

【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6月10日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出） 内国投資信託受益証券に係るファ ンドの名称】	MHAM TOPIXオープン
【届出の対象とした募集（売出） 内国投資信託受益証券の金額】	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】

MHAM TOPIXオープン(以下「当ファンド」といいます。)

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込日の基準価額とします。

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除して求めた金額(純資産総額)を計算日における受益権総口数で除した価額をいいます。ただし、便宜上1万口当たり換算した価額で表示されることがあります。

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

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

注：電話番号はコールセンターのものであります（以下同じ）。

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

（５）【申込手数料】

通常のお申込みのお取扱い

申込手数料は、取得申込金額（取得申込口数に発行価格を乗じた額）に、1.65%（税抜1.5%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。なお、申込手数料には、消費税ならびに地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）が課せられます。

確定拠出年金制度に基づくお申込みのお取扱い

無手数料とします。

申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。

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

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

(6) 【申込単位】

申込単位は、各販売会社が定める単位とします。

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

申込単位および取扱コースについては、販売会社にお問い合わせください。

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

2022年6月11日から2022年12月9日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

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

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

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

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

投資信託振替制度における振替受益権について

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

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

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

確定拠出年金制度に基づくお申込みのお取扱い

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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への投資を通じ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)銘柄に投資を行い、東証株価指数(TOPIX、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指します。

東証株価指数(TOPIX=Tokyo Stock Price Index)とは、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、基準時(1968年1月4日終値)の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。

1. 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。
2. 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。
3. 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。
4. 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。
5. 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。
6. 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。
7. 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。
8. 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。

<ファンドの特色>

東証株価指数(TOPIX、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指します。
運用にあたっては、「日本株式マルチファクターモデル」を活用します。

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

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

< 商品分類 >

・商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・商品分類定義

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

< 属性区分 >

・ 属性区分表

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

当ファンドが投資信託証券への投資を通じて実質的な投資対象とする資産は、「株式・一般」です。

(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)	目論見書又は投資信託約款において、主として「株式」、「債券」及び「不動産投信」以外の資産に投資する旨の記載があるものをいい、括弧内の記載はその該当資産を表す。
株式・一般	目論見書又は投資信託約款において、主として株式に投資する旨の記載があるもので、大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。 当ファンドは、主としてマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式に投資を行います。
年1回	目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
日本	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
TOPIX	目論見書又は投資信託約款において、TOPIX（東証株価指数）に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

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

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

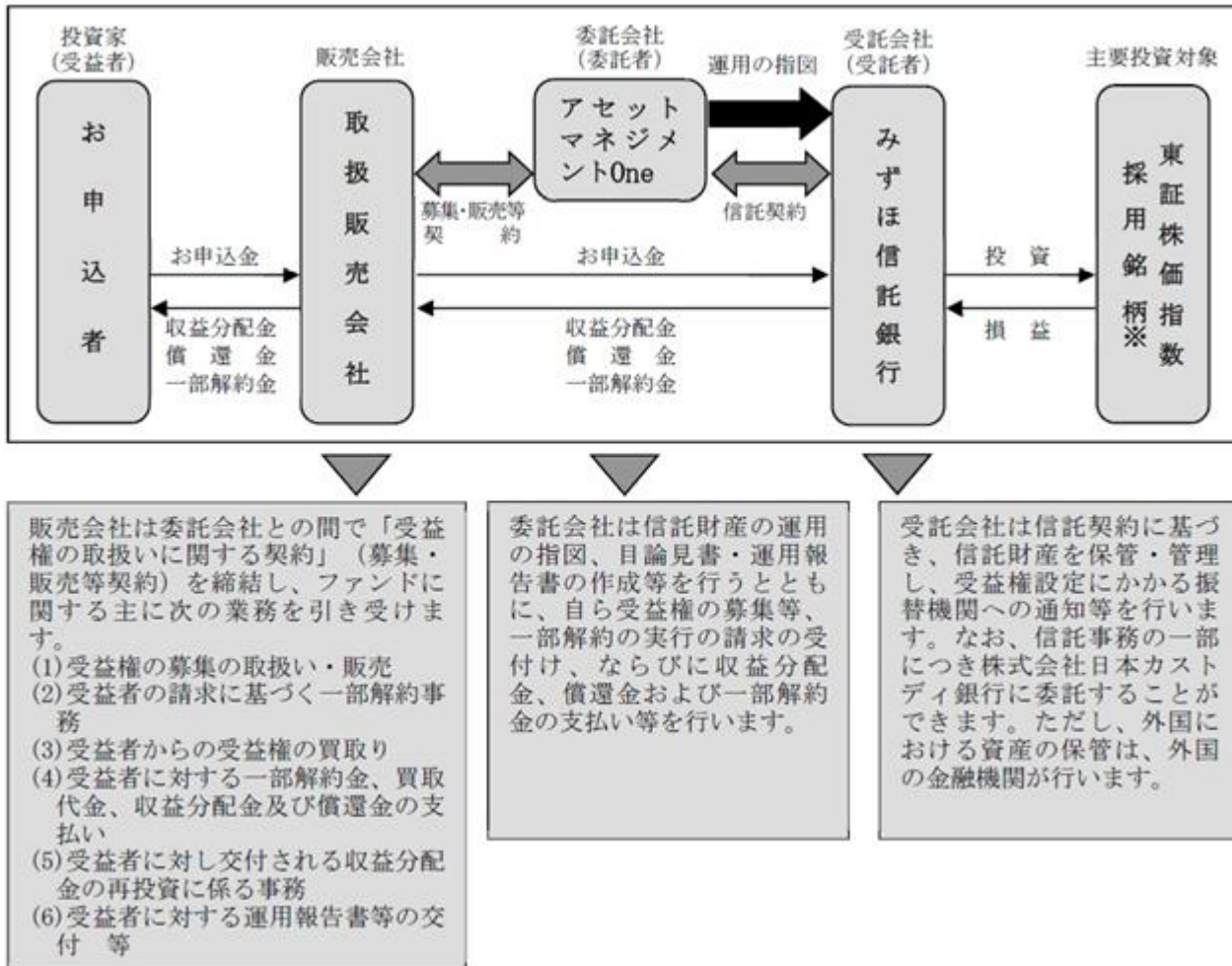
（注3）当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

（2）【ファンドの沿革】

1998年10月22日	信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
2007年1月4日	投資信託振替制度へ移行
2007年7月1日	当ファンドの名称を「富士TOPIXオープン」から「MHAM TOPIXオープン」に変更
2016年10月1日	ファンドの委託会社としての業務をみずほ投信投資顧問株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継
2021年7月2日	ファンドの主要投資対象に「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」を追加
2021年12月11日	信託報酬率(税抜)を「年率0.65%」から「年率0.6%」に引き下げ
2021年12月17日	ファンドの主要投資対象から「MHAM TOPIXマザーファンド」を削除

（3）【ファンドの仕組み】

当ファンドの運営の仕組み

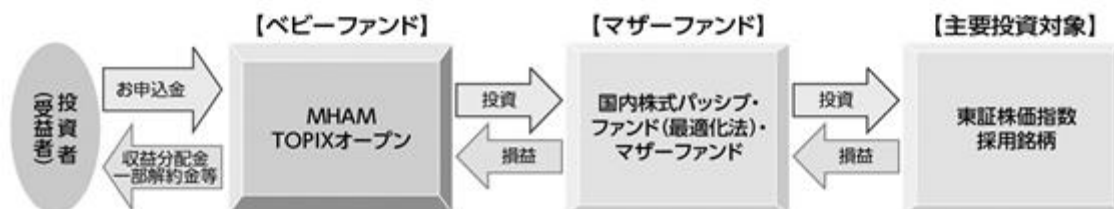


主要投資対象である東証株価指数採用銘柄には、主として、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドを通じて投資を行います。

ファミリーファンド方式の仕組み

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」をマザーファンドとするファミリーファンド方式で運用を行います。

ファミリーファンド方式



ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資することにより、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。

マザーファンドのほかに、株式等に直接投資する場合があります。

委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2022年3月31日現在）

委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月1日	D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

（2022年3月31日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

基本方針

この投資信託は、東証株価指数（TOPIX、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用方法

1．主要投資対象

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。なお、株式等に直接投資することもあります。

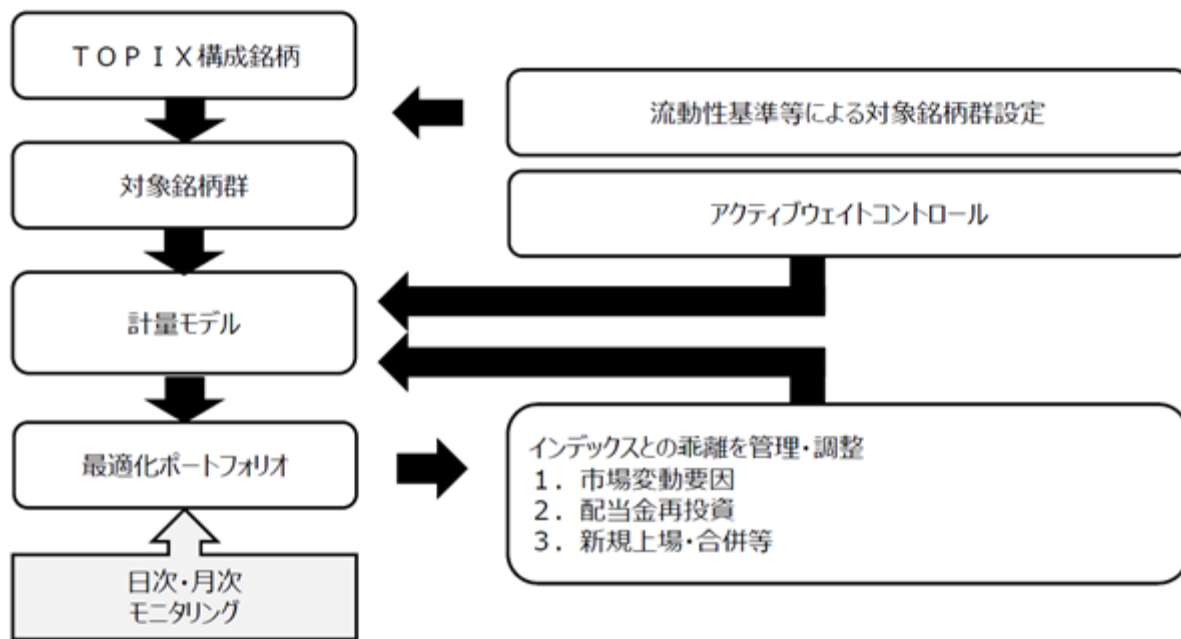
2. 投資態度

- a. 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)と連動する投資成果を目標として運用を行います。
運用にあたっては、「日本株式マルチファクターモデル」を活用します。
- ・ 「日本株式マルチファクターモデル」とは、複数のリスクファクターによって株式のリターンを分解・説明するモデルです。このモデルを活用し、TOPIXに連動する銘柄群を効率的に選びます。
 - ・ 投資する銘柄群について定期的に見直しを実施することにより、TOPIXに対する連動性を高めます。
- b. 現物株への投資よりTOPIX先物等を活用する方が有利と認められるときは、TOPIX先物等を活用することがあります。
- c. 株価指数等の先物取引を含む株式の実質投資割合は、原則信託財産の純資産総額の範囲内となるよう運用を行います。一時的に株式の実質投資総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質投資総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。
「実質投資割合」とは、投資対象である当該資産につき、当ファンドの信託財産に属する当該資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該資産のうち当ファンドの信託財産に属するとみなした額との合計額の当ファンドの信託財産総額または信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。(以下同じ。)
- * 株価指数先物取引等の詳細については、後記「(5) 投資制限 a. 約款で定める投資制限 有価証券先物取引等」をご参照ください。
- d. 組入対象銘柄は、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)銘柄とします。ただし、流動性に著しく欠ける銘柄や信用リスクが高いと判断される銘柄等は組入れません。
- e. 現物株式の実質組入比率(信託財産に属する他の投資信託受益証券の時価総額に、当該他の投資信託の信託財産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額と、信託財産に属する株式の時価総額との合計額が信託財産総額に占める割合)は、通常の状態では50%以上とすることを基本とします。
- f. 非株式(株式以外の資産)への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- g. 上記a. からf. について、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。
- h. 国内において行われる有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、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。)、有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引(以下「有価証券先物取引等」といいます。)を行うことができます。

ファンドの投資プロセス

当ファンドは、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への投資を通じ、以下のプロセスにより東証株価指数採用銘柄に投資を行います。

<国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの投資プロセス>



1. 流動性基準等による対象銘柄群設定

マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄等を除外して投資対象銘柄群を設定します。

2. 最適化法によるポートフォリオの構築

インデックス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。

3. インデックスとの乖離を管理

日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
- ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施
- ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定

(2) 【投資対象】

有価証券の指図範囲

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および次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. コマーシャル・ペーパー
7. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券(両者を総称して「新株引受権証券等」といいます。)
8. 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券または証書で、前記2.から7.の証券の性質を有するもの
9. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
10. 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。)
11. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

金融商品の指図範囲

委託会社は、信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。))により運用することを指図することができます。また、前記 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を以下に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

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

その他の投資対象

1. 有価証券先物取引等

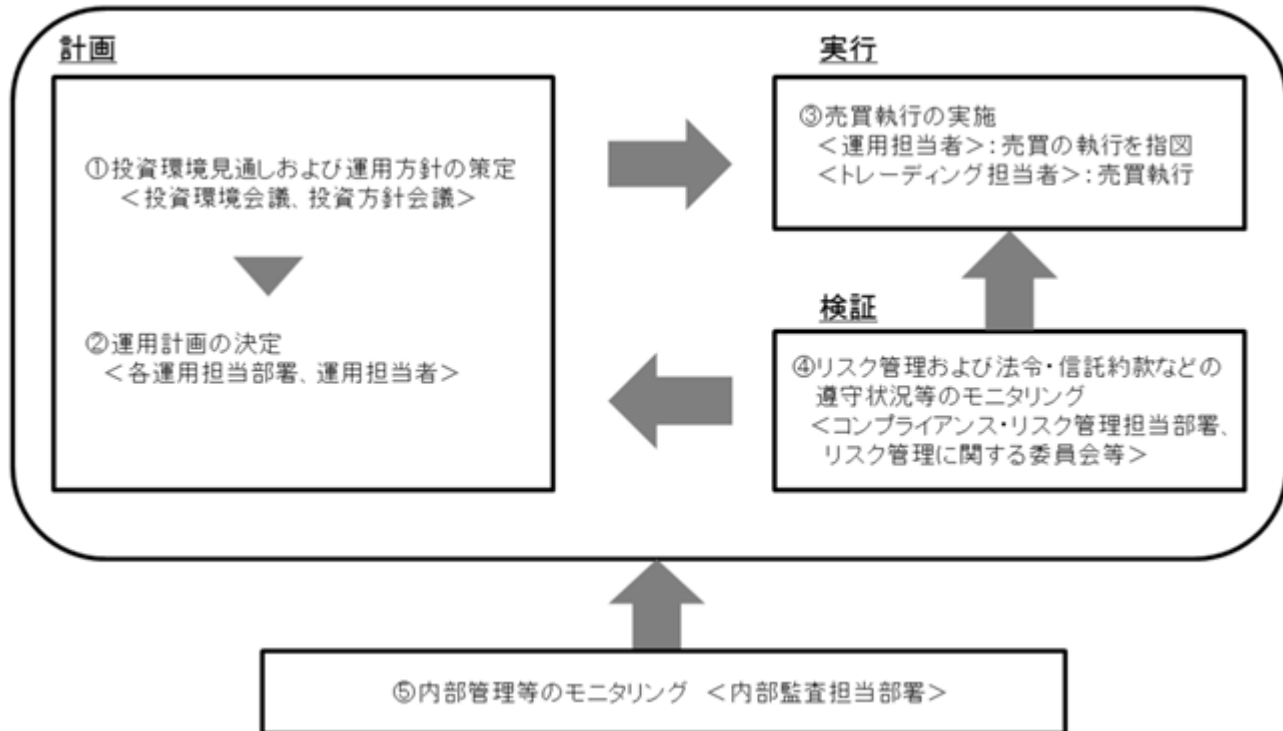
有価証券先物取引等を行うことができます。

2. スワップ取引および金利先渡し取引

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引および金利先渡し取引を行うことができます。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見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。

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2022年3月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

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

1. 分配対象収益の範囲

分配対象収益の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益(評価益を含みません)等の全額とします。

2. 分配対象収益についての分配方針

収益分配金額は、委託会社が基準価額水準および市場動向等を勘案し、原則として配当等収益を中心に決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合は、分配を行わない場合もあります。

3. 留保金の運用方針

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

将来の収益分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

収益分配金の支払い

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

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

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

(5) 【投資制限】

a. 約款で定める投資制限

株式および新株引受権証券等(約款 運用の基本方針(3)運用制限、約款第18条および第19条)

1. 株式の実質投資割合には、制限を設けません。
2. 委託会社は新株引受権証券等への実質投資割合が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
3. 同一銘柄の新株引受権証券等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
4. 委託会社が投資することを指図する株式および新株引受権証券等は、証券取引所(「証券取引所」とは、金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場(以下「取引所」といいます。)のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。)に上場(上場予定を含みます。)されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式および新株引受権証券等についてはこの限りではありません。

非株式[株式以外の資産](約款 運用の基本方針(2)運用方法 投資態度)

非株式(株式以外の資産)への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

外貨建資産への投資(約款 運用の基本方針(3)運用制限)

外貨建資産への投資は行いません。

信用取引(約款第21条)

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお当該売り付けの決済については、株券の引き渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
2. 前記1.の信用取引の指図は、次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、且つ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - a. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - b. 株式分割により取得する株券
 - c. 有償増資により取得する株券
 - d. 売り出しにより取得する株券

- e. 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(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新株予約権付社債(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ます。)の行使により取得可能な株券
- f. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前記e.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

信用リスク集中回避のための投資制限(約款第21条の1の2)

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

デリバティブ取引等(約款第21条の2)

委託会社は、デリバティブ取引等(デリバティブ取引とは、金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買および商品投資等取引(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。))を含みます。以下「デリバティブ取引等」といいます(ただし、この信託において取引可能なものに限ります。以下同じ。))について、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

有価証券先物取引等(約款第22条)

1. 委託会社は、わが国の証券取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。))。
2. 委託会社は、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。

スワップ取引(約款第23条)

1. 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、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(「スワップ取引」)を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当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。

3. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
4. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引(約款第24条)

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。
3. 金利先渡取引の評価は、当該取引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。
4. 委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

転換社債等(約款第25条)

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債(両者を総称して「転換社債等」といいます。)への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

有価証券の貸付(約款第26条)

1. 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範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - a. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価評価額を超えないものとします。
 - b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額を超えないものとします。
2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
3. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

資金の借入れ(約款第33条)

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約にともなう支払資金の手当て(一部解約にともな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手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
2. 一部解約にともなう支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解

約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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

4. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

b. 法令で定める投資制限

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

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

<参考> 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドの投資方針および主な投資制限

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式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。

2. 運用方法

(1) 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。

(2) 投資態度

- 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目指して運用を行います。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資割合には、制限を設けません。
- 2) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- 3) 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

- 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。

3【投資リスク】

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

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

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

なお、以下のリスクは、主にマザーファンドを通じて当ファンドが行う有価証券等への投資により発生します。

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。

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

なお、当ファンドでは、株式と株価指数先物取引等の合計の組入比率を原則として高位に維持するため、株式市場の動向により基準価額は大きく変動します。また、当ファンドでは、追加設定・一部解約に伴う資金の流出入に対応することにより、株式の実質組入比率(現物株式+株価指数先物取引等)が100%を超える場合があります。

流動性リスク

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

流動性リスクとは、有価証券を売却(または購入)しようとする際に、需要(または供給)がないため、有価証券を希望する時期に、希望する価格で売却(または購入)することができなくなるり

スクをいいます。一般に規模が小さい市場での売買や、取引量の少ない有価証券の売買にあつては、流動性リスクへの留意が特に必要とされます。また、一般に市場を取り巻く外部環境の急変があった場合には、市場実勢価格での売買ができなくなる可能性が高まります。当ファンドが投資する株式等の流動性が損なわれた場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

信用リスク

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

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

<その他>

- ・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ある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- ・有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- ・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。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用が影響を受ける場合があります。
- ・当ファンドは、証券取引所における取引の停止等があるときには、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことがあります。
- ・資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

<その他の留意点>

当ファンドは、ベンチマークである東証株価指数(TOPIX、配当込み)の動きと連動する投資成果を目指しておりますが、追加設定・一部解約による運用資金の変動、株価指数の構成銘柄の一部を組み入れない場合の影響、銘柄ごとの組入比率が株価指数における構成比率と異なる場合の影響、株価指数先物取引を利用する場合の株価指数と株価指数先物の値動きの差による影響、売買約定価格と取引所終値との差による影響、売買執行に要する費用や信託報酬等が信託財

産から支払われることの影響などにより、当ファンドの基準価額の騰落率と、同じ期間におけるベンチマークの騰落率との間に乖離が生じる場合があります。

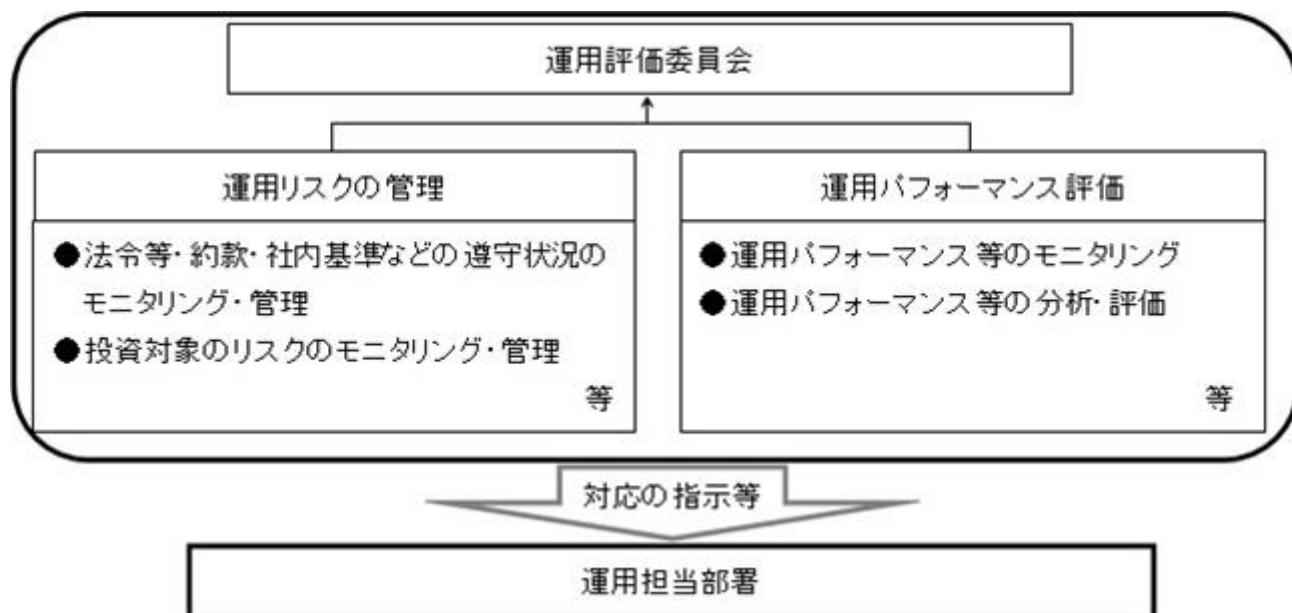
< 収益分配金に関する留意点 >

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

(2) リスク管理体制

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

- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・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3月31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>

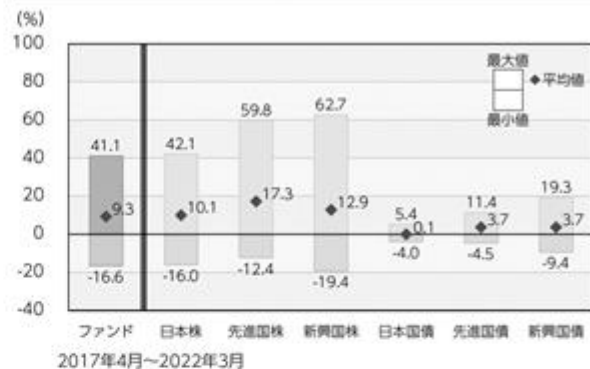
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



*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。なお、分配金再投資基準価額は、1999年1月4日の当ファンドの基準価額（9,649円）に合わせて指数化しています。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数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】

通常のお申込みの場合

申込手数料は、取得申込金額(取得申込口数に発行価格を乗じた額)に、1.65%(税抜1.5%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。なお、申込手数料には、消費税等相当額が課せられます。

確定拠出年金制度に基づくお申込みの場合

無手数料とします。

申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。

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

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

< 申込手数料を対価とする役務の内容 >

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

(2)【換金(解約)手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.66%(税抜0.6%)の率を乗じて得た額とします。

その配分(税抜)については、以下の通りとなります。

委託会社	販売会社	受託会社
0.265%	0.275%	0.060%

信託報酬は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の6カ月の終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。なお、信託報酬にかかる消費税等相当額を、信託報酬支弁の時に信託財産中から支弁します。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

< 信託報酬等を対価とする役務の内容 >

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

(4) 【その他の手数料等】

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、当該費用にかかる消費税等相当額とともに毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁します。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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

法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%(所得税15.315%(復興特別所得税を含みます。))の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

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

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「一般コース」と「自動けいぞく投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の〈収益分配金の課税について〉を参照。）

<収益分配金の課税について>

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

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

なお、収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2022年3月31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	8,792,382,889	99.98
内 日本	8,792,382,889	99.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,768,618	0.02
純資産総額	8,794,151,507	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3月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	401,814,220,820	96.94
内 日本	401,814,220,820	96.94
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	12,698,799,315	3.06
純資産総額	414,513,020,135	100.00

その他資産の投資状況

2022年3月31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）	12,691,180,000	3.06
内 日本	12,691,180,000	3.06

（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3月31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	2,696,222,904	3.0329 8,177,404,935	3.2610 8,792,382,889	- -	99.98

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年3月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.98
合計	99.98

（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

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3月31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	7,655,900	2,243.53 17,176,269,669	2,222.50 17,015,237,750	- -	4.10
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	946,800	12,701.60 12,025,882,443	12,730.00 12,052,764,000	- -	2.91
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	136,900	58,425.69 7,998,477,761	57,250.00 7,837,525,000	- -	1.89
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	9,343,800	754.04 7,045,621,061	760.30 7,104,091,140	- -	1.71
5	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	95,900	56,646.49 5,432,399,333	63,250.00 6,065,675,000	- -	1.46
6	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,113,500	5,639.09 6,279,136,759	5,414.00 6,028,489,000	- -	1.45
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,550,700	3,396.44 5,266,870,832	3,545.00 5,497,231,500	- -	1.33
8	任天堂 日本	株式 その他製品	85,300	59,399.14 5,066,746,709	61,670.00 5,260,451,000	- -	1.27
9	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,114,900	4,094.22 4,564,651,402	4,601.00 5,129,654,900	- -	1.24
10	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	888,900	5,347.55 4,753,437,905	5,559.00 4,941,395,100	- -	1.19
11	信越化学工業 日本	株式 化学	254,200	18,932.42 4,812,621,386	18,790.00 4,776,418,000	- -	1.15
12	日立製作所 日本	株式 電気機器	726,700	5,937.52 4,314,801,204	6,165.00 4,480,105,500	- -	1.08
13	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,080,800	3,825.58 4,134,687,572	4,005.00 4,328,604,000	- -	1.04
14	ダイキン工業 日本	株式 機械	192,500	22,549.73 4,340,823,220	22,410.00 4,313,925,000	- -	1.04
15	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,040,700	3,813.25 3,968,453,185	4,144.00 4,312,660,800	- -	1.04
16	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,187,400	3,484.27 4,137,231,742	3,498.00 4,153,525,200	- -	1.00
17	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,189,400	3,426.16 4,075,083,228	3,487.00 4,147,437,800	- -	1.00

18	HOYA 日本	株式 精密機器	294,900	15,204.75 4,483,883,475	14,030.00 4,137,447,000	- -	1.00
19	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,031,200	4,312.77 4,447,335,960	3,907.00 4,028,898,400	- -	0.97
20	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	170,700	21,623.87 3,691,194,814	23,510.00 4,013,157,000	- -	0.97
21	三井物産 日本	株式 卸売業	1,155,400	3,048.12 3,521,804,558	3,328.00 3,845,171,200	- -	0.93
22	日本電産 日本	株式 電気機器	391,600	9,963.39 3,901,665,385	9,748.00 3,817,316,800	- -	0.92
23	村田製作所 日本	株式 電気機器	443,700	8,242.00 3,656,978,802	8,117.00 3,601,512,900	- -	0.87
24	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	490,800	7,169.41 3,518,747,220	7,128.00 3,498,422,400	- -	0.84
25	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	582,100	5,738.21 3,340,213,021	5,813.00 3,383,747,300	- -	0.82
26	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,245,300	1,459.28 3,276,535,146	1,428.00 3,206,288,400	- -	0.77
27	第一三共 日本	株式 医薬品	1,187,100	2,396.64 2,845,058,526	2,680.00 3,181,428,000	- -	0.77
28	SMC 日本	株式 機械	44,200	65,133.76 2,878,912,372	68,840.00 3,042,728,000	- -	0.73
29	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,905,600	1,625.53 3,097,613,626	1,567.00 2,986,075,200	- -	0.72
30	ファナック 日本	株式 電気機器	132,600	22,220.97 2,946,501,678	21,645.00 2,870,127,000	- -	0.69

(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3月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	96.94
合計	96.94

(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3月31日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	17.53
輸送用機器		8.11
情報・通信業		7.99
化学		6.25
卸売業		5.92
サービス業		5.71
機械		5.18
銀行業		5.14

医薬品	4.76
小売業	4.10
食料品	3.15
陸運業	2.98
精密機器	2.45
その他製品	2.35
保険業	2.17
建設業	2.14
不動産業	1.90
その他金融業	1.11
電気・ガス業	1.09
鉄鋼	0.82
非鉄金属	0.79
証券、商品先物取引業	0.74
ガラス・土石製品	0.71
ゴム製品	0.64
海運業	0.62
金属製品	0.55
石油・石炭製品	0.43
繊維製品	0.43
空運業	0.41
鉱業	0.30
パルプ・紙	0.20
倉庫・運輸関連業	0.18
水産・農林業	0.09
合計	96.94

（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3月31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 0406月	買建	652	12,115,000,160	12,691,180,000	3.06

（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3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15計算期間末 (2013年3月11日)	9,410	9,507	0.6796	0.6866
第16計算期間末 (2014年3月10日)	8,735	8,833	0.8027	0.8117
第17計算期間末 (2015年3月10日)	9,788	9,877	1.0008	1.0098
第18計算期間末 (2016年3月10日)	8,408	8,502	0.8879	0.8979
第19計算期間末 (2017年3月10日)	9,275	9,383	1.0364	1.0484
第20計算期間末 (2018年3月12日)	9,108	9,211	1.1489	1.1619
第21計算期間末 (2019年3月11日)	8,288	8,359	1.0502	1.0592
第22計算期間末 (2020年3月10日)	6,843	6,975	0.9339	0.9519
第23計算期間末 (2021年3月10日)	8,814	8,917	1.2812	1.2962
第24計算期間末 (2022年3月10日)	8,083	8,209	1.2194	1.2384
2021年3月末日	9,160	-	1.3148	-
4月末日	8,862	-	1.2770	-
5月末日	8,939	-	1.2937	-
6月末日	8,964	-	1.3083	-
7月末日	8,706	-	1.2792	-
8月末日	8,921	-	1.3188	-
9月末日	9,225	-	1.3756	-
10月末日	9,091	-	1.3551	-
11月末日	8,729	-	1.3053	-
12月末日	9,006	-	1.3499	-
2022年1月末日	8,584	-	1.2840	-
2月末日	8,477	-	1.2778	-
3月末日	8,794	-	1.3108	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第15計算期間	0.0070
第16計算期間	0.0090
第17計算期間	0.0090
第18計算期間	0.0100
第19計算期間	0.0120
第20計算期間	0.0130

第21計算期間	0.0090
第22計算期間	0.0180
第23計算期間	0.0150
第24計算期間	0.0190

【収益率の推移】

	収益率(%)
第15計算期間	25.00
第16計算期間	19.44
第17計算期間	25.80
第18計算期間	10.28
第19計算期間	18.08
第20計算期間	12.11
第21計算期間	7.81
第22計算期間	9.4
第23計算期間	38.8
第24計算期間	3.3

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 計算期間末が2019年8月29日以前の収益率については、小数点第2位で表示しています。

(4) 【設定及び解約の実績】

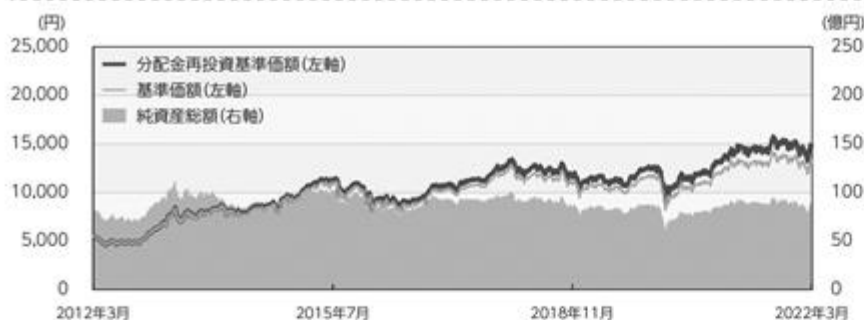
	設定口数	解約口数
第15計算期間	1,546,858,797	2,755,516,847
第16計算期間	1,720,491,029	4,684,522,874
第17計算期間	1,297,591,952	2,399,371,648
第18計算期間	1,764,811,465	2,076,291,110
第19計算期間	1,243,083,227	1,762,450,093
第20計算期間	1,277,274,100	2,299,730,471
第21計算期間	1,138,643,487	1,174,485,331
第22計算期間	1,083,065,008	1,646,604,346
第23計算期間	1,239,609,441	1,688,249,680
第24計算期間	1,042,960,494	1,294,065,701

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

参考情報

データの基準日:2022年3月31日

基準価額・純資産の推移（2012年3月30日～2022年3月31日）



※基準価額は1万円当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:1998年10月22日)

分配の推移(税引前)

2018年 3月	130円
2019年 3月	90円
2020年 3月	180円
2021年 3月	150円
2022年 3月	190円
設定来累計	5,510円

※分配金は1万円当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	99.98

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	96.94
内 日本	96.94
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.06
合計(純資産総額)	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	3.06

株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	17.53
2	輸送用機器	8.11
3	情報・通信業	7.99
4	化学	6.25
5	卸売業	5.92

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	4.10
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.91
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.89
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.71
5	東京エレクトロン	株式	日本	電気機器	1.46
6	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.45
7	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.33
8	任天堂	株式	日本	その他製品	1.27
9	三菱商事	株式	日本	卸売業	1.24
10	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.19

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】

- (1) 当ファンドのお申込みは、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後2時までにお買付けのお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日分のお申込みといたします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については翌営業日のお取扱いとなります。
 - (2) 取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。
 - (3) お申込みには、収益の分配がなされた場合に分配金を受領する「一般コース」と、分配金は原則として税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資される「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があります。ただし、販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
 - (4) 申込単位は、各販売会社が定める単位とします。申込単位については、販売会社にお問い合わせください。
 - (5) 取得申込者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入(積立)をすることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
 - (6) 取得申込みにかかる受益権の価額は、取得申込日の基準価額に、販売会社が別に定める申込手数料および申込手数料にかかる消費税等相当額を加算した価額とします。
 - (7) 販売会社において金額買付(申込単位が金額にて表示されている場合)による申込みをされた場合、申込手数料および申込手数料にかかる消費税等相当額はお申込代金の中から差し引かれません。
 - (8) 自動けいぞく投資約款に基づく契約に基づき、収益分配金を再投資する際は、1口単位で購入できるものとします。なお、その際の受益権の価額は、原則として各計算期間終了日の基準価額とします。
 - (9) 当ファンドを確定拠出年金制度に基づき取得する場合には、確定拠出年金に係る法令・制度等の定めに従って取得申込等の手続が行われます。
 - (10) 信託財産の資金管理を円滑に行うために大口の取得申込みには制限を設ける場合があります。また、信託財産の運用方針の維持および円滑な資金管理のため、当ファンドの残高や市場の流動性等に応じ、委託会社の判断により一日あたりの取得申込みの総額について制限を設ける場合があります。
- 当ファンドの場合、1件あたり10億円を目安と致します。
- (11) 信託財産の効率的な運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合、証券取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

2【換金（解約）手続等】

- (1) 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に各販売会社が定める単位をもって解約を請求することができます。

解約単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

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

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

- (5) 解約代金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において受益者に支払われます。
- (6) 信託財産の資金管理を円滑に行うために大口の解約請求には制限を設ける場合があります。また、信託財産の運用方針の維持および円滑な資金管理のため、当ファンドの残高や市場の流動性等に応じ、委託会社の判断により一日あたりの解約のお申込みの総額について制限を設ける場合があります。
- 当ファンドの場合、1件あたり10億円を目安と致します。
- (7) 信託財産の効率的な運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合、証券取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、前記(4)の規定に準じた価額とします。
- (8) ご換金の方法について、販売会社によっては解約請求制のほかに買取請求制（販売会社が受益権を買取ることにより換金する方法）による換金を受付ける場合があります。詳しくはお申込みの販売会社にお問い合わせください。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における取引所の最終相場

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

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

1998年10月22日から無期限とします。

(4)【計算期間】

毎年3月11日から翌年3月10日までとすることを原則とします。ただし、第1期計算期間は1998年10月22日から1999年3月10日までとします。

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

(5)【その他】

信託契約の解約

以下の場合には信託契約を解約し信託を終了することがあります。

1. 委託会社は、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき、もしくは信託契約の一部解約により、受益権の口数が5億口を下回るようになる場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

a. この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その

旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかる全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

- b. 前記 a. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
 - c. 前記 b. の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記 1. の信託契約の解約をしません。
 - d. 委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
 - e. 前記 b. から d. までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記 b. の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
 - f. 前記 1. に定める信託契約の解約を行う場合において、前記 b. の期間内に異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。なお、買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社の協議により決定するものとします。
2. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
 3. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、この信託は、「信託約款の変更4.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
 4. 受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

1. 委託会社は、信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更できるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
2. 委託会社は、前記 1. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前記 2. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前記 3. の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記 1. の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、この信託約款を変更しないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

6. 前記2.に定める変更を行う場合において、前記3.の期間内に異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。なお、買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社の協議により決定するものとします。

7. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記の規定にしたがいます。

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

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

関係法人との契約の更改および受託会社の辞任または解任に伴う取扱い

1. 委託会社と販売会社との間の募集・販売等契約は、締結日から原則1年間とし、期間終了の3カ月前までに別段の意思表示のない時は、同一条件にて継続されます。

2. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は「信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託事務処理の再信託

受託会社は、当ファンドにかかる信託事務処理の一部について、株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

公告

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

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

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

運用報告書

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金請求権

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

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

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

なお、「自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3) 一部解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることができます。

(4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
- なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第24期計算期間(2021年3月11日から2022年3月10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】

【MHAM TOPIXオープン】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第23期 2021年3月10日現在	第24期 2022年3月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	59,113,776	42,616,576
親投資信託受益証券	8,812,692,738	8,081,710,804
未収入金	108,207,000	138,704,000
流動資産合計	8,980,013,514	8,263,031,380
資産合計	8,980,013,514	8,263,031,380
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	103,198,370	125,946,936
未払解約金	32,522,757	23,182,609
未払受託者報酬	3,459,346	3,308,757
未払委託者報酬	26,521,851	27,266,807
その他未払費用	65,506	69,306
流動負債合計	165,767,830	179,774,415
負債合計	165,767,830	179,774,415
純資産の部		
元本等		
元本	6,879,891,358	6,628,786,151
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,934,354,326	1,454,470,814
（分配準備積立金）	2,376,042,428	1,958,983,499
元本等合計	8,814,245,684	8,083,256,965
純資産合計	8,814,245,684	8,083,256,965
負債純資産合計	8,980,013,514	8,263,031,380

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第23期		第24期	
	自	2020年3月11日 2021年3月10日	自	2021年3月11日 2022年3月10日
営業収益				
受取利息		31		139
有価証券売買等損益		2,689,677,305		206,637,255
営業収益合計		2,689,677,336		206,637,116
営業費用				
支払利息		11,283		6,711
受託者報酬		6,578,432		7,036,235
委託者報酬		50,435,175		55,844,399
その他費用		125,313		139,792
営業費用合計		57,150,203		63,027,137
営業利益又は営業損失()		2,632,527,133		269,664,253
経常利益又は経常損失()		2,632,527,133		269,664,253
当期純利益又は当期純損失()		2,632,527,133		269,664,253
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()		291,907,299		51,409,978
期首剰余金又は期首欠損金()		484,739,391		1,934,354,326
剰余金増加額又は欠損金減少額		181,672,253		334,200,939
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		99,329,657		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		82,342,596		334,200,939
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		367,063,284
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		367,063,284
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		103,198,370		125,946,936
期末剰余金又は期末欠損金()		1,934,354,326		1,454,470,814

(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24期	
	自 2021年3月11日	至 2022年3月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第23期	第24期
	2021年3月10日現在	2022年3月10日現在
1. 期首元本額	7,328,531,597円	6,879,891,358円
期中追加設定元本額	1,239,609,441円	1,042,960,494円
期中一部解約元本額	1,688,249,680円	1,294,065,701円
2. 受益権の総数	6,879,891,358口	6,628,786,151口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第23期	第24期
	自 2020年3月11日 至 2021年3月10日	自 2021年3月11日 至 2022年3月10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(166,613,953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(952,610,478円)、信託約款に規定される収益調整金(3,298,984,333円)及び分配準備積立金(1,360,016,367円)より分配対象収益は5,778,225,131円(1万口当たり8,398.71円)であり、うち103,198,370円(1万口当たり150円)を分配金額としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(121,962,087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(3,507,455,981円)及び分配準備積立金(1,962,968,348円)より分配対象収益は5,592,386,416円(1万口当たり8,436.51円)であり、うち125,946,936円(1万口当たり190円)を分配金額としております。

(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23期	第24期
	自 2020年3月11日 至 2021年3月10日	自 2021年3月11日 至 2022年3月10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23期 2021年3月10日現在	第24期 2022年3月10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23期 2021年3月10日現在	第24期 2022年3月10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	2,473,718,471	477,141,361
合計	2,473,718,471	477,141,361

（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23期 2021年3月10日現在	第24期 2022年3月10日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2812円 (12,812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3月10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	2,665,032,417	8,081,710,804	
親投資信託受益証券	合計	2,665,032,417	8,081,710,804	
合計			8,081,710,804	

（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3月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,657,721,654
株式	302,658,361,970
派生商品評価勘定	419,579,440
未収入金	36,006,330,633
未収配当金	737,397,617
差入委託証拠金	512,400,000
流動資産合計	348,991,791,314
資産合計	348,991,791,314
負債の部	
流動負債	
前受金	24,675,000
未払解約金	36,258,999,000
流動負債合計	36,283,674,000
負債合計	36,283,674,000
純資産の部	
元本等	
元本	103,118,786,197
剰余金	
剰余金又は欠損金()	209,589,331,117
元本等合計	312,708,117,314
純資産合計	312,708,117,314
負債純資産合計	348,991,791,314

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3月11日 至 2022年3月10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3月10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	88,859,520,801円
同期中追加設定元本額	181,385,437,812円
同期中一部解約元本額	167,126,172,416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	2,665,032,417円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	7,030,738,610円
One DC 国内株式インデックスファンド	20,631,403,158円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,707,403,381円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	5,852,813円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	25,533,252円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	101,689,165円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	28,274,643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	1,408,556,293円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,077,697,172円
たわらノーロード バランス(堅実型)	44,382,078円
たわらノーロード バランス(標準型)	280,384,646円
たわらノーロード バランス(積極型)	425,887,250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)	3,609,330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)	172,955,376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)	433,666,921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)	287,401,810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)	410,886,261円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	725,362円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	3,007,661円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	40,956,359円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,116,841円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	18,637,939円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,919,726,075円
Oneグローバルバランス	3,121,653円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,081,528,510円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,564,940,172円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,843,170,186円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	351,732,687円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,115,860,256円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,125,077,998円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	30,620,397円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,059,266,348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)	309,179,618円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	308,861,026円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	546,708,833円
投資のソムリエ	900,204,586円
クルーズコントロール	75,393,443円
投資のソムリエ<DC年金>	54,368,489円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	338,355,786円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	573,719,009円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	35,580,936円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	243,235,854円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	48,598,382円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	23,720,265円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	296,215円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	149,486,605円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	363,271,525円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,165,294,615円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	299,933,872円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	49,990,359円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	21,024,864円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	16,706,433円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	121,090,455円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	994,499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)	13,248,260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)	13,713,933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)	8,254,524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)	12,951,379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)	58,656,822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)2021-05(適格機関投資家限定)	21,400,356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)	35,164,588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)	24,440,349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)	11,831,677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)	24,579,073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)	35,343,107円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	22,448,387円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	34,428,091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)	106,256,286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)	22,429,851円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	586,939円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	56,490,122円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	101,200,914円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,829,909円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	26,669,183円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,571,449円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,238,584円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	6,945,752円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	30,835,108円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	543,868,421円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	621,806,167円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,780,665,290円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	29,629,553円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	28,589,501円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	292,643,513円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	72,589,955円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,397,771円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	345,064,046円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	20,169,520円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	72,434,630円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	169,180,633円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	227,249,936円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	37,090,194円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	17,604,229円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	291,737,796円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	936,557,239円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,240,495,959円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	49,936,951円
動的パッケージファンド<DC年金>	4,222,215円

コア資産形成ファンド	3,090,715円
MHAMトピックスファンド	702,783,197円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	65,047,177円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	594,499,033円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,016,054,461円
計	103,118,786,197円
2. 受益権の総数	103,118,786,197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3月11日 至 2022年3月10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3月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年3月10日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	16,598,378,310	
合計	16,598,378,310	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年2月8日から2022年3月10日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2022年3月10日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	9,228,065,000	-		419,755,000
合計	9,228,065,000	-		419,755,000

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

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

(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3月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.0325円 (30,325円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2022年3月10日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	

極洋	5,900	3,265.00	19,263,500
日本水産	164,400	535.00	87,954,000
マルハニチロ	25,800	2,427.00	62,616,600
ハウスイ	500	1,217.00	608,500
雪国まいたけ	12,200	1,149.00	14,017,800
カネコ種苗	4,100	1,581.00	6,482,100
サカタのタネ	19,800	3,540.00	70,092,000
ホクト	14,000	1,974.00	27,636,000
ホクリヨウ	2,800	699.00	1,957,200
ヒノキヤグループ	3,600	2,286.00	8,229,600
ショーボンドホールディングス	23,500	5,290.00	124,315,000
ミライト・ホールディングス	53,000	1,954.00	103,562,000
タマホーム	10,000	2,301.00	23,010,000
サンヨーホームズ	2,000	783.00	1,566,000
日本アクア	6,700	565.00	3,785,500
ファーストコーポレーション	5,300	731.00	3,874,300
ベステラ	3,300	1,239.00	4,088,700
Robot Home	27,400	197.00	5,397,800
キャンディル	3,100	488.00	1,512,800
住石ホールディングス	28,900	172.00	4,970,800
日鉄鉱業	3,700	6,880.00	25,456,000
三井松島ホールディングス	6,900	1,960.00	13,524,000
I N P E X	659,000	1,342.00	884,378,000
石油資源開発	19,300	2,653.00	51,202,900
K & O エナジーグループ	8,200	1,672.00	13,710,400
ダイセキ環境ソリューション	3,200	1,171.00	3,747,200
第一カッター興業	4,200	1,334.00	5,602,800
明豊ファシリティワークス	5,400	698.00	3,769,200
安藤・間	81,500	898.00	73,187,000
東急建設	48,100	682.00	32,804,200
コムシスホールディングス	53,000	2,710.00	143,630,000
ビーアールホールディングス	22,300	324.00	7,225,200
高松コンストラクショングループ	10,400	2,067.00	21,496,800
東建コーポレーション	4,500	8,540.00	38,430,000
ソネック	2,000	1,014.00	2,028,000
ヤマウラ	8,500	998.00	8,483,000
オリエンタル白石	55,800	235.00	13,113,000
大成建設	109,600	3,660.00	401,136,000
大林組	379,200	911.00	345,451,200
清水建設	355,300	761.00	270,383,300
飛鳥建設	10,100	1,093.00	11,039,300
長谷工コーポレーション	112,900	1,429.00	161,334,100
松井建設	15,100	681.00	10,283,100
銭高組	1,300	4,165.00	5,414,500
鹿島建設	278,000	1,524.00	423,672,000
不動テトラ	8,100	1,497.00	12,125,700
大末建設	4,100	1,270.00	5,207,000
鉄建建設	8,500	1,919.00	16,311,500
西松建設	23,000	3,700.00	85,100,000
三井住友建設	85,300	419.00	35,740,700

大豊建設	5,700	3,550.00	20,235,000
佐田建設	8,500	470.00	3,995,000
ナカノフード建設	8,900	338.00	3,008,200
奥村組	22,300	3,165.00	70,579,500
東鉄工業	17,600	2,358.00	41,500,800
イチケン	2,900	1,910.00	5,539,000
富士ピー・エス	4,800	488.00	2,342,400
浅沼組	4,300	5,460.00	23,478,000
戸田建設	157,500	762.00	120,015,000
熊谷組	19,300	2,786.00	53,769,800
北野建設	2,400	2,193.00	5,263,200
植木組	3,400	1,434.00	4,875,600
矢作建設工業	16,900	783.00	13,232,700
ピーエス三菱	12,600	599.00	7,547,400
日本ハウスホールディングス	26,100	401.00	10,466,100
大東建託	38,800	12,280.00	476,464,000
新日本建設	16,400	732.00	12,004,800
東亜道路工業	2,100	4,985.00	10,468,500
日本道路	3,700	9,630.00	35,631,000
東亜建設工業	9,500	2,540.00	24,130,000
日本国土開発	37,500	531.00	19,912,500
若築建設	6,300	1,956.00	12,322,800
東洋建設	42,400	591.00	25,058,400
五洋建設	150,300	596.00	89,578,800
世紀東急工業	18,400	797.00	14,664,800
福田組	4,100	4,270.00	17,507,000
日本ドライケミカル	3,100	1,668.00	5,170,800
住友林業	97,000	2,133.00	206,901,000
日本基礎技術	10,500	747.00	7,843,500
巴コーポレーション	17,000	510.00	8,670,000
大和ハウス工業	350,300	3,177.00	1,112,903,100
ライト工業	23,900	1,926.00	46,031,400
積水ハウス	411,400	2,312.50	951,362,500
日特建設	8,100	724.00	5,864,400
北陸電気工事	8,100	812.00	6,577,200
ユアテック	21,800	703.00	15,325,400
日本リーテック	7,800	1,305.00	10,179,000
四電工	4,300	1,620.00	6,966,000
中電工	17,500	2,155.00	37,712,500
関電工	61,800	859.00	53,086,200
きんでん	84,900	1,618.00	137,368,200
東京エネシス	12,700	1,022.00	12,979,400
トーエネック	3,900	3,450.00	13,455,000
住友電設	9,500	2,294.00	21,793,000
日本電設工業	20,900	1,633.00	34,129,700
エクシオグループ	57,500	2,356.00	135,470,000
新日本空調	10,000	1,983.00	19,830,000
日本工営	6,900	2,875.00	19,837,500
九電工	29,300	3,000.00	87,900,000
三機工業	24,800	1,446.00	35,860,800

日揮ホールディングス	116,800	1,241.00	144,948,800	
中外炉工業	3,900	1,585.00	6,181,500	
ヤマト	11,300	735.00	8,305,500	
太平電業	8,500	2,679.00	22,771,500	
高砂熱学工業	34,400	1,799.00	61,885,600	
三晃金属工業	1,300	2,567.00	3,337,100	
NEC ネットエスアイ	39,300	1,723.00	67,713,900	
朝日工業社	2,800	2,968.00	8,310,400	
明星工業	24,600	725.00	17,835,000	
大気社	18,700	3,065.00	57,315,500	
ダイダン	8,500	2,165.00	18,402,500	
日比谷総合設備	12,300	1,907.00	23,456,100	
ニッポン	35,800	1,686.00	60,358,800	
日清製粉グループ本社	137,400	1,616.00	222,038,400	
日東富士製粉	1,300	4,540.00	5,902,000	
昭和産業	11,700	2,690.00	31,473,000	
鳥越製粉	11,200	667.00	7,470,400	
中部飼料	13,700	1,025.00	14,042,500	
フィード・ワン	16,600	678.00	11,254,800	
東洋精糖	1,500	1,033.00	1,549,500	
日本甜菜製糖	6,700	1,720.00	11,524,000	
DM三井製糖ホールディングス	11,200	2,017.00	22,590,400	
塩水港精糖	16,400	218.00	3,575,200	
日新製糖	6,200	1,822.00	11,296,400	
LIFULL	35,400	220.00	7,788,000	
ミクシィ	26,400	2,166.00	57,182,400	
ジェイエシーリクルートメント	9,500	1,799.00	17,090,500	
日本M&Aセンターホールディングス	189,600	1,479.00	280,418,400	
メンバーズ	3,500	2,898.00	10,143,000	
中広	1,000	390.00	390,000	
UTグループ	16,600	2,671.00	44,338,600	
アイティメディア	5,500	1,549.00	8,519,500	
E・Jホールディングス	6,200	1,176.00	7,291,200	
夢真ビーネックスグループ	37,600	1,610.00	60,536,000	
コシダカホールディングス	30,900	653.00	20,177,700	
アルトナー	3,000	862.00	2,586,000	
パソナグループ	12,500	2,276.00	28,450,000	
CDS	2,000	1,614.00	3,228,000	
リンクアンドモチベーション	25,500	398.00	10,149,000	
エス・エム・エス	39,300	3,270.00	128,511,000	
サニーサイドアップグループ	4,200	724.00	3,040,800	
パーソルホールディングス	115,600	2,361.00	272,931,600	
リニカル	6,700	720.00	4,824,000	
クックパッド	36,300	294.00	10,672,200	
エスクリ	5,200	404.00	2,100,800	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	5,500	528.00	2,904,000	
森永製菓	28,700	3,940.00	113,078,000	
中村屋	2,100	3,205.00	6,730,500	
江崎グリコ	33,500	3,840.00	128,640,000	
名糖産業	5,700	1,682.00	9,587,400	

井村屋グループ	7,100	2,313.00	16,422,300
不二家	7,000	2,503.00	17,521,000
山崎製パン	91,000	1,517.00	138,047,000
第一屋製パン	2,900	525.00	1,522,500
モロゾフ	3,000	2,822.00	8,466,000
亀田製菓	7,100	4,145.00	29,429,500
寿スピリッツ	11,700	6,280.00	73,476,000
カルビー	55,400	2,427.00	134,455,800
森永乳業	22,500	5,460.00	122,850,000
六甲バター	9,000	1,570.00	14,130,000
ヤクルト本社	90,000	6,410.00	576,900,000
明治ホールディングス	80,300	6,790.00	545,237,000
雪印メグミルク	29,300	2,010.00	58,893,000
プリマハム	15,300	2,264.00	34,639,200
日本ハム	46,500	4,140.00	192,510,000
林兼産業	3,100	499.00	1,546,900
丸大食品	12,200	1,518.00	18,519,600
S Foods	11,000	3,225.00	35,475,000
柿安本店	4,300	2,360.00	10,148,000
伊藤ハム米久ホールディングス	78,700	685.00	53,909,500
学情	4,500	1,015.00	4,567,500
スタジオアリス	5,300	2,155.00	11,421,500
クロスキャット	3,200	2,113.00	6,761,600
シミックホールディングス	6,600	1,510.00	9,966,000
エプコ	2,800	684.00	1,915,200
システナ	169,400	435.00	73,689,000
NJS	2,400	1,912.00	4,588,800
デジタルアーツ	6,500	6,670.00	43,355,000
日鉄ソリューションズ	17,200	3,560.00	61,232,000
総合警備保障	46,000	4,220.00	194,120,000
キューブシステム	6,200	899.00	5,573,800
いちご	133,100	258.00	34,339,800
WOW WORLD	1,900	1,088.00	2,067,200
日本駐車場開発	129,900	157.00	20,394,300
コア	5,300	1,471.00	7,796,300
カカクコム	84,900	2,465.00	209,278,500
アイロムグループ	4,100	1,927.00	7,900,700
セントケア・ホールディング	7,500	819.00	6,142,500
サイネックス	2,000	583.00	1,166,000
ルネサンス	8,100	1,015.00	8,221,500
ディップ	20,300	3,180.00	64,554,000
SBSホールディングス	9,000	3,355.00	30,195,000
デジタルホールディングス	7,800	1,346.00	10,498,800
新日本科学	14,100	1,468.00	20,698,800
キャリアデザインセンター	3,000	1,242.00	3,726,000
ベネフィット・ワン	42,200	2,465.00	104,023,000
エムスリー	203,900	4,321.00	881,051,900
ツカダ・グローバルホールディング	7,000	292.00	2,044,000
プラス	1,900	632.00	1,200,800
アウトソーシング	66,200	1,161.00	76,858,200

ウェルネット	11,700	438.00	5,124,600	
ワールドホールディングス	4,500	2,172.00	9,774,000	
ディー・エヌ・エー	44,100	1,785.00	78,718,500	
博報堂DYホールディングス	160,900	1,460.00	234,914,000	
ぐるなび	18,900	408.00	7,711,200	
タカミヤ	14,500	365.00	5,292,500	
ジャパンベストレスキューシステム	7,700	1,013.00	7,800,100	
ファンコミュニケーションズ	28,900	422.00	12,195,800	
ライク	3,100	1,866.00	5,784,600	
ビジネス・ブレークスルー	4,500	427.00	1,921,500	
エスプール	32,700	1,090.00	35,643,000	
WDBホールディングス	5,400	2,455.00	13,257,000	
手間いらず	1,500	4,500.00	6,750,000	
ティア	7,100	423.00	3,003,300	
CDG	1,200	1,263.00	1,515,600	
アドウェイズ	17,200	641.00	11,025,200	
バリューコマース	9,300	3,150.00	29,295,000	
インフォマート	126,700	670.00	84,889,000	
サッポロホールディングス	41,500	2,266.00	94,039,000	
アサヒグループホールディングス	285,700	4,235.00	1,209,939,500	
麒麟ホールディングス	446,300	1,802.00	804,232,600	
宝ホールディングス	82,600	1,113.00	91,933,800	
オエノンホールディングス	35,400	345.00	12,213,000	
養命酒製造	4,200	1,770.00	7,434,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	85,300	1,400.00	119,420,000	
サントリー食品インターナショナル	81,300	4,610.00	374,793,000	
ダイドグループホールディングス	6,300	4,585.00	28,885,500	
伊藤園	37,000	6,410.00	237,170,000	
キーコーヒー	12,200	2,062.00	25,156,400	
ユニカフェ	4,100	977.00	4,005,700	
ジャパンフーズ	1,300	1,235.00	1,605,500	
日清オイリオグループ	15,400	2,930.00	45,122,000	
不二製油グループ本社	26,300	1,999.00	52,573,700	
かどや製油	900	3,770.00	3,393,000	
J-オイルミルズ	11,700	1,685.00	19,714,500	
ローソン	26,400	4,830.00	127,512,000	
サンエー	9,000	4,140.00	37,260,000	
カワチ薬品	9,300	2,433.00	22,626,900	
エービーシー・マート	18,700	4,720.00	88,264,000	
ハードオフコーポレーション	5,700	802.00	4,571,400	
高千穂交易	4,800	1,524.00	7,315,200	
アスクル	26,900	1,650.00	44,385,000	
ゲオホールディングス	15,900	1,373.00	21,830,700	
アダストリア	12,700	1,659.00	21,069,300	
ジーフット	8,300	304.00	2,523,200	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	353.00	706,000	
オルパヘルスケアホールディングス	1,300	1,475.00	1,917,500	
伊藤忠食品	2,400	5,030.00	12,072,000	
くら寿司	12,400	3,355.00	41,602,000	

キャンドウ	4,400	2,058.00	9,055,200	
エレマテック	9,600	1,036.00	9,945,600	
アイケイ	3,300	421.00	1,389,300	
パルグループホールディングス	10,400	1,450.00	15,080,000	
JALUX	3,800	2,559.00	9,724,200	
エディオン	54,600	1,169.00	63,827,400	
あらた	9,500	3,880.00	36,860,000	
サーラコーポレーション	24,300	642.00	15,600,600	
ワッツ	5,900	729.00	4,301,100	
トーメンデバイス	2,000	6,050.00	12,100,000	
ハローズ	5,500	2,960.00	16,280,000	
J Pホールディングス	29,400	223.00	6,556,200	
フジオフードグループ本社	10,100	1,300.00	13,130,000	
あみやき亭	2,800	2,954.00	8,271,200	
東京エレクトロン デバイス	3,500	5,080.00	17,780,000	
ひらまつ	25,400	197.00	5,003,800	
フィールズ	10,400	728.00	7,571,200	
双日	131,500	1,962.00	258,003,000	
アルフレッサ ホールディングス	132,200	1,775.00	234,655,000	
大黒天物産	3,900	4,890.00	19,071,000	
ハニーズホールディングス	9,500	1,007.00	9,566,500	
ファーマライズホールディングス	3,300	698.00	2,303,400	
キッコーマン	87,500	8,180.00	715,750,000	
味の素	268,200	3,442.00	923,144,400	
ブルドックソース	5,300	2,103.00	11,145,900	
キュービー	63,900	2,463.00	157,385,700	
ハウス食品グループ本社	45,600	2,936.00	133,881,600	
カゴメ	46,100	3,035.00	139,913,500	
焼津水産化学工業	4,200	916.00	3,847,200	
アリアケジャパン	11,000	5,310.00	58,410,000	
ピエトロ	1,000	1,775.00	1,775,000	
エバラ食品工業	2,000	2,896.00	5,792,000	
やまみ	1,300	1,655.00	2,151,500	
ニチレイ	55,400	2,466.00	136,616,400	
横浜冷凍	34,100	866.00	29,530,600	
東洋水産	58,500	4,580.00	267,930,000	
イトアンドホールディングス	4,600	1,988.00	9,144,800	
大冷	1,700	1,863.00	3,167,100	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,500	498.00	3,237,000	
日清食品ホールディングス	47,600	8,610.00	409,836,000	
永谷園ホールディングス	5,700	1,980.00	11,286,000	
一正蒲鉾	5,200	818.00	4,253,600	
フジッコ	11,300	1,963.00	22,181,900	
ロック・フィールド	13,200	1,435.00	18,942,000	
日本たばこ産業	651,200	2,085.00	1,357,752,000	
ケンコーマヨネーズ	7,000	1,343.00	9,401,000	
わらべや日洋ホールディングス	7,800	1,778.00	13,868,400	
なとり	6,700	2,062.00	13,815,400	
イフジ産業	2,000	954.00	1,908,000	
ピククルスコーポレーション	5,900	1,504.00	8,873,600	

ファーマフーズ	11,600	1,781.00	20,659,600
北の達人コーポレーション	42,300	222.00	9,390,600
ユーグレナ	61,800	755.00	46,659,000
紀文食品	7,100	1,073.00	7,618,300
スター・マイカ・ホールディングス	6,600	1,203.00	7,939,800
S R Eホールディングス	2,900	2,799.00	8,117,100
A Dワークスグループ	24,700	141.00	3,482,700
片倉工業	11,300	2,261.00	25,549,300
グンゼ	7,800	3,785.00	29,523,000
ヒューリック	284,800	1,046.00	297,900,800
神栄	1,700	819.00	1,392,300
ラサ商事	6,800	1,017.00	6,915,600
アルペン	9,300	2,037.00	18,944,100
ハブ	4,000	544.00	2,176,000
ラクーンホールディングス	8,500	998.00	8,483,000
クオールホールディングス	14,700	1,168.00	17,169,600
アルコニックス	12,600	1,414.00	17,816,400
神戸物産	92,600	3,800.00	351,880,000
ソリトンシステムズ	6,000	1,536.00	9,216,000
ジーンズホールディングス	8,200	6,100.00	50,020,000
ビックカメラ	70,500	1,032.00	72,756,000
D C Mホールディングス	73,500	1,089.00	80,041,500
ペッパーフードサービス	16,300	349.00	5,688,700
ハイパー	2,000	415.00	830,000
M o n o t a R O	150,700	2,423.00	365,146,100
東京一番フーズ	3,300	596.00	1,966,800
D Dホールディングス	6,300	483.00	3,042,900
あいホールディングス	17,000	1,681.00	28,577,000
ディー・ブイエックス	4,000	1,068.00	4,272,000
きちりホールディングス	3,400	375.00	1,275,000
アークランドサービスホールディングス	8,900	2,191.00	19,499,900
J . フロント リテイリング	142,200	911.00	129,544,200
ドトール・日レスホールディングス	20,600	1,562.00	32,177,200
マツキヨココカラ&カンパニー	73,300	4,335.00	317,755,500
ブロンコビリー	6,900	2,196.00	15,152,400
Z O Z O	82,100	3,175.00	260,667,500
トレジャー・ファクトリー	3,500	967.00	3,384,500
物語コーポレーション	5,900	5,470.00	32,273,000
三越伊勢丹ホールディングス	208,400	881.00	183,600,400
東洋紡	46,800	1,083.00	50,684,400
ユニチカ	32,200	276.00	8,887,200
富士紡ホールディングス	5,300	3,370.00	17,861,000
日清紡ホールディングス	73,900	1,023.00	75,599,700
倉敷紡績	10,100	1,814.00	18,321,400
ダイワボウホールディングス	57,900	1,719.00	99,530,100
シキボウ	6,500	886.00	5,759,000
日東紡績	18,100	2,874.00	52,019,400
トヨタ紡織	49,400	1,821.00	89,957,400
マクニカ・富士エレホールディングス	28,400	2,541.00	72,164,400

H a m e e	3,100	1,058.00	3,279,800
マーケットエンタープライズ	900	704.00	633,600
ラクト・ジャパン	4,100	2,010.00	8,241,000
ウエルシアホールディングス	63,000	3,145.00	198,135,000
クリエイトSDホールディングス	17,500	3,195.00	55,912,500
グリムス	5,400	2,153.00	11,626,200
パイタルケーエスケー・ホールディングス	20,700	800.00	16,560,000
八洲電機	9,000	931.00	8,379,000
メディアスホールディングス	7,000	866.00	6,062,000
レスターホールディングス	11,300	1,955.00	22,091,500
ジュテックホールディングス	3,000	1,187.00	3,561,000
丸善CHIホールディングス	15,500	371.00	5,750,500
大光	5,700	700.00	3,990,000
OCHIホールディングス	3,000	1,368.00	4,104,000
TOKAIホールディングス	57,900	892.00	51,646,800
黒谷	3,300	664.00	2,191,200
ミサワ	2,400	648.00	1,555,200
ティーライフ	1,700	1,162.00	1,975,400
Cominix	1,500	739.00	1,108,500
エー・ピーホールディングス	1,900	454.00	862,600
三洋貿易	12,200	987.00	12,041,400
チムニー	3,700	1,107.00	4,095,900
シュッピン	9,900	1,042.00	10,315,800
ビューティガレージ	2,000	2,550.00	5,100,000
オイシックス・ラ・大地	17,100	2,910.00	49,761,000
ウイン・パートナーズ	8,900	1,036.00	9,220,400
ネクステージ	24,000	2,203.00	52,872,000
ジョイフル本田	34,800	1,559.00	54,253,200
鳥貴族ホールディングス	4,400	1,677.00	7,378,800
ホットランド	9,000	1,286.00	11,574,000
すかいらーくホールディングス	153,800	1,532.00	235,621,600
SFPホールディングス	5,900	1,270.00	7,493,000
綿半ホールディングス	9,000	1,359.00	12,231,000
日本毛織	35,800	867.00	31,038,600
ダイトウボウ	19,600	88.00	1,724,800
トーア紡コーポレーション	3,500	379.00	1,326,500
ダイドーリミテッド	16,900	147.00	2,484,300
ヨシックスホールディングス	2,400	2,126.00	5,102,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	34,800	1,093.00	38,036,400
三栄建築設計	4,800	1,542.00	7,401,600
野村不動産ホールディングス	61,800	2,724.00	168,343,200
三重交通グループホールディングス	24,600	453.00	11,143,800
サムティ	19,200	2,095.00	40,224,000
ディア・ライフ	15,500	514.00	7,967,000
コーセーアールイー	3,700	582.00	2,153,400
地主	7,600	1,779.00	13,520,400
プレサンスコーポレーション	15,500	1,965.00	30,457,500
フィル・カンパニー	2,300	1,105.00	2,541,500

THEグローバル社	7,500	157.00	1,177,500
ハウスコム	1,000	1,250.00	1,250,000
日本管理センター	5,800	1,017.00	5,898,600
サンセイランディック	3,700	818.00	3,026,600
エストラスト	1,200	565.00	678,000
フージャースホールディングス	15,400	652.00	10,040,800
オープンハウスグループ	38,000	5,140.00	195,320,000
東急不動産ホールディングス	351,300	620.00	217,806,000
飯田グループホールディングス	99,600	2,127.00	211,849,200
イーグランド	2,000	1,318.00	2,636,000
ムゲンエステート	7,700	480.00	3,696,000
帝国繊維	13,400	1,780.00	23,852,000
日本コークス工業	101,900	157.00	15,998,300
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,200	954.00	5,914,800
ミタチ産業	3,300	863.00	2,847,900
B E E N O S	6,200	1,347.00	8,351,400
あさひ	9,900	1,344.00	13,305,600
日本調剤	7,200	1,324.00	9,532,800
コスモス薬品	12,200	16,130.00	196,786,000
シップヘルスケアホールディングス	38,300	2,102.00	80,506,600
トーエル	5,700	897.00	5,112,900
ソフトクリエイトホールディングス	5,300	4,595.00	24,353,500
セブン&アイ・ホールディングス	466,100	5,419.00	2,525,795,900
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	63,500	696.00	44,196,000
明治電機工業	3,900	1,022.00	3,985,800
ツルハホールディングス	26,000	9,360.00	243,360,000
デリカフーズホールディングス	4,900	544.00	2,665,600
スターティアホールディングス	2,800	528.00	1,478,400
サンマルクホールディングス	9,500	1,593.00	15,133,500
フェリシモ	2,800	1,163.00	3,256,400
トリドールホールディングス	29,500	2,254.00	66,493,000
帝人	111,400	1,299.00	144,708,600
東レ	857,700	590.50	506,471,850
クラレ	173,200	1,010.00	174,932,000
旭化成	785,000	1,013.00	795,205,000
T O K Y O B A S E	10,900	410.00	4,469,000
稲葉製作所	6,900	1,291.00	8,907,900
宮地エンジニアリンググループ	3,700	3,640.00	13,468,000
トーカロ	31,000	1,242.00	38,502,000
アルファ	4,000	981.00	3,924,000
S U M C O	184,200	1,789.00	329,533,800
川田テクノロジーズ	2,400	3,680.00	8,832,000
R S T e c h n o l o g i e s	3,900	5,410.00	21,099,000
ジェイテックコーポレーション	1,300	1,650.00	2,145,000
信和	7,500	804.00	6,030,000
ビーロッド	8,200	478.00	3,919,600
ファーストブラザーズ	2,900	789.00	2,288,100
A n d D o ホールディングス	5,900	871.00	5,138,900
シーアールイー	3,300	1,645.00	5,428,500

プロパティエージェント	1,300	1,469.00	1,909,700
ケイアイスター不動産	5,400	4,815.00	26,001,000
アグレ都市デザイン	2,000	1,431.00	2,862,000
グッドコムアセット	5,300	1,094.00	5,798,200
ジェイ・エス・ビー	2,400	3,070.00	7,368,000
テンポイノベーション	3,400	818.00	2,781,200
グローバル・リンク・マネジメント	2,200	808.00	1,777,600
フェイスネットワーク	1,200	1,300.00	1,560,000
住江織物	2,800	1,586.00	4,440,800
日本フェルト	4,800	443.00	2,126,400
イチカワ	1,200	1,377.00	1,652,400
エコナックホールディングス	21,400	88.00	1,883,200
日東製網	1,300	1,484.00	1,929,200
芦森工業	2,000	926.00	1,852,000
アツギ	9,500	601.00	5,709,500
ウイルプラスホールディングス	2,000	872.00	1,744,000
JMホールディングス	8,100	1,766.00	14,304,600
コメダホールディングス	26,000	2,066.00	53,716,000
サツドラホールディングス	6,100	663.00	4,044,300
アレンザホールディングス	9,300	920.00	8,556,000
串カツ田中ホールディングス	3,200	1,860.00	5,952,000
パロックジャパンリミテッド	8,700	754.00	6,559,800
クスリのアオキホールディングス	11,800	7,380.00	87,084,000
ダイニック	3,100	724.00	2,244,400
共和レザー	7,600	651.00	4,947,600
ピーバンドットコム	2,000	519.00	1,038,000
力の源ホールディングス	6,300	565.00	3,559,500
FOOD & LIFE COMPANIES	69,700	3,450.00	240,465,000
アセンテック	4,100	741.00	3,038,100
セーレン	24,300	2,088.00	50,738,400
ソトー	5,200	848.00	4,409,600
東海染工	1,200	1,169.00	1,402,800
小松マテーレ	19,400	1,310.00	25,414,000
ワコールホールディングス	29,500	1,793.00	52,893,500
ホギメディカル	16,000	3,235.00	51,760,000
クラウドディアホールディングス	2,000	234.00	468,000
TSIホールディングス	39,400	318.00	12,529,200
マツオカコーポレーション	3,700	1,167.00	4,317,900
ワールド	15,500	1,136.00	17,608,000
TIS	113,200	2,646.00	299,527,200
JNSホールディングス	5,500	413.00	2,271,500
グリー	54,000	964.00	52,056,000
GMOペパボ	1,200	2,238.00	2,685,600
コーエーテックモホールディングス	38,000	3,935.00	149,530,000
三菱総合研究所	5,200	3,735.00	19,422,000
ボルテージ	3,300	346.00	1,141,800
電算	900	2,250.00	2,025,000
AGS	5,900	765.00	4,513,500
ファインデックス	10,000	675.00	6,750,000

ブレインパッド	9,300	1,190.00	11,067,000	
K L a b	21,600	390.00	8,424,000	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	17,200	1,082.00	18,610,400	
ネクソン	267,700	2,706.00	724,396,200	
アイスタイル	35,900	181.00	6,497,900	
エムアップホールディングス	13,500	909.00	12,271,500	
エイチーム	8,200	709.00	5,813,800	
エニグモ	12,700	632.00	8,026,400	
テクノスジャパン	9,300	435.00	4,045,500	
e n i s h	7,200	294.00	2,116,800	
コロプラ	38,900	629.00	24,468,100	
オルトプラス	9,300	313.00	2,910,900	
ブロードリーフ	58,800	357.00	20,991,600	
クロス・マーケティンググループ	4,500	813.00	3,658,500	
デジタルハーツホールディングス	5,500	1,611.00	8,860,500	
システム情報	8,900	902.00	8,027,800	
メディアドゥ	4,200	2,414.00	10,138,800	
じげん	33,400	274.00	9,151,600	
ブイキューブ	12,200	846.00	10,321,200	
エンカレッジ・テクノロジー	2,800	540.00	1,512,000	
サイバーリンクス	4,000	897.00	3,588,000	
ディー・エル・イー	7,800	236.00	1,840,800	
フィックスターズ	12,600	713.00	8,983,800	
C A R T A H O L D I N G S	4,600	2,131.00	9,802,600	
オブティム	8,300	931.00	7,727,300	
セレス	4,400	1,349.00	5,935,600	
S H I F T	6,000	20,440.00	122,640,000	
特種東海製紙	7,300	3,115.00	22,739,500	
ティーガイア	10,500	1,681.00	17,650,500	
セック	2,000	2,161.00	4,322,000	
テクマトリックス	20,000	1,801.00	36,020,000	
プロシップ	4,100	1,445.00	5,924,500	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	30,900	2,554.00	78,918,600	
G M O ペイメントゲートウェイ	23,000	11,210.00	257,830,000	
ザッパラス	4,500	470.00	2,115,000	
システムリサーチ	3,300	1,776.00	5,860,800	
インターネットイニシアティブ	31,700	3,620.00	114,754,000	
さくらインターネット	12,600	521.00	6,564,600	
ヴィンクス	3,500	997.00	3,489,500	
G M O グローバルサイン・ホールディングス	2,800	4,415.00	12,362,000	
S R A ホールディングス	5,900	2,816.00	16,614,400	
システムインテグレータ	4,000	511.00	2,044,000	
朝日ネット	11,000	579.00	6,369,000	
e B A S E	14,100	581.00	8,192,100	
アバント	12,700	1,144.00	14,528,800	
アドソル日進	4,200	1,605.00	6,741,000	
O D K ソリューションズ	2,400	544.00	1,305,600	

フリービット	7,100	886.00	6,290,600
コムチュア	13,300	3,130.00	41,629,000
サイバーコム	2,000	1,058.00	2,116,000
アステリア	8,500	783.00	6,655,500
アイル	6,600	1,260.00	8,316,000
王子ホールディングス	495,600	535.00	265,146,000
日本製紙	56,800	1,035.00	58,788,000
三菱製紙	17,500	305.00	5,337,500
北越コーポレーション	78,000	720.00	56,160,000
中越パルプ工業	4,500	944.00	4,248,000
巴川製紙所	3,700	846.00	3,130,200
大王製紙	57,300	1,623.00	92,997,900
阿波製紙	3,300	340.00	1,122,000
マークライNZ	6,100	2,550.00	15,555,000
メディカル・データ・ビジョン	15,000	1,083.00	16,245,000
g u m i	16,500	530.00	8,745,000
ショーケース	2,800	433.00	1,212,400
モバイルファクトリー	2,800	941.00	2,634,800
テラスカイ	4,300	1,487.00	6,394,100
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,300	1,202.00	6,370,600
P C Iホールディングス	5,400	978.00	5,281,200
パイブドHD	2,300	2,755.00	6,336,500
アイピーシー	2,100	545.00	1,144,500
ネオジャパン	3,300	1,100.00	3,630,000
P R T I M E S	2,600	2,786.00	7,243,600
ラクス	40,800	1,611.00	65,728,800
ランドコンピュータ	2,000	854.00	1,708,000
ダブルスタンダード	3,600	1,837.00	6,613,200
オーブンドア	7,100	1,782.00	12,652,200
マイネット	4,200	485.00	2,037,000
アカツキ	5,300	2,743.00	14,537,900
ベネフィットジャパン	900	2,030.00	1,827,000
U b i c o mホールディングス	3,200	2,277.00	7,286,400
カナミックネットワーク	12,600	471.00	5,934,600
ノムラシステムコーポレーション	6,200	231.00	1,432,200
レンゴー	112,100	767.00	85,980,700
トーモク	7,400	1,586.00	11,736,400
ザ・パック	9,000	2,586.00	23,274,000
チェンジ	21,800	1,738.00	37,888,400
シンクロ・フード	6,200	259.00	1,605,800
オークネット	6,300	1,517.00	9,557,100
キャピタル・アセット・プランニング	2,400	695.00	1,668,000
セグエグループ	3,100	533.00	1,652,300
エイトレッド	1,900	2,018.00	3,834,200
マクロミル	24,200	1,085.00	26,257,000
ビーグリー	2,800	1,224.00	3,427,200
オロ	3,700	2,351.00	8,698,700
ユーザーローカル	3,600	1,556.00	5,601,600
テモナ	2,800	358.00	1,002,400

ニーズウェル	2,800	621.00	1,738,800
マネーフォワード	18,100	5,510.00	99,731,000
サインポスト	3,700	838.00	3,100,600
昭和電工	102,700	1,995.00	204,886,500
住友化学	870,300	517.00	449,945,100
住友精化	5,300	3,175.00	16,827,500
日産化学	64,500	6,620.00	426,990,000
ラサ工業	4,100	1,521.00	6,236,100
クレハ	9,500	8,180.00	77,710,000
多木化学	4,500	4,580.00	20,610,000
テイカ	8,900	1,302.00	11,587,800
石原産業	19,600	998.00	19,560,800
片倉コープアグリ	2,000	1,235.00	2,470,000
日本曹達	15,100	3,435.00	51,868,500
東ソー	171,000	1,706.00	291,726,000
トクヤマ	37,800	1,640.00	61,992,000
セントラル硝子	19,300	1,973.00	38,078,900
東亜合成	65,900	1,058.00	69,722,200
大阪ソーダ	11,000	2,949.00	32,439,000
関東電化工業	26,000	1,052.00	27,352,000
デンカ	43,100	3,360.00	144,816,000
イビデン	63,500	5,530.00	351,155,000
信越化学工業	203,500	17,750.00	3,612,125,000
日本カーバイド工業	4,300	1,351.00	5,809,300
電算システムホールディングス	4,900	2,554.00	12,514,600
堺化学工業	8,300	1,822.00	15,122,600
第一稀元素化学工業	11,000	951.00	10,461,000
エア・ウォーター	112,100	1,598.00	179,135,800
日本酸素ホールディングス	113,900	2,186.00	248,985,400
日本化学工業	3,700	2,214.00	8,191,800
東邦アセチレン	2,100	1,138.00	2,389,800
日本パーカライジング	59,700	940.00	56,118,000
高圧ガス工業	19,000	674.00	12,806,000
チタン工業	1,300	1,740.00	2,262,000
四国化成工業	15,700	1,322.00	20,755,400
戸田工業	2,600	2,413.00	6,273,800
ステラ ケミファ	5,900	2,330.00	13,747,000
保土谷化学工業	3,700	4,015.00	14,855,500
日本触媒	19,900	5,340.00	106,266,000
大日精化工業	9,900	2,047.00	20,265,300
カネカ	30,600	3,355.00	102,663,000
協和キリン	142,100	2,838.00	403,279,800
三菱瓦斯化学	110,100	2,022.00	222,622,200
三井化学	107,600	2,821.00	303,539,600
J S R	110,500	3,360.00	371,280,000
東京応化工業	19,100	6,870.00	131,217,000
大阪有機化学工業	10,000	2,739.00	27,390,000
三菱ケミカルホールディングス	792,000	767.40	607,780,800
K Hネオケム	19,500	2,574.00	50,193,000
ダイセル	170,400	801.00	136,490,400

住友ベークライト	18,800	4,505.00	84,694,000
積水化学工業	247,800	1,731.00	428,941,800
日本ゼオン	106,800	1,270.00	135,636,000
アイカ工業	33,000	3,025.00	99,825,000
宇部興産	55,800	1,920.00	107,136,000
積水樹脂	18,100	1,775.00	32,127,500
タキロンシーアイ	25,800	544.00	14,035,200
旭有機材	6,700	1,905.00	12,763,500
ニチバン	7,100	1,797.00	12,758,700
リケンテクノス	29,200	436.00	12,731,200
大倉工業	6,200	1,790.00	11,098,000
積水化成工業	16,100	438.00	7,051,800
群栄化学工業	2,900	3,110.00	9,019,000
タイガースポリマー	7,000	455.00	3,185,000
ミライアル	3,900	1,516.00	5,912,400
ダイキアクシス	4,500	711.00	3,199,500
ダイキョーニシカワ	25,300	520.00	13,156,000
竹本容器	4,400	796.00	3,502,400
森六ホールディングス	6,500	1,821.00	11,836,500
恵和	3,000	4,105.00	12,315,000
日本化薬	93,300	1,104.00	103,003,200
カーリットホールディングス	11,700	648.00	7,581,600
ソルクシーズ	10,000	372.00	3,720,000
CLホールディングス	2,400	1,041.00	2,498,400
プレステージ・インターナショナル	43,100	700.00	30,170,000
フェイス	3,300	648.00	2,138,400
プロトコーポレーション	12,600	1,038.00	13,078,800
ハイマックス	3,300	1,193.00	3,936,900
アミューズ	6,300	1,974.00	12,436,200
野村総合研究所	229,500	4,180.00	959,310,000
ドリームインキュベータ	3,200	2,200.00	7,040,000
サイバネットシステム	8,500	686.00	5,831,000
クイック	7,800	1,559.00	12,160,200
TAC	7,100	205.00	1,455,500
CEホールディングス	6,200	457.00	2,833,400
日本システム技術	2,400	2,266.00	5,438,400
電通グループ	119,100	4,225.00	503,197,500
インテージホールディングス	13,600	1,749.00	23,786,400
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,500	1,099.00	6,044,500
東邦システムサイエンス	3,400	883.00	3,002,200
ぴあ	4,100	3,165.00	12,976,500
イオンファンタジー	4,500	1,916.00	8,622,000
ソースネクスト	50,700	154.00	7,807,800
シーティーエス	13,200	800.00	10,560,000
ネクシーズグループ	4,100	508.00	2,082,800
インフォコム	13,100	2,007.00	26,291,700
メディカルシステムネットワーク	11,700	514.00	6,013,800
日本精化	9,500	2,142.00	20,349,000
扶桑化学工業	10,600	4,075.00	43,195,000
トリケミカル研究所	12,300	2,305.00	28,351,500

シンプレクス・ホールディングス	13,800	1,655.00	22,839,000	
HEROZ	3,300	975.00	3,217,500	
ラクスル	13,100	2,867.00	37,557,700	
I P S	3,300	1,930.00	6,369,000	
F I G	13,200	279.00	3,682,800	
システムサポート	3,500	1,032.00	3,612,000	
A D E K A	54,600	2,402.00	131,149,200	
日油	40,500	4,815.00	195,007,500	
ミヨシ油脂	5,200	1,124.00	5,844,800	
新日本理化	19,400	229.00	4,442,600	
ハリマ化成グループ	9,000	809.00	7,281,000	
イーソル	7,100	538.00	3,819,800	
アルテリア・ネットワークス	15,000	1,290.00	19,350,000	
東海ソフト	2,000	862.00	1,724,000	
ウイングアーク1st	6,800	1,175.00	7,990,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,800	1,631.00	4,566,800	
サーバーワークス	2,100	2,335.00	4,903,500	
東名	1,200	799.00	958,800	
ヴィッツ	1,000	1,218.00	1,218,000	
トピラスシステムズ	2,400	766.00	1,838,400	
S a n s a n	42,300	1,053.00	44,541,900	
L i n k - U	2,200	781.00	1,718,200	
ギフトィ	10,400	993.00	10,327,200	
花王	267,700	4,852.00	1,298,880,400	
第一工業製薬	4,500	2,653.00	11,938,500	
石原ケミカル	6,200	1,317.00	8,165,400	
日華化学	4,100	712.00	2,919,200	
ニイタカ	2,400	2,404.00	5,769,600	
三洋化成工業	7,100	4,940.00	35,074,000	
ベース	2,100	5,370.00	11,277,000	
J M D C	11,000	5,250.00	57,750,000	
武田薬品工業	950,800	3,406.00	3,238,424,800	
アステラス製薬	1,048,800	1,825.50	1,914,584,400	
大日本住友製薬	74,800	1,186.00	88,712,800	
塩野義製薬	152,100	7,234.00	1,100,291,400	
わかもと製薬	14,500	277.00	4,016,500	
日本新薬	31,700	7,930.00	251,381,000	
中外製薬	378,500	3,756.00	1,421,646,000	
科研製薬	19,000	4,210.00	79,990,000	
エーザイ	145,000	5,590.00	810,550,000	
理研ビタミン	12,600	1,700.00	21,420,000	
ロート製薬	62,100	3,720.00	231,012,000	
小野薬品工業	277,700	2,944.50	817,687,650	
久光製薬	31,900	3,710.00	118,349,000	
有機合成薬品工業	8,500	260.00	2,210,000	
持田製薬	15,400	3,885.00	59,829,000	
参天製薬	225,600	1,268.00	286,060,800	
扶桑薬品工業	4,300	2,288.00	9,838,400	
日本ケミファ	1,000	2,041.00	2,041,000	

ツムラ	37,600	3,330.00	125,208,000
日医工	37,600	831.00	31,245,600
テルモ	342,300	3,576.00	1,224,064,800
H.U.グループホールディングス	30,200	2,945.00	88,939,000
キッセイ薬品工業	21,500	2,460.00	52,890,000
生化学工業	21,400	906.00	19,388,400
栄研化学	21,400	1,742.00	37,278,800
日水製薬	4,800	979.00	4,699,200
鳥居薬品	6,600	2,925.00	19,305,000
JCRファーマ	34,200	2,077.00	71,033,400
東和薬品	17,400	2,823.00	49,120,200
富士製薬工業	7,500	981.00	7,357,500
ゼリア新薬工業	22,200	2,013.00	44,688,600
第一三共	950,600	2,424.50	2,304,729,700
キョーリン製薬ホールディングス	24,300	1,886.00	45,829,800
大幸薬品	18,300	554.00	10,138,200
ダイト	7,700	2,805.00	21,598,500
大塚ホールディングス	251,400	3,982.00	1,001,074,800
大正製薬ホールディングス	28,800	5,900.00	169,920,000
ペプチドリーム	63,500	1,828.00	116,078,000
大日本塗料	14,700	802.00	11,789,400
日本ペイントホールディングス	445,300	989.00	440,401,700
関西ペイント	122,900	1,987.00	244,202,300
神東塗料	8,300	157.00	1,303,100
中国塗料	27,900	916.00	25,556,400
日本特殊塗料	8,900	853.00	7,591,700
藤倉化成	15,000	444.00	6,660,000
太陽ホールディングス	17,500	2,994.00	52,395,000
DIC	50,100	2,328.00	116,632,800
サカタインクス	23,600	883.00	20,838,800
東洋インキSCホールディングス	25,200	1,814.00	45,712,800
T&K TOKA	9,600	885.00	8,496,000
アルプス技研	10,400	1,831.00	19,042,400
サニックス	20,100	206.00	4,140,600
ダイオーズ	2,900	1,011.00	2,931,900
日本空調サービス	12,400	808.00	10,019,200
オリエンタルランド	136,700	21,745.00	2,972,541,500
フォーカスシステムズ	7,800	910.00	7,098,000
ダスキン	26,800	2,774.00	74,343,200
パーク24	64,100	1,746.00	111,918,600
明光ネットワークジャパン	13,600	563.00	7,656,800
ファルコホールディングス	5,700	2,065.00	11,770,500
クレスコ	8,800	1,844.00	16,227,200
フジ・メディア・ホールディングス	114,400	1,167.00	133,504,800
秀英予備校	3,000	437.00	1,311,000
田谷	1,500	572.00	858,000
ラウンドワン	32,200	1,236.00	39,799,200
リゾートトラスト	53,000	1,982.00	105,046,000
オービック	37,600	17,900.00	673,040,000
ジャストシステム	16,900	5,450.00	92,105,000

TDCソフト	10,400	1,067.00	11,096,800
Zホールディングス	1,725,300	517.70	893,187,810
ビー・エム・エル	15,000	3,185.00	47,775,000
トレンドマイクロ	63,500	6,760.00	429,260,000
りらいあコミュニケーションズ	17,500	1,069.00	18,707,500
IDホールディングス	7,700	842.00	6,483,400
リソー教育	52,900	359.00	18,991,100
日本オラクル	19,200	8,170.00	156,864,000
早稲田アカデミー	6,600	1,030.00	6,798,000
アルファシステムズ	2,800	3,965.00	11,102,000
フューチャー	25,200	1,649.00	41,554,800
CAC Holdings	7,100	1,362.00	9,670,200
SBテクノロジー	5,300	2,349.00	12,449,700
トーセ	3,600	698.00	2,512,800
ユー・エス・エス	129,400	1,962.00	253,882,800
オービックビジネスコンサルタント	11,400	4,060.00	46,284,000
伊藤忠テクノソリューションズ	54,000	2,897.00	156,438,000
アイティフォー	14,300	777.00	11,111,100
東京個別指導学院	10,100	581.00	5,868,100
東計電算	1,300	4,710.00	6,123,000
サイバーエージェント	284,900	1,440.00	410,256,000
楽天グループ	593,600	920.00	546,112,000
エクスネット	2,000	991.00	1,982,000
クリーク・アンド・リバー社	6,200	1,713.00	10,620,600
モーニングスター	20,300	584.00	11,855,200
テー・オー・ダブリュー	20,400	301.00	6,140,400
大塚商会	64,200	4,175.00	268,035,000
サイボウズ	15,900	1,310.00	20,829,000
山田コンサルティンググループ	6,200	1,141.00	7,074,200
セントラルスポーツ	4,300	2,341.00	10,066,300
パラカ	3,300	1,689.00	5,573,700
電通国際情報サービス	17,100	3,570.00	61,047,000
ACCESS	13,500	567.00	7,654,500
デジタルガレージ	19,600	3,995.00	78,302,000
イーエムシステムズ	19,800	723.00	14,315,400
ウェザーニューズ	3,600	8,020.00	28,872,000
CIJ	8,100	918.00	7,435,800
ビジネスエンジニアリング	1,300	3,740.00	4,862,000
日本エンタープライズ	12,300	166.00	2,041,800
WOWOW	5,800	1,714.00	9,941,200
スカラ	10,500	699.00	7,339,500
インテリジェント ウェイブ	7,100	545.00	3,869,500
フルキャストホールディングス	9,900	2,345.00	23,215,500
エン・ジャパン	18,900	2,661.00	50,292,900
あすか製薬ホールディングス	13,800	1,120.00	15,456,000
サワイグループホールディングス	26,500	4,520.00	119,780,000
富士フイルムホールディングス	212,600	6,890.00	1,464,814,000
コニカミノルタ	264,000	478.00	126,192,000
資生堂	225,400	5,765.00	1,299,431,000
ライオン	146,100	1,437.00	209,945,700

高砂香料工業	8,500	2,753.00	23,400,500
マンダム	25,400	1,262.00	32,054,800
ミルボン	15,000	5,990.00	89,850,000
ファンケル	49,000	3,055.00	149,695,000
コーセー	22,800	12,350.00	281,580,000
コタ	7,700	1,612.00	12,412,400
シーボン	1,200	1,778.00	2,133,600
ポーラ・オルビスホールディングス	51,600	1,683.00	86,842,800
ノエビアホールディングス	10,400	5,120.00	53,248,000
アジュバンホールディングス	2,900	1,139.00	3,303,100
新日本製薬	3,300	1,368.00	4,514,400
エステー	7,800	1,540.00	12,012,000
アグロ カネショウ	4,100	1,193.00	4,891,300
コニシ	19,800	1,545.00	30,591,000
長谷川香料	21,000	2,334.00	49,014,000
星光PMC	7,100	577.00	4,096,700
小林製薬	34,000	9,980.00	339,320,000
荒川化学工業	10,100	1,099.00	11,099,900
メック	9,000	3,110.00	27,990,000
日本高純度化学	3,400	2,414.00	8,207,600
タカラバイオ	31,700	2,257.00	71,546,900
JCU	13,600	4,200.00	57,120,000
新田ゼラチン	7,700	657.00	5,058,900
OATアグリオ	5,200	900.00	4,680,000
デクセリアルズ	31,500	3,005.00	94,657,500
アース製薬	10,000	5,530.00	55,300,000
北興化学工業	11,300	845.00	9,548,500
大成ラミック	3,700	2,742.00	10,145,400
クミアイ化学工業	45,100	820.00	36,982,000
日本農薬	21,700	530.00	11,501,000
富士興産	3,100	949.00	2,941,900
ニチレキ	15,500	1,250.00	19,375,000
ユシロ化学工業	6,500	1,040.00	6,760,000
ビービー・カストロール	4,500	1,273.00	5,728,500
富士石油	32,400	309.00	10,011,600
MORESCO	4,200	1,111.00	4,666,200
出光興産	134,400	3,405.00	457,632,000
ENEOSホールディングス	1,819,100	445.90	811,136,690
コスモエネルギーホールディングス	35,100	2,577.00	90,452,700
テスホールディングス	7,000	1,387.00	9,709,000
インフロニア・ホールディングス	161,700	1,085.00	175,444,500
横浜ゴム	69,900	1,466.00	102,473,400
TOYO TIRE	63,800	1,373.00	87,597,400
ブリヂストン	348,600	4,281.00	1,492,356,600
住友ゴム工業	108,700	1,036.00	112,613,200
藤倉コンポジット	9,800	663.00	6,497,400
オカモト	7,200	3,985.00	28,692,000
アキレス	7,700	1,274.00	9,809,800
フコク	5,400	921.00	4,973,400
ニッタ	12,500	2,701.00	33,762,500

クリエートメディック	3,500	968.00	3,388,000	
住友理工	23,600	578.00	13,640,800	
三ツ星ベルト	14,800	2,036.00	30,132,800	
バンドー化学	19,800	855.00	16,929,000	
A G C	111,200	4,620.00	513,744,000	
日本板硝子	58,000	405.00	23,490,000	
石塚硝子	2,000	2,025.00	4,050,000	
有沢製作所	17,600	991.00	17,441,600	
日本山村硝子	4,600	813.00	3,739,800	
日本電気硝子	48,700	2,603.00	126,766,100	
オハラ	4,800	1,122.00	5,385,600	
住友大阪セメント	22,400	3,305.00	74,032,000	
太平洋セメント	68,700	1,931.00	132,659,700	
リソルホールディングス	1,300	4,415.00	5,739,500	
日本ヒューム	12,600	703.00	8,857,800	
日本コンクリート工業	24,000	302.00	7,248,000	
三谷セキサン	5,700	6,450.00	36,765,000	
アジアパイルホールディングス	19,100	434.00	8,289,400	
東海カーボン	101,400	1,056.00	107,078,400	
日本カーボン	6,200	3,915.00	24,273,000	
東洋炭素	7,800	2,896.00	22,588,800	
ノリタケカンパニーリミテド	6,800	4,270.00	29,036,000	
T O T O	86,400	4,650.00	401,760,000	
日本碍子	131,000	1,620.00	212,220,000	
日本特殊陶業	92,100	1,887.00	173,792,700	
ダントーホールディングス	7,800	228.00	1,778,400	
M A R U W A	4,200	14,080.00	59,136,000	
品川リフラクトリーズ	2,900	3,620.00	10,498,000	
黒崎播磨	2,200	3,900.00	8,580,000	
ヨータイ	7,700	1,286.00	9,902,200	
東京窯業	15,900	286.00	4,547,400	
ニッカトー	5,700	512.00	2,918,400	
フジインコーポレーテッド	9,800	6,350.00	62,230,000	
クニミネ工業	4,100	976.00	4,001,600	
エーアンドエーマテリアル	2,600	852.00	2,215,200	
ニチアス	28,100	2,417.00	67,917,700	
日本製鉄	535,300	2,071.50	1,108,873,950	
神戸製鋼所	223,100	568.00	126,720,800	
中山製鋼所	19,000	439.00	8,341,000	
合同製鐵	6,500	1,253.00	8,144,500	
ジェイ エフ イー ホールディングス	323,000	1,649.00	532,627,000	
東京製鐵	40,800	1,083.00	44,186,400	
共英製鋼	13,600	1,337.00	18,183,200	
大和工業	23,000	3,450.00	79,350,000	
東京鐵鋼	5,300	1,306.00	6,921,800	
大阪製鐵	6,500	1,241.00	8,066,500	
淀川製鋼所	15,900	2,684.00	42,675,600	
丸一鋼管	42,400	2,762.00	117,108,800	
モリ工業	3,600	2,517.00	9,061,200	

大同特殊鋼	19,600	3,570.00	69,972,000	
日本高周波鋼業	3,500	332.00	1,162,000	
日本冶金工業	8,900	2,769.00	24,644,100	
山陽特殊製鋼	12,400	1,901.00	23,572,400	
愛知製鋼	6,800	2,503.00	17,020,400	
日立金属	128,900	1,997.00	257,413,300	
日本金属	3,000	1,413.00	4,239,000	
大太平洋金属	7,300	3,715.00	27,119,500	
新日本電工	77,000	337.00	25,949,000	
栗本鐵工所	5,700	1,537.00	8,760,900	
虹 技	2,000	872.00	1,744,000	
日本鑄鉄管	1,300	1,002.00	1,302,600	
日本製鋼所	36,300	3,490.00	126,687,000	
三菱製鋼	7,600	1,124.00	8,542,400	
日亜鋼業	16,000	266.00	4,256,000	
日本精線	2,000	4,135.00	8,270,000	
エンビプロ・ホールディングス	4,000	1,356.00	5,424,000	
大紀アルミニウム工業所	18,100	1,493.00	27,023,300	
日本軽金属ホールディングス	30,200	1,657.00	50,041,400	
三井金属鉱業	32,400	3,235.00	104,814,000	
東邦亜鉛	6,700	2,624.00	17,580,800	
三菱マテリアル	78,800	2,098.00	165,322,400	
住友金属鉱山	152,800	6,137.00	937,733,600	
DOWAホールディングス	32,700	5,440.00	177,888,000	
古河機械金属	19,800	1,288.00	25,502,400	
エス・サイエンス	56,800	33.00	1,874,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,700	1,228.00	16,823,600	
東邦チタニウム	21,500	1,262.00	27,133,000	
UACJ	18,200	1,930.00	35,126,000	
CKサンエツ	2,600	4,075.00	10,595,000	
古河電気工業	37,100	2,122.00	78,726,200	
住友電気工業	447,300	1,344.50	601,394,850	
フジクラ	133,300	527.00	70,249,100	
昭和電線ホールディングス	10,400	1,734.00	18,033,600	
東京特殊電線	1,300	2,740.00	3,562,000	
タツタ電線	21,200	461.00	9,773,200	
カナレ電気	2,300	1,515.00	3,484,500	
平河ヒューテック	6,800	1,139.00	7,745,200	
リョービ	14,800	977.00	14,459,600	
アーレスティ	12,600	359.00	4,523,400	
アサヒホールディングス	48,000	2,269.00	108,912,000	
東洋製罐グループホールディングス	76,200	1,411.00	107,518,200	
ホッカインホールディングス	6,800	1,345.00	9,146,000	
コロナ	7,100	877.00	6,226,700	
横河ブリッジホールディングス	20,600	1,964.00	40,458,400	
駒井ハルテック	2,400	2,037.00	4,888,800	
高田機工	600	2,920.00	1,752,000	
三和ホールディングス	112,800	1,210.00	136,488,000	
文化シャッター	38,200	1,043.00	39,842,600	
三協立山	15,500	626.00	9,703,000	

アルインコ	8,900	868.00	7,725,200
東洋シャッター	2,000	572.00	1,144,000
L I X I L	188,300	2,258.00	425,181,400
日本ファイルコン	8,900	515.00	4,583,500
ノーリツ	23,000	1,475.00	33,925,000
長府製作所	12,300	2,001.00	24,612,300
リンナイ	22,500	9,220.00	207,450,000
ユニプレス	18,100	614.00	11,113,400
ダイニチ工業	5,900	658.00	3,882,200
日東精工	15,100	479.00	7,232,900
三洋工業	1,200	1,773.00	2,127,600
岡部	22,900	692.00	15,846,800
ジーテクト	15,000	1,302.00	19,530,000
東ブレ	22,300	1,074.00	23,950,200
高周波熱錬	21,400	576.00	12,326,400
東京製網	7,300	838.00	6,117,400
サンコール	10,600	474.00	5,024,400
モリテックスチール	9,400	288.00	2,707,200
パイオラックス	17,700	1,654.00	29,275,800
エイチワン	11,800	594.00	7,009,200
日本発条	109,900	836.00	91,876,400
中央発條	5,900	731.00	4,312,900
アドバネクス	1,900	1,574.00	2,990,600
三浦工業	51,800	3,015.00	156,177,000
タクマ	40,500	1,378.00	55,809,000
テクノプロ・ホールディングス	69,200	3,245.00	224,554,000
アトラグループ	2,100	238.00	499,800
インターワークス	3,600	373.00	1,342,800
アイ・アールジャパンホールディングス	5,400	3,720.00	20,088,000
K e e P e r 技研	7,400	1,918.00	14,193,200
ファーストロジック	2,400	830.00	1,992,000
三機サービス	2,400	1,000.00	2,400,000
G u n o s y	7,200	685.00	4,932,000
デザインワン・ジャパン	3,000	177.00	531,000
イー・ガーディアン	4,500	2,694.00	12,123,000
リブセンス	7,100	172.00	1,221,200
ジャパンマテリアル	35,600	1,619.00	57,636,400
ベクトル	16,300	1,034.00	16,854,200
ウチヤマホールディングス	6,100	333.00	2,031,300
チャーム・ケア・コーポレーション	8,700	1,113.00	9,683,100
キャリアリンク	4,200	1,255.00	5,271,000
I B J	9,500	673.00	6,393,500
アサンテ	5,300	1,482.00	7,854,600
バリューHR	4,500	2,618.00	11,781,000
M & A キャピタルパートナーズ	9,500	4,990.00	47,405,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,500	1,207.00	5,431,500
E R I ホールディングス	3,300	1,225.00	4,042,500
アピスト	1,900	2,875.00	5,462,500

シグマクシス・ホールディングス	7,100	2,178.00	15,463,800
ウィルグループ	8,500	1,158.00	9,843,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,500	167.00	2,588,500
メドピア	8,900	3,295.00	29,325,500
レアジョブ	2,300	817.00	1,879,100
リクルートホールディングス	891,600	4,837.00	4,312,669,200
エラン	15,900	971.00	15,438,900
ツガミ	26,300	1,200.00	31,560,000
オークマ	13,900	4,540.00	63,106,000
芝浦機械	13,600	3,040.00	41,344,000
アマダ	188,800	963.00	181,814,400
アイダエンジニアリング	31,500	979.00	30,838,500
滝澤鉄工所	4,000	1,197.00	4,788,000
F U J I	55,200	2,160.00	119,232,000
牧野フライス製作所	13,200	3,630.00	47,916,000
オーエスジー	55,400	1,837.00	101,769,800
ダイジェット工業	900	943.00	848,700
旭ダイヤモンド工業	31,600	563.00	17,790,800
D M G 森精機	71,000	1,484.00	105,364,000
ソディック	26,500	752.00	19,928,000
ディスコ	17,600	30,700.00	540,320,000
日東工器	6,700	1,523.00	10,204,100
日進工具	9,500	1,509.00	14,335,500
パンチ工業	10,000	468.00	4,680,000
富士ダイス	5,700	632.00	3,602,400
土木管理総合試験所	5,700	305.00	1,738,500
ネットマーケティング	5,700	412.00	2,348,400
日本郵政	1,509,200	919.60	1,387,860,320
ベルシステム24ホールディングス	16,500	1,324.00	21,846,000
鎌倉新書	13,200	403.00	5,319,600
S M N	2,800	593.00	1,660,400
一蔵	2,000	341.00	682,000
グローバルキッズCOMPANY	2,200	735.00	1,617,000
エアトリ	7,400	2,977.00	22,029,800
アトラエ	8,100	1,674.00	13,559,400
ストライク	4,400	4,180.00	18,392,000
ソラスト	28,400	941.00	26,724,400
セラク	3,700	1,262.00	4,669,400
インソース	11,200	1,973.00	22,097,600
豊田自動織機	98,100	7,840.00	769,104,000
豊和工業	6,500	793.00	5,154,500
O K K	4,500	824.00	3,708,000
石川製作所	3,200	1,505.00	4,816,000
東洋機械金属	8,200	587.00	4,813,400
津田駒工業	2,800	545.00	1,526,000
エンシュウ	2,900	650.00	1,885,000
島精機製作所	17,500	1,736.00	30,380,000
オプトラ	15,000	1,762.00	26,430,000
N C ホールディングス	3,400	2,031.00	6,905,400
イワキ	7,700	1,020.00	7,854,000

フリー	10,500	1,050.00	11,025,000
ヤマシンフィルタ	24,000	328.00	7,872,000
日阪製作所	15,000	793.00	11,895,000
やまびこ	23,300	1,279.00	29,800,700
野村マイクロ・サイエンス	3,200	3,585.00	11,472,000
平田機工	5,700	5,010.00	28,557,000
ペガサスミシン製造	12,400	535.00	6,634,000
マルマエ	4,900	2,401.00	11,764,900
タツモ	5,700	1,582.00	9,017,400
ナプテスコ	68,300	2,854.00	194,928,200
三井海洋開発	12,700	1,107.00	14,058,900
レオン自動機	12,800	954.00	12,211,200
S M C	35,400	64,930.00	2,298,522,000
ホソカワミクロン	8,500	2,462.00	20,927,000
ユニオンツール	4,500	3,630.00	16,335,000
オイレス工業	16,900	1,530.00	25,857,000
日精エー・エス・ビー機械	4,100	3,030.00	12,423,000
サトーホールディングス	15,900	1,737.00	27,618,300
技研製作所	10,500	3,380.00	35,490,000
日本エアテック	5,700	1,005.00	5,728,500
カワタ	3,900	988.00	3,853,200
日精樹脂工業	8,500	1,000.00	8,500,000
オカダアイヨン	3,900	1,364.00	5,319,600
ワイエイシーホールディングス	4,600	1,098.00	5,050,800
小松製作所	548,100	2,715.00	1,488,091,500
住友重機械工業	69,200	2,728.00	188,777,600
日立建機	48,500	2,858.00	138,613,000
日工	16,800	615.00	10,332,000
巴工業	4,800	2,358.00	11,318,400
井関農機	11,200	1,151.00	12,891,200
T O W A	10,400	2,192.00	22,796,800
丸山製作所	2,600	1,464.00	3,806,400
北川鉄工所	5,700	1,286.00	7,330,200
シンニッタン	14,900	222.00	3,307,800
ローツェ	6,100	10,100.00	61,610,000
タカキタ	4,100	615.00	2,521,500
クボタ	586,400	2,040.00	1,196,256,000
荏原実業	5,700	2,306.00	13,144,200
東洋エンジニアリング	15,900	590.00	9,381,000
三菱化工機	3,900	1,960.00	7,644,000
月島機械	22,400	1,027.00	23,004,800
帝国電機製作所	8,700	1,356.00	11,797,200
新東工業	26,800	680.00	18,224,000
澁谷工業	10,500	2,415.00	25,357,500
アイチコーポレーション	17,800	878.00	15,628,400
小森コーポレーション	30,900	722.00	22,309,800
鶴見製作所	9,500	1,818.00	17,271,000
住友精密工業	2,000	1,965.00	3,930,000
日本ギア工業	4,900	287.00	1,406,300
酒井重工業	2,200	3,115.00	6,853,000

荏原製作所	48,400	5,950.00	287,980,000	
石井鐵工所	1,000	3,030.00	3,030,000	
西島製作所	11,000	946.00	10,406,000	
北越工業	11,600	869.00	10,080,400	
ダイキン工業	154,200	21,090.00	3,252,078,000	
オルガノ	3,500	8,330.00	29,155,000	
トーヨーカネツ	4,500	2,455.00	11,047,500	
栗田工業	65,700	4,370.00	287,109,000	
椿本チエイン	15,900	3,085.00	49,051,500	
大同工業	5,500	886.00	4,873,000	
日機装	36,300	697.00	25,301,100	
木村化工機	10,000	791.00	7,910,000	
レイズネクスト	18,700	1,143.00	21,374,100	
アネスト岩田	18,900	818.00	15,460,200	
ダイフク	66,700	8,090.00	539,603,000	
サムコ	3,000	2,284.00	6,852,000	
加藤製作所	5,700	800.00	4,560,000	
油研工業	1,500	1,715.00	2,572,500	
タダノ	63,400	939.00	59,532,600	
フジテック	44,900	2,788.00	125,181,200	
C K D	35,800	1,802.00	64,511,600	
キトー	10,400	1,699.00	17,669,600	
平和	33,800	1,890.00	63,882,000	
理想科学工業	10,100	2,052.00	20,725,200	
SANKYO	26,300	3,185.00	83,765,500	
日本金銭機械	12,400	635.00	7,874,000	
マースグループホールディングス	7,700	1,568.00	12,073,600	
フクシマガリレイ	8,500	3,910.00	33,235,000	
オーイズミ	4,500	387.00	1,741,500	
ダイコク電機	5,700	1,216.00	6,931,200	
竹内製作所	18,400	2,528.00	46,515,200	
アマノ	31,700	2,101.00	66,601,700	
JUKI	16,900	649.00	10,968,100	
サンデン	16,800	179.00	3,007,200	
ジャノメ	10,300	730.00	7,519,000	
ブラザー工業	147,700	2,077.00	306,772,900	
マックス	16,300	1,675.00	27,302,500	
モリタホールディングス	19,400	1,195.00	23,183,000	
グローリー	31,100	1,976.00	61,453,600	
新晃工業	11,300	1,612.00	18,215,600	
大和冷機工業	17,500	1,081.00	18,917,500	
セガサミーホールディングス	120,100	2,052.00	246,445,200	
日本ピストンリング	4,500	1,287.00	5,791,500	
リケン	5,300	2,382.00	12,624,600	
T P R	16,400	1,267.00	20,778,800	
ツバキ・ナカシマ	26,500	888.00	23,532,000	
ホシザキ	35,400	8,200.00	290,280,000	
大豊工業	9,900	647.00	6,405,300	
日本精工	227,600	662.00	150,671,200	
N T N	259,100	190.00	49,229,000	

ジェイテクト	115,900	865.00	100,253,500
不二越	10,400	3,895.00	40,508,000
ミネベアミツミ	208,500	2,330.00	485,805,000
日本トムソン	33,100	514.00	17,013,400
THK	68,300	2,422.00	165,422,600
ユーシン精機	9,600	666.00	6,393,600
前澤給装工業	9,400	998.00	9,381,200
イーグル工業	15,000	963.00	14,445,000
前澤工業	7,300	621.00	4,533,300
日本ピラー工業	12,300	2,638.00	32,447,400
キッツ	40,900	647.00	26,462,300
日立製作所	581,900	5,245.00	3,052,065,500
東芝	211,400	4,418.00	933,965,200
三菱電機	1,209,700	1,313.00	1,588,336,100
富士電機	72,900	5,610.00	408,969,000
東洋電機製造	4,800	953.00	4,574,400
安川電機	130,400	4,440.00	578,976,000
シンフォニアテクノロジー	14,600	1,279.00	18,673,400
明電舎	20,500	2,263.00	46,391,500
オリジン	3,300	1,191.00	3,930,300
山洋電気	5,400	4,635.00	25,029,000
デンヨー	10,400	1,657.00	17,232,800
PHCホールディングス	13,900	1,567.00	21,781,300
ベイカレント・コンサルティング	8,200	40,400.00	331,280,000
Orchestra Holdings	2,300	2,667.00	6,134,100
アイモバイル	3,300	1,193.00	3,936,900
キャリアインデックス	4,000	639.00	2,556,000
MS-Japan	4,600	757.00	3,482,200
船場	1,300	732.00	951,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	36,600	1,528.00	55,924,800
フルテック	1,900	1,333.00	2,532,700
グリーンズ	4,400	538.00	2,367,200
ツナググループ・ホールディングス	2,800	251.00	702,800
GAMewith	3,500	441.00	1,543,500
ソウルドアウト	2,900	1,806.00	5,237,400
MS&Consulting	2,000	678.00	1,356,000
ウェルビー	7,500	1,071.00	8,032,500
エル・ティー・エス	1,500	2,307.00	3,460,500
ミダックホールディングス	5,200	2,202.00	11,450,400
日総工産	9,000	748.00	6,732,000
キュービーネットホールディングス	5,400	1,490.00	8,046,000
RPAホールディングス	16,300	312.00	5,085,600
三櫻工業	16,600	654.00	10,856,400
マキタ	147,300	3,714.00	547,072,200
東芝テック	13,200	4,695.00	61,974,000
芝浦メカトロニクス	2,200	7,490.00	16,478,000
マブチモーター	28,000	3,810.00	106,680,000
日本電産	313,600	9,215.00	2,889,824,000

ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,400	354.00	1,911,600	
トレックス・セミコンダクター	6,200	2,456.00	15,227,200	
東光高岳	6,800	1,378.00	9,370,400	
ダブル・スコープ	34,800	739.00	25,717,200	
宮越ホールディングス	4,500	863.00	3,883,500	
ダイヘン	13,300	4,200.00	55,860,000	
ヤーマン	19,800	935.00	18,513,000	
JVCケンウッド	98,200	166.00	16,301,200	
ミマキエンジニアリング	11,000	653.00	7,183,000	
IPEX	5,700	1,317.00	7,506,900	
日新電機	28,600	1,360.00	38,896,000	
大崎電気工業	22,100	480.00	10,608,000	
オムロン	100,700	7,628.00	768,139,600	
日東工業	16,100	1,576.00	25,373,600	
IDEC	15,000	2,519.00	37,785,000	
正興電機製作所	3,700	1,154.00	4,269,800	
不二電機工業	2,800	1,068.00	2,990,400	
ジーエス・ユアサコーポレーション	39,400	2,249.00	88,610,600	
サクサホールディングス	2,400	1,416.00	3,398,400	
メルコホールディングス	2,800	3,705.00	10,374,000	
テクノメディカ	2,900	1,564.00	4,535,600	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	3,400	912.00	3,100,800	
日本電気	153,800	4,945.00	760,541,000	
富士通	108,900	16,510.00	1,797,939,000	
沖電気工業	49,200	816.00	40,147,200	
岩崎通信機	5,200	830.00	4,316,000	
電気興業	6,500	2,370.00	15,405,000	
サンケン電気	11,300	4,645.00	52,488,500	
ナカヨ	1,900	1,126.00	2,139,400	
アイホン	7,000	2,054.00	14,378,000	
ルネサスエレクトロニクス	655,500	1,245.00	816,097,500	
セイコーエプソン	150,100	1,699.00	255,019,900	
ワコム	93,800	828.00	77,666,400	
アルバック	24,000	5,400.00	129,600,000	
アクセル	5,200	1,012.00	5,262,400	
EIZO	9,500	3,625.00	34,437,500	
ジャパンディスプレイ	411,400	39.00	16,044,600	
日本信号	30,900	858.00	26,512,200	
京三製作所	26,000	421.00	10,946,000	
能美防災	16,000	1,935.00	30,960,000	
ホーチキ	8,900	1,235.00	10,991,500	
星和電機	5,900	499.00	2,944,100	
エレコム	27,800	1,516.00	42,144,800	
パナソニック	1,290,300	1,095.00	1,412,878,500	
シャープ	137,900	1,081.00	149,069,900	
アンリツ	77,900	1,558.00	121,368,200	
富士通ゼネラル	32,800	2,277.00	74,685,600	
ソニーグループ	757,900	11,820.00	8,958,378,000	
TDK	175,300	3,890.00	681,917,000	

帝国通信工業	5,500	1,420.00	7,810,000
タムラ製作所	46,700	552.00	25,778,400
アルプスアルパイン	106,900	1,057.00	112,993,300
池上通信機	4,100	618.00	2,533,800
日本電波工業	11,000	1,104.00	12,144,000
鈴木	5,700	763.00	4,349,100
メイコー	9,900	3,345.00	33,115,500
日本トリム	2,400	2,608.00	6,259,200
ローランド ディー . ジー .	7,100	2,967.00	21,065,700
フォスター電機	12,200	689.00	8,405,800
S M K	2,900	2,119.00	6,145,100
ヨコオ	8,900	2,369.00	21,084,100
ティアック	19,300	111.00	2,142,300
ホシデン	29,200	1,143.00	33,375,600
ヒロセ電機	18,800	17,220.00	323,736,000
日本航空電子工業	27,800	1,785.00	49,623,000
T O A	13,200	718.00	9,477,600
マクセル	24,000	1,121.00	26,904,000
古野電気	14,300	1,018.00	14,557,400
ユニデンホールディングス	2,800	3,600.00	10,080,000
スミダコーポレーション	11,400	822.00	9,370,800
アイコム	4,500	2,395.00	10,777,500
リオン	4,500	2,087.00	9,391,500
本多通信工業	9,800	467.00	4,576,600
横河電機	121,100	1,917.00	232,148,700
新電元工業	4,500	2,779.00	12,505,500
アズビル	70,900	4,250.00	301,325,000
東亜ディーケーケー	6,200	876.00	5,431,200
日本光電工業	50,100	3,060.00	153,306,000
チノー	4,000	1,597.00	6,388,000
共和電業	12,300	370.00	4,551,000
日本電子材料	5,900	1,832.00	10,808,800
堀場製作所	22,400	6,370.00	142,688,000
アドバンテスト	90,000	8,540.00	768,600,000
小野測器	5,700	482.00	2,747,400
エスベック	9,900	1,905.00	18,859,500
キーエンス	109,600	54,300.00	5,951,280,000
日置電機	5,800	6,490.00	37,642,000
シスメックス	102,300	8,752.00	895,329,600
日本マイクロニクス	21,100	1,536.00	32,409,600
メガチップス	11,300	3,410.00	38,533,000
O B A R A G R O U P	5,700	2,998.00	17,088,600
I M A G I C A G R O U P	10,000	654.00	6,540,000
澤藤電機	1,500	1,403.00	2,104,500
デンソー	266,400	7,096.00	1,890,374,400
原田工業	6,200	1,020.00	6,324,000
コーセル	13,400	803.00	10,760,200
イリソ電子工業	10,100	3,575.00	36,107,500
オブテックスグループ	19,800	1,608.00	31,838,400
千代田インテグレ	5,300	2,037.00	10,796,100

アイ・オー・データ機器	4,500	1,299.00	5,845,500
レーザーテック	53,000	18,370.00	973,610,000
スタンレー電気	84,500	2,331.00	196,969,500
岩崎電気	4,500	2,299.00	10,345,500
ウシオ電機	61,900	1,771.00	109,624,900
岡谷電機産業	7,700	285.00	2,194,500
ヘリオス テクノ ホールディング	10,600	288.00	3,052,800
エノモト	3,300	1,418.00	4,679,400
日本セラミック	11,300	2,362.00	26,690,600
遠藤照明	5,700	934.00	5,323,800
古河電池	8,800	1,195.00	10,516,000
双信電機	5,300	543.00	2,877,900
山一電機	8,900	1,777.00	15,815,300
図研	7,800	2,973.00	23,189,400
日本電子	25,400	6,050.00	153,670,000
カシオ計算機	87,700	1,288.00	112,957,600
ファナック	106,200	19,605.00	2,082,051,000
日本シイエムケイ	23,800	573.00	13,637,400
エンプラス	3,000	2,506.00	7,518,000
大真空	16,400	1,025.00	16,810,000
ローム	54,100	8,550.00	462,555,000
浜松ホトニクス	86,800	5,780.00	501,704,000
三井ハイテック	12,000	7,400.00	88,800,000
新光電気工業	35,600	4,845.00	172,482,000
京セラ	170,200	6,318.00	1,075,323,600
協栄産業	1,300	1,488.00	1,934,400
太陽誘電	58,600	4,850.00	284,210,000
村田製作所	355,300	7,485.00	2,659,420,500
双葉電子工業	20,600	634.00	13,060,400
日東電工	73,200	7,950.00	581,940,000
北陸電気工業	4,500	1,208.00	5,436,000
東海理化電機製作所	31,900	1,386.00	44,213,400
ニチコン	38,100	1,117.00	42,557,700
日本ケミコン	11,600	1,630.00	18,908,000
K O A	18,300	1,294.00	23,680,200
三井E & Sホールディングス	43,500	323.00	14,050,500
日立造船	102,300	703.00	71,916,900
三菱重工業	190,100	3,502.00	665,730,200
川崎重工業	88,300	2,025.00	178,807,500
I H I	75,600	2,595.00	196,182,000
名村造船所	35,900	253.00	9,082,700
サノヤスホールディングス	14,000	125.00	1,750,000
スプリックス	3,300	1,325.00	4,372,500
マネジメントソリューションズ	5,700	3,135.00	17,869,500
プロレド・パートナーズ	2,400	802.00	1,924,800
and factory	2,800	422.00	1,181,600
テノ・ホールディングス	1,700	591.00	1,004,700
フロンティア・マネジメント	3,000	919.00	2,757,000
ピアラ	2,000	510.00	1,020,000
コプロ・ホールディングス	2,400	1,011.00	2,426,400

ギークス	2,100	1,118.00	2,347,800	
カーブスホールディングス	31,900	672.00	21,436,800	
フォーラムエンジニアリング	8,200	822.00	6,740,400	
FAST FITNESS JAPAN	1,700	1,638.00	2,784,600	
日本車輛製造	4,500	2,064.00	9,288,000	
三菱ロジスネクスト	16,000	846.00	13,536,000	
近畿車輛	1,300	1,012.00	1,315,600	
一家ホールディングス	2,200	525.00	1,155,000	
フルサト・マルカホールディングス	11,600	2,453.00	28,454,800	
ヤマエグループホールディングス	8,100	1,050.00	8,505,000	
藤久ホールディングス	2,900	607.00	1,760,300	
F P G	40,100	747.00	29,954,700	
島根銀行	3,600	528.00	1,900,800	
じもとホールディングス	8,900	617.00	5,491,300	
全国保証	28,600	4,715.00	134,849,000	
めぶきフィナンシャルグループ	618,500	252.00	155,862,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	9,300	1,085.00	10,090,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	15,000	1,778.00	26,670,000	
九州フィナンシャルグループ	243,800	395.00	96,301,000	
かんぼ生命保険	120,100	1,970.00	236,597,000	
ゆうちょ銀行	282,000	1,010.00	284,820,000	
あんしん保証	4,100	276.00	1,131,600	
富山第一銀行	29,400	320.00	9,408,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	681,300	444.00	302,497,200	
ジェイリース	4,100	1,651.00	6,769,100	
西日本フィナンシャルホールディングス	77,900	764.00	59,515,600	
イントラスト	5,200	552.00	2,870,400	
日本モーゲージサービス	6,800	954.00	6,487,200	
C A S A	4,200	805.00	3,381,000	
アルヒ	17,500	970.00	16,975,000	
プレミアグループ	6,200	3,660.00	22,692,000	
日産自動車	1,426,600	475.50	678,348,300	
いすゞ自動車	379,600	1,451.00	550,799,600	
トヨタ自動車	6,130,400	1,945.50	11,926,693,200	
日野自動車	151,000	675.00	101,925,000	
三菱自動車工業	447,700	273.00	122,222,100	
エフテック	8,500	490.00	4,165,000	
レシップホールディングス	4,600	543.00	2,497,800	
G M B	2,300	706.00	1,623,800	
ファルテック	2,400	630.00	1,512,000	
武蔵精密工業	26,900	1,510.00	40,619,000	
日産車体	17,800	570.00	10,146,000	
新明和工業	34,400	893.00	30,719,200	
極東開発工業	22,400	1,373.00	30,755,200	
トピー工業	10,000	1,035.00	10,350,000	
ティラド	3,500	2,270.00	7,945,000	

曙ブレーキ工業	66,300	148.00	9,812,400
タチエス	21,200	985.00	20,882,000
N O K	58,600	1,085.00	63,581,000
フタバ産業	30,300	325.00	9,847,500
K Y B	12,600	2,729.00	34,385,400
市光工業	14,600	373.00	5,445,800
大同メタル工業	23,500	583.00	13,700,500
プレス工業	60,100	360.00	21,636,000
ミクニ	16,100	342.00	5,506,200
太平洋工業	25,400	879.00	22,326,600
河西工業	14,600	272.00	3,971,200
アイシン	88,600	3,750.00	332,250,000
マツダ	379,600	768.00	291,532,800
今仙電機製作所	7,800	582.00	4,539,600
本田技研工業	952,400	3,205.00	3,052,442,000
スズキ	276,600	3,850.00	1,064,910,000
S U B A R U	346,500	1,763.00	610,879,500
安永	5,900	800.00	4,720,000
ヤマハ発動機	158,000	2,307.00	364,506,000
小糸製作所	66,400	5,030.00	333,992,000
T B K	13,900	383.00	5,323,700
エクセディ	18,300	1,526.00	27,925,800
ミツバ	22,200	332.00	7,370,400
豊田合成	39,000	1,860.00	72,540,000
愛三工業	19,000	652.00	12,388,000
盟和産業	1,300	1,034.00	1,344,200
日本プラスト	9,500	486.00	4,617,000
ヨロズ	11,400	826.00	9,416,400
エフ・シー・シー	19,800	1,288.00	25,502,400
新家工業	3,100	1,676.00	5,195,600
シマノ	48,400	26,355.00	1,275,582,000
テイ・エス テック	51,100	1,350.00	68,985,000
三十三フィナンシャルグループ	11,200	1,499.00	16,788,800
第四北越フィナンシャルグループ	19,400	2,608.00	50,595,200
ひろぎんホールディングス	176,300	665.00	117,239,500
マーキュリアホールディングス	4,200	475.00	1,995,000
おきなわフィナンシャルグループ	10,800	2,132.00	23,025,600
ダイレクトマーケティングミックス	12,500	1,752.00	21,900,000
ポピンズホールディングス	2,800	2,031.00	5,686,800
L I T A L I C O	9,500	2,442.00	23,199,000
十六フィナンシャルグループ	16,000	2,184.00	34,944,000
北國フィナンシャルホールディングス	11,000	2,814.00	30,954,000
ネットプロテクションズホールディングス	27,100	557.00	15,094,700
ジャムコ	7,100	730.00	5,183,000
小野建	11,700	1,593.00	18,638,100
はるやまホールディングス	5,700	544.00	3,100,800
南陽	2,000	1,858.00	3,716,000
ノジマ	19,200	2,400.00	46,080,000
佐島電機	7,500	900.00	6,750,000

カップ・クリエイト	16,800	1,365.00	22,932,000	
エコートレーディング	2,400	572.00	1,372,800	
伯東	7,100	2,345.00	16,649,500	
コンドーテック	9,500	1,050.00	9,975,000	
中山福	6,200	394.00	2,442,800	
ライトオン	9,300	690.00	6,417,000	
ナガイレベン	15,900	2,103.00	33,437,700	
三菱食品	11,700	3,105.00	36,328,500	
良品計画	137,200	1,570.00	215,404,000	
三城ホールディングス	12,900	267.00	3,444,300	
松田産業	8,800	2,405.00	21,164,000	
第一興商	22,700	3,300.00	74,910,000	
メディバルホールディングス	128,500	2,088.00	268,308,000	
アドヴァングループ	12,300	937.00	11,525,100	
S P K	4,900	1,308.00	6,409,200	
萩原電気ホールディングス	4,500	2,172.00	9,774,000	
アルビス	4,000	2,240.00	8,960,000	
アズワン	17,400	7,240.00	125,976,000	
スズデン	4,400	2,120.00	9,328,000	
尾家産業	2,600	980.00	2,548,000	
シモジマ	7,400	997.00	7,377,800	
ドウシシャ	11,300	1,510.00	17,063,000	
小津産業	2,000	2,003.00	4,006,000	
コナカ	13,900	342.00	4,753,800	
高速	7,200	1,575.00	11,340,000	
ハウス オブ ローゼ	1,000	1,708.00	1,708,000	
G - 7ホールディングス	13,300	1,580.00	21,014,000	
たけびし	4,500	1,419.00	6,385,500	
イオン北海道	21,200	1,211.00	25,673,200	
コジマ	20,400	543.00	11,077,200	
ヒマラヤ	4,200	927.00	3,893,400	
コーナン商事	17,000	3,585.00	60,945,000	
ネットワンシステムズ	45,200	2,652.00	119,870,400	
エコス	4,500	1,999.00	8,995,500	
ワタミ	14,500	897.00	13,006,500	
マルシェ	3,300	439.00	1,448,700	
リックス	2,000	1,626.00	3,252,000	
システムソフト	25,400	93.00	2,362,200	
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	238,200	1,810.00	431,142,000	
丸文	10,500	668.00	7,014,000	
西松屋チェーン	26,100	1,424.00	37,166,400	
ゼンショーホールディングス	58,200	2,768.00	161,097,600	
ハビネット	10,000	1,564.00	15,640,000	
幸楽苑ホールディングス	7,600	1,335.00	10,146,000	
ハークスレイ	5,200	463.00	2,407,600	
橋本総業ホールディングス	2,400	1,983.00	4,759,200	
日本ライフライン	35,300	1,073.00	37,876,900	
サイゼリヤ	17,600	2,788.00	49,068,800	
タカショー	9,000	630.00	5,670,000	

VTホールディングス	44,900	452.00	20,294,800	
アルゴグラフィックス	9,400	2,916.00	27,410,400	
魚力	3,200	2,120.00	6,784,000	
IDOM	36,100	601.00	21,696,100	
日本エム・ディ・エム	7,100	1,545.00	10,969,500	
ポブラ	3,700	140.00	518,000	
フジ・コーポレーション	6,500	1,163.00	7,559,500	
ユナイテッドアローズ	12,400	1,590.00	19,716,000	
進和	7,100	1,895.00	13,454,500	
エスケイジャパン	2,800	423.00	1,184,400	
ダイトロン	5,200	1,732.00	9,006,400	
ハイデイ日高	17,200	1,764.00	30,340,800	
シークス	17,000	976.00	16,592,000	
YU-WA CREATION HOLDINGS	7,100	199.00	1,412,900	
コロワイド	48,900	1,731.00	84,645,900	
ピーシーデポコーポレーション	13,900	300.00	4,170,000	
田中商事	2,800	624.00	1,747,200	
オーハシテクニカ	6,800	1,268.00	8,622,400	
壱番屋	8,500	4,675.00	39,737,500	
白銅	3,900	2,545.00	9,925,500	
トップカルチャー	4,500	289.00	1,300,500	
PLANT	3,000	652.00	1,956,000	
スギホールディングス	23,800	6,500.00	154,700,000	
ダイコー通産	1,300	1,154.00	1,500,200	
薬王堂ホールディングス	6,000	2,337.00	14,022,000	
島津製作所	155,700	3,955.00	615,793,500	
JMS	10,100	606.00	6,120,600	
クボテック	2,800	255.00	714,000	
長野計器	8,900	1,246.00	11,089,400	
ブイ・テクノロジー	5,300	3,180.00	16,854,000	
スター精密	18,800	1,388.00	26,094,400	
東京計器	7,700	1,087.00	8,369,900	
愛知時計電機	3,000	1,551.00	4,653,000	
インターアクション	6,200	1,899.00	11,773,800	
オーバル	11,000	277.00	3,047,000	
東京精密	20,400	4,570.00	93,228,000	
マニー	48,200	1,553.00	74,854,600	
ニコン	184,700	1,160.00	214,252,000	
トプコン	56,900	1,331.00	75,733,900	
オリンパス	634,500	2,122.50	1,346,726,250	
理研計器	9,900	4,965.00	49,153,500	
SCREENホールディングス	21,100	10,450.00	220,495,000	
キャノン電子	11,200	1,519.00	17,012,800	
タムロン	9,500	2,233.00	21,213,500	
HOYA	236,100	13,765.00	3,249,916,500	
シード	5,700	487.00	2,775,900	
ノーリツ鋼機	10,900	1,967.00	21,440,300	
エー・アンド・デイ	11,000	783.00	8,613,000	
朝日インテック	132,600	2,346.00	311,079,600	

キヤノン	601,100	2,703.50	1,625,073,850	
リコー	335,800	950.00	319,010,000	
シチズン時計	141,600	483.00	68,392,800	
リズム	3,700	1,368.00	5,061,600	
大研医器	9,900	525.00	5,197,500	
メニコン	40,100	2,868.00	115,006,800	
シンシア	1,500	445.00	667,500	
中本パックス	3,500	1,521.00	5,323,500	
スノーピーク	18,300	2,919.00	53,417,700	
パラマウントベッドホールディングス	23,200	1,994.00	46,260,800	
トランザクション	6,700	901.00	6,036,700	
粧美堂	4,100	401.00	1,644,100	
ニホンフラッシュ	10,400	1,028.00	10,691,200	
前田工織	13,400	3,100.00	41,540,000	
永大産業	16,900	289.00	4,884,100	
アートネイチャー	10,500	731.00	7,675,500	
バンダイナムコホールディングス	108,500	8,875.00	962,937,500	
アイフィスジャパン	3,500	673.00	2,355,500	
共立印刷	20,600	148.00	3,048,800	
SHOEI	11,400	4,075.00	46,455,000	
フランスベッドホールディングス	15,900	898.00	14,278,200	
マーベラス	18,800	697.00	13,103,600	
パイロットコーポレーション	20,500	5,040.00	103,320,000	
萩原工業	7,800	1,113.00	8,681,400	
エイベックス	20,500	1,367.00	28,023,500	
フジシールインターナショナル	29,400	1,607.00	47,245,800	
タカラトミー	50,500	1,203.00	60,751,500	
広済堂ホールディングス	7,400	827.00	6,119,800	
エステールホールディングス	3,300	650.00	2,145,000	
レック	15,800	902.00	14,251,600	
タカノ	4,500	698.00	3,141,000	
三光合成	12,700	326.00	4,140,200	
プロネクサス	9,500	1,083.00	10,288,500	
ホクシン	9,000	166.00	1,494,000	
ウッドワン	3,700	1,020.00	3,774,000	
大建工業	7,100	2,185.00	15,513,500	
きもと	18,900	208.00	3,931,200	
凸版印刷	183,900	2,178.00	400,534,200	
大日本印刷	143,000	2,918.00	417,274,000	
共同印刷	3,700	2,847.00	10,533,900	
N I S S H A	24,800	1,253.00	31,074,400	
光村印刷	600	1,450.00	870,000	
藤森工業	10,900	3,795.00	41,365,500	
ヴィア・ホールディングス	15,900	149.00	2,369,100	
TAKARA & COMPANY	6,100	1,847.00	11,266,700	
前澤化成工業	7,800	1,269.00	9,898,200	
未来工業	4,500	1,536.00	6,912,000	
アシックス	106,900	2,185.00	233,576,500	
ツツミ	3,100	1,902.00	5,896,200	
ウェーブブロックホールディングス	4,500	686.00	3,087,000	

JSP	7,100	1,530.00	10,863,000	
ニチハ	16,900	2,509.00	42,402,100	
ローランド	8,500	3,925.00	33,362,500	
エフピコ	22,200	3,195.00	70,929,000	
小松ウオール工業	3,500	1,870.00	6,545,000	
ヤマハ	70,400	5,090.00	358,336,000	
河合楽器製作所	3,400	3,035.00	10,319,000	
クリナップ	11,600	539.00	6,252,400	
ビジョン	73,200	2,096.00	153,427,200	
天馬	9,500	2,530.00	24,035,000	
兼松サステック	500	1,730.00	865,000	
キングジム	10,100	901.00	9,100,100	
象印マホービン	32,700	1,415.00	46,270,500	
リンテック	26,000	2,361.00	61,386,000	
信越ポリマー	21,700	1,017.00	22,068,900	
東リ	31,900	229.00	7,305,100	
イトーキ	22,100	350.00	7,735,000	
任天堂	68,300	58,600.00	4,002,380,000	
三菱鉛筆	19,900	1,249.00	24,855,100	
松風	5,300	1,583.00	8,389,900	
タカラスタANDARD	25,200	1,334.00	33,616,800	
コクヨ	58,000	1,563.00	90,654,000	
ナカバヤシ	11,600	497.00	5,765,200	
ニフコ	40,400	2,810.00	113,524,000	
立川ブラインド工業	5,500	1,031.00	5,670,500	
グロープライド	10,900	2,584.00	28,165,600	
オカムラ	41,600	1,156.00	48,089,600	
バルカー	9,900	2,535.00	25,096,500	
MUTOHホールディングス	1,000	2,174.00	2,174,000	
伊藤忠商事	833,300	3,912.00	3,259,869,600	
丸紅	1,175,200	1,294.00	1,520,708,800	
スクロール	18,300	895.00	16,378,500	
高島	2,000	2,305.00	4,610,000	
ヨンドシーホールディングス	11,000	1,589.00	17,479,000	
三陽商会	5,700	667.00	3,801,900	
長瀬産業	65,600	1,771.00	116,177,600	
ナイガイ	3,400	272.00	924,800	
蝶理	6,800	1,763.00	11,988,400	
豊田通商	119,600	4,620.00	552,552,000	
オンワードホールディングス	71,000	242.00	17,182,000	
三共生興	16,100	528.00	8,500,800	
兼松	44,400	1,362.00	60,472,800	
美津濃	12,200	2,176.00	26,547,200	
ツカモトコーポレーション	1,500	1,337.00	2,005,500	
ルックホールディングス	3,700	1,523.00	5,635,100	
三井物産	925,200	3,018.00	2,792,253,600	
日本紙パルプ商事	6,300	4,150.00	26,145,000	
東京エレクトロン	76,800	54,230.00	4,164,864,000	
カメイ	14,100	1,051.00	14,819,100	
東都水産	500	4,120.00	2,060,000	

OUGホールディングス	2,000	2,684.00	5,368,000	
スターゼン	8,900	2,080.00	18,512,000	
セイコーホールディングス	17,000	2,143.00	36,431,000	
山善	50,100	1,002.00	50,200,200	
椿本興業	2,000	3,870.00	7,740,000	
住友商事	752,000	1,925.00	1,447,600,000	
日本ユニシス	37,000	3,095.00	114,515,000	
内田洋行	5,200	4,375.00	22,750,000	
三菱商事	892,800	4,090.00	3,651,552,000	
第一実業	5,500	4,370.00	24,035,000	
キヤノンマーケティングジャパン	29,500	2,386.00	70,387,000	
西華産業	6,500	1,638.00	10,647,000	
佐藤商事	10,000	1,219.00	12,190,000	
菱洋エレクトロ	7,100	2,105.00	14,945,500	
東京産業	10,900	699.00	7,619,100	
ユアサ商事	11,300	3,045.00	34,408,500	
神鋼商事	2,800	3,790.00	10,612,000	
トルク	4,900	208.00	1,019,200	
阪和興業	23,800	3,395.00	80,801,000	
正栄食品工業	7,700	4,135.00	31,839,500	
カナデン	9,900	1,015.00	10,048,500	
菱電商事	9,500	1,720.00	16,340,000	
ニプロ	90,200	1,042.00	93,988,400	
岩谷産業	28,700	5,480.00	157,276,000	
ナイス	4,200	1,917.00	8,051,400	
ニチモウ	2,000	2,807.00	5,614,000	
極東貿易	3,400	2,288.00	7,779,200	
アステナホールディングス	16,600	417.00	6,922,200	
兼松エレクトロニクス	6,600	3,825.00	25,245,000	
三愛石油	29,300	946.00	27,717,800	
稲畑産業	26,300	2,120.00	55,756,000	
G S Iクレオス	5,700	1,143.00	6,515,100	
明和産業	11,000	1,168.00	12,848,000	
クワザワホールディングス	3,700	593.00	2,194,100	
キムラタン	65,700	18.00	1,182,600	
ゴールドウイン	21,400	5,990.00	128,186,000	
ユニ・チャーム	233,200	4,022.00	937,930,400	
デサント	23,000	2,871.00	66,033,000	
キング	5,500	533.00	2,931,500	
ワキタ	25,500	996.00	25,398,000	
ヤマトインターナショナル	11,000	278.00	3,058,000	
東邦ホールディングス	38,300	1,907.00	73,038,100	
サンゲツ	31,600	1,553.00	49,074,800	
ミツウロコグループホールディングス	17,500	1,105.00	19,337,500	
シナネンホールディングス	4,500	3,420.00	15,390,000	
伊藤忠エネクス	26,400	1,062.00	28,036,800	
サンリオ	37,000	2,246.00	83,102,000	
サンワテクノス	7,200	1,283.00	9,237,600	
リョーサン	13,200	2,194.00	28,960,800	
新光商事	18,100	965.00	17,466,500	

トーヨー	5,700	1,032.00	5,882,400
三信電気	5,700	1,641.00	9,353,700
東陽テクニカ	11,700	1,058.00	12,378,600
モスフードサービス	15,800	3,005.00	47,479,000
加賀電子	10,800	2,920.00	31,536,000
三益半導体工業	9,500	2,127.00	20,206,500
都築電気	6,200	1,409.00	8,735,800
ソーダニッカ	12,400	677.00	8,394,800
立花エレテック	9,600	1,627.00	15,619,200
木曽路	15,900	2,034.00	32,340,600
S R Sホールディングス	16,500	822.00	13,563,000
千趣会	21,700	367.00	7,963,900
タカキュー	10,600	106.00	1,123,600
リテールパートナーズ	14,500	1,319.00	19,125,500
ケーヨー	22,200	896.00	19,891,200
上新電機	13,600	2,029.00	27,594,400
日本瓦斯	57,900	1,521.00	88,065,900
ロイヤルホールディングス	20,500	1,865.00	38,232,500
東天紅	500	921.00	460,500
いなげや	14,900	1,393.00	20,755,700
チヨダ	11,600	695.00	8,062,000
ライフコーポレーション	11,000	3,120.00	34,320,000
リンガーハット	14,800	2,256.00	33,388,800
MrMaxHD	15,000	554.00	8,310,000
テナアライド	12,500	323.00	4,037,500
AOKIホールディングス	23,000	545.00	12,535,000
オークワ	18,800	966.00	18,160,800
コメリ	18,400	2,770.00	50,968,000
青山商事	24,500	597.00	14,626,500
しまむら	13,800	10,580.00	146,004,000
はせがわ	6,600	295.00	1,947,000
高島屋	86,700	1,049.00	90,948,300
松屋	24,000	665.00	15,960,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	56,400	824.00	46,473,600
近鉄百貨店	4,500	2,462.00	11,079,000
丸井グループ	94,100	2,114.00	198,927,400
クレディセゾン	76,400	1,279.00	97,715,600
アクシアル リテイリング	9,400	3,300.00	31,020,000
井筒屋	5,700	347.00	1,977,900
イオン	458,400	2,632.00	1,206,508,800
イズミ	21,600	3,210.00	69,336,000
フォーバル	5,400	817.00	4,411,800
平和堂	22,100	1,943.00	42,940,300
フジ	32,700	2,488.00	81,357,600
ヤオコー	13,600	6,680.00	90,848,000
ゼビオホールディングス	16,300	949.00	15,468,700
ケーズホールディングス	109,800	1,221.00	134,065,800
PALTAC	16,600	4,775.00	79,265,000
三谷産業	14,100	337.00	4,751,700
Olympicグループ	6,500	671.00	4,361,500

日産東京販売ホールディングス	18,800	220.00	4,136,000	
新生銀行	77,900	2,146.00	167,173,400	
あおぞら銀行	66,700	2,466.00	164,482,200	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,482,000	700.20	5,238,896,400	
りそなホールディングス	1,353,300	503.10	680,845,230	
三井住友トラスト・ホールディングス	225,600	3,912.00	882,547,200	
三井住友フィナンシャルグループ	825,800	3,858.00	3,185,936,400	
千葉銀行	398,100	695.00	276,679,500	
群馬銀行	228,700	366.00	83,704,200	
武蔵野銀行	17,700	1,825.00	32,302,500	
千葉興業銀行	28,400	265.00	7,526,000	
筑波銀行	46,800	204.00	9,547,200	
七十七銀行	37,500	1,520.00	57,000,000	
青森銀行	9,300	1,792.00	16,665,600	
秋田銀行	7,700	1,700.00	13,090,000	
山形銀行	13,400	936.00	12,542,400	
岩手銀行	7,700	1,911.00	14,714,700	
東邦銀行	99,800	209.00	20,858,200	
東北銀行	6,200	1,004.00	6,224,800	
みちのく銀行	7,800	827.00	6,450,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	100,400	2,185.00	219,374,000	
静岡銀行	290,600	812.00	235,967,200	
スルガ銀行	104,600	426.00	44,559,600	
八十二銀行	268,200	424.00	113,716,800	
山梨中央銀行	13,200	956.00	12,619,200	
大垣共立銀行	23,700	1,979.00	46,902,300	
福井銀行	10,300	1,444.00	14,873,200	
清水銀行	5,200	1,577.00	8,200,400	
富山銀行	1,900	1,981.00	3,763,900	
滋賀銀行	22,400	2,253.00	50,467,200	
南都銀行	18,800	2,036.00	38,276,800	
百五銀行	115,200	350.00	40,320,000	
京都銀行	42,700	4,865.00	207,735,500	
紀陽銀行	40,500	1,428.00	57,834,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	74,500	948.00	70,626,000	
山陰合同銀行	71,000	654.00	46,434,000	
中国銀行	95,500	885.00	84,517,500	
鳥取銀行	3,500	1,238.00	4,333,000	
伊予銀行	158,200	602.00	95,236,400	
百十四銀行	12,600	1,725.00	21,735,000	
四国銀行	18,300	774.00	14,164,200	
阿波銀行	18,300	2,262.00	41,394,600	
大分銀行	7,100	1,935.00	13,738,500	
宮崎銀行	7,500	2,114.00	15,855,000	
佐賀銀行	7,100	1,452.00	10,309,200	
琉球銀行	26,000	808.00	21,008,000	
セブン銀行	354,100	245.00	86,754,500	
みずほフィナンシャルグループ	1,525,900	1,503.00	2,293,427,700	
高知銀行	3,500	757.00	2,649,500	
山口フィナンシャルグループ	138,700	709.00	98,338,300	

芙蓉総合リース	12,500	6,920.00	86,500,000
みずほリース	18,700	2,966.00	55,464,200
東京センチュリー	23,000	4,295.00	98,785,000
SBIホールディングス	147,200	2,960.00	435,712,000
日本証券金融	47,000	915.00	43,005,000
アイフル	200,000	320.00	64,000,000
日本アジア投資	9,500	216.00	2,052,000
長野銀行	4,100	1,195.00	4,899,500
名古屋銀行	8,900	2,813.00	25,035,700
北洋銀行	180,100	242.00	43,584,200
愛知銀行	4,400	4,800.00	21,120,000
中京銀行	4,400	1,609.00	7,079,600
大光銀行	3,000	1,380.00	4,140,000
愛媛銀行	16,900	933.00	15,767,700
トマト銀行	4,600	1,055.00	4,853,000
京葉銀行	51,400	503.00	25,854,200
栃木銀行	58,000	215.00	12,470,000
北日本銀行	3,900	1,609.00	6,275,100
東和銀行	21,400	546.00	11,684,400
福島銀行	13,800	220.00	3,036,000
大東銀行	6,100	681.00	4,154,100
リコーリース	10,500	3,385.00	35,542,500
イオンフィナンシャルサービス	64,800	1,125.00	72,900,000
アコム	235,300	289.00	68,001,700
ジャックス	13,300	3,075.00	40,897,500
オリエントコーポレーション	322,200	118.00	38,019,600
オリックス	709,300	2,188.50	1,552,303,050
三菱HCキャピタル	440,800	552.00	243,321,600
ジャフコグループ	45,800	1,831.00	83,859,800
九州リースサービス	6,500	578.00	3,757,000
トモニホールディングス	92,400	332.00	30,676,800
大和証券グループ本社	893,600	673.10	601,482,160
野村ホールディングス	1,821,800	490.70	893,957,260
岡三証券グループ	93,700	376.00	35,231,200
丸三証券	35,300	510.00	18,003,000
東洋証券	38,500	153.00	5,890,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	136,300	399.00	54,383,700
光世証券	2,400	460.00	1,104,000
水戸証券	31,900	283.00	9,027,700
いちよし証券	22,400	610.00	13,664,000
松井証券	58,600	802.00	46,997,200
SOMPOホールディングス	195,900	4,914.00	962,652,600
日本取引所グループ	302,100	2,247.00	678,818,700
マネックスグループ	97,000	592.00	57,424,000
極東証券	16,000	753.00	12,048,000
岩井コスモホールディングス	11,200	1,356.00	15,187,200
アイザワ証券グループ	19,800	858.00	16,988,400
フィデアホールディングス	10,900	1,344.00	14,649,600
池田泉州ホールディングス	136,400	179.00	24,415,600

アニコム ホールディングス	36,500	662.00	24,163,000	
MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス	267,600	3,810.00	1,019,556,000	
マネーパートナーズグループ	12,600	251.00	3,162,600	
スパークス・グループ	54,800	241.00	13,206,800	
小林洋行	2,600	226.00	587,600	
第一生命ホールディングス	587,200	2,348.50	1,379,039,200	
東京海上ホールディングス	393,000	6,434.00	2,528,562,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	5,900	584.00	3,445,600	
イー・ギャランティ	17,500	1,928.00	33,740,000	
アサックス	7,000	684.00	4,788,000	
NECキャピタルソリューション	5,200	2,060.00	10,712,000	
T & Dホールディングス	309,600	1,524.00	471,830,400	
アドバンスクリエイト	5,800	975.00	5,655,000	
三井不動産	543,700	2,495.00	1,356,531,500	
三菱地所	783,900	1,662.00	1,302,841,800	
平和不動産	20,500	3,855.00	79,027,500	
東京建物	117,700	1,703.00	200,443,100	
京阪神ビルディング	18,700	1,452.00	27,152,400	
住友不動産	250,300	3,247.00	812,724,100	
太平洋興発	4,500	651.00	2,929,500	
テオーシー	21,500	689.00	14,813,500	
東京楽天地	2,000	4,025.00	8,050,000	
レオパレス21	123,600	185.00	22,866,000	
スターツコーポレーション	16,400	2,422.00	39,720,800	
フジ住宅	14,100	631.00	8,897,100	
空港施設	12,400	545.00	6,758,000	
明和地所	5,800	638.00	3,700,400	
ゴールドクレスト	9,500	1,769.00	16,805,500	
リログループ	63,300	1,644.00	104,065,200	
エスリード	4,600	1,745.00	8,027,000	
日神グループホールディングス	19,400	479.00	9,292,600	
日本エスコン	22,400	753.00	16,867,200	
タカラレーベン	50,100	303.00	15,180,300	
A V A N T I A	6,300	805.00	5,071,500	
イオンモール	59,800	1,559.00	93,228,200	
毎日コムネット	4,500	644.00	2,898,000	
ファースト住建	4,500	1,108.00	4,986,000	
ランド	647,800	11.00	7,125,800	
カチタス	29,500	3,545.00	104,577,500	
東祥	8,700	1,702.00	14,807,400	
トーセイ	16,500	1,054.00	17,391,000	
穴吹興産	2,800	2,050.00	5,740,000	
サンフロンティア不動産	16,500	1,018.00	16,797,000	
FJネクストホールディングス	12,000	987.00	11,844,000	
インテリックス	2,900	624.00	1,809,600	
ランドビジネス	4,900	239.00	1,171,100	
サンネクスタグループ	4,100	1,103.00	4,522,300	
グランディハウス	8,500	564.00	4,794,000	
東武鉄道	118,100	2,838.00	335,167,800	

相鉄ホールディングス	38,600	2,261.00	87,274,600	
東急	305,100	1,574.00	480,227,400	
京浜急行電鉄	155,300	1,193.00	185,272,900	
小田急電鉄	180,000	1,944.00	349,920,000	
京王電鉄	62,800	4,730.00	297,044,000	
京成電鉄	84,400	3,245.00	273,878,000	
富士急行	14,500	3,850.00	55,825,000	
新京成電鉄	2,800	2,020.00	5,656,000	
東日本旅客鉄道	213,000	6,561.00	1,397,493,000	
西日本旅客鉄道	146,700	4,769.00	699,612,300	
東海旅客鉄道	100,500	15,240.00	1,531,620,000	
西武ホールディングス	157,900	1,208.00	190,743,200	
鴻池運輸	19,300	1,216.00	23,468,800	
西日本鉄道	33,500	2,537.00	84,989,500	
ハマキョウレックス	8,700	2,822.00	24,551,400	
サカイ引越センター	5,700	4,095.00	23,341,500	
近鉄グループホールディングス	114,600	3,395.00	389,067,000	
阪急阪神ホールディングス	143,300	3,420.00	490,086,000	
南海電気鉄道	51,300	2,327.00	119,375,100	
京阪ホールディングス	51,100	2,820.00	144,102,000	
神戸電鉄	2,800	3,360.00	9,408,000	
名古屋鉄道	94,200	2,028.00	191,037,600	
山陽電気鉄道	9,000	2,038.00	18,342,000	
アルプス物流	8,200	1,089.00	8,929,800	
トランコム	3,300	7,050.00	23,265,000	
ヤマトホールディングス	160,600	2,239.00	359,583,400	
山九	30,100	3,990.00	120,099,000	
日新	9,300	1,650.00	15,345,000	
丸運	6,900	243.00	1,676,700	
丸全昭和運輸	9,500	3,210.00	30,495,000	
センコーグループホールディングス	57,600	931.00	53,625,600	
トナミホールディングス	2,800	3,610.00	10,108,000	
ニッコンホールディングス	38,500	2,194.00	84,469,000	
日本石油輸送	900	2,595.00	2,335,500	
福山通運	18,900	3,755.00	70,969,500	
セイノーホールディングス	78,000	1,148.00	89,544,000	
エスライン	2,600	912.00	2,371,200	
神奈川中央交通	2,800	3,530.00	9,884,000	
日立物流	22,200	6,340.00	140,748,000	
丸和運輸機関	24,200	1,003.00	24,272,600	
C & F ロジホールディングス	11,700	1,206.00	14,110,200	
日本郵船	95,800	11,750.00	1,125,650,000	
商船三井	63,500	11,100.00	704,850,000	
川崎汽船	35,300	8,720.00	307,816,000	
N S ユナイテッド海運	6,300	4,290.00	27,027,000	
明治海運	13,600	929.00	12,634,400	
飯野海運	53,000	841.00	44,573,000	
共栄タンカー	2,000	1,064.00	2,128,000	
九州旅客鉄道	88,700	2,502.00	221,927,400	
S G ホールディングス	216,600	2,208.00	478,252,800	

NIPPON EXPRESSホールディングス	39,700	8,140.00	323,158,000	
日本航空	262,600	1,996.00	524,149,600	
ANAホールディングス	291,100	2,319.00	675,060,900	
パスコ	2,300	1,285.00	2,955,500	
TREホールディングス	15,900	1,704.00	27,093,600	
人・夢・技術グループ	4,500	1,920.00	8,640,000	
西本Wismettacホールディングス	2,800	2,798.00	7,834,400	
シルバーライフ	2,400	1,177.00	2,824,800	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,866.00	1,866,000	
Genky DrugStores	5,300	4,175.00	22,127,500	
コア商事ホールディングス	8,900	718.00	6,390,200	
国際紙バルブ商事	24,700	338.00	8,348,600	
ナルミヤ・インターナショナル	1,000	867.00	867,000	
ブックオフグループホールディングス	7,200	1,039.00	7,480,800	
ギフトホールディングス	2,000	2,107.00	4,214,000	
三菱倉庫	36,300	2,812.00	102,075,600	
三井倉庫ホールディングス	12,300	2,300.00	28,290,000	
住友倉庫	40,500	2,319.00	93,919,500	
澁澤倉庫	7,000	2,237.00	15,659,000	
ヤマタネ	5,700	1,640.00	9,348,000	
東陽倉庫	18,800	312.00	5,865,600	
乾汽船	7,700	2,363.00	18,195,100	
日本トランスシティ	25,400	617.00	15,671,800	
ケイヒン	2,300	1,332.00	3,063,600	
中央倉庫	7,200	958.00	6,897,600	
川西倉庫	2,400	1,165.00	2,796,000	
安田倉庫	9,900	968.00	9,583,200	
ファイズホールディングス	2,400	654.00	1,569,600	
東洋埠頭	2,600	1,511.00	3,928,600	
上組	63,100	2,211.00	139,514,100	
サンリツ	3,300	817.00	2,696,100	
キムラユニティー	3,300	1,297.00	4,280,100	
キューソー流通システム	6,000	943.00	5,658,000	
近鉄エクスプレス	21,600	3,190.00	68,904,000	
東海運	7,100	303.00	2,151,300	
エーアイティー	7,200	1,350.00	9,720,000	
内外トランスライン	4,500	1,874.00	8,433,000	
ショーエイコーポレーション	3,300	633.00	2,088,900	
日本コンセプト	3,700	1,439.00	5,324,300	
TBSホールディングス	72,200	1,781.00	128,588,200	
日本テレビホールディングス	99,100	1,230.00	121,893,000	
朝日放送グループホールディングス	12,300	689.00	8,474,700	
テレビ朝日ホールディングス	28,600	1,468.00	41,984,800	
スカパーJ S A Tホールディングス	100,400	415.00	41,666,000	
テレビ東京ホールディングス	8,700	2,041.00	17,756,700	
日本BS放送	4,400	1,030.00	4,532,000	
ビジョン	20,200	1,121.00	22,644,200	
スマートバリュー	3,000	417.00	1,251,000	

USEN - NEXT HOLDING S	11,300	2,323.00	26,249,900	
ワイヤレスゲート	4,500	287.00	1,291,500	
コネクシオ	8,500	1,399.00	11,891,500	
日本通信	98,600	178.00	17,550,800	
クロップス	2,400	990.00	2,376,000	
日本電信電話	1,241,700	3,416.00	4,241,647,200	
KDDI	865,400	3,819.00	3,304,962,600	
ソフトバンク	1,797,900	1,470.50	2,643,811,950	
光通信	13,600	13,560.00	184,416,000	
エムティーアイ	11,700	440.00	5,148,000	
GMOインターネット	42,100	2,815.00	118,511,500	
ファイバーゲート	3,900	1,171.00	4,566,900	
アйдママーケティングコミュニケーション	2,900	287.00	832,300	
KADOKAWA	64,700	2,799.00	181,095,300	
学研ホールディングス	16,600	948.00	15,736,800	
ゼンリン	19,200	1,023.00	19,641,600	
昭文社ホールディングス	3,700	430.00	1,591,000	
インプレスホールディングス	9,600	202.00	1,939,200	
東京電力ホールディングス	905,200	330.00	298,716,000	
中部電力	370,000	1,155.00	427,350,000	
関西電力	458,400	1,138.00	521,659,200	
中国電力	189,100	873.00	165,084,300	
北陸電力	110,800	550.00	60,940,000	
東北電力	282,800	713.00	201,636,400	
四国電力	109,000	805.00	87,745,000	
九州電力	249,300	838.00	208,913,400	
北海道電力	105,100	472.00	49,607,200	
沖縄電力	25,800	1,414.00	36,481,200	
電源開発	103,000	1,855.00	191,065,000	
エフオン	7,300	533.00	3,890,900	
イーレックス	17,800	1,890.00	33,642,000	
レノバ	23,600	1,470.00	34,692,000	
東京瓦斯	231,900	2,321.00	538,239,900	
大阪瓦斯	219,000	2,214.00	484,866,000	
東邦瓦斯	55,500	2,776.00	154,068,000	
北海道瓦斯	6,200	1,499.00	9,293,800	
広島ガス	24,000	348.00	8,352,000	
西部ガスホールディングス	13,600	2,107.00	28,655,200	
静岡ガス	31,600	856.00	27,049,600	
メタウォーター	12,500	1,979.00	24,737,500	
アイネット	6,200	1,264.00	7,836,800	
松竹	7,800	12,260.00	95,628,000	
東宝	70,000	4,690.00	328,300,000	
エイチ・アイ・エス	25,700	1,861.00	47,827,700	
東映	3,900	17,260.00	67,314,000	
ラックランド	3,400	2,851.00	9,693,400	
エヌ・ティ・ティ・データ	316,200	2,151.00	680,146,200	
共立メンテナンス	20,600	4,470.00	92,082,000	

イチネンホールディングス	12,000	1,259.00	15,108,000
建設技術研究所	7,000	2,239.00	15,673,000
スペース	8,500	934.00	7,939,000
アインホールディングス	15,900	6,190.00	98,421,000
燦ホールディングス	5,200	1,537.00	7,992,400
ピー・シー・エー	7,100	1,403.00	9,961,300
スバル興業	600	8,210.00	4,926,000
東京テアトル	4,500	1,243.00	5,593,500
タナベ経営	4,000	655.00	2,620,000
ビジネスブレイン太田昭和	4,200	1,369.00	5,749,800
ナガワ	3,700	9,900.00	36,630,000
東京都競馬	8,800	4,000.00	35,200,000
常磐興産	4,500	1,387.00	6,241,500
カナモト	20,400	2,113.00	43,105,200
D T S	22,800	2,596.00	59,188,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	55,300	5,580.00	308,574,000
シーイーシー	12,600	1,025.00	12,915,000
カブコン	112,000	2,770.00	310,240,000
西尾レントオール	10,600	2,743.00	29,075,800
アイ・エス・ビー	5,700	992.00	5,654,400
アゴーラ ホスピタリティグループ	61,800	22.00	1,359,600
日本空港ビルデング	45,600	5,200.00	237,120,000
トランス・コスモス	14,800	3,100.00	45,880,000
乃村工藝社	49,500	892.00	44,154,000
ジャステック	7,100	1,050.00	7,455,000
S C S K	82,300	1,963.00	161,554,900
藤田観光	5,200	2,228.00	11,585,600
K N T - C Tホールディングス	7,100	1,390.00	9,869,000
日本管財	12,400	2,844.00	35,265,600
トーカイ	10,300	1,817.00	18,715,100
白洋舎	1,300	1,336.00	1,736,800
セコム	113,900	8,443.00	961,657,700
日本システムウエア	4,500	2,070.00	9,315,000
セントラル警備保障	5,700	2,357.00	13,434,900
アイネス	10,900	1,611.00	17,559,900
丹青社	23,600	696.00	16,425,600
メイテック	14,000	6,550.00	91,700,000
T K C	20,100	3,225.00	64,822,500
富士ソフト	12,600	5,810.00	73,206,000
応用地質	13,200	2,155.00	28,446,000
船井総研ホールディングス	23,700	2,204.00	52,234,800
N S D	38,300	2,101.00	80,468,300
進学会ホールディングス	4,200	350.00	1,470,000
丸紅建材リース	900	1,791.00	1,611,900
オオバ	8,500	686.00	5,831,000
コナミホールディングス	43,100	6,870.00	296,097,000
いであ	3,200	1,785.00	5,712,000
学究社	3,900	1,580.00	6,162,000

ベネッセホールディングス	38,500	2,175.00	83,737,500
イオンディライト	14,200	3,065.00	43,523,000
ナック	6,100	973.00	5,935,300
福井コンピュータホールディングス	5,500	3,175.00	17,462,500
ダイセキ	21,400	4,540.00	97,156,000
ステップ	4,400	1,780.00	7,832,000
日鉄物産	8,500	5,370.00	45,645,000
泉州電業	3,400	5,980.00	20,332,000
元気寿司	3,400	2,429.00	8,258,600
トラスコ中山	24,800	2,410.00	59,768,000
ヤマダホールディングス	435,100	386.00	167,948,600
オートバックスセブン	40,100	1,390.00	55,739,000
モリト	8,900	726.00	6,461,400
アーランドサカモト	18,800	1,528.00	28,726,400
ニトリホールディングス	47,400	16,530.00	783,522,000
グルメ杵屋	9,900	1,055.00	10,444,500
愛眼	6,700	190.00	1,273,000
ケーユーホールディングス	6,500	1,072.00	6,968,000
吉野家ホールディングス	41,600	2,376.00	98,841,600
加藤産業	17,300	3,100.00	53,630,000
北恵	3,300	970.00	3,201,000
イノテック	7,100	1,353.00	9,606,300
イエローハット	20,600	1,623.00	33,433,800
松屋フーズホールディングス	5,800	3,620.00	20,996,000
JBCホールディングス	8,100	1,463.00	11,850,300
JKホールディングス	9,600	1,046.00	10,041,600
サガミホールディングス	18,300	1,185.00	21,685,500
日伝	10,000	2,240.00	22,400,000
関西フードマーケット	9,000	1,160.00	10,440,000
ミロク情報サービス	10,500	1,380.00	14,490,000
北沢産業	6,200	231.00	1,432,200
杉本商事	5,400	2,243.00	12,112,200
因幡電機産業	31,900	2,563.00	81,759,700
王将フードサービス	7,800	6,060.00	47,268,000
プレナス	13,500	1,980.00	26,730,000
ミニストップ	9,300	1,453.00	13,512,900
アークス	22,800	2,198.00	50,114,400
バローホールディングス	26,400	2,150.00	56,760,000
東テク	3,700	2,380.00	8,806,000
ミスミグループ本社	149,500	3,535.00	528,482,500
アルテック	8,500	275.00	2,337,500
ベルク	5,300	5,500.00	29,150,000
大庄	6,600	1,009.00	6,659,400
タキヒヨー	3,400	1,168.00	3,971,200
ファーストリテイリング	15,900	60,110.00	955,749,000
ソフトバンクグループ	711,800	4,780.00	3,402,404,000
蔵王産業	1,900	1,966.00	3,735,400
スズケン	46,500	3,720.00	172,980,000
サンドラッグ	44,900	3,080.00	138,292,000
サクスパーホールディングス	11,300	495.00	5,593,500

ジェコス	8,900	833.00	7,413,700	
ヤマザワ	2,400	1,572.00	3,772,800	
やまや	2,400	2,541.00	6,098,400	
グローセル	14,100	438.00	6,175,800	
ペルーナ	25,600	683.00	17,484,800	
合計	132,989,200		302,658,361,970	

(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3月31日現在

資産総額	8,817,682,981円
負債総額	23,531,474円
純資産総額(-)	8,794,151,507円
発行済数量	6,709,064,512口
1口当たり純資産額(/)	1.3108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3月31日現在

資産総額	415,270,981,593円
負債総額	757,961,458円
純資産総額(-)	414,513,020,135円
発行済数量	127,112,336,018口
1口当たり純資産額(/)	3.2610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3月31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3月31日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

取締役は株主総会で選任されます。取締役(監査等委員である取締役を除く。)の任期は、その選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した取締役(監査等委員である取締役を除く。)の補欠として選任された取締役(監査等委員である取締役を除く。)の任期は、現任取締役(監査等委員である取締役を除く。)の任期の満了の時までとします。

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書

を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）ならびにその受益証券（受益権）の募集又は私募（第二種金融商品取引業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っています。

2022年3月31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	1,478,274,797,635
追加型株式投資信託	812	15,311,739,458,456
単位型公社債投資信託	27	53,798,310,639
単位型株式投資信託	223	1,265,390,314,377
合計	1,088	18,109,202,881,107

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	1,278,455	1,119,327
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	3,524,781	3,991,834
ソフトウェア	3,299,065	2,878,179
ソフトウェア仮勘定	221,784	1,109,723
電話加入権	3,931	3,931
投資その他の資産	9,482,127	11,153,554
投資有価証券	261,361	261,360
関係会社株式	5,299,196	5,299,196
長期差入保証金	1,302,402	1,324,203
繰延税金資産	2,508,004	3,676,823
その他	111,162	591,970
固定資産計	14,285,364	16,264,717
資産合計	95,566,859	104,757,915

(単位:千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	3,702,906	3,730,283
未払金	4,803,140	7,337,541
未払収益分配金	966	846
未払償還金	9,999	9,999
未払手数料	4,582,140	6,889,193
その他未払金	210,034	437,502
未払費用	6,673,320	9,713,972
未払法人税等	4,090,268	4,199,922
未払消費税等	1,338,183	2,106,617
賞与引当金	1,373,328	1,789,597
役員賞与引当金	65,290	76,410
流動負債計	22,046,438	28,954,345
固定負債		
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
時効後支払損引当金	174,139	157,945
固定負債計	2,293,087	2,450,431
負債合計	24,339,526	31,404,777
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	49,674,383	51,800,187
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	49,551,090	51,676,893
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	17,871,090	19,996,893
株主資本計	71,227,341	73,353,144
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	7	6
評価・換算差額等計	7	6
純資産合計	71,227,333	73,353,137
負債・純資産合計	95,566,859	104,757,915

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(3)【株主資本等変動計算書】

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

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

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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本 合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341
当期変動額									
剰余金の配当							12,000,000	12,000,000	12,000,000
当期純利益							14,125,803	14,125,803	14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,125,803	2,125,803	2,125,803
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	19,996,893	51,800,187	73,353,144

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

(未適用の会計基準等)

1. 収益認識に関する会計基準等

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

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

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

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

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第35期(自2019年4月1日至2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種 類株式					

第36期(自2020年4月1日至2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種類 株式				

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2021年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種 類株式					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

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

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的主要原因別の内訳

	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 その他有価証券	1	1	-
資産計	25,868	25,868	-

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

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

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

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

(有価証券関係)

第37期中間会計期間末

(2021年9月30日現在)

1. 子会社株式

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

2. その他有価証券

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

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率 50.00%

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2021年4月1日から2021年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん 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)	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社みちのく銀行(1)	36,986	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東邦銀行	23,519	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北陸銀行	140,409	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社大垣共立銀行	46,773	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社広島銀行	54,573	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社西日本シティ銀行	85,745	日本において銀行業務を営んでおります。
みずほ信託銀行株式会社(1)	247,369	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。
株式会社名古屋銀行	25,090	日本において銀行業務を営んでおります。
auカブコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社SBI証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
OKB証券株式会社(1)	1,500	「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。
楽天証券株式会社	(2)7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
SMB C日興証券株式会社	10,000	「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。
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。
丸國證券株式会社	601	「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

(注) 確定拠出年金向けの取扱販売会社を含みます。

(1) 新規の取得のお申込みのお取扱いを行っていません。

(2) 2020年12月31日現在

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

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4月22日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMHAM TOPIXオープンの2021年3月11日から2022年3月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、MHAM TOPIXオープンの2022年3月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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。