

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券報告書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2022年12月12日提出
<b>【計算期間】</b>	第53期(自 2022年3月11日至 2022年9月12日)
<b>【ファンド名】</b>	MHAMスリーウェイオープン
<b>【発行者名】</b>	アセットマネジメントOne株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 菅野 暁
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	酒井 隆
<b>【連絡場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【電話番号】</b>	03-6774-5100
<b>【縦覧に供する場所】</b>	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】

わが国の金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所をいいます。以下同じ。)に上場(これに準ずるものを含みます。)されている株式・公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、信託財産の安定的な成長を目標として運用を行います。

##### <ファンドの特色>

・わが国の3資産(株式・債券・短期金融資産)に分散投資します。

・「TAAモデル」の指示により、資産配分を行います。

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

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

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

##### <商品分類>

###### ・商品分類表

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

(注)当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

###### ・商品分類定義

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## ・属性区分定義

資産複合 (株式、債券、短期金融 資産、その他資産(投 資信託証券(株 式))) 資産配分変更型	目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、括弧内の記載はその該当複数資産を表す。 当ファンドでの株式への投資は、マザーファンド受益証券(投資信託証券)を通じて行うことがあります。
年2回	目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
日本	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。

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

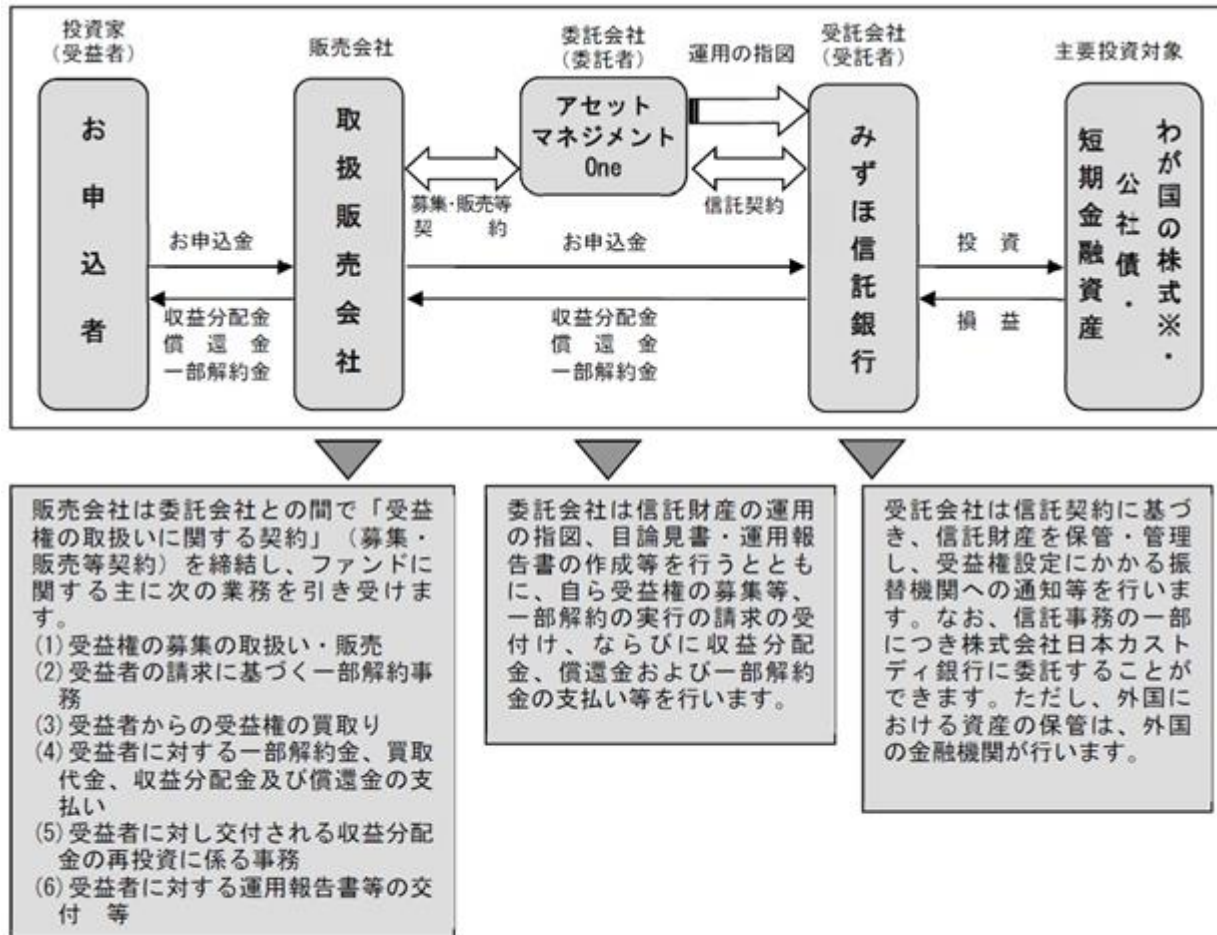
(注2) 当ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)でご覧いただけます。

## (2) 【ファンドの沿革】

1993年11月26日	信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
1998年11月30日	当ファンドの信託期間を無期限に変更 当ファンドの決算を年1回(9月10日)から年2回(3月10日および9月10日)に変更 当ファンドの投資対象に「富士TOPIXオープンマザーファンド」を追加
1998年12月1日	1口当たり元本額を1万円から1円に変更するための受益権分割を実施
2007年1月4日	投資信託振替制度へ移行
2007年7月1日	当ファンドの名称を「富士スリーウェイオープン」から「MHAMスリーウェイオープン」に変更
2016年10月1日	ファンドの委託会社としての業務をみずほ投信投資顧問株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継
2021年7月2日	ファンドの主要投資対象に「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」を追加
2021年12月17日	ファンドの主要投資対象から「MHAM TOPIXマザーファンド」を削除

## (3) 【ファンドの仕組み】

## 当ファンドの運営の仕組み



※ 主要投資対象の内、わが国の株式には、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドを通じて投資を行う場合があります。

## 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

## 資本金の額

20億円（2022年9月30日現在）

## 委託会社の沿革

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

- 2008年1月1日 「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更
- 2016年10月1日 D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社(資産運用部門)が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

## 大株主の状況

(2022年9月30日現在)

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 <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、わが国の株式、債券および短期金融資産の組入比率の変更を、原則としてT A Aモデル(タクティカル・アセット・アロケーション・モデル)の指示により機動的に行い、信託財産の安定的な成長を目標として運用を行います。

#### 運用方法

##### 1. 主要投資対象

わが国の金融商品取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている株式、公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。なお、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組入れることもあります。

株式への投資は、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への投資を通じて行う場合があります。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ます。

東証株価指数(TOPIX)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。

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

東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、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JPXは責任を負いません。

## 2. 投資態度

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

アロケーションとは、株式や債券等の各資産間の配分をいいます。

### 分散投資の効果

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

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

ただし、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組入れる場合は、東証株価指数(TOPIX、配当込み)に連動する投資成果を目標とします。

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

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

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

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

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

## ファンドの投資プロセス

当ファンドは、以下の投資プロセスにより運用を行います。

#### 1．運用方針についての考え方

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

#### 2．モデルの指示に基づく一貫した投資手法

当ファンドは、投資情報の数理的分析等に基づくアセットマネジメントOne独自の投資モデル(TAAモデル)を採用しています。モデルの採用により、より効率的な運用・高度なリスクコントロールの追求が可能になるとともに、運用プロセス全体が明確になります。また、モデルを使ったシステム運用は、常に一貫した手法が用いられるため、運用手法・運用内容が運用担当者の主観や判断および交代などの影響を受けにくいことが特徴です。

#### 3．機動的なアロケーション変更

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

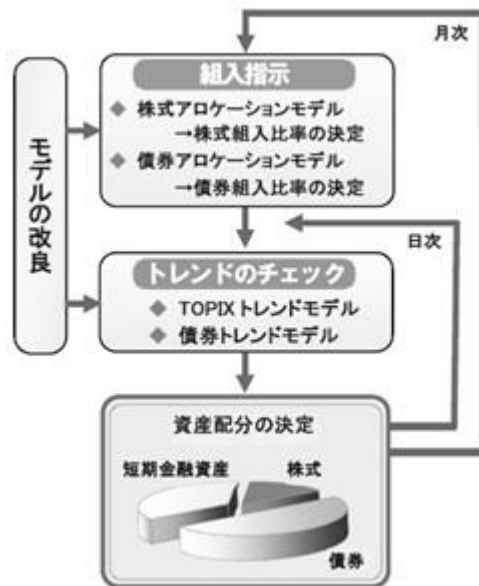
トレンドとは、相場の上昇や下降等の傾向のことをいいます。

#### 4．モデルの改良

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



## T A A モデルの構成



## 株式アロケーションモデル

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

## 債券アロケーションモデル

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

以上2種類のモデルにより、資産配分比率の月次の基本方針を決定します。

## TOPIXトレンドモデル

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

## 債券トレンドモデル

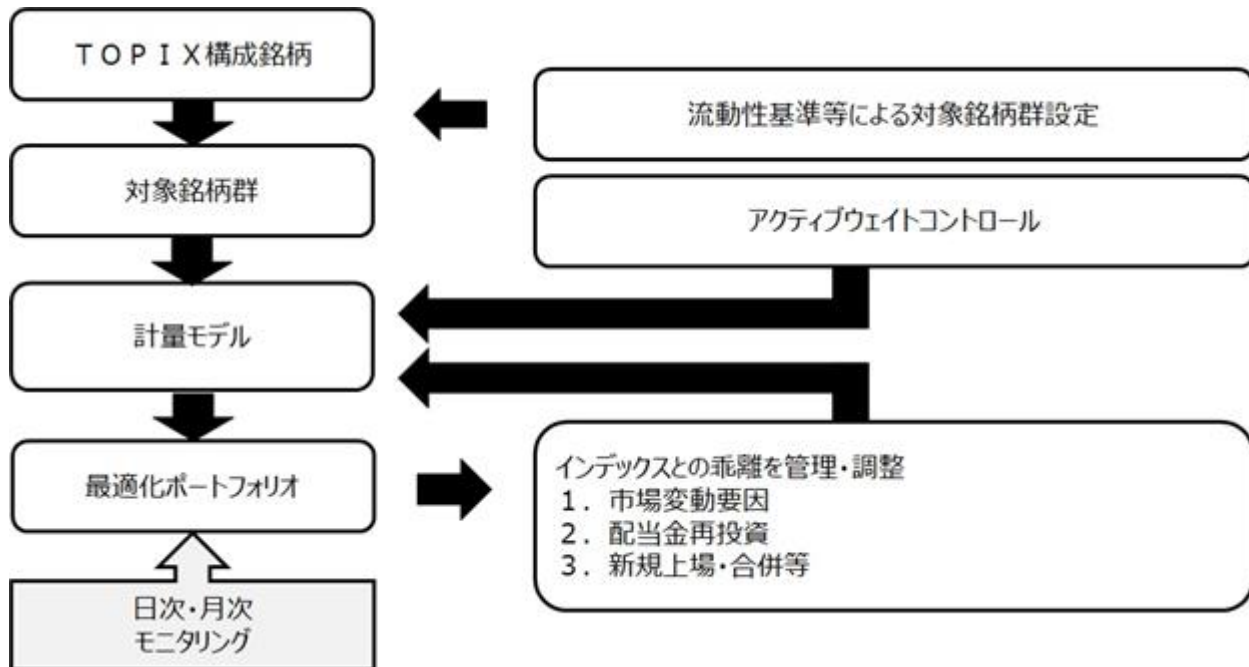
主に市場データを基に債券市場の方向性とその強さ（トレンド）を統計的手法により分析し、日次で債券組入比率の調整を決定するモデルです。

以上2種類のトレンドモデルにより、日次で資産配分比率の変更を行います。

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

## <国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの投資プロセス>

当ファンドは、株式運用部分について、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を組入れる場合があります。国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの具体的な投資プロセスは以下の通りです。



### 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】

### 有価証券の指図範囲

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

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

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

### 金融商品の指図範囲

委託会社は、信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）および抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）ならびに次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。また、前記 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を以下に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

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

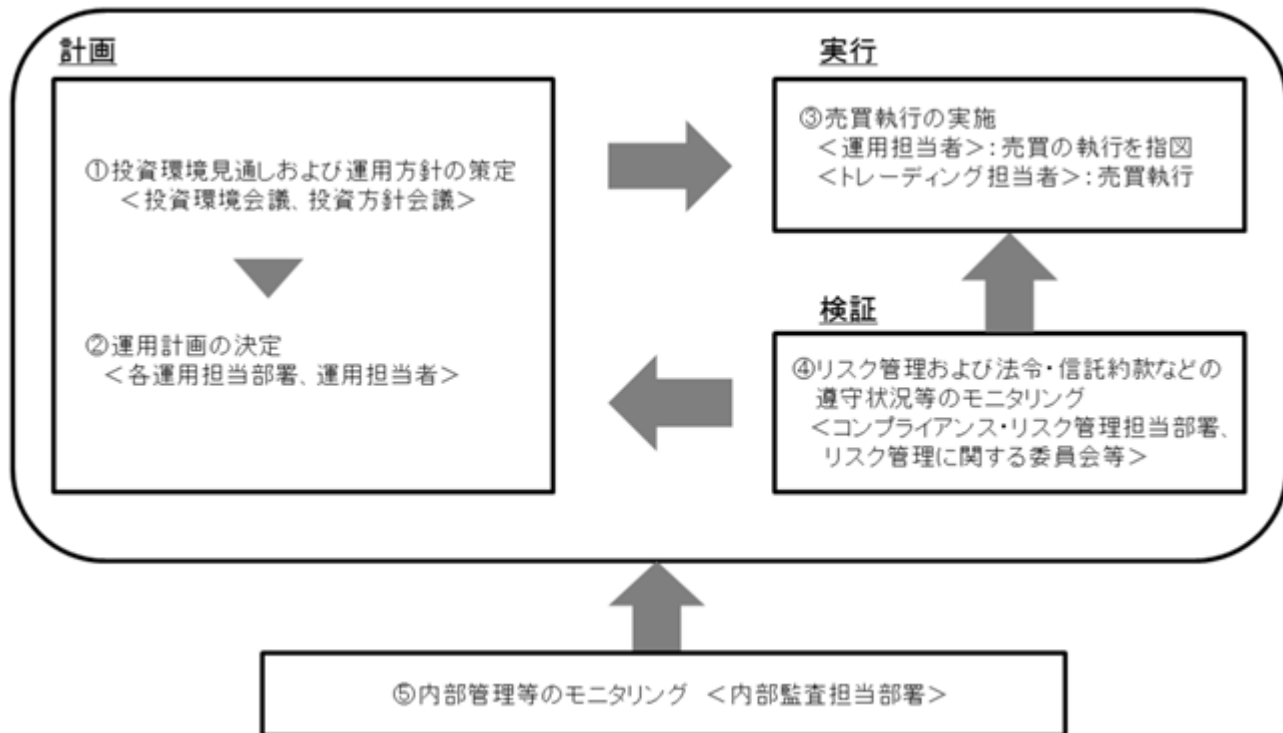
### その他の投資対象

有価証券先物取引等

委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を約款に規定する範囲で行うことができます。

### （3）【運用体制】

#### a. ファンドの運用体制



#### 投資環境見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。

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

## 内部管理等のモニタリング

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

### b. ファンドの関係法人に関する管理

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

### c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2022年9月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

## (4) 【分配方針】

### 収益分配方針

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

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

分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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

将来の収益分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

### 収益分配金の支払い

1. 収益分配金は、原則として毎計算期間終了日から起算して5営業日までに販売会社において支払いが開始されます。
2. 自動払いぞく投資約款に基づく契約に基づいて収益分配金を再投資することにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

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

#### (5)【投資制限】

##### a. 約款で定める投資制限

株式および新株引受権証券等(約款第21条、第22条および第23条)

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

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

2. 委託会社は、新株引受権証券等への実質投資割合が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
3. 委託会社は、同一銘柄の株式への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
4. 委託会社は、同一銘柄の新株引受権証券等への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
5. 委託会社が投資することを指図する株式および新株引受権証券等は、わが国の証券取引所(「証券取引所」とは、金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場(以下「取引所」といいます。))のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。)に上場(上場予定を含みます。)されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式および新株引受権証券等についてはこの限りではありません。

転換社債等(約款第26条)

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下、会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。(両者および前記(2)投資対象 有価証券の指図範囲8.において同様の性質を有するものを総称して「転換社債等」といいます。))への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図はしません。

信用リスク集中回避のための投資制限(約款第23条の1の2)

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、

原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

#### デリバティブ取引等(約款第23条の2)

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

#### 有価証券先物取引等(約款第24条)

1. 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。)
  - a. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
  - b. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに前記(2)投資対象 金融商品の指図範囲1.から4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
  - c. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、この で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲とします。
2. 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびにこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、現物オプション取引は預金に限るものとします。
  - a. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前記(2)投資対象 金融商品の指図範囲1.から4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
  - b. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに前記(2)投資対象 金融商品の指図範囲1.から4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

- c. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つこので規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

#### 公社債(約款第25条)

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

#### 資金の借入れ(約款第32条の2)

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
2. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
4. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

#### b. 法令で定める投資制限

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

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって取得することを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、値動きのある有価証券等に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。したがって、元本や一定の投資成果が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。
- ・運用により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者の皆様に帰属します。
- ・投資信託は預金商品や保険商品ではなく、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
- ・登録金融機関が取扱う投資信託は、投資者保護基金の対象ではありません。
- ・投資信託は預貯金とは異なります。
- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

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

#### 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

#### 金利変動リスク

金利の上昇（公社債の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

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

#### 信用リスク

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

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

## 流動性リスク

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

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

### <その他>

- ・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。
- ・当ファンドの株式運用部分として、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を組入れる場合があります。そのため、同マザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用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。

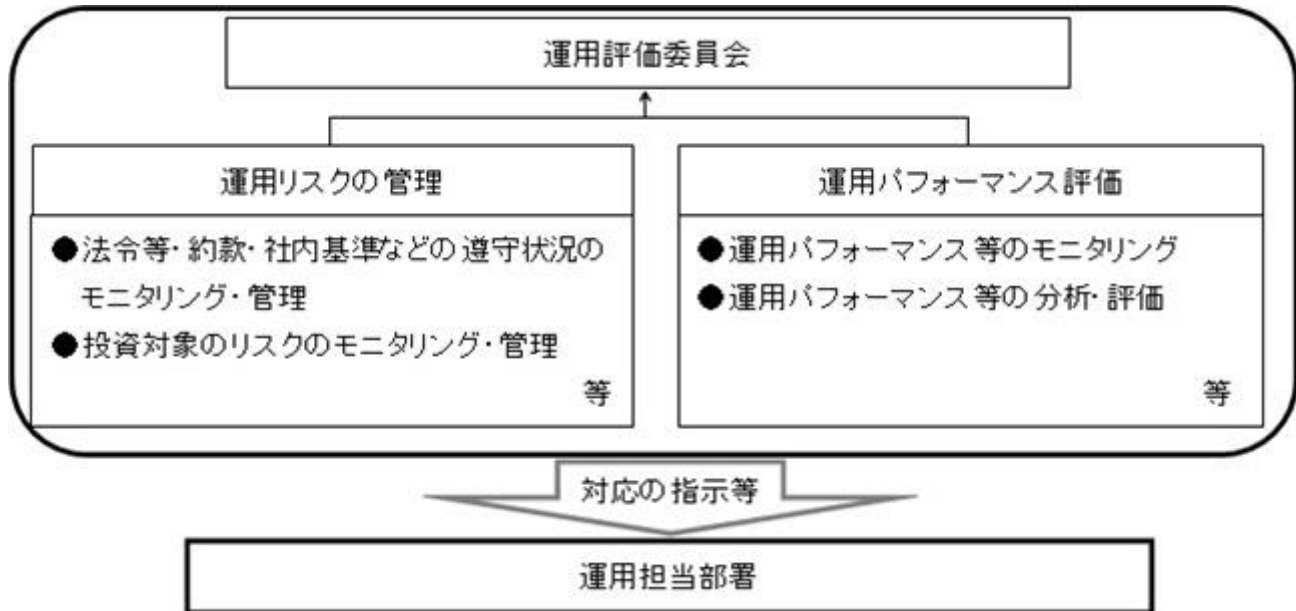
### <収益分配金に関する留意点>

- ・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。

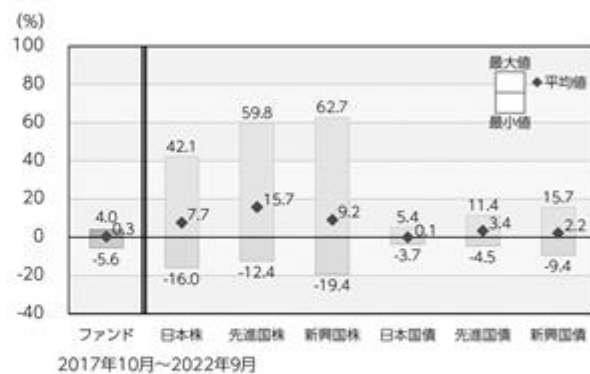
リスク管理体制は2022年9月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <参考情報>

### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



※ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。なお、分配金再投資基準価額は、1999年1月4日の当ファンドの基準価額(9,967円)に合わせて指数化しています。

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

※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商標または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる商標または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

通常のお申込みの場合

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

確定拠出年金制度に基づくお申込みの場合

無手数料とします。

申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。

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

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

#### < 申込手数料を対価とする役務の内容 >

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

### (2)【換金(解約)手数料】

ありません。

### (3)【信託報酬等】

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

その配分(税抜)については、以下の通りとなります。

委託会社	販売会社	受託会社
0.40%	0.35%	0.10%

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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

< 信託報酬等を対価とする役務の内容 >

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

解約(換金)時および償還時の差損(譲渡損)については、確定申告を行うことにより上場株式等(上場株式、上場投資信託(ETF)、上場不動産投資信託(REIT)、公募株式投資信託および特定公社債等(公募公社債投資信託を含みます。))など。以下同じ。)の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額(配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、)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9月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

#### 個別元本方式について

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

##### < 個別元本について >

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

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



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

<収益分配金の課税について>

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

2022年9月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	3,446,279,800	48.18
内 日本	3,446,279,800	48.18
親投資信託受益証券	1,751,646,125	24.49
内 日本	1,751,646,125	24.49
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,955,666,439	27.34
純資産総額	7,153,592,364	100.00

## その他資産の投資状況

2022年9月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（売建）	514,080,000	7.19
内 日本	514,080,000	7.19
債券先物取引（買建）	889,800,000	12.44
内 日本	889,800,000	12.44

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

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

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

## (参考)

## 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9月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	336,234,294,360	96.33
内 日本	336,234,294,360	96.33
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	12,797,044,795	3.67
純資産総額	349,031,339,155	100.00

## その他資産の投資状況

2022年9月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	13,072,320,000	3.75
内 日本	13,072,320,000	3.75

(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9月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
----	-----------------	----	----	---------------------	---------------------	------------------	-----------------

1	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	561,857,238	3.3271 1,869,411,402	3.1176 1,751,646,125	- -	24.49
2	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	600,000,000	100.56 603,378,000	100.43 602,592,000	0.1 2026/3/20	8.42
3	71回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証 券	200,000,000	104.05 208,106,000	103.86 207,728,000	2.2 2024/6/20	2.90
4	151回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証 券	200,000,000	99.95 199,908,000	99.86 199,732,000	0.005 2027/3/20	2.79
5	15回 利付国庫債券(40年) 日本	国債証 券	220,000,000	88.80 195,373,200	85.90 188,984,400	1 2062/3/20	2.64
6	141回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	150,000,000	113.94 170,919,000	113.70 170,557,500	1.7 2032/12/20	2.38
7	100回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	140,000,000	111.64 156,296,000	111.40 155,965,600	2.2 2028/3/20	2.18
8	57回 利付国庫債券(30年) 日本	国債証 券	170,000,000	92.24 156,814,800	90.41 153,712,300	0.8 2047/12/20	2.15
9	180回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	150,000,000	97.93 146,899,500	96.66 144,994,500	0.8 2042/3/20	2.03
10	333回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	130,000,000	101.06 131,380,600	100.99 131,292,200	0.6 2024/3/20	1.84
11	15回 利付国庫債券(30年) 日本	国債証 券	100,000,000	123.60 123,600,000	123.15 123,150,000	2.5 2034/6/20	1.72
12	142回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	100,000,000	114.94 114,942,000	114.69 114,694,000	1.8 2032/12/20	1.60
13	145回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	100,000,000	114.12 114,126,000	113.82 113,821,000	1.7 2033/6/20	1.59
14	102回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	100,000,000	113.22 113,220,000	112.96 112,967,000	2.4 2028/6/20	1.58
15	105回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	100,000,000	111.93 111,932,000	111.65 111,659,000	2.1 2028/9/20	1.56
16	97回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証 券	100,000,000	110.73 110,736,000	110.53 110,537,000	2.2 2027/9/20	1.55
17	171回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	120,000,000	91.78 110,144,400	90.78 108,943,200	0.3 2039/12/20	1.52

18	10回 利付国庫債券(30年) 日本	国債証券	100,000,000	107.87 107,879,000	107.62 107,622,000	1.1 2033/3/20	1.50
19	73回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	100,000,000	104.73 104,738,000	104.54 104,543,000	2 2024/12/20	1.46
20	364回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	100,000,000	98.67 98,676,000	98.42 98,425,000	0.1 2031/9/20	1.38
21	156回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	100,000,000	97.98 97,989,000	97.32 97,327,000	0.4 2036/3/20	1.36
22	167回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	100,000,000	96.23 96,235,000	95.28 95,284,000	0.5 2038/12/20	1.33
23	170回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	100,000,000	92.09 92,096,000	91.16 91,169,000	0.3 2039/9/20	1.27
24	148回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	60,000,000	112.10 67,264,800	111.74 67,048,200	1.5 2034/3/20	0.94
25	140回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	20,000,000	113.89 22,778,800	113.60 22,720,000	1.7 2032/9/20	0.32
26	151回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	10,000,000	108.65 10,865,600	108.11 10,811,900	1.2 2034/12/20	0.15

(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9月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	48.18
親投資信託受益証券	24.49
合計	72.66

(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9月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	6,534,300	2,196.52 14,352,770,366	1,876.00 12,258,346,800	- -	3.51
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	897,900	12,220.07 10,972,408,802	9,286.00 8,337,899,400	- -	2.39

3	キーエンス 日本	株式 電気機器	129,900	54,582.94 7,090,323,911	47,900.00 6,222,210,000	- -	1.78
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通 信業	1,576,400	3,620.37 5,707,163,679	3,906.00 6,157,418,400	- -	1.76
5	三菱UFJフィナンシャ ル・グループ 日本	株式 銀行業	8,274,800	748.76 6,195,852,443	651.50 5,391,032,200	- -	1.54
6	任天堂 日本	株式 その他製 品	809,000	5,886.77 4,762,401,505	5,854.00 4,735,886,000	- -	1.36
7	KDDI 日本	株式 情報・通 信業	1,025,300	4,051.70 4,154,214,982	4,243.00 4,350,347,900	- -	1.25
8	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,126,600	3,589.88 4,044,359,389	3,767.00 4,243,902,200	- -	1.22
9	日立製作所 日本	株式 電気機器	689,400	6,184.68 4,263,719,572	6,114.00 4,214,991,600	- -	1.21
10	第一三共 日本	株式 医薬品	1,039,700	2,746.78 2,855,835,275	4,042.00 4,202,467,400	- -	1.20
11	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通 信業	843,400	5,323.80 4,490,098,241	4,900.00 4,132,660,000	- -	1.18
12	リクルートホールディン グス 日本	株式 サービス 業	981,200	5,151.22 5,054,377,361	4,161.00 4,082,773,200	- -	1.17
13	HOYA 日本	株式 精密機器	273,100	14,223.11 3,884,332,713	13,880.00 3,790,628,000	- -	1.09
14	三井住友フィナンシャル グループ 日本	株式 銀行業	917,400	4,207.43 3,859,897,846	4,024.00 3,691,617,600	- -	1.06
15	三菱商事 日本	株式 卸売業	925,600	4,124.21 3,817,377,742	3,968.00 3,672,780,800	- -	1.05
16	ダイキン工業 日本	株式 機械	156,500	22,068.09 3,453,656,161	22,295.00 3,489,167,500	- -	1.00
17	本田技研工業 日本	株式 輸送用機 器	1,048,000	3,363.70 3,525,158,942	3,137.00 3,287,576,000	- -	0.94
18	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	91,000	54,466.10 4,956,415,322	35,700.00 3,248,700,000	- -	0.93
19	信越化学工業 日本	株式 化学	222,500	18,156.79 4,039,886,788	14,330.00 3,188,425,000	- -	0.91
20	ソフトバンク 日本	株式 情報・通 信業	2,130,300	1,475.99 3,144,320,243	1,446.50 3,081,478,950	- -	0.88
21	三井物産 日本	株式 卸売業	992,000	3,051.94 3,027,532,979	3,089.00 3,064,288,000	- -	0.88
22	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,180,200	2,454.72 2,897,064,705	2,565.00 3,027,213,000	- -	0.87

23	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	846,400	3,780.09 3,199,468,318	3,501.00 2,963,246,400	- -	0.85
24	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	145,700	20,681.78 3,013,335,551	19,705.00 2,871,018,500	- -	0.82
25	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	473,300	5,590.55 2,646,009,396	5,806.00 2,747,979,800	- -	0.79
26	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,695,000	1,595.12 2,703,730,044	1,562.50 2,648,437,500	- -	0.76
27	村田製作所 日本	株式 電気機器	391,000	8,085.52 3,161,438,653	6,632.00 2,593,112,000	- -	0.74
28	日本電産 日本	株式 電気機器	318,400	9,423.03 3,000,295,083	8,130.00 2,588,592,000	- -	0.74
29	ファナック 日本	株式 電気機器	125,800	21,848.01 2,748,479,663	20,260.00 2,548,708,000	- -	0.73
30	S M C 日本	株式 機械	42,000	64,363.74 2,703,277,323	58,220.00 2,445,240,000	- -	0.70

(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9月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	96.33
合計	96.33

(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9月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	15.96
情報・通信業		8.92
輸送用機器		7.32
化学		5.93
医薬品		5.51
卸売業		5.44
サービス業		5.26
銀行業		5.15
機械		5.02
小売業		4.53
食料品		3.45
陸運業		3.23
精密機器		2.74
その他製品		2.46
保険業		2.19
建設業		2.18
不動産業		1.96
電気・ガス業		1.21
その他金融業		1.10
鉄鋼		0.78

非鉄金属	0.72
証券、商品先物取引業	0.71
ガラス・土石製品	0.70
ゴム製品	0.67
金属製品	0.56
石油・石炭製品	0.49
海運業	0.49
空運業	0.47
繊維製品	0.46
鉱業	0.28
パルプ・紙	0.18
倉庫・運輸関連業	0.16
水産・農林業	0.10
合計	96.33

（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】

2022年9月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0412月	売建	28	533,110,760	514,080,000	7.19
債券先物取引	大阪取引所	長国 先 0412 月	買建	6	888,461,925	889,800,000	12.44

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

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9月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0412月	買建	712	13,359,294,960	13,072,320,000	3.75

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

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第34計算期間末 (2013年 3月11日)	14,710	14,784	0.9872	0.9922
第35計算期間末 (2013年 9月10日)	12,849	12,977	1.0023	1.0123
第36計算期間末 (2014年 3月10日)	11,584	11,595	1.0001	1.0011
第37計算期間末 (2014年 9月10日)	11,061	11,072	0.9947	0.9957
第38計算期間末 (2015年 3月10日)	10,480	10,490	1.0087	1.0097
第39計算期間末 (2015年 9月10日)	9,762	9,820	1.0024	1.0084
第40計算期間末 (2016年 3月10日)	9,700	9,758	1.0090	1.0150
第41計算期間末 (2016年 9月12日)	9,838	9,896	1.0257	1.0317
第42計算期間末 (2017年 3月10日)	9,526	9,526	1.0258	1.0258
第43計算期間末 (2017年 9月11日)	9,279	9,288	1.0305	1.0315
第44計算期間末 (2018年 3月12日)	8,952	9,038	1.0417	1.0517
第45計算期間末 (2018年 9月10日)	8,713	8,713	1.0288	1.0288
第46計算期間末 (2019年 3月11日)	8,515	8,515	1.0330	1.0330
第47計算期間末 (2019年9月10日)	8,354	8,354	1.0270	1.0270
第48計算期間末 (2020年3月10日)	8,120	8,120	1.0083	1.0083
第49計算期間末 (2020年9月10日)	7,877	7,892	1.0158	1.0178
第50計算期間末 (2021年3月10日)	7,908	7,984	1.0387	1.0487
第51計算期間末 (2021年9月10日)	7,839	7,846	1.0557	1.0567
第52計算期間末 (2022年3月10日)	7,436	7,436	1.0130	1.0130
第53計算期間末 (2022年9月12日)	7,259	7,267	1.0023	1.0033
2021年9月末日	7,776	-	1.0473	-
10月末日	7,699	-	1.0400	-
11月末日	7,693	-	1.0391	-
12月末日	7,700	-	1.0454	-
2022年1月末日	7,515	-	1.0225	-



2月末日	7,470	-	1.0175	-
3月末日	7,532	-	1.0262	-
4月末日	7,519	-	1.0253	-
5月末日	7,499	-	1.0277	-
6月末日	7,335	-	1.0059	-
7月末日	7,323	-	1.0053	-
8月末日	7,317	-	1.0068	-
9月末日	7,153	-	0.9874	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第34計算期間	0.0050
第35計算期間	0.0100
第36計算期間	0.0010
第37計算期間	0.0010
第38計算期間	0.0010
第39計算期間	0.0060
第40計算期間	0.0060
第41計算期間	0.0060
第42計算期間	0.0000
第43計算期間	0.0010
第44計算期間	0.0100
第45計算期間	0.0000
第46計算期間	0.0000
第47計算期間	0.0000
第48計算期間	0.0000
第49計算期間	0.0020
第50計算期間	0.0100
第51計算期間	0.0010
第52計算期間	0.0000
第53計算期間	0.0010

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第34計算期間	8.85
第35計算期間	2.54
第36計算期間	0.12
第37計算期間	0.44
第38計算期間	1.51
第39計算期間	0.03
第40計算期間	1.26
第41計算期間	2.25
第42計算期間	0.01
第43計算期間	0.56
第44計算期間	2.06
第45計算期間	1.24
第46計算期間	0.41
第47計算期間	0.6
第48計算期間	1.8

第49計算期間	0.9
第50計算期間	3.2
第51計算期間	1.7
第52計算期間	4.0
第53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】

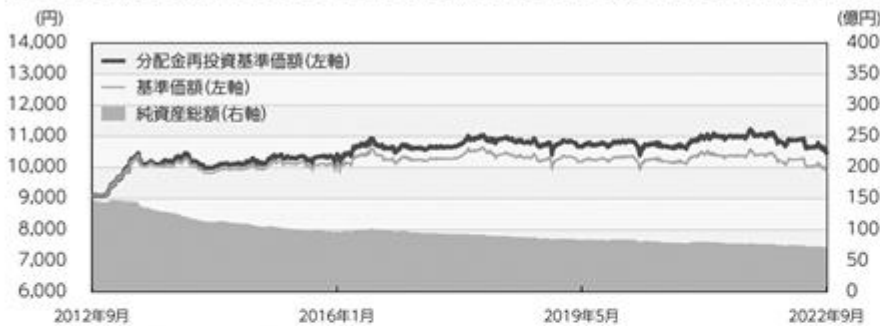
	設定口数	解約口数
第34計算期間	369,488,222	1,773,844,457
第35計算期間	427,178,848	2,508,637,111
第36計算期間	417,035,300	1,653,362,434
第37計算期間	428,874,227	892,182,541
第38計算期間	294,952,276	1,024,842,529
第39計算期間	317,180,609	968,640,410
第40計算期間	442,473,798	566,960,043
第41計算期間	440,391,845	462,278,145
第42計算期間	497,804,047	804,194,658
第43計算期間	290,194,467	571,802,304
第44計算期間	275,168,842	685,083,990
第45計算期間	376,901,704	502,346,126
第46計算期間	221,128,589	446,507,337
第47計算期間	255,610,157	364,455,489
第48計算期間	328,416,839	409,867,557
第49計算期間	337,863,174	636,916,350
第50計算期間	356,094,482	496,405,488
第51計算期間	304,220,136	492,728,215
第52計算期間	230,074,406	314,104,055
第53計算期間	234,209,843	332,469,655

(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9月30日

## 基準価額・純資産の推移 (2012年9月28日～2022年9月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、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:1993年11月26日)

## 分配の推移 (税引前)

2020年 9月	20円
2021年 3月	100円
2021年 9月	10円
2022年 3月	0円
2022年 9月	10円
設定来累計	2,100円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

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

## 資産の状況

資産の種類	比率(%)
国債証券	48.18
内 日本	48.18
親投資信託受益証券	24.49
内 日本	24.49
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	27.34
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(先建)	△7.19
債券先物取引(買建)	12.44

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	利率(%)	償還日	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	親投資信託受益証券	-	-	24.49
2	342回 利付国庫債券(10年)	国債証券	0.1	2026/3/20	8.42
3	71回 利付国庫債券(20年)	国債証券	2.2	2024/6/20	2.90
4	151回 利付国庫債券(5年)	国債証券	0.005	2027/3/20	2.79
5	15回 利付国庫債券(40年)	国債証券	1	2062/3/20	2.64
6	141回 利付国庫債券(20年)	国債証券	1.7	2032/12/20	2.38
7	100回 利付国庫債券(20年)	国債証券	2.2	2028/3/20	2.18
8	57回 利付国庫債券(30年)	国債証券	0.8	2047/12/20	2.15
9	180回 利付国庫債券(20年)	国債証券	0.8	2042/3/20	2.03
10	333回 利付国庫債券(10年)	国債証券	0.6	2024/3/20	1.84

## ■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	96.33
内 日本	96.33
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.67
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)	3.75

## 株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	15.96
2	情報・通信業	8.92
3	輸送用機器	7.32
4	化学	5.93
5	医薬品	5.51

## 組入上位10銘柄

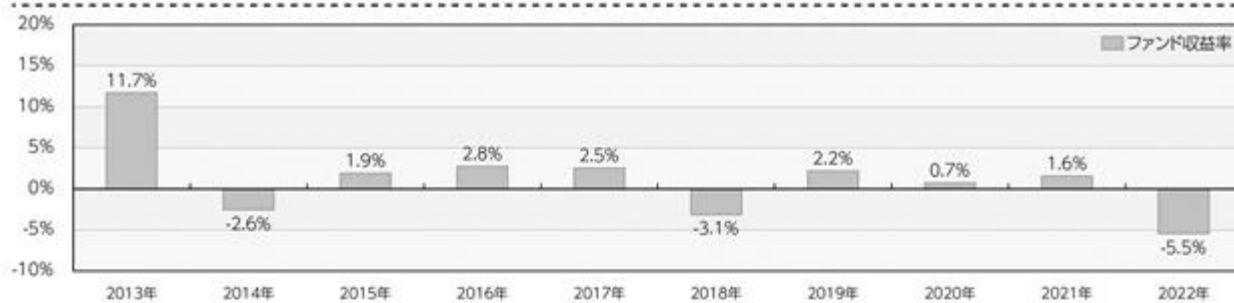
順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.51
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.39
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.78
4	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.76
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.54
6	任天堂	株式	日本	その他製品	1.36
7	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.25
8	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.22
9	日立製作所	株式	日本	電気機器	1.21
10	第一三共	株式	日本	医薬品	1.20

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2022年9月30日

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資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。  
※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

### 2【換金（解約）手続等】

#### <一部解約（解約請求）>

- (1) 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に各販売会社が定める単位をもって解約を請求することができます。  
解約単位は、販売会社にお問い合わせください。
- (2) 解約の請求を行う受益者は、振替制度にかかる口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等

の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。なお、解約の請求を受益者が行う際は、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

- (3) 解約請求の受付けについては、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後3時までに解約のお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付けにかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日分のお申込みとします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については、翌営業日のお取扱いとなります。
- (4) 解約の価額は、解約請求受付日の基準価額とします。詳しくは、販売会社または委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

（以下同じ。）

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

#### < 受益権の買取り（買取請求） >

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

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

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

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	<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】

1993年11月26日から無期限とします。

#### (4)【計算期間】

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

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

#### (5)【その他】

信託契約の解約

以下の場合には信託契約を解約し信託を終了することがあります。

1. 委託会社は、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき、もしくは信託契約の一部解約により、受益権の口数が当初設定口数の10分の1を下回るようになった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。
    - a. この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかる全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
    - b. 前記 a. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
    - c. 前記 b. の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記 1. の信託契約の解約をしません。
    - d. 委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
    - e. 前記 b. から d. までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記 b. の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
    - f. 前記 1. に定める信託契約の解約を行う場合において、前記 b. の期間内に異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。なお、買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社の協議により決定するものとします。
  2. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
  3. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、この信託は、「信託約款の変更 4.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
  4. 受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- #### 信託約款の変更
1. 委託会社は、信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更できるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
  2. 委託会社は、前記 1. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
  3. 前記 2. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。



4. 前記3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、この信託約款を変更しないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前記2.に定める変更を行う場合において、前記3.の期間内に異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。なお、買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社の協議により決定するものとします。
7. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記の規定にしたがいます。

#### 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

#### 関係法人との契約の更改および受託会社の辞任または解任に伴う取扱い

1. 委託会社と販売会社との間の募集・販売等契約は、締結日から原則1年間とし、期間終了の3カ月前までに別段の意思表示のない時は、同一条件にて継続されます。
2. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社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】

受益者の主な権利の内容は次のとおりです。

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

##### (1) 収益分配金請求権

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

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

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

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

##### (2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

##### (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) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 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53期計算期間(2022年3月11日から2022年9月12日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【MHAMスリーウェイオープン】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第52期 2022年3月10日現在	第53期 2022年9月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,213,688,793	1,924,297,153
国債証券	3,525,231,700	3,466,297,700
親投資信託受益証券	1,703,832,074	1,869,411,402
派生商品評価勘定	5,704,820	635,765
未収利息	10,429,925	10,744,210
前払金	-	13,675,000
前払費用	20,273	1,167,504
差入委託証拠金	41,250,000	39,510,000
流動資産合計	7,500,157,585	7,325,738,734
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,362,310	16,164,240
前受金	21,760,000	-
未払金	260,770	-
未払収益分配金	-	7,243,255
未払解約金	4,320,180	6,976,623
未払受託者報酬	4,177,553	4,154,836
未払委託者報酬	31,331,977	31,161,615
その他未払費用	63,413	63,062
流動負債合計	63,276,203	65,763,631
負債合計	63,276,203	65,763,631
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,341,514,895	7,243,255,083
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	95,366,487	16,720,020
(分配準備積立金)	445,793,653	425,197,078
元本等合計	7,436,881,382	7,259,975,103
純資産合計	7,436,881,382	7,259,975,103
負債純資産合計	7,500,157,585	7,325,738,734

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第52期 自 2021年9月11日 至 2022年3月10日	第53期 自 2022年3月11日 至 2022年9月12日
<b>営業収益</b>		
受取利息	18,957,680	17,547,563
有価証券売買等損益	310,983,372	93,308,428
派生商品取引等損益	12,289,880	145,410,105
その他収益	-	1,046
営業収益合計	279,735,812	34,553,068
<b>営業費用</b>		
支払利息	140,367	221,959
受託者報酬	4,177,553	4,154,836
委託者報酬	31,331,977	31,161,615
その他費用	63,413	63,063
営業費用合計	35,713,310	35,601,473
営業利益又は営業損失( )	315,449,122	70,154,541
経常利益又は経常損失( )	315,449,122	70,154,541
当期純利益又は当期純損失( )	315,449,122	70,154,541
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( )	6,010,209	772,806
期首剰余金又は期首欠損金( )	413,968,715	95,366,487
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,283,099	3,884,811
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	8,283,099	3,884,811
剰余金減少額又は欠損金増加額	17,446,414	4,360,676
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	17,446,414	4,360,676
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	-	7,243,255
期末剰余金又は期末欠損金( )	95,366,487	16,720,020

## (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53期	
	自 2022年3月11日	至 2022年9月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 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、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。</p> <p>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。</p>	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>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。</p>	
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年3月10日及び9月10日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を2022年9月12日としております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第52期	第53期
	2022年3月10日現在	2022年9月12日現在
1. 期首元本額	7,425,544,544円	7,341,514,895円
期中追加設定元本額	230,074,406円	234,209,843円
期中一部解約元本額	314,104,055円	332,469,655円
2. 受益権の総数	7,341,514,895口	7,243,255,083口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第52期	第53期
	自 2021年9月11日 至 2022年3月10日	自 2022年3月11日 至 2022年9月12日
1. 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,488,670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(365,736,650円)及び分配準備積立金(444,304,983円)より分配対象収益は811,530,303円(1万口当たり1,105.39円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,510,654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(374,858,058円)及び分配準備積立金(425,929,679円)より分配対象収益は807,298,391円(1万口当たり1,114.55円)であり、うち7,243,255円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第52期	第53期
	自 2021年9月11日 至 2022年3月10日	自 2022年3月11日 至 2022年9月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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、株価指数先物取引及び債券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、株価及び市場金利の変動による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。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。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第52期	第53期
	2022年3月10日現在	2022年9月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載していません。</p> <p>(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。</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。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。	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	第52期 2022年3月10日現在	第53期 2022年9月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	58,890,800	51,954,700
親投資信託受益証券	223,506,809	165,579,328
合計	282,397,609	113,624,628

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	第52期 2022年3月10日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 売建	583,520,000	-	580,320,000	3,200,000
合計	583,520,000	-	580,320,000	3,200,000



種類	第53期 2022年9月12日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引 売建	532,085,000	-	548,240,000	16,155,000	
合計	532,085,000	-	548,240,000	16,155,000	

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

#### 債券関連

種類	第52期 2022年3月10日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引 売建	2,710,160,000	-	2,709,000,000	1,160,000	
合計	2,710,160,000	-	2,709,000,000	1,160,000	

種類	第53期 2022年9月12日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	1,635,170,000	-	1,635,810,000	640,000	
合計	1,635,170,000	-	1,635,810,000	640,000	

（注）時価の算定方法

債券先物取引

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第52期 2022年3月10日現在	第53期 2022年9月12日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0130円 (10,130円)	1.0023円 (10,023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9月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	151回 利付国庫債券(5年)	200,000,000	199,908,000	
	15回 利付国庫債券(40年)	220,000,000	195,373,200	
	333回 利付国庫債券(10年)	130,000,000	131,380,600	
	342回 利付国庫債券(10年)	600,000,000	603,378,000	
	364回 利付国庫債券(10年)	100,000,000	98,676,000	
	10回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	107,879,000	
	15回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	123,600,000	
	57回 利付国庫債券(30年)	170,000,000	156,814,800	
	71回 利付国庫債券(20年)	200,000,000	208,106,000	
	73回 利付国庫債券(20年)	100,000,000	104,738,000	
	97回 利付国庫債券(20年)	100,000,000	110,736,000	
	100回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	156,296,000	
	102回 利付国庫債券(20年)	100,000,000	113,220,000	
	105回 利付国庫債券(20年)	100,000,000	111,932,000	
	140回 利付国庫債券(20年)	20,000,000	22,778,800	
	141回 利付国庫債券(20年)	150,000,000	170,919,000	
	142回 利付国庫債券(20年)	100,000,000	114,942,000	
	145回 利付国庫債券(20年)	100,000,000	114,126,000	
148回 利付国庫債券(20年)	60,000,000	67,264,800		

	151回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,865,600	
	156回 利付国庫債券(20年)	100,000,000	97,989,000	
	167回 利付国庫債券(20年)	100,000,000	96,235,000	
	170回 利付国庫債券(20年)	100,000,000	92,096,000	
	171回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	110,144,400	
	180回 利付国庫債券(20年)	150,000,000	146,899,500	
国債証券 合計		3,370,000,000	3,466,297,700	
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	561,857,238	1,869,411,402	
親投資信託受益証券 合計		561,857,238	1,869,411,402	
合計			5,335,709,102	

(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

「(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。

(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9月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	13,042,863,773
株式	394,851,389,800
派生商品評価勘定	200,341,350
未収入金	2,596,700
未収配当金	212,527,209
差入委託証拠金	332,100,000
流動資産合計	408,641,818,832
資産合計	408,641,818,832
負債の部	
流動負債	
前受金	159,900,000
未払解約金	5,608,454,000
流動負債合計	5,768,354,000
負債合計	5,768,354,000
純資産の部	
元本等	
元本	121,085,299,722
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	281,788,165,110
元本等合計	402,873,464,832
純資産合計	402,873,464,832
負債純資産合計	408,641,818,832

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年3月11日 至 2022年9月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年9月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	103,118,786,197円
同期中追加設定元本額	88,218,321,707円
同期中一部解約元本額	70,251,808,182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	2,642,602,518円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	4,872,928,735円
One DC 国内株式インデックスファンド	22,494,578,303円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,848,648,204円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	5,435,386円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	22,092,894円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	77,672,731円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	25,861,666円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	17,483,546円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	23,984,499円
たわらノーロード TOPIX	1,518,704,650円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,347,659,086円
たわらノーロード バランス(堅実型)	47,971,343円
たわらノーロード バランス(標準型)	315,279,795円
たわらノーロード バランス(積極型)	492,359,758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)	5,058,977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)	179,697,378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)	432,773,659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)	300,662,329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)	431,359,451円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	645,669円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,715,123円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	42,443,126円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,449,159円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	16,766,288円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,770,160,945円
Oneグローバルバランス	3,357,919円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,068,970,289円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,608,291,514円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,946,209,717円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	342,066,840円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,095,725,024円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,130,899,964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>	1,130,856,960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)	354,479,856円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	576,367,757円
投資のソムリエ	12,976,838,287円
クルーズコントロール	486,638,425円
投資のソムリエ<DC年金>	865,675,192円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	356,788,123円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	782,582,936円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	799,489,571円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,814,867,727円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	54,122,246円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	26,563,128円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,316,119円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	149,208,843円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	469,486,363円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	442,187,948円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	270,412,398円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	57,025,462円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	27,469,326円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	17,457,146円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	289,666,524円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	3,289,951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)	33,580,994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)	34,396,016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)	18,924,260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)	21,036,102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)	32,952,527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)	72,064,478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)	31,161,886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)	133,747,900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)	51,450,418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)	35,839,732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)	29,880,324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)	35,964,795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)	51,614,319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)	87,201,528円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	327,013,099円
AMOne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)(適格機関投資家限定)	7,839,821円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	31,640,655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)	59,142,012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)	56,861,129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)	11,085,271円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	9,696,871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)	49,513,943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)	96,115,489円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,733,172円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	24,557,072円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,956,382円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	649,685円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	6,828,328円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	27,738,873円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	476,711,653円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	566,699,407円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,653,510,846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)	16,833,437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)	24,737,681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)	255,532,529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)	63,429,468円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	464,377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)	300,739,386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)	17,191,479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)	61,395,888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)	136,773,568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)	208,461,117円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	33,167,248円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	16,304,396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)	260,091,271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)	922,255,638円

D I A M世界アセットバランスファンド7 V A ( 1 3 0 6 ) ( 適格機関投資家限定 )	1,220,307,862円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A ( 1 3 0 9 ) ( 適格機関投資家限定 )	48,743,066円
動的パッケージファンド< D C 年金 >	6,592,905円
コア資産形成ファンド	4,379,747円
M H A Mトピックスファンド	756,073,593円
M H A M T O P I XファンドV A ( 適格機関投資家専用 )	59,775,573円
M H A M動的パッケージファンド [ 適格機関投資家限定 ]	860,002,376円
M H A M日本株式パッシブファンド [ 適格機関投資家限定 ]	1,715,406,584円
計	121,085,299,722円
2. 受益権の総数	121,085,299,722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 2022年3月11日 至 2022年9月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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9月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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9月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	12,396,378,522	
合計	12,396,378,522	

（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9月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2022年9月12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	7,729,425,000	-	7,929,900,000	200,475,000
合計	7,729,425,000	-	7,929,900,000	200,475,000

（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9月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.3272円 (33,272円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2022年9月12日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	6,800	3,660.00	24,888,000	
日本水産	196,600	549.00	107,933,400	

マルハニチロ	28,000	2,435.00	68,180,000
雪国まいたけ	15,400	1,004.00	15,461,600
カネコ種苗	5,900	1,580.00	9,322,000
サカタのタネ	22,900	5,190.00	118,851,000
ホクト	16,100	1,909.00	30,734,900
ホクリヨウ	2,900	616.00	1,786,400
ショーボンドホールディングス	24,700	6,200.00	153,140,000
ミライト・ワン	68,200	1,556.00	106,119,200
タマホーム	12,900	2,341.00	30,198,900
サンヨーホームズ	2,500	694.00	1,735,000
日本アクア	8,400	707.00	5,938,800
ファーストコーポレーション	5,100	746.00	3,804,600
ベステラ	4,400	1,068.00	4,699,200
Robot Home	31,000	188.00	5,828,000
キャンディル	3,200	595.00	1,904,000
住石ホールディングス	37,100	255.00	9,460,500
日鉄鉱業	4,100	6,040.00	24,764,000
三井松島ホールディングス	8,900	3,510.00	31,239,000
I N P E X	671,300	1,493.00	1,002,250,900
石油資源開発	24,900	3,775.00	93,997,500
K & O エナジーグループ	8,200	1,711.00	14,030,200
ダイセキ環境ソリューション	4,100	929.00	3,808,900
第一カッター興業	4,600	1,276.00	5,869,600
明豊ファシリティワークス	6,700	679.00	4,549,300
安藤・間	96,400	901.00	86,856,400
東急建設	56,800	674.00	38,283,200
コムシスホールディングス	68,200	2,653.00	180,934,600
ビーアールホールディングス	26,600	352.00	9,363,200
高松コンストラクショングループ	13,600	1,930.00	26,248,000
東建コーポレーション	5,800	8,500.00	49,300,000
ソネック	2,200	1,035.00	2,277,000
ヤマウラ	9,200	966.00	8,887,200
オリエンタル白石	71,100	256.00	18,201,600
大成建設	136,100	4,255.00	579,105,500
大林組	454,000	974.00	442,196,000
清水建設	419,900	766.00	321,643,400
飛島建設	13,100	1,076.00	14,095,600
長谷工コーポレーション	131,100	1,641.00	215,135,100
松井建設	16,200	592.00	9,590,400
銭高組	1,600	3,240.00	5,184,000
鹿島建設	332,600	1,490.00	495,574,000
不動テトラ	10,400	1,556.00	16,182,400
大末建設	5,100	1,545.00	7,879,500
鉄建建設	9,800	1,806.00	17,698,800
西松建設	29,600	4,105.00	121,508,000
三井住友建設	110,200	451.00	49,700,200
大豊建設	7,100	4,120.00	29,252,000
佐田建設	10,600	429.00	4,547,400
ナカノフード建設	11,700	303.00	3,545,100
奥村組	24,300	2,978.00	72,365,400

東鉄工業	19,200	2,348.00	45,081,600
イチケン	3,600	1,817.00	6,541,200
富士ピー・エス	6,300	470.00	2,961,000
浅沼組	11,000	2,841.00	31,251,000
戸田建設	187,400	762.00	142,798,800
熊谷組	24,100	2,635.00	63,503,500
北野建設	3,000	2,399.00	7,197,000
植木組	4,000	1,276.00	5,104,000
矢作建設工業	19,400	778.00	15,093,200
ピーエス三菱	16,000	659.00	10,544,000
日本ハウスホールディングス	25,200	452.00	11,390,400
大東建託	50,000	14,630.00	731,500,000
新日本建設	20,800	718.00	14,934,400
東亜道路工業	2,600	5,990.00	15,574,000
日本道路	4,300	6,210.00	26,703,000
東亜建設工業	10,900	2,458.00	26,792,200
日本国土開発	38,000	612.00	23,256,000
若築建設	7,500	2,294.00	17,205,000
東洋建設	54,800	872.00	47,785,600
五洋建設	180,000	743.00	133,740,000
世紀東急工業	22,400	775.00	17,360,000
福田組	4,700	4,900.00	23,030,000
日本ドライケミカル	3,600	1,570.00	5,652,000
住友林業	97,400	2,347.00	228,597,800
日本基礎技術	12,000	515.00	6,180,000
巴コーポレーション	17,700	428.00	7,575,600
大和ハウス工業	387,000	3,127.00	1,210,149,000
ライト工業	26,900	1,929.00	51,890,100
積水ハウス	464,000	2,534.50	1,176,008,000
日特建設	10,100	937.00	9,463,700
北陸電気工事	8,700	754.00	6,559,800
ユアテック	27,900	759.00	21,176,100
日本リーテック	9,300	817.00	7,598,100
四電工	4,700	1,885.00	8,859,500
中電工	19,700	2,151.00	42,374,700
関電工	79,400	846.00	67,172,400
きんでん	99,300	1,523.00	151,233,900
東京エネシス	14,400	1,023.00	14,731,200
トーエネック	4,900	3,540.00	17,346,000
住友電設	12,200	2,702.00	32,964,400
日本電設工業	20,800	1,814.00	37,731,200
エクシオグループ	67,900	2,181.00	148,089,900
新日本空調	10,600	1,869.00	19,811,400
日本工営	9,500	3,865.00	36,717,500
九電工	31,000	2,901.00	89,931,000
三機工業	31,800	1,696.00	53,932,800
日揮ホールディングス	138,100	1,969.00	271,918,900
中外炉工業	4,500	1,614.00	7,263,000
ヤマト	11,800	790.00	9,322,000
太平電業	8,900	3,540.00	31,506,000

高砂熱学工業	37,400	1,665.00	62,271,000
三晃金属工業	1,900	2,656.00	5,046,400
NEC ネットエスアイ	50,500	1,706.00	86,153,000
朝日工業社	5,800	1,872.00	10,857,600
明星工業	24,600	746.00	18,351,600
大気社	20,400	3,320.00	67,728,000
ダイダン	9,200	2,292.00	21,086,400
日比谷総合設備	13,400	1,902.00	25,486,800
ニッポン	38,200	1,566.00	59,821,200
日清製粉グループ本社	147,400	1,538.00	226,701,200
日東富士製粉	1,600	4,715.00	7,544,000
昭和産業	12,400	2,540.00	31,496,000
鳥越製粉	11,400	663.00	7,558,200
中部飼料	16,100	1,078.00	17,355,800
フィード・ワン	18,600	705.00	13,113,000
東洋精糖	1,900	885.00	1,681,500
日本甜菜製糖	8,200	1,622.00	13,300,400
DM三井製糖ホールディングス	12,700	1,861.00	23,634,700
塩水港精糖	18,600	206.00	3,831,600
日新製糖	7,400	1,779.00	13,164,600
LIFULL	45,500	174.00	7,917,000
ミクシィ	34,000	2,444.00	83,096,000
ジェイエイシーリクルートメント	12,100	2,022.00	24,466,200
日本M&Aセンターホールディングス	244,400	1,757.00	429,410,800
メンバーズ	3,900	2,660.00	10,374,000
中広	1,100	402.00	442,200
UTグループ	21,600	2,764.00	59,702,400
アイティメディア	7,000	1,689.00	11,823,000
E・Jホールディングス	8,500	1,325.00	11,262,500
夢真ビーネックスグループ	48,600	1,695.00	82,377,000
コシダカホールディングス	39,900	874.00	34,872,600
アルトナー	3,600	994.00	3,578,400
パソナグループ	16,100	2,006.00	32,296,600
CDS	3,700	1,705.00	6,308,500
リンクアンドモチベーション	38,300	699.00	26,771,700
エス・エム・エス	50,500	3,020.00	152,510,000
サニーサイドアップグループ	5,100	619.00	3,156,900
パーソルホールディングス	149,000	2,830.00	421,670,000
リニカル	8,300	749.00	6,216,700
クックパッド	36,400	214.00	7,789,600
エスクリ	6,600	372.00	2,455,200
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,300	623.00	4,547,900
森永製菓	31,500	3,850.00	121,275,000
中村屋	3,200	3,120.00	9,984,000
江崎グリコ	36,400	3,500.00	127,400,000
名糖産業	5,600	1,650.00	9,240,000
井村屋グループ	7,600	2,240.00	17,024,000
不二家	8,700	2,382.00	20,723,400
山崎製パン	85,300	1,622.00	138,356,600
第一屋製パン	2,800	460.00	1,288,000

モロゾフ	4,600	3,715.00	17,089,000
亀田製菓	8,100	4,430.00	35,883,000
寿スピリッツ	13,600	8,490.00	115,464,000
カルビー	71,300	2,763.00	197,001,900
森永乳業	26,500	4,085.00	108,252,500
六甲バター	9,300	1,439.00	13,382,700
ヤクルト本社	99,300	8,210.00	815,253,000
明治ホールディングス	86,200	6,530.00	562,886,000
雪印メグミルク	34,200	1,693.00	57,900,600
プリマハム	19,600	2,075.00	40,670,000
日本ハム	54,800	3,950.00	216,460,000
林兼産業	4,000	468.00	1,872,000
丸大食品	14,100	1,515.00	21,361,500
S Foods	14,000	2,940.00	41,160,000
柿安本店	5,400	2,287.00	12,349,800
伊藤ハム米久ホールディングス	99,000	662.00	65,538,000
学情	6,000	1,215.00	7,290,000
スタジオアリス	6,600	2,195.00	14,487,000
クロスキャット	8,200	1,509.00	12,373,800
シミックホールディングス	7,300	1,657.00	12,096,100
エプロ	3,200	642.00	2,054,400
システナ	218,200	440.00	96,008,000
NJS	2,900	1,963.00	5,692,700
デジタルアーツ	8,200	6,730.00	55,186,000
日鉄ソリューションズ	26,600	3,730.00	99,218,000
総合警備保障	54,400	3,625.00	197,200,000
キューブシステム	7,700	1,030.00	7,931,000
いちご	171,200	310.00	53,072,000
WOW WORLD	2,100	854.00	1,793,400
日本駐車場開発	151,700	185.00	28,064,500
コア	6,500	1,452.00	9,438,000
カカクコム	109,300	2,601.00	284,289,300
アイロムグループ	5,300	2,582.00	13,684,600
セントケア・ホールディング	9,700	828.00	8,031,600
サイネックス	2,500	598.00	1,495,000
ルネサンス	10,400	985.00	10,244,000
ディップ	26,200	3,465.00	90,783,000
SBSホールディングス	11,500	2,899.00	33,338,500
デジタルホールディングス	10,400	1,267.00	13,176,800
新日本科学	18,200	2,967.00	53,999,400
キャリアデザインセンター	3,100	1,622.00	5,028,200
ベネフィット・ワン	53,900	2,124.00	114,483,600
エムスリー	262,900	4,603.00	1,210,128,700
ツカダ・グローバルホールディング	9,500	349.00	3,315,500
プラス	2,000	1,112.00	2,224,000
アウトソーシング	79,300	1,229.00	97,459,700
ウェルネット	13,200	600.00	7,920,000
ワールドホールディングス	5,900	2,685.00	15,841,500
ディー・エヌ・エー	56,800	1,907.00	108,317,600
博報堂DYホールディングス	188,500	1,232.00	232,232,000

ぐるなび	21,800	463.00	10,093,400	
タカミヤ	18,000	419.00	7,542,000	
ジャパンベストレスキューシステム	8,400	735.00	6,174,000	
ファンコミュニケーションズ	26,100	419.00	10,935,900	
ライク	4,900	2,183.00	10,696,700	
ビジネス・ブレイクスルー	5,500	406.00	2,233,000	
エスプール	38,300	1,060.00	40,598,000	
WDBホールディングス	6,700	2,650.00	17,755,000	
手間いらず	2,100	4,930.00	10,353,000	
ティア	8,700	442.00	3,845,400	
CDG	1,600	1,266.00	2,025,600	
アドウェイズ	18,300	748.00	13,688,400	
バリューコマース	10,000	2,469.00	24,690,000	
インフォマート	138,200	443.00	61,222,600	
サッポロホールディングス	41,900	3,120.00	130,728,000	
アサヒグループホールディングス	294,600	4,683.00	1,379,611,800	
キリンホールディングス	575,200	2,240.50	1,288,735,600	
宝ホールディングス	87,000	1,091.00	94,917,000	
オエノンホールディングス	38,100	289.00	11,010,900	
養命酒製造	4,300	1,809.00	7,778,700	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	99,800	1,405.00	140,219,000	
サントリー食品インターナショナル	89,700	5,170.00	463,749,000	
ダイドーグループホールディングス	8,000	4,695.00	37,560,000	
伊藤園	47,500	6,000.00	285,000,000	
キーコーヒー	14,300	2,121.00	30,330,300	
ユニカフェ	4,700	927.00	4,356,900	
ジャパンフーズ	1,600	1,105.00	1,768,000	
日清オイリオグループ	17,900	3,200.00	57,280,000	
不二製油グループ本社	33,900	2,392.00	81,088,800	
かどや製油	1,300	3,555.00	4,621,500	
J-オイルミルズ	14,500	1,576.00	22,852,000	
ローソン	34,000	4,775.00	162,350,000	
サンエー	10,500	4,225.00	44,362,500	
カワチ薬品	12,000	2,083.00	24,996,000	
エービーシー・マート	23,900	6,230.00	148,897,000	
ハードオフコーポレーション	6,700	1,378.00	9,232,600	
高千穂交易	5,400	2,229.00	12,036,600	
アスクル	33,000	1,842.00	60,786,000	
ゲオホールディングス	18,400	1,735.00	31,924,000	
アダストリア	16,500	2,191.00	36,151,500	
ジーフット	9,300	305.00	2,836,500	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	2,200	392.00	862,400	
オルパヘルスケアホールディングス	2,500	1,486.00	3,715,000	
伊藤忠食品	3,100	5,070.00	15,717,000	
くら寿司	16,000	3,005.00	48,080,000	
キャンドウ	4,800	2,184.00	10,483,200	
エレマテック	12,300	1,377.00	16,937,100	
アイケイ	4,800	445.00	2,136,000	
パルグループホールディングス	13,500	2,459.00	33,196,500	

エディオン	70,500	1,183.00	83,401,500
あらた	11,400	4,260.00	48,564,000
サーラコーポレーション	28,800	827.00	23,817,600
ワッツ	7,400	686.00	5,076,400
トーメンデバイス	2,200	5,740.00	12,628,000
ハローズ	7,000	2,992.00	20,944,000
J Pホールディングス	38,300	271.00	10,379,300
フジオフードグループ本社	11,400	1,319.00	15,036,600
あみやき亭	3,700	2,908.00	10,759,600
東京エレクトロン デバイス	4,500	5,870.00	26,415,000
ひらまつ	32,500	184.00	5,980,000
フィールズ	13,500	1,531.00	20,668,500
双日	157,600	2,364.00	372,566,400
アルフレッサ ホールディングス	159,300	1,697.00	270,332,100
大黒天物産	4,900	5,820.00	28,518,000
ハニーズホールディングス	12,200	1,236.00	15,079,200
ファーマライズホールディングス	3,300	656.00	2,164,800
キッコーマン	93,900	8,740.00	820,686,000
味の素	312,000	3,986.00	1,243,632,000
ブルドックソース	5,500	1,839.00	10,114,500
キュービー	68,500	2,239.00	153,371,500
ハウス食品グループ本社	48,800	2,974.00	145,131,200
カゴメ	59,300	2,990.00	177,307,000
焼津水産化学工業	6,300	877.00	5,525,100
アリアケジャパン	14,300	4,530.00	64,779,000
ピエトロ	2,000	1,781.00	3,562,000
エバラ食品工業	3,500	3,125.00	10,937,500
やまみ	1,200	1,408.00	1,689,600
ニチレイ	58,400	2,456.00	143,430,400
横浜冷凍	37,300	923.00	34,427,900
東洋水産	69,800	5,780.00	403,444,000
イトアンドホールディングス	5,800	2,143.00	12,429,400
大冷	1,800	1,908.00	3,434,400
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,100	489.00	3,960,900
日清食品ホールディングス	50,400	9,830.00	495,432,000
永谷園ホールディングス	6,900	2,012.00	13,882,800
一正蒲鉾	6,000	777.00	4,662,000
フジッコ	14,500	1,900.00	27,550,000
ロック・フィールド	15,500	1,507.00	23,358,500
日本たばこ産業	839,100	2,394.00	2,008,805,400
ケンコーマヨネーズ	8,000	1,533.00	12,264,000
わらべや日洋ホールディングス	9,400	2,246.00	21,112,400
なとり	8,700	2,065.00	17,965,500
イフジ産業	2,800	904.00	2,531,200
ファーマフーズ	19,700	1,373.00	27,048,100
北の達人コーポレーション	54,600	260.00	14,196,000
ユーグレナ	81,800	970.00	79,346,000
紀文食品	12,200	988.00	12,053,600
ピックルスホールディングス	8,400	1,100.00	9,240,000
スター・マイカ・ホールディングス	6,500	1,552.00	10,088,000

S R Eホールディングス	3,900	3,390.00	13,221,000
A Dワークスグループ	27,500	156.00	4,290,000
片倉工業	12,000	2,011.00	24,132,000
グンゼ	8,900	3,905.00	34,754,500
ヒューリック	297,300	1,090.00	324,057,000
神栄	2,100	801.00	1,682,100
ラサ商事	6,900	986.00	6,803,400
アルペン	11,400	2,141.00	24,407,400
ハブ	5,000	566.00	2,830,000
ラクーンホールディングス	13,000	1,258.00	16,354,000
クオールホールディングス	18,800	1,234.00	23,199,200
アルコニックス	19,500	1,389.00	27,085,500
神戸物産	106,000	3,460.00	366,760,000
ソリトンシステムズ	6,600	1,169.00	7,715,400
ジンズホールディングス	8,200	4,560.00	37,392,000
ビックカメラ	91,100	1,139.00	103,762,900
D C Mホールディングス	91,200	1,037.00	94,574,400
ペッパーフードサービス	28,600	242.00	6,921,200
ハイパー	2,500	438.00	1,095,000
M o n o t a R O	194,200	2,449.00	475,595,800
東京一番フーズ	3,500	596.00	2,086,000
D Dホールディングス	8,000	599.00	4,792,000
あいホールディングス	22,000	2,213.00	48,686,000
ディーブイエックス	5,000	897.00	4,485,000
きちりホールディングス	4,200	344.00	1,444,800
アークランドサービスホールディングス	11,300	2,072.00	23,413,600
J . フロントリテイリング	170,200	1,218.00	207,303,600
ドトール・日レスホールディングス	24,300	1,658.00	40,289,400
マツキヨココカラ&カンパニー	90,000	5,730.00	515,700,000
ブロンコビリー	7,300	2,410.00	17,593,000
Z O Z O	105,600	3,055.00	322,608,000
トレジャー・ファクトリー	4,500	1,868.00	8,406,000
物語コーポレーション	7,600	7,120.00	54,112,000
三越伊勢丹ホールディングス	230,500	1,247.00	287,433,500
東洋紡	60,300	1,109.00	66,872,700
ユニチカ	41,900	273.00	11,438,700
富士紡ホールディングス	6,200	3,545.00	21,979,000
日清紡ホールディングス	106,400	1,116.00	118,742,400
倉敷紡績	10,600	2,164.00	22,938,400
ダイワボウホールディングス	65,400	1,999.00	130,734,600
シキボウ	8,000	891.00	7,128,000
日東紡績	19,300	2,587.00	49,929,100
トヨタ紡織	54,500	2,057.00	112,106,500
マクニカホールディングス	36,600	2,921.00	106,908,600
H a m e e	5,500	1,059.00	5,824,500
マーケットエンタープライズ	1,600	902.00	1,443,200
ラクト・ジャパン	5,200	2,310.00	12,012,000
ウエルシアホールディングス	81,200	2,994.00	243,112,800
クリエイティブSDホールディングス	22,700	3,130.00	71,051,000



グリムス	6,800	1,788.00	12,158,400
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,400	668.00	16,299,200
八洲電機	11,100	1,022.00	11,344,200
メディアスホールディングス	8,800	731.00	6,432,800
レスターホールディングス	14,500	2,035.00	29,507,500
ジューテックホールディングス	3,000	1,096.00	3,288,000
丸善CHIホールディングス	17,900	354.00	6,336,600
大光	6,500	708.00	4,602,000
OCHIホールディングス	3,500	1,230.00	4,305,000
TOKAIホールディングス	74,400	889.00	66,141,600
黒谷	4,200	575.00	2,415,000
ミサワ	3,100	603.00	1,869,300
ティーライフ	2,000	1,268.00	2,536,000
Cominix	2,700	721.00	1,946,700
エー・ピーホールディングス	2,200	448.00	985,600
三洋貿易	14,000	1,073.00	15,022,000
チムニー	4,600	1,238.00	5,694,800
シュッピン	12,700	1,308.00	16,611,600
ビューティガレージ	2,500	2,739.00	6,847,500
オイシックス・ラ・大地	22,200	1,770.00	39,294,000
ウイン・パートナーズ	11,100	971.00	10,778,100
ネクステージ	31,200	3,290.00	102,648,000
ジョイフル本田	44,100	1,763.00	77,748,300
鳥貴族ホールディングス	5,000	2,036.00	10,180,000
ホットランド	10,500	1,312.00	13,776,000
すかいらーくホールディングス	187,200	1,524.00	285,292,800
SFPホールディングス	7,400	1,687.00	12,483,800
綿半ホールディングス	10,600	1,410.00	14,946,000
日本毛織	37,700	1,075.00	40,527,500
ダイトウボウ	24,800	87.00	2,157,600
トーア紡コーポレーション	4,400	350.00	1,540,000
ガイドーリミテッド	20,900	151.00	3,155,900
ヨシックスホールディングス	3,000	2,150.00	6,450,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	44,600	1,063.00	47,409,800
三栄建築設計	6,100	1,647.00	10,046,700
野村不動産ホールディングス	79,500	3,600.00	286,200,000
三重交通グループホールディングス	31,200	488.00	15,225,600
サムティ	20,300	2,263.00	45,938,900
ディア・ライフ	19,000	633.00	12,027,000
コーセーアールイー	4,500	629.00	2,830,500
地主	9,800	2,000.00	19,600,000
プレサンスコーポレーション	16,800	1,637.00	27,501,600
フィル・カンパニー	2,200	1,228.00	2,701,600
THEグローバル社	8,200	206.00	1,689,200
ハウスコム	2,700	954.00	2,575,800
JPMC	6,400	1,005.00	6,432,000
サンセイランディック	4,200	826.00	3,469,200
エストラスト	1,600	549.00	878,400

フージャースホールディングス	19,700	818.00	16,114,600	
オープンハウスグループ	49,000	5,410.00	265,090,000	
東急不動産ホールディングス	418,200	781.00	326,614,200	
飯田グループホールディングス	125,600	2,166.00	272,049,600	
イーランド	2,100	1,693.00	3,555,300	
ムゲンエステート	9,400	482.00	4,530,800	
帝国繊維	14,500	1,626.00	23,577,000	
日本コークス工業	131,800	98.00	12,916,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,200	2,044.00	12,672,800	
ミタチ産業	3,900	781.00	3,045,900	
B E E N O S	7,700	2,402.00	18,495,400	
あさひ	12,800	1,323.00	16,934,400	
日本調剤	9,300	1,268.00	11,792,400	
コスモス薬品	15,400	14,500.00	223,300,000	
シップヘルスケアホールディングス	44,200	2,700.00	119,340,000	
トーエル	6,600	785.00	5,181,000	
ソフトクリエイトホールディングス	6,600	3,610.00	23,826,000	
セブン&アイ・ホールディングス	514,900	6,023.00	3,101,242,700	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	103,000	903.00	93,009,000	
明治電機工業	4,600	1,056.00	4,857,600	
ツルハホールディングス	33,500	7,950.00	266,325,000	
デリカフーズホールディングス	5,900	524.00	3,091,600	
スターティアホールディングス	3,600	1,019.00	3,668,400	
サンマルクホールディングス	12,200	1,602.00	19,544,400	
フェリシモ	3,500	1,040.00	3,640,000	
トリドールホールディングス	38,200	3,090.00	118,038,000	
帝人	134,200	1,473.00	197,676,600	
東レ	947,700	795.00	753,421,500	
クラレ	206,100	1,075.00	221,557,500	
旭化成	944,600	1,046.00	988,051,600	
T O K Y O B A S E	14,000	343.00	4,802,000	
稲葉製作所	7,800	1,345.00	10,491,000	
宮地エンジニアリンググループ	4,400	3,250.00	14,300,000	
トーカロ	39,800	1,296.00	51,580,800	
アルファ	5,400	945.00	5,103,000	
S U M C O	254,200	1,954.00	496,706,800	
川田テクノロジーズ	2,900	3,790.00	10,991,000	
R S T e c h n o l o g i e s	4,400	6,770.00	29,788,000	
ジェイテックコーポレーション	2,000	1,689.00	3,378,000	
信和	9,600	811.00	7,785,600	
ビーロット	9,700	561.00	5,441,700	
ファーストブラザーズ	2,800	847.00	2,371,600	
A n d D o ホールディングス	7,500	866.00	6,495,000	
シーアールイー	5,800	1,783.00	10,341,400	
プロパティエージェント	1,800	1,500.00	2,700,000	
ケイアイスター不動産	6,900	4,980.00	34,362,000	
アグレ都市デザイン	2,500	1,494.00	3,735,000	
グッドコムアセット	5,800	1,373.00	7,963,400	
ジェイ・エス・ビー	3,200	3,590.00	11,488,000	

ロードスターキャピタル	5,400	1,817.00	9,811,800
テンポイノベーション	4,400	919.00	4,043,600
グローバル・リンク・マネジメント	2,800	942.00	2,637,600
フェイスネットワーク	2,000	1,406.00	2,812,000
住江織物	2,700	1,750.00	4,725,000
日本フェルト	8,600	416.00	3,577,600
イチカワ	1,600	1,384.00	2,214,400
エコナックホールディングス	25,600	91.00	2,329,600
日東製網	1,700	1,348.00	2,291,600
芦森工業	2,900	1,039.00	3,013,100
アツギ	10,900	406.00	4,425,400
ウイルプラスホールディングス	2,900	1,095.00	3,175,500
J Mホールディングス	11,600	1,590.00	18,444,000
コメダホールディングス	33,500	2,290.00	76,715,000
サツドラホールディングス	6,800	651.00	4,426,800
アレンザホールディングス	10,300	998.00	10,279,400
串カツ田中ホールディングス	3,600	1,780.00	6,408,000
パロックジャパンリミテッド	10,600	793.00	8,405,800
クスリのアオキホールディングス	13,700	6,330.00	86,721,000
ダイニック	4,900	614.00	3,008,600
共和レザー	8,300	550.00	4,565,000
ピーバンドットコム	2,000	511.00	1,022,000
力の源ホールディングス	7,900	779.00	6,154,100
FOOD & LIFE COMPANIES	78,600	2,340.00	183,924,000
アセンテック	5,200	645.00	3,354,000
セーレン	28,200	2,122.00	59,840,400
ソトー	5,500	732.00	4,026,000
東海染工	1,600	1,122.00	1,795,200
小松マテーレ	23,000	842.00	19,366,000
ワコールホールディングス	31,300	2,258.00	70,675,400
ホギメディカル	19,000	3,490.00	66,310,000
クラウドシアホールディングス	2,500	282.00	705,000
T S Iホールディングス	46,400	417.00	19,348,800
マツオカコーポレーション	4,400	1,034.00	4,549,600
ワールド	20,000	1,402.00	28,040,000
T I S	133,700	4,285.00	572,904,500
J N Sホールディングス	7,000	399.00	2,793,000
グリー	69,600	930.00	64,728,000
G M Oペパボ	1,700	1,865.00	3,170,500
コーエーテックモホールディングス	48,900	4,690.00	229,341,000
三菱総合研究所	6,300	4,475.00	28,192,500
ボルテージ	4,200	310.00	1,302,000
電算	900	1,970.00	1,773,000
A G S	6,000	695.00	4,170,000
ファインデックス	10,300	618.00	6,365,400
ブレインパッド	13,000	1,061.00	13,793,000
K L a b	24,300	432.00	10,497,600
ポルトゥウィンホールディングス	22,200	950.00	21,090,000
ネクソン	349,300	2,828.00	987,820,400

アイスタイル	39,600	556.00	22,017,600
エムアップホールディングス	17,600	1,817.00	31,979,200
エイチーム	9,600	871.00	8,361,600
エニグモ	16,500	538.00	8,877,000
テクノスジャパン	11,900	456.00	5,426,400
e n i s h	10,900	418.00	4,556,200
コロプラ	50,300	707.00	35,562,100
オルトプラス	11,000	313.00	3,443,000
ブロードリーフ	75,800	536.00	40,628,800
クロス・マーケティンググループ	5,800	916.00	5,312,800
デジタルハーツホールディングス	6,900	1,778.00	12,268,200
システム情報	11,400	1,000.00	11,400,000
メディアドゥ	5,100	2,072.00	10,567,200
じげん	43,300	343.00	14,851,900
バイキューブ	15,500	1,201.00	18,615,500
エンカレッジ・テクノロジー	3,400	520.00	1,768,000
サイバーリンクス	4,500	1,131.00	5,089,500
ディー・エル・イー	10,300	380.00	3,914,000
フィックスターズ	14,600	1,170.00	17,082,000
CARTA HOLDINGS	6,200	1,784.00	11,060,800
オブティム	10,700	912.00	9,758,400
セレス	5,100	1,080.00	5,508,000
S H I F T	9,500	20,720.00	196,840,000
特種東海製紙	7,900	3,135.00	24,766,500
ティーガイア	13,600	1,682.00	22,875,200
セック	2,200	2,257.00	4,965,400
テクマトリックス	25,800	1,690.00	43,602,000
プロシップ	5,000	1,449.00	7,245,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	39,700	2,274.00	90,277,800
GMOペイメントゲートウェイ	29,700	11,210.00	332,937,000
ザッパラス	5,200	317.00	1,648,400
システムリサーチ	4,500	1,942.00	8,739,000
インターネットイニシアティブ	40,800	4,855.00	198,084,000
さくらインターネット	16,400	556.00	9,118,400
ヴィンクス	4,400	1,580.00	6,952,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,000	5,290.00	21,160,000
S R Aホールディングス	7,400	3,095.00	22,903,000
システムインテグレータ	4,800	448.00	2,150,400
朝日ネット	13,900	623.00	8,659,700
e B A S E	18,300	546.00	9,991,800
アバント	16,400	1,456.00	23,878,400
アドソル日進	5,400	1,533.00	8,278,200
ODKソリューションズ	3,200	611.00	1,955,200
フリービット	7,900	902.00	7,125,800
コムチュア	17,100	2,308.00	39,466,800
サイバーコム	2,300	1,355.00	3,116,500
アステリア	11,000	841.00	9,251,000
アイル	7,300	1,733.00	12,650,900

王子ホールディングス	589,200	558.00	328,773,600
日本製紙	61,900	883.00	54,657,700
三菱製紙	19,500	300.00	5,850,000
北越コーポレーション	91,100	754.00	68,689,400
中越パルプ工業	5,800	961.00	5,573,800
巴川製紙所	4,500	823.00	3,703,500
大王製紙	65,400	1,231.00	80,507,400
阿波製紙	3,500	315.00	1,102,500
マークライズ	7,000	2,369.00	16,583,000
メディカル・データ・ビジョン	19,400	1,073.00	20,816,200
gumi	21,200	946.00	20,055,200
ショーケース	3,400	402.00	1,366,800
モバイルファクトリー	3,000	960.00	2,880,000
テラスカイ	5,500	2,026.00	11,143,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,700	1,578.00	10,572,600
PCIホールディングス	5,900	954.00	5,628,600
アイビーシー	2,200	483.00	1,062,600
ネオジャパン	4,400	1,103.00	4,853,200
PR TIMES	3,300	2,485.00	8,200,500
ラクス	70,100	1,653.00	115,875,300
ランドコンピュータ	3,600	874.00	3,146,400
ダブルスタンダード	4,500	2,569.00	11,560,500
オープンドア	9,000	2,039.00	18,351,000
マイネット	4,600	505.00	2,323,000
アカツキ	6,800	2,302.00	15,653,600
ベネフィットジャパン	900	1,564.00	1,407,600
Ubicomホールディングス	4,100	2,470.00	10,127,000
カナミックネットワーク	18,600	555.00	10,323,000
ノムラシステムコーポレーション	13,500	132.00	1,782,000
レンゴー	118,100	844.00	99,676,400
トーモク	7,400	1,525.00	11,285,000
ザ・パック	9,700	2,315.00	22,455,500
チェンジ	31,800	1,862.00	59,211,600
シンクロ・フード	7,800	443.00	3,455,400
オークネット	6,700	2,240.00	15,008,000
キャピタル・アセット・プランニング	2,800	705.00	1,974,000
セグエグループ	4,000	708.00	2,832,000
エイトレッド	2,100	1,830.00	3,843,000
マクロミル	29,400	1,188.00	34,927,200
ビーグリー	2,400	1,392.00	3,340,800
オロ	4,000	1,617.00	6,468,000
ユーザーローカル	4,600	1,556.00	7,157,600
テモナ	2,800	321.00	898,800
ニーズウェル	4,400	645.00	2,838,000
マネーフォワード	31,200	3,565.00	111,228,000
サインポスト	4,900	898.00	4,400,200
昭和電工	125,300	2,179.00	273,028,700
住友化学	1,041,600	553.00	576,004,800
住友精化	6,000	3,330.00	19,980,000

日産化学	68,700	7,170.00	492,579,000	
ラサ工業	5,300	2,473.00	13,106,900	
クレハ	11,100	9,670.00	107,337,000	
多木化学	5,000	5,110.00	25,550,000	
テイカ	8,700	1,298.00	11,292,600	
石原産業	27,400	1,073.00	29,400,200	
片倉コープアグリ	3,500	1,231.00	4,308,500	
日本曹達	16,800	4,570.00	76,776,000	
東ソー	188,800	1,844.00	348,147,200	
トクヤマ	45,400	1,893.00	85,942,200	
セントラル硝子	22,900	3,460.00	79,234,000	
東亜合成	66,700	1,132.00	75,504,400	
大阪ソーダ	11,700	3,895.00	45,571,500	
関東電化工業	27,800	1,025.00	28,495,000	
デンカ	51,400	3,380.00	173,732,000	
イビデン	75,000	4,580.00	343,500,000	
信越化学工業	242,000	16,715.00	4,045,030,000	
日本カーバイド工業	5,400	1,264.00	6,825,600	
電算システムホールディングス	6,200	2,387.00	14,799,400	
堺化学工業	9,800	1,981.00	19,413,800	
第一稀元素化学工業	13,000	1,435.00	18,655,000	
エア・ウォーター	122,400	1,766.00	216,158,400	
日本酸素ホールディングス	125,700	2,569.00	322,923,300	
日本化学工業	4,400	2,083.00	9,165,200	
東邦アセチレン	3,100	1,162.00	3,602,200	
日本パーカライジング	64,200	990.00	63,558,000	
高压ガス工業	21,600	681.00	14,709,600	
チタン工業	1,800	1,610.00	2,898,000	
四国化成工業	17,600	1,296.00	22,809,600	
戸田工業	3,300	2,844.00	9,385,200	
ステラ ケミファ	7,600	2,745.00	20,862,000	
保土谷化学工業	4,100	3,295.00	13,509,500	
日本触媒	21,700	5,720.00	124,124,000	
大日精化工業	10,800	1,805.00	19,494,000	
カネカ	32,900	4,005.00	131,764,500	
協和キリン	156,900	3,300.00	517,770,000	
三菱瓦斯化学	118,300	2,110.00	249,613,000	
三井化学	118,900	3,155.00	375,129,500	
J S R	142,200	3,155.00	448,641,000	
東京応化工業	22,700	6,780.00	153,906,000	
大阪有機化学工業	9,800	2,384.00	23,363,200	
三菱ケミカルグループ	947,900	734.20	695,948,180	
K Hネオケム	21,600	2,677.00	57,823,200	
ダイセル	205,300	914.00	187,644,200	
住友ベークライト	21,600	4,590.00	99,144,000	
積水化学工業	291,600	1,937.00	564,829,200	
日本ゼオン	111,100	1,431.00	158,984,100	
アイカ工業	36,000	3,230.00	116,280,000	
U B E	72,000	2,081.00	149,832,000	
積水樹脂	21,000	1,769.00	37,149,000	

タキロンシーアイ	33,000	542.00	17,886,000
旭有機材	8,600	2,410.00	20,726,000
ニチバン	8,000	1,700.00	13,600,000
リケンテクノス	31,000	534.00	16,554,000
大倉工業	5,900	1,801.00	10,625,900
積水化成成品工業	18,200	414.00	7,534,800
群栄化学工業	3,100	2,461.00	7,629,100
タイガースポリマー	7,300	427.00	3,117,100
ミライアル	4,900	2,047.00	10,030,300
ダイキアクシス	5,200	676.00	3,515,200
ダイキョーニシカワ	32,200	597.00	19,223,400
竹本容器	4,800	758.00	3,638,400
森六ホールディングス	7,400	1,780.00	13,172,000
恵和	4,300	4,305.00	18,511,500
日本化薬	107,300	1,226.00	131,549,800
カーリットホールディングス	12,900	665.00	8,578,500
ソルクシーズ	11,700	373.00	4,364,100
CLホールディングス	3,200	879.00	2,812,800
プレステージ・インターナショナル	55,900	706.00	39,465,400
フェイス	4,100	568.00	2,328,800
プロトコーポレーション	16,200	1,097.00	17,771,400
ハイマックス	4,100	1,364.00	5,592,400
アミューズ	8,100	1,936.00	15,681,600
野村総合研究所	266,100	3,710.00	987,231,000
ドリームインキュベータ	4,500	1,945.00	8,752,500
サイバネットシステム	10,900	1,005.00	10,954,500
クイック	9,200	1,866.00	17,167,200
TAC	8,100	210.00	1,701,000
CEホールディングス	7,400	503.00	3,722,200
日本システム技術	2,800	2,793.00	7,820,400
電通グループ	139,700	4,355.00	608,393,500
インテージホールディングス	17,600	1,732.00	30,483,200
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,900	1,725.00	11,902,500
東邦システムサイエンス	4,100	1,008.00	4,132,800
ぴあ	4,500	3,375.00	15,187,500
イオンファンタジー	5,700	3,570.00	20,349,000
ソースネクスト	66,000	314.00	20,724,000
シーティーエス	16,800	742.00	12,465,600
ネクシーズグループ	4,500	591.00	2,659,500
インフォコム	16,800	1,962.00	32,961,600
メディカルシステムネットワーク	13,400	426.00	5,708,400
日本精化	9,800	1,952.00	19,129,600
扶桑化学工業	12,100	3,475.00	42,047,500
トリケミカル研究所	15,700	2,362.00	37,083,400
シンプレクス・ホールディングス	24,200	2,095.00	50,699,000
HEROZ	4,400	999.00	4,395,600
ラクスル	18,300	2,375.00	43,462,500
メルカリ	58,400	2,240.00	130,816,000
IPS	4,300	3,170.00	13,631,000
FIG	16,700	413.00	6,897,100

システムサポート	5,500	1,471.00	8,090,500
A D E K A	60,200	2,397.00	144,299,400
日油	44,100	5,400.00	238,140,000
ミヨシ油脂	5,000	996.00	4,980,000
新日本理化	21,700	244.00	5,294,800
ハリマ化成グループ	10,100	934.00	9,433,400
イーソル	8,300	627.00	5,204,100
アルテリア・ネットワークス	14,400	1,300.00	18,720,000
東海ソフト	2,300	933.00	2,145,900
ウイングアーク1st	11,700	1,882.00	22,019,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,500	1,718.00	6,013,000
サーバーワークス	2,700	2,538.00	6,852,600
東名	1,100	1,075.00	1,182,500
ヴィッツ	1,300	1,036.00	1,346,800
トピラシステムズ	3,100	1,046.00	3,242,600
S a n s a n	48,400	1,390.00	67,276,000
L i n k - U	2,800	849.00	2,377,200
ギフトィ	12,700	2,309.00	29,324,300
花王	322,000	6,114.00	1,968,708,000
第一工業製薬	5,100	2,156.00	10,995,600
石原ケミカル	7,100	1,297.00	9,208,700
日華化学	5,100	890.00	4,539,000
ニイタカ	2,900	2,387.00	6,922,300
三洋化成工業	9,100	4,625.00	42,087,500
ベース	2,200	6,820.00	15,004,000
J M D C	19,200	5,980.00	114,816,000
武田薬品工業	1,225,500	3,894.00	4,772,097,000
アステラス製薬	1,333,000	2,026.50	2,701,324,500
住友ファーマ	96,300	1,059.00	101,981,700
塩野義製薬	181,000	7,050.00	1,276,050,000
わかもと製薬	15,200	242.00	3,678,400
日本新薬	34,000	7,590.00	258,060,000
中外製薬	406,400	3,664.00	1,489,049,600
科研製薬	22,300	3,895.00	86,858,500
エーザイ	172,300	5,983.00	1,030,870,900
理研ビタミン	11,000	1,748.00	19,228,000
ロート製薬	74,300	4,435.00	329,520,500
小野薬品工業	300,600	3,385.00	1,017,531,000
久光製薬	33,000	3,505.00	115,665,000
有機合成薬品工業	10,600	335.00	3,551,000
持田製薬	17,500	3,445.00	60,287,500
参天製薬	271,500	1,023.00	277,744,500
扶桑薬品工業	5,000	2,022.00	10,110,000
日本ケミファ	1,700	1,890.00	3,213,000
ツムラ	44,600	3,130.00	139,598,000
日医工	45,000	450.00	20,250,000
テルモ	441,100	4,640.00	2,046,704,000
H . U . グループホールディングス	38,900	2,761.00	107,402,900
キッセイ薬品工業	22,600	2,541.00	57,426,600



生化学工業	27,500	893.00	24,557,500
栄研化学	23,100	1,856.00	42,873,600
鳥居薬品	6,900	2,861.00	19,740,900
JCRファーマ	43,900	2,204.00	96,755,600
東和薬品	22,500	2,219.00	49,927,500
富士製薬工業	8,400	1,022.00	8,584,800
ゼリア新薬工業	23,100	2,102.00	48,556,200
第一三共	1,131,000	4,309.00	4,873,479,000
キョーリン製薬ホールディングス	28,200	1,777.00	50,111,400
大幸薬品	23,500	606.00	14,241,000
ダイト	9,800	2,668.00	26,146,400
大塚ホールディングス	297,000	4,643.00	1,378,971,000
大正製薬ホールディングス	28,900	5,210.00	150,569,000
ペプチドリーム	63,000	1,701.00	107,163,000
大日本塗料	17,300	736.00	12,732,800
日本ペイントホールディングス	573,800	1,107.00	635,196,600
関西ペイント	131,900	2,194.00	289,388,600
神東塗料	10,400	143.00	1,487,200
中国塗料	33,000	877.00	28,941,000
日本特殊塗料	9,100	963.00	8,763,300
藤倉化成	19,000	463.00	8,797,000
太陽ホールディングス	22,500	2,711.00	60,997,500
DIC	50,600	2,553.00	129,181,800
サカタインクス	28,800	991.00	28,540,800
東洋インキS Cホールディングス	25,400	1,940.00	49,276,000
T & K TOKA	12,300	1,045.00	12,853,500
アルプス技研	11,600	1,843.00	21,378,800
サニックス	26,100	275.00	7,177,500
ダイオーズ	2,900	1,498.00	4,344,200
日本空調サービス	15,600	768.00	11,980,800
オリエンタルランド	158,500	20,170.00	3,196,945,000
フォーカスシステムズ	9,500	1,010.00	9,595,000
ダスキン	32,000	2,845.00	91,040,000
パーク24	99,300	2,000.00	198,600,000
明光ネットワークジャパン	17,500	602.00	10,535,000
ファルコホールディングス	6,600	1,818.00	11,998,800
クレスコ	11,200	1,793.00	20,081,600
フジ・メディア・ホールディングス	136,000	1,104.00	150,144,000
秀英予備校	3,300	446.00	1,471,800
田谷	1,900	557.00	1,058,300
ラウンドワン	41,600	2,108.00	87,692,800
リゾートトラスト	63,000	2,277.00	143,451,000
オービック	48,200	20,850.00	1,004,970,000
ジャストシステム	21,800	3,400.00	74,120,000
TDCソフト	12,200	1,183.00	14,432,600
Zホールディングス	2,206,200	415.40	916,455,480
ビー・エム・エル	19,000	3,475.00	66,025,000
トレンドマイクロ	75,000	8,730.00	654,750,000
りらいあコミュニケーションズ	22,000	1,009.00	22,198,000
IDホールディングス	9,700	886.00	8,594,200

リソー教育	68,100	322.00	21,928,200
日本オラクル	24,800	8,370.00	207,576,000
早稲田アカデミー	8,200	1,099.00	9,011,800
アルファシステムズ	4,100	4,355.00	17,855,500
フューチャー	32,300	1,701.00	54,942,300
C A C H o l d i n g s	8,000	1,439.00	11,512,000
S B テクノロジー	6,600	2,494.00	16,460,400
トーセ	3,800	804.00	3,055,200
ユー・エス・エス	166,800	2,440.00	406,992,000
オービックビジネスコンサルタント	14,500	5,040.00	73,080,000
伊藤忠テクノソリューションズ	69,700	3,510.00	244,647,000
アイティフォー	18,500	778.00	14,393,000
東京個別指導学院	13,200	564.00	7,444,800
東計電算	1,800	6,190.00	11,142,000
サイバーエージェント	318,200	1,346.00	428,297,200
楽天グループ	614,800	678.00	416,834,400
エクスネット	2,400	1,000.00	2,400,000
クリーク・アンド・リバー社	7,800	2,557.00	19,944,600
モーニングスター	26,100	491.00	12,815,100
テー・オー・ダブリュー	28,500	310.00	8,835,000
大塚商会	73,600	4,645.00	341,872,000
サイボウズ	17,900	1,457.00	26,080,300
山田コンサルティンググループ	7,700	1,256.00	9,671,200
セントラルスポーツ	5,500	2,505.00	13,777,500
パラカ	4,500	1,960.00	8,820,000
電通国際情報サービス	15,800	4,645.00	73,391,000
A C C E S S	17,300	734.00	12,698,200
デジタルガレージ	25,400	3,810.00	96,774,000
イーエムシステムズ	21,600	902.00	19,483,200
ウェザーニューズ	4,500	7,990.00	35,955,000
C I J	11,900	779.00	9,270,100
ビジネスエンジニアリング	3,600	2,284.00	8,222,400
日本エンタープライズ	14,900	163.00	2,428,700
WOWOW	6,300	1,359.00	8,561,700
スカラ	12,900	712.00	9,184,800
インテリジェント ウェイブ	7,600	888.00	6,748,800
フルキャストホールディングス	12,800	2,563.00	32,806,400
エン・ジャパン	26,400	2,423.00	63,967,200
あすか製薬ホールディングス	14,700	1,189.00	17,478,300
サワイグループホールディングス	30,000	4,025.00	120,750,000
富士フイルムホールディングス	274,000	7,161.00	1,962,114,000
コニカミノルタ	316,300	491.00	155,303,300
資生堂	271,100	5,140.00	1,393,454,000
ライオン	155,800	1,645.00	256,291,000
高砂香料工業	8,800	2,861.00	25,176,800
マンダム	30,400	1,540.00	46,816,000
ミルボン	19,200	6,370.00	122,304,000
ファンケル	63,100	2,923.00	184,441,300
コーセー	26,400	14,110.00	372,504,000
コタ	10,900	1,577.00	17,189,300

シーボン	1,600	1,662.00	2,659,200
ポーラ・オルビスホールディングス	66,600	1,566.00	104,295,600
ノビアホールディングス	11,600	5,770.00	66,932,000
アジュバンホールディングス	3,600	962.00	3,463,200
新日本製薬	7,400	1,642.00	12,150,800
エステー	10,000	1,553.00	15,530,000
アグロ カネショウ	5,100	1,328.00	6,772,800
コニシ	23,600	1,651.00	38,963,600
長谷川香料	26,900	3,085.00	82,986,500
星光PMC	7,400	570.00	4,218,000
小林製薬	39,700	8,380.00	332,686,000
荒川化学工業	11,000	1,042.00	11,462,000
メック	10,700	2,499.00	26,739,300
日本高純度化学	3,700	2,385.00	8,824,500
タカラバイオ	40,900	1,902.00	77,791,800
JCU	16,000	3,200.00	51,200,000
新田ゼラチン	8,900	898.00	7,992,200
OATアグリオ	5,800	1,925.00	11,165,000
デクセリアルズ	40,600	4,125.00	167,475,000
アース製薬	11,800	5,460.00	64,428,000
北興化学工業	13,100	998.00	13,073,800
大成ラミック	4,200	2,948.00	12,381,600
クミアイ化学工業	51,500	1,020.00	52,530,000
日本農薬	27,800	841.00	23,379,800
富士興産	3,800	1,202.00	4,567,600
ニチレキ	16,800	1,345.00	22,596,000
ユシロ化学工業	7,400	876.00	6,482,400
ビービー・カストロール	5,500	1,104.00	6,072,000
富士石油	34,000	337.00	11,458,000
MORESCO	5,100	1,132.00	5,773,200
出光興産	158,600	3,445.00	546,377,000
ENEOSホールディングス	2,345,600	511.70	1,200,243,520
コスモエネルギーホールディングス	61,500	3,975.00	244,462,500
テスホールディングス	13,600	1,115.00	15,164,000
インフロニア・ホールディングス	170,200	1,018.00	173,263,600
横浜ゴム	73,900	2,377.00	175,660,300
TOYO TIRE	74,700	1,703.00	127,214,100
ブリヂストン	414,500	5,226.00	2,166,177,000
住友ゴム工業	127,300	1,223.00	155,687,900
藤倉コンポジット	12,500	965.00	12,062,500
オカモト	7,200	3,850.00	27,720,000
アキレス	10,000	1,345.00	13,450,000
フコク	6,800	1,002.00	6,813,600
ニッタ	14,600	2,992.00	43,683,200
クリエートメディック	4,600	916.00	4,213,600
住友理工	30,200	585.00	17,667,000
三ツ星ベルト	19,000	3,290.00	62,510,000
パンドー化学	25,100	1,050.00	26,355,000
AGC	132,000	4,870.00	642,840,000
日本板硝子	70,500	587.00	41,383,500

石塚硝子	2,500	1,604.00	4,010,000
有沢製作所	21,200	1,354.00	28,704,800
日本山村硝子	5,300	617.00	3,270,100
日本電気硝子	52,900	2,663.00	140,872,700
オハラ	6,100	1,555.00	9,485,500
住友大阪セメント	23,200	3,535.00	82,012,000
太平洋セメント	88,600	2,141.00	189,692,600
リソルホールディングス	1,600	4,350.00	6,960,000
日本ヒューム	12,900	669.00	8,630,100
日本コンクリート工業	27,900	273.00	7,616,700
三谷セキサン	6,300	3,810.00	24,003,000
アジアパイルホールディングス	22,200	513.00	11,388,600
東海カーボン	108,900	1,023.00	111,404,700
日本カーボン	7,400	4,075.00	30,155,000
東洋炭素	8,200	3,435.00	28,167,000
ノリタケカンパニーリミテド	7,900	4,160.00	32,864,000
TOTO	94,300	4,915.00	463,484,500
日本碍子	153,600	2,012.00	309,043,200
日本特殊陶業	108,700	2,976.00	323,491,200
ダントーホールディングス	10,200	349.00	3,559,800
MARUWA	5,300	17,490.00	92,697,000
品川リフクトリーズ	3,700	4,020.00	14,874,000
黒崎播磨	2,700	5,010.00	13,527,000
ヨータイ	9,900	1,437.00	14,226,300
東京窯業	15,300	273.00	4,176,900
ニッカトー	6,500	455.00	2,957,500
フジインコーポレーテッド	12,500	6,540.00	81,750,000
クニミネ工業	4,900	826.00	4,047,400
エーアンドエーマテリアル	2,700	868.00	2,343,600
ニチアス	32,800	2,396.00	78,588,800
日本製鉄	644,000	2,288.00	1,473,472,000
神戸製鋼所	268,600	647.00	173,784,200
中山製鋼所	21,400	612.00	13,096,800
合同製鐵	7,400	1,837.00	13,593,800
JFEホールディングス	356,900	1,490.00	531,781,000
東京製鐵	45,000	1,314.00	59,130,000
共英製鋼	15,200	1,513.00	22,997,600
大和工業	25,200	4,795.00	120,834,000
東京鐵鋼	6,300	1,355.00	8,536,500
大阪製鐵	8,200	1,241.00	10,176,200
淀川製鋼所	16,800	2,527.00	42,453,600
丸一鋼管	44,700	2,979.00	133,161,300
モリ工業	3,800	2,731.00	10,377,800
大同特殊鋼	21,100	3,865.00	81,551,500
日本高周波鋼業	4,400	336.00	1,478,400
日本冶金工業	10,600	2,885.00	30,581,000
山陽特殊製鋼	13,200	2,091.00	27,601,200
愛知製鋼	8,700	2,130.00	18,531,000
日立金属	166,100	2,120.00	352,132,000
日本金属	3,900	1,023.00	3,989,700

大平洋金属	9,500	2,411.00	22,904,500
新日本電工	85,400	362.00	30,914,800
栗本鐵工所	6,300	1,645.00	10,363,500
虹 技	2,000	941.00	1,882,000
日本鑄鉄管	1,600	979.00	1,566,400
日本製鋼所	39,600	3,125.00	123,750,000
三菱製鋼	9,900	1,025.00	10,147,500
日亜鋼業	17,600	246.00	4,329,600
日本精線	2,500	4,655.00	11,637,500
エンビプロ・ホールディングス	10,200	896.00	9,139,200
大紀アルミニウム工業所	19,000	1,362.00	25,878,000
日本軽金属ホールディングス	39,000	1,625.00	63,375,000
三井金属鉱業	41,600	3,225.00	134,160,000
東邦亜鉛	7,900	2,515.00	19,868,500
三菱マテリアル	89,100	2,057.00	183,278,700
住友金属鉱山	168,900	4,422.00	746,875,800
DOWAホールディングス	36,000	5,500.00	198,000,000
古河機械金属	23,500	1,272.00	29,892,000
エス・サイエンス	68,500	26.00	1,781,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	17,800	3,390.00	60,342,000
東邦チタニウム	27,600	2,474.00	68,282,400
UACJ	21,100	2,499.00	52,728,900
CKサンエツ	2,900	4,105.00	11,904,500
古河電気工業	44,400	2,495.00	110,778,000
住友電気工業	538,100	1,640.00	882,484,000
フジクラ	171,800	987.00	169,566,600
昭和電線ホールディングス	13,500	1,854.00	25,029,000
東京特殊電線	2,000	2,253.00	4,506,000
タツタ電線	27,100	467.00	12,655,700
カナレ電気	2,300	1,483.00	3,410,900
平河ヒューテック	8,500	1,131.00	9,613,500
リョービ	14,200	1,340.00	19,028,000
アーレスティ	16,400	401.00	6,576,400
アサヒホールディングス	61,700	2,143.00	132,223,100
東洋製罐グループホールディングス	78,600	1,788.00	140,536,800
ホッカンホールディングス	7,200	1,336.00	9,619,200
コロナ	7,400	840.00	6,216,000
横河ブリッジホールディングス	22,100	1,975.00	43,647,500
駒井ハルテック	2,400	1,678.00	4,027,200
高田機工	600	2,411.00	1,446,600
三和ホールディングス	145,300	1,392.00	202,257,600
文化シャッター	45,400	1,068.00	48,487,200
三協立山	18,400	625.00	11,500,000
アルインコ	10,200	907.00	9,251,400
東洋シャッター	2,500	545.00	1,362,500
LIXIL	242,600	2,380.00	577,388,000
日本フィルコン	9,700	482.00	4,675,400
ノーリツ	19,700	1,559.00	30,712,300
長府製作所	13,900	2,036.00	28,300,400
リンナイ	26,600	10,740.00	285,684,000

ユニプレス	25,500	970.00	24,735,000
ダイニチ工業	7,400	662.00	4,898,800
日東精工	17,500	532.00	9,310,000
三洋工業	1,600	1,704.00	2,726,400
岡部	21,600	672.00	14,515,200
ジーテクト	17,000	1,400.00	23,800,000
東プレ	23,500	1,255.00	29,492,500
高周波熱錬	23,800	695.00	16,541,000
東京製綱	9,500	976.00	9,272,000
サンコール	13,200	738.00	9,741,600
モリテックスチール	12,100	285.00	3,448,500
パイオラックス	20,300	1,982.00	40,234,600
エイチワン	13,700	609.00	8,343,300
日本発条	130,000	962.00	125,060,000
中央発條	7,400	703.00	5,202,200
アドバネクス	2,000	1,234.00	2,468,000
三浦工業	60,600	2,961.00	179,436,600
タクマ	44,200	1,357.00	59,979,400
テクノプロ・ホールディングス	89,200	3,060.00	272,952,000
アトラグループ	3,400	190.00	646,000
インターワークス	4,400	392.00	1,724,800
アイ・アールジャパンホールディングス	6,900	2,296.00	15,842,400
Keeper 技研	9,600	4,300.00	41,280,000
ファーストロジック	2,300	830.00	1,909,000
三機サービス	2,600	946.00	2,459,600
Gunosy	8,200	815.00	6,683,000
デザインワン・ジャパン	3,900	176.00	686,400
イー・ガーディアン	5,000	3,035.00	15,175,000
リブセンス	6,800	297.00	2,019,600
ジャパンマテリアル	45,800	1,957.00	89,630,600
ベクトル	20,900	1,159.00	24,223,100
ウチヤマホールディングス	7,300	309.00	2,255,700
チャーム・ケア・コーポレーション	11,100	1,156.00	12,831,600
キャリアリンク	5,400	2,346.00	12,668,400
IBJ	8,200	964.00	7,904,800
アサンテ	6,600	1,619.00	10,685,400
バリューHR	11,600	1,457.00	16,901,200
M&Aキャピタルパートナーズ	12,300	3,470.00	42,681,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,800	1,141.00	6,617,800
ERIホールディングス	4,200	1,078.00	4,527,600
アビスト	2,200	2,987.00	6,571,400
シグマクシス・ホールディングス	17,900	1,239.00	22,178,100
ウィルグループ	11,100	1,417.00	15,728,700
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,400	164.00	2,525,600
メドピア	10,500	1,540.00	16,170,000
レアジョブ	2,800	772.00	2,161,600
リクルートホールディングス	1,067,300	4,654.00	4,967,214,200
エラン	17,600	1,101.00	19,377,600

ツガミ	31,500	1,235.00	38,902,500
オークマ	14,600	5,310.00	77,526,000
芝浦機械	17,400	3,060.00	53,244,000
アマダ	243,300	1,110.00	270,063,000
アイダエンジニアリング	33,600	849.00	28,526,400
滝澤鉄工所	4,500	1,143.00	5,143,500
F U J I	61,500	2,051.00	126,136,500
牧野フライス製作所	15,600	4,510.00	70,356,000
オーエスジー	62,400	1,961.00	122,366,400
ダイジェット工業	1,600	875.00	1,400,000
旭ダイヤモンド工業	37,800	774.00	29,257,200
D M G 森精機	79,300	1,782.00	141,312,600
ソディック	36,400	813.00	29,593,200
ディスコ	22,700	34,900.00	792,230,000
日東工器	7,400	1,645.00	12,173,000
日進工具	12,200	1,126.00	13,737,200
パンチ工業	13,100	440.00	5,764,000
富士ダイス	7,700	621.00	4,781,700
土木管理総合試験所	6,200	315.00	1,953,000
ネットマーケティング	7,300	898.00	6,555,400
日本郵政	1,627,800	985.10	1,603,545,780
ベルシステム24ホールディングス	21,500	1,440.00	30,960,000
鎌倉新書	16,900	736.00	12,438,400
S M N	3,400	539.00	1,832,600
一蔵	1,900	452.00	858,800
グローバルキッズCOMPANY	2,200	673.00	1,480,600
エアトリ	8,600	2,898.00	24,922,800
アトラエ	10,500	1,607.00	16,873,500
ストライク	6,600	4,060.00	26,796,000
ソラスト	36,600	894.00	32,720,400
セラク	4,700	1,109.00	5,212,300
インソース	16,500	2,910.00	48,015,000
豊田自動織機	110,400	7,800.00	861,120,000
豊和工業	7,900	833.00	6,580,700
ニデックオーケー	5,800	1,150.00	6,670,000
石川製作所	4,100	1,391.00	5,703,100
東洋機械金属	10,000	578.00	5,780,000
津田駒工業	2,700	498.00	1,344,600
エンシュウ	3,500	786.00	2,751,000
島精機製作所	22,600	2,204.00	49,810,400
オプトラン	19,300	2,365.00	45,644,500
N C ホールディングス	4,400	1,988.00	8,747,200
イワキ	9,800	1,403.00	13,749,400
フリー	13,700	1,035.00	14,179,500
ヤマシンフィルタ	24,200	333.00	8,058,600
日阪製作所	15,800	851.00	13,445,800
やまびこ	21,400	1,167.00	24,973,800
野村マイクロ・サイエンス	4,900	3,730.00	18,277,000
平田機工	6,700	4,670.00	31,289,000
ペガサスミシン製造	15,600	919.00	14,336,400

マルマエ	6,300	2,034.00	12,814,200
タツモ	7,200	1,443.00	10,389,600
ナブテスコ	82,000	3,355.00	275,110,000
三井海洋開発	16,400	1,477.00	24,222,800
レオン自動機	16,500	1,234.00	20,361,000
S M C	45,700	68,590.00	3,134,563,000
ホソカワミクロン	10,000	2,620.00	26,200,000
ユニオンツール	5,700	3,605.00	20,548,500
オイレス工業	20,000	1,524.00	30,480,000
日精エー・エス・ビー機械	5,900	4,140.00	24,426,000
サトーホールディングス	20,300	1,912.00	38,813,600
技研製作所	13,600	3,480.00	47,328,000
日本エアテック	6,600	1,075.00	7,095,000
カワタ	4,500	908.00	4,086,000
日精樹脂工業	9,700	959.00	9,302,300
オカダアイヨン	4,800	1,470.00	7,056,000
ワイエイシーホールディングス	6,100	1,452.00	8,857,200
小松製作所	706,500	2,895.00	2,045,317,500
住友重機械工業	83,300	2,939.00	244,818,700
日立建機	62,400	2,933.00	183,019,200
日工	19,300	638.00	12,313,400
巴工業	5,600	2,549.00	14,274,400
井関農機	12,200	1,254.00	15,298,800
T O W A	13,400	1,887.00	25,285,800
丸山製作所	2,500	1,576.00	3,940,000
北川鉄工所	6,000	1,351.00	8,106,000
シンニッタン	18,600	221.00	4,110,600
ローツェ	7,700	8,750.00	67,375,000
タカキタ	4,700	546.00	2,566,200
クボタ	697,100	2,203.00	1,535,711,300
荏原実業	6,500	2,188.00	14,222,000
東洋エンジニアリング	20,600	671.00	13,822,600
三菱化工機	4,500	2,231.00	10,039,500
月島機械	24,300	905.00	21,991,500
帝国電機製作所	9,900	1,993.00	19,730,700
東京機械製作所	6,300	720.00	4,536,000
新東工業	29,100	718.00	20,893,800
澁谷工業	12,300	2,462.00	30,282,600
アイチコーポレーション	22,300	829.00	18,486,700
小森コーポレーション	35,800	754.00	26,993,200
鶴見製作所	11,000	2,330.00	25,630,000
住友精密工業	2,300	2,600.00	5,980,000
日本ギア工業	5,500	369.00	2,029,500
酒井重工業	2,600	3,030.00	7,878,000
荏原製作所	53,500	5,330.00	285,155,000
石井鐵工所	1,100	2,786.00	3,064,600
西島製作所	12,700	1,401.00	17,792,700
北越工業	13,200	1,017.00	13,424,400
ダイキン工業	170,200	24,885.00	4,235,427,000
オルガノ	4,500	9,030.00	40,635,000



トヨーカネツ	5,400	2,541.00	13,721,400	
栗田工業	78,700	5,510.00	433,637,000	
椿本チエイン	20,400	3,260.00	66,504,000	
大同工業	6,300	722.00	4,548,600	
日機装	32,400	1,030.00	33,372,000	
木村化工機	12,000	755.00	9,060,000	
レイズネクスト	21,000	1,215.00	25,515,000	
アネスト岩田	24,200	932.00	22,554,400	
ダイフク	73,500	7,990.00	587,265,000	
サムコ	4,400	3,350.00	14,740,000	
加藤製作所	7,400	761.00	5,631,400	
油研工業	1,900	1,820.00	3,458,000	
タダノ	75,300	930.00	70,029,000	
フジテック	47,900	2,961.00	141,831,900	
C K D	39,500	1,915.00	75,642,500	
キトー	12,200	2,709.00	33,049,800	
平和	43,400	2,152.00	93,396,800	
理想科学工業	13,100	2,492.00	32,645,200	
SANKYO	32,100	4,080.00	130,968,000	
日本金銭機械	15,800	675.00	10,665,000	
マースグループホールディングス	9,900	1,604.00	15,879,600	
フクシマガリレイ	9,600	3,660.00	35,136,000	
オーイズミ	5,400	405.00	2,187,000	
ダイコク電機	7,100	1,299.00	9,222,900	
竹内製作所	23,700	2,738.00	64,890,600	
アマノ	40,900	2,569.00	105,072,100	
JUKI	20,300	714.00	14,494,200	
サンデン	21,600	280.00	6,048,000	
ジャノメ	13,300	692.00	9,203,600	
ブラザー工業	177,700	2,632.00	467,706,400	
マックス	18,400	2,039.00	37,517,600	
モリタホールディングス	24,900	1,314.00	32,718,600	
グローリー	37,000	2,278.00	84,286,000	
新晃工業	14,400	1,582.00	22,780,800	
大和冷機工業	20,000	1,116.00	22,320,000	
セガサミーホールディングス	140,200	2,036.00	285,447,200	
日本ピストンリング	5,700	1,272.00	7,250,400	
リケン	5,700	2,428.00	13,839,600	
T P R	16,900	1,293.00	21,851,700	
ツバキ・ナカシマ	32,200	1,198.00	38,575,600	
ホシザキ	84,200	4,055.00	341,431,000	
大豊工業	12,800	708.00	9,062,400	
日本精工	266,900	778.00	207,648,200	
N T N	283,600	282.00	79,975,200	
ジェイテクト	132,900	1,042.00	138,481,800	
不二越	9,700	3,825.00	37,102,500	
ミネベアミツミ	248,100	2,457.00	609,581,700	
日本トムソン	35,600	570.00	20,292,000	
T H K	75,500	2,794.00	210,947,000	
ユーシン精機	12,200	713.00	8,698,600	

前澤給装工業	10,000	907.00	9,070,000
イーグル工業	16,800	1,224.00	20,563,200
前澤工業	9,300	632.00	5,877,600
日本ピラー工業	13,400	2,580.00	34,572,000
キット	48,200	816.00	39,331,200
日立製作所	749,900	7,007.00	5,254,549,300
東芝	272,600	5,047.00	1,375,812,200
三菱電機	1,455,100	1,390.00	2,022,589,000
富士電機	86,700	5,990.00	519,333,000
東洋電機製造	5,100	892.00	4,549,200
安川電機	154,900	4,720.00	731,128,000
シンフォニアテクノロジー	15,900	1,489.00	23,675,100
明電舎	22,100	2,048.00	45,260,800
オリジン	3,600	1,471.00	5,295,600
山洋電気	5,600	5,340.00	29,904,000
デンヨー	11,100	1,573.00	17,460,300
PHCホールディングス	24,000	1,597.00	38,328,000
ペイカレント・コンサルティング	10,600	41,900.00	444,140,000
Orchestra Holdings	2,800	2,706.00	7,576,800
アイモバイル	7,400	1,335.00	9,879,000
キャリアインデックス	5,000	420.00	2,100,000
MS-Japan	6,000	814.00	4,884,000
船場	1,600	746.00	1,193,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	47,300	1,971.00	93,228,300
フルテック	2,000	1,159.00	2,318,000
グリーンズ	5,600	793.00	4,440,800
ツナググループ・ホールディングス	4,200	318.00	1,335,600
GAMEWITH	4,400	387.00	1,702,800
MS&Consulting	2,100	621.00	1,304,100
ウェルビー	9,800	786.00	7,702,800
エル・ティー・エス	1,700	3,300.00	5,610,000
ミダックホールディングス	6,700	3,650.00	24,455,000
日総工産	11,500	586.00	6,739,000
キュービーネットホールディングス	6,800	1,408.00	9,574,400
RPAホールディングス	21,000	311.00	6,531,000
三櫻工業	21,600	757.00	16,351,200
マキタ	176,300	3,208.00	565,570,400
東芝テック	16,800	4,165.00	69,972,000
芝浦メカトロニクス	2,800	11,320.00	31,696,000
マブチモーター	32,400	4,030.00	130,572,000
日本電産	346,400	9,444.00	3,271,401,600
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,400	496.00	2,678,400
トレックス・セミコンダクター	6,600	2,974.00	19,628,400
東光高岳	8,700	1,932.00	16,808,400
ダブル・スコープ	42,600	2,919.00	124,349,400
宮越ホールディングス	5,800	946.00	5,486,800
ダイヘン	14,400	4,085.00	58,824,000
ヤーマン	25,400	1,455.00	36,957,000

JVCケンウッド	127,000	203.00	25,781,000	
ミマキエンジニアリング	13,900	708.00	9,841,200	
I-PEX	7,300	1,373.00	10,022,900	
日新電機	36,500	1,439.00	52,523,500	
大崎電気工業	26,200	526.00	13,781,200	
オムロン	129,800	7,378.00	957,664,400	
日東工業	19,600	2,635.00	51,646,000	
I D E C	19,300	2,988.00	57,668,400	
正興電機製作所	4,400	1,087.00	4,782,800	
不二電機工業	2,900	1,123.00	3,256,700	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	46,800	2,540.00	118,872,000	
サクサホールディングス	3,000	1,279.00	3,837,000	
メルコホールディングス	4,400	3,285.00	14,454,000	
テクノメディカ	3,600	1,638.00	5,896,800	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,400	1,330.00	5,852,000	
日本電気	185,000	5,090.00	941,650,000	
富士通	140,300	16,660.00	2,337,398,000	
沖電気工業	59,100	747.00	44,147,700	
岩崎通信機	6,300	756.00	4,762,800	
電気興業	7,400	2,402.00	17,774,800	
サンケン電気	13,400	4,900.00	65,660,000	
ナカヨ	2,200	1,072.00	2,358,400	
アイホン	7,000	2,072.00	14,504,000	
ルネサスエレクトロニクス	850,800	1,347.00	1,146,027,600	
セイコーエプソン	174,200	2,164.00	376,968,800	
ワコム	119,500	797.00	95,241,500	
アルバック	31,100	5,860.00	182,246,000	
アクセル	5,900	956.00	5,640,400	
E I Z O	10,600	3,845.00	40,757,000	
ジャパンディスプレイ	532,400	57.00	30,346,800	
日本信号	33,100	947.00	31,345,700	
京三製作所	30,400	430.00	13,072,000	
能美防災	17,600	1,629.00	28,670,400	
ホーチキ	9,800	1,368.00	13,406,400	
星和電機	5,800	454.00	2,633,200	
エレコム	35,700	1,652.00	58,976,400	
パナソニック ホールディングス	1,662,900	1,151.00	1,913,997,900	
シャープ	148,100	979.00	144,989,900	
アンリツ	98,600	1,655.00	163,183,000	
富士通ゼネラル	42,300	2,920.00	123,516,000	
ソニーグループ	976,700	10,760.00	10,509,292,000	
T D K	225,800	5,090.00	1,149,322,000	
帝国通信工業	6,800	1,454.00	9,887,200	
タムラ製作所	56,100	721.00	40,448,100	
アルプスアルパイン	127,300	1,264.00	160,907,200	
池上通信機	4,500	596.00	2,682,000	
日本電波工業	15,600	1,609.00	25,100,400	
鈴木	7,600	884.00	6,718,400	
メイコー	16,800	3,020.00	50,736,000	

日本トリム	2,900	2,345.00	6,800,500	
ローランド ディー . ジー .	7,400	3,270.00	24,198,000	
フォスター電機	14,400	786.00	11,318,400	
S M K	3,600	2,482.00	8,935,200	
ヨコオ	10,400	2,176.00	22,630,400	
ティアック	23,800	118.00	2,808,400	
ホシデン	34,400	1,611.00	55,418,400	
ヒロセ電機	21,600	20,550.00	443,880,000	
日本航空電子工業	31,300	2,455.00	76,841,500	
T O A	16,700	805.00	13,443,500	
マクセル	28,400	1,467.00	41,662,800	
古野電気	18,500	1,147.00	21,219,500	
スミダコーポレーション	12,000	1,056.00	12,672,000	
アイコム	5,000	2,602.00	13,010,000	
リオン	5,300	2,092.00	11,087,600	
本多通信工業	12,300	703.00	8,646,900	
横河電機	143,000	2,473.00	353,639,000	
新電元工業	5,500	3,745.00	20,597,500	
アズビル	90,400	4,070.00	367,928,000	
東亜ディーケーケー	7,700	848.00	6,529,600	
日本光電工業	59,800	3,205.00	191,659,000	
チノー	4,900	1,653.00	8,099,700	
共和電業	13,600	341.00	4,637,600	
日本電子材料	7,300	1,553.00	11,336,900	
堀場製作所	28,800	6,400.00	184,320,000	
アドバンテスト	115,900	7,900.00	915,610,000	
小野測器	5,300	414.00	2,194,200	
エスベック	11,500	1,833.00	21,079,500	
キーエンス	141,300	54,990.00	7,770,087,000	
日置電機	6,700	6,690.00	44,823,000	
シスメックス	111,600	8,396.00	936,993,600	
日本マイクロニクス	21,400	1,420.00	30,388,000	
メガチップス	13,700	2,624.00	35,948,800	
O B A R A G R O U P	6,000	3,430.00	20,580,000	
I M A G I C A G R O U P	10,800	958.00	10,346,400	
澤藤電機	1,900	1,223.00	2,323,700	
デンソー	305,100	7,365.00	2,247,061,500	
原田工業	7,400	778.00	5,757,200	
コーセル	17,300	919.00	15,898,700	
イリソ電子工業	13,100	4,135.00	54,168,500	
オブテックスグループ	23,700	2,157.00	51,120,900	
千代田インテグレ	5,200	2,213.00	11,507,600	
レーザーテック	63,900	19,025.00	1,215,697,500	
スタンレー電気	100,500	2,595.00	260,797,500	
岩崎電気	4,900	2,569.00	12,588,100	
ウシオ電機	73,800	1,706.00	125,902,800	
岡谷電機産業	11,100	247.00	2,741,700	
ヘリオス テクノ ホールディング	13,300	376.00	5,000,800	
エノモト	4,400	1,530.00	6,732,000	
日本セラミック	13,200	2,658.00	35,085,600	

遠藤照明	7,100	782.00	5,552,200	
古河電池	11,200	1,192.00	13,350,400	
双信電機	7,400	431.00	3,189,400	
山一電機	10,200	2,085.00	21,267,000	
図研	10,100	3,660.00	36,966,000	
日本電子	30,000	5,830.00	174,900,000	
カシオ計算機	96,400	1,355.00	130,622,000	
ファナック	136,800	23,180.00	3,171,024,000	
日本シイエムケイ	27,500	474.00	13,035,000	
エンプラス	3,900	4,610.00	17,979,000	
大真空	19,200	985.00	18,912,000	
ローム	64,800	11,090.00	718,632,000	
浜松ホトニクス	103,900	6,330.00	657,687,000	
三井ハイテック	13,400	8,650.00	115,910,000	
新光電気工業	45,800	3,880.00	177,704,000	
京セラ	219,400	8,086.00	1,774,068,400	
協栄産業	1,600	1,504.00	2,406,400	
太陽誘電	69,300	4,300.00	297,990,000	
村田製作所	425,300	7,623.00	3,242,061,900	
双葉電子工業	26,700	655.00	17,488,500	
日東電工	94,300	9,230.00	870,389,000	
北陸電気工業	5,800	1,105.00	6,409,000	
東海理化電機製作所	41,100	1,522.00	62,554,200	
ニチコン	41,500	1,546.00	64,159,000	
日本ケミコン	14,700	1,959.00	28,797,300	
K O A	21,600	2,474.00	53,438,400	
三井E & Sホールディングス	57,900	420.00	24,318,000	
日立造船	123,500	887.00	109,544,500	
三菱重工業	228,700	5,210.00	1,191,527,000	
川崎重工業	105,600	2,582.00	272,659,200	
I H I	97,300	3,760.00	365,848,000	
名村造船所	40,300	648.00	26,114,400	
サノヤスホールディングス	17,600	124.00	2,182,400	
スプリックス	5,000	988.00	4,940,000	
マネジメントソリューションズ	7,300	2,990.00	21,827,000	
プロレド・パートナーズ	3,200	545.00	1,744,000	
and factory	4,300	373.00	1,603,900	
テノ・ホールディングス	1,800	569.00	1,024,200	
フロンティア・マネジメント	4,000	1,288.00	5,152,000	
ピアラ	2,300	765.00	1,759,500	
コプロ・ホールディングス	2,900	903.00	2,618,700	
ギークス	2,600	895.00	2,327,000	
カーブスホールディングス	40,900	854.00	34,928,600	
フォーラムエンジニアリング	9,000	929.00	8,361,000	
FAST FITNESS JAPAN	2,800	1,584.00	4,435,200	
日本車輛製造	5,000	2,137.00	10,685,000	
三菱ロジスネクスト	20,700	836.00	17,305,200	
近畿車輛	1,600	1,002.00	1,603,200	
一家ホールディングス	2,800	706.00	1,976,800	

フルサト・マルカホールディングス	13,600	3,320.00	45,152,000	
ヤマエグループホールディングス	8,600	1,663.00	14,301,800	
藤久ホールディングス	4,700	598.00	2,810,600	
F P G	51,700	1,342.00	69,381,400	
島根銀行	4,600	463.00	2,129,800	
じもとホールディングス	10,200	506.00	5,161,200	
全国保証	36,700	4,750.00	174,325,000	
めぶきフィナンシャルグループ	632,600	273.00	172,699,800	
ジャパンインベストメントアドバイザ	10,500	1,389.00	14,584,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,800	2,267.00	40,352,600	
九州フィナンシャルグループ	269,100	374.00	100,643,400	
かんぽ生命保険	154,800	2,203.00	341,024,400	
ゆうちょ銀行	363,000	1,029.00	373,527,000	
あんしん保証	6,000	263.00	1,578,000	
富山第一銀行	34,200	427.00	14,603,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	761,200	452.00	344,062,400	
ジェイリース	5,100	2,738.00	13,963,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	80,700	744.00	60,040,800	
イントラスト	6,500	611.00	3,971,500	
日本モーゲージサービス	8,500	908.00	7,718,000	
C A S A	5,400	836.00	4,514,400	
アルヒ	22,700	1,022.00	23,199,400	
プレミアグループ	23,400	1,937.00	45,325,800	
日産自動車	1,838,800	552.90	1,016,672,520	
いすゞ自動車	451,600	1,791.00	808,815,600	
トヨタ自動車	7,107,900	2,070.00	14,713,353,000	
日野自動車	194,700	650.00	126,555,000	
三菱自動車工業	577,200	627.00	361,904,400	
エフテック	9,900	529.00	5,237,100	
レシップホールディングス	5,700	530.00	3,021,000	
G M B	2,800	731.00	2,046,800	
ファルテック	2,800	600.00	1,680,000	
武蔵精密工業	34,800	1,719.00	59,821,200	
日産車体	22,800	805.00	18,354,000	
新明和工業	40,700	1,069.00	43,508,300	
極東開発工業	24,800	1,392.00	34,521,600	
トビー工業	11,700	1,418.00	16,590,600	
ティラド	4,300	2,778.00	11,945,400	
曙ブレーキ工業	85,700	175.00	14,997,500	
タチエス	25,500	1,221.00	31,135,500	
N O K	58,700	1,270.00	74,549,000	
フタバ産業	34,700	352.00	12,214,400	
K Y B	13,700	3,495.00	47,881,500	
市光工業	18,600	391.00	7,272,600	
大同メタル工業	30,000	521.00	15,630,000	
プレス工業	69,900	442.00	30,895,800	
ミクニ	18,100	331.00	5,991,100	

太平洋工業	29,700	1,136.00	33,739,200
河西工業	19,200	234.00	4,492,800
アイシン	114,000	4,180.00	476,520,000
マツダ	458,800	1,236.00	567,076,800
今仙電機製作所	10,200	568.00	5,793,600
本田技研工業	1,140,000	3,714.00	4,233,960,000
スズキ	309,100	5,043.00	1,558,791,300
S U B A R U	409,600	2,652.50	1,086,464,000
安永	6,200	723.00	4,482,600
ヤマハ発動機	203,500	2,925.00	595,237,500
小糸製作所	77,800	4,870.00	378,886,000
T B K	15,600	313.00	4,882,800
エクセディ	23,500	1,804.00	42,394,000
ミツバ	24,200	434.00	10,502,800
豊田合成	44,100	2,424.00	106,898,400
愛三工業	24,400	739.00	18,031,600
盟和産業	1,600	990.00	1,584,000
日本プラスト	11,300	460.00	5,198,000
ヨロズ	12,200	885.00	10,797,000
エフ・シー・シー	25,400	1,454.00	36,931,600
新家工業	3,300	1,696.00	5,596,800
シマノ	52,900	25,270.00	1,336,783,000
テイ・エス テック	65,900	1,563.00	103,001,700
三十三フィナンシャルグループ	12,400	1,470.00	18,228,000
第四北越フィナンシャルグループ	21,700	2,632.00	57,114,400
ひろぎんホールディングス	196,500	614.00	120,651,000
マーキュリアホールディングス	8,300	645.00	5,353,500
おきなわフィナンシャルグループ	13,000	2,150.00	27,950,000
ダイレクトマーケティングミックス	15,100	1,753.00	26,470,300
ポピンズ	2,000	1,766.00	3,532,000
L I T A L I C O	12,100	2,886.00	34,920,600
十六フィナンシャルグループ	17,900	2,470.00	44,213,000
北國フィナンシャルホールディングス	12,800	4,710.00	60,288,000
ネットプロテクションズホールディングス	46,700	508.00	23,723,600
プロクレアホールディングス	15,600	2,159.00	33,680,400
ジャムコ	9,100	1,514.00	13,777,400
小野建	13,700	1,485.00	20,344,500
はるやまホールディングス	7,200	416.00	2,995,200
南陽	2,900	1,877.00	5,443,300
ノジマ	24,800	2,750.00	68,200,000
佐島電機	9,600	1,263.00	12,124,800
カッパ・クリエイト	21,600	1,418.00	30,628,800
エコートレーディング	3,000	546.00	1,638,000
伯東	9,000	3,625.00	32,625,000
コンドーテック	11,500	1,030.00	11,845,000
中山福	8,100	308.00	2,494,800
ライトオン	11,500	692.00	7,958,000
ナガイレーベン	18,500	1,979.00	36,611,500
三菱食品	14,700	3,335.00	49,024,500

良品計画	176,700	1,297.00	229,179,900	
パリミキホールディングス	19,000	250.00	4,750,000	
松田産業	11,200	2,364.00	26,476,800	
第一興商	29,200	4,030.00	117,676,000	
メディカルホールディングス	142,000	1,885.00	267,670,000	
アドヴァングループ	13,000	854.00	11,102,000	
S P K	6,000	1,420.00	8,520,000	
萩原電気ホールディングス	5,200	2,280.00	11,856,000	
アルビス	4,500	2,308.00	10,386,000	
アズワン	22,100	6,570.00	145,197,000	
スズデン	4,800	2,085.00	10,008,000	
尾家産業	3,200	866.00	2,771,200	
シモジマ	9,400	1,088.00	10,227,200	
ドウシシャ	14,400	1,508.00	21,715,200	
小津産業	3,400	1,751.00	5,953,400	
コナカ	16,600	350.00	5,810,000	
高速	8,100	1,532.00	12,409,200	
ハウス オブ ローゼ	1,900	1,623.00	3,083,700	
G - 7ホールディングス	17,000	1,465.00	24,905,000	
たけびし	5,100	1,528.00	7,792,800	
イオン北海道	20,300	1,150.00	23,345,000	
コジマ	26,400	619.00	16,341,600	
ヒマラヤ	4,700	955.00	4,488,500	
コーナン商事	21,900	3,350.00	73,365,000	
ネットワークシステムズ	56,500	3,015.00	170,347,500	
エコス	5,000	1,830.00	9,150,000	
ワタミ	18,600	915.00	17,019,000	
マルシェ	5,000	457.00	2,285,000	
リックス	3,200	2,065.00	6,608,000	
システムソフト	45,100	107.00	4,825,700	
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	307,100	2,605.00	799,995,500	
丸文	12,200	809.00	9,869,800	
西松屋チェーン	30,300	1,565.00	47,419,500	
ゼンショーホールディングス	75,000	3,565.00	267,375,000	
ハビネット	11,700	1,604.00	18,766,800	
幸楽苑ホールディングス	9,000	1,020.00	9,180,000	
ハークスレイ	6,400	507.00	3,244,800	
橋本総業ホールディングス	2,800	2,004.00	5,611,200	
日本ライフライン	45,500	1,017.00	46,273,500	
サイゼリヤ	22,700	2,565.00	58,225,500	
タカショー	12,000	683.00	8,196,000	
V Tホールディングス	57,800	494.00	28,553,200	
アルゴグラフィックス	12,000	3,985.00	47,820,000	
魚力	4,300	2,205.00	9,481,500	
I D O M	46,600	876.00	40,821,600	
日本エム・ディ・エム	9,000	1,281.00	11,529,000	
ポブラ	3,500	148.00	518,000	
フジ・コーポレーション	8,100	1,267.00	10,262,700	
ユナイテッドアローズ	16,000	1,883.00	30,128,000	



進和	9,000	2,205.00	19,845,000
エスケイジャパン	3,700	590.00	2,183,000
ダイترون	5,300	2,145.00	11,368,500
ハイデイ日高	22,200	2,031.00	45,088,200
シークス	19,500	1,145.00	22,327,500
YU - WA CREATION HOLDINGS	9,000	205.00	1,845,000
コロワイド	63,100	1,884.00	118,880,400
ピーシーデポコーポレーション	17,800	276.00	4,912,800
田中商事	3,700	568.00	2,101,600
オーハシテクニカ	7,500	1,400.00	10,500,000
壱番屋	10,800	4,445.00	48,006,000
白銅	4,900	2,654.00	13,004,600
トップカルチャー	4,900	215.00	1,053,500
PLANT	3,600	675.00	2,430,000
スギホールディングス	30,700	6,000.00	184,200,000
ダイコー通産	1,600	1,124.00	1,798,400
薬王堂ホールディングス	7,600	2,315.00	17,594,000
島津製作所	186,400	4,130.00	769,832,000
JMS	12,000	569.00	6,828,000
クボテック	3,400	243.00	826,200
長野計器	10,400	1,082.00	11,252,800
ブイ・テクノロジー	6,800	2,929.00	19,917,200
スター精密	25,300	1,829.00	46,273,700
東京計器	9,900	1,273.00	12,602,700
愛知時計電機	5,600	1,436.00	8,041,600
インターアクション	7,800	1,706.00	13,306,800
オーバル	13,900	468.00	6,505,200
東京精密	24,300	4,695.00	114,088,500
マニー	56,900	1,804.00	102,647,600
ニコン	219,800	1,512.00	332,337,600
トプコン	73,300	1,940.00	142,202,000
オリンパス	747,000	3,177.00	2,373,219,000
理研計器	10,300	4,605.00	47,431,500
SCREENホールディングス	24,600	9,360.00	230,256,000
キヤノン電子	14,300	1,636.00	23,394,800
タムロン	9,700	3,140.00	30,458,000
HOYA	301,000	15,260.00	4,593,260,000
シード	7,300	555.00	4,051,500
ノーリツ鋼機	12,300	2,650.00	32,595,000
A & Dホロンホールディングス	17,600	937.00	16,491,200
朝日インテック	171,000	2,522.00	431,262,000
キヤノン	710,200	3,337.00	2,369,937,400
リコー	370,900	1,124.00	416,891,600
シチズン時計	142,200	631.00	89,728,200
リズム	4,800	1,454.00	6,979,200
大研医器	12,300	485.00	5,965,500
メニコン	48,200	3,330.00	160,506,000
シンシア	1,300	437.00	568,100
中本パックス	4,400	1,577.00	6,938,800

スノーピーク	22,200	2,203.00	48,906,600
パラマウントベッドホールディングス	29,900	2,671.00	79,862,900
トランザクション	9,900	1,054.00	10,434,600
粧美堂	3,900	427.00	1,665,300
ニホンフラッシュ	12,200	1,022.00	12,468,400
前田工織	14,000	3,410.00	47,740,000
永大産業	16,900	248.00	4,191,200
アートネイチャー	13,400	735.00	9,849,000
パンダイナムコホールディングス	128,900	10,300.00	1,327,670,000
アイフィスジャパン	4,000	606.00	2,424,000
共立印刷	21,400	134.00	2,867,600
SHOEI	13,600	5,570.00	75,752,000
フランスベッドホールディングス	20,000	955.00	19,100,000
マーベラス	24,000	675.00	16,200,000
パイロットコーポレーション	20,200	5,410.00	109,282,000
萩原工業	8,700	1,083.00	9,422,100
エイベックス	26,400	1,620.00	42,768,000
フジシールインターナショナル	32,000	1,564.00	50,048,000
タカラトミー	64,400	1,339.00	86,231,600
広済堂ホールディングス	9,700	1,280.00	12,416,000
エステールホールディングス	3,400	627.00	2,131,800
レック	18,400	788.00	14,499,200
タカノ	5,300	752.00	3,985,600
三光合成	17,800	464.00	8,259,200
プロネクサス	12,200	971.00	11,846,200
ホクシン	10,800	150.00	1,620,000
ウッドワン	4,700	1,125.00	5,287,500
大建工業	7,900	1,958.00	15,468,200
きもと	23,800	261.00	6,211,800
凸版印刷	203,200	2,297.00	466,750,400
大日本印刷	168,900	3,065.00	517,678,500
共同印刷	4,100	2,496.00	10,233,600
NISSHA	24,600	1,897.00	46,666,200
光村印刷	600	1,232.00	739,200
藤森工業	12,200	3,585.00	43,737,000
ヴィア・ホールディングス	20,000	140.00	2,800,000
TAKARA & COMPANY	9,000	2,126.00	19,134,000
前澤化成工業	9,100	1,313.00	11,948,300
未来工業	5,600	1,515.00	8,484,000
アシックス	119,500	2,601.00	310,819,500
ツツミ	3,900	2,027.00	7,905,300
ウェーブロックホールディングス	5,800	622.00	3,607,600
JSP	9,100	1,454.00	13,231,400
ニチハ	19,900	2,859.00	56,894,100
ローランド	9,500	4,005.00	38,047,500
エフピコ	28,600	3,405.00	97,383,000
小松ウオール工業	4,700	1,908.00	8,967,600
ヤマハ	90,600	5,390.00	488,334,000
河合楽器製作所	4,000	2,781.00	11,124,000
クリナップ	14,400	616.00	8,870,400

ビジョン	82,500	2,201.00	181,582,500
天馬	12,300	2,250.00	27,675,000
兼松サステック	600	1,645.00	987,000
キングジム	11,400	917.00	10,453,800
象印マホービン	38,700	1,602.00	61,997,400
リンテック	29,700	2,356.00	69,973,200
信越ポリマー	28,000	1,347.00	37,716,000
東リ	35,600	204.00	7,262,400
イトーキ	26,500	425.00	11,262,500
任天堂	88,000	58,960.00	5,188,480,000
三菱鉛筆	18,700	1,415.00	26,460,500
松風	5,100	2,319.00	11,826,900
タカラスタンダード	25,000	1,356.00	33,900,000
コクヨ	62,300	1,840.00	114,632,000
ナカバヤシ	12,600	515.00	6,489,000
ニフコ	52,000	3,180.00	165,360,000
立川ブラインド工業	6,000	1,045.00	6,270,000
グローブライド	11,600	2,543.00	29,498,800
オカムラ	43,800	1,359.00	59,524,200
パルカー	12,700	2,711.00	34,429,700
MUTOHホールディングス	1,100	1,925.00	2,117,500
伊藤忠商事	920,700	3,833.00	3,529,043,100
丸紅	1,330,300	1,413.50	1,880,379,050
スクロール	23,600	748.00	17,652,800
高島	2,100	2,555.00	5,365,500
ヨンドシーホールディングス	13,000	1,801.00	23,413,000
三陽商会	6,700	967.00	6,478,900
長瀬産業	70,200	2,066.00	145,033,200
ナイガイ	4,300	271.00	1,165,300
蝶理	8,600	2,048.00	17,612,800
豊田通商	137,100	5,070.00	695,097,000
オンワードホールディングス	84,200	293.00	24,670,600
三共生興	19,700	475.00	9,357,500
兼松	53,200	1,517.00	80,704,400
美津濃	13,000	2,731.00	35,503,000
ツカモトコーポレーション	1,900	1,041.00	1,977,900
ルックホールディングス	4,200	2,116.00	8,887,200
三井物産	1,113,100	3,247.00	3,614,235,700
日本紙パルプ商事	7,300	4,425.00	32,302,500
東京エレクトロン	99,000	43,450.00	4,301,550,000
カメイ	16,300	1,139.00	18,565,700
東都水産	600	4,955.00	2,973,000
OUGホールディングス	2,100	2,911.00	6,113,100
スターゼン	10,400	2,079.00	21,621,600
セイコーホールディングス	22,100	2,964.00	65,504,400
山善	55,300	937.00	51,816,100
椿本興業	2,600	3,770.00	9,802,000
住友商事	908,600	1,966.00	1,786,307,600
BIPROGY	47,800	3,145.00	150,331,000
内田洋行	6,000	4,405.00	26,430,000

三菱商事	1,006,900	4,416.00	4,446,470,400	
第一実業	5,800	3,845.00	22,301,000	
キヤノンマーケティングジャパン	31,800	3,225.00	102,555,000	
西華産業	6,600	1,641.00	10,830,600	
佐藤商事	10,600	1,178.00	12,486,800	
菱洋エレクトロ	9,000	2,357.00	21,213,000	
東京産業	12,500	798.00	9,975,000	
ユアサ商事	12,300	3,635.00	44,710,500	
神鋼商事	3,500	4,180.00	14,630,000	
トルク	6,000	230.00	1,380,000	
阪和興業	26,600	3,680.00	97,888,000	
正栄食品工業	9,100	3,980.00	36,218,000	
カナデン	12,500	1,073.00	13,412,500	
菱電商事	12,200	1,629.00	19,873,800	
ニプロ	107,900	1,161.00	125,271,900	
岩谷産業	34,000	5,530.00	188,020,000	
ナイス	4,700	1,576.00	7,407,200	
ニチモウ	1,900	2,560.00	4,864,000	
極東貿易	8,800	1,346.00	11,844,800	
アステナホールディングス	20,000	452.00	9,040,000	
兼松エレクトロニクス	8,300	4,245.00	35,233,500	
三愛オブリ	34,300	1,106.00	37,935,800	
稲畑産業	30,800	2,451.00	75,490,800	
G S Iクレオス	7,400	1,533.00	11,344,200	
明和産業	14,100	796.00	11,223,600	
クワザワホールディングス	5,400	429.00	2,316,600	
キムラタン	85,000	22.00	1,870,000	
ゴールドウイン	25,300	7,940.00	200,882,000	
ユニ・チャーム	270,500	4,812.00	1,301,646,000	
デサント	26,100	3,600.00	93,960,000	
キング	7,200	422.00	3,038,400	
ワキタ	27,700	1,138.00	31,522,600	
ヤマトインターナショナル	11,400	267.00	3,043,800	
東邦ホールディングス	41,700	1,867.00	77,853,900	
サンゲツ	37,200	1,669.00	62,086,800	
ミツウロコグループホールディングス	17,600	1,023.00	18,004,800	
シナネンホールディングス	5,000	3,760.00	18,800,000	
伊藤忠エネクス	34,000	1,072.00	36,448,000	
サンリオ	43,100	3,675.00	158,392,500	
サンワテクノス	7,700	1,400.00	10,780,000	
リョーサン	15,700	2,312.00	36,298,400	
新光商事	20,200	981.00	19,816,200	
トーヨー	5,800	1,505.00	8,729,000	
三信電気	6,300	1,767.00	11,132,100	
東陽テクニカ	15,200	1,313.00	19,957,600	
モスフードサービス	20,100	3,100.00	62,310,000	
加賀電子	12,500	4,230.00	52,875,000	
三益半導体工業	12,100	2,122.00	25,676,200	
都築電気	6,800	1,351.00	9,186,800	
ソーダニッカ	12,200	608.00	7,417,600	

立花エレテック	10,000	1,659.00	16,590,000
木曽路	20,700	2,137.00	44,235,900
S R S ホールディングス	22,400	867.00	19,420,800
千趣会	25,200	392.00	9,878,400
タカキュー	10,600	86.00	911,600
リテールパートナーズ	20,300	1,065.00	21,619,500
ケーヨー	28,400	896.00	25,446,400
上新電機	14,900	1,887.00	28,116,300
日本瓦斯	73,400	2,161.00	158,617,400
ロイヤルホールディングス	26,100	2,146.00	56,010,600
東天紅	600	851.00	510,600
いなげや	15,200	1,207.00	18,346,400
チヨダ	13,100	791.00	10,362,100
ライフコーポレーション	12,000	2,683.00	32,196,000
リンガーハット	17,600	2,149.00	37,822,400
M r M a x H D	19,200	630.00	12,096,000
テンアライド	15,200	307.00	4,666,400
A O K I ホールディングス	29,700	739.00	21,948,300
オークワ	21,900	930.00	20,367,000
コメリ	23,700	2,635.00	62,449,500
青山商事	29,300	1,003.00	29,387,900
しまむら	17,800	12,560.00	223,568,000
はせがわ	7,900	394.00	3,112,600
高島屋	103,300	1,707.00	176,333,100
松屋	25,800	1,036.00	26,728,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	66,700	1,148.00	76,571,600
近鉄百貨店	4,400	2,336.00	10,278,400
丸井グループ	111,100	2,554.00	283,749,400
クレディセゾン	89,700	1,786.00	160,204,200
アクシアル リテイリング	10,200	3,365.00	34,323,000
井筒屋	7,200	389.00	2,800,800
イオン	506,500	2,687.50	1,361,218,750
イズミ	24,300	3,020.00	73,386,000
フォーバル	5,300	996.00	5,278,800
平和堂	22,900	2,025.00	46,372,500
フジ	33,600	1,939.00	65,150,400
ヤオコー	17,500	6,620.00	115,850,000
ゼビオホールディングス	20,900	986.00	20,607,400
ケーズホールディングス	130,700	1,243.00	162,460,100
P A L T A C	21,600	4,165.00	89,964,000
三谷産業	23,800	310.00	7,378,000
O l y m p i c グループ	6,700	589.00	3,946,300
日産東京販売ホールディングス	22,600	294.00	6,644,400
新生銀行	100,300	1,948.00	195,384,400
あおぞら銀行	85,900	2,694.00	231,414,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,001,200	725.30	6,528,570,360
りそなホールディングス	1,627,200	530.00	862,416,000
三井住友トラスト・ホールディングス	254,300	4,312.00	1,096,541,600
三井住友フィナンシャルグループ	997,900	4,326.00	4,316,915,400
千葉銀行	434,200	754.00	327,386,800

群馬銀行	247,400	392.00	96,980,800
武蔵野銀行	19,700	1,702.00	33,529,400
千葉興業銀行	33,100	265.00	8,771,500
筑波銀行	59,900	190.00	11,381,000
七十七銀行	40,900	1,792.00	73,292,800
秋田銀行	9,200	1,654.00	15,216,800
山形銀行	14,100	943.00	13,296,300
岩手銀行	9,400	1,850.00	17,390,000
東邦銀行	110,000	208.00	22,880,000
東北銀行	6,900	974.00	6,720,600
ふくおかフィナンシャルグループ	111,000	2,505.00	278,055,000
静岡銀行	316,900	816.00	258,590,400
スルガ銀行	134,900	375.00	50,587,500
八十二銀行	285,400	478.00	136,421,200
山梨中央銀行	15,400	1,156.00	17,802,400
大垣共立銀行	26,300	1,722.00	45,288,600
福井銀行	12,300	1,406.00	17,293,800
清水銀行	5,500	1,470.00	8,085,000
富山銀行	2,300	1,709.00	3,930,700
滋賀銀行	25,000	2,531.00	63,275,000
南都銀行	20,800	1,973.00	41,038,400
百五銀行	129,200	317.00	40,956,400
京都銀行	47,700	5,430.00	259,011,000
紀陽銀行	45,600	1,535.00	69,996,000
ほくほくフィナンシャルグループ	87,200	844.00	73,596,800
山陰合同銀行	85,500	694.00	59,337,000
中国銀行	108,200	937.00	101,383,400
鳥取銀行	4,900	1,115.00	5,463,500
伊予銀行	172,400	644.00	111,025,600
百十四銀行	14,100	1,631.00	22,997,100
四国銀行	20,300	851.00	17,275,300
阿波銀行	20,400	1,887.00	38,494,800
大分銀行	8,200	1,878.00	15,399,600
宮崎銀行	8,300	2,204.00	18,293,200
佐賀銀行	8,100	1,544.00	12,506,400
琉球銀行	33,300	780.00	25,974,000
セブン銀行	456,800	262.00	119,681,600
みずほフィナンシャルグループ	1,843,800	1,637.00	3,018,300,600
高知銀行	4,800	657.00	3,153,600
山口フィナンシャルグループ	153,600	778.00	119,500,800
芙蓉総合リース	13,200	8,190.00	108,108,000
みずほリース	19,000	3,320.00	63,080,000
東京センチュリー	23,800	4,910.00	116,858,000
SBIホールディングス	189,900	2,727.00	517,857,300
日本証券金融	60,400	836.00	50,494,400
アイフル	258,100	396.00	102,207,600
日本アジア投資	12,200	241.00	2,940,200
長野銀行	4,700	1,246.00	5,856,200
名古屋銀行	9,400	3,100.00	29,140,000
北洋銀行	193,200	228.00	44,049,600

愛知銀行	4,700	5,650.00	26,555,000
中京銀行	4,700	1,844.00	8,666,800
大光銀行	4,500	1,356.00	6,102,000
愛媛銀行	20,000	860.00	17,200,000
トマト銀行	4,600	1,033.00	4,751,800
京葉銀行	64,200	493.00	31,650,600
栃木銀行	68,900	282.00	19,429,800
北日本銀行	4,500	1,740.00	7,830,000
東和銀行	25,200	530.00	13,356,000
福島銀行	16,200	213.00	3,450,600
大東銀行	6,700	630.00	4,221,000
リコーリース	13,600	3,615.00	49,164,000
イオンフィナンシャルサービス	83,700	1,507.00	126,135,900
アコム	303,400	328.00	99,515,200
ジャックス	15,200	3,845.00	58,444,000
オリエントコーポレーション	416,000	120.00	49,920,000
オリックス	913,700	2,331.50	2,130,291,550
三菱HCキャピタル	497,000	681.00	338,457,000
ジャフコ グループ	53,200	2,199.00	116,986,800
九州リースサービス	6,600	609.00	4,019,400
トモニホールディングス	111,000	316.00	35,076,000
大和証券グループ本社	987,500	620.90	613,138,750
野村ホールディングス	2,348,000	507.70	1,192,079,600
岡三証券グループ	110,900	335.00	37,151,500
丸三証券	45,700	475.00	21,707,500
東洋証券	46,600	255.00	11,883,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	151,400	379.00	57,380,600
光世証券	3,000	438.00	1,314,000
水戸証券	37,700	260.00	9,802,000
いちよし証券	25,400	644.00	16,357,600
松井証券	75,300	804.00	60,541,200
SOMPOホールディングス	218,800	6,110.00	1,336,868,000
日本取引所グループ	358,200	2,095.00	750,429,000
マネックスグループ	129,500	506.00	65,527,000
極東証券	17,500	695.00	12,162,500
岩井コスモホールディングス	14,400	1,253.00	18,043,200
アイザワ証券グループ	20,800	660.00	13,728,000
フィデアホールディングス	14,000	1,317.00	18,438,000
池田泉州ホールディングス	163,200	213.00	34,761,600
アニコム ホールディングス	47,300	642.00	30,366,600
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	316,100	4,162.00	1,315,608,200
マネーパートナーズグループ	16,300	257.00	4,189,100
スパークス・グループ	71,000	311.00	22,081,000
小林洋行	3,200	220.00	704,000
第一生命ホールディングス	748,900	2,419.00	1,811,589,100
東京海上ホールディングス	427,900	7,762.00	3,321,359,800
アドバンテッジリスクマネジメント	7,400	483.00	3,574,200
イー・ギャランティ	22,800	2,328.00	53,078,400

アサックス	8,000	595.00	4,760,000
NECキャピタルソリューション	6,200	2,132.00	13,218,400
T&Dホールディングス	342,100	1,505.00	514,860,500
アドバンスクリエイト	7,400	1,076.00	7,962,400
三井不動産	600,100	2,915.00	1,749,291,500
三菱地所	875,700	1,955.00	1,711,993,500
平和不動産	24,400	4,035.00	98,454,000
東京建物	121,600	2,142.00	260,467,200
京阪神ビルディング	20,100	1,287.00	25,868,700
住友不動産	276,600	3,552.00	982,483,200
太平洋興発	5,600	710.00	3,976,000
テーオーシー	23,000	754.00	17,342,000
東京楽天地	2,200	4,060.00	8,932,000
レオパレス21	159,400	344.00	54,833,600
スターツコーポレーション	20,900	2,707.00	56,576,300
フジ住宅	17,800	657.00	11,694,600
空港施設	15,300	556.00	8,506,800
明和地所	7,200	619.00	4,456,800
ゴールドクレスト	12,200	1,768.00	21,569,600
リログループ	81,500	2,319.00	188,998,500
エスリード	5,900	1,738.00	10,254,200
日神グループホールディングス	25,000	433.00	10,825,000
日本エスコン	28,600	799.00	22,851,400
タカラレーベン	64,500	390.00	25,155,000
AVANTIA	7,200	805.00	5,796,000
イオンモール	77,200	1,668.00	128,769,600
毎日コムネット	5,200	630.00	3,276,000
ファースト住建	5,700	1,098.00	6,258,600
ランド	837,100	11.00	9,208,100
カチタス	38,100	3,590.00	136,779,000
東祥	11,200	1,199.00	13,428,800
トーセイ	21,300	1,437.00	30,608,100
穴吹興産	3,400	2,066.00	7,024,400
サンフロンティア不動産	21,300	1,185.00	25,240,500
FJネクストホールディングス	15,100	1,038.00	15,673,800
インテリックス	3,500	560.00	1,960,000
ランドビジネス	5,100	235.00	1,198,500
サンネクスタグループ	4,600	968.00	4,452,800
グランディハウス	10,500	559.00	5,869,500
東武鉄道	142,100	3,360.00	477,456,000
相鉄ホールディングス	46,300	2,358.00	109,175,400
東急	362,900	1,690.00	613,301,000
京浜急行電鉄	173,500	1,423.00	246,890,500
小田急電鉄	196,100	1,886.00	369,844,600
京王電鉄	68,400	5,470.00	374,148,000
京成電鉄	94,762	3,930.00	372,414,660
富士急行	16,000	4,225.00	67,600,000
東日本旅客鉄道	237,800	7,215.00	1,715,727,000
西日本旅客鉄道	165,400	5,527.00	914,165,800
東海旅客鉄道	109,700	16,650.00	1,826,505,000



西武ホールディングス	187,900	1,439.00	270,388,100
鴻池運輸	22,100	1,382.00	30,542,200
西日本鉄道	37,500	2,859.00	107,212,500
ハマキョウレックス	10,100	3,320.00	33,532,000
サカイ引越センター	7,200	4,820.00	34,704,000
近鉄グループホールディングス	138,400	4,715.00	652,556,000
阪急阪神ホールディングス	172,300	4,300.00	740,890,000
南海電気鉄道	61,700	2,829.00	174,549,300
京阪ホールディングス	57,600	3,585.00	206,496,000
神戸電鉄	3,600	3,385.00	12,186,000
名古屋鉄道	142,800	2,155.00	307,734,000
山陽電気鉄道	10,600	2,202.00	23,341,200
アルプス物流	10,300	1,120.00	11,536,000
トランコム	4,200	7,960.00	33,432,000
ヤマトホールディングス	202,300	2,191.00	443,239,300
山九	35,900	4,360.00	156,524,000
日新	10,800	1,929.00	20,833,200
丸運	7,000	224.00	1,568,000
丸全昭和運輸	10,000	3,160.00	31,600,000
センコーグループホールディングス	68,400	985.00	67,374,000
トナミホールディングス	2,800	3,750.00	10,500,000
ニッコンホールディングス	44,500	2,430.00	108,135,000
日本石油輸送	900	2,406.00	2,165,400
福山通運	18,900	3,165.00	59,818,500
セイノーホールディングス	80,400	1,154.00	92,781,600
エスライン	4,100	805.00	3,300,500
神奈川中央交通	3,700	3,685.00	13,634,500
日立物流	28,600	8,800.00	251,680,000
丸和運輸機関	24,900	1,567.00	39,018,300
C & F ロジホールディングス	12,500	1,214.00	15,175,000
日本郵船	123,400	10,000.00	1,234,000,000
商船三井	227,700	3,385.00	770,764,500
川崎汽船	45,500	8,060.00	366,730,000
NSユナイテッド海運	6,900	4,460.00	30,774,000
明治海運	13,900	778.00	10,814,200
飯野海運	58,000	756.00	43,848,000
共栄タンカー	2,700	900.00	2,430,000
九州旅客鉄道	99,000	3,010.00	297,990,000
S Gホールディングス	248,000	2,187.00	542,376,000
NIPPON EXPRESSホールディングス	48,200	7,610.00	366,802,000
日本航空	317,400	2,600.00	825,240,000
ANAホールディングス	351,600	2,702.00	950,023,200
ビーウィズ	4,000	1,406.00	5,624,000
パスコ	2,800	1,314.00	3,679,200
TREホールディングス	28,000	1,737.00	48,636,000
人・夢・技術グループ	5,800	2,692.00	15,613,600
西本Wismettacホールディングス	3,600	3,715.00	13,374,000
シルバーライフ	3,200	1,422.00	4,550,400

ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,300	1,575.00	2,047,500	
Genky DrugStores	6,700	3,660.00	24,522,000	
コア商事ホールディングス	9,600	648.00	6,220,800	
国際紙バルブ商事	28,400	756.00	21,470,400	
ナルミヤ・インターナショナル	3,600	857.00	3,085,200	
ブックオフグループホールディングス	9,000	1,044.00	9,396,000	
ギフトホールディングス	2,300	3,085.00	7,095,500	
三菱倉庫	35,700	3,740.00	133,518,000	
三井倉庫ホールディングス	14,400	3,395.00	48,888,000	
住友倉庫	43,400	2,192.00	95,132,800	
澁澤倉庫	7,400	2,097.00	15,517,800	
ヤマタネ	6,600	1,617.00	10,672,200	
東陽倉庫	20,900	277.00	5,789,300	
乾汽船	8,900	1,899.00	16,901,100	
日本トランスシティ	26,000	509.00	13,234,000	
ケイヒン	2,600	1,410.00	3,666,000	
中央倉庫	7,600	943.00	7,166,800	
川西倉庫	2,800	1,042.00	2,917,600	
安田倉庫	9,900	925.00	9,157,500	
ファイズホールディングス	3,200	1,022.00	3,270,400	
東洋埠頭	4,200	1,229.00	5,161,800	
上組	70,100	2,778.00	194,737,800	
サンリツ	3,800	688.00	2,614,400	
キムラユニティー	7,600	819.00	6,224,400	
キューソー流通システム	7,400	1,347.00	9,967,800	
東海運	8,400	277.00	2,326,800	
エーアイテイー	9,200	1,544.00	14,204,800	
内外トランスライン	4,600	2,315.00	10,649,000	
ショーエイコーポレーション	4,300	583.00	2,506,900	
日本コンセプト	4,100	1,794.00	7,355,400	
TBSホールディングス	74,800	1,624.00	121,475,200	
日本テレビホールディングス	127,700	1,174.00	149,919,800	
朝日放送グループホールディングス	12,200	644.00	7,856,800	
テレビ朝日ホールディングス	36,800	1,439.00	52,955,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	129,600	558.00	72,316,800	
テレビ東京ホールディングス	9,400	1,968.00	18,499,200	
日本BS放送	5,100	925.00	4,717,500	
ビジョン	17,000	1,426.00	24,242,000	
スマートバリュー	3,600	485.00	1,746,000	
USEN-NEXT HOLDINGS	11,600	2,044.00	23,710,400	
ワイヤレスゲート	6,200	294.00	1,822,800	
コネクシオ	10,800	1,274.00	13,759,200	
日本通信	127,200	231.00	29,383,200	
クロップス	2,800	941.00	2,634,800	
日本電信電話	1,714,800	3,962.00	6,794,037,600	
KDDI	1,115,300	4,428.00	4,938,548,400	
ソフトバンク	2,317,300	1,520.00	3,522,296,000	
光通信	17,600	17,650.00	310,640,000	
エムティーアイ	11,900	507.00	6,033,300	

GMOインターネットグループ	48,200	2,709.00	130,573,800	
ファイバーゲート	6,900	948.00	6,541,200	
アйдママーケティングコミュニケーション	3,300	292.00	963,600	
KADOKAWA	82,400	2,974.00	245,057,600	
学研ホールディングス	21,600	976.00	21,081,600	
ゼンリン	24,900	940.00	23,406,000	
昭文社ホールディングス	6,100	309.00	1,884,900	
インプレスホールディングス	12,700	216.00	2,743,200	
東京電力ホールディングス	1,166,900	501.00	584,616,900	
中部電力	440,400	1,411.00	621,404,400	
関西電力	545,300	1,336.00	728,520,800	
中国電力	224,900	833.00	187,341,700	
北陸電力	132,300	508.00	67,208,400	
東北電力	340,900	711.00	242,379,900	
四国電力	129,600	812.00	105,235,200	
九州電力	298,400	833.00	248,567,200	
北海道電力	135,500	510.00	69,105,000	
沖縄電力	33,100	1,124.00	37,204,400	
電源開発	115,200	2,128.00	245,145,600	
エフオン	9,400	730.00	6,862,000	
イーレックス	20,100	2,977.00	59,837,700	
レノバ	30,600	3,705.00	113,373,000	
東京瓦斯	277,500	2,589.00	718,447,500	
大阪瓦斯	262,200	2,306.00	604,633,200	
東邦瓦斯	61,100	3,075.00	187,882,500	
北海道瓦斯	7,700	1,663.00	12,805,100	
広島ガス	27,200	331.00	9,003,200	
西部ガスホールディングス	14,800	1,822.00	26,965,600	
静岡ガス	29,500	1,053.00	31,063,500	
メタウォーター	16,100	2,054.00	33,069,400	
アイネット	7,100	1,331.00	9,450,100	
松竹	8,800	11,970.00	105,336,000	
東宝	90,300	5,370.00	484,911,000	
エイチ・アイ・エス	34,800	2,111.00	73,462,800	
東映	4,400	18,020.00	79,288,000	
ラックランド	4,200	2,869.00	12,049,800	
エヌ・ティ・ティ・データ	407,400	2,041.00	831,503,400	
共立メンテナンス	26,600	5,880.00	156,408,000	
イチネンホールディングス	15,200	1,290.00	19,608,000	
建設技術研究所	6,800	2,984.00	20,291,200	
スペース	9,700	863.00	8,371,100	
アインホールディングス	18,900	6,600.00	124,740,000	
燦ホールディングス	6,500	1,866.00	12,129,000	
ピー・シー・エー	9,000	1,070.00	9,630,000	
スバル興業	600	9,160.00	5,496,000	
東京テアトル	5,400	1,213.00	6,550,200	
タナベ経営	4,800	627.00	3,009,600	
ビジネスブレイン太田昭和	5,000	1,543.00	7,715,000	
ナガワ	4,200	7,760.00	32,592,000	

東京都競馬	11,200	4,275.00	47,880,000
常磐興産	5,000	1,270.00	6,350,000
カナモト	24,400	2,113.00	51,557,200
D T S	28,600	3,645.00	104,247,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	71,200	6,250.00	445,000,000
シーイーシー	16,400	1,456.00	23,878,400
カブコン	141,900	3,750.00	532,125,000
西尾レントオール	12,400	2,907.00	36,046,800
アイ・エス・ビー	6,600	1,272.00	8,395,200
アゴーラ ホスピタリティグループ	81,800	23.00	1,881,400
日本空港ビルディング	49,700	6,180.00	307,146,000
トランス・コスモス	18,900	3,815.00	72,103,500
乃村工藝社	63,800	961.00	61,311,800
ジャステック	8,000	1,213.00	9,704,000
S C S K	105,900	2,333.00	247,064,700
藤田観光	5,800	2,763.00	16,025,400
K N T - C Tホールディングス	9,200	1,699.00	15,630,800
日本管財	16,000	2,666.00	42,656,000
トーカイ	11,800	1,868.00	22,042,400
白洋舎	1,400	1,341.00	1,877,400
セコム	146,800	8,788.00	1,290,078,400
N S W	5,800	2,258.00	13,096,400
セントラル警備保障	7,200	2,370.00	17,064,000
アイネス	13,200	1,574.00	20,776,800
丹青社	28,100	798.00	22,423,800
メイテック	52,600	2,391.00	125,766,600
T K C	23,200	3,600.00	83,520,000
富士ソフト	14,600	8,610.00	125,706,000
応用地質	13,000	1,917.00	24,921,000
船井総研ホールディングス	27,900	2,456.00	68,522,400
N S D	48,000	2,563.00	123,024,000
進学会ホールディングス	4,800	315.00	1,512,000
丸紅建材リース	900	1,837.00	1,653,300
オオバ	9,300	714.00	6,640,200
コナミグループ	55,600	7,350.00	408,660,000
いであ	3,300	1,711.00	5,646,300
学究社	4,700	1,646.00	7,736,200
ベネッセホールディングス	49,700	2,140.00	106,358,000
イオンディライト	17,200	2,850.00	49,020,000
ナック	7,000	935.00	6,545,000
福井コンピュータホールディングス	7,000	3,625.00	25,375,000
ダイセキ	27,100	4,485.00	121,543,500
ステップ	5,400	1,861.00	10,049,400
日鉄物産	9,400	5,430.00	51,042,000
泉州電業	3,500	5,540.00	19,390,000
元気寿司	4,400	2,912.00	12,812,800
トラスコ中山	28,700	1,991.00	57,141,700
ヤマダホールディングス	543,200	484.00	262,908,800

オートボックスセブン	47,700	1,436.00	68,497,200	
モリト	10,100	710.00	7,171,000	
アークランズ	24,000	1,493.00	35,832,000	
ニトリホールディングス	60,900	13,000.00	791,700,000	
グルメ杵屋	12,200	1,035.00	12,627,000	
愛眼	8,100	180.00	1,458,000	
ケユーホールディングス	8,000	1,232.00	9,856,000	
吉野家ホールディングス	53,600	2,314.00	124,030,400	
加藤産業	16,600	3,480.00	57,768,000	
北恵	3,500	740.00	2,590,000	
イノテック	9,300	1,355.00	12,601,500	
イエローハット	24,100	1,850.00	44,585,000	
松屋フーズホールディングス	7,400	3,755.00	27,787,000	
JBC Cホールディングス	10,400	1,888.00	19,635,200	
J Kホールディングス	10,800	1,050.00	11,340,000	
サガミホールディングス	22,100	1,224.00	27,050,400	
日伝	10,500	1,826.00	19,173,000	
関西フードマーケット	12,400	1,189.00	14,743,600	
ミロク情報サービス	13,500	1,558.00	21,033,000	
北沢産業	7,600	222.00	1,687,200	
杉本商事	7,200	1,908.00	13,737,600	
因幡電機産業	38,200	2,779.00	106,157,800	
王将フードサービス	10,200	6,330.00	64,566,000	
プレナス	17,200	1,914.00	32,920,800	
ミニストップ	11,400	1,415.00	16,131,000	
アークス	27,200	2,046.00	55,651,200	
パローホールディングス	31,400	1,764.00	55,389,600	
東テク	4,500	3,510.00	15,795,000	
ミスミグループ本社	192,900	3,460.00	667,434,000	
アルテック	8,400	327.00	2,746,800	
ベルク	6,800	5,510.00	37,468,000	
大 庄	8,200	1,120.00	9,184,000	
タキヒヨー	4,200	778.00	3,267,600	
ファーストリテイリング	20,600	85,190.00	1,754,914,000	
ソフトバンクグループ	917,400	5,637.00	5,171,383,800	
蔵王産業	2,200	1,802.00	3,964,400	
スズケン	55,100	3,305.00	182,105,500	
サンドラッグ	57,800	3,485.00	201,433,000	
サックスパー ホールディングス	14,400	650.00	9,360,000	
ジェコス	10,600	820.00	8,692,000	
ヤマザワ	3,000	1,290.00	3,870,000	
やまや	3,200	2,590.00	8,288,000	
グローセル	16,600	428.00	7,104,800	
ペルーナ	32,900	732.00	24,082,800	
合計	159,915,662		394,851,389,800	

(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9月30日現在

資産総額	7,158,287,321円
負債総額	4,694,957円
純資産総額( - )	7,153,592,364円
発行済数量	7,244,776,128口
1口当たり純資産額( / )	0.9874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9月30日現在

資産総額	349,588,610,758円
負債総額	557,271,603円
純資産総額( - )	349,031,339,155円
発行済数量	111,954,114,221口
1口当たり純資産額( / )	3.1176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9月30日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構（2022年9月30日現在）

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

###### 2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年9月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,409,829,470,021
追加型株式投資信託	809	13,996,223,441,636
単位型公社債投資信託	25	48,976,536,231
単位型株式投資信託	220	1,121,972,007,292
合計	1,080	16,577,001,455,180

### 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		
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		
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		
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			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	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おります。

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

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

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おります。

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

## 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) 通常の実行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
株式会社みずほ銀行（ 1）	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北海道銀行	93,524	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北都銀行（ 1）	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。
株式会社常陽銀行	85,113	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社千葉興業銀行（ 1）	62,120	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社きらぼし銀行（ 1）	43,734	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	140,409	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社大垣共立銀行（ 1）	46,773	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社池田泉州銀行	61,385	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社山口銀行	10,005	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社四国銀行（ 1）	25,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社十八親和銀行	36,878	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社宮崎銀行（ 1）	14,697	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北九州銀行	10,000	日本において銀行業務を営んでおります。
みずほ信託銀行株式会社（ 1）	247,369	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。
株式会社きらやか銀行	24,200	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社もみじ銀行	10,000	日本において銀行業務を営んでおります。
信金中央金庫	（ 2）690,998	日本において全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の受給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
a uカブコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

株式会社SBI証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
OKB証券株式会社(1)	1,500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
岡三証券株式会社(1)	5,000	「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。
みずほ証券株式会社(1)	125,167	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	(3) 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。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
フィデリティ証券株式会社	11,758	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
丸國證券株式会社	601	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
丸三証券株式会社	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。
ワイエム証券株式会社	1,270	「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) 出資の総額

(3) 2021年12月31日現在

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

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

### (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

## 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
2022年6月10日	有価証券報告書
2022年6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、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) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

2022年11月11日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 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スリーウェイオープンの2022年3月11日から2022年9月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、MHAMスリーウェイオープンの2022年9月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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