク	1,400	1,278.00	1,789,200
住江織物	3,400	1,913.00	6,504,200
日本フェルト	5,900	448.00	2,643,200
イチカワ	1,400	1,384.00	1,937,600
エコナックホールディングス	26,000	88.00	2,288,000
日東製網	1,700	1,447.00	2,459,900
芦森工業	2,500	897.00	2,242,500
アツギ	11,500	583.00	6,704,500
ウイルプラスホールディングス	2,500	970.00	2,425,000
J Mホールディングス	9,800	1,713.00	16,787,400
コメダホールディングス	31,600	2,145.00	67,782,000
サツドラホールディングス	7,400	633.00	4,684,200
アレンザホールディングス	11,200	1,090.00	12,208,000
串カツ田中ホールディングス	3,900	2,061.00	8,037,900
パロックジャパンリミテッド	10,600	897.00	9,508,200
クスリのアオキホールディングス	14,400	6,870.00	98,928,000
ダイニック	3,800	718.00	2,728,400
共和レザー	9,200	666.00	6,127,200
ピーバンドットコム	2,400	634.00	1,521,600
力の源ホールディングス	7,700	561.00	4,319,700
FOOD & LIFE COMPANIES	84,700	3,550.00	300,685,000
アセンテック	4,900	709.00	3,474,100
セーレン	29,600	2,093.00	61,952,800
ソトー	6,200	829.00	5,139,800
東海染工	1,400	1,147.00	1,605,800
小松マテーレ	23,600	1,266.00	29,877,600
ワコールホールディングス	35,900	2,054.00	73,738,600
ホギメディカル	19,500	3,150.00	61,425,000
クラウドシアホールディングス	2,500	236.00	590,000
T S Iホールディングス	47,900	330.00	15,807,000
マツオカコーポレーション	4,600	1,176.00	5,409,600
ワールド	18,900	1,178.00	22,264,200
T I S	137,600	2,759.00	379,638,400
J N Sホールディングス	6,700	413.00	2,767,100
グリー	65,700	847.00	55,647,900
G M Oペパボ	1,500	2,285.00	3,427,500
コーエーテクモホールディングス	46,100	4,135.00	190,623,500
三菱総合研究所	6,300	3,845.00	24,223,500
ボルテージ	4,000	328.00	1,312,000
電算	1,100	2,251.00	2,476,100
A G S	7,200	806.00	5,803,200
ファインデックス	12,100	929.00	11,240,900
ブレインパッド	11,300	1,136.00	12,836,800
K L a b	26,300	435.00	11,440,500

ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	20,900	987.00	20,628,300	
ネクソン	325,400	2,339.00	761,110,600	
アイスタイル	43,700	203.00	8,871,100	
エムアップホールディングス	16,400	790.00	12,956,000	
エイチーム	9,900	744.00	7,365,600	
エニグモ	15,500	641.00	9,935,500	
テクノスジャパン	11,200	454.00	5,084,800	
e n i s h	8,800	361.00	3,176,800	
コロブラ	47,300	678.00	32,069,400	
オルトプラス	11,200	317.00	3,550,400	
ブロードリーフ	71,500	349.00	24,953,500	
クロス・マーケティンググループ	5,400	860.00	4,644,000	
デジタルハーツホールディングス	6,700	1,798.00	12,046,600	
システム情報	10,900	939.00	10,235,100	
メディアドゥ	5,100	2,546.00	12,984,600	
じげん	40,600	308.00	12,504,800	
ブイキューブ	14,700	806.00	11,848,200	
エンカレッジ・テクノロジー	3,400	543.00	1,846,200	
サイバーリンクス	4,800	885.00	4,248,000	
ディー・エル・イー	9,600	223.00	2,140,800	
フィックスターズ	15,400	726.00	11,180,400	
C A R T A H O L D I N G S	5,700	1,939.00	11,052,300	
オブティム	10,000	1,003.00	10,030,000	
セレス	5,300	1,897.00	10,054,100	
S H I F T	7,300	20,500.00	149,650,000	
特種東海製紙	8,900	4,190.00	37,291,000	
ティーガイア	12,700	1,675.00	21,272,500	
セック	2,300	2,218.00	5,101,400	
テクマトリックス	24,300	1,568.00	38,102,400	
プロシップ	4,900	1,350.00	6,615,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	37,500	2,443.00	91,612,500	
G M O ペイメントゲートウェイ	28,000	9,960.00	278,880,000	
ザッパラス	5,600	477.00	2,671,200	
システムリサーチ	4,000	1,760.00	7,040,000	
インターネットイニシアティブ	38,500	3,890.00	149,765,000	
さくらインターネット	15,400	506.00	7,792,400	
ヴィンクス	4,200	825.00	3,465,000	
G M O グローバルサイン・ホールディングス	3,300	3,550.00	11,715,000	
S R A ホールディングス	7,200	2,934.00	21,124,800	
システムインテグレータ	4,800	553.00	2,654,400	
朝日ネット	13,300	620.00	8,246,000	
e B A S E	17,200	565.00	9,718,000	
アバント	15,500	1,139.00	17,654,500	
アドソル日進	5,100	1,656.00	8,445,600	
O D K ソリューションズ	3,000	637.00	1,911,000	
フリービット	8,600	908.00	7,808,800	
コムチュア	16,200	2,961.00	47,968,200	



サイバーコム	2,400	1,089.00	2,613,600
アステリア	10,400	896.00	9,318,400
アイル	8,000	1,255.00	10,040,000
王子ホールディングス	602,300	604.00	363,789,200
日本製紙	69,000	1,177.00	81,213,000
三菱製紙	21,300	319.00	6,794,700
北越コーポレーション	94,700	784.00	74,244,800
中越パルプ工業	5,600	989.00	5,538,400
巴川製紙所	4,600	818.00	3,762,800
大王製紙	69,600	1,915.00	133,284,000
阿波製紙	4,000	331.00	1,324,000
マークラインズ	7,400	2,421.00	17,915,400
メディカル・データ・ビジョン	18,300	1,022.00	18,702,600
g u m i	20,000	586.00	11,720,000
ショーケース	3,400	458.00	1,557,200
モバイルファクトリー	3,300	1,028.00	3,392,400
テラスカイ	5,200	1,469.00	7,638,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	6,400	1,212.00	7,756,800
P C Iホールディングス	6,600	1,046.00	6,903,600
パイプドHD	2,800	2,575.00	7,210,000
アイビーシー	2,600	660.00	1,716,000
ネオジャパン	4,000	1,075.00	4,300,000
P R T I M E S	3,200	2,811.00	8,995,200
ラクス	49,600	2,192.00	108,723,200
ランドコンピュータ	2,500	821.00	2,052,500
ダブルスタンダード	4,500	2,467.00	11,101,500
オーブンドア	8,600	1,658.00	14,258,800
マイネット	5,100	503.00	2,565,300
アカツキ	6,400	2,943.00	18,835,200
ベネフィットジャパン	1,100	2,116.00	2,327,600
U b i c o mホールディングス	3,900	2,270.00	8,853,000
カナミックネットワーク	15,400	453.00	6,976,200
ノムラシステムコーポレーション	7,600	255.00	1,938,000
レンゴー	136,300	864.00	117,763,200
トーモク	9,000	1,761.00	15,849,000
ザ・パック	11,000	2,721.00	29,931,000
チェンジ	26,500	1,422.00	37,683,000
シンクロ・フード	7,500	313.00	2,347,500
オークネット	7,700	1,521.00	11,711,700
キャピタル・アセット・プランニング	2,900	791.00	2,293,900
セグエグループ	3,800	579.00	2,200,200
エイトレッド	2,200	2,109.00	4,639,800
マクロミル	29,500	1,102.00	32,509,000
ビーグリー	3,400	1,150.00	3,910,000
オロ	4,600	2,330.00	10,718,000
ユーザーローカル	4,500	1,460.00	6,570,000
テモナ	3,300	425.00	1,402,500
ニーズウェル	3,400	611.00	2,077,400
マネーフォワード	22,000	4,970.00	109,340,000

サインポスト	4,600	899.00	4,135,400	
昭和電工	124,800	2,383.00	297,398,400	
住友化学	1,057,700	586.00	619,812,200	
住友精化	6,400	3,310.00	21,184,000	
日産化学	78,400	6,590.00	516,656,000	
ラサ工業	5,000	1,619.00	8,095,000	
クレハ	11,500	9,040.00	103,960,000	
多木化学	5,600	5,250.00	29,400,000	
テイカ	10,800	1,375.00	14,850,000	
石原産業	23,800	1,161.00	27,631,800	
片倉コープアグリ	2,500	1,150.00	2,875,000	
日本曹達	18,400	3,435.00	63,204,000	
東ソー	207,700	1,907.00	396,083,900	
トクヤマ	46,000	1,971.00	90,666,000	
セントラル硝子	23,500	2,107.00	49,514,500	
東亜合成	80,100	1,128.00	90,352,800	
大阪ソーダ	13,500	3,005.00	40,567,500	
関東電化工業	31,600	1,077.00	34,033,200	
デンカ	52,400	3,635.00	190,474,000	
イビデン	77,200	6,030.00	465,516,000	
信越化学工業	247,400	18,970.00	4,693,178,000	
日本カーバイド工業	5,200	1,362.00	7,082,400	
電算システムホールディングス	6,000	2,628.00	15,768,000	
堺化学工業	10,000	2,031.00	20,310,000	
第一稀元素化学工業	13,400	1,140.00	15,276,000	
エア・ウォーター	136,200	1,750.00	238,350,000	
日本酸素ホールディングス	138,500	2,283.00	316,195,500	
日本化学工業	4,600	2,638.00	12,134,800	
東邦アセチレン	2,600	1,270.00	3,302,000	
日本パーカライジング	72,600	1,028.00	74,632,800	
高压ガス工業	23,100	748.00	17,278,800	
チタン工業	1,700	1,632.00	2,774,400	
四国化成工業	19,000	1,400.00	26,600,000	
戸田工業	3,200	3,115.00	9,968,000	
ステラ ケミファ	7,200	2,497.00	17,978,400	
保土谷化学工業	4,600	5,220.00	24,012,000	
日本触媒	24,200	5,980.00	144,716,000	
大日精化工業	12,000	2,259.00	27,108,000	
カネカ	37,300	3,910.00	145,843,000	
協和キリン	172,700	2,923.00	504,802,100	
三菱瓦斯化学	133,800	2,134.00	285,529,200	
三井化学	130,800	3,040.00	397,632,000	
J S R	134,400	3,450.00	463,680,000	
東京応化工業	23,300	6,350.00	147,955,000	
大阪有機化学工業	12,200	2,986.00	36,429,200	
三菱ケミカルホールディングス	962,600	839.30	807,910,180	
K Hネオケム	23,700	3,065.00	72,640,500	
ダイセル	207,200	876.00	181,507,200	
住友ベークライト	22,800	5,340.00	121,752,000	
積水化学工業	301,300	1,937.00	583,618,100	

日本ゼオン	129,800	1,352.00	175,489,600
アイカ工業	40,100	3,175.00	127,317,500
宇部興産	67,800	2,169.00	147,058,200
積水樹脂	21,900	2,002.00	43,843,800
タキロンシーアイ	31,400	559.00	17,552,600
旭有機材	8,100	2,164.00	17,528,400
ニチパン	8,600	1,727.00	14,852,200
リケンテクノス	35,400	456.00	16,142,400
大倉工業	7,500	2,005.00	15,037,500
積水化成成品工業	19,600	449.00	8,800,400
群栄化学工業	3,500	3,450.00	12,075,000
タイガースポリマー	8,500	437.00	3,714,500
ミライアル	4,700	1,484.00	6,974,800
ダイキアクシス	5,600	701.00	3,925,600
ダイキョーニシカワ	30,700	609.00	18,696,300
竹本容器	5,300	793.00	4,202,900
森六ホールディングス	7,900	1,979.00	15,634,100
恵和	3,600	5,140.00	18,504,000
日本化薬	113,400	1,166.00	132,224,400
カーリットホールディングス	14,300	703.00	10,052,900
ソルクシーズ	12,200	418.00	5,099,600
CLホールディングス	3,000	1,198.00	3,594,000
プレステージ・インターナショナル	52,400	722.00	37,832,800
フェイス	4,000	666.00	2,664,000
プロトコーポレーション	15,400	1,260.00	19,404,000
ハイマックス	4,000	1,197.00	4,788,000
アミューズ	7,700	2,106.00	16,216,200
野村総合研究所	278,900	4,040.00	1,126,756,000
ドリームインキュベータ	3,900	2,074.00	8,088,600
サイバネットシステム	10,300	632.00	6,509,600
クイック	9,600	1,646.00	15,801,600
TAC	8,600	227.00	1,952,200
CEホールディングス	7,600	481.00	3,655,600
日本システム技術	2,900	2,187.00	6,342,300
電通グループ	144,800	4,185.00	605,988,000
インテージホールディングス	16,600	1,861.00	30,892,600
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,700	1,027.00	6,880,900
東邦システムサイエンス	4,100	930.00	3,813,000
ぴあ	4,900	3,350.00	16,415,000
イオンファンタジー	5,400	2,170.00	11,718,000
ソースネクスト	61,700	159.00	9,810,300
シーティーエス	16,000	811.00	12,976,000
ネクシィーズグループ	5,000	689.00	3,445,000
インフォコム	15,900	1,945.00	30,925,500
メディカルシステムネットワーク	14,200	540.00	7,668,000
日本精化	11,600	2,075.00	24,070,000
扶桑化学工業	12,900	4,735.00	61,081,500
トリケミカル研究所	14,900	2,976.00	44,342,400
シンプレクス・ホールディングス	16,800	2,072.00	34,809,600
HEROZ	4,000	927.00	3,708,000

ラクスル	15,900	3,640.00	57,876,000
I P S	4,000	1,839.00	7,356,000
F I G	16,000	283.00	4,528,000
システムサポート	4,300	962.00	4,136,600
A D E K A	66,300	2,526.00	167,473,800
日油	49,200	5,140.00	252,888,000
ミヨシ油脂	6,200	1,108.00	6,869,600
新日本理化	23,600	251.00	5,923,600
ハリマ化成グループ	11,000	817.00	8,987,000
イーソル	8,700	544.00	4,732,800
アルテリア・ネットワークス	18,300	1,376.00	25,180,800
東海ソフト	2,400	916.00	2,198,400
ウイングアーク1st	8,200	1,393.00	11,422,600
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,400	1,945.00	6,613,000
サーバーワークス	2,600	2,356.00	6,125,600
東名	1,500	951.00	1,426,500
ヴィッツ	1,200	1,296.00	1,555,200
トピラシステムズ	2,900	819.00	2,375,100
S a n s a n	51,300	1,225.00	62,842,500
L i n k - U	2,700	753.00	2,033,100
ギフトィ	12,600	1,092.00	13,759,200
花王	325,300	5,254.00	1,709,126,200
第一工業製薬	5,400	2,900.00	15,660,000
石原ケミカル	7,500	1,322.00	9,915,000
日華化学	5,000	803.00	4,015,000
ニイタカ	3,000	2,283.00	6,849,000
三洋化成工業	8,600	5,130.00	44,118,000
ベース	2,600	4,390.00	11,414,000
J M D C	13,500	4,955.00	66,892,500
武田薬品工業	1,155,500	3,443.00	3,978,386,500
アステラス製薬	1,274,700	2,021.50	2,576,806,050
大日本住友製薬	90,900	1,242.00	112,897,800
塩野義製薬	184,800	7,984.00	1,475,443,200
わかもと製薬	17,600	303.00	5,332,800
日本新薬	38,500	7,640.00	294,140,000
中外製薬	460,000	4,059.00	1,867,140,000
科研製薬	23,100	4,105.00	94,825,500
エーザイ	176,100	5,752.00	1,012,927,200
理研ビタミン	15,400	1,705.00	26,257,000
ロート製薬	75,500	3,205.00	241,977,500
小野薬品工業	337,600	2,830.50	955,576,800
久光製薬	38,800	3,680.00	142,784,000
有機合成薬品工業	10,300	273.00	2,811,900
持田製薬	18,700	3,720.00	69,564,000
参天製薬	274,100	1,321.00	362,086,100
扶桑薬品工業	5,200	2,246.00	11,679,200
日本ケミファ	1,200	2,123.00	2,547,600
ツムラ	45,700	3,360.00	153,552,000
日医工	45,600	747.00	34,063,200

テルモ	416,000	4,145.00	1,724,320,000	
H.U.グループホールディングス	36,700	2,954.00	108,411,800	
キッセイ薬品工業	26,200	2,359.00	61,805,800	
生化学工業	26,000	950.00	24,700,000	
栄研化学	25,900	1,788.00	46,309,200	
日水製薬	5,900	987.00	5,823,300	
鳥居薬品	8,000	3,140.00	25,120,000	
JCRファーマ	41,500	2,032.00	84,328,000	
東和薬品	21,100	2,930.00	61,823,000	
富士製薬工業	9,100	999.00	9,090,900	
ゼリア新薬工業	26,900	1,908.00	51,325,200	
第一三共	1,155,400	2,360.50	2,727,321,700	
キョーリン製薬ホールディングス	29,600	1,857.00	54,967,200	
大幸薬品	22,300	643.00	14,338,900	
ダイト	9,400	2,817.00	26,479,800	
大塚ホールディングス	305,500	4,091.00	1,249,800,500	
大正製薬ホールディングス	35,000	5,690.00	199,150,000	
ペプチドリーム	77,100	2,020.00	155,742,000	
大日本塗料	17,800	812.00	14,453,600	
日本ペイントホールディングス	541,200	849.00	459,478,800	
関西ペイント	149,300	2,296.00	342,792,800	
神東塗料	10,000	154.00	1,540,000	
中国塗料	34,000	902.00	30,668,000	
日本特殊塗料	10,900	840.00	9,156,000	
藤倉化成	18,300	482.00	8,820,600	
太陽ホールディングス	21,200	3,215.00	68,158,000	
DIC	60,900	2,997.00	182,517,300	
サカタイクス	28,700	982.00	28,183,400	
東洋インキSCホールディングス	30,500	1,925.00	58,712,500	
T&K TOKA	11,700	865.00	10,120,500	
アルプス技研	12,600	1,853.00	23,347,800	
サニックス	24,400	194.00	4,733,600	
ダイオーズ	3,500	993.00	3,475,500	
日本空調サービス	15,000	782.00	11,730,000	
オリエンタルランド	166,100	20,920.00	3,474,812,000	
フォーカスシステムズ	9,600	931.00	8,937,600	
ダスキン	32,600	2,750.00	89,650,000	
パーク24	77,800	1,734.00	134,905,200	
明光ネットワークジャパン	16,500	565.00	9,322,500	
ファルコホールディングス	6,800	2,066.00	14,048,800	
クレスコ	10,700	1,695.00	18,136,500	
フジ・メディア・ホールディングス	139,000	1,253.00	174,167,000	
秀英予備校	3,600	422.00	1,519,200	
田谷	1,800	551.00	991,800	
ラウンドワン	39,200	1,462.00	57,310,400	
リゾートトラスト	64,400	1,916.00	123,390,400	
オービック	45,600	18,840.00	859,104,000	
ジャストシステム	20,500	4,930.00	101,065,000	
TDCソフト	12,600	1,044.00	13,154,400	
Zホールディングス	2,096,900	579.10	1,214,314,790	

ビー・エム・エル	18,200	3,645.00	66,339,000
トレンドマイクロ	77,100	6,130.00	472,623,000
りらいあコミュニケーションズ	21,300	1,029.00	21,917,700
IDホールディングス	9,400	849.00	7,980,600
リソー教育	64,300	406.00	26,105,800
日本オラクル	23,400	8,360.00	195,624,000
早稲田アカデミー	8,000	1,013.00	8,104,000
アルファシステムズ	3,300	3,725.00	12,292,500
フューチャー	30,500	1,461.00	44,560,500
CAC Holdings	8,600	1,345.00	11,567,000
SBテクノロジー	6,400	2,423.00	15,507,200
トーセ	4,500	723.00	3,253,500
ユー・エス・エス	157,300	1,905.00	299,656,500
オービックビジネスコンサルタント	13,900	4,345.00	60,395,500
伊藤忠テクノソリューションズ	65,700	2,946.00	193,552,200
アイティフォー	17,400	777.00	13,519,800
東京個別指導学院	12,300	626.00	7,699,800
東計電算	1,700	4,775.00	8,117,500
サイバーエージェント	346,200	1,468.00	508,221,600
楽天グループ	721,400	978.00	705,529,200
エクスネット	2,500	963.00	2,407,500
クリーク・アンド・リバー社	7,500	1,745.00	13,087,500
モーニングスター	24,700	584.00	14,424,800
テー・オー・ダブリュ	24,800	302.00	7,489,600
大塚商会	78,000	4,275.00	333,450,000
サイボウズ	19,400	1,434.00	27,819,600
山田コンサルティンググループ	7,500	1,142.00	8,565,000
セントラルスポーツ	5,200	2,470.00	12,844,000
パラカ	4,000	1,621.00	6,484,000
電通国際情報サービス	20,800	3,495.00	72,696,000
ACCESS	16,400	587.00	9,626,800
デジタルガレージ	23,800	3,730.00	88,774,000
イーエムシステムズ	24,000	654.00	15,696,000
ウェザーニューズ	4,500	7,920.00	35,640,000
CIJ	9,800	811.00	7,947,800
ビジネスエンジニアリング	1,700	3,455.00	5,873,500
日本エンタープライズ	14,900	171.00	2,547,900
WOWOW	7,000	1,739.00	12,173,000
スカラ	12,700	670.00	8,509,000
インテリジェント ウェイブ	8,700	557.00	4,845,900
フルキャストホールディングス	12,000	2,205.00	26,460,000
エン・ジャパン	22,900	2,897.00	66,341,300
あすか製薬ホールディングス	16,800	1,037.00	17,421,600
サワイグループホールディングス	32,200	4,505.00	145,061,000
富士フイルムホールディングス	258,500	7,612.00	1,967,702,000
コニカミノルタ	320,900	498.00	159,808,200
資生堂	273,900	5,997.00	1,642,578,300
ライオン	177,600	1,513.00	268,708,800
高砂香料工業	10,300	2,811.00	28,953,300
マンダム	30,900	1,283.00	39,644,700

ミルボン	18,300	5,450.00	99,735,000
ファンケル	59,600	3,110.00	185,356,000
コーセー	27,700	10,980.00	304,146,000
コタ	9,400	1,566.00	14,720,400
シーボン	1,400	1,804.00	2,525,600
ポーラ・オルビスホールディングス	62,800	1,734.00	108,895,200
ノエビアホールディングス	12,600	5,020.00	63,252,000
アジュバンホールディングス	3,500	1,099.00	3,846,500
新日本製薬	4,000	1,325.00	5,300,000
エステー	9,500	1,537.00	14,601,500
アグロ カネショウ	5,000	1,303.00	6,515,000
コニシ	24,100	1,586.00	38,222,600
長谷川香料	25,500	2,423.00	61,786,500
星光PMC	8,600	655.00	5,633,000
小林製薬	41,300	9,470.00	391,111,000
荒川化学工業	12,300	1,126.00	13,849,800
メック	11,000	3,080.00	33,880,000
日本高純度化学	4,100	2,578.00	10,569,800
タカラバイオ	38,500	2,293.00	88,280,500
JCU	16,600	4,555.00	75,613,000
新田ゼラチン	9,300	650.00	6,045,000
OATアグリオ	3,200	2,008.00	6,425,600
デクセリアルズ	38,200	3,100.00	118,420,000
アース製薬	12,100	5,870.00	71,027,000
北興化学工業	13,800	788.00	10,874,400
大成ラミック	4,600	2,818.00	12,962,800
クミアイ化学工業	54,800	807.00	44,223,600
日本農薬	26,400	531.00	14,018,400
富士興産	3,800	971.00	3,689,800
ニチレキ	18,900	1,290.00	24,381,000
ユシロ化学工業	7,900	1,076.00	8,500,400
ビーピー・カストロール	5,500	1,301.00	7,155,500
富士石油	39,400	256.00	10,086,400
MORESCO	5,100	1,176.00	5,997,600
出光興産	163,300	3,075.00	502,147,500
ENEOSホールディングス	2,210,800	468.70	1,036,201,960
コスモエネルギーホールディングス	42,600	2,376.00	101,217,600
テスホールディングス	8,500	1,331.00	11,313,500
インフロニア・ホールディングス	196,500	1,054.00	207,111,000
横浜ゴム	85,000	1,710.00	145,350,000
TOYO TIRE	77,500	1,633.00	126,557,500
ブリヂストン	423,600	5,198.00	2,201,872,800
住友ゴム工業	132,100	1,188.00	156,934,800
藤倉コンポジット	11,900	813.00	9,674,700
オカモト	8,800	4,110.00	36,168,000
アキレス	9,400	1,238.00	11,637,200
フコク	6,600	963.00	6,355,800
ニッタ	15,300	2,816.00	43,084,800
クリエートメディック	4,300	969.00	4,166,700
住友理工	28,700	600.00	17,220,000

三ツ星ベルト	17,900	2,136.00	38,234,400
バンドー化学	24,000	884.00	21,216,000
A G C	135,100	5,040.00	680,904,000
日本板硝子	70,500	466.00	32,853,000
石塚硝子	2,500	2,043.00	5,107,500
有沢製作所	21,500	996.00	21,414,000
日本山村硝子	5,700	785.00	4,474,500
日本電気硝子	59,100	2,811.00	166,130,100
オハラ	5,900	1,110.00	6,549,000
住友大阪セメント	27,300	3,535.00	96,505,500
太平洋セメント	83,500	2,307.00	192,634,500
リソルホールディングス	1,600	4,375.00	7,000,000
日本ヒューム	15,400	691.00	10,641,400
日本コンクリート工業	29,100	283.00	8,235,300
三谷セキサン	6,900	6,520.00	44,988,000
アジアパイルホールディングス	23,300	442.00	10,298,600
東海カーボン	123,200	1,147.00	141,310,400
日本カーボン	7,600	3,990.00	30,324,000
東洋炭素	9,500	2,901.00	27,559,500
ノリタケカンパニーリミテド	8,200	4,510.00	36,982,000
T O T O	105,000	4,885.00	512,925,000
日本碍子	159,300	1,862.00	296,616,600
日本特殊陶業	111,900	2,205.00	246,739,500
ダントーホールディングス	9,500	352.00	3,344,000
M A R U W A	5,100	13,820.00	70,482,000
品川リフラクトリーズ	3,500	3,935.00	13,772,500
黒崎播磨	2,700	4,425.00	11,947,500
ヨータイ	9,400	1,287.00	12,097,800
イソライト工業	6,600	1,198.00	7,906,800
東京窯業	19,400	308.00	5,975,200
ニッカトー	6,800	613.00	4,168,400
フジインコーポレーテッド	11,900	6,650.00	79,135,000
クニミネ工業	4,900	1,003.00	4,914,700
エーアンドエーマテリアル	3,200	900.00	2,880,000
ニチアス	34,200	2,595.00	88,749,000
日本製鉄	650,600	1,967.00	1,279,730,200
神戸製鋼所	271,200	569.00	154,312,800
中山製鋼所	23,100	451.00	10,418,100
合同製鐵	7,900	1,349.00	10,657,100
ジェイ エフ イー ホールディングス	392,600	1,535.00	602,641,000
東京製鐵	49,600	1,147.00	56,891,200
共英製鋼	16,500	1,563.00	25,789,500
大和工業	28,000	3,720.00	104,160,000
東京鐵鋼	6,400	1,352.00	8,652,800
大阪製鐵	7,900	1,222.00	9,653,800
淀川製鋼所	19,300	2,610.00	50,373,000
丸一鋼管	51,500	2,642.00	136,063,000
モリ工業	4,500	2,534.00	11,403,000
大同特殊鋼	23,800	4,300.00	102,340,000



日本高周波鋼業	4,200	340.00	1,428,000	
日本冶金工業	10,800	2,960.00	31,968,000	
山陽特殊製鋼	15,000	2,209.00	33,135,000	
愛知製鋼	8,200	2,585.00	21,197,000	
日立金属	156,700	2,088.00	327,189,600	
日本金属	3,600	1,078.00	3,880,800	
大平洋金属	8,900	2,991.00	26,619,900	
新日本電工	93,600	326.00	30,513,600	
栗本鐵工所	6,800	1,560.00	10,608,000	
虹 技	2,300	947.00	2,178,100	
日本鑄鉄管	1,600	1,001.00	1,601,600	
日本製鋼所	44,100	3,750.00	165,375,000	
三菱製鋼	9,200	1,255.00	11,546,000	
日亜鋼業	19,500	277.00	5,401,500	
日本精線	2,500	4,480.00	11,200,000	
エンビプロ・ホールディングス	4,800	1,670.00	8,016,000	
大紀アルミニウム工業所	22,000	1,463.00	32,186,000	
日本軽金属ホールディングス	36,700	1,787.00	65,582,900	
三井金属鉱業	39,400	3,260.00	128,444,000	
東邦亜鉛	8,100	2,427.00	19,658,700	
三菱マテリアル	95,900	2,085.00	199,951,500	
住友金属鉱山	185,800	5,373.00	998,303,400	
DOWAホールディングス	39,700	5,180.00	205,646,000	
古河機械金属	24,100	1,263.00	30,438,300	
エス・サイエンス	69,000	23.00	1,587,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	16,700	859.00	14,345,300	
東邦チタニウム	26,200	914.00	23,946,800	
UACJ	22,200	2,316.00	51,415,200	
CKサンエツ	3,200	4,015.00	12,848,000	
古河電気工業	45,200	2,205.00	99,666,000	
住友電気工業	543,600	1,561.00	848,559,600	
フジクラ	162,000	620.00	100,440,000	
昭和電線ホールディングス	12,600	1,899.00	23,927,400	
東京特殊電線	1,700	2,895.00	4,921,500	
タツタ電線	25,700	451.00	11,590,700	
カナレ電気	2,800	1,519.00	4,253,200	
平河ヒューテック	8,200	1,169.00	9,585,800	
リョービ	17,900	1,122.00	20,083,800	
アーレスティ	15,400	379.00	5,836,600	
アサヒホールディングス	58,300	2,202.00	128,376,600	
東洋製罐グループホールディングス	92,600	1,519.00	140,659,400	
ホッカンホールディングス	8,200	1,418.00	11,627,600	
コロナ	8,600	899.00	7,731,400	
横河ブリッジホールディングス	25,000	2,040.00	51,000,000	
駒井ハルテック	2,900	2,372.00	6,878,800	
高田機工	700	2,842.00	1,989,400	
三和ホールディングス	137,100	1,202.00	164,794,200	
文化シャッター	46,400	1,028.00	47,699,200	
三協立山	18,900	615.00	11,623,500	
アルインコ	10,900	910.00	9,919,000	

東洋シャッター	2,500	543.00	1,357,500
L I X I L	228,900	2,516.00	575,912,400
日本フィルコン	10,900	535.00	5,831,500
ノーリツ	28,000	1,635.00	45,780,000
長府製作所	14,900	1,945.00	28,980,500
リンナイ	27,400	10,110.00	277,014,000
ユニプレス	21,900	819.00	17,936,100
ダイニチ工業	7,200	713.00	5,133,600
日東精工	18,400	520.00	9,568,000
三洋工業	1,400	1,809.00	2,532,600
岡部	27,800	749.00	20,822,200
ジーテクト	18,200	1,433.00	26,080,600
東ブレ	27,100	1,231.00	33,360,100
高周波熱錬	25,900	591.00	15,306,900
東京製綱	8,900	886.00	7,885,400
サンコール	12,900	558.00	7,198,200
モリテックスチール	11,400	324.00	3,693,600
パイオラックス	21,600	1,794.00	38,750,400
エイチワン	14,400	655.00	9,432,000
日本発条	133,700	900.00	120,330,000
中央発條	7,200	795.00	5,724,000
アドパネクス	2,200	1,482.00	3,260,400
三浦工業	63,000	3,295.00	207,585,000
タクマ	49,200	1,424.00	70,060,800
テクノプロ・ホールディングス	84,100	3,510.00	295,191,000
アトラグループ	2,600	260.00	676,000
インターワークス	4,500	375.00	1,687,500
アイ・アールジャパンホールディングス	6,600	4,925.00	32,505,000
Keeper 技研	9,000	1,881.00	16,929,000
ファーストロジック	2,900	747.00	2,166,300
三機サービス	3,000	969.00	2,907,000
Gunosy	8,800	713.00	6,274,400
デザインワン・ジャパン	3,600	187.00	673,200
イー・ガーディアン	5,600	2,642.00	14,795,200
リブセンス	8,700	161.00	1,400,700
ジャパンマテリアル	43,200	1,658.00	71,625,600
ベクトル	19,700	1,038.00	20,448,600
ウチヤマホールディングス	7,400	326.00	2,412,400
チャーム・ケア・コーポレーション	10,600	1,140.00	12,084,000
キャリアリンク	5,100	1,681.00	8,573,100
I B J	11,500	759.00	8,728,500
アサンテ	6,400	1,628.00	10,419,200
バリューHR	5,600	2,483.00	13,904,800
M&Aキャピタルパートナーズ	11,600	4,745.00	55,042,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,400	1,530.00	8,262,000
E R Iホールディングス	4,000	1,165.00	4,660,000
アビスト	2,200	2,925.00	6,435,000
シグマクシス・ホールディングス	8,600	2,215.00	19,049,000

ウィルグループ	10,400	1,267.00	13,176,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	18,900	188.00	3,553,200
メドピア	10,900	2,798.00	30,498,200
レアジョブ	2,800	815.00	2,282,000
リクルートホールディングス	1,083,700	5,666.00	6,140,244,200
エラン	19,400	1,022.00	19,826,800
ツガミ	31,900	1,305.00	41,629,500
オークマ	16,900	4,820.00	81,458,000
芝浦機械	16,500	3,085.00	50,902,500
アマダ	229,400	1,097.00	251,651,800
アイダエンジニアリング	38,200	1,034.00	39,498,800
滝澤鉄工所	4,800	1,193.00	5,726,400
F U J I	67,000	2,509.00	168,103,000
牧野フライス製作所	16,000	3,770.00	60,320,000
オーエスジー	67,300	2,029.00	136,551,700
ダイジェット工業	1,100	985.00	1,083,500
旭ダイヤモンド工業	38,300	604.00	23,133,200
D M G 森精機	86,300	1,733.00	149,557,900
ソディック	32,200	795.00	25,599,000
ディスコ	21,500	32,250.00	693,375,000
日東工器	8,100	1,608.00	13,024,800
日進工具	11,600	1,429.00	16,576,400
パンチ工業	12,200	491.00	5,990,200
富士ダイス	6,800	615.00	4,182,000
土木管理総合試験所	6,900	317.00	2,187,300
ネットマーケティング	6,900	439.00	3,029,100
日本郵政	1,834,300	1,025.00	1,880,157,500
ベルシステム24ホールディングス	20,100	1,425.00	28,642,500
鎌倉新書	16,000	525.00	8,400,000
S M N	3,400	602.00	2,046,800
一蔵	2,300	391.00	899,300
グローバルキッズCOMPANY	2,700	789.00	2,130,300
エアトリ	9,000	3,030.00	27,270,000
アトラエ	9,800	2,090.00	20,482,000
ストライク	5,300	4,150.00	21,995,000
ソラスト	34,500	1,060.00	36,570,000
セラク	4,600	1,218.00	5,602,800
インソース	13,700	1,906.00	26,112,200
豊田自動織機	119,200	8,900.00	1,060,880,000
豊和工業	7,900	830.00	6,557,000
O K K	5,600	758.00	4,244,800
石川製作所	3,900	1,475.00	5,752,500
東洋機械金属	9,900	567.00	5,613,300
津田駒工業	3,400	581.00	1,975,400
エンシュウ	3,500	654.00	2,289,000
島精機製作所	21,200	1,749.00	37,078,800
オプトラン	18,300	2,296.00	42,016,800
N C ホールディングス	4,100	1,617.00	6,629,700
イワキ	9,400	1,003.00	9,428,200
フリーー	12,800	1,287.00	16,473,600

ヤマシンフィルタ	29,300	383.00	11,221,900
日阪製作所	18,300	823.00	15,060,900
やまびこ	28,300	1,058.00	29,941,400
野村マイクロ・サイエンス	3,900	4,175.00	16,282,500
平田機工	6,900	5,660.00	39,054,000
ペガサスミシン製造	15,000	571.00	8,565,000
マルマエ	6,000	2,378.00	14,268,000
タツモ	6,900	1,405.00	9,694,500
ナブテスコ	82,900	3,505.00	290,564,500
三井海洋開発	15,500	1,206.00	18,693,000
レオン自動機	15,600	1,043.00	16,270,800
S M C	43,100	63,910.00	2,754,521,000
ホソカワミクロン	10,300	2,867.00	29,530,100
ユニオンツール	5,500	3,710.00	20,405,000
オイレス工業	20,500	1,613.00	33,066,500
日精エー・エス・ビー機械	4,900	2,924.00	14,327,600
サトーホールディングス	19,300	2,027.00	39,121,100
技研製作所	12,800	3,890.00	49,792,000
日本エアーテック	6,800	1,097.00	7,459,600
カワタ	4,700	1,066.00	5,010,200
日精樹脂工業	10,400	1,024.00	10,649,600
オカダアイオン	4,700	1,470.00	6,909,000
ワイエイシイホールディングス	5,700	1,232.00	7,022,400
小松製作所	666,100	2,819.50	1,878,068,950
住友重機械工業	84,100	2,965.00	249,356,500
日立建機	58,900	2,930.00	172,577,000
日工	20,400	610.00	12,444,000
巴工業	5,900	2,211.00	13,044,900
井関農機	13,700	1,336.00	18,303,200
T O W A	12,600	2,442.00	30,769,200
丸山製作所	3,200	1,498.00	4,793,600
北川鉄工所	6,800	1,401.00	9,526,800
シンニッタン	18,000	235.00	4,230,000
ローツェ	7,400	10,260.00	75,924,000
タカキタ	5,000	610.00	3,050,000
クボタ	712,600	2,396.50	1,707,745,900
荏原実業	6,900	2,179.00	15,035,100
東洋エンジニアリング	19,400	668.00	12,959,200
三菱化工機	4,700	2,020.00	9,494,000
月島機械	27,300	1,037.00	28,310,100
帝国電機製作所	10,600	1,315.00	13,939,000
新東工業	32,600	696.00	22,689,600
澁谷工業	12,800	2,520.00	32,256,000
アイチコーポレーション	21,700	828.00	17,967,600
小森コーポレーション	37,500	696.00	26,100,000
鶴見製作所	11,500	1,707.00	19,630,500
住友精密工業	2,400	1,885.00	4,524,000
日本ギア工業	6,000	263.00	1,578,000
酒井重工業	2,700	2,830.00	7,641,000
荏原製作所	61,100	5,540.00	338,494,000

石井鐵工所	1,200	2,987.00	3,584,400	
西島製作所	13,500	921.00	12,433,500	
北越工業	14,000	900.00	12,600,000	
ダイキン工業	187,400	22,385.00	4,194,949,000	
オルガノ	4,200	7,750.00	32,550,000	
トーヨーカネツ	5,500	2,558.00	14,069,000	
栗田工業	79,700	4,765.00	379,770,500	
椿本チエイン	19,400	3,240.00	62,856,000	
大同工業	6,700	930.00	6,231,000	
日機装	44,100	851.00	37,529,100	
木村化工機	12,200	743.00	9,064,600	
レイズネクスト	22,600	1,129.00	25,515,400	
アネスト岩田	23,000	811.00	18,653,000	
ダイフク	81,000	8,530.00	690,930,000	
サムコ	3,600	2,241.00	8,067,600	
加藤製作所	6,900	846.00	5,837,400	
油研工業	1,800	1,732.00	3,117,600	
タダノ	77,000	974.00	74,998,000	
フジテック	54,600	2,700.00	147,420,000	
C K D	43,400	2,058.00	89,317,200	
キトー	12,600	1,687.00	21,256,200	
平和	41,100	1,900.00	78,090,000	
理想科学工業	12,300	2,229.00	27,416,700	
S A N K Y O	31,800	3,035.00	96,513,000	
日本金銭機械	15,000	644.00	9,660,000	
マースグループホールディングス	9,400	1,617.00	15,199,800	
フクシマガリレイ	10,300	4,185.00	43,105,500	
オーイズミ	5,400	395.00	2,133,000	
ダイコク電機	6,900	1,244.00	8,583,600	
竹内製作所	22,400	2,822.00	63,212,800	
アマノ	38,500	2,187.00	84,199,500	
J U K I	20,500	767.00	15,723,500	
サンデン	20,400	194.00	3,957,600	
ジャノメ	12,500	725.00	9,062,500	
ブラザー工業	179,500	2,220.00	398,490,000	
マックス	19,700	1,774.00	34,947,800	
モリタホールディングス	23,600	1,265.00	29,854,000	
グローリー	37,700	2,089.00	78,755,300	
新晃工業	13,800	1,831.00	25,267,800	
大和冷機工業	21,200	1,131.00	23,977,200	
セガサミーホールディングス	145,900	2,071.00	302,158,900	
日本ピストンリング	5,400	1,338.00	7,225,200	
リケン	6,400	2,703.00	17,299,200	
T P R	19,900	1,489.00	29,631,100	
ツバキ・ナカシマ	32,200	1,449.00	46,657,800	
ホシザキ	43,000	8,680.00	373,240,000	
大豊工業	12,000	716.00	8,592,000	
日本精工	276,600	747.00	206,620,200	
N T N	314,800	233.00	73,348,400	
ジェイテクト	140,900	1,048.00	147,663,200	

不二越	12,600	4,215.00	53,109,000
ミネベアミツミ	253,400	2,671.00	676,831,400
日本トムソン	40,200	621.00	24,964,200
THK	83,000	2,819.00	233,977,000
ユーシン精機	11,700	697.00	8,154,900
前澤給装工業	11,400	978.00	11,149,200
イーグル工業	18,300	1,071.00	19,599,300
前澤工業	8,900	667.00	5,936,300
日本ピラー工業	14,900	3,100.00	46,190,000
キッツ	49,700	664.00	33,000,800
日立製作所	707,200	5,888.00	4,163,993,600
東芝	256,900	4,800.00	1,233,120,000
三菱電機	1,470,100	1,410.00	2,072,841,000
富士電機	88,600	5,940.00	526,284,000
東洋電機製造	5,900	959.00	5,658,100
安川電機	158,400	4,800.00	760,320,000
シンフォニアテクノロジー	17,700	1,261.00	22,319,700
明電舎	24,900	2,454.00	61,104,600
オリジン	4,000	1,258.00	5,032,000
山洋電気	6,600	4,970.00	32,802,000
デンヨー	12,600	1,674.00	21,092,400
PHCホールディングス	16,900	1,605.00	27,124,500
ベイカレント・コンサルティング	9,900	40,650.00	402,435,000
Orchestra Holdings	2,800	2,798.00	7,834,400
アイモバイル	4,000	1,165.00	4,660,000
キャリアインデックス	4,800	752.00	3,609,600
MS-Japan	5,700	888.00	5,061,600
船場	1,700	747.00	1,269,900
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	44,500	1,605.00	71,422,500
フルテック	2,200	1,315.00	2,893,000
グリーンズ	5,300	472.00	2,501,600
ツナググループ・ホールディングス	3,400	303.00	1,030,200
GAMEWITH	4,300	446.00	1,917,800
ソウルドアウト	3,500	907.00	3,174,500
MS&Consulting	2,400	657.00	1,576,800
ウェルビー	9,100	1,223.00	11,129,300
エル・ティー・エス	1,800	2,307.00	4,152,600
ミダックホールディングス	6,200	2,534.00	15,710,800
日総工産	11,000	778.00	8,558,000
キュービーネットホールディングス	6,600	1,694.00	11,180,400
RPAホールディングス	19,700	358.00	7,052,600
三櫻工業	20,200	834.00	16,846,800
マキタ	179,000	3,977.00	711,883,000
東芝テック	16,000	4,945.00	79,120,000
芝浦メカトロニクス	2,700	8,320.00	22,464,000
マブチモーター	34,100	3,600.00	122,760,000
日本電産	381,100	9,981.00	3,803,759,100
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,600	384.00	2,534,400

トレックス・セミコンダクター	7,500	2,632.00	19,740,000	
東光高岳	8,200	1,437.00	11,783,400	
ダブル・スコープ	42,300	784.00	33,163,200	
宮越ホールディングス	5,500	948.00	5,214,000	
ダイヘン	16,100	3,995.00	64,319,500	
ヤーマン	24,000	894.00	21,456,000	
JVCケンウッド	119,500	187.00	22,346,500	
ミマキエンジニアリング	13,300	780.00	10,374,000	
I-PEX	6,900	1,718.00	11,854,200	
日新電機	34,700	1,461.00	50,696,700	
大崎電気工業	26,800	478.00	12,810,400	
オムロン	122,400	8,227.00	1,006,984,800	
日東工業	19,600	1,573.00	30,830,800	
IDEC	18,300	2,330.00	42,639,000	
正興電機製作所	4,600	1,038.00	4,774,800	
不二電機工業	3,400	1,080.00	3,672,000	
ジーエス・ユアサコーポレーション	47,900	2,270.00	108,733,000	
サクサホールディングス	2,900	1,318.00	3,822,200	
メルコホールディングス	3,300	3,785.00	12,490,500	
テクノメディカ	3,500	1,581.00	5,533,500	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,100	1,067.00	4,374,700	
日本電気	186,900	5,080.00	949,452,000	
富士通	132,400	16,115.00	2,133,626,000	
沖電気工業	59,800	895.00	53,521,000	
岩崎通信機	6,300	815.00	5,134,500	
電気興業	7,900	2,312.00	18,264,800	
サンケン電気	13,800	4,730.00	65,274,000	
ナカヨ	2,200	1,134.00	2,494,800	
アイホン	8,500	2,136.00	18,156,000	
ルネサスエレクトロニクス	796,700	1,256.00	1,000,655,200	
セイコーエプソン	182,400	1,842.00	335,980,800	
ワコム	114,000	892.00	101,688,000	
アルバック	29,300	5,900.00	172,870,000	
アクセル	6,300	1,039.00	6,545,700	
EIZO	11,500	3,690.00	42,435,000	
ジャパンディスプレイ	500,000	38.00	19,000,000	
日本信号	37,500	906.00	33,975,000	
京三製作所	31,600	420.00	13,272,000	
能美防災	19,500	2,079.00	40,540,500	
ホーチキ	10,900	1,209.00	13,178,100	
星和電機	7,200	544.00	3,916,800	
エレコム	33,700	1,365.00	46,000,500	
パナソニック	1,568,100	1,201.50	1,884,072,150	
シャープ	167,600	1,247.00	208,997,200	
アンリツ	94,600	1,581.00	149,562,600	
富士通ゼネラル	39,900	2,456.00	97,994,400	
ソニーグループ	921,100	12,660.00	11,661,126,000	
TDK	213,000	4,555.00	970,215,000	
帝国通信工業	6,700	1,360.00	9,112,000	

タムラ製作所	56,800	647.00	36,749,600
アルプスアルパイン	129,900	1,268.00	164,713,200
池上通信機	5,000	643.00	3,215,000
日本電波工業	13,300	1,252.00	16,651,600
鈴木	6,800	865.00	5,882,000
メイコー	12,000	3,725.00	44,700,000
日本トリム	2,900	3,040.00	8,816,000
ローランド ディー・ジー	8,700	2,642.00	22,985,400
フォスター電機	14,800	806.00	11,928,800
S M K	3,500	2,163.00	7,570,500
ヨコオ	10,900	2,629.00	28,656,100
ティアック	23,500	133.00	3,125,500
ホシデン	35,400	1,200.00	42,480,000
ヒロセ電機	22,800	17,280.00	393,984,000
日本航空電子工業	33,700	1,832.00	61,738,400
T O A	16,000	777.00	12,432,000
マクセル	29,300	1,230.00	36,039,000
古野電気	17,400	1,054.00	18,339,600
ユニデンホールディングス	3,300	3,610.00	11,913,000
スミダコーポレーション	13,900	974.00	13,538,600
アイコム	5,500	2,360.00	12,980,000
リオン	5,600	2,193.00	12,280,800
本多通信工業	11,900	480.00	5,712,000
横河電機	147,200	1,868.00	274,969,600
新電元工業	5,600	3,375.00	18,900,000
アズビル	86,200	4,165.00	359,023,000
東亜ディーケーケー	7,600	905.00	6,878,000
日本光電工業	60,900	3,100.00	188,790,000
チノー	4,800	1,638.00	7,862,400
共和電業	14,900	378.00	5,632,200
日本電子材料	7,200	2,294.00	16,516,800
堀場製作所	27,300	6,050.00	165,165,000
アドバンテスト	109,300	9,220.00	1,007,746,000
小野測器	6,900	480.00	3,312,000
エスベック	12,000	2,014.00	24,168,000
キーエンス	133,200	58,760.00	7,826,832,000
日置電機	7,000	6,320.00	44,240,000
シスメックス	124,400	10,585.00	1,316,774,000
日本マイクロニクス	25,600	1,503.00	38,476,800
メガチップス	13,800	4,155.00	57,339,000
O B A R A G R O U P	6,800	3,270.00	22,236,000
I M A G I C A G R O U P	12,200	583.00	7,112,600
澤藤電機	1,800	1,472.00	2,649,600
デンソー	323,700	8,500.00	2,751,450,000
原田工業	7,500	981.00	7,357,500
コーセル	16,300	811.00	13,219,300
イリソ電子工業	12,300	4,240.00	52,152,000
オブテックスグループ	24,000	1,469.00	35,256,000
千代田インテグレ	6,400	1,865.00	11,936,000
アイ・オー・データ機器	5,500	857.00	4,713,500



レーザーテック	64,500	22,255.00	1,435,447,500	
スタンレー電気	102,800	2,666.00	274,064,800	
岩崎電気	5,400	2,249.00	12,144,600	
ウシオ電機	75,300	1,847.00	139,079,100	
岡谷電機産業	9,300	315.00	2,929,500	
ヘリオス テクノ ホールディング	12,900	288.00	3,715,200	
エノモト	4,000	1,602.00	6,408,000	
日本セラミック	13,800	2,508.00	34,610,400	
遠藤照明	6,900	988.00	6,817,200	
古河電池	10,700	1,231.00	13,171,700	
双信電機	6,400	581.00	3,718,400	
山一電機	10,800	2,188.00	23,630,400	
図研	9,500	2,987.00	28,376,500	
日本電子	30,800	6,250.00	192,500,000	
カシオ計算機	106,500	1,397.00	148,780,500	
ファナック	129,100	22,270.00	2,875,057,000	
日本シイエムケイ	28,900	562.00	16,241,800	
エンプラス	3,600	2,633.00	9,478,800	
大真空	19,900	1,221.00	24,297,900	
ローム	65,800	9,180.00	604,044,000	
浜松ホトニクス	105,500	5,810.00	612,955,000	
三井ハイテック	14,600	8,500.00	124,100,000	
新光電気工業	43,200	4,975.00	214,920,000	
京セラ	206,900	6,846.00	1,416,437,400	
協栄産業	1,700	1,540.00	2,618,000	
太陽誘電	71,300	5,290.00	377,177,000	
村田製作所	431,900	8,234.00	3,556,264,600	
双葉電子工業	25,100	673.00	16,892,300	
日東電工	89,000	8,710.00	775,190,000	
北陸電気工業	5,500	1,254.00	6,897,000	
東海理化電機製作所	38,800	1,545.00	59,946,000	
ニチコン	46,300	1,198.00	55,467,400	
日本ケミコン	14,000	1,863.00	26,082,000	
K O A	22,300	1,448.00	32,290,400	
三井E & Sホールディングス	53,000	370.00	19,610,000	
日立造船	124,300	743.00	92,354,900	
三菱重工業	231,000	3,193.00	737,583,000	
川崎重工業	107,300	2,172.00	233,055,600	
I H I	91,800	2,335.00	214,353,000	
名村造船所	43,700	202.00	8,827,400	
サノヤスホールディングス	17,000	131.00	2,227,000	
スプリックス	4,000	1,447.00	5,788,000	
マネジメントソリューションズ	6,900	3,300.00	22,770,000	
プロレド・パートナーズ	3,000	812.00	2,436,000	
and factory	3,300	368.00	1,214,400	
テノ・ホールディングス	2,000	603.00	1,206,000	
フロンティア・マネジメント	3,600	653.00	2,350,800	
ピアラ	2,300	547.00	1,258,100	
コプロ・ホールディングス	2,900	1,105.00	3,204,500	
ギークス	2,600	1,463.00	3,803,800	

カーブスホールディングス	38,700	704.00	27,244,800	
フォーラムエンジニアリング	9,900	870.00	8,613,000	
FAST FITNESS JAPAN	2,000	2,112.00	4,224,000	
日本車輛製造	5,500	2,000.00	11,000,000	
三菱ロジスネクスト	19,500	1,022.00	19,929,000	
近畿車輛	1,700	1,087.00	1,847,900	
一家ホールディングス	2,700	527.00	1,422,900	
フルサト・マルカホールディングス	14,000	2,194.00	30,716,000	
ヤマエグループホールディングス	9,800	1,041.00	10,201,800	
藤久ホールディングス	3,500	768.00	2,688,000	
F P G	48,800	896.00	43,724,800	
島根銀行	4,500	563.00	2,533,500	
じもとホールディングス	10,800	688.00	7,430,400	
全国保証	34,700	5,090.00	176,623,000	
めぶきフィナンシャルグループ	751,700	277.00	208,220,900	
ジャパンインベストメントアドバイザー	11,300	1,165.00	13,164,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,300	1,678.00	30,707,400	
九州フィナンシャルグループ	296,300	458.00	135,705,400	
かんぼ生命保険	145,900	2,162.00	315,435,800	
ゆうちょ銀行	342,800	1,174.00	402,447,200	
あんしん保証	4,900	285.00	1,396,500	
富山第一銀行	35,700	320.00	11,424,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	828,000	503.00	416,484,000	
ジェイリース	4,900	1,626.00	7,967,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	94,600	854.00	80,788,400	
イントラスト	6,300	618.00	3,893,400	
日本モーゲージサービス	8,200	1,064.00	8,724,800	
C A S A	5,100	845.00	4,309,500	
アルヒ	21,300	1,080.00	23,004,000	
プレミアグループ	7,500	3,810.00	28,575,000	
日産自動車	1,733,900	598.90	1,038,432,710	
いすゞ自動車	461,400	1,491.00	687,947,400	
トヨタ自動車	7,450,700	2,275.50	16,954,067,850	
日野自動車	183,600	1,060.00	194,616,000	
三菱自動車工業	544,100	316.00	171,935,600	
エフテック	10,300	540.00	5,562,000	
レシップホールディングス	5,700	560.00	3,192,000	
G M B	2,800	815.00	2,282,000	
ファルテック	2,900	726.00	2,105,400	
武蔵精密工業	32,700	1,756.00	57,421,200	
日産車体	21,700	711.00	15,428,700	
新明和工業	41,700	913.00	38,072,100	
極東開発工業	27,300	1,453.00	39,666,900	
トピー工業	12,100	1,113.00	13,467,300	
ティラド	4,200	2,838.00	11,919,600	
曙ブレーキ工業	80,600	172.00	13,863,200	

タチエス	25,700	1,211.00	31,122,700
NOK	71,200	1,281.00	91,207,200
フタバ産業	36,800	411.00	15,124,800
KYB	15,400	3,060.00	47,124,000
市光工業	17,700	512.00	9,062,400
大同メタル工業	28,500	636.00	18,126,000
プレス工業	73,000	381.00	27,813,000
ミクニ	19,600	458.00	8,976,800
太平洋工業	30,800	1,076.00	33,140,800
河西工業	17,700	314.00	5,557,800
アイシン	107,700	4,525.00	487,342,500
マツダ	461,400	882.00	406,954,800
今仙電機製作所	9,600	595.00	5,712,000
本田技研工業	1,157,500	3,403.00	3,938,972,500
スズキ	336,200	4,803.00	1,614,768,600
SUBARU	421,200	2,012.50	847,665,000
安永	7,200	872.00	6,278,400
ヤマハ発動機	191,900	2,777.00	532,906,300
小糸製作所	80,700	5,850.00	472,095,000
TBK	16,900	410.00	6,929,000
エクセディ	22,300	1,689.00	37,664,700
ミツバ	27,000	415.00	11,205,000
豊田合成	47,400	2,247.00	106,507,800
愛三工業	23,100	740.00	17,094,000
盟和産業	1,700	1,014.00	1,723,800
日本プラスト	11,500	559.00	6,428,500
ヨロズ	13,900	1,008.00	14,011,200
エフ・シー・シー	24,000	1,427.00	34,248,000
新家工業	3,800	1,692.00	6,429,600
シマノ	59,100	25,940.00	1,533,054,000
テイ・エス テック	62,100	1,562.00	97,000,200
三十三フィナンシャルグループ	13,700	1,558.00	21,344,600
第四北越フィナンシャルグループ	23,600	2,779.00	65,584,400
ひろぎんホールディングス	214,300	703.00	150,652,900
マーキュリアホールディングス	5,100	547.00	2,789,700
おきなわフィナンシャルグループ	13,100	2,322.00	30,418,200
ダイレクトマーケティングミックス	15,200	1,445.00	21,964,000
ポピンズホールディングス	3,400	2,498.00	8,493,200
LITALICO	11,500	3,060.00	35,190,000
十六フィナンシャルグループ	19,500	2,438.00	47,541,000
北國フィナンシャルホールディングス	13,400	3,200.00	42,880,000
ネットプロテクションズホールディングス	33,000	1,035.00	34,155,000
ジャムコ	8,600	831.00	7,146,600
小野建	14,300	1,695.00	24,238,500
はるやまホールディングス	6,900	510.00	3,519,000
南陽	2,300	1,945.00	4,473,500
ノジマ	23,400	2,484.00	58,125,600
佐鳥電機	9,100	923.00	8,399,300
カップ・クリエイト	20,400	1,347.00	27,478,800

エコートレーディング	2,900	594.00	1,722,600	
伯東	8,700	2,274.00	19,783,800	
コンドーテック	11,600	1,033.00	11,982,800	
中山福	7,600	409.00	3,108,400	
ライトオン	11,200	720.00	8,064,000	
ナガイレーベン	19,300	2,120.00	40,916,000	
三菱食品	14,200	3,190.00	45,298,000	
良品計画	166,700	1,763.00	293,892,100	
三城ホールディングス	15,700	251.00	3,940,700	
松田産業	10,700	2,356.00	25,209,200	
第一興商	27,500	3,340.00	91,850,000	
メディカルホールディングス	156,200	2,172.00	339,266,400	
アドヴァングループ	14,900	948.00	14,125,200	
S P K	6,000	1,278.00	7,668,000	
萩原電気ホールディングス	5,400	1,977.00	10,675,800	
アルビス	4,800	2,188.00	10,502,400	
アズワン	21,100	6,120.00	129,132,000	
スズデン	5,300	2,025.00	10,732,500	
尾家産業	3,200	995.00	3,184,000	
シモジマ	9,000	1,013.00	9,117,000	
ドウシシャ	13,800	1,516.00	20,920,800	
小津産業	2,500	1,968.00	4,920,000	
コナカ	16,900	353.00	5,965,700	
高速	8,800	1,471.00	12,944,800	
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,689.00	2,026,800	
G - 7ホールディングス	16,200	1,514.00	24,526,800	
たけびし	5,600	1,445.00	8,092,000	
イオン北海道	25,700	1,144.00	29,400,800	
コジマ	24,800	540.00	13,392,000	
ヒマラヤ	5,100	1,026.00	5,232,600	
コーナン商事	20,600	3,535.00	72,821,000	
ネットワンシステムズ	55,000	2,733.00	150,315,000	
エコス	5,400	2,099.00	11,334,600	
ワタミ	17,600	922.00	16,227,200	
マルシェ	4,000	440.00	1,760,000	
リックス	2,500	1,550.00	3,875,000	
システムソフト	30,800	103.00	3,172,400	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	289,500	1,661.00	480,859,500	
丸文	12,700	729.00	9,258,300	
西松屋チェーン	31,700	1,491.00	47,264,700	
ゼンショーホールディングス	70,800	2,767.00	195,903,600	
ハビネット	12,100	1,525.00	18,452,500	
幸楽苑ホールディングス	9,200	1,358.00	12,493,600	
ハークスレイ	6,300	480.00	3,024,000	
橋本総業ホールディングス	3,000	2,009.00	6,027,000	
日本ライフライン	42,900	1,001.00	42,942,900	
サイゼリヤ	21,500	2,760.00	59,340,000	
タカショー	11,000	661.00	7,271,000	
V Tホールディングス	54,600	456.00	24,897,600	

アルゴグラフィックス	11,400	3,110.00	35,454,000
魚力	3,900	2,046.00	7,979,400
IDOM	43,900	673.00	29,544,700
日本エム・ディ・エム	8,600	1,609.00	13,837,400
ポブラ	4,600	141.00	648,600
フジ・コーポレーション	7,900	1,183.00	9,345,700
ユナイテッドアローズ	15,100	1,804.00	27,240,400
進和	8,700	2,040.00	17,748,000
エスケイジャパン	3,300	419.00	1,382,700
ダイترون	6,300	2,034.00	12,814,200
ハイデイ日高	20,900	1,719.00	35,927,100
シークス	20,600	1,313.00	27,047,800
YU-WA CREATION HOLDINGS	8,600	200.00	1,720,000
コロワイド	59,500	1,688.00	100,436,000
ピーシーデポコーポレーション	16,900	288.00	4,867,200
田中商事	3,300	645.00	2,128,500
オーハシテクニカ	8,200	1,426.00	11,693,200
壱番屋	10,300	4,665.00	48,049,500
白銅	4,700	2,660.00	12,502,000
トップカルチャー	5,500	281.00	1,545,500
PLANT	3,600	664.00	2,390,400
スギホールディングス	28,900	6,740.00	194,786,000
ダイコー通産	1,700	1,184.00	2,012,800
薬王堂ホールディングス	7,300	2,407.00	17,571,100
島津製作所	189,300	4,120.00	779,916,000
JMS	12,300	616.00	7,576,800
クボテック	3,300	260.00	858,000
長野計器	10,800	1,338.00	14,450,400
ブイ・テクノロジー	6,400	3,400.00	21,760,000
スター精密	22,800	1,460.00	33,288,000
東京計器	9,400	1,017.00	9,559,800
愛知時計電機	3,700	1,912.00	7,074,400
インターアクション	7,500	1,958.00	14,685,000
オーバル	13,300	268.00	3,564,400
東京精密	24,800	4,540.00	112,592,000
マニー	58,600	1,653.00	96,865,800
ニコン	224,500	1,305.00	292,972,500
トプコン	69,100	1,486.00	102,682,600
オリンパス	771,100	2,263.00	1,744,999,300
理研計器	12,000	5,250.00	63,000,000
SCREENホールディングス	25,600	11,250.00	288,000,000
キヤノン電子	13,700	1,612.00	22,084,400
タムロン	11,500	2,514.00	28,911,000
HOYA	287,000	15,470.00	4,439,890,000
シード	6,900	523.00	3,608,700
ノーリツ鋼機	13,200	2,084.00	27,508,800
エー・アンド・デイ	13,400	950.00	12,730,000
朝日インテック	161,200	1,940.00	312,728,000
キヤノン	730,500	2,798.00	2,043,939,000

リコー	408,100	982.00	400,754,200
シチズン時計	172,100	505.00	86,910,500
リズム	4,600	1,310.00	6,026,000
大研医器	12,000	527.00	6,324,000
メニコン	48,800	2,716.00	132,540,800
シンシア	1,800	532.00	957,600
中本パックス	4,200	1,732.00	7,274,400
スノーピーク	19,300	2,308.00	44,544,400
パラマウントベッドホールディングス	28,200	1,934.00	54,538,800
トランザクション	8,100	1,018.00	8,245,800
粧美堂	5,000	413.00	2,065,000
ニホンフラッシュ	12,600	1,063.00	13,393,800
前田工織	16,300	3,155.00	51,426,500
永大産業	20,500	307.00	6,293,500
アートネイチャー	12,700	693.00	8,801,100
バンドダイナムコホールディングス	131,800	8,531.00	1,124,385,800
アイフィスジャパン	4,300	673.00	2,893,900
共立印刷	25,100	144.00	3,614,400
S H O E I	13,900	4,375.00	60,812,500
フランスベッドホールディングス	19,300	903.00	17,427,900
マーベラス	22,800	724.00	16,507,200
パイロットコーポレーション	24,900	4,210.00	104,829,000
萩原工業	9,600	1,201.00	11,529,600
エイベックス	24,900	1,338.00	33,316,200
フジシールインターナショナル	35,700	2,144.00	76,540,800
タカラトミー	61,500	1,164.00	71,586,000
広済堂ホールディングス	9,000	777.00	6,993,000
エステールホールディングス	4,000	638.00	2,552,000
レック	19,100	948.00	18,106,800
タカノ	5,400	696.00	3,758,400
三光合成	15,500	372.00	5,766,000
プロネクサス	11,500	1,082.00	12,443,000
ホクシン	11,000	155.00	1,705,000
ウッドワン	4,600	998.00	4,590,800
大建工業	8,700	2,145.00	18,661,500
きもと	22,900	212.00	4,854,800
凸版印刷	223,500	2,184.00	488,124,000
大日本印刷	173,800	2,739.00	476,038,200
共同印刷	4,600	2,713.00	12,479,800
N I S S H A	30,200	1,486.00	44,877,200
光村印刷	700	1,410.00	987,000
藤森工業	13,200	4,165.00	54,978,000
ヴィア・ホールディングス	19,300	153.00	2,952,900
T A K A R A & C O M P A N Y	7,400	1,880.00	13,912,000
前澤化成工業	9,500	1,241.00	11,789,500
未来工業	5,500	1,541.00	8,475,500
アシックス	129,900	2,392.00	310,720,800
ツツミ	3,800	1,863.00	7,079,400
ウェーブロックホールディングス	5,600	702.00	3,931,200
J S P	8,700	1,573.00	13,685,100

ニチハ	20,500	2,618.00	53,669,000
ローランド	10,300	4,355.00	44,856,500
エフピコ	27,000	3,375.00	91,125,000
小松ウオール工業	4,300	1,847.00	7,942,100
ヤマハ	85,500	5,370.00	459,135,000
河合楽器製作所	4,100	2,978.00	12,209,800
クリナップ	14,000	533.00	7,462,000
ビジョン	89,000	2,201.00	195,889,000
天馬	11,600	2,604.00	30,206,400
兼松サステック	600	1,650.00	990,000
キングジム	12,300	874.00	10,750,200
象印マホービン	39,800	1,473.00	58,625,400
リンテック	31,600	2,579.00	81,496,400
信越ポリマー	26,400	1,114.00	29,409,600
東リ	38,800	224.00	8,691,200
イトーキ	26,800	348.00	9,326,400
任天堂	83,000	58,490.00	4,854,670,000
三菱鉛筆	24,200	1,229.00	29,741,800
松風	6,400	1,917.00	12,268,800
タカラスタンダード	30,500	1,362.00	41,541,000
コクヨ	70,500	1,700.00	119,850,000
ナカバヤシ	14,000	516.00	7,224,000
ニフコ	49,100	3,430.00	168,413,000
立川ブラインド工業	6,700	1,100.00	7,370,000
グローブライト	13,200	2,725.00	35,970,000
オカムラ	50,600	1,196.00	60,517,600
バルカー	12,000	2,528.00	30,336,000
MUTOHホールディングス	1,200	2,092.00	2,510,400
伊藤忠商事	1,012,800	3,719.00	3,766,603,200
丸紅	1,428,300	1,179.50	1,684,679,850
スクロール	22,300	904.00	20,159,200
高島	2,300	2,367.00	5,444,100
ヨンドシーホールディングス	13,300	1,757.00	23,368,100
三陽商会	6,900	863.00	5,954,700
長瀬産業	79,600	1,820.00	144,872,000
ナイガイ	4,100	283.00	1,160,300
蝶理	8,200	1,790.00	14,678,000
豊田通商	145,300	4,940.00	717,782,000
オンワードホールディングス	86,300	297.00	25,631,100
三共生興	19,600	565.00	11,074,000
兼松	53,900	1,295.00	69,800,500
美津濃	14,700	2,261.00	33,236,700
ツカモトコーポレーション	1,800	1,308.00	2,354,400
ルックホールディングス	4,600	1,321.00	6,076,600
三井物産	1,124,400	2,965.00	3,333,846,000
日本紙パルプ商事	7,700	3,985.00	30,684,500
東京エレクトロン	93,300	55,270.00	5,156,691,000
カメイ	17,100	1,035.00	17,698,500
東都水産	600	3,935.00	2,361,000
OUGホールディングス	2,300	2,685.00	6,175,500

スターゼン	10,900	2,098.00	22,868,200	
セイコーホールディングス	20,700	2,203.00	45,602,100	
山善	60,900	999.00	60,839,100	
椿本興業	2,300	4,125.00	9,487,500	
住友商事	913,900	1,836.50	1,678,377,350	
日本ユニシス	45,100	3,135.00	141,388,500	
内田洋行	6,300	4,595.00	28,948,500	
三菱商事	1,085,100	3,953.00	4,289,400,300	
第一実業	6,700	4,260.00	28,542,000	
キャノンマーケティングジャパン	35,900	2,502.00	89,821,800	
西華産業	7,900	1,606.00	12,687,400	
佐藤商事	12,100	1,159.00	14,023,900	
菱洋エレクトロ	8,600	2,023.00	17,397,800	
東京産業	13,200	715.00	9,438,000	
ユアサ商事	13,800	2,900.00	40,020,000	
神鋼商事	3,400	3,750.00	12,750,000	
トルク	6,000	212.00	1,272,000	
阪和興業	28,900	3,300.00	95,370,000	
正栄食品工業	9,400	4,080.00	38,352,000	
カナデン	12,000	1,005.00	12,060,000	
菱電商事	11,600	1,743.00	20,218,800	
ニプロ	109,600	1,068.00	117,052,800	
岩谷産業	34,800	5,280.00	183,744,000	
ナイス	5,100	1,805.00	9,205,500	
ニチモウ	2,400	2,576.00	6,182,400	
極東貿易	4,100	2,657.00	10,893,700	
アステナホールディングス	20,300	412.00	8,363,600	
兼松エレクトロニクス	8,000	3,850.00	30,800,000	
三愛石油	35,600	919.00	32,716,400	
稲畑産業	31,800	2,032.00	64,617,600	
G S Iクレオス	6,900	1,122.00	7,741,800	
明和産業	13,300	1,117.00	14,856,100	
クワザワホールディングス	4,600	623.00	2,865,800	
キムラタン	79,900	19.00	1,518,100	
ゴールドウイン	26,000	6,090.00	158,340,000	
ユニ・チャーム	283,400	4,405.00	1,248,377,000	
デサント	28,100	3,455.00	97,085,500	
キング	6,700	517.00	3,463,900	
ワキタ	31,000	1,014.00	31,434,000	
ヤマトインターナショナル	13,300	285.00	3,790,500	
東邦ホールディングス	46,500	1,879.00	87,373,500	
サンゲツ	38,400	1,572.00	60,364,800	
ミツウロコグループホールディングス	21,300	1,029.00	21,917,700	
シナネンホールディングス	5,400	3,275.00	17,685,000	
伊藤忠エネクス	32,100	1,042.00	33,448,200	
サンリオ	44,900	2,345.00	105,290,500	
サンワテクノス	8,800	1,354.00	11,915,200	
リョーサン	16,000	2,286.00	36,576,000	
新光商事	22,000	871.00	19,162,000	
トーヨー	6,800	1,072.00	7,289,600	



三信電気	6,800	1,637.00	11,131,600
東陽テクニカ	14,300	1,050.00	15,015,000
モスフードサービス	19,100	3,025.00	57,777,500
加賀電子	13,100	3,270.00	42,837,000
三益半導体工業	11,500	2,380.00	27,370,000
都築電気	7,500	1,402.00	10,515,000
ソーダニッカ	15,100	889.00	13,423,900
立花エレテック	11,700	1,584.00	18,532,800
木曽路	19,300	2,222.00	42,884,600
S R S ホールディングス	20,000	813.00	16,260,000
千趣会	26,400	371.00	9,794,400
タカキュー	12,900	107.00	1,380,300
リテールパートナーズ	17,600	1,295.00	22,792,000
ケーヨー	26,900	852.00	22,918,800
上新電機	16,600	2,125.00	35,275,000
日本瓦斯	70,400	1,662.00	117,004,800
ロイヤルホールディングス	24,900	1,886.00	46,961,400
東天紅	600	938.00	562,800
いなげや	18,000	1,412.00	25,416,000
チヨダ	14,000	762.00	10,668,000
ライフコーポレーション	13,500	3,055.00	41,242,500
リンガーハット	17,900	2,271.00	40,650,900
M r M a x H D	18,200	613.00	11,156,600
テンアライド	15,300	311.00	4,758,300
A O K I ホールディングス	28,000	602.00	16,856,000
オークワ	22,800	943.00	21,500,400
コメリ	22,400	2,733.00	61,219,200
青山商事	29,700	693.00	20,582,100
しまむら	16,800	10,530.00	176,904,000
はせがわ	8,000	301.00	2,408,000
高島屋	105,300	1,118.00	117,725,400
松屋	29,100	727.00	21,155,700
エイチ・ツー・オー リテイリング	68,500	832.00	56,992,000
近鉄百貨店	5,500	2,683.00	14,756,500
丸井グループ	114,300	2,274.00	259,918,200
クレディセゾン	92,900	1,324.00	122,999,600
アクシアル リテイリング	11,400	3,320.00	37,848,000
井筒屋	6,900	396.00	2,732,400
イオン	557,200	2,659.00	1,481,594,800
イズミ	26,300	3,285.00	86,395,500
フォーバル	6,600	936.00	6,177,600
平和堂	26,800	1,958.00	52,474,400
フジ	17,600	1,871.00	32,929,600
ヤオコー	16,500	6,640.00	109,560,000
ゼビオホールディングス	19,700	917.00	18,064,900
ケーズホールディングス	133,400	1,239.00	165,282,600
P A L T A C	20,300	4,415.00	89,624,500
三谷産業	17,100	306.00	5,232,600
O l y m p i c グループ	7,900	710.00	5,609,000
日産東京販売ホールディングス	22,800	228.00	5,198,400

新生銀行	94,600	2,341.00	221,458,600
あおぞら銀行	81,000	2,752.00	222,912,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,093,400	740.30	6,731,844,020
りそなホールディングス	1,659,400	543.20	901,386,080
三井住友トラスト・ホールディングス	274,100	4,240.00	1,162,184,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,003,600	4,336.00	4,351,609,600
千葉銀行	483,800	789.00	381,718,200
群馬銀行	277,900	404.00	112,271,600
武蔵野銀行	21,600	1,933.00	41,752,800
千葉興業銀行	34,500	290.00	10,005,000
筑波銀行	56,900	207.00	11,778,300
七十七銀行	45,500	1,608.00	73,164,000
青森銀行	11,300	1,969.00	22,249,700
秋田銀行	9,400	1,845.00	17,343,000
山形銀行	16,300	1,003.00	16,348,900
岩手銀行	9,400	1,978.00	18,593,200
東邦銀行	121,400	222.00	26,950,800
東北銀行	7,500	1,073.00	8,047,500
みちのく銀行	9,500	899.00	8,540,500
ふくおかフィナンシャルグループ	122,000	2,369.00	289,018,000
静岡銀行	353,200	916.00	323,531,200
スルガ銀行	127,000	501.00	63,627,000
八十二銀行	326,000	443.00	144,418,000
山梨中央銀行	16,000	967.00	15,472,000
大垣共立銀行	28,800	2,094.00	60,307,200
福井銀行	12,500	1,487.00	18,587,500
清水銀行	6,300	1,668.00	10,508,400
富山銀行	2,200	2,190.00	4,818,000
滋賀銀行	27,300	2,302.00	62,844,600
南都銀行	22,800	2,044.00	46,603,200
百五銀行	140,000	367.00	51,380,000
京都銀行	51,900	5,690.00	295,311,000
紀陽銀行	49,200	1,512.00	74,390,400
ほくほくフィナンシャルグループ	90,500	962.00	87,061,000
山陰合同銀行	86,300	679.00	58,597,700
中国銀行	116,000	951.00	110,316,000
鳥取銀行	4,200	1,236.00	5,191,200
伊予銀行	192,300	629.00	120,956,700
百十四銀行	15,400	1,771.00	27,273,400
四国銀行	22,300	826.00	18,419,800
阿波銀行	22,300	2,372.00	52,895,600
大分銀行	8,600	2,009.00	17,277,400
宮崎銀行	9,100	2,213.00	20,138,300
佐賀銀行	8,600	1,550.00	13,330,000
琉球銀行	31,600	852.00	26,923,200
セブン銀行	430,400	254.00	109,321,600
みずほフィナンシャルグループ	1,854,400	1,618.50	3,001,346,400
高知銀行	4,300	788.00	3,388,400
山口フィナンシャルグループ	168,700	739.00	124,669,300
芙蓉総合リース	15,300	7,720.00	118,116,000

みずほリース	22,600	3,275.00	74,015,000
東京センチュリー	28,100	5,880.00	165,228,000
SBIホールディングス	178,900	3,040.00	543,856,000
日本証券金融	57,100	899.00	51,332,900
アイフル	243,000	343.00	83,349,000
日本アジア投資	11,500	179.00	2,058,500
長野銀行	4,900	1,315.00	6,443,500
名古屋銀行	10,900	3,210.00	34,989,000
北洋銀行	218,800	266.00	58,200,800
愛知銀行	5,300	4,860.00	25,758,000
中京銀行	5,300	1,741.00	9,227,300
大光銀行	3,600	1,562.00	5,623,200
愛媛銀行	20,500	975.00	19,987,500
トマト銀行	5,700	1,091.00	6,218,700
京葉銀行	62,500	522.00	32,625,000
栃木銀行	70,500	238.00	16,779,000
北日本銀行	4,700	1,776.00	8,347,200
東和銀行	25,900	575.00	14,892,500
福島銀行	16,800	252.00	4,233,600
大東銀行	7,400	760.00	5,624,000
リコーリース	12,800	3,825.00	48,960,000
イオンフィナンシャルサービス	78,800	1,231.00	97,002,800
アコム	286,000	315.00	90,090,000
ジャックス	16,100	3,145.00	50,634,500
オリエントコーポレーション	391,500	123.00	48,154,500
オリックス	880,300	2,471.50	2,175,661,450
三菱HCキャピタル	535,700	623.00	333,741,100
ジャフコグループ	55,700	1,735.00	96,639,500
九州リースサービス	7,900	604.00	4,771,600
トモニホールディングス	112,300	347.00	38,968,100
大和証券グループ本社	1,086,000	716.10	777,684,600
野村ホールディングス	2,214,100	541.50	1,198,935,150
岡三証券グループ	113,800	389.00	44,268,200
丸三証券	42,900	546.00	23,423,400
東洋証券	46,800	158.00	7,394,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	165,700	419.00	69,428,300
光世証券	2,900	477.00	1,383,300
水戸証券	38,700	281.00	10,874,700
いちよし証券	27,300	681.00	18,591,300
松井証券	71,200	817.00	58,170,400
SOMPOホールディングス	238,100	5,620.00	1,338,122,000
日本取引所グループ	367,100	2,391.00	877,736,100
マネックスグループ	118,000	531.00	62,658,000
極東証券	19,500	765.00	14,917,500
岩井コスモホールディングス	13,700	1,408.00	19,289,600
アイザワ証券グループ	24,000	919.00	22,056,000
フィデアホールディングス	13,200	1,439.00	18,994,800
池田泉州ホールディングス	165,800	198.00	32,828,400
アニコムホールディングス	44,400	766.00	34,010,400

MS & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	325,200	4,150.00	1,349,580,000	
マネーパートナーズグループ	15,400	217.00	3,341,800	
スパークス・グループ	66,700	260.00	17,342,000	
小林洋行	3,200	212.00	678,400	
第一生命ホールディングス	713,700	2,765.50	1,973,737,350	
東京海上ホールディングス	477,600	7,087.00	3,384,751,200	
アドバンテッジリスクマネジメント	7,200	720.00	5,184,000	
イー・ギャランティ	21,200	1,924.00	40,788,800	
アサックス	8,500	675.00	5,737,500	
NECキャピタルソリューション	6,200	2,187.00	13,559,400	
T & Dホールディングス	376,300	1,826.00	687,123,800	
アドバンスクリエイト	7,000	1,023.00	7,161,000	
三井不動産	660,900	2,492.00	1,646,962,800	
三菱地所	952,800	1,689.00	1,609,279,200	
平和不動産	24,900	4,020.00	100,098,000	
東京建物	143,100	1,727.00	247,133,700	
京阪神ビルディング	22,600	1,394.00	31,504,400	
住友不動産	304,300	3,558.00	1,082,699,400	
太平洋興発	5,600	654.00	3,662,400	
テーオーシー	26,200	756.00	19,807,200	
東京楽天地	2,300	3,860.00	8,878,000	
レオパレス21	150,200	204.00	30,640,800	
スターツコーポレーション	19,900	2,534.00	50,426,600	
フジ住宅	17,200	665.00	11,438,000	
空港施設	15,000	548.00	8,220,000	
明和地所	7,000	615.00	4,305,000	
ゴールドクレスト	11,500	1,894.00	21,781,000	
リログループ	76,900	2,059.00	158,337,100	
エスリード	5,700	1,703.00	9,707,100	
日神グループホールディングス	23,600	493.00	11,634,800	
日本エスコン	27,300	764.00	20,857,200	
タカラレーベン	61,000	318.00	19,398,000	
A V A N T I A	7,700	850.00	6,545,000	
イオンモール	72,700	1,669.00	121,336,300	
毎日コムネット	5,400	686.00	3,704,400	
ファースト住建	5,600	1,170.00	6,552,000	
ランド	787,300	10.00	7,873,000	
カチタス	35,900	3,360.00	120,624,000	
東祥	10,600	1,554.00	16,472,400	
トーセイ	20,000	1,041.00	20,820,000	
穴吹興産	3,400	1,946.00	6,616,400	
サンフロンティア不動産	20,000	1,042.00	20,840,000	
FJネクストホールディングス	14,600	992.00	14,483,200	
インテリックス	3,500	618.00	2,163,000	
ランドビジネス	6,000	242.00	1,452,000	
サンネクスタグループ	5,000	1,058.00	5,290,000	
グランディハウス	10,300	507.00	5,222,100	
東武鉄道	143,600	2,839.00	407,680,400	
相鉄ホールディングス	47,000	2,134.00	100,298,000	

東急	370,800	1,564.00	579,931,200
京浜急行電鉄	188,700	1,185.00	223,609,500
小田急電鉄	218,700	2,032.00	444,398,400
京王電鉄	76,300	5,150.00	392,945,000
京成電鉄	102,500	3,200.00	328,000,000
富士急行	17,600	3,895.00	68,552,000
新京成電鉄	3,400	2,003.00	6,810,200
東日本旅客鉄道	258,800	6,955.00	1,799,954,000
西日本旅客鉄道	178,400	4,938.00	880,939,200
東海旅客鉄道	122,100	14,950.00	1,825,395,000
西武ホールディングス	191,800	1,186.00	227,474,800
鴻池運輸	23,500	1,171.00	27,518,500
西日本鉄道	40,700	2,538.00	103,296,600
ハマキョウレックス	10,600	2,867.00	30,390,200
サカイ引越センター	6,900	4,390.00	30,291,000
近鉄グループホールディングス	139,300	3,415.00	475,709,500
阪急阪神ホールディングス	174,100	3,450.00	600,645,000
南海電気鉄道	62,300	2,308.00	143,788,400
京阪ホールディングス	62,100	2,771.00	172,079,100
神戸電鉄	3,300	3,255.00	10,741,500
名古屋鉄道	114,500	1,829.00	209,420,500
山陽電気鉄道	11,000	2,000.00	22,000,000
アルプス物流	9,900	1,014.00	10,038,600
トランコム	4,000	7,420.00	29,680,000
ヤマトホールディングス	195,200	2,483.00	484,681,600
山九	36,600	4,075.00	149,145,000
日新	11,300	1,666.00	18,825,800
丸運	8,300	242.00	2,008,600
丸全昭和運輸	11,500	3,185.00	36,627,500
センコーグループホールディングス	69,900	924.00	64,587,600
トナミホールディングス	3,400	3,690.00	12,546,000
ニッコンホールディングス	46,800	2,120.00	99,216,000
日本石油輸送	1,100	2,641.00	2,905,100
福山通運	23,000	3,650.00	83,950,000
セイノーホールディングス	94,900	1,145.00	108,660,500
エスライン	3,200	897.00	2,870,400
神奈川中央交通	3,400	3,360.00	11,424,000
日立物流	26,900	5,360.00	144,184,000
丸和運輸機関	29,500	1,160.00	34,220,000
C & F ロジホールディングス	14,300	1,353.00	19,347,900
日本郵船	116,400	9,280.00	1,080,192,000
商船三井	77,100	8,690.00	669,999,000
川崎汽船	42,900	6,730.00	288,717,000
NSユナイテッド海運	7,700	3,555.00	27,373,500
明治海運	16,500	815.00	13,447,500
飯野海運	64,500	553.00	35,668,500
共栄タンカー	2,500	924.00	2,310,000
九州旅客鉄道	107,800	2,433.00	262,277,400
SGホールディングス	263,300	2,364.00	622,441,200

NIPPON EXPRESSホールディングス	48,200	6,750.00	325,350,000	
日本航空	319,200	2,290.00	730,968,000	
ANAホールディングス	353,800	2,586.00	914,926,800	
パスコ	2,800	1,317.00	3,687,600	
TREホールディングス	19,400	1,481.00	28,731,400	
人・夢・技術グループ	5,600	1,804.00	10,102,400	
西本Wismettacホールディングス	3,400	3,130.00	10,642,000	
シルバーライフ	3,000	1,088.00	3,264,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	1,962.00	2,354,400	
Genky DrugStores	6,400	3,570.00	22,848,000	
コア商事ホールディングス	10,900	616.00	6,714,400	
国際紙パルプ商事	30,000	315.00	9,450,000	
ナルミヤ・インターナショナル	3,400	1,150.00	3,910,000	
ブックオフグループホールディングス	8,800	1,041.00	9,160,800	
ギフト	2,400	2,460.00	5,904,000	
三菱倉庫	44,100	2,810.00	123,921,000	
三井倉庫ホールディングス	14,900	2,369.00	35,298,100	
住友倉庫	49,200	2,083.00	102,483,600	
澁澤倉庫	8,500	2,132.00	18,122,000	
ヤマタネ	6,900	1,609.00	11,102,100	
東陽倉庫	22,800	316.00	7,204,800	
乾汽船	9,400	2,349.00	22,080,600	
日本トランスシティ	30,800	639.00	19,681,200	
ケイヒン	2,800	1,384.00	3,875,200	
中央倉庫	8,800	971.00	8,544,800	
川西倉庫	2,900	1,093.00	3,169,700	
安田倉庫	12,000	960.00	11,520,000	
ファイズホールディングス	2,900	611.00	1,771,900	
東洋埠頭	3,200	1,462.00	4,678,400	
上組	76,700	2,242.00	171,961,400	
サンリツ	4,000	840.00	3,360,000	
キムラユニティー	4,000	1,359.00	5,436,000	
キューソー流通システム	7,300	900.00	6,570,000	
近鉄エクスプレス	26,300	2,980.00	78,374,000	
東海運	8,600	306.00	2,631,600	
エーアイティー	8,800	1,453.00	12,786,400	
内外トランスライン	5,400	1,941.00	10,481,400	
ショーエイコーポレーション	4,000	662.00	2,648,000	
日本コンセプト	4,600	1,341.00	6,168,600	
TBSホールディングス	87,700	1,823.00	159,877,100	
日本テレビホールディングス	120,400	1,328.00	159,891,200	
朝日放送グループホールディングス	14,900	708.00	10,549,200	
テレビ朝日ホールディングス	34,700	1,609.00	55,832,300	
スカパーJ S A Tホールディングス	122,000	451.00	55,022,000	
テレビ東京ホールディングス	10,600	2,035.00	21,571,000	
日本BS放送	5,300	1,095.00	5,803,500	
ビジョン	24,600	1,044.00	25,682,400	
スマートバリュー	3,600	473.00	1,702,800	

USEN - NEXT HOLDING S	13,800	2,523.00	34,817,400	
ワイヤレスゲート	5,500	332.00	1,826,000	
コネクシオ	10,400	1,409.00	14,653,600	
日本通信	119,800	199.00	23,840,200	
クロップス	2,900	879.00	2,549,100	
日本電信電話	1,509,200	3,349.00	5,054,310,800	
KDDI	1,051,800	3,745.00	3,938,991,000	
ソフトバンク	2,185,100	1,441.00	3,148,729,100	
光通信	16,600	14,130.00	234,558,000	
エムティーアイ	14,200	566.00	8,037,200	
GMOインターネット	51,100	2,494.00	127,443,400	
ファイバーゲート	4,700	1,202.00	5,649,400	
アйдママーケティングコミュニケーション	3,500	287.00	1,004,500	
KADOKAWA	78,700	2,283.00	179,672,100	
学研ホールディングス	20,200	1,069.00	21,593,800	
ゼンリン	23,400	1,036.00	24,242,400	
昭文社ホールディングス	4,600	438.00	2,014,800	
インプレスホールディングス	11,700	211.00	2,468,700	
東京電力ホールディングス	1,100,200	357.00	392,771,400	
中部電力	449,800	1,122.00	504,675,600	
関西電力	557,000	1,070.00	595,990,000	
中国電力	229,800	873.00	200,615,400	
北陸電力	134,600	532.00	71,607,200	
東北電力	343,800	725.00	249,255,000	
四国電力	132,500	784.00	103,880,000	
九州電力	303,000	823.00	249,369,000	
北海道電力	127,800	503.00	64,283,400	
沖縄電力	31,400	1,405.00	44,117,000	
電源開発	125,200	1,970.00	246,644,000	
エフオン	8,900	542.00	4,823,800	
イーレックス	21,700	1,469.00	31,877,300	
レノバ	28,700	1,495.00	42,906,500	
東京瓦斯	281,800	2,299.00	647,858,200	
大阪瓦斯	266,100	2,037.00	542,045,700	
東邦瓦斯	67,500	3,150.00	212,625,000	
北海道瓦斯	7,600	1,498.00	11,384,800	
広島ガス	29,100	358.00	10,417,800	
西部ガスホールディングス	16,600	2,180.00	36,188,000	
静岡ガス	38,400	996.00	38,246,400	
メタウォーター	15,300	2,019.00	30,890,700	
アイネット	7,600	1,283.00	9,750,800	
松竹	9,500	12,060.00	114,570,000	
東宝	85,200	4,765.00	405,978,000	
エイチ・アイ・エス	31,300	2,050.00	64,165,000	
東映	4,700	17,600.00	82,720,000	
ラックランド	4,100	2,887.00	11,836,700	
エヌ・ティ・ティ・データ	384,200	2,256.00	866,755,200	
共立メンテナンス	25,000	4,155.00	103,875,000	

イチネンホールディングス	14,600	1,288.00	18,804,800
建設技術研究所	8,500	2,365.00	20,102,500
スペース	10,400	914.00	9,505,600
アインホールディングス	19,400	5,970.00	115,818,000
燦ホールディングス	6,300	1,542.00	9,714,600
ピー・シー・エー	8,600	1,542.00	13,261,200
スバル興業	700	7,910.00	5,537,000
東京テアトル	5,400	1,225.00	6,615,000
タナベ経営	4,800	631.00	3,028,800
ビジネスブレイン太田昭和	5,100	1,731.00	8,828,100
ナガワ	4,600	9,480.00	43,608,000
東京都競馬	10,700	4,320.00	46,224,000
常磐興産	5,400	1,355.00	7,317,000
カナモト	24,800	2,299.00	57,015,200
D T S	27,700	2,590.00	71,743,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	67,100	5,930.00	397,903,000
シーイーシー	15,400	1,088.00	16,755,200
カブコン	136,100	2,893.00	393,737,300
西尾レントオール	12,900	2,860.00	36,894,000
アイ・エス・ビー	6,800	924.00	6,283,200
アゴーラ ホスピタリティグループ	75,200	22.00	1,654,400
日本空港ビルデング	55,300	5,260.00	290,878,000
トランス・コスモス	17,900	3,190.00	57,101,000
乃村工藝社	60,200	958.00	57,671,600
ジャステック	8,600	1,043.00	8,969,800
S C S K	100,000	1,956.00	195,600,000
藤田観光	6,200	2,451.00	15,196,200
K N T - C Tホールディングス	8,700	1,466.00	12,754,200
日本管財	15,100	2,787.00	42,083,700
トーカイ	12,500	1,831.00	22,887,500
白洋舎	1,700	1,206.00	2,050,200
セコム	138,500	8,287.00	1,147,749,500
日本システムウエア	5,400	2,129.00	11,496,600
セントラル警備保障	6,800	2,369.00	16,109,200
アイネス	13,200	1,501.00	19,813,200
丹青社	28,700	719.00	20,635,300
メイテック	17,000	6,700.00	113,900,000
T K C	24,400	2,976.00	72,614,400
富士ソフト	15,400	5,000.00	77,000,000
応用地質	16,000	2,135.00	34,160,000
船井総研ホールディングス	28,800	2,314.00	66,643,200
N S D	46,500	2,075.00	96,487,500
進学会ホールディングス	5,100	328.00	1,672,800
丸紅建材リース	1,100	1,789.00	1,967,900
オオバ	10,200	726.00	7,405,200
コナミホールディングス	52,400	7,000.00	366,800,000
いであ	3,900	1,783.00	6,953,700
学究社	4,700	1,536.00	7,219,200



ベネッセホールディングス	46,800	2,276.00	106,516,800
イオンディライト	17,300	3,025.00	52,332,500
ナック	7,400	982.00	7,266,800
福井コンピュータホールディングス	6,700	2,985.00	19,999,500
ダイセキ	26,000	4,895.00	127,270,000
ステップ	5,300	1,789.00	9,481,700
日鉄物産	10,400	5,310.00	55,224,000
泉州電業	4,100	6,330.00	25,953,000
元気寿司	4,100	2,550.00	10,455,000
トラスコ中山	30,200	2,495.00	75,349,000
ヤマダホールディングス	528,800	398.00	210,462,400
オートバックスセブン	48,800	1,413.00	68,954,400
モリト	10,900	730.00	7,957,000
アーランドサカモト	22,800	1,530.00	34,884,000
ニトリホールディングス	57,600	16,250.00	936,000,000
グルメ杵屋	12,000	1,012.00	12,144,000
愛眼	8,100	175.00	1,417,500
ケーユーホールディングス	7,900	1,028.00	8,121,200
吉野家ホールディングス	50,600	2,392.00	121,035,200
加藤産業	21,000	3,290.00	69,090,000
北恵	4,000	868.00	3,472,000
イノテック	8,700	1,473.00	12,815,100
イエローハット	25,100	1,674.00	42,017,400
松屋フーズホールディングス	7,000	3,625.00	25,375,000
JBCホールディングス	9,800	1,502.00	14,719,600
JKホールディングス	11,700	994.00	11,629,800
サガミホールディングス	22,300	1,079.00	24,061,700
日伝	12,100	2,158.00	26,111,800
関西フードマーケット	11,000	1,046.00	11,506,000
ミロク情報サービス	12,700	1,287.00	16,344,900
北沢産業	7,600	227.00	1,725,200
杉本商事	6,600	2,158.00	14,242,800
因幡電機産業	38,700	2,583.00	99,962,100
王将フードサービス	9,500	5,950.00	56,525,000
プレナス	16,400	2,014.00	33,029,600
ミニストップ	11,200	1,473.00	16,497,600
アークス	27,700	2,200.00	60,940,000
バローホールディングス	32,100	2,250.00	72,225,000
東テク	4,600	2,423.00	11,145,800
ミスミグループ本社	181,700	3,470.00	630,499,000
アルテック	10,300	307.00	3,162,100
ベルク	6,400	5,390.00	34,496,000
大庄	8,000	1,032.00	8,256,000
タキヒヨー	4,100	1,410.00	5,781,000
ファーストリテイリング	19,400	64,050.00	1,242,570,000
ソフトバンクグループ	865,000	5,350.00	4,627,750,000
蔵王産業	2,200	1,835.00	4,037,000
スズケン	56,600	3,545.00	200,647,000
サンドラッグ	54,500	2,984.00	162,628,000
サクスパー ホールディングス	13,800	516.00	7,120,800

ジェコス	10,800	800.00	8,640,000	
ヤマザワ	2,900	1,634.00	4,738,600	
やまや	3,000	2,494.00	7,482,000	
グローセル	17,100	445.00	7,609,500	
ペルーナ	31,100	753.00	23,418,300	
合計	161,644,000		387,140,847,090	

(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】

2022年2月28日現在

資産総額	64,131,792,456円
負債総額	206,715,265円
純資産総額( - )	63,925,077,191円
発行済数量	41,625,945,308口
1口当たり純資産額( / )	1.5357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

2022年2月28日現在

資産総額	383,174,801,338円
負債総額	789,601,521円
純資産総額( - )	382,385,199,817円
発行済数量	122,304,728,287口
1口当たり純資産額( / )	3.1265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（2022年2月28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（2022年2月28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。

2022年2月28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	1,457,224,919,605
追加型株式投資信託	816	14,809,317,410,845
単位型公社債投資信託	28	57,065,906,952
単位型株式投資信託	224	1,299,846,341,843
合計	1,094	17,623,454,579,245

### 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	3,524,781	3,991,834
ソフトウェア仮勘定	3,299,065	2,878,179
電話加入権	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	9,482,127	11,153,554
関係会社株式	261,361	261,360
長期差入保証金	5,299,196	5,299,196
繰延税金資産	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								
	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	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おります。

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おります。

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あります。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	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	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 其他有価証券	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	-	-	-	-
其他有価証券	-	-	-	-
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) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。



## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (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「販売会社一覧表」の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社武蔵野銀行	45,743	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社京葉銀行	49,759	日本において銀行業務を営んでおります。
信金中央金庫	( 1 ) 690,998	日本において全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の受給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
松井証券株式会社	11,945	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2021年3月末日現在

## (1) 出資の総額

## 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

2022年3月11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 稲葉 宏和  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているOne DC 国内株式インデックスファンドの2021年2月9日から2022年2月7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、One DC 国内株式インデックスファンドの2022年2月7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) 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

(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。