

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年9月9日提出
【計算期間】	第21期(自 2021年6月11日至 2022年6月10日)
【ファンド名】	MHAMトピックスファンド
【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
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【電話番号】	03-6774-5100
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【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】

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(以下「マザーファンド」ということがあります。)受益証券への投資を通じ、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。

東証株価指数(TOPIX [トピックス]=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J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」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J P Xが有しています。
2. J P X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. J P X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. J P X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、J P X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、J P X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. J P X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. J P X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、J P X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。

株式と株価指数先物取引等の合計の組入比率は、原則として高位を保つことを基本とします。

1兆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	インデックス型
	海外	不動産投信	特殊型
	内外	その他資産 ( )	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・ 商品分類定義

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

## &lt;属性区分&gt;

## ・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	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ
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)	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東)	
不動産投信 その他資産 (投資信託証券)	日々 その他	エマージング	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/>）でご覧いただけます。

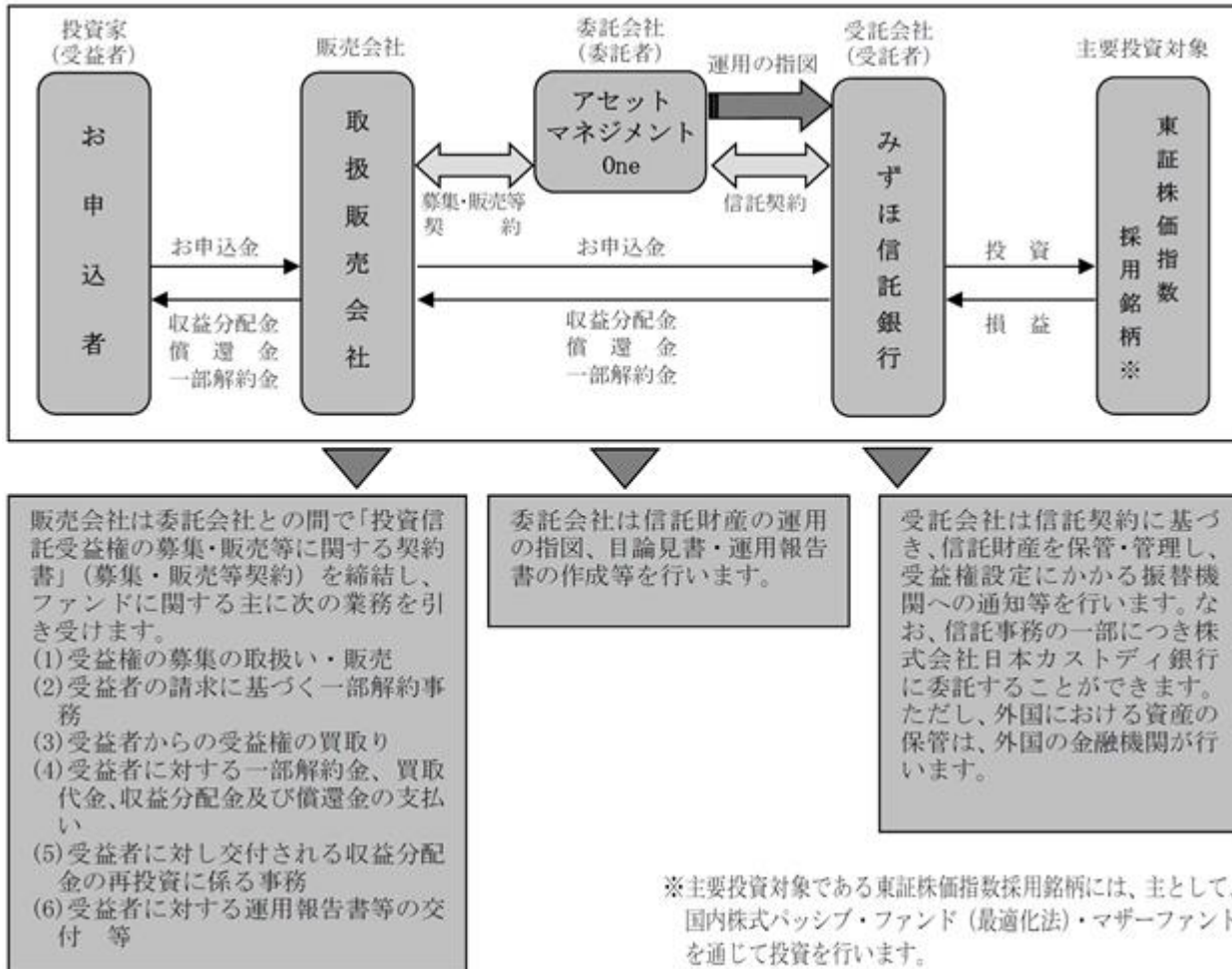
（注3）当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

## （2）【ファンドの沿革】

2001年6月29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	ファンドの名称を「DKA TOPIX ファンド」から「MHAMトピックスファンド」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
2018年9月11日	信託財産留保額の撤廃
2021年4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9月17日	ファンドの主要投資対象から「MHAMトピックスマザーファンド」を削除

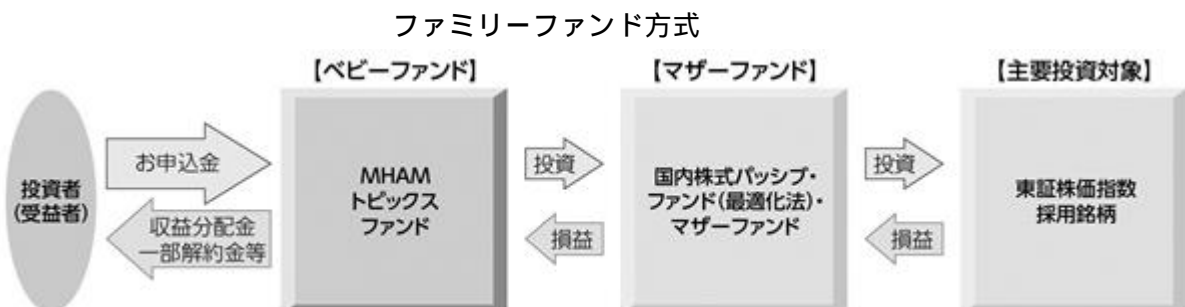
## (3) 【ファンドの仕組み】

## 当ファンドの運営の仕組み



## ファミリーファンド方式について

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6月30日現在）

### 委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月1日	DIAM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6月30日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

#### 基本方針

この投資信託は、東証株価指数(TOPIX、配当込み)に連動する投資成果を目指した運用を行います。

## 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。

### 2. 投資態度

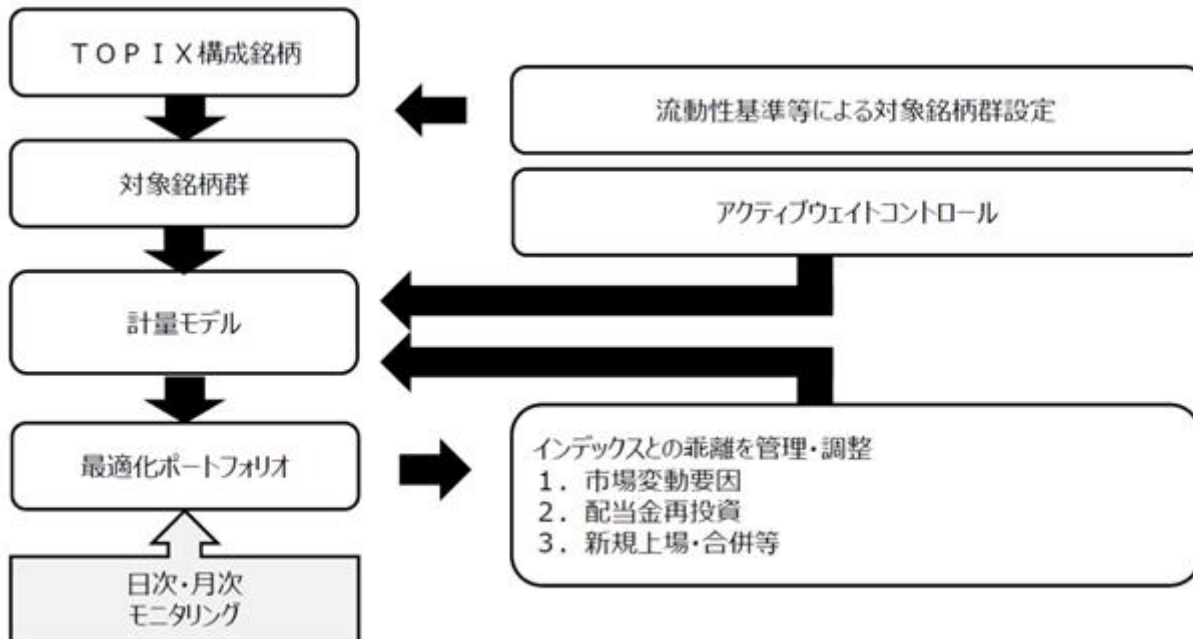
- a. 主として国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド受益証券に投資を行い、東証株価指数(TOPIX、配当込み)に連動した投資成果を目指します。
- b. 投資にあたっては、主として国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド受益証券への投資を通じ、以下の方針に基づき運用を行います。
  - . わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている(または採用予定の)銘柄を主要投資対象とします。
  - . 運用の効率化を図るため、ならびに追加設定・一部解約等に対応するため、株価指数先物取引等を利用することがあります。
  - . 原則として、株式と株価指数先物取引等の合計の組入比率(株式の実質組入比率)は、高位を保つことを基本とします。
- c. 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。

「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。)
- d. 市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- e. 国内において行われる有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかか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。
- f. 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことができます。
- g. 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引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。



### 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】

### 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1.次に掲げる特定資産（「特定資産」とは投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - a.有価証券
  - b.デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第27条、第28条および第29条に定めるものに限ります。）

- c. 金銭債権
  - d. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
- a. 為替手形

#### 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(以下「マザーファンド受益証券」といいます。)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、かつ本邦通貨建のものに限ります。)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が発行する債券
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. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)または優先出資引受権を表示する証書
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 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
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.~11.の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
20. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

21.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

22.外国の者に対する権利で前記21.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、12.および17.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに12.および17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券(外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

委託会社は、信託金を、 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、 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
- 6.外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

## (3) 【運用体制】

## a. ファンドの運用体制



## 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

## 運用計画の決定

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

## 売買執行の実施

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

## モニタリング

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

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

## 内部管理等のモニタリング

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

#### b. ファンドの関係法人に関する管理

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

#### c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2022年6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

### (4) 【分配方針】

#### 収益分配方針

年1回の毎決算時(原則として6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、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

1. 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益(繰越分およびマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。))を含みます。)および売買益(評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額)等の全額とします。
2. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。
3. 収益分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

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. 収益分配金の再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資することにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

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

(5) 【投資制限】

a. 約款で定める投資制限

株式、新株引受権証券および新株予約権証券(約款 運用の基本方針 運用方法(3)投資制限、約款第21条、第23条および第24条)

1. 株式への実質投資割合には制限を設けません。
2. 委託会社は、新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
3. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、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。)に上場されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。なお、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができるものとし、
4. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の実質投資割合には制限を設けません。
5. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の実質投資割合が、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。

非株式[株式以外の資産](約款 運用の基本方針 運用方法 (2)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100分の50を超えないものとし、

投資信託証券(約款第21条)

委託会社は、投資信託証券(マザーファンド受益証券を除きます。)への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

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、ならびに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下、会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第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。)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。

外貨建資産(約款 運用の基本方針 運用方法 (3)投資制限)

外貨建資産への投資は行いません。

信用取引(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、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
2. 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、か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書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(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)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の行使、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26条の1の2)

上記 4. および5. の規定にかかわらず、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26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、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。

#### 先物取引等(約款第27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わが国の有価証券にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。(以下同じ。)
2. 委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### スワップ取引(約款第28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、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
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、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. 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。
6. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または担保の受入れの指図を行うものとします。

#### 金利先渡取引(約款第29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、ならびに価格変動リスクを回避するため、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. 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、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信



託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

5. 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
6. 委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または担保の受入れの指図を行うものとします。

#### 有価証券の貸付(約款第30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総額を超えないものとします。
  - b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
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38条)

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用および運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
2. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を上回らない範囲内とします。
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入に対応することにより、株式と株価指数先物取引等の合計の実質組入比率が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リスクをいいます。一般に規模が小さい市場での売買や、取引量の少ない有価証券の売買にあたっては、流動性リスクへの留意が特に必要とされます。また、一般に市場を取り巻く外部環境の急変があった場合には、市場実勢価格での売買ができなくなる可能性が高まります。当ファンドが投資する株式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。

### <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、株価指数先物取引の最低取引単位の存在、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可能性があります。

### <収益分配金に関する留意点>

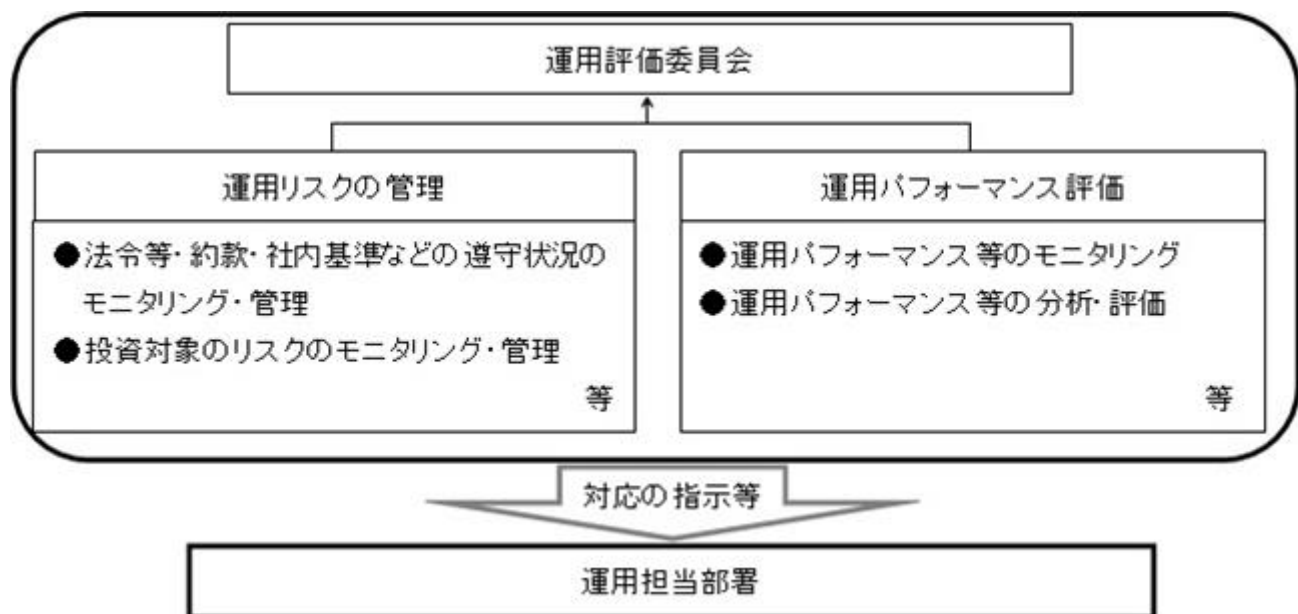
- ・投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

- ・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6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

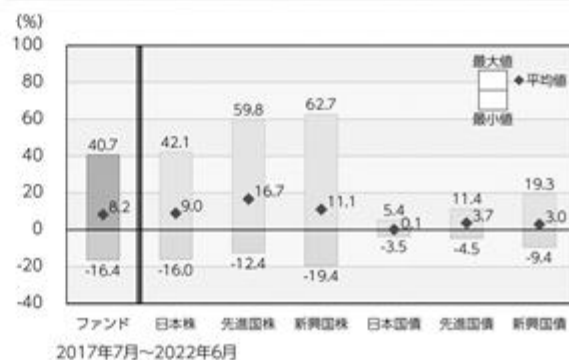
## <参考情報>

### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



- 上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
- すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	[東証株価指数(TOPIX)]は、日本の株式市場を広くに網羅し、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JPMリサーチまたは株式会社JPMリサーチの関連会社(以下「JPM」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JPM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】

申込手数料(受益権1口当たり)は、取得申込日の基準価額に、2.2%(税抜2%)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。

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。

「分配金再投資コース」を選択された場合収益分配金は、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。

販売会社で支払いを受けた償還金をもって、当ファンドの受益権の取得申込みをする場合、販売会社によっては、取得申込口数のうち当該償還金額の範囲内で取得する口数についての申込手数料を、上記に定める申込手数料の規定にかかわらず、販売会社が独自に定めることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、償還乗換えの際に償還金の支払いを受けたことを証する書類を提示いただくことがあります。

## &lt; 申込手数料を対価とする役務の内容 &gt;

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、ファンドの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、純資産総額の残高に応じて次の通りとします。

純資産総額	委託会社	販売会社	受託会社
200億円以下の部分	0.18%	0.35%	0.07%
200億円超500億円以下の部分	0.14%	0.40%	0.06%
500億円超の部分	0.10%	0.45%	0.05%

信託報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の6ヵ月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

## &lt; 信託報酬等を対価とする役務の内容 &gt;

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、信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該費用にかかる消費税等相当額、外国における資産の保管等に要する費用、特定資産の価格調査に要する費用、受託会社の立替えた立替金の利息および資金の借入れを行った際の当該借入金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。なお、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、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するものとします。

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



限ります。)との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座(源泉徴収口座)をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います(確定申告不要)。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

#### 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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6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ついては販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」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6月30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	2,334,136,901	99.98
内 日本	2,334,136,901	99.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	470,747	0.02
純資産総額	2,334,607,648	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6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	385,716,641,130	96.73
内 日本	385,716,641,130	96.73
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	13,043,264,390	3.27
純資産総額	398,759,905,520	100.00

その他資産の投資状況

2022年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	13,037,385,000	3.27
内 日本	13,037,385,000	3.27

（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6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	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	742,787,965	3.2554 2,418,143,370	3.1424 2,334,136,901	- -	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6月30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6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,309,300	2,210.59 16,157,934,865	2,100.00 15,349,530,000	- -	3.85
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	1,004,400	12,375.05 12,429,507,271	11,095.00 11,143,818,000	- -	2.79
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,763,500	3,588.62 6,328,537,515	3,896.00 6,870,596,000	- -	1.72
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	9,256,600	750.55 6,947,601,469	729.40 6,751,764,040	- -	1.69
5	キーエンス 日本	株式 電気機器	145,200	55,522.26 8,061,832,883	46,380.00 6,734,376,000	- -	1.69
6	任天堂 日本	株式 その他製品	90,500	59,001.98 5,339,679,611	58,680.00 5,310,540,000	- -	1.33
7	日立製作所 日本	株式 電気機器	771,200	6,159.54 4,750,241,056	6,438.00 4,964,985,600	- -	1.25
8	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	943,500	5,337.66 5,036,090,996	5,235.00 4,939,222,500	- -	1.24
9	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,147,000	4,018.13 4,608,806,172	4,289.00 4,919,483,000	- -	1.23
10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,260,200	3,565.98 4,493,852,533	3,818.00 4,811,443,600	- -	1.21
11	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	101,700	55,861.16 5,681,080,756	44,300.00 4,505,310,000	- -	1.13
12	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,097,500	5,291.29 5,807,192,966	3,995.00 4,384,512,500	- -	1.10
13	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,035,400	4,158.80 4,306,022,960	4,037.00 4,179,909,800	- -	1.05
14	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,026,200	4,229.03 4,339,830,974	4,032.00 4,137,638,400	- -	1.04
15	第一三共 日本	株式 医薬品	1,163,000	2,668.25 3,103,176,163	3,437.00 3,997,231,000	- -	1.00
16	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,172,200	3,379.54 3,961,505,209	3,293.00 3,860,054,600	- -	0.97
17	信越化学工業 日本	株式 化学	248,900	18,476.20 4,598,727,454	15,300.00 3,808,170,000	- -	0.96

18	ダイキン工業 日本	株式 機械	175,000	22,087.04 3,865,233,118	21,750.00 3,806,250,000	- -	0.95
19	ソフトバンク 日本	株式 情報・通 信業	2,383,100	1,471.52 3,506,790,059	1,506.50 3,590,140,150	- -	0.90
20	HOYA 日本	株式 精密機器	309,500	14,510.69 4,491,060,398	11,585.00 3,585,557,500	- -	0.90
21	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	440,000	7,303.45 3,213,520,882	7,903.00 3,477,320,000	- -	0.87
22	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	946,800	3,787.60 3,586,105,451	3,667.00 3,471,915,600	- -	0.87
23	三井物産 日本	株式 卸売業	1,144,600	3,077.32 3,522,311,601	2,994.50 3,427,504,700	- -	0.86
24	村田製作所 日本	株式 電気機器	437,400	8,183.72 3,579,561,825	7,396.00 3,235,010,400	- -	0.81
25	オリエンタルランド 日本	株式 サービス 業	163,000	20,946.77 3,414,323,899	18,920.00 3,083,960,000	- -	0.77
26	ファナック 日本	株式 電気機器	140,700	21,930.81 3,085,665,683	21,240.00 2,988,468,000	- -	0.75
27	日本電産 日本	株式 電気機器	356,200	9,561.95 3,405,968,368	8,380.00 2,984,956,000	- -	0.75
28	みずほフィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	1,896,000	1,600.84 3,035,196,344	1,543.00 2,925,528,000	- -	0.73
29	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,370,900	2,031.42 2,784,884,637	2,115.00 2,899,453,500	- -	0.73
30	S M C 日本	株式 機械	47,000	64,905.05 3,050,537,801	60,470.00 2,842,090,000	- -	0.71

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2022年6月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	96.73
合計	96.73

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

2022年6月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	16.77
情報・通信業		8.82
輸送用機器		7.81
化学		6.07
卸売業		5.33
医薬品		5.29
銀行業		5.22
機械		5.13
サービス業		5.03
小売業		4.18

食料品	3.33
陸運業	2.97
精密機器	2.54
その他製品	2.44
保険業	2.27
建設業	2.18
不動産業	1.99
電気・ガス業	1.33
その他金融業	1.12
鉄鋼	0.75
証券、商品先物取引業	0.71
非鉄金属	0.70
ガラス・土石製品	0.70
ゴム製品	0.68
海運業	0.60
金属製品	0.58
石油・石炭製品	0.52
繊維製品	0.45
空運業	0.42
鉱業	0.32
パルプ・紙	0.19
倉庫・運輸関連業	0.18
水産・農林業	0.10
合計	96.73

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 【投資不動産物件】

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6月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0409月	買建	697	13,532,830,010	13,037,385,000	3.27

(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6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12計算期間末 (2013年 6月10日)	1,488	1,503	0.8893	0.8983
第13計算期間末 (2014年 6月10日)	1,402	1,415	0.9866	0.9956
第14計算期間末 (2015年 6月10日)	1,425	1,446	1.3059	1.3249
第15計算期間末 (2016年 6月10日)	1,181	1,196	1.0682	1.0817
第16計算期間末 (2017年 6月12日)	1,253	1,275	1.2754	1.2974
第17計算期間末 (2018年 6月11日)	1,486	1,511	1.4292	1.4532
第18計算期間末 (2019年 6月10日)	1,569	1,594	1.2438	1.2638
第19計算期間末 (2020年6月10日)	1,710	1,739	1.3036	1.3256
第20計算期間末 (2021年6月10日)	2,050	2,086	1.5621	1.5901
第21計算期間末 (2022年6月10日)	2,329	2,368	1.5525	1.5785
2021年6月末日	2,092	-	1.5530	-
7月末日	2,067	-	1.5187	-
8月末日	2,163	-	1.5654	-
9月末日	2,298	-	1.6326	-
10月末日	2,276	-	1.6084	-
11月末日	2,156	-	1.5493	-
12月末日	2,237	-	1.6023	-
2022年1月末日	2,163	-	1.5241	-
2月末日	2,167	-	1.5167	-
3月末日	2,326	-	1.5810	-
4月末日	2,306	-	1.5425	-
5月末日	2,325	-	1.5536	-
6月末日	2,334	-	1.4963	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第12計算期間	0.0090
第13計算期間	0.0090
第14計算期間	0.0190
第15計算期間	0.0135
第16計算期間	0.0220
第17計算期間	0.0240
第18計算期間	0.0200
第19計算期間	0.0220
第20計算期間	0.0280
第21計算期間	0.0260

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第12計算期間	54.24
第13計算期間	11.95
第14計算期間	34.29
第15計算期間	17.17
第16計算期間	21.46
第17計算期間	13.94
第18計算期間	11.57
第19計算期間	6.6
第20計算期間	22.0
第21計算期間	1.0

(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12計算期間	404,731,479	585,087,054
第13計算期間	415,192,775	667,030,372
第14計算期間	282,452,469	612,472,406
第15計算期間	275,893,672	261,261,712
第16計算期間	235,331,201	358,383,357
第17計算期間	289,202,857	232,412,332
第18計算期間	421,909,161	199,827,190
第19計算期間	439,743,322	389,648,264
第20計算期間	520,353,240	519,915,581
第21計算期間	535,427,210	347,619,907

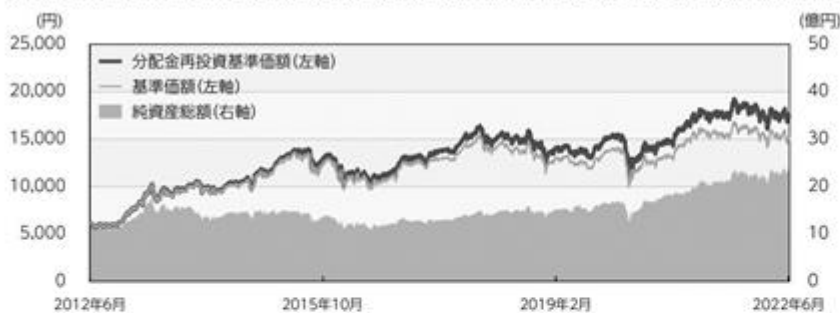
(注) 本邦外における設定及び解約はありません。



## 参考情報

データの基準日:2022年6月30日

## 基準価額・純資産の推移（2012年6月29日～2022年6月30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:2001年6月29日）

## 分配の推移（税引前）

2018年 6月	240円
2019年 6月	200円
2020年 6月	220円
2021年 6月	280円
2022年 6月	260円
設定来累計	2,785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	96.73
内 日本	96.73
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.27
合計(純資産総額)	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	3.27

株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	16.77
2	情報・通信業	8.82
3	輸送用機器	7.81
4	化学	6.07
5	卸売業	5.33

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.85
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.79
3	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.72
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.69
5	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.69
6	任天堂	株式	日本	その他製品	1.33
7	日立製作所	株式	日本	電気機器	1.25
8	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.24
9	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.23
10	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.21

## 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。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

- (1) 当ファンドのお申込みは、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後3時までにお買付けのお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日分のお申込みといたします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については翌営業日のお取扱いとなります。
- (2) 取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。
- (3) お申込みには、収益の分配がなされた場合に分配金を受領する「分配金受取コース」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「分配金再投資コース」の2つの申込方法があります。ただし、販売会社によっては、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け（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す。
- (8) 収益分配金の再投資に関する契約に基づき、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ついては、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) 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、販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け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いて、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3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、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として4営業日目から販売会社において受益者に支払われます。
- (6) 信託財産の資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。
- (7) 委託会社は、証券取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。この場合、受益者が当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとし、前記(4)の規定に準じた価額とします。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
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	<a href="http://www.am-one.co.jp/">http://www.am-one.co.jp/</a>	0120-104-694

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2001年6月29日から無期限とします。

(4)【計算期間】

原則として毎年6月11日から翌年6月10日までとします。なお、第1期計算期間は、2001年6月29日から2002年6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、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、受益権の総口数が10億口を下回ることとなる場合には、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、一定の期間は一カ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.の一定の期間が一カ月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
  - f. 前記1.に定める信託契約の解約を行う場合において、前記b.の期間内に異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。なお、買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社の協議により決定するものとします。
2. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。

3. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、この信託は、「信託約款の変更4.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
4. 受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 信託約款の変更

1. 委託会社は、信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
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ヵ月前までに別段の意思表示のない時は、同一条件にて継続されます。
2. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は「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ません。）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

なお、「分配金再投資コース」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ません。）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21期計算期間(2021年6月11日から2022年6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トピックスファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第20期 2021年6月10日現在	第21期 2022年6月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	7,582,781	13,208,701
親投資信託受益証券	2,049,805,918	2,328,756,850
未収入金	56,842,000	38,749,000
流動資産合計	2,114,230,699	2,380,714,551
資産合計	2,114,230,699	2,380,714,551
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	36,750,262	39,008,233
未払解約金	20,710,363	5,068,029
未払受託者報酬	763,014	862,612
未払委託者報酬	5,777,385	6,531,578
その他未払費用	15,399	17,405
流動負債合計	64,016,423	51,487,857
負債合計	64,016,423	51,487,857
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,312,509,385	1,500,316,688
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	737,704,891	828,910,006
(分配準備積立金)	370,776,427	289,616,695
元本等合計	2,050,214,276	2,329,226,694
純資産合計	2,050,214,276	2,329,226,694
負債純資産合計	2,114,230,699	2,380,714,551

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第20期 自 2020年6月11日 至 2021年6月10日	第21期 自 2021年6月11日 至 2022年6月10日
<b>営業収益</b>		
受取利息	4	14
有価証券売買等損益	393,559,155	45,752,444
その他収益	-	157
<b>営業収益合計</b>	<b>393,559,159</b>	<b>45,752,615</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	1,233	1,034
受託者報酬	1,443,734	1,710,939
委託者報酬	10,931,631	12,954,987
その他費用	29,236	34,518
<b>営業費用合計</b>	<b>12,405,834</b>	<b>14,701,478</b>
営業利益又は営業損失( )	381,153,325	31,051,137
経常利益又は経常損失( )	381,153,325	31,051,137
当期純利益又は当期純損失( )	381,153,325	31,051,137
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( )	62,811,617	9,153,279
期首剰余金又は期首欠損金( )	398,282,853	737,704,891
剰余金増加額又は欠損金減少額	220,086,247	304,680,073
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	220,086,247	304,680,073
剰余金減少額又は欠損金増加額	162,255,655	196,364,583
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	162,255,655	196,364,583
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	36,750,262	39,008,233
期末剰余金又は期末欠損金( )	737,704,891	828,910,006

## (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21期	
	自 2021年6月11日	至 2022年6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20期	第21期
	2021年6月10日現在	2022年6月10日現在
1. 期首元本額	1,312,071,726円	1,312,509,385円
期中追加設定元本額	520,353,240円	535,427,210円
期中一部解約元本額	519,915,581円	347,619,907円
2. 受益権の総数	1,312,509,385口	1,500,316,688口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第20期	第21期
	自 2020年6月11日 至 2021年6月10日	自 2021年6月11日 至 2022年6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(39,290,202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(233,873,756円)、信託約款に規定される収益調整金(964,485,754円)及び分配準備積立金(134,362,731円)より分配対象収益は1,372,012,443円(1万口当たり10,453.35円)であり、うち36,750,262円(1万口当たり280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(38,581,915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(1,237,679,925円)及び分配準備積立金(290,043,013円)より分配対象収益は1,566,304,853円(1万口当たり10,439.82円)であり、うち39,008,233円(1万口当たり260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20期	第21期
	自 2020年6月11日 至 2021年6月10日	自 2021年6月11日 至 2022年6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20期 2021年6月10日現在	第21期 2022年6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	<p>(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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(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。</p>	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。	金融商品の時価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。

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第20期 2021年6月10日現在	第21期 2022年6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	2,098,659	34,866,468
合計	2,098,659	34,866,468

（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20期 2021年6月10日現在	第21期 2022年6月10日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5621円 (15,621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6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	714,517,934	2,328,756,850	
親投資信託受益証券	合計	714,517,934	2,328,756,850	
合計			2,328,756,850	

（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6月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,067,483,406
株式	404,656,708,760
未収配当金	3,461,955,453
差入委託証拠金	470,640,000
流動資産合計	416,656,787,619
資産合計	416,656,787,619
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	135,994,700
前受金	11,740,000
未払金	541,320
未払解約金	412,562,000
流動負債合計	560,838,020
負債合計	560,838,020
純資産の部	
元本等	
元本	127,666,783,778
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	288,429,165,821
元本等合計	416,095,949,599
純資産合計	416,095,949,599
負債純資産合計	416,656,787,619

## 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6月11日 至 2022年6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6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	105,488,606,697円
同期中追加設定元本額	195,286,356,531円
同期中一部解約元本額	173,108,179,450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	2,662,444,662円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	6,966,364,850円
One DC 国内株式インデックスファンド	21,492,125,475円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,771,592,581円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	5,402,887円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	24,588,219円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	105,384,484円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	25,642,293円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	17,567,875円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	13,991,837円
たわらノーロード TOPIX	1,416,766,358円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,195,089,809円
たわらノーロード バランス(堅実型)	43,692,936円
たわらノーロード バランス(標準型)	285,709,858円
たわらノーロード バランス(積極型)	446,891,531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)	3,906,342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)	171,589,391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)	446,510,634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)	300,747,944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)	433,436,925円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	754,178円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	3,238,669円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	46,652,477円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,396,388円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	20,352,219円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,841,229,106円
Oneグローバルバランス	5,187,379円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,067,175,807円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,597,239,327円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,892,007,764円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	345,619,009円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,111,273,894円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,132,392,937円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	32,407,197円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,118,339,989円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	15,484,653円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	309,475,685円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	313,431,637円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	565,734,371円
投資のソムリエ	16,620,188,254円
クルーズコントロール	311,657,542円
投資のソムリエ<DC年金>	1,039,283,845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>	674,580,926円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	855,390,646円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,397,680,692円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	53,587,701円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	27,060,996円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,703,866円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	153,891,245円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	416,621,512円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	600,623,894円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	266,468,092円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	63,115,592円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	27,041,124円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	17,888,524円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	180,839,264円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	3,127,678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)	29,679,768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)	30,490,853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)	18,606,291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)	18,675,839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)	29,361,099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)	62,667,313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)	37,573,737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)	50,428,093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)	61,917,924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)	43,255,595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)	26,379,912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)	43,072,092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)	62,402,647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)2022-05(適格機関投資家限定)	65,607,260円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	430,579,752円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	33,426,816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)	142,026,768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)	50,532,183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)	15,891,052円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	74,011,865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)	51,186,283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)	98,304,831円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,179,661円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	26,439,603円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,475,392円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	660,077円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	6,940,293円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	29,450,520円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	512,602,357円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	601,051,251円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,735,346,298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)	23,645,023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)	26,388,506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)	272,439,991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)	66,895,512円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,031,323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)	321,144,712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)	19,553,361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)	67,822,018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)	156,373,472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)	219,206,598円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	34,075,153円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	16,835,995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>	15,749,909円
コア資産形成ファンド	10,259,810円
MHAMトピックスファンド	714,517,934円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	59,967,759円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	2,146,787,996円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,708,333,342円
計	127,666,783,778円
2. 受益権の総数	127,666,783,778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6月11日 至 2022年6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6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。
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6月10日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	2,915,558,133	
合計	2,915,558,133	

（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6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6月10日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	11,593,600,000	-	11,457,800,000	135,800,000
合計	11,593,600,000	-	11,457,800,000	135,800,000

（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6月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.2592円 (32,592円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2022年6月10日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	7,300	3,350.00	24,455,000	
日本水産	204,900	534.00	109,416,600	

マルハニチロ	30,100	2,339.00	70,403,900
雪国まいたけ	15,600	889.00	13,868,400
カネコ種苗	6,200	1,701.00	10,546,200
サカタのタネ	24,200	4,580.00	110,836,000
ホクト	17,200	1,902.00	32,714,400
ホクリヨウ	3,100	635.00	1,968,500
ショーボンドホールディングス	27,100	6,120.00	165,852,000
ミライト・ホールディングス	69,200	1,625.00	112,450,000
タマホーム	13,100	2,394.00	31,361,400
サンヨーホームズ	2,600	734.00	1,908,400
日本アクア	8,500	601.00	5,108,500
ファーストコーポレーション	5,500	758.00	4,169,000
ベステラ	4,400	1,178.00	5,183,200
Robot Home	35,800	197.00	7,052,600
キャンディル	3,700	543.00	2,009,100
住石ホールディングス	37,600	196.00	7,369,600
日鉄鉱業	4,500	5,750.00	25,875,000
三井松島ホールディングス	9,000	3,020.00	27,180,000
I N P E X	773,800	1,784.00	1,380,459,200
石油資源開発	25,400	3,650.00	92,710,000
K & O エナジーグループ	8,800	1,635.00	14,388,000
ダイセキ環境ソリューション	4,200	994.00	4,174,800
第一カッター興業	5,000	1,320.00	6,600,000
明豊ファシリティワークス	6,900	660.00	4,554,000
安藤・間	101,000	822.00	83,022,000
東急建設	59,400	622.00	36,946,800
コムシスホールディングス	69,300	2,516.00	174,358,800
ビーアールホールディングス	27,900	316.00	8,816,400
高松コンストラクショングループ	13,200	2,059.00	27,178,800
東建コーポレーション	6,000	8,600.00	51,600,000
ソネック	2,300	1,016.00	2,336,800
ヤマウラ	9,800	930.00	9,114,000
オリエンタル白石	72,500	246.00	17,835,000
大成建設	135,000	4,135.00	558,225,000
大林組	473,600	975.00	461,760,000
清水建設	440,000	736.00	323,840,000
飛島建設	13,400	1,009.00	13,520,600
長谷工コーポレーション	138,100	1,592.00	219,855,200
松井建設	17,700	673.00	11,912,100
銭高組	1,600	3,565.00	5,704,000
鹿島建設	347,000	1,451.00	503,497,000
不動テトラ	10,700	1,610.00	17,227,000
大末建設	5,200	1,587.00	8,252,400
鉄建建設	10,400	1,819.00	18,917,600
西松建設	30,000	4,255.00	127,650,000
三井住友建設	112,100	450.00	50,445,000
大豊建設	7,300	4,460.00	32,558,000
佐田建設	11,000	453.00	4,983,000
ナカノフード建設	12,400	314.00	3,893,600
奥村組	26,000	2,950.00	76,700,000

東鉄工業	20,700	2,297.00	47,547,900
イチケン	3,700	1,838.00	6,800,600
富士ピー・エス	6,100	478.00	2,915,800
浅沼組	5,600	5,380.00	30,128,000
戸田建設	196,000	723.00	141,708,000
熊谷組	24,600	2,714.00	66,764,400
北野建設	3,000	2,103.00	6,309,000
植木組	4,300	1,449.00	6,230,700
矢作建設工業	20,600	768.00	15,820,800
ピーエス三菱	16,400	607.00	9,954,800
日本ハウスホールディングス	33,500	401.00	13,433,500
大東建託	51,000	11,410.00	581,910,000
新日本建設	21,100	746.00	15,740,600
東亜道路工業	2,600	5,550.00	14,430,000
日本道路	4,400	6,690.00	29,436,000
東亜建設工業	11,500	2,400.00	27,600,000
日本国土開発	42,000	514.00	21,588,000
若築建設	7,900	2,149.00	16,977,100
東洋建設	55,700	824.00	45,896,800
五洋建設	187,800	651.00	122,257,800
世紀東急工業	24,100	809.00	19,496,900
福田組	5,300	4,515.00	23,929,500
日本ドライケミカル	3,800	1,606.00	6,102,800
住友林業	115,000	2,009.00	231,035,000
日本基礎技術	12,800	604.00	7,731,200
巴コーポレーション	19,600	417.00	8,173,200
大和ハウス工業	415,500	3,137.00	1,303,423,500
ライト工業	28,300	1,782.00	50,430,600
積水ハウス	494,500	2,373.50	1,173,695,750
日特建設	10,400	789.00	8,205,600
北陸電気工事	9,500	769.00	7,305,500
ユアテック	28,500	709.00	20,206,500
日本リーテック	9,700	1,104.00	10,708,800
四電工	5,100	1,740.00	8,874,000
中電工	21,100	2,091.00	44,120,100
関電工	81,000	835.00	67,635,000
きんでん	104,400	1,523.00	159,001,200
東京エネシス	15,400	996.00	15,338,400
トーエネック	5,100	3,365.00	17,161,500
住友電設	12,400	2,489.00	30,863,600
日本電設工業	23,200	1,613.00	37,421,600
エクシオグループ	71,000	2,120.00	150,520,000
新日本空調	11,600	1,885.00	21,866,000
日本工営	9,600	3,300.00	31,680,000
九電工	33,700	2,747.00	92,573,900
三機工業	32,400	1,511.00	48,956,400
日揮ホールディングス	144,700	2,011.00	290,991,700
中外炉工業	4,800	1,754.00	8,419,200
ヤマト	13,000	750.00	9,750,000
太平電業	9,700	2,789.00	27,053,300

高砂熱学工業	40,400	1,621.00	65,488,400
三晃金属工業	1,900	2,633.00	5,002,700
NEC ネットエスアイ	51,500	1,863.00	95,944,500
朝日工業社	6,300	1,621.00	10,212,300
明星工業	26,900	743.00	19,986,700
大気社	21,900	3,185.00	69,751,500
ダイダン	9,800	2,068.00	20,266,400
日比谷総合設備	14,400	1,888.00	27,187,200
ニッポン	41,500	1,555.00	64,532,500
日清製粉グループ本社	159,900	1,497.00	239,370,300
日東富士製粉	1,600	4,380.00	7,008,000
昭和産業	13,400	2,438.00	32,669,200
鳥越製粉	12,500	646.00	8,075,000
中部飼料	17,200	1,016.00	17,475,200
フィード・ワン	19,600	663.00	12,994,800
東洋精糖	1,900	960.00	1,824,000
日本甜菜製糖	8,300	1,649.00	13,686,700
DM三井製糖ホールディングス	13,400	1,871.00	25,071,400
塩水港精糖	19,500	210.00	4,095,000
日新製糖	7,700	1,723.00	13,267,100
LIFULL	46,400	171.00	7,934,400
ミクシィ	34,700	2,187.00	75,888,900
ジェイエイシーリクルートメント	12,300	1,727.00	21,242,100
日本M&Aセンターホールディングス	248,500	1,397.00	347,154,500
メンバーズ	4,200	2,785.00	11,697,000
中広	1,100	386.00	424,600
UTグループ	21,800	2,442.00	53,235,600
アイティメディア	7,100	1,690.00	11,999,000
E・Jホールディングス	8,600	1,152.00	9,907,200
夢真ビーネックスグループ	49,400	1,430.00	70,642,000
コシダカホールディングス	40,400	800.00	32,320,000
アルトナー	3,700	853.00	3,156,100
パソナグループ	16,300	1,982.00	32,306,600
CDS	3,900	1,959.00	7,640,100
リンクアンドモチベーション	33,400	450.00	15,030,000
エス・エム・エス	51,500	2,830.00	145,745,000
サニーサイドアップグループ	5,200	612.00	3,182,400
パーソルホールディングス	151,500	2,406.00	364,509,000
リニカル	8,500	815.00	6,927,500
クックパッド	47,800	222.00	10,611,600
エスクリ	6,600	421.00	2,778,600
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,400	618.00	4,573,200
森永製菓	33,700	3,855.00	129,913,500
中村屋	3,600	3,060.00	11,016,000
江崎グリコ	39,400	3,660.00	144,204,000
名糖産業	6,300	1,619.00	10,199,700
井村屋グループ	8,100	2,299.00	18,621,900
不二家	8,800	2,317.00	20,389,600
山崎製パン	104,900	1,483.00	155,566,700
第一屋製パン	3,600	514.00	1,850,400

モロゾフ	4,900	3,395.00	16,635,500
亀田製菓	8,400	4,335.00	36,414,000
寿スピリッツ	14,300	7,520.00	107,536,000
カルビー	72,500	2,413.00	174,942,500
森永乳業	27,800	4,415.00	122,737,000
六甲バター	11,000	1,406.00	15,466,000
ヤクルト本社	106,800	7,420.00	792,456,000
明治ホールディングス	92,600	6,230.00	576,898,000
雪印メグミルク	35,900	1,711.00	61,424,900
プリマハム	19,900	2,115.00	42,088,500
日本ハム	57,600	4,020.00	231,552,000
林兼産業	4,000	493.00	1,972,000
丸大食品	14,800	1,483.00	21,948,400
S Foods	14,300	3,025.00	43,257,500
柿安本店	5,600	2,432.00	13,619,200
伊藤ハム米久ホールディングス	102,400	661.00	67,686,400
学情	6,200	975.00	6,045,000
スタジオアリス	6,700	2,274.00	15,235,800
クロスキャット	8,100	1,034.00	8,375,400
シミックホールディングス	7,700	1,455.00	11,203,500
エプコ	3,200	761.00	2,435,200
システナ	222,100	443.00	98,390,300
NJS	3,000	2,036.00	6,108,000
デジタルアーツ	8,200	6,340.00	51,988,000
日鉄ソリューションズ	25,600	3,695.00	94,592,000
総合警備保障	56,900	3,505.00	199,434,500
キューブシステム	7,900	925.00	7,307,500
いちご	174,200	302.00	52,608,400
WOW WORLD	2,100	1,112.00	2,335,200
日本駐車場開発	160,000	171.00	27,360,000
コア	6,600	1,449.00	9,563,400
カカクコム	111,100	2,330.00	258,863,000
アイロムグループ	5,500	1,894.00	10,417,000
セントケア・ホールディング	9,800	844.00	8,271,200
サイネックス	2,500	595.00	1,487,500
ルネサンス	10,600	956.00	10,133,600
ディップ	26,700	3,710.00	99,057,000
SBSホールディングス	11,700	2,912.00	34,070,400
デジタルホールディングス	10,700	1,316.00	14,081,200
新日本科学	18,400	1,929.00	35,493,600
キャリアデザインセンター	3,500	1,112.00	3,892,000
ベネフィット・ワン	55,000	1,856.00	102,080,000
エムスリー	267,400	3,908.00	1,044,999,200
ツカダ・グローバルホールディング	9,400	363.00	3,412,200
プラス	1,900	910.00	1,729,000
アウトソーシング	86,800	1,124.00	97,563,200
ウェルネット	14,000	510.00	7,140,000
ワールドホールディングス	6,100	2,383.00	14,536,300
ディー・エヌ・エー	57,800	1,849.00	106,872,200
博報堂DYホールディングス	198,300	1,282.00	254,220,600

ぐるなび	22,800	430.00	9,804,000
タカミヤ	18,700	382.00	7,143,400
ジャパンベストレスキューシステム	9,100	785.00	7,143,500
ファンコミュニケーションズ	35,500	401.00	14,235,500
ライク	5,000	2,128.00	10,640,000
ビジネス・ブレイクスルー	5,800	442.00	2,563,600
エスプール	42,800	1,229.00	52,601,200
WDBホールディングス	6,900	2,304.00	15,897,600
手間いらず	2,200	5,370.00	11,814,000
ティア	9,200	444.00	4,084,800
CDG	1,500	1,282.00	1,923,000
アドウェイズ	22,600	719.00	16,249,400
バリューコマース	11,800	3,260.00	38,468,000
インフォマート	166,100	456.00	75,741,600
サッポロホールディングス	49,100	2,843.00	139,591,300
アサヒグループホールディングス	341,300	4,431.00	1,512,300,300
麒麟ホールディングス	584,900	2,078.50	1,215,714,650
宝ホールディングス	94,900	968.00	91,863,200
オエノンホールディングス	43,300	296.00	12,816,800
養命酒製造	4,700	1,748.00	8,215,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	104,900	1,466.00	153,783,400
サントリー食品インターナショナル	106,500	4,850.00	516,525,000
ダイドーグループホールディングス	8,100	4,990.00	40,419,000
伊藤園	48,200	5,310.00	255,942,000
キーコーヒー	14,800	2,075.00	30,710,000
ユニカフェ	5,000	918.00	4,590,000
ジャパンフーズ	1,600	1,160.00	1,856,000
日清オイリオグループ	18,900	2,986.00	56,435,400
不二製油グループ本社	34,400	1,827.00	62,848,800
かどや製油	1,500	3,450.00	5,175,000
J-オイルミルズ	14,800	1,511.00	22,362,800
ローソン	34,600	4,290.00	148,434,000
サンエー	11,100	4,000.00	44,400,000
カワチ薬品	12,100	2,061.00	24,938,100
エービーシー・マート	24,400	5,830.00	142,252,000
ハードオフコーポレーション	7,000	886.00	6,202,000
高千穂交易	5,900	1,870.00	11,033,000
アスクル	35,300	1,502.00	53,020,600
ゲオホールディングス	19,400	1,246.00	24,172,400
アダストリア	16,900	2,162.00	36,537,800
ジーフット	9,900	341.00	3,375,900
シー・ヴィ・エス・バイエリア	2,500	397.00	992,500
オルパヘルスケアホールディングス	1,600	1,795.00	2,872,000
伊藤忠食品	3,500	4,730.00	16,555,000
くら寿司	16,200	3,070.00	49,734,000
キャンドウ	5,900	2,220.00	13,098,000
エレマテック	12,500	1,330.00	16,625,000
アイケイ	4,800	534.00	2,563,200
パルグループホールディングス	13,700	1,765.00	24,180,500



エディオン	71,800	1,178.00	84,580,400
あらた	11,800	3,960.00	46,728,000
サーラコーポレーション	31,800	640.00	20,352,000
ワッツ	7,600	733.00	5,570,800
トーメンデバイス	2,300	5,990.00	13,777,000
ハローズ	7,100	3,240.00	23,004,000
J Pホールディングス	38,900	226.00	8,791,400
フジオフードグループ本社	12,200	1,370.00	16,714,000
あみやき亭	3,800	2,920.00	11,096,000
東京エレクトロン デバイス	4,700	5,710.00	26,837,000
ひらまつ	33,200	203.00	6,739,600
フィールズ	13,700	1,045.00	14,316,500
双日	164,300	2,146.00	352,587,800
アルフレッサ ホールディングス	166,000	1,666.00	276,556,000
大黒天物産	5,000	4,385.00	21,925,000
ハニーズホールディングス	12,900	1,172.00	15,118,800
ファーマライズホールディングス	3,900	719.00	2,804,100
キッコーマン	101,800	6,870.00	699,366,000
味の素	326,100	2,993.50	976,180,350
ブルドックソース	6,100	1,839.00	11,217,900
キュービー	74,300	2,141.00	159,076,300
ハウス食品グループ本社	53,000	2,720.00	144,160,000
カゴメ	60,400	3,275.00	197,810,000
焼津水産化学工業	7,000	915.00	6,405,000
アリアケジャパン	14,500	5,330.00	77,285,000
ピエトロ	2,100	1,800.00	3,780,000
エバラ食品工業	3,600	2,987.00	10,753,200
やまみ	1,300	1,636.00	2,126,800
ニチレイ	63,800	2,262.00	144,315,600
横浜冷凍	40,000	845.00	33,800,000
東洋水産	72,700	4,760.00	346,052,000
イトアンドホールディングス	6,100	2,285.00	13,938,500
大冷	1,900	1,900.00	3,610,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,200	542.00	4,444,400
日清食品ホールディングス	54,700	8,320.00	455,104,000
永谷園ホールディングス	7,100	1,988.00	14,114,800
一正蒲鉾	6,600	834.00	5,504,400
フジッコ	14,700	1,917.00	28,179,900
ロック・フィールド	16,200	1,391.00	22,534,200
日本たばこ産業	853,400	2,383.00	2,033,652,200
ケンコーマヨネーズ	8,300	1,394.00	11,570,200
わらべや日洋ホールディングス	9,700	1,727.00	16,751,900
なとり	9,000	1,978.00	17,802,000
イフジ産業	2,900	986.00	2,859,400
ピククルスコーポレーション	7,600	1,313.00	9,978,800
ファーマフーズ	20,000	1,612.00	32,240,000
北の達人コーポレーション	55,400	221.00	12,243,400
ユーグレナ	81,800	922.00	75,419,600
紀文食品	12,400	958.00	11,879,200
スター・マイカ・ホールディングス	8,400	1,593.00	13,381,200

S R Eホールディングス	4,000	2,179.00	8,716,000
A Dワークスグループ	29,900	154.00	4,604,600
片倉工業	14,900	2,136.00	31,826,400
グンゼ	9,300	3,725.00	34,642,500
ヒューリック	351,200	1,098.00	385,617,600
神栄	2,200	934.00	2,054,800
ラサ商事	7,500	972.00	7,290,000
アルペン	11,600	1,965.00	22,794,000
ハブ	5,000	615.00	3,075,000
ラクーンホールディングス	13,200	1,375.00	18,150,000
クオールホールディングス	19,100	1,333.00	25,460,300
アルコニックス	19,600	1,340.00	26,264,000
神戸物産	112,300	3,180.00	357,114,000
ソリトンシステムズ	7,800	1,276.00	9,952,800
ジンズホールディングス	9,100	4,190.00	38,129,000
ビックカメラ	92,800	1,110.00	103,008,000
D C Mホールディングス	92,800	1,030.00	95,584,000
ペッパーフードサービス	21,200	410.00	8,692,000
ハイパー	2,500	470.00	1,175,000
M o n o t a R O	197,400	2,026.00	399,932,400
東京一番フーズ	4,000	591.00	2,364,000
D Dホールディングス	8,100	654.00	5,297,400
あいホールディングス	22,200	1,634.00	36,274,800
ディーブイエックス	5,300	1,076.00	5,702,800
きちりホールディングス	4,300	420.00	1,806,000
アークランドサービスホールディングス	11,400	2,128.00	24,259,200
J . フロントリテイリング	177,500	1,159.00	205,722,500
ドトール・日レスホールディングス	25,500	1,530.00	39,015,000
マツキヨココカラ&カンパニー	93,100	5,090.00	473,879,000
ブロンコビリー	8,300	2,448.00	20,318,400
Z O Z O	107,400	2,527.00	271,399,800
トレジャー・ファクトリー	4,600	1,129.00	5,193,400
物語コーポレーション	7,700	6,010.00	46,277,000
三越伊勢丹ホールディングス	247,400	1,146.00	283,520,400
東洋紡	61,300	1,052.00	64,487,600
ユニチカ	42,500	239.00	10,157,500
富士紡ホールディングス	6,600	3,380.00	22,308,000
日清紡ホールディングス	91,600	1,108.00	101,492,800
倉敷紡績	11,900	2,042.00	24,299,800
ダイワボウホールディングス	69,400	1,750.00	121,450,000
シキボウ	8,200	895.00	7,339,000
日東紡績	21,000	2,598.00	54,558,000
トヨタ紡織	58,600	2,184.00	127,982,400
マクニカ・富士エレホールディングス	37,300	2,953.00	110,146,900
H a m e e	5,600	1,209.00	6,770,400
マーケットエンタープライズ	1,500	1,087.00	1,630,500
ラクト・ジャパン	5,300	2,055.00	10,891,500
ウエルシアホールディングス	82,600	2,514.00	207,656,400
クリエイトSDホールディングス	22,900	2,821.00	64,600,900

グリムス	6,900	1,504.00	10,377,600	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25,800	692.00	17,853,600	
八洲電機	11,400	975.00	11,115,000	
メディアスホールディングス	9,000	1,010.00	9,090,000	
レスターホールディングス	14,800	2,014.00	29,807,200	
ジューテックホールディングス	3,200	1,009.00	3,228,800	
丸善CHIホールディングス	18,900	386.00	7,295,400	
大光	6,800	718.00	4,882,400	
OCHIホールディングス	4,000	1,251.00	5,004,000	
TOKAIホールディングス	75,600	865.00	65,394,000	
黒谷	4,400	601.00	2,644,400	
ミサワ	3,100	639.00	1,980,900	
ティーライフ	2,000	1,391.00	2,782,000	
Cominix	3,000	724.00	2,172,000	
エー・ピーホールディングス	2,300	452.00	1,039,600	
三洋貿易	14,700	977.00	14,361,900	
チムニー	4,800	1,212.00	5,817,600	
シュッピン	13,000	1,494.00	19,422,000	
ビューティガレージ	2,500	2,596.00	6,490,000	
オイシックス・ラ・大地	22,400	1,815.00	40,656,000	
ウイン・パートナーズ	11,400	1,010.00	11,514,000	
ネクステージ	31,800	2,252.00	71,613,600	
ジョイフル本田	46,900	1,606.00	75,321,400	
鳥貴族ホールディングス	5,300	2,055.00	10,891,500	
ホットランド	11,700	1,338.00	15,654,600	
すかいらくホールディングス	194,100	1,607.00	311,918,700	
SFPホールディングス	7,600	1,570.00	11,932,000	
綿半ホールディングス	11,200	1,321.00	14,795,200	
日本毛織	41,100	960.00	39,456,000	
ダイトウボウ	24,800	92.00	2,281,600	
トーア紡コーポレーション	4,400	376.00	1,654,400	
ダイドーリミテッド	21,300	137.00	2,918,100	
ヨシックスホールディングス	3,000	2,353.00	7,059,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	45,500	1,047.00	47,638,500	
三栄建築設計	6,300	1,647.00	10,376,100	
野村不動産ホールディングス	80,900	3,375.00	273,037,500	
三重交通グループホールディングス	32,000	501.00	16,032,000	
サムティ	23,800	2,020.00	48,076,000	
ディア・ライフ	19,500	549.00	10,705,500	
コーセーアールイー	4,600	627.00	2,884,200	
地主	9,800	2,024.00	19,835,200	
プレサンスコーポレーション	18,200	1,526.00	27,773,200	
フィル・カンパニー	2,600	1,217.00	3,164,200	
THEグローバル社	8,100	151.00	1,223,100	
ハウスコム	1,100	1,026.00	1,128,600	
JPMC	7,600	1,032.00	7,843,200	
サンセイランディック	4,800	872.00	4,185,600	
エストラスト	1,500	552.00	828,000	

フージャースホールディングス	20,000	827.00	16,540,000	
オープンハウスグループ	49,700	5,410.00	268,877,000	
東急不動産ホールディングス	437,100	696.00	304,221,600	
飯田グループホールディングス	130,300	2,017.00	262,815,100	
イーランド	2,200	1,509.00	3,319,800	
ムゲンエステート	9,900	495.00	4,900,500	
帝国繊維	16,500	1,607.00	26,515,500	
日本コークス工業	134,000	131.00	17,554,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,000	1,463.00	11,704,000	
ミタチ産業	3,900	931.00	3,630,900	
B E E N O S	7,800	2,133.00	16,637,400	
あさひ	13,000	1,302.00	16,926,000	
日本調剤	9,400	1,297.00	12,191,800	
コスモス薬品	15,700	11,770.00	184,789,000	
シップヘルスケアホールディングス	46,700	2,388.00	111,519,600	
トーエル	7,100	878.00	6,233,800	
ソフトクリエイトホールディングス	6,800	4,035.00	27,438,000	
セブン&アイ・ホールディングス	552,800	5,545.00	3,065,276,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	97,600	966.00	94,281,600	
明治電機工業	4,900	1,107.00	5,424,300	
ツルハホールディングス	34,000	6,710.00	228,140,000	
デリカフーズホールディングス	6,300	526.00	3,313,800	
スターティアホールディングス	3,600	790.00	2,844,000	
サンマルクホールディングス	12,400	1,556.00	19,294,400	
フェリシモ	3,600	1,172.00	4,219,200	
トリドールホールディングス	38,900	2,285.00	88,886,500	
帝人	139,700	1,376.00	192,227,200	
東レ	1,017,500	727.30	740,027,750	
クラレ	215,500	1,150.00	247,825,000	
旭化成	983,700	1,088.00	1,070,265,600	
T O K Y O B A S E	14,200	347.00	4,927,400	
稲葉製作所	8,200	1,321.00	10,832,200	
宮地エンジニアリンググループ	4,600	3,395.00	15,617,000	
トーカロ	40,400	1,350.00	54,540,000	
アルファ	5,900	998.00	5,888,200	
S U M C O	252,800	2,093.00	529,110,400	
川田テクノロジーズ	3,000	3,505.00	10,515,000	
R S T e c h n o l o g i e s	5,100	6,290.00	32,079,000	
ジェイテックコーポレーション	2,000	2,257.00	4,514,000	
信和	9,700	787.00	7,633,900	
ビーロット	10,900	505.00	5,504,500	
ファーストブラザーズ	3,800	854.00	3,245,200	
A n d D o ホールディングス	7,700	904.00	6,960,800	
シーアールイー	5,300	1,595.00	8,453,500	
プロパティエージェント	1,800	1,537.00	2,766,600	
ケイアイスター不動産	7,000	4,775.00	33,425,000	
アグレ都市デザイン	2,600	1,545.00	4,017,000	
グッドコムアセット	6,700	1,184.00	7,932,800	
ジェイ・エス・ビー	3,100	3,390.00	10,509,000	

ロードスターキャピタル	4,000	1,509.00	6,036,000	
テンポイノベーション	4,500	850.00	3,825,000	
グローバル・リンク・マネジメント	2,700	938.00	2,532,600	
フェイスネットワーク	2,000	1,363.00	2,726,000	
住江織物	2,800	1,719.00	4,813,200	
日本フェルト	9,100	421.00	3,831,100	
イチカワ	1,500	1,383.00	2,074,500	
エコナックホールディングス	26,800	92.00	2,465,600	
日東製網	1,600	1,369.00	2,190,400	
芦森工業	3,000	1,024.00	3,072,000	
アツギ	11,500	534.00	6,141,000	
ウイルプラスホールディングス	2,900	921.00	2,670,900	
J Mホールディングス	11,400	1,512.00	17,236,800	
コメダホールディングス	34,000	2,300.00	78,200,000	
サツドラホールディングス	7,100	657.00	4,664,700	
アレンザホールディングス	11,000	1,007.00	11,077,000	
串カツ田中ホールディングス	4,300	1,873.00	8,053,900	
パロックジャパンリミテッド	11,000	817.00	8,987,000	
クスリのアオキホールディングス	14,400	5,420.00	78,048,000	
ダイニック	4,000	685.00	2,740,000	
共和レザー	9,100	596.00	5,423,600	
ピーバンドットコム	2,100	548.00	1,150,800	
力の源ホールディングス	8,000	715.00	5,720,000	
FOOD & LIFE COMPANIES	83,700	3,080.00	257,796,000	
アセンテック	5,300	730.00	3,869,000	
セーレン	29,600	2,003.00	59,288,800	
ソトー	5,900	830.00	4,897,000	
東海染工	1,500	1,138.00	1,707,000	
小松マテーレ	24,200	1,317.00	31,871,400	
ワコールホールディングス	34,400	2,142.00	73,684,800	
ホギメディカル	19,900	2,955.00	58,804,500	
クラウドシアホールディングス	2,500	242.00	605,000	
T S Iホールディングス	48,500	373.00	18,090,500	
マツオカコーポレーション	4,700	1,004.00	4,718,800	
ワールド	20,400	1,375.00	28,050,000	
T I S	140,100	3,405.00	477,040,500	
J N Sホールディングス	7,000	462.00	3,234,000	
グリー	70,800	898.00	63,578,400	
G M Oペパボ	1,500	2,097.00	3,145,500	
コーエーテックモホールディングス	49,600	4,565.00	226,424,000	
三菱総合研究所	7,300	4,200.00	30,660,000	
ボルテージ	4,200	354.00	1,486,800	
電算	900	2,268.00	2,041,200	
A G S	6,900	753.00	5,195,700	
ファインデックス	13,200	634.00	8,368,800	
ブレインパッド	13,200	1,187.00	15,668,400	
K L a b	27,300	505.00	13,786,500	
ポルトゥウィンホールディングス	22,500	1,080.00	24,300,000	
ネクソン	353,600	3,260.00	1,152,736,000	

アイスタイル	40,000	245.00	9,800,000
エムアップホールディングス	18,000	1,250.00	22,500,000
エイチーム	10,000	720.00	7,200,000
エニグモ	16,900	549.00	9,278,100
テクノスジャパン	12,100	504.00	6,098,400
e n i s h	10,700	335.00	3,584,500
コロプラ	51,200	639.00	32,716,800
オルトプラス	11,500	414.00	4,761,000
ブロードリーフ	77,000	425.00	32,725,000
クロス・マーケティンググループ	6,000	864.00	5,184,000
デジタルハーツホールディングス	7,000	1,723.00	12,061,000
システム情報	11,700	1,019.00	11,922,300
メディアドゥ	5,500	1,878.00	10,329,000
じげん	43,800	355.00	15,549,000
バイキューブ	15,700	1,042.00	16,359,400
エンカレッジ・テクノロジー	3,600	525.00	1,890,000
サイバーリンクス	5,200	1,121.00	5,829,200
ディー・エル・イー	10,400	365.00	3,796,000
フィックスターズ	15,400	950.00	14,630,000
CARTA HOLDINGS	6,400	1,923.00	12,307,200
オブティム	10,900	852.00	9,286,800
セレス	5,900	1,384.00	8,165,600
S H I F T	9,100	19,260.00	175,266,000
特種東海製紙	8,400	3,125.00	26,250,000
ティーガイア	13,900	1,623.00	22,559,700
セック	2,200	2,520.00	5,544,000
テクマトリックス	26,300	1,698.00	44,657,400
プロシップ	5,200	1,454.00	7,560,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	40,300	2,464.00	99,299,200
GMOペイメントゲートウェイ	30,000	10,320.00	309,600,000
ザッパラス	5,800	407.00	2,360,600
システムリサーチ	4,600	2,025.00	9,315,000
インターネットイニシアティブ	41,500	4,710.00	195,465,000
さくらインターネット	16,600	572.00	9,495,200
ヴィンクス	4,500	1,105.00	4,972,500
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,500	5,950.00	20,825,000
S R Aホールディングス	7,600	2,865.00	21,774,000
システムインテグレータ	5,000	499.00	2,495,000
朝日ネット	14,300	602.00	8,608,600
e B A S E	18,700	552.00	10,322,400
アバント	16,600	1,354.00	22,476,400
アドソル日進	5,600	1,549.00	8,674,400
ODKソリューションズ	3,500	570.00	1,995,000
フリービット	8,000	922.00	7,376,000
コムチュア	17,600	2,787.00	49,051,200
サイバーコム	2,300	1,151.00	2,647,300
アステリア	11,200	1,101.00	12,331,200
アイル	7,800	1,549.00	12,082,200

王子ホールディングス	616,000	562.00	346,192,000
日本製紙	66,800	954.00	63,727,200
三菱製紙	20,900	306.00	6,395,400
北越コーポレーション	95,800	665.00	63,707,000
中越パルプ工業	6,100	917.00	5,593,700
巴川製紙所	4,600	631.00	2,902,600
大王製紙	69,300	1,439.00	99,722,700
阿波製紙	4,200	319.00	1,339,800
マークライズ	7,800	2,257.00	17,604,600
メディカル・データ・ビジョン	19,600	1,019.00	19,972,400
gumi	21,400	571.00	12,219,400
ショーケース	3,500	461.00	1,613,500
モバイルファクトリー	3,600	1,161.00	4,179,600
テラスカイ	5,800	1,474.00	8,549,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	6,800	1,430.00	9,724,000
PCIホールディングス	6,400	1,025.00	6,560,000
パイプドHD	2,800	2,810.00	7,868,000
アイビーシー	2,300	492.00	1,131,600
ネオジャパン	4,500	1,250.00	5,625,000
PR TIMES	3,200	2,092.00	6,694,400
ラクス	71,500	1,582.00	113,113,000
ランドコンピュータ	3,700	907.00	3,355,900
ダブルスタンダード	4,700	1,944.00	9,136,800
オープンドア	9,200	1,939.00	17,838,800
マイネット	5,500	525.00	2,887,500
アカツキ	6,900	2,916.00	20,120,400
ベネフィットジャパン	900	1,985.00	1,786,500
Ubicomホールディングス	4,200	2,525.00	10,605,000
カナミックネットワーク	18,200	525.00	9,555,000
ノムラシステムコーポレーション	8,100	228.00	1,846,800
レンゴー	128,700	706.00	90,862,200
トーモク	8,200	1,540.00	12,628,000
ザ・バック	10,600	2,244.00	23,786,400
チェンジ	31,200	1,906.00	59,467,200
シンクロ・フード	7,700	350.00	2,695,000
オークネット	8,200	1,862.00	15,268,400
キャピタル・アセット・プランニング	2,900	694.00	2,012,600
セグエグループ	4,000	560.00	2,240,000
エイトレッド	2,200	2,058.00	4,527,600
マクロミル	31,400	976.00	30,646,400
ビーグリー	3,700	1,411.00	5,220,700
オロ	4,800	1,797.00	8,625,600
ユーザーローカル	4,800	1,674.00	8,035,200
テモナ	2,900	385.00	1,116,500
ニーズウェル	4,400	678.00	2,983,200
マネーフォワード	31,800	3,420.00	108,756,000
サインポスト	5,000	883.00	4,415,000
昭和電工	135,900	2,643.00	359,183,700
住友化学	1,086,700	565.00	613,985,500

住友精化	6,500	3,005.00	19,532,500
日産化学	75,100	7,520.00	564,752,000
ラサ工業	5,500	2,074.00	11,407,000
クレハ	11,600	10,730.00	124,468,000
多木化学	5,500	4,810.00	26,455,000
テイカ	9,600	1,306.00	12,537,600
石原産業	27,100	1,199.00	32,492,900
片倉コープアグリ	3,700	1,428.00	5,283,600
日本曹達	18,000	4,365.00	78,570,000
東ソー	202,700	1,795.00	363,846,500
トクヤマ	47,300	1,811.00	85,660,300
セントラル硝子	24,100	3,035.00	73,143,500
東亜合成	78,200	1,056.00	82,579,200
大阪ソーダ	12,800	3,070.00	39,296,000
関東電化工業	30,100	925.00	27,842,500
デンカ	53,800	3,315.00	178,347,000
イビデン	78,700	4,435.00	349,034,500
信越化学工業	253,000	18,115.00	4,583,095,000
日本カーバイド工業	5,600	1,445.00	8,092,000
電算システムホールディングス	6,400	2,416.00	15,462,400
堺化学工業	10,400	1,964.00	20,425,600
第一稀元素化学工業	13,700	1,158.00	15,864,600
エア・ウォーター	132,000	1,724.00	227,568,000
日本酸素ホールディングス	135,000	2,458.00	331,830,000
日本化学工業	4,600	2,112.00	9,715,200
東邦アセチレン	3,100	1,168.00	3,620,800
日本パーカライジング	69,400	920.00	63,848,000
高圧ガス工業	22,700	665.00	15,095,500
チタン工業	1,600	1,721.00	2,753,600
四国化成工業	18,800	1,289.00	24,233,200
戸田工業	3,200	2,703.00	8,649,600
ステラ ケミファ	7,700	2,567.00	19,765,900
保土谷化学工業	4,500	3,885.00	17,482,500
日本触媒	23,400	5,550.00	129,870,000
大日精化工業	11,600	1,850.00	21,460,000
カネカ	35,600	3,415.00	121,574,000
協和キリン	168,400	2,940.00	495,096,000
三菱瓦斯化学	129,600	2,173.00	281,620,800
三井化学	127,600	3,220.00	410,872,000
J S R	144,700	4,160.00	601,952,000
東京応化工業	23,900	7,470.00	178,533,000
大阪有機化学工業	11,700	2,603.00	30,455,100
三菱ケミカルホールディングス	988,900	786.90	778,165,410
K Hネオケム	24,400	2,610.00	63,684,000
ダイセル	213,700	903.00	192,971,100
住友ベークライト	22,700	4,675.00	106,122,500
積水化学工業	309,500	1,835.00	567,932,500
日本ゼオン	124,600	1,395.00	173,817,000
アイカ工業	38,800	2,805.00	108,834,000
U B E	73,200	2,097.00	153,500,400



積水樹脂	22,000	1,699.00	37,378,000
タキロンシーアイ	33,600	536.00	18,009,600
旭有機材	8,600	2,230.00	19,178,000
ニチバン	8,500	1,611.00	13,693,500
リケンテクノス	33,700	442.00	14,895,400
大倉工業	7,100	1,757.00	12,474,700
積水化成成品工業	19,300	412.00	7,951,600
群栄化学工業	3,200	2,805.00	8,976,000
タイガースポリマー	8,000	437.00	3,496,000
ミライアル	5,000	2,216.00	11,080,000
ダイキアクシス	6,200	762.00	4,724,400
ダイキョーニシカワ	32,900	515.00	16,943,500
竹本容器	5,600	820.00	4,592,000
森六ホールディングス	7,800	1,839.00	14,344,200
恵和	4,300	4,350.00	18,705,000
日本化薬	112,000	1,140.00	127,680,000
カーリットホールディングス	13,800	736.00	10,156,800
ソルクシーズ	13,100	381.00	4,991,100
CLホールディングス	3,100	1,010.00	3,131,000
プレステージ・インターナショナル	56,700	668.00	37,875,600
フェイス	4,300	666.00	2,863,800
プロトコーポレーション	16,400	989.00	16,219,600
ハイマックス	4,300	1,286.00	5,529,800
アミューズ	8,200	2,079.00	17,047,800
野村総合研究所	280,700	3,680.00	1,032,976,000
ドリームインキュベータ	4,500	2,311.00	10,399,500
サイバネットシステム	11,200	766.00	8,579,200
クイック	9,700	1,437.00	13,938,900
TAC	8,300	227.00	1,884,100
CEホールディングス	7,800	441.00	3,439,800
日本システム技術	2,800	2,586.00	7,240,800
電通グループ	146,800	4,375.00	642,250,000
インテージホールディングス	18,000	1,462.00	26,316,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	7,000	1,555.00	10,885,000
東邦システムサイエンス	4,300	940.00	4,042,000
ぴあ	4,800	3,575.00	17,160,000
イオンファンタジー	5,900	2,638.00	15,564,200
ソースネクスト	67,100	272.00	18,251,200
シーティーエス	17,300	853.00	14,756,900
ネクシーズグループ	4,900	553.00	2,709,700
インフォコム	17,200	2,181.00	37,513,200
メディカルシステムネットワーク	14,100	433.00	6,105,300
日本精化	10,900	2,000.00	21,800,000
扶桑化学工業	12,900	3,880.00	50,052,000
トリケミカル研究所	15,900	2,579.00	41,006,100
シンプレクス・ホールディングス	24,700	1,910.00	47,177,000
HEROZ	4,500	974.00	4,383,000
ラクスル	18,100	2,225.00	40,272,500
IPS	4,400	2,416.00	10,630,400
FIG	16,600	313.00	5,195,800

システムサポート	5,800	1,180.00	6,844,000
A D E K A	64,700	2,575.00	166,602,500
日油	47,600	5,130.00	244,188,000
ミヨシ油脂	6,100	1,044.00	6,368,400
新日本理化	23,200	257.00	5,962,400
ハリマ化成グループ	11,000	768.00	8,448,000
イーソル	9,500	591.00	5,614,500
アルテリア・ネットワークス	16,400	1,264.00	20,729,600
東海ソフト	2,300	997.00	2,293,100
ウイングアーク1st	11,800	1,455.00	17,169,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,600	1,583.00	5,698,800
サーバーワークス	2,600	2,168.00	5,636,800
東名	1,200	1,196.00	1,435,200
ヴィッツ	1,400	1,186.00	1,660,400
トピラシステムズ	3,100	782.00	2,424,200
S a n s a n	51,300	1,012.00	51,915,600
L i n k - U	2,700	674.00	1,819,800
ギフトィ	13,200	1,230.00	16,236,000
花王	335,200	5,265.00	1,764,828,000
第一工業製薬	5,500	2,233.00	12,281,500
石原ケミカル	7,500	1,325.00	9,937,500
日華化学	5,300	891.00	4,722,300
ニイタカ	3,000	2,207.00	6,621,000
三洋化成工業	9,300	4,765.00	44,314,500
ベース	2,600	5,830.00	15,158,000
J M D C	19,400	5,160.00	100,104,000
武田薬品工業	1,246,400	3,632.00	4,526,924,800
アステラス製薬	1,355,800	2,077.50	2,816,674,500
住友ファーマ	98,000	1,084.00	106,232,000
塩野義製薬	189,100	7,002.00	1,324,078,200
わかもと製薬	16,500	267.00	4,405,500
日本新薬	36,800	7,600.00	279,680,000
中外製薬	496,000	3,608.00	1,789,568,000
科研製薬	23,400	3,725.00	87,165,000
エーザイ	180,100	5,395.00	971,639,500
理研ビタミン	14,500	1,595.00	23,127,500
ロート製薬	77,400	3,340.00	258,516,000
小野薬品工業	322,800	3,331.00	1,075,246,800
久光製薬	36,300	3,340.00	121,242,000
有機合成薬品工業	11,100	282.00	3,130,200
持田製薬	18,600	3,145.00	58,497,000
参天製薬	282,700	1,008.00	284,961,600
扶桑薬品工業	5,300	2,127.00	11,273,100
日本ケミファ	1,100	1,910.00	2,101,000
ツムラ	46,600	2,886.00	134,487,600
日医工	47,100	372.00	17,521,200
テルモ	448,600	4,110.00	1,843,746,000
H . U . グループホールディングス	39,600	2,712.00	107,395,200
キッセイ薬品工業	24,700	2,460.00	60,762,000

生化学工業	28,100	817.00	22,957,700
栄研化学	25,100	1,620.00	40,662,000
日水製薬	6,200	1,711.00	10,608,200
鳥居薬品	8,400	2,944.00	24,729,600
JCRファーマ	44,700	2,401.00	107,324,700
東和薬品	22,700	2,441.00	55,410,700
富士製薬工業	9,000	945.00	8,505,000
ゼリア新薬工業	25,400	2,082.00	52,882,800
第一三共	1,182,300	3,370.00	3,984,351,000
キョーリン製薬ホールディングス	29,700	1,686.00	50,074,200
大幸薬品	24,100	585.00	14,098,500
ダイト	9,900	2,720.00	26,928,000
大塚ホールディングス	311,200	4,436.00	1,380,483,200
大正製薬ホールディングス	32,200	4,830.00	155,526,000
ペプチドリーム	83,100	1,485.00	123,403,500
大日本塗料	18,100	752.00	13,611,200
日本ペイントホールディングス	583,500	990.00	577,665,000
関西ペイント	143,100	1,745.00	249,709,500
神東塗料	10,600	156.00	1,653,600
中国塗料	34,600	867.00	29,998,200
日本特殊塗料	10,000	938.00	9,380,000
藤倉化成	19,600	490.00	9,604,000
太陽ホールディングス	22,700	3,095.00	70,256,500
DIC	59,300	2,554.00	151,452,200
サカタインクス	31,000	922.00	28,582,000
東洋インキSCホールディングス	31,000	1,975.00	61,225,000
T&K TOKA	12,700	829.00	10,528,300
アルプス技研	12,500	1,865.00	23,312,500
サニックス	26,500	240.00	6,360,000
ダイオーズ	3,200	1,151.00	3,683,200
日本空調サービス	16,000	795.00	12,720,000
オリエンタルランド	167,100	18,635.00	3,113,908,500
フォーカスシステムズ	9,800	912.00	8,937,600
ダスキン	33,500	2,699.00	90,416,500
パーク24	92,700	2,114.00	195,967,800
明光ネットワークジャパン	17,900	600.00	10,740,000
ファルコホールディングス	6,900	2,054.00	14,172,600
クレスコ	11,400	2,032.00	23,164,800
フジ・メディア・ホールディングス	142,200	1,168.00	166,089,600
秀英予備校	3,600	436.00	1,569,600
田谷	1,900	567.00	1,077,300
ラウンドワン	42,200	1,692.00	71,402,400
リゾートトラスト	65,900	2,178.00	143,530,200
オービック	49,100	19,210.00	943,211,000
ジャストシステム	22,100	4,075.00	90,057,500
TDCソフト	12,900	1,031.00	13,299,900
Zホールディングス	2,243,900	431.00	967,120,900
ピー・エム・エル	19,300	3,545.00	68,418,500
トレンドマイクロ	78,600	7,200.00	565,920,000
りらいあコミュニケーションズ	22,300	1,068.00	23,816,400

I Dホールディングス	9,900	854.00	8,454,600
リソー教育	68,900	333.00	22,943,700
日本オラクル	25,300	7,610.00	192,533,000
早稲田アカデミー	8,400	1,130.00	9,492,000
アルファシステムズ	3,600	4,195.00	15,102,000
フューチャー	32,900	1,620.00	53,298,000
C A C Holdings	8,400	1,446.00	12,146,400
S Bテクノロジー	6,700	2,325.00	15,577,500
トーセ	4,000	771.00	3,084,000
ユー・エス・エス	169,600	2,425.00	411,280,000
オービックビジネスコンサルタント	14,800	4,490.00	66,452,000
伊藤忠テクノソリューションズ	71,000	3,230.00	229,330,000
アイティフォー	18,900	792.00	14,968,800
東京個別指導学院	13,300	603.00	8,019,900
東計電算	1,800	5,940.00	10,692,000
サイバーエージェント	340,200	1,405.00	477,981,000
楽天グループ	728,400	713.00	519,349,200
エクスネット	2,500	1,010.00	2,525,000
クリーク・アンド・リバー社	7,900	2,012.00	15,894,800
モーニングスター	26,600	521.00	13,858,600
テー・オー・ダブリュー	29,200	333.00	9,723,600
大塚商会	84,200	3,995.00	336,379,000
サイボウズ	20,800	1,036.00	21,548,800
山田コンサルティンググループ	7,800	1,141.00	8,899,800
セントラルスポーツ	5,800	2,422.00	14,047,600
パラカ	4,500	1,793.00	8,068,500
電通国際情報サービス	20,400	3,975.00	81,090,000
A C C E S S	17,700	704.00	12,460,800
デジタルガレージ	25,700	4,030.00	103,571,000
イーエムシステムズ	25,800	963.00	24,845,400
ウェザーニューズ	4,900	6,430.00	31,507,000
C I J	12,400	797.00	9,882,800
ビジネスエンジニアリング	3,500	2,115.00	7,402,500
日本エンタープライズ	15,500	162.00	2,511,000
WOWOW	6,800	1,507.00	10,247,600
スカラ	13,100	773.00	10,126,300
インテリジェント ウェイブ	7,700	712.00	5,482,400
フルキャストホールディングス	13,000	2,161.00	28,093,000
エン・ジャパン	26,100	1,812.00	47,293,200
あすか製薬ホールディングス	15,900	997.00	15,852,300
サワイグループホールディングス	31,900	3,950.00	126,005,000
富士フイルムホールディングス	278,700	7,315.00	2,038,690,500
コニカミノルタ	330,100	460.00	151,846,000
資生堂	295,400	5,500.00	1,624,700,000
ライオン	168,000	1,412.00	237,216,000
高砂香料工業	9,600	2,383.00	22,876,800
マンダム	31,800	1,472.00	46,809,600
ミルボン	19,500	5,060.00	98,670,000
ファンケル	64,300	2,321.00	149,240,300
コーセー	29,800	12,100.00	360,580,000

コタ	11,200	1,428.00	15,993,600
シーボン	1,500	1,712.00	2,568,000
ポーラ・オルビスホールディングス	67,600	1,587.00	107,281,200
ノエビアホールディングス	12,400	5,650.00	70,060,000
アジュバンホールディングス	3,700	989.00	3,659,300
新日本製薬	6,500	1,446.00	9,399,000
エステー	10,300	1,470.00	15,141,000
アグロ カネショウ	5,300	1,314.00	6,964,200
コニシ	24,800	1,578.00	39,134,400
長谷川香料	27,400	2,519.00	69,020,600
星光PMC	9,000	576.00	5,184,000
小林製薬	44,500	8,340.00	371,130,000
荒川化学工業	11,900	1,011.00	12,030,900
メック	11,200	2,596.00	29,075,200
日本高純度化学	4,000	2,332.00	9,328,000
タカラバイオ	41,500	1,912.00	79,348,000
JCU	16,600	3,570.00	59,262,000
新田ゼラチン	9,500	625.00	5,937,500
OATアグリオ	6,600	1,853.00	12,229,800
デクセリアルズ	41,200	4,125.00	169,950,000
アース製薬	13,100	5,210.00	68,251,000
北興化学工業	13,800	1,100.00	15,180,000
大成ラミック	4,500	2,667.00	12,001,500
クミアイ化学工業	59,000	1,107.00	65,313,000
日本農薬	28,300	790.00	22,357,000
富士興産	3,900	1,127.00	4,395,300
ニチレキ	18,200	1,311.00	23,860,200
ユシロ化学工業	7,800	1,009.00	7,870,200
ビービー・カストロール	5,800	1,222.00	7,087,600
富士石油	37,300	354.00	13,204,200
MORESCO	5,300	1,271.00	6,736,300
出光興産	166,300	3,915.00	651,064,500
ENEOSホールディングス	2,385,200	569.30	1,357,894,360
コスモエネルギーホールディングス	57,100	4,005.00	228,685,500
テスホールディングス	13,800	1,350.00	18,630,000
インフロニア・ホールディングス	193,000	927.00	178,911,000
横浜ゴム	80,600	1,806.00	145,563,600
TOYO TIRE	78,500	1,841.00	144,518,500
ブリヂストン	433,400	5,253.00	2,276,650,200
住友ゴム工業	133,900	1,258.00	168,446,200
藤倉コンポジット	12,800	891.00	11,404,800
オカモト	8,100	3,875.00	31,387,500
アキレス	10,300	1,371.00	14,121,300
フコク	7,000	975.00	6,825,000
ニッタ	15,400	2,932.00	45,152,800
クリエートメディック	4,400	991.00	4,360,400
住友理工	31,000	587.00	18,197,000
三ツ星ベルト	19,200	2,863.00	54,969,600
バンドー化学	25,600	905.00	23,168,000
AGC	138,000	5,150.00	710,700,000

日本板硝子	73,000	427.00	31,171,000
石塚硝子	2,600	1,714.00	4,456,400
有沢製作所	22,000	1,098.00	24,156,000
日本山村硝子	6,000	748.00	4,488,000
日本電気硝子	60,500	2,831.00	171,275,500
オハラ	6,300	1,324.00	8,341,200
住友大阪セメント	26,900	3,455.00	92,939,500
太平洋セメント	90,000	2,082.00	187,380,000
リソルホールディングス	1,600	4,715.00	7,544,000
日本ヒューム	14,300	697.00	9,967,100
日本コンクリート工業	29,700	290.00	8,613,000
三谷セキサン	6,800	4,680.00	31,824,000
アジアパイルホールディングス	23,600	466.00	10,997,600
東海カーボン	125,500	1,209.00	151,729,500
日本カーボン	8,100	4,360.00	35,316,000
東洋炭素	9,600	2,862.00	27,475,200
ノリタケカンパニーリミテド	8,200	4,255.00	34,891,000
TOTO	101,700	4,420.00	449,514,000
日本碍子	161,400	1,951.00	314,891,400
日本特殊陶業	114,000	2,647.00	301,758,000
ダントーホールディングス	10,400	283.00	2,943,200
MARUWA	5,500	14,720.00	80,960,000
品川リフラクトリーズ	3,800	3,590.00	13,642,000
黒崎播磨	2,700	4,315.00	11,650,500
ヨータイ	10,000	1,468.00	14,680,000
東京窯業	17,300	282.00	4,878,600
ニッカトー	6,900	486.00	3,353,400
フジインコーポレーテッド	12,800	5,970.00	76,416,000
クニミネ工業	5,100	950.00	4,845,000
エーアンドエーマテリアル	2,800	890.00	2,492,000
ニチアス	34,400	2,360.00	81,184,000
日本製鉄	670,600	2,150.00	1,441,790,000
神戸製鋼所	279,700	703.00	196,629,100
中山製鋼所	22,600	440.00	9,944,000
合同製鐵	7,900	1,362.00	10,759,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	383,100	1,623.00	621,771,300
東京製鐵	48,200	1,621.00	78,132,200
共英製鋼	16,200	1,368.00	22,161,600
大和工業	26,700	4,600.00	122,820,000
東京鐵鋼	6,700	1,250.00	8,375,000
大阪製鐵	8,200	1,473.00	12,078,600
淀川製鋼所	18,300	2,251.00	41,193,300
丸一鋼管	46,800	3,025.00	141,570,000
モリ工業	4,200	2,452.00	10,298,400
大同特殊鋼	22,700	3,655.00	82,968,500
日本高周波鋼業	4,400	341.00	1,500,400
日本冶金工業	11,000	2,219.00	24,409,000
山陽特殊製鋼	14,300	2,158.00	30,859,400
愛知製鋼	8,800	2,092.00	18,409,600

日立金属	169,000	2,024.00	342,056,000
日本金属	4,000	1,172.00	4,688,000
大平洋金属	9,600	2,775.00	26,640,000
新日本電工	91,600	379.00	34,716,400
栗本鐵工所	6,700	1,635.00	10,954,500
虹 技	2,100	977.00	2,051,700
日本鑄鉄管	1,500	1,021.00	1,531,500
日本製鋼所	42,700	3,310.00	141,337,000
三菱製鋼	9,900	997.00	9,870,300
日垂鋼業	19,000	265.00	5,035,000
日本精線	2,500	4,245.00	10,612,500
エンビプロ・ホールディングス	10,400	920.00	9,568,000
大紀アルミニウム工業所	20,800	1,337.00	27,809,600
日本軽金属ホールディングス	39,700	1,589.00	63,083,300
三井金属鉱業	42,200	3,425.00	144,535,000
東邦亜鉛	8,100	2,396.00	19,407,600
三菱マテリアル	94,900	2,030.00	192,647,000
住友金属鉱山	181,300	5,311.00	962,884,300
DOWAホールディングス	38,700	4,725.00	182,857,500
古河機械金属	24,800	1,244.00	30,851,200
エス・サイエンス	74,900	30.00	2,247,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	18,100	2,838.00	51,367,800
東邦チタニウム	28,100	2,817.00	79,157,700
UACJ	22,100	2,288.00	50,564,800
CKサンエツ	3,000	4,030.00	12,090,000
古河電気工業	46,400	2,268.00	105,235,200
住友電気工業	560,100	1,520.00	851,352,000
フジクラ	174,700	835.00	145,874,500
昭和電線ホールディングス	13,700	1,750.00	23,975,000
東京特殊電線	2,100	2,390.00	5,019,000
タツタ電線	27,700	499.00	13,822,300
カナレ電気	2,500	1,659.00	4,147,500
平河ヒューテック	8,600	1,132.00	9,735,200
リョービ	17,300	1,116.00	19,306,800
アーレスティ	16,600	388.00	6,440,800
アサヒホールディングス	62,700	2,126.00	133,300,200
東洋製罐グループホールディングス	86,600	1,408.00	121,932,800
ホッカンホールディングス	7,800	1,257.00	9,804,600
コロナ	8,200	837.00	6,863,400
横河ブリッジホールディングス	24,100	2,018.00	48,633,800
駒井ハルテック	2,600	1,736.00	4,513,600
高田機工	600	2,506.00	1,503,600
三和ホールディングス	147,700	1,284.00	189,646,800
文化シャッター	47,500	987.00	46,882,500
三協立山	19,200	593.00	11,385,600
アルインコ	10,900	855.00	9,319,500
東洋シャッター	2,500	648.00	1,620,000
LIXIL	246,800	2,551.00	629,586,800
日本フィルコン	10,600	500.00	5,300,000
ノーリツ	26,700	1,507.00	40,236,900

長府製作所	15,900	1,781.00	28,317,900
リンナイ	27,900	9,060.00	252,774,000
ユニプレス	25,300	948.00	23,984,400
ダイニチ工業	7,500	641.00	4,807,500
日東精工	18,400	503.00	9,255,200
三洋工業	1,500	1,738.00	2,607,000
岡部	26,000	637.00	16,562,000
ジーテクト	18,000	1,334.00	24,012,000
東プレ	25,700	1,070.00	27,499,000
高周波熱錬	25,000	694.00	17,350,000
東京製綱	9,600	933.00	8,956,800
サンコール	13,500	653.00	8,815,500
モリテックスチール	12,300	307.00	3,776,100
パイオラックス	21,200	2,070.00	43,884,000
エイチワン	14,500	624.00	9,048,000
日本発条	136,100	966.00	131,472,600
中央発條	7,600	712.00	5,411,200
アドバネクス	2,000	1,463.00	2,926,000
三浦工業	63,800	2,829.00	180,490,200
タクマ	47,700	1,420.00	67,734,000
テクノプロ・ホールディングス	90,800	2,930.00	266,044,000
アトラグループ	3,700	204.00	754,800
インターワークス	4,600	383.00	1,761,800
アイ・アールジャパンホールディングス	7,000	2,218.00	15,526,000
Keeper 技研	9,700	3,425.00	33,222,500
ファーストロジック	2,600	774.00	2,012,400
三機サービス	2,700	1,022.00	2,759,400
Gunosy	8,200	921.00	7,552,200
デザインワン・ジャパン	3,900	179.00	698,100
イー・ガーディアン	5,500	2,969.00	16,329,500
リブセンス	9,000	167.00	1,503,000
ジャパンマテリアル	46,600	1,880.00	87,608,000
ベクトル	21,200	1,044.00	22,132,800
ウチヤマホールディングス	7,700	303.00	2,333,100
チャーム・ケア・コーポレーション	11,300	1,010.00	11,413,000
キャリアリンク	5,600	1,836.00	10,281,600
IBJ	12,400	715.00	8,866,000
アサンテ	6,700	1,522.00	10,197,400
バリューHR	12,900	1,255.00	16,189,500
M&Aキャピタルパートナーズ	12,500	3,300.00	41,250,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,000	1,202.00	7,212,000
ERIホールディングス	4,300	1,539.00	6,617,700
アビスト	2,300	2,877.00	6,617,100
シグマクシス・ホールディングス	18,300	1,090.00	19,947,000
ウィルグループ	11,300	1,152.00	13,017,600
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	17,400	176.00	3,062,400
メドピア	11,100	2,091.00	23,210,100
レアジョブ	2,800	601.00	1,682,800



リクルートホールディングス	1,113,300	4,448.00	4,951,958,400	
エラン	20,900	1,016.00	21,234,400	
ツガミ	32,700	1,244.00	40,678,800	
オークマ	15,900	5,560.00	88,404,000	
芝浦機械	17,800	3,090.00	55,002,000	
アマダ	247,600	1,071.00	265,179,600	
アイダエンジニアリング	36,400	905.00	32,942,000	
滝澤鉄工所	4,700	1,256.00	5,903,200	
F U J I	65,800	2,164.00	142,391,200	
牧野フライス製作所	16,300	4,575.00	74,572,500	
オーエスジー	69,900	1,670.00	116,733,000	
ダイジェット工業	1,800	930.00	1,674,000	
旭ダイヤモンド工業	39,400	603.00	23,758,200	
D M G 森精機	88,800	1,927.00	171,117,600	
ソディック	34,100	832.00	28,371,200	
ディスコ	22,900	33,300.00	762,570,000	
日東工器	7,900	1,551.00	12,252,900	
日進工具	12,400	1,286.00	15,946,400	
パンチ工業	13,300	479.00	6,370,700	
富士ダイス	8,100	678.00	5,491,800	
土木管理総合試験所	7,100	334.00	2,371,400	
ネットマーケティング	7,400	628.00	4,647,200	
日本郵政	1,814,000	956.80	1,735,635,200	
ベルシステム24ホールディングス	21,800	1,390.00	30,302,000	
鎌倉新書	17,400	553.00	9,622,200	
S M N	3,500	600.00	2,100,000	
一蔵	2,100	514.00	1,079,400	
グローバルキッズCOMPANY	2,500	667.00	1,667,500	
エアトリ	9,100	2,846.00	25,898,600	
アトラエ	10,700	1,770.00	18,939,000	
ストライク	6,400	3,675.00	23,520,000	
ソラスト	37,300	695.00	25,923,500	
セラク	4,800	1,181.00	5,668,800	
インソース	16,000	2,238.00	35,808,000	
豊田自動織機	117,600	8,440.00	992,544,000	
豊和工業	8,000	1,043.00	8,344,000	
O K K	5,900	1,178.00	6,950,200	
石川製作所	4,200	1,808.00	7,593,600	
東洋機械金属	10,300	606.00	6,241,800	
津田駒工業	3,000	566.00	1,698,000	
エンシュウ	3,600	839.00	3,020,400	
島精機製作所	22,800	2,235.00	50,958,000	
オプトラン	19,600	2,028.00	39,748,800	
N C ホールディングス	4,000	1,993.00	7,972,000	
イワキ	9,900	948.00	9,385,200	
フリーー	14,000	1,122.00	15,708,000	
ヤマシンフィルタ	26,800	347.00	9,299,600	
日阪製作所	17,400	840.00	14,616,000	
やまびこ	27,500	1,197.00	32,917,500	
野村マイクロ・サイエンス	5,100	4,000.00	20,400,000	

平田機工	7,000	4,320.00	30,240,000
ペガサスミシン製造	15,900	611.00	9,714,900
マルマエ	6,500	2,031.00	13,201,500
タツモ	7,300	1,270.00	9,271,000
ナブテスコ	85,500	3,320.00	283,860,000
三井海洋開発	16,600	1,347.00	22,360,200
レオン自動機	16,900	1,300.00	21,970,000
S M C	46,500	69,600.00	3,236,400,000
ホソカワミクロン	10,600	2,672.00	28,323,200
ユニオンツール	6,000	3,650.00	21,900,000
オイレス工業	20,900	1,574.00	32,896,600
日精エー・エス・ビー機械	5,900	3,410.00	20,119,000
サトーホールディングス	20,700	1,889.00	39,102,300
技研製作所	13,900	3,340.00	46,426,000
日本エアーテック	7,100	1,041.00	7,391,100
カワタ	4,800	1,065.00	5,112,000
日精樹脂工業	10,400	915.00	9,516,000
オカダアイヨン	5,000	1,525.00	7,625,000
ワイエイシイホールディングス	6,300	1,744.00	10,987,200
小松製作所	718,600	3,469.00	2,492,823,400
住友重機械工業	86,700	3,250.00	281,775,000
日立建機	63,500	3,355.00	213,042,500
日工	20,600	611.00	12,586,600
巴工業	6,000	2,361.00	14,166,000
井関農機	13,200	1,258.00	16,605,600
T O W A	13,500	1,811.00	24,448,500
丸山製作所	2,800	1,585.00	4,438,000
北川鉄工所	6,600	1,516.00	10,005,600
シンニッタ	19,400	226.00	4,384,400
ローツェ	7,800	10,180.00	79,404,000
タカキタ	5,100	563.00	2,871,300
クボタ	768,200	2,452.00	1,883,626,400
荏原実業	7,300	2,412.00	17,607,600
東洋エンジニアリング	20,900	664.00	13,877,600
三菱化工機	4,800	2,127.00	10,209,600
月島機械	26,200	910.00	23,842,000
帝国電機製作所	10,600	1,563.00	16,567,800
東京機械製作所	6,500	980.00	6,370,000
新東工業	31,600	699.00	22,088,400
澁谷工業	13,000	2,334.00	30,342,000
アイチコーポレーション	22,600	871.00	19,684,600
小森コーポレーション	38,500	797.00	30,684,500
鶴見製作所	11,600	1,826.00	21,181,600
住友精密工業	2,300	2,946.00	6,775,800
日本ギア工業	6,000	273.00	1,638,000
酒井重工業	2,600	3,035.00	7,891,000
荏原製作所	63,400	5,680.00	360,112,000
石井鐵工所	1,100	2,862.00	3,148,200
西島製作所	13,400	1,375.00	18,425,000
北越工業	13,900	842.00	11,703,800

ダイキン工業	182,800	21,565.00	3,942,082,000	
オルガノ	4,600	10,050.00	46,230,000	
トヨーカネツ	5,800	2,754.00	15,973,200	
栗田工業	82,000	5,390.00	441,980,000	
橋本チエイン	20,700	3,335.00	69,034,500	
大同工業	6,700	859.00	5,755,300	
日機装	42,700	874.00	37,319,800	
木村化工機	12,500	699.00	8,737,500	
レイズネクスト	22,300	1,174.00	26,180,200	
アネスト岩田	24,800	883.00	21,898,400	
ダイフク	79,000	8,280.00	654,120,000	
サムコ	4,300	2,778.00	11,945,400	
加藤製作所	7,600	842.00	6,399,200	
油研工業	1,900	1,770.00	3,363,000	
タダノ	78,700	967.00	76,102,900	
フジテック	51,400	2,685.00	138,009,000	
C K D	42,200	1,901.00	80,222,200	
キトー	12,800	2,642.00	33,817,600	
平和	44,300	1,945.00	86,163,500	
理想科学工業	12,900	2,236.00	28,844,400	
SANKYO	34,100	4,260.00	145,266,000	
日本金銭機械	16,000	677.00	10,832,000	
マースグループホールディングス	10,000	1,716.00	17,160,000	
フクシマガリレイ	10,000	3,390.00	33,900,000	
オーイズミ	5,800	424.00	2,459,200	
ダイコク電機	7,300	1,218.00	8,891,400	
竹内製作所	24,200	2,488.00	60,209,600	
アマノ	41,600	2,485.00	103,376,000	
JUKI	22,000	738.00	16,236,000	
サンデン	21,700	242.00	5,251,400	
ジャノメ	13,500	703.00	9,490,500	
ブラザー工業	185,100	2,424.00	448,682,400	
マックス	19,500	1,609.00	31,375,500	
モリタホールディングス	25,500	1,309.00	33,379,500	
グローリー	38,700	2,054.00	79,489,800	
新晃工業	14,700	1,643.00	24,152,100	
大和冷機工業	22,800	1,060.00	24,168,000	
セガサミーホールディングス	157,200	2,379.00	373,978,800	
日本ピストンリング	5,900	1,331.00	7,852,900	
リケン	6,200	2,427.00	15,047,400	
T P R	19,000	1,272.00	24,168,000	
ツバキ・ナカシマ	34,800	1,007.00	35,043,600	
ホシザキ	46,400	7,710.00	357,744,000	
大豊工業	13,000	726.00	9,438,000	
日本精工	280,500	780.00	218,790,000	
NTN	305,600	296.00	90,457,600	
ジェイテクト	140,800	1,101.00	155,020,800	
不二越	11,800	3,785.00	44,663,000	
ミネベアミツミ	259,300	2,528.00	655,510,400	
日本トムソン	38,600	546.00	21,075,600	

THK	89,400	2,871.00	256,667,400
ユーシン精機	12,500	705.00	8,812,500
前澤給装工業	11,000	860.00	9,460,000
イーグル工業	18,000	1,005.00	18,090,000
前澤工業	9,800	618.00	6,056,400
日本ピラー工業	14,300	2,918.00	41,727,400
キッツ	47,400	699.00	33,132,600
日立製作所	762,700	6,945.00	5,296,951,500
東芝	277,100	5,669.00	1,570,879,900
三菱電機	1,515,200	1,476.00	2,236,435,200
富士電機	90,700	6,160.00	558,712,000
東洋電機製造	5,600	919.00	5,146,400
安川電機	161,900	4,645.00	752,025,500
シンフォニアテクノロジー	17,200	1,420.00	24,424,000
明電舎	24,000	2,068.00	49,632,000
オリジン	3,800	1,256.00	4,772,800
山洋電気	6,200	5,530.00	34,286,000
デンヨー	12,100	1,593.00	19,275,300
PHCホールディングス	24,500	1,345.00	32,952,500
ベikalent・コンサルティング	10,800	35,500.00	383,400,000
Orchestra Holdings	2,800	2,642.00	7,397,600
アイモバイル	6,500	1,418.00	9,217,000
キャリアインデックス	5,200	509.00	2,646,800
MS-Japan	6,200	894.00	5,542,800
船場	1,600	676.00	1,081,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	48,000	1,507.00	72,336,000
フルテック	2,100	1,333.00	2,799,300
グリーンズ	5,900	665.00	3,923,500
ツナググループ・ホールディングス	4,000	325.00	1,300,000
GAMewith	4,500	500.00	2,250,000
MS&Consulting	2,200	721.00	1,586,200
ウェルビー	9,800	794.00	7,781,200
エル・ティー・エス	1,900	3,515.00	6,678,500
ミダックホールディングス	6,800	2,695.00	18,326,000
日総工産	11,800	607.00	7,162,600
キュービーネットホールディングス	6,900	1,323.00	9,128,700
RPAホールディングス	21,300	397.00	8,456,100
三櫻工業	21,900	682.00	14,935,800
マキタ	183,800	3,613.00	664,069,400
東芝テック	17,200	4,160.00	71,552,000
芝浦メカトロニクス	2,800	11,280.00	31,584,000
マブチモーター	36,300	3,730.00	135,399,000
日本電産	371,800	8,866.00	3,296,378,800
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,100	468.00	2,854,800
トレックス・セミコンダクター	7,100	2,907.00	20,639,700
東光高岳	8,600	1,795.00	15,437,000
ダブル・スコープ	45,600	1,511.00	68,901,600
宮越ホールディングス	6,000	905.00	5,430,000

ダイヘン	15,500	4,335.00	67,192,500
ヤーマン	25,900	1,276.00	33,048,400
JVCケンウッド	129,000	191.00	24,639,000
ミマキエンジニアリング	14,300	569.00	8,136,700
I-PEX	7,400	1,404.00	10,389,600
日新電機	37,200	1,571.00	58,441,200
大崎電気工業	27,600	500.00	13,800,000
オムロン	132,100	7,441.00	982,956,100
日東工業	19,900	2,333.00	46,426,700
I D E C	19,600	2,733.00	53,566,800
正興電機製作所	4,600	1,156.00	5,317,600
不二電機工業	3,000	1,141.00	3,423,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	48,900	2,193.00	107,237,700
サクサホールディングス	3,000	1,468.00	4,404,000
メルコホールディングス	4,200	3,495.00	14,679,000
テクノメディカ	3,600	1,580.00	5,688,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,500	1,247.00	5,611,500
日本電気	192,600	5,260.00	1,013,076,000
富士通	142,700	18,435.00	2,630,674,500
沖電気工業	61,500	801.00	49,261,500
岩崎通信機	6,600	831.00	5,484,600
電気興業	7,800	2,594.00	20,233,200
サンケン電気	14,000	5,370.00	75,180,000
ナカヨ	2,300	1,113.00	2,559,900
アイホン	7,800	1,723.00	13,439,400
ルネサスエレクトロニクス	861,800	1,439.00	1,240,130,200
セイコーエプソン	183,600	2,231.00	409,611,600
ワコム	122,900	927.00	113,928,300
アルバック	31,700	5,290.00	167,693,000
アクセル	6,300	848.00	5,342,400
E I Z O	11,600	3,815.00	44,254,000
ジャパンディスプレイ	541,900	67.00	36,307,300
日本信号	35,800	927.00	33,186,600
京三製作所	32,100	435.00	13,963,500
能美防災	19,000	1,763.00	33,497,000
ホーチキ	10,600	1,269.00	13,451,400
星和電機	6,900	492.00	3,394,800
エレコム	36,300	1,512.00	54,885,600
パナソニック ホールディングス	1,691,400	1,144.00	1,934,961,600
シャープ	160,800	1,026.00	164,980,800
アンリツ	102,100	1,507.00	153,864,700
富士通ゼネラル	43,000	2,474.00	106,382,000
ソニーグループ	993,400	12,130.00	12,049,942,000
T D K	229,600	4,690.00	1,076,824,000
帝国通信工業	7,000	1,378.00	9,646,000
タムラ製作所	58,400	583.00	34,047,200
アルプスアルパイン	133,200	1,502.00	200,066,400
池上通信機	4,800	614.00	2,947,200
日本電波工業	15,800	1,178.00	18,612,400

鈴木	7,800	839.00	6,544,200	
メイコー	17,300	4,050.00	70,065,000	
日本トリム	2,900	2,490.00	7,221,000	
ローランド ディー・ジー	9,300	3,350.00	31,155,000	
フォスター電機	15,200	750.00	11,400,000	
S M K	3,800	2,164.00	8,223,200	
ヨコオ	11,000	2,303.00	25,333,000	
ティアック	24,400	125.00	3,050,000	
ホシデン	36,100	1,227.00	44,294,700	
ヒロセ電機	23,000	17,720.00	407,560,000	
日本航空電子工業	33,300	2,140.00	71,262,000	
T O A	17,200	781.00	13,433,200	
マクセル	29,700	1,323.00	39,293,100	
古野電気	19,000	1,070.00	20,330,000	
ユニデンホールディングス	3,600	3,535.00	12,726,000	
スミダコーポレーション	14,800	829.00	12,269,200	
アイコム	5,500	2,430.00	13,365,000	
リオン	5,800	2,602.00	15,091,600	
本多通信工業	12,500	548.00	6,850,000	
横河電機	149,900	2,379.00	356,612,100	
新電元工業	5,900	3,340.00	19,706,000	
アズビル	93,000	3,600.00	334,800,000	
東亜ディーケーケー	8,000	905.00	7,240,000	
日本光電工業	62,500	3,035.00	189,687,500	
チノー	5,100	1,642.00	8,374,200	
共和電業	15,600	335.00	5,226,000	
日本電子材料	7,600	1,910.00	14,516,000	
堀場製作所	27,900	6,740.00	188,046,000	
アドバンテスト	117,900	8,210.00	967,959,000	
小野測器	6,600	446.00	2,943,600	
エスベック	12,200	1,895.00	23,119,000	
キーエンス	143,700	50,390.00	7,241,043,000	
日置電機	7,600	7,150.00	54,340,000	
シスメックス	120,400	8,458.00	1,018,343,200	
日本マイクロニクス	25,000	1,422.00	35,550,000	
メガチップス	14,100	3,310.00	46,671,000	
O B A R A G R O U P	6,600	2,943.00	19,423,800	
I M A G I C A G R O U P	11,800	779.00	9,192,200	
澤藤電機	1,900	1,521.00	2,889,900	
デンソー	323,300	8,131.00	2,628,752,300	
原田工業	7,600	941.00	7,151,600	
コーセル	17,700	800.00	14,160,000	
イリソ電子工業	13,300	3,355.00	44,621,500	
オブテックスグループ	26,000	2,068.00	53,768,000	
千代田インテグレ	6,300	2,029.00	12,782,700	
レーザーテック	66,600	17,370.00	1,156,842,000	
スタンレー電気	105,100	2,344.00	246,354,400	
岩崎電気	5,200	2,550.00	13,260,000	
ウシオ電機	77,000	1,732.00	133,364,000	
岡谷電機産業	11,400	274.00	3,123,600	

ヘリオス テクノ ホールディング	13,800	292.00	4,029,600	
エノモト	4,500	1,630.00	7,335,000	
日本セラミック	14,700	2,093.00	30,767,100	
遠藤照明	7,300	772.00	5,635,600	
古河電池	11,300	1,231.00	13,910,300	
双信電機	7,500	577.00	4,327,500	
山一電機	10,800	1,917.00	20,703,600	
図研	10,400	2,991.00	31,106,400	
日本電子	31,400	5,910.00	185,574,000	
カシオ計算機	102,200	1,285.00	131,327,000	
ファナック	139,300	21,320.00	2,969,876,000	
日本シイエムケイ	28,900	469.00	13,554,100	
エンプラス	3,900	3,480.00	13,572,000	
大真空	20,300	995.00	20,198,500	
ローム	67,600	10,470.00	707,772,000	
浜松ホトニクス	108,400	6,060.00	656,904,000	
三井ハイテック	14,200	11,560.00	164,152,000	
新光電気工業	46,600	4,455.00	207,603,000	
京セラ	223,000	7,487.00	1,669,601,000	
協栄産業	1,500	1,434.00	2,151,000	
太陽誘電	72,600	5,480.00	397,848,000	
村田製作所	443,600	8,411.00	3,731,119,600	
双葉電子工業	27,200	682.00	18,550,400	
日東電工	95,900	9,750.00	935,025,000	
北陸電気工業	6,000	1,169.00	7,014,000	
東海理化電機製作所	41,700	1,495.00	62,341,500	
ニチコン	44,800	1,389.00	62,227,200	
日本ケミコン	14,900	1,933.00	28,801,700	
K O A	22,400	1,736.00	38,886,400	
三井E & Sホールディングス	57,600	390.00	22,464,000	
日立造船	128,500	918.00	117,963,000	
三菱重工業	238,000	5,483.00	1,304,954,000	
川崎重工業	110,200	2,943.00	324,318,600	
I H I	99,000	4,150.00	410,850,000	
名村造船所	43,000	429.00	18,447,000	
サノヤスホールディングス	19,200	133.00	2,553,600	
スプリックス	4,900	1,018.00	4,988,200	
マネジメントソリューションズ	7,400	3,840.00	28,416,000	
プロレド・パートナーズ	3,200	577.00	1,846,400	
and factory	4,300	430.00	1,849,000	
テノ・ホールディングス	1,800	680.00	1,224,000	
フロンティア・マネジメント	4,000	1,284.00	5,136,000	
ピアラ	2,300	762.00	1,752,600	
コプロ・ホールディングス	2,900	940.00	2,726,000	
ギークス	2,600	977.00	2,540,200	
カーブスホールディングス	41,600	685.00	28,496,000	
フォーラムエンジニアリング	9,600	936.00	8,985,600	
FAST FITNESS JAPAN	2,700	1,490.00	4,023,000	
日本車輛製造	5,300	2,082.00	11,034,600	

三菱ロジスネクスト	21,000	834.00	17,514,000
近畿車輛	1,600	1,166.00	1,865,600
一家ホールディングス	2,800	586.00	1,640,800
フルサト・マルカホールディングス	14,200	3,225.00	45,795,000
ヤマエグループホールディングス	9,400	1,205.00	11,327,000
藤久ホールディングス	4,900	728.00	3,567,200
F P G	52,700	933.00	49,169,100
島根銀行	4,600	513.00	2,359,800
じもとホールディングス	10,800	580.00	6,264,000
全国保証	37,300	4,275.00	159,457,500
めぶきフィナンシャルグループ	678,300	253.00	171,609,900
ジャパンインベストメントアドバイザ	12,100	1,390.00	16,819,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,600	1,926.00	35,823,600
九州フィナンシャルグループ	288,800	394.00	113,787,200
かんぽ生命保険	157,300	2,190.00	344,487,000
ゆうちょ銀行	369,400	994.00	367,183,600
あんしん保証	6,300	274.00	1,726,200
富山第一銀行	35,700	400.00	14,280,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	814,000	458.00	372,812,000
ジェイリース	5,200	1,747.00	9,084,400
西日本フィナンシャルホールディングス	87,000	771.00	67,077,000
イントラスト	6,500	557.00	3,620,500
日本モーゲージサービス	8,600	964.00	8,290,400
C A S A	5,600	843.00	4,720,800
アルヒ	22,900	987.00	22,602,300
プレミアグループ	7,900	3,865.00	30,533,500
日産自動車	1,870,100	564.00	1,054,736,400
いすゞ自動車	472,100	1,645.00	776,604,500
トヨタ自動車	7,497,400	2,203.50	16,520,520,900
日野自動車	198,000	715.00	141,570,000
三菱自動車工業	586,700	453.00	265,775,100
エフテック	10,600	580.00	6,148,000
レシップホールディングス	5,900	560.00	3,304,000
G M B	2,800	721.00	2,018,800
ファルテック	2,800	611.00	1,710,800
武蔵精密工業	35,300	1,425.00	50,302,500
日産車体	23,200	604.00	14,012,800
新明和工業	42,300	1,162.00	49,152,600
極東開発工業	26,700	1,460.00	38,982,000
トピー工業	12,300	1,365.00	16,789,500
ティラド	4,200	2,829.00	11,881,800
曙ブレーキ工業	87,000	171.00	14,877,000
タチエス	26,600	1,180.00	31,388,000
N O K	65,400	1,227.00	80,245,800
フタバ産業	36,600	400.00	14,640,000
K Y B	14,700	3,085.00	45,349,500
市光工業	18,900	391.00	7,389,900



大同メタル工業	30,600	534.00	16,340,400
プレス工業	72,600	443.00	32,161,800
ミクニ	19,100	368.00	7,028,800
太平洋工業	31,200	1,083.00	33,789,600
河西工業	19,500	284.00	5,538,000
アイシン	115,900	4,415.00	511,698,500
マツダ	476,900	1,174.00	559,880,600
今仙電機製作所	10,700	615.00	6,580,500
本田技研工業	1,189,100	3,398.00	4,040,561,800
スズキ	330,400	4,058.00	1,340,763,200
S U B A R U	429,200	2,544.50	1,092,099,400
安永	6,800	756.00	5,140,800
ヤマハ発動機	206,900	2,742.00	567,319,800
小糸製作所	81,800	4,875.00	398,775,000
T B K	17,100	346.00	5,916,600
エクセディ	24,000	1,795.00	43,080,000
ミツバ	26,100	413.00	10,779,300
豊田合成	46,900	2,186.00	102,523,400
愛三工業	24,800	757.00	18,773,600
盟和産業	1,600	1,018.00	1,628,800
日本プラスト	12,100	470.00	5,687,000
ヨロズ	13,200	918.00	12,117,600
エフ・シー・シー	25,900	1,393.00	36,078,700
新家工業	3,600	1,545.00	5,562,000
シマノ	60,400	22,150.00	1,337,860,000
テイ・エス テック	67,000	1,431.00	95,877,000
三十三フィナンシャルグループ	13,300	1,369.00	18,207,700
第四北越フィナンシャルグループ	23,000	2,516.00	57,868,000
ひろぎんホールディングス	210,100	608.00	127,740,800
マーキュリアホールディングス	7,700	607.00	4,673,900
おきなわフィナンシャルグループ	13,500	2,149.00	29,011,500
ダイレクトマーケティングミックス	16,000	1,812.00	28,992,000
ポピンズ	3,600	2,130.00	7,668,000
L I T A L I C O	12,300	2,616.00	32,176,800
十六フィナンシャルグループ	19,100	2,283.00	43,605,300
北國フィナンシャルホールディングス	13,800	4,380.00	60,444,000
ネットプロテクションズホールディングス	47,500	571.00	27,122,500
プロクレアホールディングス	16,000	1,917.00	30,672,000
ジャムコ	9,200	1,215.00	11,178,000
小野建	14,300	1,401.00	20,034,300
はるやまホールディングス	7,500	456.00	3,420,000
南陽	3,000	1,844.00	5,532,000
ノジマ	25,300	2,911.00	73,648,300
佐鳥電機	9,700	1,170.00	11,349,000
カッパ・クリエイト	21,800	1,407.00	30,672,600
エコートレーディング	3,000	591.00	1,773,000
伯東	9,500	2,841.00	26,989,500
コンドーテック	11,800	1,043.00	12,307,400
中山福	8,400	337.00	2,830,800

ライトオン	11,800	751.00	8,861,800
ナガイレーベン	19,400	1,907.00	36,995,800
三菱食品	14,900	3,080.00	45,892,000
良品計画	179,700	1,386.00	249,064,200
パリミキホールディングス	19,500	270.00	5,265,000
松田産業	11,400	2,080.00	23,712,000
第一興商	29,600	4,000.00	118,400,000
メディバルホールディングス	152,600	1,790.00	273,154,000
アドヴァングループ	14,200	809.00	11,487,800
S P K	6,400	1,382.00	8,844,800
萩原電気ホールディングス	5,500	2,073.00	11,401,500
アルビス	4,800	2,208.00	10,598,400
アズワン	22,300	6,120.00	136,476,000
スズデン	5,100	2,020.00	10,302,000
尾家産業	3,200	876.00	2,803,200
シモジマ	9,600	953.00	9,148,800
ドウシシャ	14,700	1,532.00	22,520,400
小津産業	3,600	1,878.00	6,760,800
コナカ	17,700	339.00	6,000,300
高速	8,500	1,554.00	13,209,000
ハウス オブ ローゼ	2,100	1,680.00	3,528,000
G - 7ホールディングス	17,500	1,371.00	23,992,500
たけびし	5,600	1,462.00	8,187,200
イオン北海道	22,800	1,080.00	24,624,000
コジマ	26,800	584.00	15,651,200
ヒマラヤ	5,100	951.00	4,850,100
コーナン商事	22,100	3,580.00	79,118,000
ネットワンシステムズ	57,400	2,873.00	164,910,200
エコス	5,300	2,033.00	10,774,900
ワタミ	18,900	940.00	17,766,000
マルシェ	5,300	471.00	2,496,300
リックス	3,500	1,902.00	6,657,000
システムソフト	41,700	109.00	4,545,300
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	312,400	2,048.00	639,795,200
丸文	13,000	779.00	10,127,000
西松屋チェーン	32,000	1,461.00	46,752,000
ゼンショーホールディングス	76,200	3,030.00	230,886,000
ハビネット	12,300	1,563.00	19,224,900
幸楽苑ホールディングス	9,300	1,285.00	11,950,500
ハークスレイ	6,800	583.00	3,964,400
橋本総業ホールディングス	2,900	1,963.00	5,692,700
日本ライフライン	46,300	925.00	42,827,500
サイゼリヤ	23,000	2,618.00	60,214,000
タカショー	12,100	813.00	9,837,300
V Tホールディングス	58,900	472.00	27,800,800
アルゴグラフィックス	12,200	3,085.00	37,637,000
魚力	4,500	2,291.00	10,309,500
I D O M	47,400	728.00	34,507,200
日本エム・ディ・エム	9,200	1,588.00	14,609,600

ポブラ	4,300	152.00	653,600
フジ・コーポレーション	8,200	1,217.00	9,979,400
ユナイテッドアローズ	16,300	2,100.00	34,230,000
進和	9,300	2,161.00	20,097,300
エスケイジャパン	3,800	467.00	1,774,600
ダイトロン	6,300	2,000.00	12,600,000
ハイデイ日高	22,500	2,104.00	47,340,000
シークス	20,700	1,043.00	21,590,100
YU-WA CREATION HOLDINGS	9,500	249.00	2,365,500
コロワイド	64,300	1,795.00	115,418,500
ピーシーデポコーポレーション	18,200	350.00	6,370,000
田中商事	3,600	603.00	2,170,800
オーハシテクニカ	7,900	1,292.00	10,206,800
壱番屋	11,100	4,865.00	54,001,500
白銅	5,000	2,498.00	12,490,000
トップカルチャー	5,800	266.00	1,542,800
PLANT	3,900	653.00	2,546,700
スギホールディングス	31,200	5,220.00	162,864,000
ダイコー通産	1,600	1,147.00	1,835,200
薬王堂ホールディングス	7,800	2,044.00	15,943,200
島津製作所	194,400	4,715.00	916,596,000
JMS	12,800	585.00	7,488,000
クボテック	3,600	266.00	957,600
長野計器	10,900	1,172.00	12,774,800
ブイ・テクノロジー	6,900	2,945.00	20,320,500
スター精密	22,000	1,770.00	38,940,000
東京計器	10,000	1,495.00	14,950,000
愛知時計電機	6,200	1,471.00	9,120,200
インターアクション	7,900	2,040.00	16,116,000
オーバル	14,400	312.00	4,492,800
東京精密	25,500	4,730.00	120,615,000
マニー	59,700	1,436.00	85,729,200
ニコン	229,700	1,735.00	398,529,500
トプコン	74,600	1,935.00	144,351,000
オリンパス	789,100	2,800.00	2,209,480,000
理研計器	11,300	3,965.00	44,804,500
SCREENホールディングス	25,800	11,200.00	288,960,000
キヤノン電子	14,500	1,549.00	22,460,500
タムロン	11,500	2,449.00	28,163,500
HOYA	306,100	13,285.00	4,066,538,500
シード	7,500	517.00	3,877,500
ノーリツ鋼機	14,200	2,459.00	34,917,800
A&Dホロンホールディングス	17,900	1,004.00	17,971,600
朝日インテック	173,900	1,926.00	334,931,400
キヤノン	788,000	3,328.00	2,622,464,000
リコー	398,400	1,159.00	461,745,600
シチズン時計	165,000	583.00	96,195,000
リズム	5,000	1,891.00	9,455,000
大研医器	12,900	499.00	6,437,100

メニコン	50,100	2,841.00	142,334,100
シンシア	1,600	432.00	691,200
中本パックス	4,500	1,616.00	7,272,000
スノーピーク	20,700	2,784.00	57,628,800
パラマウントベッドホールディングス	30,500	2,019.00	61,579,500
トランザクション	9,600	1,101.00	10,569,600
粧美堂	4,800	411.00	1,972,800
ニホンフラッシュ	12,900	981.00	12,654,900
前田工織	15,300	2,646.00	40,483,800
永大産業	19,000	273.00	5,187,000
アートネイチャー	13,700	730.00	10,001,000
バンダイナムコホールディングス	134,700	9,809.00	1,321,272,300
アイフィスジャパン	4,400	663.00	2,917,200
共立印刷	23,800	153.00	3,641,400
SHOEI	14,200	5,150.00	73,130,000
フランスベッドホールディングス	20,600	890.00	18,334,000
マーベラス	24,500	698.00	17,101,000
パイロットコーポレーション	24,100	5,120.00	123,392,000
萩原工業	9,800	1,152.00	11,289,600
エイベックス	26,800	1,310.00	35,108,000
フジシールインターナショナル	34,600	1,526.00	52,799,600
タカラトミー	65,500	1,289.00	84,429,500
広済堂ホールディングス	9,700	1,152.00	11,174,400
エステールホールディングス	3,900	638.00	2,488,200
レック	19,500	701.00	13,669,500
タカノ	5,600	821.00	4,597,600
三光合成	18,200	350.00	6,370,000
プロネクサス	12,400	1,084.00	13,441,600
ホクシン	11,100	148.00	1,642,800
ウッドワン	4,900	1,203.00	5,894,700
大建工業	8,400	1,814.00	15,237,600
きもと	24,700	231.00	5,705,700
凸版印刷	218,200	2,374.00	518,006,800
大日本印刷	177,000	2,844.00	503,388,000
共同印刷	4,400	2,645.00	11,638,000
NISSHA	29,100	1,551.00	45,134,100
光村印刷	600	1,269.00	761,400
藤森工業	13,000	3,670.00	47,710,000
ヴィア・ホールディングス	19,900	161.00	3,203,900
TAKARA & COMPANY	9,300	1,838.00	17,093,400
前澤化成工業	9,600	1,302.00	12,499,200
未来工業	5,800	1,529.00	8,868,200
アシックス	127,700	2,591.00	330,870,700
ツツミ	3,900	1,961.00	7,647,900
ウェーブロックホールディングス	6,100	665.00	4,056,500
JSP	9,300	1,429.00	13,289,700
ニチハ	20,800	2,507.00	52,145,600
ローランド	11,100	4,515.00	50,116,500
エフピコ	29,100	2,709.00	78,831,900
小松ウオール工業	4,900	1,894.00	9,280,600

ヤマハ	92,400	5,750.00	531,300,000
河合楽器製作所	4,200	2,805.00	11,781,000
クリナップ	14,800	571.00	8,450,800
ピジョン	95,800	1,854.00	177,613,200
天馬	12,500	2,408.00	30,100,000
兼松サステック	600	1,635.00	981,000
キングジム	12,800	913.00	11,686,400
象印マホービン	40,500	1,431.00	57,955,500
リンテック	31,600	2,430.00	76,788,000
信越ポリマー	28,400	1,156.00	32,830,400
東リ	38,600	216.00	8,337,600
イトーキ	29,300	386.00	11,309,800
任天堂	89,500	58,940.00	5,275,130,000
三菱鉛筆	22,800	1,379.00	31,441,200
松風	5,900	1,685.00	9,941,500
タカラスタンダード	27,900	1,260.00	35,154,000
コクヨ	71,900	1,631.00	117,268,900
ナカバヤシ	13,900	496.00	6,894,400
ニフコ	53,000	3,210.00	170,130,000
立川ブラインド工業	6,500	1,099.00	7,143,500
グロープライド	12,700	2,249.00	28,562,300
オカムラ	47,800	1,089.00	52,054,200
バルカー	12,900	2,867.00	36,984,300
MUTOHホールディングス	1,100	2,083.00	2,291,300
伊藤忠商事	988,400	3,844.00	3,799,409,600
丸紅	1,426,700	1,451.00	2,070,141,700
スクロール	24,100	862.00	20,774,200
高島	2,200	2,439.00	5,365,800
ヨンドシーホールディングス	13,500	1,786.00	24,111,000
三陽商会	7,000	915.00	6,405,000
長瀬産業	75,400	1,886.00	142,204,400
ナイガイ	4,300	311.00	1,337,300
蝶理	8,600	1,954.00	16,804,400
豊田通商	145,300	5,060.00	735,218,000
オンワードホールディングス	88,000	264.00	23,232,000
三共生興	20,300	556.00	11,286,800
兼松	55,400	1,358.00	75,233,200
美津濃	14,000	2,260.00	31,640,000
ツカモトコーポレーション	1,900	1,210.00	2,299,000
ルックホールディングス	4,900	1,570.00	7,693,000
三井物産	1,159,200	3,459.00	4,009,672,800
日本紙パルプ商事	7,600	3,725.00	28,310,000
東京エレクトロン	100,700	55,660.00	5,604,962,000
カメイ	17,400	1,080.00	18,792,000
東都水産	600	4,370.00	2,622,000
OUGホールディングス	2,200	2,800.00	6,160,000
スターゼン	11,000	1,951.00	21,461,000
セイコーホールディングス	22,300	2,845.00	63,443,500
山善	59,300	988.00	58,588,400
椿本興業	2,800	3,685.00	10,318,000

住友商事	944,800	1,961.00	1,852,752,800
B I P R O G Y	48,500	2,954.00	143,269,000
内田洋行	6,400	5,300.00	33,920,000
三菱商事	1,073,000	4,733.00	5,078,509,000
第一実業	6,400	3,410.00	21,824,000
キャノンマーケティングジャパン	38,800	3,010.00	116,788,000
西華産業	7,100	1,636.00	11,615,600
佐藤商事	11,500	1,153.00	13,259,500
菱洋エレクトロ	9,200	2,332.00	21,454,400
東京産業	13,300	715.00	9,509,500
ユアサ商事	13,300	3,415.00	45,419,500
神鋼商事	3,600	3,875.00	13,950,000
トルク	6,300	204.00	1,285,200
阪和興業	28,500	2,999.00	85,471,500
正栄食品工業	10,000	3,965.00	39,650,000
カナデン	12,800	1,013.00	12,966,400
菱電商事	12,400	1,637.00	20,298,800
ニプロ	112,600	1,035.00	116,541,000
岩谷産業	35,500	5,560.00	197,380,000
ナイス	5,000	1,618.00	8,090,000
ニチモウ	2,000	2,455.00	4,910,000
極東貿易	4,500	2,676.00	12,042,000
アステナホールディングス	20,900	433.00	9,049,700
兼松エレクトロニクス	8,400	3,985.00	33,474,000
三愛オプリー	36,100	1,012.00	36,533,200
稲畑産業	31,400	2,325.00	73,005,000
G S I クレオス	7,500	1,314.00	9,855,000
明和産業	14,400	712.00	10,252,800
クワザワホールディングス	6,300	470.00	2,961,000
キムラタン	87,200	23.00	2,005,600
ゴールドウイン	26,500	8,390.00	222,335,000
ユニ・チャーム	305,700	4,205.00	1,285,468,500
デサント	27,700	3,100.00	85,870,000
キング	7,500	540.00	4,050,000
ワキタ	29,800	1,149.00	34,240,200
ヤマトインターナショナル	12,900	285.00	3,676,500
東邦ホールディングス	45,000	1,925.00	86,625,000
サンゲツ	38,900	1,521.00	59,166,900
ミツウロコグループホールディングス	19,400	947.00	18,371,800
シナネンホールディングス	5,300	3,415.00	18,099,500
伊藤忠エネクス	34,700	1,078.00	37,406,600
サンリオ	45,400	2,600.00	118,040,000
サンワテクノス	8,300	1,454.00	12,068,200
リョーサン	16,300	2,350.00	38,305,000
新光商事	21,400	887.00	18,981,800
トーホー	6,400	1,224.00	7,833,600
三信電気	6,700	1,617.00	10,833,900
東陽テクニカ	15,400	1,105.00	17,017,000
モスフードサービス	20,500	3,010.00	61,705,000
加賀電子	13,200	3,080.00	40,656,000

三益半導体工業	12,300	2,423.00	29,802,900
都築電気	7,400	1,334.00	9,871,600
ソーダニッカ	13,900	621.00	8,631,900
立花エレテック	10,900	1,561.00	17,014,900
木曽路	20,900	2,098.00	43,848,200
S R S ホールディングス	22,300	856.00	19,088,800
千趣会	28,400	397.00	11,274,800
タカキュー	12,300	95.00	1,168,500
リテールパートナーズ	22,100	1,130.00	24,973,000
ケーヨー	28,800	945.00	27,216,000
上新電機	15,900	1,873.00	29,780,700
日本瓦斯	75,800	2,007.00	152,130,600
ロイヤルホールディングス	25,700	2,259.00	58,056,300
東天紅	600	928.00	556,800
いなげや	16,900	1,192.00	20,144,800
チヨダ	14,000	742.00	10,388,000
ライフコーポレーション	13,000	2,601.00	33,813,000
リンガーハット	18,400	2,321.00	42,706,400
MrMaxHD	19,500	604.00	11,778,000
テナアライド	15,400	309.00	4,758,600
AOKIホールディングス	30,000	697.00	20,910,000
オークワ	22,900	853.00	19,533,700
コメリ	24,200	2,650.00	64,130,000
青山商事	30,600	911.00	27,876,600
しまむら	18,200	11,110.00	202,202,000
はせがわ	8,200	284.00	2,328,800
高島屋	107,900	1,359.00	146,636,100
松屋	27,900	963.00	26,867,700
エイチ・ツー・オー リテイリング	69,800	1,059.00	73,918,200
近鉄百貨店	5,000	2,478.00	12,390,000
丸井グループ	116,300	2,444.00	284,237,200
クレディセゾン	94,300	1,538.00	145,033,400
アクシアル リテイリング	11,000	3,015.00	33,165,000
井筒屋	7,300	389.00	2,839,700
イオン	543,900	2,291.00	1,246,074,900
イズミ	25,900	2,953.00	76,482,700
フォーバル	6,100	885.00	5,398,500
平和堂	24,200	1,887.00	45,665,400
フジ	37,000	2,215.00	81,955,000
ヤオコー	17,800	6,250.00	111,250,000
ゼビオホールディングス	21,200	909.00	19,270,800
ケーズホールディングス	136,500	1,253.00	171,034,500
PALTAC	21,900	4,265.00	93,403,500
三谷産業	24,600	316.00	7,773,600
Olympicグループ	7,400	703.00	5,202,200
日産東京販売ホールディングス	23,400	258.00	6,037,200
新生銀行	102,000	1,966.00	200,532,000
あおぞら銀行	87,400	2,660.00	232,484,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,373,100	745.00	6,982,959,500
りそなホールディングス	1,694,500	500.00	847,250,000

三井住友トラスト・ホールディングス	270,900	4,037.00	1,093,623,300	
三井住友フィナンシャルグループ	1,037,600	3,977.00	4,126,535,200	
千葉銀行	468,500	714.00	334,509,000	
群馬銀行	265,400	377.00	100,055,800	
武蔵野銀行	21,000	1,764.00	37,044,000	
千葉興業銀行	34,800	260.00	9,048,000	
筑波銀行	61,100	187.00	11,425,700	
七十七銀行	44,000	1,833.00	80,652,000	
秋田銀行	9,600	1,578.00	15,148,800	
山形銀行	15,000	865.00	12,975,000	
岩手銀行	9,700	2,058.00	19,962,600	
東邦銀行	117,900	201.00	23,697,900	
東北銀行	7,400	990.00	7,326,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	119,200	2,425.00	289,060,000	
静岡銀行	341,900	786.00	268,733,400	
スルガ銀行	137,100	357.00	48,944,700	
八十二銀行	318,600	468.00	149,104,800	
山梨中央銀行	16,200	1,130.00	18,306,000	
大垣共立銀行	28,200	1,720.00	48,504,000	
福井銀行	12,900	1,328.00	17,131,200	
清水銀行	6,100	1,495.00	9,119,500	
富山銀行	2,300	1,902.00	4,374,600	
滋賀銀行	26,800	2,658.00	71,234,400	
南都銀行	22,200	1,960.00	43,512,000	
百五銀行	137,700	322.00	44,339,400	
京都銀行	51,100	5,970.00	305,067,000	
紀陽銀行	48,400	1,360.00	65,824,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	90,800	822.00	74,637,600	
山陰合同銀行	88,800	669.00	59,407,200	
中国銀行	118,600	925.00	109,705,000	
鳥取銀行	5,100	1,210.00	6,171,000	
伊予銀行	186,000	640.00	119,040,000	
百十四銀行	15,000	1,729.00	25,935,000	
四国銀行	21,700	807.00	17,511,900	
阿波銀行	21,800	2,013.00	43,883,400	
大分銀行	8,500	1,792.00	15,232,000	
宮崎銀行	9,000	2,063.00	18,567,000	
佐賀銀行	8,400	1,431.00	12,020,400	
琉球銀行	34,000	794.00	26,996,000	
セブン銀行	464,200	247.00	114,657,400	
みずほフィナンシャルグループ	1,917,100	1,506.00	2,887,152,600	
高知銀行	5,200	759.00	3,946,800	
山口フィナンシャルグループ	164,800	762.00	125,577,600	
芙蓉総合リース	14,400	7,740.00	111,456,000	
みずほリース	20,900	3,150.00	65,835,000	
東京センチュリー	26,200	4,250.00	111,350,000	
SBIホールディングス	193,200	2,633.00	508,695,600	
日本証券金融	61,400	880.00	54,032,000	
アイフル	262,300	347.00	91,018,100	
日本アジア投資	12,400	264.00	3,273,600	



長野銀行	4,900	1,272.00	6,232,800
名古屋銀行	10,000	2,994.00	29,940,000
北洋銀行	209,500	217.00	45,461,500
愛知銀行	5,100	5,000.00	25,500,000
中京銀行	5,100	1,618.00	8,251,800
大光銀行	4,900	1,314.00	6,438,600
愛媛銀行	20,900	884.00	18,475,600
トマト銀行	5,200	1,022.00	5,314,400
京葉銀行	65,200	460.00	29,992,000
栃木銀行	72,100	265.00	19,106,500
北日本銀行	4,700	1,561.00	7,336,700
東和銀行	26,500	514.00	13,621,000
福島銀行	17,200	227.00	3,904,400
大東銀行	7,100	653.00	4,636,300
リコーリース	13,900	3,455.00	48,024,500
イオンフィナンシャルサービス	85,200	1,240.00	105,648,000
アコム	308,600	315.00	97,209,000
ジャックス	16,000	3,360.00	53,760,000
オリエントコーポレーション	422,900	125.00	52,862,500
オリックス	929,200	2,421.50	2,250,057,800
三菱HCキャピタル	529,700	628.00	332,651,600
ジャフコグループ	59,800	1,623.00	97,055,400
九州リースサービス	7,400	579.00	4,284,600
トモニホールディングス	115,100	312.00	35,911,200
大和証券グループ本社	1,115,500	619.90	691,498,450
野村ホールディングス	2,387,800	492.80	1,176,707,840
岡三証券グループ	116,200	340.00	39,508,000
丸三証券	46,500	483.00	22,459,500
東洋証券	48,700	186.00	9,058,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	162,300	374.00	60,700,200
光世証券	3,000	478.00	1,434,000
水戸証券	39,800	264.00	10,507,200
いちよし証券	27,800	646.00	17,958,800
松井証券	76,500	818.00	62,577,000
SOMPOホールディングス	234,000	5,961.00	1,394,874,000
日本取引所グループ	373,000	2,105.50	785,351,500
マネックスグループ	130,100	489.00	63,618,900
極東証券	18,900	681.00	12,870,900
岩井コスモホールディングス	14,700	1,244.00	18,286,800
アイザワ証券グループ	22,500	696.00	15,660,000
フィデアホールディングス	14,300	1,266.00	18,103,800
池田泉州ホールディングス	169,900	194.00	32,960,600
アニコムホールディングス	48,000	656.00	31,488,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	331,200	4,115.00	1,362,888,000
マネーパートナーズグループ	16,600	249.00	4,133,400
スパークス・グループ	72,300	253.00	18,291,900
小林洋行	3,200	224.00	716,800
第一生命ホールディングス	744,700	2,598.00	1,934,730,600

東京海上ホールディングス	457,600	7,572.00	3,464,947,200	
アドバンテッジリスクマネジメント	7,600	483.00	3,670,800	
イー・ギャランティ	22,900	1,972.00	45,158,800	
アサックス	8,400	601.00	5,048,400	
NECキャピタルソリューション	6,500	1,970.00	12,805,000	
T&Dホールディングス	367,200	1,579.00	579,808,800	
アドバンスクリエイト	7,500	968.00	7,260,000	
三井不動産	645,600	2,932.00	1,892,899,200	
三菱地所	936,500	1,994.00	1,867,381,000	
平和不動産	25,600	3,955.00	101,248,000	
東京建物	140,700	1,772.00	249,320,400	
京阪神ビルディング	21,700	1,282.00	27,819,400	
住友不動産	296,800	3,693.00	1,096,082,400	
太平洋興発	6,100	650.00	3,965,000	
テーオーシー	25,200	633.00	15,951,600	
東京楽天地	2,300	4,010.00	9,223,000	
レオパレス21	162,100	251.00	40,687,100	
スターツコーポレーション	21,200	2,576.00	54,611,200	
フジ住宅	18,300	646.00	11,821,800	
空港施設	15,800	542.00	8,563,600	
明和地所	7,400	622.00	4,602,800	
ゴールドクレスト	12,400	1,713.00	21,241,200	
リログループ	82,800	2,105.00	174,294,000	
エスリード	6,200	1,692.00	10,490,400	
日神グループホールディングス	25,700	446.00	11,462,200	
日本エスコン	29,100	769.00	22,377,900	
タカラレーベン	65,700	344.00	22,600,800	
A V A N T I A	7,700	846.00	6,514,200	
イオンモール	78,500	1,651.00	129,603,500	
毎日コムネット	5,500	681.00	3,745,500	
ファースト住建	6,000	1,111.00	6,666,000	
ランド	851,300	10.00	8,513,000	
カチタス	38,800	2,969.00	115,197,200	
東祥	11,400	1,351.00	15,401,400	
トーセイ	21,500	1,176.00	25,284,000	
穴吹興産	3,600	2,363.00	8,506,800	
サンフロンティア不動産	21,500	1,082.00	23,263,000	
FJネクストホールディングス	15,300	1,081.00	16,539,300	
インテリックス	3,600	610.00	2,196,000	
ランドビジネス	6,300	237.00	1,493,100	
サンネクスタグループ	5,100	1,174.00	5,987,400	
グランディハウス	10,900	538.00	5,864,200	
東武鉄道	148,000	3,055.00	452,140,000	
相鉄ホールディングス	48,200	2,302.00	110,956,400	
東急	379,500	1,534.00	582,153,000	
京浜急行電鉄	185,500	1,435.00	266,192,500	
小田急電鉄	211,700	1,771.00	374,920,700	
京王電鉄	73,800	4,625.00	341,325,000	
京成電鉄	99,100	3,640.00	360,724,000	
富士急行	17,300	4,140.00	71,622,000	

新京成電鉄	3,800	2,932.00	11,141,600
東日本旅客鉄道	254,400	7,043.00	1,791,739,200
西日本旅客鉄道	176,200	5,033.00	886,814,600
東海旅客鉄道	118,400	16,250.00	1,924,000,000
西武ホールディングス	196,500	1,405.00	276,082,500
鴻池運輸	23,400	1,193.00	27,916,200
西日本鉄道	40,000	2,848.00	113,920,000
ハマキョウレックス	10,700	2,963.00	31,704,100
サカイ引越センター	7,300	4,445.00	32,448,500
近鉄グループホールディングス	143,900	4,005.00	576,319,500
阪急阪神ホールディングス	179,600	3,615.00	649,254,000
南海電気鉄道	64,300	2,604.00	167,437,200
京阪ホールディングス	61,200	3,340.00	204,408,000
神戸電鉄	3,600	3,280.00	11,808,000
名古屋鉄道	151,700	2,210.00	335,257,000
山陽電気鉄道	11,100	2,104.00	23,354,400
アルプス物流	10,700	1,124.00	12,026,800
トランコム	4,300	6,450.00	27,735,000
ヤマトホールディングス	210,300	2,142.00	450,462,600
山九	37,500	3,910.00	146,625,000
日新	11,400	1,612.00	18,376,800
丸運	8,400	241.00	2,024,400
丸全昭和運輸	10,900	3,045.00	33,190,500
センコーグループホールディングス	72,300	859.00	62,105,700
トナミホールディングス	3,100	3,500.00	10,850,000
ニッコンホールディングス	48,100	2,098.00	100,913,800
日本石油輸送	900	2,551.00	2,295,900
福山通運	21,000	3,225.00	67,725,000
セイノーホールディングス	88,600	1,040.00	92,144,000
エスライン	4,600	857.00	3,942,200
神奈川中央交通	3,700	3,425.00	12,672,500
日立物流	28,900	8,570.00	247,673,000
丸和運輸機関	27,500	1,513.00	41,607,500
C & F ロジホールディングス	13,500	1,036.00	13,986,000
日本郵船	125,600	9,810.00	1,232,136,000
商船三井	237,500	3,230.00	767,125,000
川崎汽船	46,300	9,190.00	425,497,000
NSユナイテッド海運	7,500	3,950.00	29,625,000
明治海運	15,300	1,499.00	22,934,700
飯野海運	62,500	748.00	46,750,000
共栄タンカー	2,700	1,035.00	2,794,500
九州旅客鉄道	105,800	2,679.00	283,438,200
S Gホールディングス	262,800	2,275.00	597,870,000
NIPPON EXPRESSホールディングス	47,000	7,770.00	365,190,000
日本航空	330,000	2,357.00	777,810,000
ANAホールディングス	365,400	2,538.50	927,567,900
ピーウィズ	4,200	1,390.00	5,838,000
パスコ	2,800	1,314.00	3,679,200
TREホールディングス	25,900	1,969.00	50,997,100

人・夢・技術グループ	6,100	2,453.00	14,963,300	
西本Wismettacホールディングス	3,600	3,710.00	13,356,000	
シルバーライフ	3,100	1,786.00	5,536,600	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,300	1,899.00	2,468,700	
Genky DrugStores	6,800	3,340.00	22,712,000	
コア商事ホールディングス	9,700	834.00	8,089,800	
国際紙パルプ商事	29,900	429.00	12,827,100	
ナルミヤ・インターナショナル	3,600	907.00	3,265,200	
ブックオフグループホールディングス	9,100	986.00	8,972,600	
ギフトホールディングス	2,300	2,185.00	5,025,500	
三菱倉庫	41,900	3,185.00	133,451,500	
三井倉庫ホールディングス	15,000	2,996.00	44,940,000	
住友倉庫	46,800	2,104.00	98,467,200	
澁澤倉庫	8,000	2,272.00	18,176,000	
ヤマタネ	7,000	1,611.00	11,277,000	
東陽倉庫	23,000	305.00	7,015,000	
乾汽船	9,400	1,790.00	16,826,000	
日本トランスシティ	28,700	518.00	14,866,600	
ケイヒン	2,600	1,350.00	3,510,000	
中央倉庫	8,300	983.00	8,158,900	
川西倉庫	2,800	1,109.00	3,105,200	
安田倉庫	11,200	956.00	10,707,200	
ファイズホールディングス	3,200	797.00	2,550,400	
東洋埠頭	3,200	1,330.00	4,256,000	
上組	77,400	2,560.00	198,144,000	
サンリツ	4,200	763.00	3,204,600	
キムラユニティー	4,000	1,501.00	6,004,000	
キューソー流通システム	7,600	1,097.00	8,337,200	
近鉄エクスプレス	28,400	4,175.00	118,570,000	
東海運	8,800	295.00	2,596,000	
エーアイティー	9,400	1,492.00	14,024,800	
内外トランスライン	5,900	1,937.00	11,428,300	
ショーエイコーポレーション	4,300	581.00	2,498,300	
日本コンセプト	4,800	1,575.00	7,560,000	
TBSホールディングス	81,700	1,788.00	146,079,600	
日本テレビホールディングス	129,800	1,304.00	169,259,200	
朝日放送グループホールディングス	13,500	666.00	8,991,000	
テレビ朝日ホールディングス	37,400	1,540.00	57,596,000	
スカパーJSATホールディングス	132,000	502.00	66,264,000	
テレビ東京ホールディングス	10,000	2,008.00	20,080,000	
日本BS放送	5,300	1,058.00	5,607,400	
ビジョン	25,600	1,414.00	36,198,400	
スマートバリュー	3,600	513.00	1,846,800	
USEN-NEXT HOLDINGS	12,900	2,028.00	26,161,200	
ワイヤレスゲート	6,400	319.00	2,041,600	
コネクシオ	11,100	1,305.00	14,485,500	
日本通信	129,200	196.00	25,323,200	
クロップス	2,800	1,047.00	2,931,600	

日本電信電話	1,705,400	3,941.00	6,720,981,400	
KDDI	1,134,400	4,488.00	5,091,187,200	
ソフトバンク	2,356,900	1,470.00	3,464,643,000	
光通信	18,000	13,970.00	251,460,000	
エムティーアイ	13,200	457.00	6,032,400	
GMOインターネット	54,500	2,550.00	138,975,000	
ファイバーゲート	7,000	986.00	6,902,000	
アйдママーケティングコミュニケーション	3,600	323.00	1,162,800	
KADOKAWA	84,200	2,821.00	237,528,200	
学研ホールディングス	21,900	881.00	19,293,900	
ゼンリン	25,400	920.00	23,368,000	
昭文社ホールディングス	4,700	392.00	1,842,400	
インプレスホールディングス	12,900	220.00	2,838,000	
東京電力ホールディングス	1,186,600	508.00	602,792,800	
中部電力	460,300	1,266.00	582,739,800	
関西電力	570,000	1,227.00	699,390,000	
中国電力	235,200	836.00	196,627,200	
北陸電力	138,100	518.00	71,535,800	
東北電力	354,800	709.00	251,553,200	
四国電力	135,600	747.00	101,293,200	
九州電力	311,100	831.00	258,524,100	
北海道電力	137,800	476.00	65,592,800	
沖縄電力	33,600	1,212.00	40,723,200	
電源開発	123,100	2,168.00	266,880,800	
エフオン	9,600	566.00	5,433,600	
イーレックス	21,300	2,194.00	46,732,200	
レノバ	31,200	2,078.00	64,833,600	
東京瓦斯	289,500	2,714.00	785,703,000	
大阪瓦斯	273,600	2,583.00	706,708,800	
東邦瓦斯	65,700	3,235.00	212,539,500	
北海道瓦斯	7,900	1,624.00	12,829,600	
広島ガス	28,900	322.00	9,305,800	
西部ガスホールディングス	15,900	1,900.00	30,210,000	
静岡ガス	38,800	867.00	33,639,600	
メタウォーター	16,400	2,061.00	33,800,400	
アイネット	7,600	1,231.00	9,355,600	
松竹	9,400	13,300.00	125,020,000	
東宝	91,800	5,150.00	472,770,000	
エイチ・アイ・エス	32,200	2,220.00	71,484,000	
東映	4,700	18,120.00	85,164,000	
ラックランド	4,700	2,985.00	14,029,500	
エヌ・ティ・ティ・データ	414,400	1,949.00	807,665,600	
共立メンテナンス	27,100	5,020.00	136,042,000	
イチネンホールディングス	15,500	1,219.00	18,894,500	
建設技術研究所	8,100	2,581.00	20,906,100	
スペース	10,300	916.00	9,434,800	
アインホールディングス	19,700	7,080.00	139,476,000	
燦ホールディングス	6,600	1,815.00	11,979,000	
ピー・シー・エー	9,100	1,186.00	10,792,600	

スバル興業	600	8,780.00	5,268,000	
東京テアトル	6,000	1,232.00	7,392,000	
タナベ経営	5,000	683.00	3,415,000	
ビジネスブレイン太田昭和	4,900	1,475.00	7,227,500	
ナガワ	4,500	8,700.00	39,150,000	
東京都競馬	11,400	3,805.00	43,377,000	
常磐興産	5,600	1,302.00	7,291,200	
カナモト	25,500	2,030.00	51,765,000	
D T S	28,900	3,110.00	89,879,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	72,400	6,200.00	448,880,000	
シーイーシー	16,600	1,241.00	20,600,600	
カブコン	146,800	3,500.00	513,800,000	
西尾レントオール	13,100	2,847.00	37,295,700	
アイ・エス・ピー	7,300	1,052.00	7,679,600	
アゴーラ ホスピタリティグループ	84,200	25.00	2,105,000	
日本空港ビルデング	53,500	5,420.00	289,970,000	
トランス・コスモス	19,200	3,515.00	67,488,000	
乃村工藝社	65,100	914.00	59,501,400	
ジャステック	9,100	1,191.00	10,838,100	
S C S K	107,700	2,245.00	241,786,500	
藤田観光	6,600	2,941.00	19,410,600	
K N T - C Tホールディングス	9,400	1,735.00	16,309,000	
日本管財	16,200	2,570.00	41,634,000	
トーカイ	12,500	1,667.00	20,837,500	
白洋舎	1,600	1,540.00	2,464,000	
セコム	149,200	8,521.00	1,271,333,200	
日本システムウエア	6,000	2,487.00	14,922,000	
セントラル警備保障	7,300	2,248.00	16,410,400	
アイネス	13,100	1,549.00	20,291,900	
丹青社	29,300	838.00	24,553,400	
メイテック	18,000	6,900.00	124,200,000	
T K C	24,600	3,320.00	81,672,000	
富士ソフト	15,400	7,400.00	113,960,000	
応用地質	15,300	1,801.00	27,555,300	
船井総研ホールディングス	29,200	2,111.00	61,641,200	
N S D	48,700	2,391.00	116,441,700	
進学会ホールディングス	5,000	355.00	1,775,000	
丸紅建材リース	900	1,912.00	1,720,800	
オオバ	9,800	774.00	7,585,200	
コナミホールディングス	56,400	8,590.00	484,476,000	
いであ	3,900	1,796.00	7,004,400	
学究社	4,900	1,578.00	7,732,200	
ベネッセホールディングス	50,500	2,069.00	104,484,500	
イオンディライト	17,600	2,850.00	50,160,000	
ナック	7,500	955.00	7,162,500	
福井コンピュータホールディングス	7,100	3,280.00	23,288,000	
ダイセキ	27,600	4,820.00	133,032,000	
ステップ	5,600	1,742.00	9,755,200	

日鉄物産	10,000	5,280.00	52,800,000	
泉州電業	4,000	5,640.00	22,560,000	
元気寿司	4,500	2,511.00	11,299,500	
トラスコ中山	32,400	1,808.00	58,579,200	
ヤマダホールディングス	568,300	471.00	267,669,300	
オートバックスセブン	49,700	1,383.00	68,735,100	
モリト	11,500	764.00	8,786,000	
アークランドサカモト	24,500	1,502.00	36,799,000	
ニトリホールディングス	61,900	12,430.00	769,417,000	
グルメ杵屋	12,700	1,014.00	12,877,800	
愛眼	8,300	187.00	1,552,100	
ケーユーホールディングス	8,100	1,078.00	8,731,800	
吉野家ホールディングス	54,500	2,480.00	135,160,000	
加藤産業	18,800	3,075.00	57,810,000	
北恵	4,000	897.00	3,588,000	
イノテック	9,400	1,356.00	12,746,400	
イエローハット	25,400	1,615.00	41,021,000	
松屋フーズホールディングス	7,500	3,820.00	28,650,000	
JBCホールディングス	10,700	1,628.00	17,419,600	
JKホールディングス	11,500	936.00	10,764,000	
サガミホールディングス	22,800	1,150.00	26,220,000	
日伝	11,400	1,972.00	22,480,800	
関西フードマーケット	13,700	1,241.00	17,001,700	
ミロク情報サービス	13,800	1,170.00	16,146,000	
北沢産業	7,800	217.00	1,692,600	
杉本商事	7,400	2,223.00	16,450,200	
因幡電機産業	39,800	2,695.00	107,261,000	
王将フードサービス	10,400	6,780.00	70,512,000	
プレナス	17,600	1,933.00	34,020,800	
ミニストップ	11,700	1,404.00	16,426,800	
アークス	28,400	1,953.00	55,465,200	
バローホールディングス	32,700	1,826.00	59,710,200	
東テク	4,900	2,905.00	14,234,500	
ミスミグループ本社	195,900	2,977.00	583,194,300	
アルテック	10,300	236.00	2,430,800	
ベルク	6,900	5,170.00	35,673,000	
大庄	8,300	1,170.00	9,711,000	
タキヒヨー	4,500	1,072.00	4,824,000	
ファーストリテイリング	20,900	69,180.00	1,445,862,000	
ソフトバンクグループ	933,100	5,545.00	5,174,039,500	
蔵王産業	2,300	1,999.00	4,597,700	
スズケン	57,800	3,495.00	202,011,000	
サンドラッグ	58,800	2,890.00	169,932,000	
サックスパーホールディングス	14,700	576.00	8,467,200	
ジェコス	11,000	841.00	9,251,000	
ヤマザワ	3,000	1,512.00	4,536,000	
やまや	3,200	2,500.00	8,000,000	
グローセル	17,700	408.00	7,221,600	
ベルーナ	33,500	685.00	22,947,500	
合計	167,231,100		404,656,708,760	

( 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6月30日現在

資産総額	2,337,488,141円
負債総額	2,880,493円
純資産総額( - )	2,334,607,648円
発行済数量	1,560,225,905口
1口当たり純資産額( / )	1.4963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6月30日現在

資産総額	440,973,778,613円
負債総額	42,213,873,093円
純資産総額( - )	398,759,905,520円
発行済数量	126,898,412,740口
1口当たり純資産額( / )	3.1424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。

## 第二部【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6月30日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構（2022年6月30日現在）

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

##### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

##### 2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年6月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,478,276,781,447
追加型株式投資信託	809	14,302,967,516,746
単位型公社債投資信託	26	50,827,152,396
単位型株式投資信託	221	1,095,208,940,961
合計	1,082	16,927,280,391,550

### 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。
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期事業年度の財務諸表及び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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第37期事業年度(自2021年4月1日至2022年3月31日)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：百万円 )

	第36期 ( 2021年3月31日現在 )	第37期 ( 2022年3月31日現在 )
( 資産の部 )		
流動資産		
現金・預金	36,734	31,421
金銭の信託	25,670	30,332
未収委託者報酬	16,804	17,567
未収運用受託報酬	5,814	4,348
未収投資助言報酬	317	309
未収収益	7	5
前払費用	724	1,167
その他	2,419	2,673
流動資産計	88,493	87,826
固定資産		
有形固定資産	1,119	1,268
建物	1 915	1 1,109
器具備品	1 202	1 158
建設仮勘定	0	-
無形固定資産	3,991	4,561
ソフトウェア	2,878	3,107
ソフトウェア仮勘定	1,109	1,449
電話加入権	3	3
投資その他の資産	11,153	10,153
投資有価証券	261	241
関係会社株式	5,299	5,349
長期差入保証金	1,324	1,102
繰延税金資産	3,676	3,092
その他	591	367
固定資産計	16,264	15,983
資産合計	104,757	103,810

(単位:百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	3,730	1,445
未払金	7,337	7,616
未払収益分配金	0	0
未払償還金	9	9
未払手数料	6,889	7,430
その他未払金	437	175
未払費用	9,713	8,501
未払法人税等	4,199	2,683
未払消費税等	2,106	1,330
賞与引当金	1,789	1,933
役員賞与引当金	76	69
流動負債計	28,954	23,581
固定負債		
退職給付引当金	2,292	2,507
時効後支払損引当金	157	147
固定負債計	2,450	2,655
負債合計	31,404	26,236
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金	19,552	19,552
資本準備金	2,428	2,428
その他資本剰余金	17,124	17,124
利益剰余金	51,800	56,020
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	51,676	55,896
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	19,996	24,216
株主資本計	73,353	77,573
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	0	0
評価・換算差額等計	0	0
純資産合計	73,353	77,573
負債・純資産合計	104,757	103,810



## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	89,905		108,563	
運用受託報酬	17,640		16,716	
投資助言報酬	1,103		1,587	
その他営業収益	781		12	
営業収益計		109,430		126,879
営業費用				
支払手数料	37,003		45,172	
広告宣伝費	424		391	
公告費	0		0	
調査費	30,794		36,488	
調査費	11,302		10,963	
委託調査費	19,491		25,525	
委託計算費	543		557	
営業雑経費	938		842	
通信費	46		35	
印刷費	680		606	
協会費	71		66	
諸会費	23		26	
支払販売手数料	116		106	
営業費用計		69,704		83,453
一般管理費				
給料	10,586		10,377	
役員報酬	163		168	
給料・手当	9,030		8,995	
賞与	1,392		1,213	
交際費	8		6	
寄付金	7		15	
旅費交通費	50		40	
租税公課	912		367	
不動産賃借料	1,499		1,674	
退職給付費用	524		495	
固定資産減価償却費	1,078		1,389	
福利厚生費	44		42	
修繕費	0		0	
賞与引当金繰入額	1,789		1,933	
役員賞与引当金繰入額	76		69	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,793		3,901	
事務用消耗品費	68		45	
器具備品費	0		0	
諸経費	152		217	
一般管理費計		20,594		20,578
営業利益		19,132		22,848

(単位:百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	27		13	
受取配当金	2		1	559
時効成立分配金・償還金	0			0
為替差益	7			7
金銭の信託運用益	1,229			-
雑収入	13			19
時効後支払損引当金戻入額	13			10
営業外収益計		1,293		610
営業外費用				
投資信託償還損	0			-
金銭の信託運用損	-			743
早期割増退職金	48			20
雑損失	0			-
営業外費用計		48		764
経常利益		20,376		22,694
特別利益				
固定資産売却益	-			0
特別利益計		-		0
特別損失				
固定資産除却損	1			5
投資有価証券売却損	-			6
ゴルフ会員権売却損	-			3
オフィス再編費用	-		2	509
特別損失計		1		525
税引前当期純利益		20,375		22,169
法人税、住民税及び事業税		7,418		6,085
法人税等調整額		1,168		584
法人税等合計		6,249		6,669
当期純利益		14,125		15,499

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		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		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	17,871	49,674	71,227
当期変動額									
剰余金の配当							12,000	12,000	12,000
当期純利益							14,125	14,125	14,125
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	2,125	2,125
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996	51,800	73,353

	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	0	0	71,227
当期変動額			
剰余金の配当			12,000
当期純利益			14,125
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	2,125
当期末残高	0	0	73,353

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		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		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	51,800	73,353
当期変動額									
剰余金の配当							11,280	11,280	11,280
当期純利益							15,499	15,499	15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	4,219	4,219	4,219
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573

	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	0	0	73,353
当期変動額			
剰余金の配当			11,280
当期純利益			15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	4,219
当期末残高	0	0	77,573

## 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 市場価格のない株式等以外のもの 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) 市場価格のない株式等 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。 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 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 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 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。 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。 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 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. 収益及び費用の計上基準	<p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。</p> <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回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、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回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、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回又は4回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、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

（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

当社は、当事業年度において、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、当事業年度において、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、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ334百万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。

## 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。

## （未適用の会計基準等）

・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）

## (1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分法相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

## (2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2022年4月1日に開始する事業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

(百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
建物	407	415
器具備品	978	966

(損益計算書関係)

## 1. 各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

(百万円)

	第36期 (自2020年4月1日 至2021年3月31日)	第37期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)
受取配当金	-	543

## 2. オフィス再編費用

オフィス再編費用は、主に本社オフィスレイアウトの見直しによるものです。

(株主資本等変動計算書関係)

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 (百万円)	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	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

決議	株式の 種類	配当の 原資	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	利益 剰余金	11,280	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種 類株式					



## 第37期(自 2021年4月1日 至 2022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 (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  
2022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 (百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,360	309,000	2022年3月31日	2022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。

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

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

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

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてあります。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。

## 第36期(2021年3月31日現在)

	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	25,670	25,670	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	25,672	25,672	-

## 第37期(2022年3月31日現在)

	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	30,332	30,332	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	30,334	30,334	-

(注1) 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。

(注2) 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36期(2021年3月31日現在)

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	36,734	-	-	-
(2) 金銭の信託	25,670	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,804	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	85,024	1	-	-

## 第37期(2022年3月31日現在)

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	31,421	-	-	-
(2) 金銭の信託	30,332	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	17,567	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,348	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	83,670	1	-	-

### 3. 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
(1) 金銭の信託	-	6,932	-	6,932
(2) 投資有価証券	-	-	-	-
その他有価証券	-	-	-	-
資産計	-	6,932	-	6,932

「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）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。貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託23,399百万円、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、2. 金融商品の時価等に関する事項及び3. 金融商品の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。

（百万円）

	第36期 （2021年3月31日現在）	第37期 （2022年3月31日現在）
投資有価証券（その他有価証券）		
非上場株式	259	239
関係会社株式		
非上場株式	5,299	5,349

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式(第36期の貸借対照表計上額5,299百万円、第37期の貸借対照表計上額5,349百万円)については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

## 2. その他有価証券

第36期(2021年3月31日現在)

(百万円)

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	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

(注) 非上場株式(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。

第37期(2022年3月31日現在)

(百万円)

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	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額239百万円)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。

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

## 第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
投資信託	0	-	0

(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。

## 第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
株式	13	-	6

## (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

(百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,422	2,479
勤務費用	303	295
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	4	14
退職給付の支払額	245	185
過去勤務費用の発生額	1	-
その他	1	-
退職給付債務の期末残高	2,479	2,576

## (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

(百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,479	2,576
未積立退職給付債務	2,479	2,576
未認識数理計算上の差異	84	35
未認識過去勤務費用	102	33
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,292	2,507
退職給付引当金	2,292	2,507
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,292	2,507

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
勤務費用	303	295
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	41	34
過去勤務費用の費用処理額	69	69
その他	7	3
確定給付制度に係る退職給付費用	409	398

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、前事業年度において48百万円、当事業年度において20百万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36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 3.76%	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100百万円、当事業年度97百万円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第36期	第37期
	(2021年3月31日現在)	(2022年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	260	156
未払事業所税	10	10
賞与引当金	547	592
未払法定福利費	92	92
運用受託報酬	1,410	845
資産除去債務	18	13
減価償却超過額(一括償却資産)	25	12
減価償却超過額	51	58
繰延資産償却超過額(税法上)	301	292
退職給付引当金	701	767
時効後支払損引当金	48	45
ゴルフ会員権評価損	7	7
関係会社株式評価損	166	166
投資有価証券評価損	28	28
その他	3	2
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産小計	3,676	3,092
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	3,676	3,092
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	3,676	3,092

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	144,212百万円
取得原価		144,212百万円

## (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

## (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。

## (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

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
流動資産	- 百万円	- 百万円
固定資産	84,609百万円	76,763百万円
資産合計	84,609百万円	76,763百万円
流動負債	- 百万円	- 百万円
固定負債	5,570百万円	4,740百万円
負債合計	5,570百万円	4,740百万円
純資産	79,038百万円	72,022百万円

(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	59,074百万円	55,263百万円
顧客関連資産	29,793百万円	25,175百万円

## (2) 損益計算書項目

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	8,823百万円	8,429百万円
経常利益	8,823百万円	8,429百万円
税引前当期純利益	8,823百万円	8,429百万円
当期純利益	7,288百万円	7,015百万円
1株当たり当期純利益	182,220円85銭	175,380円68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	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	5,016百万円	4,618百万円

(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。

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当事業年度の収益の構成は次の通りです。

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
委託者報酬	108,259百万円
運用受託報酬	14,425百万円
投資助言報酬	1,587百万円
成功報酬(注)	2,594百万円
その他営業収益	12百万円
合計	126,879百万円

(注) 成功報酬は、損益計算書において委託者報酬及び運用受託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. 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)

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36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)及び第37期(自 2021年4月1日 至 2022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36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

第37期(自 2021年4月1日 至 2022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36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

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 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						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	未払 手数料	1,457
	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	未払 手数料	2,524

第37期(自 2021年4月1日 至 2022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 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						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	7,789	未払 手数料	1,592
	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	16,373	未払 手数料	2,651

## 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36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1株当たり純資産額	1,833,828円44銭	1,939,327円79銭
1株当たり当期純利益金額	353,145円08銭	387,499円36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36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益金額	14,125百万円	15,499百万円
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当期純利益金額	14,125百万円	15,499百万円
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	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

委託会社は、アストマックス株式会社からPayPayアセットマネジメント株式会社(以下「PPAM」といいます。 )の発行済株式の49.9%を2022年8月1日付で譲り受けており、同日付でPPAMは委託会社の関連会社となりました。

##### (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（2022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
株式会社北都銀行	12,500	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社荘内銀行	8,500	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社第四北越銀行（ 1）	30,000	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（ 1）	140,409	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社静岡銀行	90,845	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社三十三銀行（ 1）	37,400	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社筑邦銀行（ 1）	8,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社佐賀銀行（ 1）	16,062	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社琉球銀行（ 1）	56,967	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北洋銀行（ 1）	121,101	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社愛知銀行（ 1）	18,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社高知銀行（ 1）	19,544	日本において銀行業務を営んでおります。
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。
北洋証券株式会社（ 1）	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	（ 2）17,495	「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。

（注）資本金の額は2022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おりません。

（ 2）2021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ならびに収益分配金、償還金および一部解約金の支払等を行います。

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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2021年9月10日	有価証券報告書
2021年9月10日	有価証券届出書
2022年3月10日	半期報告書
2022年3月10日	有価証券届出書

## 独立監査人の監査報告書

2022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 公認会計士 丘本 正彦  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている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2022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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

## 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) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

2022年8月12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トピックスファンドの2021年6月11日から2022年6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トピックスファンドの2022年6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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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。