

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年2月9日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集(売出) 内国投資信託受益証券に係るファ ンドの名称】	MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラッ プ)
【届出の対象とした募集(売出) 内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)

(以下「当ファンド」といいます。)

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

(3)【発行(売出)価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4)【発行(売出)価格】

取得申込日の基準価額とします。

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

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

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

注：電話番号はコールセンターのものであります(以下同じ)。

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

(5)【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

申込単位は各販売会社が定める単位とします。

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

申込単位および取扱コースについては、販売会社にお問い合わせください。

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

2023年2月10日から2023年8月7日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

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

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

(9) 【払込期日】

取得申込金額は、販売会社が定める期日までに、販売会社にお支払いいただきます。なお、取得申込金額には利息は付されません。

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

(10) 【払込取扱場所】

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

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

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

お申込みの方法

当ファンドは、ラップ口座にかかる契約¹に基づいて、ラップ口座の資金を運用するためのファンドです。

当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社にラップ口座を開設した者²に限るものとします。

- 1 当該契約については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約を使用することがあります。
- 2 販売会社にSMA(セパレートリー・マネージド・アカウント)にかかる契約に基づくSMA口座を開設した者を含む場合があります。

投資信託振替制度における振替受益権について

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド（以下「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券への投資を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資を行い、東証株価指数（TOPIX、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指します。

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

1. 東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。
2. JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数（TOPIX）にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
3. JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（TOPIX）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
4. JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
5. 本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。
6. JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
7. JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（TOPIX）の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。
8. 以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

<ファンドの特色>

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

1,000億円を上限に信託金を追加することができます。なお、信託金の上限額については、受託会社と合意のうえ変更することができます。

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

< 商品分類 >

・商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・商品分類定義

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

< 属性区分 >

・属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

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

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

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

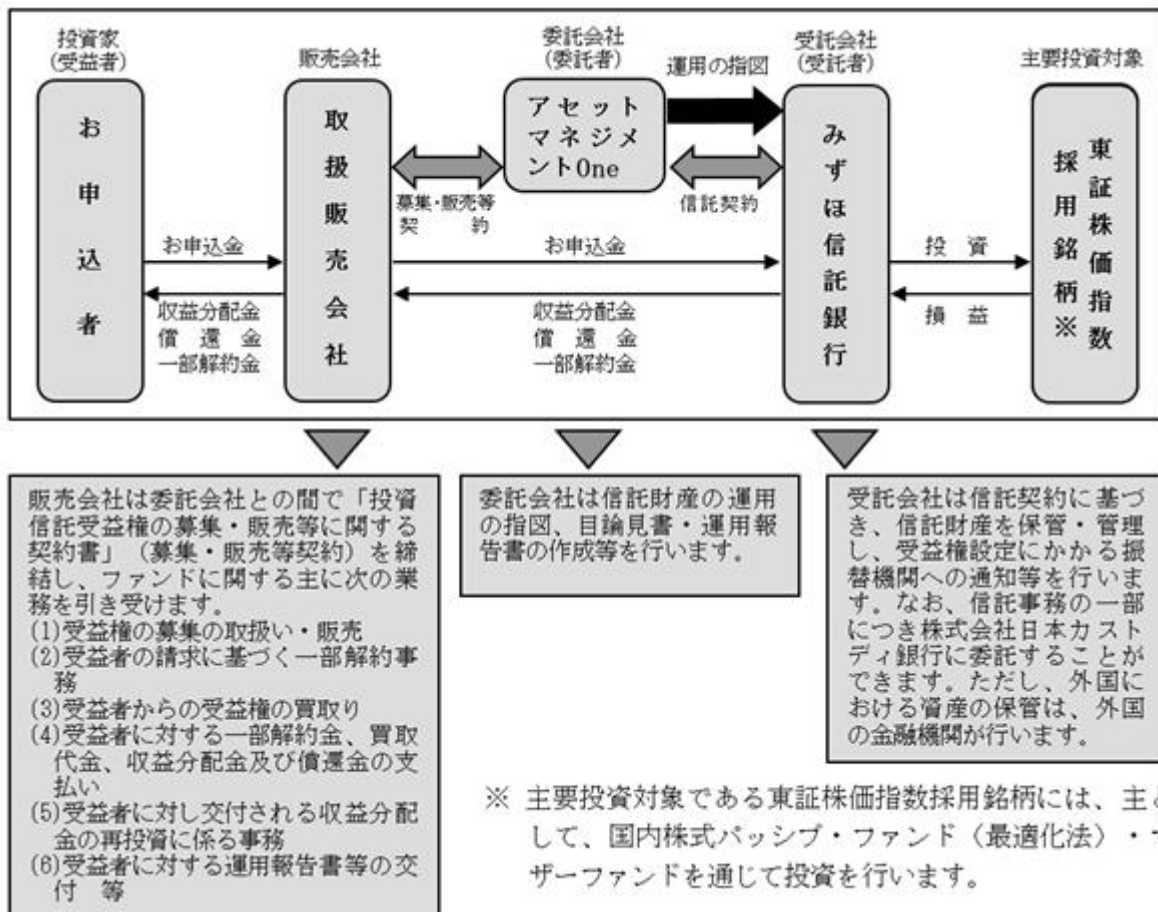
（注3）当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

（2）【ファンドの沿革】

2008年6月3日	信託契約締結、当ファンドの設定・運用開始
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
2020年10月1日	信託報酬率(税抜)を「年率0.26%」から「年率0.135%」に引き下げ
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
2023年2月10日	信託報酬率(税抜)を「年率0.135%」から「年率0.08%」に引き下げ

(3) 【ファンドの仕組み】

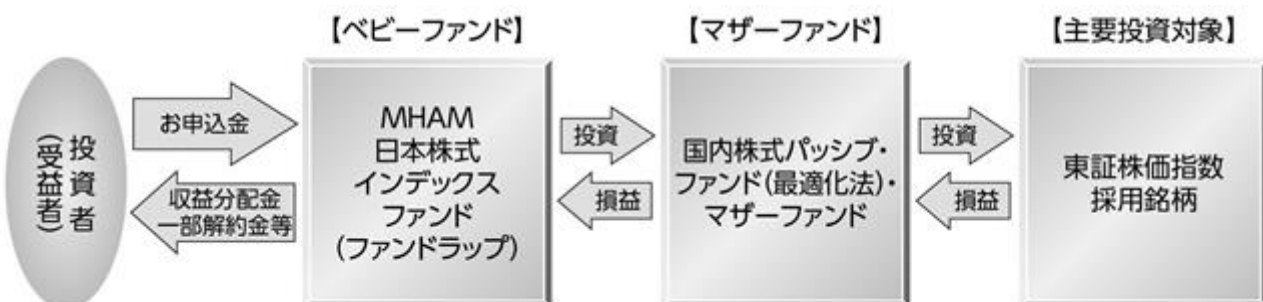
当ファンドの運営の仕組み



ファミリーファンド方式の仕組み

当ファンドは「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」をマザーファンドとするファミリーファンド方式で運用を行います。

ファミリーファンド方式



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

マザーファンドのほかに、株式等に直接投資する場合があります。

委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2022年11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11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 ¹	70.0% ²
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% ²

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

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

運用方法

1. 主要投資対象

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

2. 投資態度

a. 主として、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド受益証券に投資を行い、東証株価指数(TOPIX、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指します。

運用にあたっては「日本株式マルチファクターモデル」を活用します。

- ・ 「日本株式マルチファクターモデル」とは、複数のリスクファクターによって株式のリターンを分解・説明するモデルです。このモデルを活用し、TOPIXに連動する銘柄群を効率的に選びます。
- ・ 投資する銘柄群について定期的に見直しを実施することにより、TOPIXに対する連動性を高めます。

b. 現物株への投資よりTOPIX先物等を活用する方が有利と認められるときは、TOPIX先物等を活用することがあります。

c. 株価指数等の先物取引を含む株式の実質投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の範囲内となるよう運用を行います。ただし、一時的に株式の実質投資総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質投資総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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

d. 組入対象銘柄は、わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている(または採用予定の)銘柄とします。ただし、流動性に著しく欠ける銘柄や信用リスクが高いと判断される銘柄等は組入れません。

e. 現物株式の実質組入比率(信託財産に属する他の投資信託受益証券の時価総額に、当該他の投資信託の信託財産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額と、信託財産に属する株式の時価総額との合計額が信託財産総額に占める割合)は、通常の状態では50%以上とすることを基本とします。

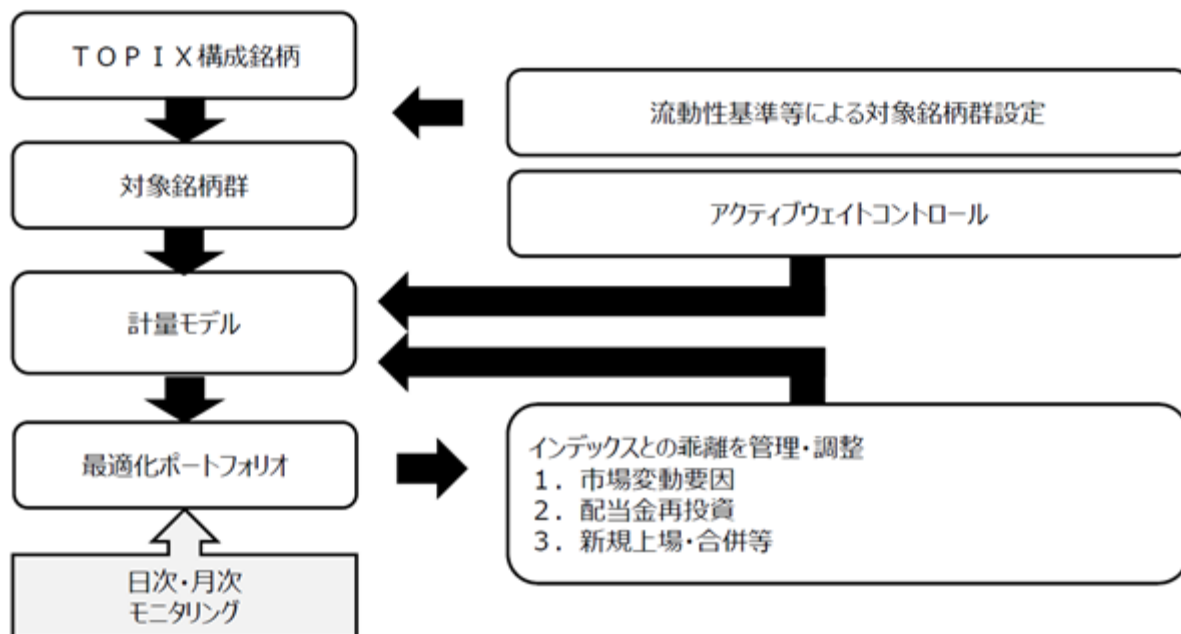
f. 非株式(株式以外の資産)への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

g. 上記a. からf. について、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

h. 国内において行われる有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。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有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引(以下「有価証券先物取引等」といいます。)を行うことができます。

ファンドの投資プロセス

当ファンドは、主として国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド受益証券への投資を通じ、以下のプロセスにより東証株価指数採用銘柄に投資を行います。



1. 流動性基準等による対象銘柄群設定

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

2. 最適化法によるポートフォリオの構築

インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3. インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - a．有価証券
 - b．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限りません。）
 - c．金銭債権
 - d．約束手形（a．に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 2．次に掲げる特定資産以外の資産
 - a．為替手形

有価証券の指図範囲

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

- 1．株券または新株引受権証券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人が発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6．コマーシャル・ペーパー
- 7．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券（両者を総称して「新株引受権証券等」といいます。）
- 8．外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券または証書で、2．～7．の証券または証書の性質を有するもの
- 9．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
- 10．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 11．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、1．の証券または証書を以下「株式」といい、2．から5．までの証券および8．の証券または証書のうち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

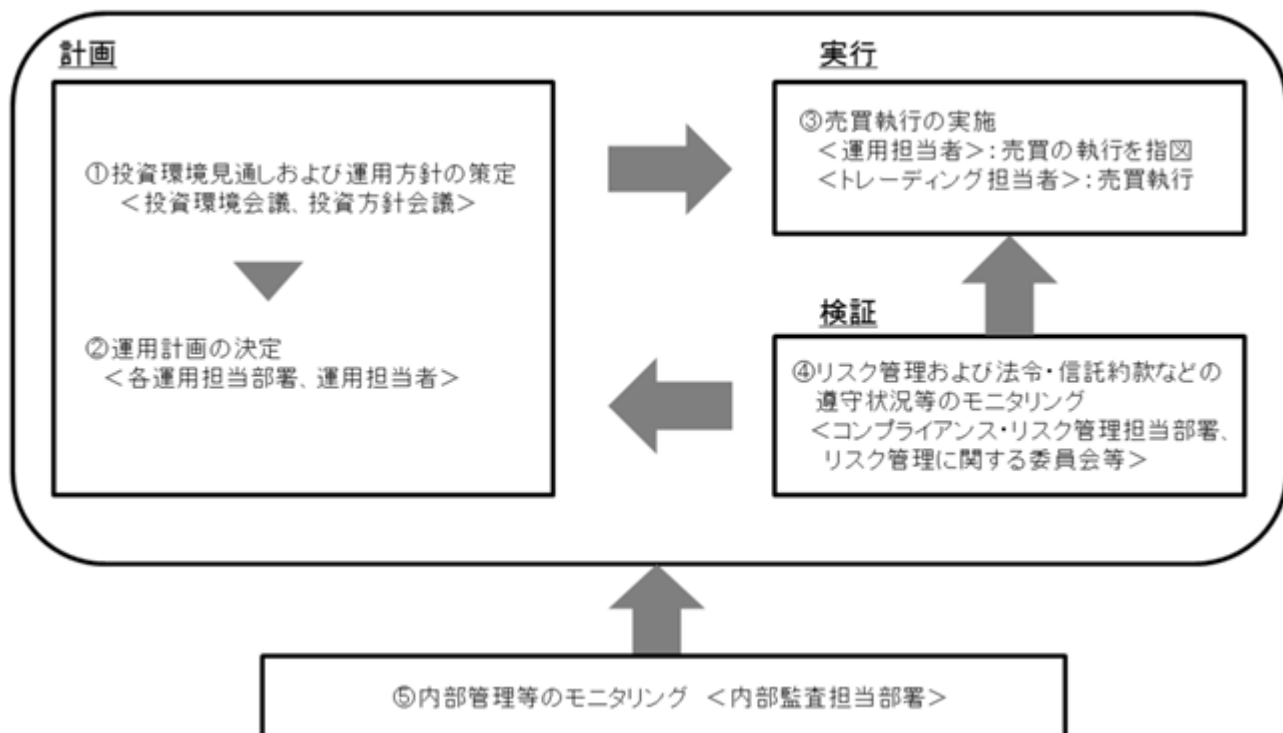
委託会社は、信託金を、 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。また、 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償

還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を以下に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

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

（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11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

毎計算期末(原則として5月8日。ただし、休業日の場合は翌日以降の最初の営業日)に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益(繰越分およびマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。))を含みます。)および売買益(評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額)等の全額とします。
2. 分配金額は、委託会社が基準価額の水準や市況動向等を勘案して決定します。ただし、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。
3. 収益分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。
将来の収益分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

収益分配金の支払い

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

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

(5) 【投資制限】

a. 約款で定める投資制限

株式および新株引受権証券等(約款 運用の基本方針 運用方法(3) 投資制限、約款第17条および第20条)

1. 株式への実質投資割合には制限を設けません。
2. 委託会社は、取得時において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20を超えることとなる投資の指図をしません。
3. 委託会社が投資することを指図する株式および新株引受権証券等は、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および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。)に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび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、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。なお、上場予定または登録予定の株式および新株引受権証券等で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

非株式[株式以外の資産](約款 運用の基本方針 運用方法(2) 投資態度)

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

転換社債等(約款第21条)

委託会社は、同一銘柄の転換社債、ならびに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下、会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

外貨建資産(約款 運用の基本方針 運用方法(3)投資制限)

外貨建資産への投資は行いません。

信用取引(約款第22条)

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

信用リスク集中回避のための投資制限(約款第22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22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23条)

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

スワップ取引(約款第24条)

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
4. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または担保の受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引(約款第25条)

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
4. 委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または担保の受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付(約款第26条)

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を以下の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - a. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
3. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

資金の借入れ(約款第32条)

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

b. 法令で定める投資制限

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

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

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

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている(または採用予定の)銘柄を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている(または採用予定の)銘柄に投資し、東証株価指数(TOPIX、配当込み)に連動する投資成果を目指して運用を行います。

- 2) 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。
- 3) 株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市場動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 4) 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
- 5) 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。

(3) 投資制限

- 1) 株式への投資割合には、制限を設けません。
- 2) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- 3) 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
- 4) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3【投資リスク】

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

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

当ファンドにおいて主として想定されるリスクは以下の通りですが、基準価額の変動要因はこれらに限定されるものではありません。なお、以下のリスクは、主にマザーファンドを通じて当ファンドが行う有価証券等への投資により発生します。

株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

株価変動リスクとは、株式市場および投資先となっている企業の株価が下落するリスクをいいます。当ファンドが投資する企業の株価が下落した場合には、当ファンドの基準価額が下落する

要因となります。また、当ファンドが投資する企業が業績悪化や倒産等に陥った場合には、当該企業の株価が大きく下落することや無くなることがあり、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。なお、当ファンドでは、株式と株価指数先物取引等の合計の組入比率を原則として高位に維持するため、株式市場の動向により基準価額は大きく変動します。また、当ファンドでは、追加設定・一部解約に伴う資金の流入に対応することにより、株式と株価指数先物取引等の合計の実質組入比率が100%を超える場合があります。

流動性リスク

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

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

信用リスク

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

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

<その他>

- ・当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- ・有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用に影響を受ける場合があります。

- ・当ファンドは、取引所における取引の停止等があるときには、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことがあります。
- ・資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

<その他の留意点>

当ファンドは、ベンチマークである東証株価指数(TOPIX、配当込み)の動きと連動する投資成果を目指しておりますが、追加設定・一部解約による運用資金の変動、株価指数の構成銘柄の一部を組み入れない場合の影響、銘柄ごとの組入比率が株価指数における構成比率と異なる場合の影響、株価指数先物取引を利用する場合の株価指数と株価指数先物の値動きの差による影響、売買約定価格と取引所終値との差による影響、売買執行に要する費用や信託報酬等が信託財産から支払われることの影響などにより、当ファンドの基準価額の騰落率と、同じ期間におけるベンチマークの騰落率との間に乖離が生じる場合があります。

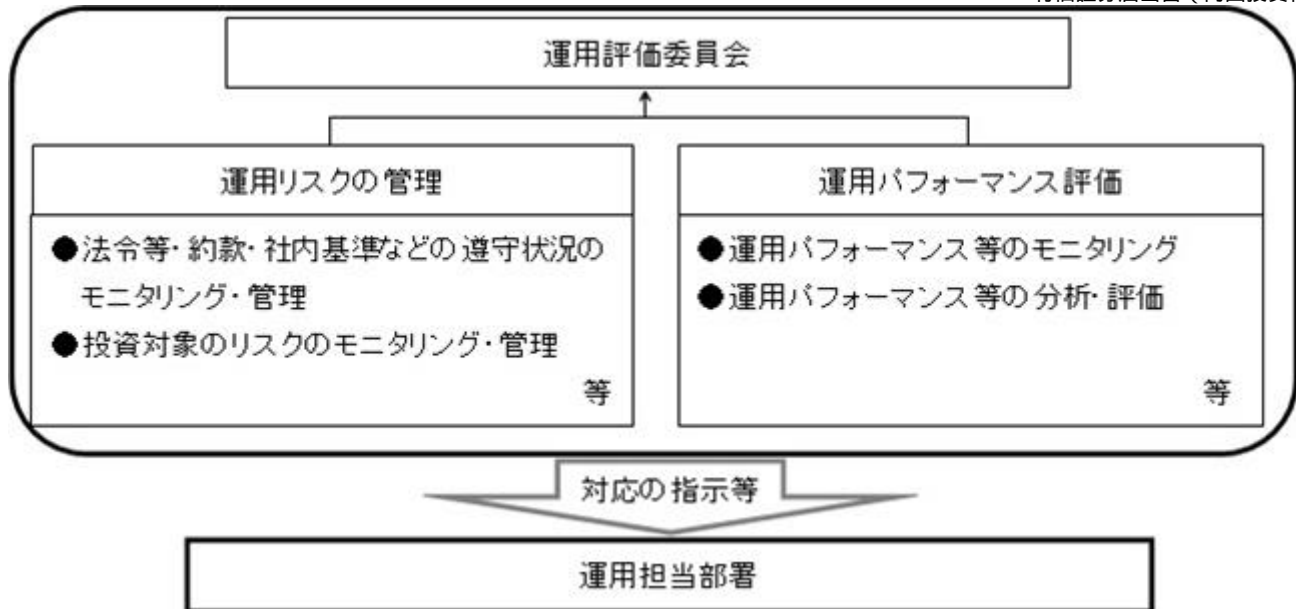
<収益分配金に関する留意点>

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

(2) リスク管理体制

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

- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・運用評価委員会：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、運用評価委員会は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



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

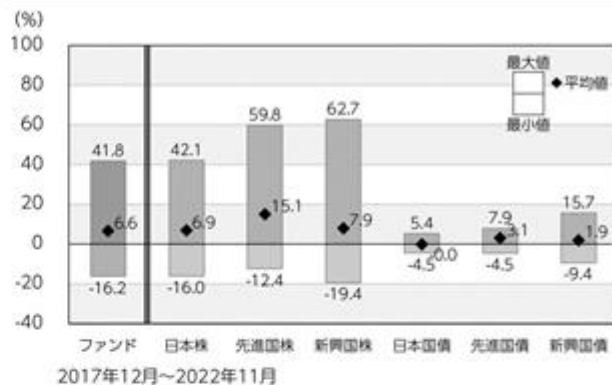
リスク管理体制は2022年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<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。

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

(注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

当ファンドの信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.088%（税抜0.08%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分（税抜）については、以下の通りとします。

委託会社	販売会社	受託会社
0.05%	0.01%	0.02%

信託報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。なお、信託報酬にかかる消費税ならびに地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）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、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用にかかる消費税等相当額、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該費用にかかる消費税等相当額、外国における資産の保管等に要する費用、受託会社の立替えた立替金の利息および資金の借入れを行った際の当該借入金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。なお、信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、当該費用にかかる消費税等相当額とともに毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき、信託財産中から支弁します。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2022年11月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の< 収益分配金の課税について >を参照。）

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2022年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	13,783,280,811	100.00
内 日本	13,783,280,811	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	506,816	0.00
純資産総額	13,783,787,627	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	370,866,915,690	97.68
内 日本	370,866,915,690	97.68
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,820,018,212	2.32
純資産総額	379,686,933,902	100.00

その他資産の投資状況

2022年11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）	8,596,800,000	2.26
内 日本	8,596,800,000	2.26

（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11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	4,086,356,600	3.1490 12,868,126,914	3.3730 13,783,280,811	- -	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年11月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2022年11月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,106,300	2,178.62 15,481,942,769	2,010.50 14,287,216,150	- -	3.76
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	915,500	12,129.00 11,104,106,340	11,255.00 10,303,952,500	- -	2.71
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	129,500	54,656.78 7,078,054,067	57,140.00 7,399,630,000	- -	1.95
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,663,200	3,655.20 6,079,331,088	3,820.00 6,353,424,000	- -	1.67
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,356,500	746.90 6,241,525,131	755.10 6,309,993,150	- -	1.66
6	第一三共 日本	株式 医薬品	1,130,700	2,952.15 3,338,004,008	4,518.00 5,108,502,600	- -	1.35
7	任天堂 日本	株式 その他製品	817,100	5,888.51 4,811,508,653	5,894.00 4,815,987,400	- -	1.27
8	日立製作所 日本	株式 電気機器	656,300	6,210.24 4,075,781,943	7,299.00 4,790,333,700	- -	1.26
9	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,148,600	3,603.82 4,139,351,702	4,050.00 4,651,830,000	- -	1.23
10	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	750,500	5,369.79 4,030,031,678	5,952.00 4,466,976,000	- -	1.18
11	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	931,400	4,207.74 3,919,093,645	4,673.00 4,352,432,200	- -	1.15
12	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	985,100	5,131.26 5,054,804,236	4,329.00 4,264,497,900	- -	1.12
13	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,003,000	4,061.05 4,073,241,919	4,111.00 4,123,333,000	- -	1.09
14	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	91,300	54,004.53 4,930,613,819	45,090.00 4,116,717,000	- -	1.08
15	三井物産 日本	株式 卸売業	1,001,800	3,069.34 3,074,867,026	3,983.00 3,990,169,400	- -	1.05
16	三菱商事 日本	株式 卸売業	856,100	4,125.70 3,532,019,670	4,605.00 3,942,340,500	- -	1.04
17	HOYA 日本	株式 精密機器	279,600	14,199.72 3,970,243,547	14,060.00 3,931,176,000	- -	1.04

18	信越化学工業 日本	株式 化学	221,700	18,082.14 4,008,811,878	17,570.00 3,895,269,000	- -	1.03
19	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,283,400	2,478.66 3,181,117,263	2,827.00 3,628,171,800	- -	0.96
20	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	843,700	3,788.00 3,195,943,101	4,287.00 3,616,941,900	- -	0.95
21	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,052,100	3,364.89 3,540,203,506	3,356.00 3,530,847,600	- -	0.93
22	ダイキン工業 日本	株式 機械	156,000	22,071.05 3,443,084,178	22,405.00 3,495,180,000	- -	0.92
23	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,843,400	1,595.25 2,940,699,887	1,717.00 3,165,117,800	- -	0.83
24	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,085,100	1,476.21 3,078,054,818	1,497.50 3,122,437,250	- -	0.82
25	村田製作所 日本	株式 電気機器	392,400	8,063.35 3,164,061,009	7,464.00 2,928,873,600	- -	0.77
26	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	140,800	20,649.49 2,907,449,176	19,720.00 2,776,576,000	- -	0.73
27	日本電産 日本	株式 電気機器	317,500	9,383.69 2,979,323,667	8,534.00 2,709,545,000	- -	0.71
28	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,243,900	2,036.05 2,532,644,412	2,128.00 2,647,019,200	- -	0.70
29	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	471,900	5,589.70 2,637,783,719	5,579.00 2,632,730,100	- -	0.69
30	S M C 日本	株式 機械	42,400	64,237.93 2,723,688,461	61,760.00 2,618,624,000	- -	0.69

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年11月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	97.68
合計	97.68

(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11月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	17.05
情報・通信業		8.63
輸送用機器		7.57
化学		6.01
卸売業		5.80
医薬品		5.63
銀行業		5.44
サービス業		5.27

機械	5.05
小売業	4.40
食料品	3.42
陸運業	3.05
精密機器	2.69
その他製品	2.31
保険業	2.30
不動産業	2.07
建設業	1.90
電気・ガス業	1.17
その他金融業	1.09
ゴム製品	0.73
証券、商品先物取引業	0.72
非鉄金属	0.71
鉄鋼	0.71
ガラス・土石製品	0.69
海運業	0.58
金属製品	0.55
空運業	0.50
石油・石炭製品	0.47
繊維製品	0.44
鉱業	0.31
パルプ・紙	0.17
倉庫・運輸関連業	0.14
水産・農林業	0.09
合計	97.68

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2022年11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	432	8,347,697,560	8,596,800,000	2.26

（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11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5計算期間末 (2013年 3月11日)	4,056	4,056	0.8047	0.8047
第6計算期間末 (2014年 3月10日)	3,507	3,507	0.9651	0.9651
第7計算期間末 (2015年 3月10日)	18,168	18,168	1.2193	1.2193
第8計算期間末 (2015年 5月 8日)	23,464	23,464	1.2795	1.2795
第9計算期間末 (2016年 5月 9日)	34,880	34,880	1.0706	1.0706
第10計算期間末 (2017年 5月 8日)	24,701	24,701	1.3241	1.3241
第11計算期間末 (2018年 5月 8日)	24,798	24,798	1.5130	1.5130
第12計算期間末 (2019年 5月 8日)	23,492	23,492	1.3647	1.3647
第13計算期間末 (2020年5月8日)	20,650	20,650	1.2958	1.2958
第14計算期間末 (2021年5月10日)	22,061	22,061	1.7681	1.7681
第15計算期間末 (2022年5月9日)	22,106	22,106	1.7393	1.7393
2021年11月末日	22,136	-	1.7629	-
12月末日	23,507	-	1.8240	-
2022年1月末日	22,275	-	1.7357	-
2月末日	22,025	-	1.7279	-
3月末日	22,835	-	1.8021	-
4月末日	22,324	-	1.7588	-
5月末日	22,365	-	1.7723	-
6月末日	21,872	-	1.7359	-
7月末日	22,682	-	1.8002	-
8月末日	16,129	-	1.8216	-
9月末日	15,171	-	1.7215	-
10月末日	13,479	-	1.8090	-
11月末日	13,783	-	1.8621	-

【分配の推移】

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

第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
2022年5月10日～2022年11月9日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第5計算期間	25.50
第6計算期間	19.93
第7計算期間	26.34
第8計算期間	4.94
第9計算期間	16.33
第10計算期間	23.68
第11計算期間	14.27
第12計算期間	9.80
第13計算期間	5.0
第14計算期間	36.4
第15計算期間	1.6
2022年5月10日～2022年11月9日	5.1

(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】

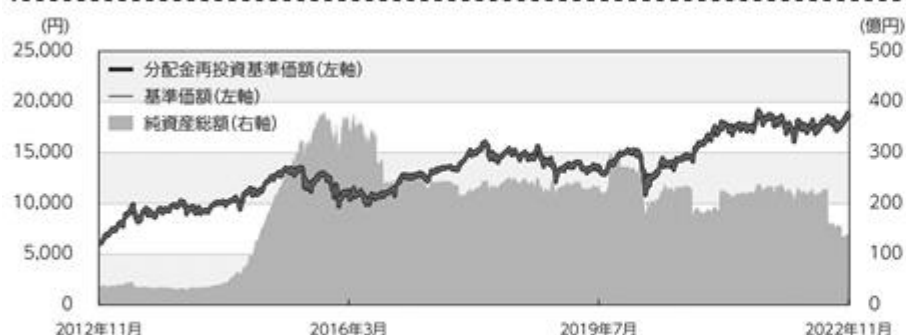
	設定口数	解約口数
第5計算期間	3,359,518,776	4,839,867,579
第6計算期間	1,248,985,946	2,655,636,874
第7計算期間	12,620,641,465	1,354,962,285
第8計算期間	3,661,017,401	222,867,697
第9計算期間	18,896,947,423	4,655,481,241
第10計算期間	1,050,077,350	14,973,850,728
第11計算期間	3,135,814,239	5,401,555,184
第12計算期間	3,888,606,333	3,064,145,943
第13計算期間	5,479,157,635	6,756,920,323
第14計算期間	3,489,786,570	6,948,840,767
第15計算期間	1,902,432,211	1,670,525,638
2022年5月10日～ 2022年11月9日	441,533,335	5,708,823,301

(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11月30日

基準価額・純資産の推移 (2012年11月30日~2022年11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:2008年6月3日)

分配の推移(税引前)

2018年 5月	0円
2019年 5月	0円
2020年 5月	0円
2021年 5月	0円
2022年 5月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。計理処理の関係上、一時的に100%を超える場合があります。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	100.00

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	97.68
内 日本	97.68
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.32
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)	2.26

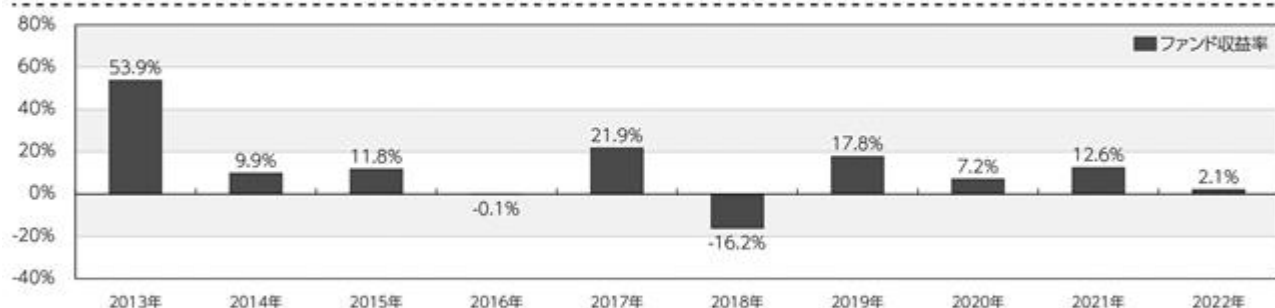
株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	17.05
2	情報・通信業	8.63
3	輸送用機器	7.57
4	化学	6.01
5	卸売業	5.80

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	3.76
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.71
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.95
4	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.67
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.66
6	第一三共	株式	日本	医薬品	1.35
7	任天堂	株式	日本	その他製品	1.27
8	日立製作所	株式	日本	電気機器	1.26
9	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.23
10	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.18

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2022年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- (1) 当ファンドのお申込みは、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後2時までにお買付けのお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日分のお申込みといたします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については翌営業日のお取扱いとなります。
- (2) 取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。
- (3) お申込みには、収益の分配がなされた場合に分配金を受領する「分配金受取コース」と、分配金は原則として税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資される「分配金再投資コース」の2つの申込方法があります。ただし、販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、有価証券届出書提出日現在、「分配金受取コース」を取扱う販売会社はありません。
- (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とします。
- (7) 収益分配金の再投資に関する契約に基づき、収益分配金を再投資する際は、1口単位で購入できるものとし、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。
- (8) 取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

2【換金（解約）手続等】

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

- (3) 解約請求の受付については、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後2時までに解約のお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日分のお申込みとします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については、翌営業日のお取扱いとなります。
- (4) 解約の価額は、解約請求受付日の基準価額とします。詳しくは、販売会社または委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

- (5) 解約代金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、4営業日目から販売会社において受益者に支払われます。
- (6) 信託財産の資金管理を円滑に行うために大口の解約請求には制限を設ける場合があります。
- (7) 委託会社は、取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。

ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、前記(4)の規定に準じた価額とします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

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

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2008年6月3日から無期限とします。

(4)【計算期間】

原則として毎年5月9日から翌年5月8日までとします。ただし、第1計算期間は、2008年6月3日から2009年3月10日までとし、第8計算期間は、2015年3月11日から2015年5月8日までとします。

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

(5)【その他】

信託契約の解約

1. 委託会社は、次のいずれかに該当する場合、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(繰上償還)させることがあります。この場合、委託会社は書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。ただし、当該信託契約の解約についての委託会社による提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには書面決議は行いません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の手続きを行うことが困難な場合にも書面決議は行いません。
 - a. 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。
 - b. やむを得ない事情が発生したとき。
 - c. 信託契約の一部解約により、受益権の口数が10億口を下回ることとなるとき。
2. 前記1.により信託契約を解約する場合には、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。
3. 委託会社は、次の事象が起きた場合、信託契約を解約し、信託を終了(繰上償還)させます。
 - a. 委託会社が監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき。
 - b. 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。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、「信託約款の変更等」の書面決議が否決された場合を除き、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。
 - c. 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。

信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合

しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は「信託約款の変更等」および「書面決議」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

2. 委託会社は、前記1.の事項(前記1.の変更事項にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、前記1.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。ただし、当該重大な約款の変更等についての委託会社による提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには書面決議は行いません。
3. この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
4. 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。

書面決議

1. 委託会社は、信託契約の解約または重大な約款の変更等に係る書面決議を行う場合には、あらかじめ、書面決議の日および当該決議の内容に応じて次の事項をそれぞれ定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約または信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
 - a. 信託契約の解約の場合 信託契約の解約の理由など
 - b. 重大な約款の変更等の場合 重大な約款の変更等の内容およびその理由など
2. 書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下この2.において同じ。)は受益権の口数に応じて議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
3. 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
4. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
5. この信託は、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

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ならびに受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

2. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。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、「信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託事務処理の再信託

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

公告

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

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

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

運用報告書

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金請求権

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

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

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

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

(2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3) 一部解約請求権

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

(4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
- なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間(2021年5月11日から2022年5月9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日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第14期 2021年5月10日現在	第15期 2022年5月9日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,824,187	25,893,278
親投資信託受益証券	22,061,126,691	22,105,565,725
未収入金	32,073,000	-
流動資産合計	22,110,023,878	22,131,459,003
資産合計	22,110,023,878	22,131,459,003
負債の部		
流動負債		
未払解約金	33,175,410	8,306,276
未払受託者報酬	4,375,867	4,917,473
未払委託者報酬	10,392,757	11,679,036
その他未払費用	152,498	164,225
流動負債合計	48,096,532	25,067,010
負債合計	48,096,532	25,067,010
純資産の部		
元本等		
元本	12,477,799,096	12,709,705,669
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	9,584,128,250	9,396,686,324
(分配準備積立金)	4,976,592,711	4,854,862,771
元本等合計	22,061,927,346	22,106,391,993
純資産合計	22,061,927,346	22,106,391,993
負債純資産合計	22,110,023,878	22,131,459,003

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第14期 自 2020年5月9日 至 2021年5月10日	第15期 自 2021年5月11日 至 2022年5月9日
営業収益		
受取利息	14	88
有価証券売買等損益	6,294,802,024	317,644,521
その他収益	-	5
営業収益合計	6,294,802,038	317,644,428
営業費用		
支払利息	5,868	4,087
受託者報酬	10,353,725	9,891,660
委託者報酬	33,627,606	23,492,825
その他費用	321,096	331,169
営業費用合計	44,308,295	33,719,741
営業利益又は営業損失()	6,250,493,743	351,364,169
経常利益又は経常損失()	6,250,493,743	351,364,169
当期純利益又は当期純損失()	6,250,493,743	351,364,169
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()	1,297,519,710	43,976,287
期首剰余金又は期首欠損金()	4,713,656,423	9,584,128,250
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,056,535,999	1,492,672,601
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	2,056,535,999	1,492,672,601
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,139,038,205	1,284,774,071
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,139,038,205	1,284,774,071
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	9,584,128,250	9,396,686,324

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第15期	
	自 2021年5月11日	至 2022年5月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年5月8日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2021年5月10日、当計算期間末日を2022年5月9日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第14期	第15期
	2021年5月10日現在	2022年5月9日現在
1. 期首元本額	15,936,853,293円	12,477,799,096円
期中追加設定元本額	3,489,786,570円	1,902,432,211円
期中一部解約元本額	6,948,840,767円	1,670,525,638円
2. 受益権の総数	12,477,799,096口	12,709,705,669口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第14期	第15期
	自 2020年5月9日 至 2021年5月10日	自 2021年5月11日 至 2022年5月9日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(413,305,963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(2,380,872,021円)、信託約款に規定される収益調整金(7,726,958,078円)及び分配準備積立金(2,182,414,727円)より分配対象収益は12,703,550,789円(1万口当たり10,180.92円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(494,710,114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(8,582,604,317円)及び分配準備積立金(4,360,152,657円)より分配対象収益は13,437,467,088円(1万口当たり10,572.60円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第14期	第15期
	自 2020年5月9日 至 2021年5月10日	自 2021年5月11日 至 2022年5月9日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 2021年5月10日現在	第15期 2022年5月9日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第14期 2021年5月10日現在	第15期 2022年5月9日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	5,084,142,078	447,457,098
合計	5,084,142,078	447,457,098

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第14期 2021年5月10日現在	第15期 2022年5月9日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7681円 (17,681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5月9日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	7,022,098,388	22,105,565,725	
親投資信託受益証券	合計	7,022,098,388	22,105,565,725	
合計			22,105,565,725	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

		2022年5月9日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		9,265,709,948
株式		342,399,039,710
派生商品評価勘定		2,899,720
未収配当金		4,684,405,626
差入委託証拠金		438,075,000
流動資産合計		356,790,130,004
資産合計		
356,790,130,004		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		100,307,790
前受金		77,055,000
未払金		14,365,560
未払解約金		4,901,110,000
流動負債合計		5,092,838,350
負債合計		
5,092,838,350		
純資産の部		
元本等		
元本		111,720,693,843
剰余金		
剰余金又は欠損金()		239,976,597,811
元本等合計		351,697,291,654
純資産合計		
351,697,291,654		
負債純資産合計		
356,790,130,004		

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年5月11日 至 2022年5月9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5月9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	111,902,695,114円
同期中追加設定元本額	184,383,628,678円
同期中一部解約元本額	184,565,629,949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	2,678,856,718円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	7,022,098,388円
One DC 国内株式インデックスファンド	21,154,373,018円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,727,719,452円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	5,402,887円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	24,945,102円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	108,615,403円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	25,302,412円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	17,567,875円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	13,951,068円
たわらノーロード TOPIX	1,403,669,929円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,169,373,970円
たわらノーロード バランス(堅実型)	44,033,153円
たわらノーロード バランス(標準型)	286,277,156円
たわらノーロード バランス(積極型)	439,936,062円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	3,662,761円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	172,786,709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)	438,867,354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)	294,875,175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)	426,568,906円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	740,574円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	3,019,423円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	43,276,099円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,377,732円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	19,962,324円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,949,755,720円
Oneグローバルバランス	3,127,298円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,084,651,475円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,597,750,478円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,890,417,999円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	348,265,964円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,120,063,627円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,135,166,613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>	1,111,761,786円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	15,484,653円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	309,475,685円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	313,431,637円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	566,744,839円
投資のソムリエ	7,553,910,911円
クルーズコントロール	237,107,897円
投資のソムリエ<DC年金>	462,453,548円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	338,355,786円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	617,421,526円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	230,673,311円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,274,094,844円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	44,473,788円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	21,902,857円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,605,438円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	134,923,980円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	380,459,421円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	558,141,239円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	297,597,660円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	42,416,231円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	19,631,621円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	14,849,802円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	129,399,754円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	2,079,167円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	22,877,436円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	23,382,532円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	21,508,092円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	14,348,403円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	22,560,843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)	18,836,219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)	10,989,111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)	68,800,315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)	18,029,169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)	12,498,039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)	20,503,849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)	12,636,763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)	18,207,688円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	193,263,877円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	33,301,365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)	38,131,400円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	39,090,198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)	6,914,190円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	18,506,299円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	51,789,549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)	99,094,348円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,791,937円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	26,230,433円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,479,776円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,237,384円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	6,954,582円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	29,537,097円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	523,461,867円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	612,501,515円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,766,802,358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)	27,315,762円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	26,942,297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)	278,809,176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)	68,877,851円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,299,241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)	327,855,610円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	20,040,682円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	70,244,143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)	163,558,478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)	222,231,058円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	34,619,444円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	16,923,639円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	291,737,796円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	936,557,239円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,240,495,959円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	49,936,951円

動的パッケージファンド<DC年金>	4,988,294円
コア資産形成ファンド	3,187,891円
MHAMトピックスファンド	722,316,815円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	60,200,117円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	680,133,628円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,796,034,498円
計	111,720,693,843円
2. 受益権の総数	111,720,693,843口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年5月11日 至 2022年5月9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5月9日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年5月9日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	10,289,734,528	
合計	10,289,734,528	

(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5月9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5月9日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	9,109,635,000	-		97,250,000
合計	9,109,635,000	-		97,250,000

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2022年5月9日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.1480円 (31,480円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2022年5月9日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	

極洋	6,400	3,260.00	20,864,000	
日本水産	180,300	572.00	103,131,600	
マルハニチロ	27,400	2,363.00	64,746,200	
雪国まいたけ	13,500	1,000.00	13,500,000	
カネコ種苗	5,300	1,799.00	9,534,700	
サカタのタネ	21,400	4,380.00	93,732,000	
ホクト	15,100	2,027.00	30,607,700	
ホクリヨウ	2,700	667.00	1,800,900	
ショーボンドホールディングス	24,800	5,370.00	133,176,000	
ミライト・ホールディングス	59,500	1,834.00	109,123,000	
タマホーム	11,200	2,650.00	29,680,000	
サンヨーホームズ	2,300	740.00	1,702,000	
日本アクア	7,400	592.00	4,380,800	
ファーストコーポレーション	4,700	803.00	3,774,100	
ベステラ	3,700	1,173.00	4,340,100	
Robot Home	30,800	198.00	6,098,400	
キャンディル	3,200	514.00	1,644,800	
住石ホールディングス	32,300	178.00	5,749,400	
日鉄鉱業	4,000	6,240.00	24,960,000	
三井松島ホールディングス	7,700	1,960.00	15,092,000	
INPEX	683,600	1,598.00	1,092,392,800	
石油資源開発	21,700	2,701.00	58,611,700	
K&Oエナジーグループ	8,000	1,660.00	13,280,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,600	980.00	3,528,000	
第一カッター興業	4,400	1,331.00	5,856,400	
明豊ファシリティワークス	6,000	679.00	4,074,000	
安藤・間	89,200	899.00	80,190,800	
東急建設	52,600	588.00	30,928,800	
コムシスホールディングス	59,500	2,696.00	160,412,000	
ピーアールホールディングス	24,500	300.00	7,350,000	
高松コンストラクショングループ	10,800	2,182.00	23,565,600	
東建コーポレーション	5,100	8,520.00	43,452,000	
ソネック	2,100	993.00	2,085,300	
ヤマウラ	8,800	929.00	8,175,200	
オリエンタル白石	62,200	234.00	14,554,800	
大成建設	113,100	3,505.00	396,415,500	
大林組	416,600	888.00	369,940,800	
清水建設	388,700	677.00	263,149,900	
飛鳥建設	11,400	1,017.00	11,593,800	
長谷工コーポレーション	122,800	1,395.00	171,306,000	
松井建設	16,000	636.00	10,176,000	
銭高組	1,500	3,690.00	5,535,000	
鹿島建設	305,300	1,433.00	437,494,900	
不動テトラ	9,100	1,551.00	14,114,100	
大未建設	4,500	1,322.00	5,949,000	
鉄建建設	9,100	1,855.00	16,880,500	
西松建設	25,800	3,815.00	98,427,000	
三井住友建設	96,100	420.00	40,362,000	
大豊建設	6,200	4,465.00	27,683,000	
佐田建設	9,500	445.00	4,227,500	

ナカノフドー建設	10,600	313.00	3,317,800
奥村組	24,100	3,115.00	75,071,500
東鉄工業	18,800	2,206.00	41,472,800
イチケン	3,100	1,829.00	5,669,900
富士ピー・エス	5,300	484.00	2,565,200
浅沼組	4,800	5,060.00	24,288,000
戸田建設	172,900	737.00	127,427,300
熊谷組	21,100	2,702.00	57,012,200
北野建設	2,600	2,112.00	5,491,200
植木組	3,700	1,391.00	5,146,700
矢作建設工業	18,300	780.00	14,274,000
ピーエス三菱	14,200	571.00	8,108,200
日本ハウスホールディングス	29,000	415.00	12,035,000
大東建託	43,700	11,470.00	501,239,000
新日本建設	18,200	692.00	12,594,400
東亜道路工業	2,200	5,090.00	11,198,000
日本道路	3,700	7,210.00	26,677,000
東亜建設工業	10,200	2,826.00	28,825,200
日本国土開発	38,900	540.00	21,006,000
若築建設	7,000	1,944.00	13,608,000
東洋建設	47,900	889.00	42,583,100
五洋建設	165,200	620.00	102,424,000
世紀東急工業	20,600	742.00	15,285,200
福田組	4,600	4,570.00	21,022,000
日本ドライケミカル	3,300	1,629.00	5,375,700
住友林業	103,900	1,941.00	201,669,900
日本基礎技術	11,400	758.00	8,641,200
巴コーポレーション	18,000	458.00	8,244,000
大和ハウス工業	375,300	3,106.00	1,165,681,800
ライト工業	25,000	1,890.00	47,250,000
積水ハウス	443,600	2,224.50	986,788,200
日特建設	9,000	703.00	6,327,000
北陸電気工事	8,600	739.00	6,355,400
ユアテック	24,500	682.00	16,709,000
日本リーテック	8,700	1,070.00	9,309,000
四電工	4,500	1,741.00	7,834,500
中電工	18,900	2,105.00	39,784,500
関電工	69,400	826.00	57,324,400
きんでん	92,400	1,503.00	138,877,200
東京エネシス	13,800	953.00	13,151,400
トーエネック	4,300	3,350.00	14,405,000
住友電設	10,600	2,221.00	23,542,600
日本電設工業	21,700	1,663.00	36,087,100
エクシオグループ	62,500	2,178.00	136,125,000
新日本空調	10,600	1,807.00	19,154,200
日本工営	8,300	2,904.00	24,103,200
九電工	30,900	2,839.00	87,725,100
三機工業	27,800	1,490.00	41,422,000
日揮ホールディングス	127,900	1,447.00	185,071,300
中外炉工業	4,200	1,490.00	6,258,000

ヤマト	11,900	728.00	8,663,200
太平電業	8,900	2,757.00	24,537,300
高砂熱学工業	36,600	1,686.00	61,707,600
三晃金属工業	1,700	2,558.00	4,348,600
N E C ネットズエスアイ	44,200	1,831.00	80,930,200
朝日工業社	5,600	1,566.00	8,769,600
明星工業	24,800	675.00	16,740,000
大気社	19,800	3,200.00	63,360,000
ダイダン	9,000	2,075.00	18,675,000
日比谷総合設備	13,100	1,889.00	24,745,900
ニッポン	37,800	1,684.00	63,655,200
日清製粉グループ本社	145,800	1,717.00	250,338,600
日東富士製粉	1,500	4,040.00	6,060,000
昭和産業	12,200	2,609.00	31,829,800
鳥越製粉	11,600	640.00	7,424,000
中部飼料	15,100	1,012.00	15,281,200
フィード・ワン	17,400	652.00	11,344,800
東洋精糖	1,700	983.00	1,671,100
日本甜菜製糖	7,200	1,660.00	11,952,000
D M 三井製糖ホールディングス	12,000	1,909.00	22,908,000
塩水港精糖	17,100	208.00	3,556,800
日新製糖	6,600	1,706.00	11,259,600
L I F U L L	39,600	219.00	8,672,400
ミクシィ	29,800	2,246.00	66,930,800
ジェイエイシーリクルートメント	10,500	1,796.00	18,858,000
日本M & A センターホールディングス	213,300	1,382.00	294,780,600
メンバーズ	3,700	2,981.00	11,029,700
中広	1,000	380.00	380,000
U T グループ	18,800	2,722.00	51,173,600
アイティメディア	6,200	1,693.00	10,496,600
E・Jホールディングス	7,500	1,150.00	8,625,000
夢真ビーネックスグループ	42,400	1,403.00	59,487,200
コシダカホールディングス	34,700	764.00	26,510,800
アルトナー	3,200	832.00	2,662,400
パソナグループ	14,100	1,969.00	27,762,900
C D S	2,200	1,746.00	3,841,200
リンクアンドモチベーション	28,600	426.00	12,183,600
エス・エム・エス	44,200	3,055.00	135,031,000
サニーサイドアップグループ	4,600	792.00	3,643,200
パーソルホールディングス	130,000	2,430.00	315,900,000
リニカル	7,400	796.00	5,890,400
クックパッド	40,900	254.00	10,388,600
エスクリ	5,800	415.00	2,407,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,400	569.00	3,641,600
森永製菓	30,500	4,030.00	122,915,000
中村屋	3,200	3,085.00	9,872,000
江崎グリコ	35,700	3,685.00	131,554,500
名糖産業	5,800	1,618.00	9,384,400
井村屋グループ	7,400	2,226.00	16,472,400
不二家	7,600	2,375.00	18,050,000

山崎製パン	96,100	1,656.00	159,141,600
第一屋製パン	3,000	521.00	1,563,000
モロゾフ	3,400	3,070.00	10,438,000
亀田製菓	7,600	4,040.00	30,704,000
寿スピリッツ	12,700	6,850.00	86,995,000
カルビー	62,200	2,307.00	143,495,400
森永乳業	24,600	5,010.00	123,246,000
六甲バター	9,700	1,512.00	14,666,400
ヤクルト本社	96,400	6,750.00	650,700,000
明治ホールディングス	83,600	6,420.00	536,712,000
雪印メグミルク	31,900	1,918.00	61,184,200
プリマハム	17,100	2,186.00	37,380,600
日本ハム	50,800	4,015.00	203,962,000
林兼産業	3,500	503.00	1,760,500
丸大食品	13,200	1,500.00	19,800,000
S Foods	12,300	2,942.00	36,186,600
柿安本店	4,700	2,416.00	11,355,200
伊藤ハム米久ホールディングス	88,000	650.00	57,200,000
学情	5,300	935.00	4,955,500
スタジオアリス	5,800	2,246.00	13,026,800
クロスキャット	7,300	874.00	6,380,200
シミックホールディングス	6,900	1,423.00	9,818,700
エブコ	2,800	689.00	1,929,200
システナ	190,600	407.00	77,574,200
NJS	2,600	2,031.00	5,280,600
デジタルアーツ	7,200	6,740.00	48,528,000
日鉄ソリューションズ	20,600	3,760.00	77,456,000
総合警備保障	50,300	3,645.00	183,343,500
キューブシステム	6,800	888.00	6,038,400
いちご	149,500	283.00	42,308,500
WOW WORLD	1,900	1,065.00	2,023,500
日本駐車場開発	142,200	154.00	21,898,800
コア	5,700	1,385.00	7,894,500
カカクコム	95,400	2,651.00	252,905,400
アイロムグループ	4,700	1,998.00	9,390,600
セントケア・ホールディング	8,500	793.00	6,740,500
サイネックス	2,200	594.00	1,306,800
ルネサンス	9,000	878.00	7,902,000
ディップ	22,900	4,180.00	95,722,000
SBSホールディングス	10,100	2,957.00	29,865,700
デジタルホールディングス	9,000	1,441.00	12,969,000
新日本科学	15,800	1,345.00	21,251,000
キャリアデザインセンター	3,100	1,042.00	3,230,200
ベネフィット・ワン	47,300	1,880.00	88,924,000
エムスリー	229,500	3,887.00	892,066,500
ツカダ・グローバルホールディング	8,300	310.00	2,573,000
プラス	1,700	689.00	1,171,300
アウトソーシング	74,500	1,249.00	93,050,500
ウェルネット	12,600	455.00	5,733,000
ワールドホールディングス	5,200	2,281.00	11,861,200

ディー・エヌ・エー	49,500	1,893.00	93,703,500
博報堂DYホールディングス	175,600	1,540.00	270,424,000
ぐるなび	20,500	402.00	8,241,000
タカミヤ	16,000	341.00	5,456,000
ジャパンベストレスキューシステム	8,300	801.00	6,648,300
ファンコミュニケーションズ	31,600	419.00	13,240,400
ライク	4,300	2,135.00	9,180,500
ビジネス・ブレークスルー	5,000	408.00	2,040,000
エスプール	36,700	1,255.00	46,058,500
WDBホールディングス	5,900	2,651.00	15,640,900
手間いらず	1,900	5,020.00	9,538,000
ティア	7,800	433.00	3,377,400
CDG	1,400	1,294.00	1,811,600
アドウェイズ	19,400	833.00	16,160,200
バリューコマース	10,200	3,105.00	31,671,000
インフォマート	142,500	503.00	71,677,500
サッポロホールディングス	44,400	2,744.00	121,833,600
アサヒグループホールディングス	307,100	4,822.00	1,480,836,200
麒麟ホールディングス	502,000	1,917.50	962,585,000
宝ホールディングス	87,200	1,056.00	92,083,200
オエノンホールディングス	38,400	311.00	11,942,400
養命酒製造	4,100	1,727.00	7,080,700
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	93,000	1,482.00	137,826,000
サントリー食品インターナショナル	91,400	5,140.00	469,796,000
ダイドーグループホールディングス	7,000	5,080.00	35,560,000
伊藤園	41,500	5,390.00	223,685,000
キーコーヒー	13,100	2,030.00	26,593,000
ユニカフェ	4,300	922.00	3,964,600
ジャパンフーズ	1,500	1,149.00	1,723,500
日清オイリオグループ	16,600	3,010.00	49,966,000
不二製油グループ本社	29,600	1,838.00	54,404,800
かどや製油	1,400	3,520.00	4,928,000
J-オイルミルズ	12,800	1,596.00	20,428,800
ローソン	29,700	4,735.00	140,629,500
サンエー	9,800	4,165.00	40,817,000
カワチ薬品	10,400	2,058.00	21,403,200
エービーシー・マート	20,900	5,470.00	114,323,000
ハードオフコーポレーション	6,000	816.00	4,896,000
高千穂交易	5,100	1,531.00	7,808,100
アスクル	30,300	1,493.00	45,237,900
ゲオホールディングス	17,300	1,266.00	21,901,800
アダストリア	14,400	2,176.00	31,334,400
ジーフット	8,400	311.00	2,612,400
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,200	391.00	860,200
オルパヘルスケアホールディングス	1,500	1,713.00	2,569,500
伊藤忠食品	3,100	4,800.00	14,880,000
くら寿司	14,000	3,060.00	42,840,000
キャンドウ	5,000	2,366.00	11,830,000
エレマテック	10,800	1,190.00	12,852,000

アイケイ	4,200	546.00	2,293,200
パルグループホールディングス	11,700	1,476.00	17,269,200
エディオン	61,500	1,204.00	74,046,000
あらた	10,400	3,585.00	37,284,000
サーラコーポレーション	27,300	630.00	17,199,000
ワッツ	6,500	710.00	4,615,000
トーメンデバイス	2,000	5,830.00	11,660,000
ハローズ	6,100	3,100.00	18,910,000
J Pホールディングス	33,400	209.00	6,980,600
フジオフードグループ本社	10,900	1,332.00	14,518,800
あみやき亭	3,200	2,901.00	9,283,200
東京エレクトロン デバイス	4,000	5,710.00	22,840,000
ひらまつ	28,500	190.00	5,415,000
フィールズ	11,700	872.00	10,202,400
双日	144,500	2,032.00	293,624,000
アルフレッサ ホールディングス	145,600	1,810.00	263,536,000
大黒天物産	4,300	4,760.00	20,468,000
ハニーズホールディングス	11,400	1,084.00	12,357,600
ファーマライズホールディングス	3,400	719.00	2,444,600
キッコーマン	92,800	7,060.00	655,168,000
味の素	287,500	3,098.00	890,675,000
ブルドックソース	5,500	1,870.00	10,285,000
キュービー	67,800	2,197.00	148,956,600
ハウス食品グループ本社	48,200	2,985.00	143,877,000
カゴメ	51,800	3,175.00	164,465,000
焼津水産化学工業	6,600	880.00	5,808,000
アリアケジャパン	12,500	5,060.00	63,250,000
ピエトロ	1,900	1,755.00	3,334,500
エバラ食品工業	3,000	2,804.00	8,412,000
やまみ	1,200	1,664.00	1,996,800
ニチレイ	58,500	2,333.00	136,480,500
横浜冷凍	36,000	864.00	31,104,000
東洋水産	64,000	4,055.00	259,520,000
イートアンドホールディングス	5,200	2,205.00	11,466,000
大冷	1,700	1,882.00	3,199,400
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,100	524.00	3,720,400
日清食品ホールディングス	49,900	8,940.00	446,106,000
永谷園ホールディングス	6,200	1,970.00	12,214,000
一正蒲鉾	5,800	812.00	4,709,600
フジッコ	12,700	2,011.00	25,539,700
ロック・フィールド	14,300	1,388.00	19,848,400
日本たばこ産業	732,400	2,271.50	1,663,646,600
ケンコーマヨネーズ	7,400	1,403.00	10,382,200
わらべや日洋ホールディングス	8,700	1,672.00	14,546,400
なとり	7,700	2,014.00	15,507,800
イフジ産業	2,200	1,023.00	2,250,600
ピククルスコーポレーション	6,500	1,280.00	8,320,000
ファーマフーズ	17,200	1,573.00	27,055,600
北の達人コーポレーション	47,500	168.00	7,980,000
ユージェナ	69,800	835.00	58,283,000

紀文食品	10,600	1,022.00	10,833,200
スター・マイカ・ホールディングス	7,300	1,477.00	10,782,100
SREホールディングス	3,400	2,426.00	8,248,400
ADワークスグループ	26,800	147.00	3,939,600
片倉工業	13,900	2,459.00	34,180,100
グンゼ	8,200	3,800.00	31,160,000
ヒューリック	311,000	1,057.00	328,727,000
神栄	1,900	885.00	1,681,500
ラサ商事	6,700	986.00	6,606,200
アルペン	10,000	1,947.00	19,470,000
ハブ	4,400	508.00	2,235,200
ラクーンホールディングス	11,300	1,451.00	16,396,300
クオールホールディングス	16,400	1,069.00	17,531,600
アルコニックス	16,800	1,402.00	23,553,600
神戸物産	100,200	2,855.00	286,071,000
ソリトンシステムズ	6,700	1,385.00	9,279,500
ジーンズホールディングス	8,400	4,150.00	34,860,000
ビックカメラ	79,500	1,137.00	90,391,500
DCMホールディングス	82,700	1,079.00	89,233,300
ペッパーフードサービス	18,300	375.00	6,862,500
ハイパー	2,200	471.00	1,036,200
Monotaro	169,500	1,947.00	330,016,500
東京一番フーズ	3,500	592.00	2,072,000
DDホールディングス	7,000	518.00	3,626,000
あいホールディングス	19,200	1,683.00	32,313,600
ディーブイエックス	4,700	1,035.00	4,864,500
きちりホールディングス	3,700	383.00	1,417,100
アークランドサービスホールディングス	9,800	2,082.00	20,403,600
J.フロントリテイリング	156,200	1,000.00	156,200,000
ドトール・日レスホールディングス	22,500	1,490.00	33,525,000
マツキヨココカラ&カンパニー	81,100	4,205.00	341,025,500
ブロンコビリー	7,400	2,306.00	17,064,400
ZOZO	92,200	2,626.00	242,117,200
トレジャー・ファクトリー	3,900	957.00	3,732,300
物語コーポレーション	6,600	5,110.00	33,726,000
三越伊勢丹ホールディングス	223,500	1,010.00	225,735,000
東洋紡	52,600	1,104.00	58,070,400
ユニチカ	36,500	279.00	10,183,500
富士紡ホールディングス	5,800	3,150.00	18,270,000
日清紡ホールディングス	78,600	954.00	74,984,400
倉敷紡績	10,800	1,831.00	19,774,800
ダイワボウホールディングス	62,400	1,650.00	102,960,000
シキボウ	7,100	888.00	6,304,800
日東紡績	19,100	2,420.00	46,222,000
トヨタ紡織	52,900	2,074.00	109,714,600
マクニカ・富士エレホールディングス	32,000	2,793.00	89,376,000
Hamee	4,800	1,068.00	5,126,400
マーケットエンタープライズ	1,400	738.00	1,033,200
ラクト・ジャパン	4,600	2,025.00	9,315,000

ウエルシアホールディングス	70,900	2,552.00	180,936,800
クリエイトSDホールディングス	19,800	2,895.00	57,321,000
グリムス	6,000	1,583.00	9,498,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,700	753.00	17,093,100
八洲電機	9,800	940.00	9,212,000
メディアスホールディングス	7,700	985.00	7,584,500
レスターホールディングス	12,700	2,038.00	25,882,600
ジューテックホールディングス	3,000	1,041.00	3,123,000
丸善CHIホールディングス	16,200	380.00	6,156,000
大光	5,900	719.00	4,242,100
OCHIホールディングス	3,700	1,220.00	4,514,000
TOKAIホールディングス	65,000	874.00	56,810,000
黒谷	3,600	581.00	2,091,600
ミサワ	2,700	611.00	1,649,700
ティーライフ	1,800	1,434.00	2,581,200
Cominix	2,600	734.00	1,908,400
エー・ピーホールディングス	2,100	445.00	934,500
三洋貿易	13,100	972.00	12,733,200
チムニー	4,200	1,163.00	4,884,600
シュッピン	11,100	1,132.00	12,565,200
ビューティガレージ	2,200	2,699.00	5,937,800
オイシックス・ラ・大地	19,300	2,482.00	47,902,600
ウイン・パートナーズ	9,800	995.00	9,751,000
ネクステージ	27,200	1,942.00	52,822,400
ジョイフル本田	40,300	1,576.00	63,512,800
鳥貴族ホールディングス	4,700	1,739.00	8,173,300
ホットランド	10,100	1,371.00	13,847,100
すかいらーくホールディングス	169,800	1,534.00	260,473,200
SFPホールディングス	6,600	1,382.00	9,121,200
綿半ホールディングス	9,900	1,325.00	13,117,500
日本毛織	37,700	966.00	36,418,200
ダイトウボウ	21,600	92.00	1,987,200
トーア紡コーポレーション	3,800	385.00	1,463,000
ダイドーリミテッド	18,700	138.00	2,580,600
ヨシックスホールディングス	2,600	2,056.00	5,345,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	38,900	1,082.00	42,089,800
三栄建築設計	5,400	1,656.00	8,942,400
野村不動産ホールディングス	69,400	3,155.00	218,957,000
三重交通グループホールディングス	27,400	468.00	12,823,200
サムティ	20,900	2,067.00	43,200,300
ディア・ライフ	17,100	515.00	8,806,500
コーセーアールイー	4,000	639.00	2,556,000
地主	8,500	1,961.00	16,668,500
プレサンスコーポレーション	16,600	1,490.00	24,734,000
フィル・カンパニー	2,300	1,097.00	2,523,100
THEグローバル社	7,200	156.00	1,123,200
ハウスコム	1,000	1,156.00	1,156,000
日本管理センター	6,500	991.00	6,441,500

サンセイランディック	4,100	814.00	3,337,400
エストラスト	1,400	556.00	778,400
フージャースホールディングス	17,300	647.00	11,193,100
オープンハウスグループ	42,700	4,870.00	207,949,000
東急不動産ホールディングス	385,300	673.00	259,306,900
飯田グループホールディングス	112,000	2,103.00	235,536,000
イーランド	2,100	1,372.00	2,881,200
ムゲンエステート	8,500	510.00	4,335,000
帝国繊維	14,600	1,550.00	22,630,000
日本コークス工業	115,100	134.00	15,423,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,000	970.00	6,790,000
ミタチ産業	3,400	879.00	2,988,600
B E E N O S	6,800	1,449.00	9,853,200
あさひ	11,100	1,325.00	14,707,500
日本調剤	8,100	1,177.00	9,533,700
コスモス薬品	13,500	11,260.00	152,010,000
シップヘルスケアホールディングス	41,500	2,128.00	88,312,000
トーエル	6,400	834.00	5,337,600
ソフトクリエイイトホールディングス	5,800	3,930.00	22,794,000
セブン&アイ・ホールディングス	499,400	5,762.00	2,877,542,800
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	77,500	805.00	62,387,500
明治電機工業	4,300	1,025.00	4,407,500
ツルハホールディングス	29,200	6,430.00	187,756,000
デリカフーズホールディングス	5,400	532.00	2,872,800
スターティアホールディングス	3,000	533.00	1,599,000
サンマルクホールディングス	10,600	1,487.00	15,762,200
フェリシモ	3,000	1,163.00	3,489,000
トリドールホールディングス	33,300	2,223.00	74,025,900
帝人	122,600	1,390.00	170,414,000
東レ	919,000	637.20	585,586,800
クラレ	189,800	1,062.00	201,567,600
旭化成	863,800	1,073.00	926,857,400
T O K Y O B A S E	12,200	313.00	3,818,600
稲葉製作所	7,400	1,281.00	9,479,400
宮地エンジニアリンググループ	4,000	3,325.00	13,300,000
トーカロ	34,700	1,277.00	44,311,900
アルファ	5,100	950.00	4,845,000
S U M C O	212,000	1,933.00	409,796,000
川田テクノロジーズ	2,700	3,630.00	9,801,000
R S T e c h n o l o g i e s	4,400	5,830.00	25,652,000
ジェイテックコーポレーション	1,700	1,687.00	2,867,900
信和	8,400	798.00	6,703,200
ビーロット	9,100	488.00	4,440,800
ファーストブラザーズ	3,200	835.00	2,672,000
A n d D o ホールディングス	6,600	908.00	5,992,800
シーアールイー	4,200	1,506.00	6,325,200
プロパティエージェント	1,600	1,557.00	2,491,200
ケイアイスター不動産	6,000	5,270.00	31,620,000
アグレ都市デザイン	2,200	1,494.00	3,286,800

グッドコムアセット	5,800	1,096.00	6,356,800
ジェイ・エス・ビー	2,700	3,450.00	9,315,000
ロードスターキャピタル	3,400	1,435.00	4,879,000
テンポイノベーション	3,800	814.00	3,093,200
グローバル・リンク・マネジメント	2,400	902.00	2,164,800
フェイスネットワーク	1,700	1,327.00	2,255,900
住江織物	2,500	1,978.00	4,945,000
日本フェルト	7,900	421.00	3,325,900
イチカワ	1,400	1,407.00	1,969,800
エコナックホールディングス	23,400	90.00	2,106,000
日東製網	1,500	1,349.00	2,023,500
芦森工業	2,200	946.00	2,081,200
アツギ	10,100	515.00	5,201,500
ウイルプラスホールディングス	2,500	913.00	2,282,500
J Mホールディングス	9,400	1,626.00	15,284,400
コメダホールディングス	29,200	2,261.00	66,021,200
サツドラホールディングス	6,200	659.00	4,085,800
アレンザホールディングス	9,800	987.00	9,672,600
串カツ田中ホールディングス	3,600	1,647.00	5,929,200
パロックジャパンリミテッド	9,400	792.00	7,444,800
クスリのアオキホールディングス	12,900	5,370.00	69,273,000
ダイニック	3,500	716.00	2,506,000
共和レザー	8,100	679.00	5,499,900
ビーバンドットコム	1,900	555.00	1,054,500
力の源ホールディングス	7,000	591.00	4,137,000
FOOD & LIFE COMPANIES	75,200	2,950.00	221,840,000
アセンテック	4,600	690.00	3,174,000
セーレン	26,400	2,053.00	54,199,200
ソトー	5,100	854.00	4,355,400
東海染工	1,400	1,167.00	1,633,800
小松マテーレ	21,300	1,434.00	30,544,200
ワコールホールディングス	31,400	1,827.00	57,367,800
ホギメディカル	17,500	3,230.00	56,525,000
クラウドシアホールディングス	2,200	231.00	508,200
T S Iホールディングス	43,100	314.00	13,533,400
マツオカコーポレーション	4,100	1,111.00	4,555,100
ワールド	17,400	1,298.00	22,585,200
T I S	123,800	2,982.00	369,171,600
J N Sホールディングス	6,100	395.00	2,409,500
グリー	60,800	918.00	55,814,400
G M Oペパボ	1,400	2,036.00	2,850,400
コーエーテクモホールディングス	42,600	4,065.00	173,169,000
三菱総合研究所	6,900	4,240.00	29,256,000
ボルテージ	3,600	352.00	1,267,200
電算	900	2,236.00	2,012,400
A G S	6,500	756.00	4,914,000
ファインデックス	11,300	607.00	6,859,100
ブレインパッド	11,300	1,115.00	12,599,500
K L a b	23,800	426.00	10,138,800

ポールトゥウィンホールディングス	19,400	1,007.00	19,535,800	
ネクソン	302,400	2,893.00	874,843,200	
アイスタイル	34,300	155.00	5,316,500	
エムアップホールディングス	15,400	980.00	15,092,000	
エイチーム	8,900	692.00	6,158,800	
エニグモ	14,400	550.00	7,920,000	
テクノスジャパン	10,300	447.00	4,604,100	
e n i s h	8,900	306.00	2,723,400	
コロプラ	43,800	634.00	27,769,200	
オルトプラス	10,000	306.00	3,060,000	
ブロードリーフ	66,200	362.00	23,964,400	
クロス・マーケティンググループ	5,100	877.00	4,472,700	
デジタルハーツホールディングス	6,100	1,638.00	9,991,800	
システム情報	10,000	922.00	9,220,000	
メディアドゥ	4,700	1,658.00	7,792,600	
じげん	37,700	296.00	11,159,200	
ブイキューブ	13,600	1,005.00	13,668,000	
エンカレッジ・テクノロジー	3,100	524.00	1,624,400	
サイバーリンクス	4,500	1,030.00	4,635,000	
ディー・エル・イー	9,000	290.00	2,610,000	
フィックスターズ	13,700	772.00	10,576,400	
CARTA HOLDINGS	5,400	2,332.00	12,592,800	
オブティム	9,300	817.00	7,598,100	
セレス	5,000	1,332.00	6,660,000	
S H I F T	7,300	22,000.00	160,600,000	
特種東海製紙	7,800	3,535.00	27,573,000	
ティーガイア	11,900	1,690.00	20,111,000	
セック	2,000	2,219.00	4,438,000	
テクマトリックス	22,600	1,836.00	41,493,600	
プロシップ	4,500	1,350.00	6,075,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	34,700	2,639.00	91,573,300	
GMOペイメントゲートウェイ	25,900	9,840.00	254,856,000	
ザッパラス	5,000	418.00	2,090,000	
システムリサーチ	3,900	1,930.00	7,527,000	
インターネットイニシアティブ	35,600	3,970.00	141,332,000	
さくらインターネット	14,400	566.00	8,150,400	
ヴィンクス	3,800	1,136.00	4,316,800	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,000	5,220.00	15,660,000	
S R Aホールディングス	6,500	2,750.00	17,875,000	
システムインテグレータ	4,300	473.00	2,033,900	
朝日ネット	12,300	577.00	7,097,100	
e B A S E	16,000	409.00	6,544,000	
アバント	14,300	1,156.00	16,530,800	
アドソル日進	4,800	1,569.00	7,531,200	
ODKソリューションズ	2,900	610.00	1,769,000	
フリービット	6,900	908.00	6,265,200	
コムチュア	15,000	2,715.00	40,725,000	
サイバーコム	2,100	1,109.00	2,328,900	

アステリア	9,600	885.00	8,496,000
アイル	7,100	1,299.00	9,222,900
王子ホールディングス	542,900	603.00	327,368,700
日本製紙	60,500	1,047.00	63,343,500
三菱製紙	18,700	303.00	5,666,100
北越コーポレーション	84,800	679.00	57,579,200
中越パルプ工業	5,200	943.00	4,903,600
巴川製紙所	4,000	796.00	3,184,000
大王製紙	61,900	1,549.00	95,883,100
阿波製紙	3,600	329.00	1,184,400
マークライNZ	6,700	2,530.00	16,951,000
メディカル・データ・ビジョン	16,900	918.00	15,514,200
gumi	18,400	509.00	9,365,600
ショーケース	2,900	436.00	1,264,400
モバイルファクトリー	3,000	966.00	2,898,000
テラスカイ	4,900	1,254.00	6,144,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,900	1,155.00	6,814,500
PCIホールディングス	5,700	971.00	5,534,700
パイプドHD	2,400	2,649.00	6,357,600
アイビーシー	2,100	484.00	1,016,400
ネオジャパン	3,800	1,144.00	4,347,200
PR TIMES	2,800	2,051.00	5,742,800
ラクス	61,200	1,311.00	80,233,200
ランドコンピュータ	3,200	907.00	2,902,400
ダブルスタンダード	4,000	1,765.00	7,060,000
オーブンドア	7,900	1,745.00	13,785,500
マイネット	4,800	507.00	2,433,600
アカツキ	5,900	2,967.00	17,505,300
ベネフィットジャパン	900	1,996.00	1,796,400
Ubicomホールディングス	3,500	2,730.00	9,555,000
カナミックネットワーク	14,900	488.00	7,271,200
ノムラシステムコーポレーション	6,900	228.00	1,573,200
レンゴー	118,100	780.00	92,118,000
トーモク	7,700	1,554.00	11,965,800
ザ・バック	9,500	2,343.00	22,258,500
チェンジ	25,700	1,769.00	45,463,300
シンクロ・フード	6,800	278.00	1,890,400
オークネット	7,100	1,502.00	10,664,200
キャピタル・アセット・プランニング	2,600	730.00	1,898,000
セグエグループ	3,500	557.00	1,949,500
エイトレッド	1,900	2,010.00	3,819,000
マクロミル	27,900	1,125.00	31,387,500
ビーグリー	3,100	1,313.00	4,070,300
オロ	4,200	1,808.00	7,593,600
ユーザーローカル	4,100	1,628.00	6,674,800
テモナ	2,700	377.00	1,017,900
ニーズウェル	3,300	666.00	2,197,800
マネーフォワード	27,100	3,600.00	97,560,000
サインポスト	4,300	828.00	3,560,400

昭和電工	116,100	2,466.00	286,302,600
住友化学	956,000	575.00	549,700,000
住友精化	5,700	3,040.00	17,328,000
日産化学	68,500	7,020.00	480,870,000
ラサ工業	4,700	1,643.00	7,722,100
クレハ	10,300	10,050.00	103,515,000
多木化学	4,900	4,970.00	24,353,000
テイカ	9,100	1,187.00	10,801,700
石原産業	22,700	1,054.00	23,925,800
片倉コープアグリ	3,200	1,309.00	4,188,800
日本曹達	16,200	3,500.00	56,700,000
東ソー	183,100	1,836.00	336,171,600
トクヤマ	41,500	1,770.00	73,455,000
セントラル硝子	21,200	2,417.00	51,240,400
東亜合成	70,500	1,039.00	73,249,500
大阪ソーダ	11,700	3,215.00	37,615,500
関東電化工業	27,500	973.00	26,757,500
デンカ	47,400	3,490.00	165,426,000
イビデン	69,400	4,650.00	322,710,000
信越化学工業	223,000	18,015.00	4,017,345,000
日本カーバイド工業	4,800	1,380.00	6,624,000
電算システムホールディングス	5,500	2,559.00	14,074,500
堺化学工業	9,100	1,880.00	17,108,000
第一稀元素化学工業	12,000	974.00	11,688,000
エア・ウォーター	119,700	1,690.00	202,293,000
日本酸素ホールディングス	122,000	2,332.00	284,504,000
日本化学工業	4,000	2,325.00	9,300,000
東邦アセチレン	2,900	1,134.00	3,288,600
日本パーカライジング	63,500	926.00	58,801,000
高圧ガス工業	20,400	655.00	13,362,000
チタン工業	1,500	1,707.00	2,560,500
四国化成工業	16,600	1,240.00	20,584,000
戸田工業	2,800	2,424.00	6,787,200
ステラ ケミファ	6,700	2,475.00	16,582,500
保土谷化学工業	4,000	3,660.00	14,640,000
日本触媒	21,300	5,240.00	111,612,000
大日精化工業	10,500	1,955.00	20,527,500
カネカ	32,500	3,455.00	112,287,500
協和キリン	152,200	2,627.00	399,829,400
三菱瓦斯化学	117,600	1,995.00	234,612,000
三井化学	115,300	3,015.00	347,629,500
J S R	124,200	3,505.00	435,321,000
東京応化工業	21,000	6,930.00	145,530,000
大阪有機化学工業	10,700	2,785.00	29,799,500
三菱ケミカルホールディングス	869,900	815.90	709,751,410
K Hネオケム	21,400	2,492.00	53,328,800
ダイセル	187,700	788.00	147,907,600
住友ベークライト	20,300	4,280.00	86,884,000
積水化学工業	272,300	1,747.00	475,708,100
日本ゼオン	113,500	1,376.00	156,176,000

アイカ工業	35,200	2,969.00	104,508,800
UBE	62,800	2,071.00	130,058,800
積水樹脂	19,500	1,762.00	34,359,000
タキロンシーアイ	28,900	555.00	16,039,500
旭有機材	7,500	1,897.00	14,227,500
ニチバン	7,700	1,727.00	13,297,900
リケンテクノス	30,800	426.00	13,120,800
大倉工業	6,500	1,828.00	11,882,000
積水化成成品工業	17,200	418.00	7,189,600
群栄化学工業	2,900	2,694.00	7,812,600
タイガースポリマー	7,100	432.00	3,067,200
ミライアル	4,300	1,663.00	7,150,900
ダイキアクシス	5,300	720.00	3,816,000
ダイキョーニシカワ	28,100	513.00	14,415,300
竹本容器	4,800	787.00	3,777,600
森六ホールディングス	7,000	1,787.00	12,509,000
恵和	3,600	4,485.00	16,146,000
日本化薬	98,500	1,107.00	109,039,500
カーリットホールディングス	12,500	640.00	8,000,000
ソルクシーズ	11,400	382.00	4,354,800
CLホールディングス	2,700	1,079.00	2,913,300
プレステージ・インターナショナル	48,800	605.00	29,524,000
フェイス	3,600	734.00	2,642,400
プロトコーポレーション	14,200	1,031.00	14,640,200
ハイマックス	3,600	1,281.00	4,611,600
アミューズ	7,100	1,935.00	13,738,500
野村総合研究所	249,500	3,285.00	819,607,500
ドリームインキュベータ	3,700	2,000.00	7,400,000
サイバネットシステム	9,500	843.00	8,008,500
クイック	8,600	1,478.00	12,710,800
TAC	7,400	227.00	1,679,800
CEホールディングス	6,900	452.00	3,118,800
日本システム技術	2,500	2,492.00	6,230,000
電通グループ	130,000	4,730.00	614,900,000
インテージホールディングス	15,400	1,533.00	23,608,200
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,100	1,250.00	7,625,000
東邦システムサイエンス	3,700	902.00	3,337,400
ぴあ	4,300	3,035.00	13,050,500
イオンファンタジー	5,000	2,180.00	10,900,000
ソースネクスト	57,400	173.00	9,930,200
シーティーエス	14,700	878.00	12,906,600
ネクシーズグループ	4,400	522.00	2,296,800
インフォコム	14,600	2,073.00	30,265,800
メディカルシステムネットワーク	12,500	448.00	5,600,000
日本精化	10,000	1,901.00	19,010,000
扶桑化学工業	11,500	3,770.00	43,355,000
トリケミカル研究所	13,700	2,302.00	31,537,400
シンプレクス・ホールディングス	21,100	1,793.00	37,832,300
HEROZ	3,800	892.00	3,389,600
ラクスル	15,100	2,334.00	35,243,400

I P S	3,700	2,140.00	7,918,000	
F I G	14,600	281.00	4,102,600	
システムサポート	4,900	1,016.00	4,978,400	
A D E K A	58,400	2,413.00	140,919,200	
日油	43,200	4,750.00	205,200,000	
ミヨシ油脂	5,300	1,118.00	5,925,400	
新日本理化	21,000	261.00	5,481,000	
ハリマ化成グループ	9,700	782.00	7,585,400	
イーソル	8,200	618.00	5,067,600	
アルテリア・ネットワークス	15,500	1,348.00	20,894,000	
東海ソフト	2,100	947.00	1,988,700	
ウイングアーク1st	10,200	1,289.00	13,147,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,000	1,495.00	4,485,000	
サーバーワークス	2,300	1,958.00	4,503,400	
東名	1,200	743.00	891,600	
ヴィッツ	1,200	1,187.00	1,424,400	
トピラシステムズ	2,700	757.00	2,043,900	
S a n s a n	45,700	1,117.00	51,046,900	
L i n k - U	2,400	636.00	1,526,400	
ギフトィ	11,800	930.00	10,974,000	
花王	294,400	5,171.00	1,522,342,400	
第一工業製薬	4,800	2,546.00	12,220,800	
石原ケミカル	6,600	1,277.00	8,428,200	
日華化学	4,600	800.00	3,680,000	
ニイタカ	2,700	2,327.00	6,282,900	
三洋化成工業	8,000	5,000.00	40,000,000	
ベース	2,300	6,130.00	14,099,000	
J M D C	16,700	5,400.00	90,180,000	
武田薬品工業	1,069,700	3,811.00	4,076,626,700	
アステラス製薬	1,163,600	1,920.50	2,234,693,800	
住友ファーマ	84,000	1,216.00	102,144,000	
塩野義製薬	166,800	7,110.00	1,185,948,000	
わかもと製薬	15,200	270.00	4,104,000	
日本新薬	33,600	8,590.00	288,624,000	
中外製薬	425,700	3,696.00	1,573,387,200	
科研製薬	20,700	3,940.00	81,558,000	
エーザイ	158,700	5,535.00	878,404,500	
理研ビタミン	13,400	1,662.00	22,270,800	
ロート製薬	68,200	3,355.00	228,811,000	
小野薬品工業	297,700	3,435.00	1,022,599,500	
久光製薬	33,600	3,460.00	116,256,000	
有機合成薬品工業	9,300	272.00	2,529,600	
持田製薬	16,400	3,650.00	59,860,000	
参天製薬	248,300	1,075.00	266,922,500	
扶桑薬品工業	4,700	2,091.00	9,827,700	
日本ケミファ	1,000	1,930.00	1,930,000	
ツムラ	41,100	3,220.00	132,342,000	
日医工	41,200	784.00	32,300,800	
テルモ	385,100	3,761.00	1,448,361,100	

H・U・グループホールディングス	34,000	2,953.00	100,402,000
キッセイ薬品工業	22,600	2,557.00	57,788,200
生化学工業	24,100	836.00	20,147,600
栄研化学	22,700	1,606.00	36,456,200
日水製薬	5,200	980.00	5,096,000
鳥居薬品	7,300	3,115.00	22,739,500
JCRファーマ	38,400	2,295.00	88,128,000
東和薬品	19,600	2,860.00	56,056,000
富士製薬工業	8,100	970.00	7,857,000
ゼリア新薬工業	23,200	1,984.00	46,028,800
第一三共	1,042,200	3,283.00	3,421,542,600
キョーリン製薬ホールディングス	26,400	1,867.00	49,288,800
大幸薬品	20,500	583.00	11,951,500
ダイト	8,800	2,664.00	23,443,200
大塚ホールディングス	275,000	4,439.00	1,220,725,000
大正製薬ホールディングス	30,000	5,020.00	150,600,000
ペプチドリーム	71,400	1,949.00	139,158,600
大日本塗料	15,900	785.00	12,481,500
日本ペイントホールディングス	500,800	982.00	491,785,600
関西ペイント	130,500	1,756.00	229,158,000
神東塗料	9,100	155.00	1,410,500
中国塗料	30,600	964.00	29,498,400
日本特殊塗料	9,400	808.00	7,595,200
藤倉化成	16,900	465.00	7,858,500
太陽ホールディングス	19,600	3,155.00	61,838,000
DIC	53,600	2,496.00	133,785,600
サカタインクス	26,500	989.00	26,208,500
東洋インキS Cホールディングス	27,300	1,978.00	53,999,400
T&K TOKA	10,800	813.00	8,780,400
アルプス技研	10,400	1,895.00	19,708,000
サニックス	22,800	274.00	6,247,200
ダイオーズ	2,800	1,043.00	2,920,400
日本空調サービス	13,900	810.00	11,259,000
オリエンタルランド	148,600	17,855.00	2,653,253,000
フォーカスシステムズ	8,700	891.00	7,751,700
ダスキン	29,400	2,774.00	81,555,600
パーク24	79,500	1,856.00	147,552,000
明光ネットワークジャパン	15,300	577.00	8,828,100
ファルコホールディングス	6,100	2,103.00	12,828,300
クレスコ	9,700	1,897.00	18,400,900
フジ・メディア・ホールディングス	125,400	1,137.00	142,579,800
秀英予備校	3,100	418.00	1,295,800
田谷	1,700	553.00	940,100
ラウンドワン	36,300	1,349.00	48,968,700
リゾートトラスト	58,100	2,167.00	125,902,700
オービック	42,100	18,730.00	788,533,000
ジャストシステム	19,000	5,280.00	100,320,000
TDCソフト	11,400	1,139.00	12,984,600
Zホールディングス	1,925,700	444.00	855,010,800
ビー・エム・エル	16,500	3,335.00	55,027,500

トレンドマイクロ	69,400	7,190.00	498,986,000	
りらいあコミュニケーションズ	19,200	1,048.00	20,121,600	
IDホールディングス	8,600	831.00	7,146,600	
リソー教育	59,300	364.00	21,585,200	
日本オラクル	21,700	8,250.00	179,025,000	
早稲田アカデミー	7,300	1,037.00	7,570,100	
アルファシステムズ	3,100	3,780.00	11,718,000	
フューチャー	28,200	1,740.00	49,068,000	
CAC Holdings	7,600	1,348.00	10,244,800	
SBテクノロジー	5,800	2,048.00	11,878,400	
トーセ	3,600	729.00	2,624,400	
ユー・エス・エス	145,600	2,169.00	315,806,400	
オービックビジネスコンサルタント	12,700	4,475.00	56,832,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	60,800	2,974.00	180,819,200	
アイティフォー	16,200	811.00	13,138,200	
東京個別指導学院	11,400	581.00	6,623,400	
東計電算	1,500	5,310.00	7,965,000	
サイバーエージェント	306,300	1,368.00	419,018,400	
楽天グループ	646,900	863.00	558,274,700	
エクスネット	2,200	992.00	2,182,400	
クリーク・アンド・リバー社	6,800	1,987.00	13,511,600	
モーニングスター	22,800	533.00	12,152,400	
テー・オー・ダブリュ	25,200	320.00	8,064,000	
大塚商会	72,300	4,015.00	290,284,500	
サイボウズ	17,800	1,196.00	21,288,800	
山田コンサルティンググループ	6,700	1,161.00	7,778,700	
セントラルスポーツ	4,900	2,339.00	11,461,100	
パラカ	3,700	1,779.00	6,582,300	
電通国際情報サービス	18,400	3,945.00	72,588,000	
ACCESS	15,100	558.00	8,425,800	
デジタルガレージ	22,100	4,125.00	91,162,500	
イーエムシステムズ	22,100	947.00	20,928,700	
ウェザーニューズ	4,300	6,310.00	27,133,000	
CIJ	10,600	760.00	8,056,000	
ビジネスエンジニアリング	1,500	3,920.00	5,880,000	
日本エンタープライズ	13,600	163.00	2,216,800	
WOWOW	6,200	1,542.00	9,560,400	
スカラ	11,200	762.00	8,534,400	
インテリジェント ウェイブ	6,800	576.00	3,916,800	
フルキャストホールディングス	11,100	2,308.00	25,618,800	
エン・ジャパン	21,700	3,075.00	66,727,500	
あすか製薬ホールディングス	14,600	1,179.00	17,213,400	
サワイグループホールディングス	28,600	4,120.00	117,832,000	
富士フイルムホールディングス	239,200	7,194.00	1,720,804,800	
コニカミノルタ	290,300	486.00	141,085,800	
資生堂	253,500	5,308.00	1,345,578,000	
ライオン	152,400	1,351.00	205,892,400	
高砂香料工業	8,800	2,639.00	23,223,200	
マンダム	27,900	1,238.00	34,540,200	
ミルボン	16,800	5,080.00	85,344,000	

ファンケル	55,100	2,406.00	132,570,600
コーセー	25,600	11,800.00	302,080,000
コタ	9,600	1,411.00	13,545,600
シーボン	1,400	1,701.00	2,381,400
ポーラ・オルビスホールディングス	58,000	1,456.00	84,448,000
ノエビアホールディングス	11,100	5,000.00	55,500,000
アジュバンホールディングス	3,200	976.00	3,123,200
新日本製薬	4,600	1,368.00	6,292,800
エステー	8,800	1,464.00	12,883,200
アグロ カネショウ	4,600	1,167.00	5,368,200
コニシ	21,800	1,526.00	33,266,800
長谷川香料	23,500	2,588.00	60,818,000
星光PMC	7,800	566.00	4,414,800
小林製薬	38,100	8,710.00	331,851,000
荒川化学工業	10,800	1,022.00	11,037,600
メック	9,900	2,284.00	22,611,600
日本高純度化学	3,600	2,281.00	8,211,600
タカラバイオ	35,600	2,082.00	74,119,200
JCU	14,700	3,310.00	48,657,000
新田ゼラチン	8,500	623.00	5,295,500
OATアグリオ	5,600	1,165.00	6,524,000
デクセリアルズ	35,400	2,815.00	99,651,000
アース製薬	11,200	5,430.00	60,816,000
北興化学工業	12,300	1,021.00	12,558,300
大成ラミック	4,000	2,561.00	10,244,000
クミアイ化学工業	50,700	910.00	46,137,000
日本農薬	24,400	619.00	15,103,600
富士興産	3,300	890.00	2,937,000
ニチレキ	16,500	1,217.00	20,080,500
ユシロ化学工業	6,900	1,020.00	7,038,000
ビーピー・カストロール	4,900	1,224.00	5,997,600
富士石油	34,200	280.00	9,576,000
MORESCO	4,600	1,193.00	5,487,800
出光興産	146,900	3,615.00	531,043,500
ENEOSホールディングス	2,047,200	477.40	977,333,280
コスモエネルギーホールディングス	44,200	3,260.00	144,092,000
テスホールディングス	11,800	1,356.00	16,000,800
インフロニア・ホールディングス	173,700	955.00	165,883,500
横浜ゴム	74,000	1,703.00	126,022,000
TOYO TIRE	69,400	1,475.00	102,365,000
ブリヂストン	382,000	4,763.00	1,819,466,000
住友ゴム工業	118,600	1,145.00	135,797,000
藤倉コンポジット	10,900	683.00	7,444,700
オカモト	7,600	3,925.00	29,830,000
アキレス	8,800	1,343.00	11,818,400
フコク	6,000	943.00	5,658,000
ニッタ	13,600	2,825.00	38,420,000
クリエートメディック	3,800	984.00	3,739,200
住友理工	26,400	560.00	14,784,000
三ツ星ベルト	16,500	2,056.00	33,924,000

バンドー化学	22,000	873.00	19,206,000
A G C	121,700	4,880.00	593,896,000
日本板硝子	63,900	390.00	24,921,000
石塚硝子	2,300	1,772.00	4,075,600
有沢製作所	19,500	916.00	17,862,000
日本山村硝子	5,200	793.00	4,123,600
日本電気硝子	53,300	2,731.00	145,562,300
オハラ	5,400	1,096.00	5,918,400
住友大阪セメント	24,100	3,535.00	85,193,500
太平洋セメント	77,300	2,094.00	161,866,200
リソルホールディングス	1,500	4,465.00	6,697,500
日本ヒューム	13,100	668.00	8,750,800
日本コンクリート工業	26,100	310.00	8,091,000
三谷セキサン	6,100	4,775.00	29,127,500
アジアパイルホールディングス	20,600	429.00	8,837,400
東海カーボン	110,800	1,038.00	115,010,400
日本カーボン	7,000	4,225.00	29,575,000
東洋炭素	8,600	2,795.00	24,037,000
ノリタケカンパニーリミテド	7,300	4,170.00	30,441,000
T O T O	92,200	4,295.00	395,999,000
日本碍子	143,000	1,774.00	253,682,000
日本特殊陶業	100,600	2,315.00	232,889,000
ダントーホールディングス	8,700	239.00	2,079,300
M A R U W A	4,700	15,710.00	73,837,000
品川リフラクトリーズ	3,200	3,680.00	11,776,000
黒崎播磨	2,300	4,090.00	9,407,000
ヨータイ	8,700	1,365.00	11,875,500
東京窯業	16,200	282.00	4,568,400
ニッカトー	6,000	502.00	3,012,000
フジインコーポレーテッド	10,900	5,590.00	60,931,000
クニミネ工業	4,400	971.00	4,272,400
エーアンドエーマテリアル	2,500	857.00	2,142,500
ニチアス	30,500	2,318.00	70,699,000
日本製鉄	589,000	1,970.50	1,160,624,500
神戸製鋼所	245,500	561.00	137,725,500
中山製鋼所	20,400	426.00	8,690,400
合同製鐵	7,000	1,251.00	8,757,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	346,100	1,481.00	512,574,100
東京製鐵	43,700	1,401.00	61,223,700
共英製鋼	14,600	1,296.00	18,921,600
大和工業	23,800	4,205.00	100,079,000
東京鐵鋼	5,800	1,290.00	7,482,000
大阪製鐵	7,200	1,318.00	9,489,600
淀川製鋼所	16,700	2,431.00	40,597,700
丸一鋼管	41,400	2,803.00	116,044,200
モリ工業	3,700	2,481.00	9,179,700
大同特殊鋼	20,800	3,525.00	73,320,000
日本高周波鋼業	3,800	332.00	1,261,600
日本冶金工業	9,600	2,493.00	23,932,800

山陽特殊製鋼	13,100	2,037.00	26,684,700
愛知製鋼	7,500	2,135.00	16,012,500
日立金属	145,000	2,041.00	295,945,000
日本金属	3,400	1,161.00	3,947,400
大平洋金属	8,300	3,485.00	28,925,500
新日本電工	82,700	307.00	25,388,900
栗本鐵工所	6,000	1,582.00	9,492,000
虹 技	1,900	917.00	1,742,300
日本鑄鉄管	1,400	1,006.00	1,408,400
日本製鋼所	38,800	3,025.00	117,370,000
三菱製鋼	8,600	1,050.00	9,030,000
日亜鋼業	16,900	260.00	4,394,000
日本精線	2,200	4,110.00	9,042,000
エンビプロ・ホールディングス	8,900	947.00	8,428,300
大紀アルミニウム工業所	19,000	1,338.00	25,422,000
日本軽金属ホールディングス	34,000	1,651.00	56,134,000
三井金属鉱業	36,300	3,225.00	117,067,500
東邦亜鉛	7,300	2,728.00	19,914,400
三菱マテリアル	85,200	2,016.00	171,763,200
住友金属鉱山	163,800	5,495.00	900,081,000
DOWAホールディングス	34,900	5,420.00	189,158,000
古河機械金属	21,800	1,277.00	27,838,600
エス・サイエンス	65,600	28.00	1,836,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,500	1,226.00	19,003,000
東邦チタニウム	24,100	1,448.00	34,896,800
UACJ	19,700	2,171.00	42,768,700
CKサンエツ	2,700	3,950.00	10,665,000
古河電気工業	40,800	2,127.00	86,781,600
住友電気工業	492,000	1,434.00	705,528,000
フジクラ	149,900	619.00	92,788,100
昭和電線ホールディングス	11,700	1,722.00	20,147,400
東京特殊電線	2,000	2,656.00	5,312,000
タツタ電線	23,800	465.00	11,067,000
カナレ電気	2,100	1,687.00	3,542,700
平河ヒューテック	7,500	1,102.00	8,265,000
リョービ	15,600	1,086.00	16,941,600
アーレスティ	14,400	355.00	5,112,000
アサヒホールディングス	53,900	2,091.00	112,704,900
東洋製罐グループホールディングス	80,000	1,413.00	113,040,000
ホッカンホールディングス	7,100	1,249.00	8,867,900
コロナ	7,400	827.00	6,119,800
横河ブリッジホールディングス	21,800	1,892.00	41,245,600
駒井ハルテック	2,400	1,896.00	4,550,400
高田機工	700	2,734.00	1,913,800
三和ホールディングス	126,800	1,182.00	149,877,600
文化シャッター	41,700	964.00	40,198,800
三協立山	16,900	597.00	10,089,300
アルインコ	9,600	850.00	8,160,000
東洋シャッター	2,200	570.00	1,254,000
LIXIL	211,800	2,336.00	494,764,800

日本ファイルコン	9,300	510.00	4,743,000
ノーリツ	24,300	1,496.00	36,352,800
長府製作所	13,700	1,882.00	25,783,400
リンナイ	24,700	8,130.00	200,811,000
ユニプレス	20,900	767.00	16,030,300
ダイニチ工業	6,500	626.00	4,069,000
日東精工	16,300	502.00	8,182,600
三洋工業	1,400	1,780.00	2,492,000
岡部	23,700	660.00	15,642,000
ジーテクト	16,100	1,272.00	20,479,200
東プレ	23,500	1,107.00	26,014,500
高周波熱錬	22,000	585.00	12,870,000
東京製綱	8,300	840.00	6,972,000
サンコール	11,600	505.00	5,858,000
モリテックスチール	10,400	292.00	3,036,800
パイオラックス	18,800	1,480.00	27,824,000
エイチワン	12,900	597.00	7,701,300
日本発条	120,300	846.00	101,773,800
中央発條	6,500	690.00	4,485,000
アドパネクス	1,800	1,733.00	3,119,400
三浦工業	56,500	2,607.00	147,295,500
タクマ	43,300	1,455.00	63,001,500
テクノプロ・ホールディングス	77,900	2,970.00	231,363,000
アトラグループ	2,400	256.00	614,400
インターワークス	4,000	379.00	1,516,000
アイ・アールジャパンホールディングス	6,000	3,960.00	23,760,000
Keeper 技研	8,400	2,400.00	20,160,000
ファーストロジック	2,400	768.00	1,843,200
三機サービス	2,300	1,203.00	2,766,900
Gunosy	7,100	980.00	6,958,000
デザインワン・ジャパン	3,400	184.00	625,600
イー・ガーディアン	5,000	2,774.00	13,870,000
リブセンス	7,800	162.00	1,263,600
ジャパンマテリアル	40,000	1,882.00	75,280,000
ベクトル	18,200	1,179.00	21,457,800
ウチヤマホールディングス	6,700	317.00	2,123,900
チャーム・ケア・コーポレーション	9,700	1,298.00	12,590,600
キャリアリンク	4,800	1,441.00	6,916,800
IBJ	10,600	690.00	7,314,000
アサンテ	5,800	1,470.00	8,526,000
バリューHR	10,700	1,308.00	13,995,600
M&Aキャピタルパートナーズ	10,700	3,400.00	36,380,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,000	1,150.00	5,750,000
ERIホールディングス	3,600	1,272.00	4,579,200
アビスト	2,100	2,770.00	5,817,000
シグマクシス・ホールディングス	15,700	1,017.00	15,966,900
ウィルグループ	9,700	1,070.00	10,379,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	16,100	163.00	2,624,300

メドピア	9,700	2,594.00	25,161,800
レアジョブ	2,500	758.00	1,895,000
リクルートホールディングス	979,400	4,471.00	4,378,897,400
エラン	17,900	957.00	17,130,300
ツガミ	28,900	1,196.00	34,564,400
オークマ	14,700	4,745.00	69,751,500
芝浦機械	15,200	2,964.00	45,052,800
アマダ	212,300	1,019.00	216,333,700
アイダエンジニアリング	33,300	959.00	31,934,700
滝澤鉄工所	4,100	1,290.00	5,289,000
F U J I	59,200	2,165.00	128,168,000
牧野フライス製作所	14,400	4,205.00	60,552,000
オーエスジー	61,500	1,613.00	99,199,500
ダイジェット工業	1,600	942.00	1,507,200
旭ダイヤモンド工業	34,500	571.00	19,699,500
D M G 森精機	78,000	1,621.00	126,438,000
ソディック	29,200	740.00	21,608,000
ディスコ	19,800	31,000.00	613,800,000
日東工器	7,100	1,490.00	10,579,000
日進工具	10,600	1,432.00	15,179,200
パンチ工業	11,400	473.00	5,392,200
富士ダイス	6,300	637.00	4,013,100
土木管理総合試験所	6,200	331.00	2,052,200
ネットマーケティング	6,300	651.00	4,101,300
日本郵政	1,627,400	909.90	1,480,771,260
ベルシステム24ホールディングス	18,700	1,465.00	27,395,500
鎌倉新書	14,800	543.00	8,036,400
S M N	2,900	599.00	1,737,100
一蔵	1,800	380.00	684,000
グローバルキッズCOMPANY	2,300	698.00	1,605,400
エアトリ	8,100	2,974.00	24,089,400
アトラエ	9,100	1,665.00	15,151,500
ストライク	5,200	3,785.00	19,682,000
ソラスト	31,900	831.00	26,508,900
セラク	4,100	1,146.00	4,698,600
インソース	13,200	1,976.00	26,083,200
豊田自動織機	105,600	8,040.00	849,024,000
豊和工業	7,000	806.00	5,642,000
O K K	4,900	1,311.00	6,423,900
石川製作所	3,500	1,399.00	4,896,500
東洋機械金属	8,900	586.00	5,215,400
津田駒工業	2,600	572.00	1,487,200
エンシュウ	3,000	672.00	2,016,000
島精機製作所	19,700	1,785.00	35,164,500
オプトラ	16,900	1,811.00	30,605,900
N C ホールディングス	3,100	1,650.00	5,115,000
イワキ	8,600	1,071.00	9,210,600
フリー	11,900	1,009.00	12,007,100
ヤマシンフィルタ	25,000	343.00	8,575,000
日阪製作所	15,800	754.00	11,913,200

やまびこ	24,900	1,411.00	35,133,900
野村マイクロ・サイエンス	4,600	3,655.00	16,813,000
平田機工	6,200	4,735.00	29,357,000
ペガサスミシン製造	13,700	609.00	8,343,300
マルマエ	5,500	2,125.00	11,687,500
タツモ	6,300	1,327.00	8,360,100
ナブテスコ	75,000	2,792.00	209,400,000
三井海洋開発	14,400	1,232.00	17,740,800
レオン自動機	14,400	1,117.00	16,084,800
S M C	39,900	61,620.00	2,458,638,000
ホソカワミクロン	9,200	2,404.00	22,116,800
ユニオンツール	5,000	3,735.00	18,675,000
オイレス工業	18,400	1,504.00	27,673,600
日精エー・エス・ビー機械	4,800	2,942.00	14,121,600
サトーホールディングス	17,700	1,818.00	32,178,600
技研製作所	11,900	3,530.00	42,007,000
日本エアテック	6,200	1,049.00	6,503,800
カワタ	4,200	958.00	4,023,600
日精樹脂工業	9,200	966.00	8,887,200
オカダアイヨン	4,300	1,549.00	6,660,700
ワイエイシーホールディングス	5,400	1,443.00	7,792,200
小松製作所	616,800	3,085.00	1,902,828,000
住友重機械工業	76,200	2,760.00	210,312,000
日立建機	54,500	3,080.00	167,860,000
日工	18,200	612.00	11,138,400
巴工業	5,200	2,298.00	11,949,600
井関農機	12,000	1,258.00	15,096,000
T O W A	11,600	1,967.00	22,817,200
丸山製作所	2,600	1,514.00	3,936,400
北川鉄工所	5,900	1,295.00	7,640,500
シンニッタン	16,400	216.00	3,542,400
ローツェ	6,700	10,150.00	68,005,000
タカキタ	4,500	567.00	2,551,500
クボタ	659,300	2,250.00	1,483,425,000
荏原実業	6,300	2,404.00	15,145,200
東洋エンジニアリング	18,000	616.00	11,088,000
三菱化工機	4,300	1,941.00	8,346,300
月島機械	23,900	1,035.00	24,736,500
帝国電機製作所	9,300	1,656.00	15,400,800
東京機械製作所	5,500	806.00	4,433,000
新東工業	28,600	680.00	19,448,000
澁谷工業	11,500	2,305.00	26,507,500
アイチコーポレーション	19,500	894.00	17,433,000
小森コーポレーション	33,800	756.00	25,552,800
鶴見製作所	10,200	1,880.00	19,176,000
住友精密工業	2,000	2,202.00	4,404,000
日本ギア工業	5,200	258.00	1,341,600
酒井重工業	2,400	3,050.00	7,320,000
荏原製作所	54,400	5,960.00	324,224,000
石井鐵工所	1,000	2,850.00	2,850,000

西島製作所	11,900	1,313.00	15,624,700
北越工業	12,400	874.00	10,837,600
ダイキン工業	165,100	19,125.00	3,157,537,500
オルガノ	3,900	8,760.00	34,164,000
トヨーカネツ	5,000	2,445.00	12,225,000
栗田工業	72,000	4,435.00	319,320,000
椿本チエイン	17,800	2,997.00	53,346,600
大同工業	5,900	916.00	5,404,400
日機装	38,700	829.00	32,082,300
木村化工機	11,100	778.00	8,635,800
レイズネクスト	20,000	1,079.00	21,580,000
アネスト岩田	21,200	829.00	17,574,800
ダイフク	71,300	7,820.00	557,566,000
サムコ	3,500	2,383.00	8,340,500
加藤製作所	6,500	777.00	5,050,500
油研工業	1,700	1,695.00	2,881,500
タダノ	69,300	903.00	62,577,900
フジテック	46,400	2,643.00	122,635,200
C K D	38,200	1,646.00	62,877,200
キトー	11,300	1,678.00	18,961,400
平和	38,000	1,911.00	72,618,000
理想科学工業	10,600	2,433.00	25,789,800
SANKYO	29,400	3,785.00	111,279,000
日本金銭機械	13,800	730.00	10,074,000
マースグループホールディングス	8,700	1,660.00	14,442,000
フクシマガリレイ	9,000	3,730.00	33,570,000
オーイズミ	4,800	465.00	2,232,000
ダイコク電機	6,300	1,257.00	7,919,100
竹内製作所	20,700	2,472.00	51,170,400
アマノ	35,600	2,498.00	88,928,800
JUKI	18,900	747.00	14,118,300
サンデン	19,000	190.00	3,610,000
ジャノメ	11,600	690.00	8,004,000
ブラザー工業	162,500	2,297.00	373,262,500
マックス	17,400	1,558.00	27,109,200
モリタホールディングス	21,800	1,307.00	28,492,600
グローリー	34,100	2,143.00	73,076,300
新晃工業	12,700	1,575.00	20,002,500
大和冷機工業	19,700	1,105.00	21,768,500
セガサミーホールディングス	135,000	2,299.00	310,365,000
日本ピストンリング	5,000	1,312.00	6,560,000
リケン	5,600	2,444.00	13,686,400
T P R	17,300	1,274.00	22,040,200
ツバキ・ナカシマ	29,900	899.00	26,880,100
ホシザキ	39,800	8,000.00	318,400,000
大豊工業	11,100	633.00	7,026,300
日本精工	248,400	725.00	180,090,000
NTN	277,100	213.00	59,022,300
ジェイテクト	125,700	938.00	117,906,600
不二越	10,900	3,680.00	40,112,000

ミネベアミツミ	228,600	2,472.00	565,099,200
日本トムソン	35,100	503.00	17,655,300
THK	76,800	2,610.00	200,448,000
ユーシン精機	10,800	632.00	6,825,600
前澤給装工業	9,800	907.00	8,888,600
イーグル工業	16,100	1,029.00	16,566,900
前澤工業	8,800	633.00	5,570,400
日本ピラー工業	13,000	2,525.00	32,825,000
キッツ	43,200	660.00	28,512,000
日立製作所	654,600	6,383.00	4,178,311,800
東芝	237,800	5,461.00	1,298,625,800
三菱電機	1,330,700	1,355.00	1,803,098,500
富士電機	79,900	5,790.00	462,621,000
東洋電機製造	4,900	930.00	4,557,000
安川電機	142,700	4,180.00	596,486,000
シンフォニアテクノロジー	15,500	1,270.00	19,685,000
明電舎	21,800	2,337.00	50,946,600
オリジン	3,300	1,330.00	4,389,000
山洋電気	5,700	5,520.00	31,464,000
デンヨー	11,000	1,598.00	17,578,000
PHCホールディングス	21,000	1,586.00	33,306,000
ベイクレント・コンサルティング	9,200	41,050.00	377,660,000
Orchestra Holdings	2,500	2,377.00	5,942,500
アイモバイル	4,600	1,337.00	6,150,200
キャリアインデックス	4,400	526.00	2,314,400
MS-Japan	5,300	814.00	4,314,200
船場	1,500	700.00	1,050,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	41,300	1,660.00	68,558,000
フルテック	1,900	1,389.00	2,639,100
グリーンズ	4,900	622.00	3,047,800
ツナググループ・ホールディングス	3,100	268.00	830,800
GAMEWITH	3,900	466.00	1,817,400
MS&Consulting	1,900	712.00	1,352,800
ウェルビー	8,400	926.00	7,778,400
エル・ティー・エス	1,700	2,763.00	4,697,100
ミダックホールディングス	5,900	1,965.00	11,593,500
日総工産	10,100	633.00	6,393,300
キュービーネットホールディングス	6,000	1,364.00	8,184,000
RPAホールディングス	18,200	375.00	6,825,000
三櫻工業	18,800	700.00	13,160,000
マキタ	161,700	3,647.00	589,719,900
東芝テック	14,600	4,375.00	63,875,000
芝浦メカトロニクス	2,400	7,090.00	17,016,000
マブチモーター	31,500	3,505.00	110,407,500
日本電産	335,900	8,214.00	2,759,082,600
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,600	399.00	2,234,400
トレックス・セミコンダクター	6,500	2,228.00	14,482,000
東光高岳	7,600	1,687.00	12,821,200

ダブル・スコープ	39,100	879.00	34,368,900
宮越ホールディングス	5,100	831.00	4,238,100
ダイヘン	14,100	3,745.00	52,804,500
ヤーマン	22,200	1,150.00	25,530,000
JVCケンウッド	110,800	198.00	21,938,400
ミマキエンジニアリング	12,200	702.00	8,564,400
I - P E X	6,300	1,424.00	8,971,200
日新電機	31,900	1,384.00	44,149,600
大崎電気工業	24,400	500.00	12,200,000
オムロン	113,300	7,215.00	817,459,500
日東工業	17,100	1,537.00	26,282,700
I D E C	16,800	2,278.00	38,270,400
正興電機製作所	4,100	1,074.00	4,403,400
不二電機工業	2,700	1,126.00	3,040,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	43,100	2,272.00	97,923,200
サクサホールディングス	2,600	1,501.00	3,902,600
メルコホールディングス	3,300	3,860.00	12,738,000
テクノメディカ	3,100	1,544.00	4,786,400
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	3,800	897.00	3,408,600
日本電気	169,100	5,420.00	916,522,000
富士通	122,500	20,080.00	2,459,800,000
沖電気工業	54,000	862.00	46,548,000
岩崎通信機	5,800	800.00	4,640,000
電気興業	7,000	2,448.00	17,136,000
サンケン電気	12,400	4,795.00	59,458,000
ナカヨ	2,100	1,072.00	2,251,200
アイホン	7,200	2,002.00	14,414,400
ルネサスエレクトロニクス	739,200	1,375.00	1,016,400,000
セイコーエプソン	163,300	1,947.00	317,945,100
ワコム	105,600	963.00	101,692,800
アルバック	27,100	5,050.00	136,855,000
アクセル	5,500	880.00	4,840,000
E I Z O	10,300	3,510.00	36,153,000
ジャパンディスプレイ	464,800	71.00	33,000,800
日本信号	32,700	915.00	29,920,500
京三製作所	28,600	439.00	12,555,400
能美防災	17,100	1,928.00	32,968,800
ホーチキ	9,400	1,159.00	10,894,600
星和電機	6,000	515.00	3,090,000
エレコム	31,200	1,574.00	49,108,800
パナソニック ホールディングス	1,451,500	1,152.00	1,672,128,000
シャープ	146,600	1,076.00	157,741,600
アンリツ	87,600	1,445.00	126,582,000
富士通ゼネラル	37,000	2,181.00	80,697,000
ソニーグループ	852,500	10,840.00	9,241,100,000
T D K	197,100	4,040.00	796,284,000
帝国通信工業	6,100	1,403.00	8,558,300
タムラ製作所	51,300	544.00	27,907,200
アルプスアルパイン	117,300	1,357.00	159,176,100

池上通信機	4,200	604.00	2,536,800
日本電波工業	13,600	1,145.00	15,572,000
鈴木	6,700	755.00	5,058,500
メイコー	14,700	3,500.00	51,450,000
日本トリム	2,500	2,311.00	5,777,500
ローランド ディー・ジー	8,000	3,325.00	26,600,000
フォスター電機	13,400	718.00	9,621,200
S M K	3,200	2,147.00	6,870,400
ヨコオ	9,700	2,541.00	24,647,700
ティアック	21,300	115.00	2,449,500
ホシデン	31,900	1,301.00	41,501,900
ヒロセ電機	20,400	17,300.00	352,920,000
日本航空電子工業	29,900	1,868.00	55,853,200
T O A	14,700	819.00	12,039,300
マクセル	26,300	1,152.00	30,297,600
古野電気	16,200	975.00	15,795,000
ユニデンホールディングス	3,000	3,525.00	10,575,000
スミダコーポレーション	12,700	839.00	10,655,300
アイコム	4,900	2,424.00	11,877,600
リオン	5,000	2,439.00	12,195,000
本多通信工業	10,700	455.00	4,868,500
横河電機	132,400	2,067.00	273,670,800
新電元工業	5,100	2,848.00	14,524,800
アズビル	79,700	3,785.00	301,664,500
東亜ディーケーケー	6,900	915.00	6,313,500
日本光電工業	55,000	3,145.00	172,975,000
チノー	4,400	1,631.00	7,176,400
共和電業	13,500	353.00	4,765,500
日本電子材料	6,700	1,912.00	12,810,400
堀場製作所	24,600	6,240.00	153,504,000
アドバンテスト	101,200	8,550.00	865,260,000
小野測器	5,800	475.00	2,755,000
エスベック	10,700	1,708.00	18,275,600
キーエンス	123,300	50,240.00	6,194,592,000
日置電機	6,500	7,290.00	47,385,000
シスメックス	109,300	7,838.00	856,693,400
日本マイクロニクス	22,500	1,491.00	33,547,500
メガチップス	12,100	3,250.00	39,325,000
O B A R A G R O U P	5,900	2,842.00	16,767,800
I M A G I C A G R O U P	10,700	663.00	7,094,100
澤藤電機	1,700	1,478.00	2,512,600
デンソー	288,600	7,602.00	2,193,937,200
原田工業	6,600	923.00	6,091,800
コーセル	15,100	765.00	11,551,500
イリソ電子工業	11,400	3,095.00	35,283,000
オブテックスグループ	22,300	1,646.00	36,705,800
千代田インテグレ	5,600	2,104.00	11,782,400
レーザーテック	58,400	17,500.00	1,022,000,000
スタンレー電気	92,500	2,234.00	206,645,000
岩崎電気	4,800	2,309.00	11,083,200

ウシオ電機	68,000	1,698.00	115,464,000
岡谷電機産業	9,900	276.00	2,732,400
ヘリオス テクノ ホールディング	11,700	292.00	3,416,400
エノモト	3,800	1,539.00	5,848,200
日本セラミック	12,600	2,258.00	28,450,800
遠藤照明	6,300	830.00	5,229,000
古河電池	9,700	1,185.00	11,494,500
双信電機	6,500	530.00	3,445,000
山一電機	9,500	1,715.00	16,292,500
図研	8,900	2,950.00	26,255,000
日本電子	27,600	5,910.00	163,116,000
カシオ計算機	91,200	1,320.00	120,384,000
ファナック	119,400	19,080.00	2,278,152,000
日本シイエムケイ	25,700	525.00	13,492,500
エンプラス	3,400	3,470.00	11,798,000
大真空	17,800	1,122.00	19,971,600
ローム	59,500	9,230.00	549,185,000
浜松ホトニクス	95,300	5,730.00	546,069,000
三井ハイテック	12,800	11,220.00	143,616,000
新光電気工業	40,000	5,060.00	202,400,000
京セラ	191,500	6,817.00	1,305,455,500
協栄産業	1,400	1,298.00	1,817,200
太陽誘電	64,200	5,340.00	342,828,000
村田製作所	390,300	8,208.00	3,203,582,400
双葉電子工業	23,400	669.00	15,654,600
日東電工	82,300	8,980.00	739,054,000
北陸電気工業	5,100	1,187.00	6,053,700
東海理化電機製作所	35,800	1,385.00	49,583,000
ニチコン	40,600	1,254.00	50,912,400
日本ケミコン	12,900	1,944.00	25,077,600
K O A	19,900	1,580.00	31,442,000
三井E & Sホールディングス	49,100	359.00	17,626,900
日立造船	112,700	693.00	78,101,100
三菱重工業	209,100	4,562.00	953,914,200
川崎重工業	96,900	2,356.00	228,296,400
I H I	85,000	2,984.00	253,640,000
名村造船所	38,900	349.00	13,576,100
サノヤスホールディングス	16,800	127.00	2,133,600
スプリックス	3,900	1,182.00	4,609,800
マネジメントソリューションズ	6,400	4,555.00	29,152,000
プロレド・パートナーズ	2,900	528.00	1,531,200
and factory	3,100	405.00	1,255,500
テノ・ホールディングス	1,600	618.00	988,800
フロンティア・マネジメント	3,400	930.00	3,162,000
ピアラ	2,100	857.00	1,799,700
コプロ・ホールディングス	2,500	1,006.00	2,515,000
ギークス	2,200	1,113.00	2,448,600
カーブスホールディングス	35,700	701.00	25,025,700
フォーラムエンジニアリング	8,700	836.00	7,273,200

FAST FITNESS JAPAN	2,400	1,851.00	4,442,400	
日本車輛製造	4,800	2,062.00	9,897,600	
三菱ロジスネクスト	18,000	757.00	13,626,000	
近畿車輛	1,500	1,206.00	1,809,000	
一家ホールディングス	2,500	535.00	1,337,500	
フルサト・マルカホールディングス	12,500	3,485.00	43,562,500	
ヤマエグループホールディングス	8,600	1,047.00	9,004,200	
藤久ホールディングス	3,300	690.00	2,277,000	
F P G	45,100	827.00	37,297,700	
島根銀行	4,000	524.00	2,096,000	
じもとホールディングス	9,400	625.00	5,875,000	
全国保証	32,000	4,540.00	145,280,000	
めぶきフィナンシャルグループ	612,900	267.00	163,644,300	
ジャパンインベストメントアドバイザー	10,400	1,169.00	12,157,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	16,400	1,771.00	29,044,400	
九州フィナンシャルグループ	260,900	398.00	103,838,200	
かんぽ生命保険	135,100	2,174.00	293,707,400	
ゆうちょ銀行	317,000	986.00	312,562,000	
あんしん保証	5,400	302.00	1,630,800	
富山第一銀行	31,600	327.00	10,333,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	732,500	480.00	351,600,000	
ジェイリース	4,500	1,388.00	6,246,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	78,900	790.00	62,331,000	
イントラスト	5,700	530.00	3,021,000	
日本モーゲージサービス	7,500	950.00	7,125,000	
C A S A	4,800	810.00	3,888,000	
アルヒ	19,800	996.00	19,720,800	
プレミアグループ	6,800	3,685.00	25,058,000	
日産自動車	1,604,900	519.40	833,585,060	
いすゞ自動車	416,100	1,537.00	639,545,700	
トヨタ自動車	6,664,500	2,245.00	14,961,802,500	
日野自動車	169,900	687.00	116,721,300	
三菱自動車工業	503,500	340.00	171,190,000	
エフテック	9,300	537.00	4,994,100	
レシップホールディングス	5,100	565.00	2,881,500	
G M B	2,500	724.00	1,810,000	
ファルテック	2,500	632.00	1,580,000	
武蔵精密工業	30,300	1,337.00	40,511,100	
日産車体	20,000	579.00	11,580,000	
新明和工業	37,400	914.00	34,183,600	
極東開発工業	24,100	1,334.00	32,149,400	
トビー工業	10,900	1,020.00	11,118,000	
ティラド	3,300	2,270.00	7,491,000	
曙ブレーキ工業	74,700	153.00	11,429,100	
タチエス	23,400	1,031.00	24,125,400	
N O K	60,900	1,122.00	68,329,800	

フタバ産業	32,800	386.00	12,660,800
K Y B	13,400	2,914.00	39,047,600
市光工業	16,200	373.00	6,042,600
大同メタル工業	26,200	562.00	14,724,400
プレス工業	64,000	396.00	25,344,000
ミクニ	16,900	383.00	6,472,700
太平洋工業	27,600	993.00	27,406,800
河西工業	16,800	273.00	4,586,400
アイシン	99,600	3,780.00	376,488,000
マツダ	418,200	967.00	404,399,400
今仙電機製作所	9,000	584.00	5,256,000
本田技研工業	1,046,100	3,394.00	3,550,463,400
スズキ	297,400	3,946.00	1,173,540,400
S U B A R U	379,200	1,997.50	757,452,000
安永	6,200	687.00	4,259,400
ヤマハ発動機	177,600	2,765.00	491,064,000
小糸製作所	72,500	4,570.00	331,325,000
T B K	15,000	343.00	5,145,000
エクセディ	20,500	1,682.00	34,481,000
ミツバ	23,800	351.00	8,353,800
豊田合成	42,100	1,896.00	79,821,600
愛三工業	21,300	755.00	16,081,500
盟和産業	1,500	1,035.00	1,552,500
日本プラスト	10,600	495.00	5,247,000
ヨロズ	12,100	755.00	9,135,500
エフ・シー・シー	22,200	1,342.00	29,792,400
新家工業	3,200	1,562.00	4,998,400
シマノ	53,100	22,965.00	1,219,441,500
テイ・エス テック	57,400	1,376.00	78,982,400
三十三フィナンシャルグループ	12,000	1,445.00	17,340,000
第四北越フィナンシャルグループ	20,900	2,530.00	52,877,000
ひろぎんホールディングス	189,200	633.00	119,763,600
マーキュリアホールディングス	6,000	571.00	3,426,000
おきなわフィナンシャルグループ	11,900	2,219.00	26,406,100
ダイレクトマーケティングミックス	14,500	1,609.00	23,330,500
ポピンズ	3,000	1,937.00	5,811,000
L I T A L I C O	10,500	2,427.00	25,483,500
十六フィナンシャルグループ	17,200	2,221.00	38,201,200
北國フィナンシャルホールディングス	12,100	4,325.00	52,332,500
ネットプロテクションズホールディングス	40,700	606.00	24,664,200
プロクレアホールディングス	14,100	1,820.00	25,662,000
ジャムコ	7,900	779.00	6,154,100
小野建	12,600	1,535.00	19,341,000
はるやまホールディングス	6,500	455.00	2,957,500
南陽	2,700	1,825.00	4,927,500
ノジマ	21,700	2,998.00	65,056,600
佐鳥電機	8,400	1,290.00	10,836,000
カップ・クリエイト	18,800	1,320.00	24,816,000
エコートレーディング	2,600	579.00	1,505,400

伯東	8,200	2,887.00	23,673,400
コンドーテック	10,100	1,079.00	10,897,900
中山福	7,200	344.00	2,476,800
ライトオン	10,100	708.00	7,150,800
ナガイレーベン	17,200	1,925.00	33,110,000
三菱食品	12,900	3,260.00	42,054,000
良品計画	154,200	1,187.00	183,035,400
パリミキホールディングス	17,100	263.00	4,497,300
松田産業	9,800	2,283.00	22,373,400
第一興商	25,400	3,580.00	90,932,000
メディバルホールディングス	137,800	2,222.00	306,191,600
アドヴァングループ	12,900	780.00	10,062,000
S P K	5,400	1,295.00	6,993,000
萩原電気ホールディングス	4,900	1,916.00	9,388,400
アルビス	4,200	2,227.00	9,353,400
アズワン	19,200	6,480.00	124,416,000
スズデン	4,500	2,127.00	9,571,500
尾家産業	2,800	892.00	2,497,600
シモジマ	8,300	920.00	7,636,000
ドウシシャ	12,600	1,566.00	19,731,600
小津産業	3,000	2,000.00	6,000,000
コナカ	15,400	336.00	5,174,400
高速	7,800	1,489.00	11,614,200
ハウス オブ ローゼ	1,800	1,664.00	2,995,200
G - 7ホールディングス	14,900	1,526.00	22,737,400
たけびし	4,900	1,446.00	7,085,400
イオン北海道	21,700	1,005.00	21,808,500
コジマ	23,000	608.00	13,984,000
ヒマラヤ	4,500	910.00	4,095,000
コーナン商事	19,000	3,655.00	69,445,000
ネットワンシステムズ	49,300	3,000.00	147,900,000
エコス	4,800	1,976.00	9,484,800
ワタミ	16,200	904.00	14,644,800
マルシェ	4,500	471.00	2,119,500
リックス	3,000	1,603.00	4,809,000
システムソフト	32,200	97.00	3,123,400
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	268,000	2,007.00	537,876,000
丸文	11,500	687.00	7,900,500
西松屋チェーン	28,400	1,531.00	43,480,400
ゼンショーホールディングス	65,400	2,974.00	194,499,600
ハビネット	10,800	1,505.00	16,254,000
幸楽苑ホールディングス	8,200	1,242.00	10,184,400
ハークスレイ	5,800	466.00	2,702,800
橋本総業ホールディングス	2,600	1,980.00	5,148,000
日本ライフライン	39,700	1,048.00	41,605,600
サイゼリヤ	19,900	2,350.00	46,765,000
タカショー	10,200	695.00	7,089,000
V Tホールディングス	50,400	463.00	23,335,200
アルゴグラフィックス	10,400	3,070.00	31,928,000

魚力	3,500	2,188.00	7,658,000	
I D O M	40,600	655.00	26,593,000	
日本エム・ディ・エム	7,900	1,505.00	11,889,500	
ポブラ	3,700	138.00	510,600	
フジ・コーポレーション	7,100	1,121.00	7,959,100	
ユナイテッドアローズ	14,000	1,852.00	25,928,000	
進和	8,000	2,003.00	16,024,000	
エスケイジャパン	3,100	427.00	1,323,700	
ダイトロン	5,500	1,878.00	10,329,000	
ハイデイ日高	19,400	1,903.00	36,918,200	
シークス	18,400	1,003.00	18,455,200	
Y U - W A C R E A T I O N H O L D I N G S	7,800	199.00	1,552,200	
コロワイド	55,100	1,649.00	90,859,900	
ピーシーデポコーポレーション	15,600	309.00	4,820,400	
田中商事	3,100	602.00	1,866,200	
オーハシテクニカ	7,100	1,275.00	9,052,500	
壱番屋	9,500	4,805.00	45,647,500	
白銅	4,300	2,446.00	10,517,800	
トップカルチャー	5,000	282.00	1,410,000	
P L A N T	3,400	671.00	2,281,400	
スギホールディングス	26,800	5,250.00	140,700,000	
ダイコー通産	1,500	1,305.00	1,957,500	
薬王堂ホールディングス	6,700	1,829.00	12,254,300	
島津製作所	171,000	4,350.00	743,850,000	
J M S	11,200	576.00	6,451,200	
クボテック	3,100	256.00	793,600	
長野計器	9,600	1,112.00	10,675,200	
ブイ・テクノロジー	5,900	3,030.00	17,877,000	
スター精密	19,600	1,475.00	28,910,000	
東京計器	8,700	1,185.00	10,309,500	
愛知時計電機	5,600	1,477.00	8,271,200	
インターアクション	6,800	1,899.00	12,913,200	
オーバル	12,300	311.00	3,825,300	
東京精密	22,400	4,365.00	97,776,000	
マニー	52,700	1,427.00	75,202,900	
ニコン	202,500	1,479.00	299,497,500	
トプコン	64,000	1,629.00	104,256,000	
オリンパス	695,500	2,246.50	1,562,440,750	
理研計器	10,300	3,780.00	38,934,000	
S C R E E Nホールディングス	22,900	10,530.00	241,137,000	
キヤノン電子	12,500	1,484.00	18,550,000	
タムロン	10,200	2,400.00	24,480,000	
H O Y A	265,500	12,625.00	3,351,937,500	
シード	6,500	523.00	3,399,500	
ノーリツ鋼機	12,200	2,120.00	25,864,000	
A & Dホロンホールディングス	15,300	853.00	13,050,900	
朝日インテック	149,200	2,405.00	358,826,000	
キヤノン	676,300	3,047.00	2,060,686,100	
リコー	359,800	992.00	356,921,600	

シチズン時計	150,500	490.00	73,745,000
リズム	4,300	1,789.00	7,692,700
大研医器	11,000	509.00	5,599,000
メニコン	44,100	2,598.00	114,571,800
シンシア	1,500	437.00	655,500
中本パックス	3,800	1,569.00	5,962,200
スノーピーク	17,700	2,193.00	38,816,100
パラマウントベッドホールディングス	26,100	2,135.00	55,723,500
トランザクション	7,900	971.00	7,670,900
粧美堂	4,300	412.00	1,771,600
ニホンフラッシュ	11,300	955.00	10,791,500
前田工織	14,100	2,604.00	36,716,400
永大産業	17,200	273.00	4,695,600
アートネイチャー	11,700	742.00	8,681,400
バンダイナムコホールディングス	118,800	8,534.00	1,013,839,200
アイフィスジャパン	3,700	634.00	2,345,800
共立印刷	21,800	134.00	2,921,200
SHOEI	12,500	4,765.00	59,562,500
フランスベッドホールディングス	17,600	876.00	15,417,600
マーベラス	21,000	765.00	16,065,000
パイロットコーポレーション	21,800	5,120.00	111,616,000
萩原工業	8,600	1,068.00	9,184,800
エイベックス	23,000	1,398.00	32,154,000
フジシールインターナショナル	31,300	1,735.00	54,305,500
タカラトミー	56,200	1,195.00	67,159,000
広済堂ホールディングス	8,400	786.00	6,602,400
エステールホールディングス	3,400	636.00	2,162,400
レック	17,200	867.00	14,912,400
タカノ	4,800	804.00	3,859,200
三光合成	15,600	339.00	5,288,400
プロネクサス	10,600	1,046.00	11,087,600
ホクシン	9,600	177.00	1,699,200
ウッドワン	4,200	1,295.00	5,439,000
大建工業	7,600	2,094.00	15,914,400
きもと	21,200	212.00	4,494,400
凸版印刷	197,000	2,173.00	428,081,000
大日本印刷	156,400	2,747.00	429,630,800
共同印刷	3,800	2,743.00	10,423,400
N I S S H A	26,500	1,513.00	40,094,500
光村印刷	700	1,305.00	913,500
藤森工業	11,700	3,555.00	41,593,500
ヴィア・ホールディングス	17,400	149.00	2,592,600
TAKARA & COMPANY	8,200	1,910.00	15,662,000
前澤化成工業	8,500	1,292.00	10,982,000
未来工業	5,000	1,469.00	7,345,000
アシックス	115,000	1,873.00	215,395,000
ツツミ	3,400	1,935.00	6,579,000
ウェーブロックホールディングス	5,200	682.00	3,546,400
J S P	8,000	1,471.00	11,768,000
ニチハ	18,400	2,319.00	42,669,600

ローランド	9,500	4,320.00	41,040,000
エフピコ	25,000	2,701.00	67,525,000
小松ウオール工業	4,200	1,846.00	7,753,200
ヤマハ	79,100	4,935.00	390,358,500
河合楽器製作所	3,700	2,908.00	10,759,600
クリナップ	12,700	524.00	6,654,800
ピジョン	82,200	2,088.00	171,633,600
天馬	10,700	2,277.00	24,363,900
兼松サステック	700	1,743.00	1,220,100
キングジム	11,600	926.00	10,741,600
象印マホービン	35,800	1,334.00	47,757,200
リンテック	28,100	2,458.00	69,069,800
信越ポリマー	24,400	1,037.00	25,302,800
東リ	33,700	214.00	7,211,800
イトーキ	25,300	357.00	9,032,100
任天堂	76,800	56,220.00	4,317,696,000
三菱鉛筆	21,100	1,325.00	27,957,500
松風	5,300	1,577.00	8,358,100
タカラスタANDARD	26,000	1,298.00	33,748,000
コクヨ	63,400	1,733.00	109,872,200
ナカバヤシ	12,200	488.00	5,953,600
ニフコ	45,400	2,715.00	123,261,000
立川ブラインド工業	5,800	1,056.00	6,124,800
グローブライド	11,500	2,448.00	28,152,000
オカムラ	43,900	1,198.00	52,592,200
バルカー	11,000	2,623.00	28,853,000
MUTOHホールディングス	1,000	2,247.00	2,247,000
伊藤忠商事	892,900	3,877.00	3,461,773,300
丸紅	1,273,300	1,349.50	1,718,318,350
スクロール	20,600	857.00	17,654,200
高島	1,900	2,280.00	4,332,000
ヨンドシーホールディングス	12,000	1,703.00	20,436,000
三陽商会	6,200	814.00	5,046,800
長瀬産業	68,100	1,904.00	129,662,400
ナイガイ	3,700	306.00	1,132,200
蝶理	7,500	1,936.00	14,520,000
豊田通商	129,700	4,525.00	586,892,500
オンワードホールディングス	77,700	247.00	19,191,900
三共生興	17,300	546.00	9,445,800
兼松	48,700	1,349.00	65,696,300
美津濃	12,700	2,099.00	26,657,300
ツカモトコーポレーション	1,700	1,213.00	2,062,100
ルックホールディングス	4,300	1,549.00	6,660,700
三井物産	1,017,900	3,308.00	3,367,213,200
日本紙パルプ商事	6,800	3,810.00	25,908,000
東京エレクトロン	86,400	54,210.00	4,683,744,000
カメイ	15,400	1,045.00	16,093,000
東都水産	700	4,440.00	3,108,000
OUGホールディングス	2,000	2,651.00	5,302,000
スターゼン	9,700	1,974.00	19,147,800

セイコーホールディングス	19,200	2,157.00	41,414,400	
山善	53,600	969.00	51,938,400	
椿本興業	2,600	3,660.00	9,516,000	
住友商事	828,500	2,051.00	1,699,253,500	
B I P R O G Y	41,700	2,881.00	120,137,700	
内田洋行	5,600	4,870.00	27,272,000	
三菱商事	962,600	4,341.00	4,178,646,600	
第一実業	5,800	3,605.00	20,909,000	
キヤノンマーケティングジャパン	33,300	3,060.00	101,898,000	
西華産業	6,500	1,617.00	10,510,500	
佐藤商事	10,500	1,148.00	12,054,000	
菱洋エレクトロ	7,900	2,081.00	16,439,900	
東京産業	11,800	706.00	8,330,800	
ユアサ商事	12,000	2,922.00	35,064,000	
神鋼商事	3,000	3,695.00	11,085,000	
トルク	5,400	202.00	1,090,800	
阪和興業	25,600	3,175.00	81,280,000	
正栄食品工業	8,700	3,920.00	34,104,000	
カナデン	10,900	926.00	10,093,400	
菱電商事	10,600	1,690.00	17,914,000	
ニプロ	99,000	1,010.00	99,990,000	
岩谷産業	31,300	5,170.00	161,821,000	
ナイス	4,500	1,818.00	8,181,000	
ニチモウ	1,800	2,548.00	4,586,400	
極東貿易	3,900	2,232.00	8,704,800	
アステナホールディングス	18,300	436.00	7,978,800	
兼松エレクトロニクス	7,300	3,790.00	27,667,000	
三愛オブリ	32,000	954.00	30,528,000	
稲畑産業	28,200	2,170.00	61,194,000	
G S I クレオス	6,400	1,222.00	7,820,800	
明和産業	12,400	737.00	9,138,800	
クワザワホールディングス	5,400	496.00	2,678,400	
キムラタン	76,400	21.00	1,604,400	
ゴールドウイン	23,400	6,360.00	148,824,000	
ユニ・チャーム	262,300	4,220.00	1,106,906,000	
デザート	24,900	2,302.00	57,319,800	
キング	6,500	515.00	3,347,500	
ワキタ	27,100	1,081.00	29,295,100	
ヤマトインターナショナル	11,500	285.00	3,277,500	
東邦ホールディングス	40,800	2,138.00	87,230,400	
サンゲツ	34,200	1,558.00	53,283,600	
ミツウロコグループホールディングス	18,000	995.00	17,910,000	
シナネンホールディングス	4,800	3,295.00	15,816,000	
伊藤忠エネクス	29,700	1,088.00	32,313,600	
サンリオ	40,100	2,680.00	107,468,000	
サンワ テクノス	7,700	1,353.00	10,418,100	
リョーサン	14,400	2,413.00	34,747,200	
新光商事	19,300	949.00	18,315,700	
トーヨー	5,800	1,100.00	6,380,000	
三信電気	6,000	1,518.00	9,108,000	

東陽テクニカ	13,300	1,036.00	13,778,800
モスフードサービス	17,600	2,998.00	52,764,800
加賀電子	11,700	3,075.00	35,977,500
三益半導体工業	10,500	2,294.00	24,087,000
都築電気	6,600	1,477.00	9,748,200
ソーダニッカ	12,500	653.00	8,162,500
立花エレテック	9,800	1,626.00	15,934,800
木曽路	18,100	2,077.00	37,593,700
S R Sホールディングス	19,100	816.00	15,585,600
千趣会	24,400	397.00	9,686,800
タカキュー	10,800	105.00	1,134,000
リテールパートナーズ	20,400	1,118.00	22,807,200
ケーヨー	24,800	973.00	24,130,400
上新電機	14,600	1,898.00	27,710,800
日本瓦斯	65,100	1,856.00	120,825,600
ロイヤルホールディングス	23,500	2,075.00	48,762,500
東天紅	700	922.00	645,400
いなげや	15,500	1,321.00	20,475,500
チヨダ	12,500	698.00	8,725,000
ライフコーポレーション	11,800	2,860.00	33,748,000
リンガーハット	16,200	2,182.00	35,348,400
M r M a x H D	16,800	606.00	10,180,800
テンアライド	13,500	310.00	4,185,000
A O K Iホールディングス	25,900	631.00	16,342,900
オークワ	20,400	874.00	17,829,600
コメリ	20,700	2,778.00	57,504,600
青山商事	26,900	678.00	18,238,200
しまむら	15,600	11,590.00	180,804,000
はせがわ	7,300	266.00	1,941,800
高島屋	95,100	1,236.00	117,543,600
松屋	25,500	776.00	19,788,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	61,700	883.00	54,481,100
近鉄百貨店	4,700	2,524.00	11,862,800
丸井グループ	102,900	2,287.00	235,332,300
クレディセゾン	83,600	1,540.00	128,744,000
アクシアル リテイリング	9,900	3,145.00	31,135,500
井筒屋	6,300	298.00	1,877,400
イオン	491,200	2,389.00	1,173,476,800
イズミ	23,200	2,763.00	64,101,600
フォーバル	5,600	811.00	4,541,600
平和堂	23,900	1,963.00	46,915,700
フジ	34,300	2,326.00	79,781,800
ヤオコー	15,200	6,810.00	103,512,000
ゼビオホールディングス	18,200	915.00	16,653,000
ケーズホールディングス	120,400	1,363.00	164,105,200
P A L T A C	18,800	4,610.00	86,668,000
三谷産業	21,000	317.00	6,657,000
O l y m p i cグループ	6,700	643.00	4,308,100
日産東京販売ホールディングス	20,100	224.00	4,502,400
新生銀行	87,600	2,301.00	201,567,600

あおぞら銀行	74,900	2,647.00	198,260,300
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,231,700	762.90	6,279,963,930
りそなホールディングス	1,487,900	553.60	823,701,440
三井住友トラスト・ホールディングス	243,100	4,121.00	1,001,815,100
三井住友フィナンシャルグループ	909,800	3,935.00	3,580,063,000
千葉銀行	425,000	753.00	320,025,000
群馬銀行	239,700	375.00	89,887,500
武蔵野銀行	19,000	1,781.00	33,839,000
千葉興業銀行	30,700	269.00	8,258,300
筑波銀行	52,200	199.00	10,387,800
七十七銀行	40,000	1,698.00	67,920,000
秋田銀行	8,500	1,691.00	14,373,500
山形銀行	13,700	874.00	11,973,800
岩手銀行	8,600	1,948.00	16,752,800
東邦銀行	106,300	203.00	21,578,900
東北銀行	6,400	998.00	6,387,200
ふくおかフィナンシャルグループ	107,700	2,376.00	255,895,200
静岡銀行	310,100	852.00	264,205,200
スルガ銀行	117,600	416.00	48,921,600
八十二銀行	288,000	453.00	130,464,000
山梨中央銀行	14,300	1,001.00	14,314,300
大垣共立銀行	25,300	1,905.00	48,196,500
福井銀行	11,300	1,349.00	15,243,700
清水銀行	5,400	1,503.00	8,116,200
富山銀行	2,100	1,946.00	4,086,600
滋賀銀行	24,100	2,492.00	60,057,200
南都銀行	20,000	2,039.00	40,780,000
百五銀行	123,500	342.00	42,237,000
京都銀行	45,900	5,640.00	258,876,000
紀陽銀行	43,500	1,419.00	61,726,500
ほくほくフィナンシャルグループ	79,700	885.00	70,534,500
山陰合同銀行	77,900	655.00	51,024,500
中国銀行	104,500	959.00	100,215,500
鳥取銀行	4,400	1,194.00	5,253,600
伊予銀行	168,600	631.00	106,386,600
百十四銀行	13,600	1,710.00	23,256,000
四国銀行	19,600	803.00	15,738,800
阿波銀行	19,600	2,146.00	42,061,600
大分銀行	7,500	1,893.00	14,197,500
宮崎銀行	8,000	2,086.00	16,688,000
佐賀銀行	7,500	1,454.00	10,905,000
琉球銀行	29,200	822.00	24,002,400
セブン銀行	398,300	246.00	97,981,800
みずほフィナンシャルグループ	1,681,000	1,592.50	2,676,992,500
高知銀行	4,700	735.00	3,454,500
山口フィナンシャルグループ	148,800	734.00	109,219,200
芙蓉総合リース	13,200	7,120.00	93,984,000
みずほリース	19,300	3,035.00	58,575,500
東京センチュリー	24,300	4,130.00	100,359,000
SBIホールディングス	165,700	2,891.00	479,038,700

日本証券金融	52,800	942.00	49,737,600
アイフル	225,100	380.00	85,538,000
日本アジア投資	10,500	235.00	2,467,500
長野銀行	4,300	1,307.00	5,620,100
名古屋銀行	9,200	3,120.00	28,704,000
北洋銀行	191,000	242.00	46,222,000
愛知銀行	4,600	4,760.00	21,896,000
中京銀行	4,600	1,696.00	7,801,600
大光銀行	4,400	1,274.00	5,605,600
愛媛銀行	18,400	930.00	17,112,000
トマト銀行	4,700	1,016.00	4,775,200
京葉銀行	55,800	502.00	28,011,600
栃木銀行	63,400	251.00	15,913,400
北日本銀行	4,100	1,555.00	6,375,500
東和銀行	23,100	539.00	12,450,900
福島銀行	14,900	217.00	3,233,300
大東銀行	6,400	654.00	4,185,600
リコーリース	11,900	3,410.00	40,579,000
イオンフィナンシャルサービス	73,000	1,203.00	87,819,000
アコム	264,700	343.00	90,792,100
ジャックス	14,300	3,260.00	46,618,000
オリエン特コーポレーション	362,900	124.00	44,999,600
オリックス	797,500	2,363.50	1,884,891,250
三菱HCキャピタル	475,200	587.00	278,942,400
ジャフコグループ	51,300	1,524.00	78,181,200
九州リースサービス	6,600	575.00	3,795,000
トモニホールディングス	101,400	330.00	33,462,000
大和証券グループ本社	981,400	627.70	616,024,780
野村ホールディングス	2,049,200	491.70	1,007,591,640
岡三証券グループ	102,800	351.00	36,082,800
丸三証券	39,800	510.00	20,298,000
東洋証券	43,100	179.00	7,714,900
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	146,700	383.00	56,186,100
光世証券	2,600	468.00	1,216,800
水戸証券	35,100	260.00	9,126,000
いちよし証券	24,500	563.00	13,793,500
松井証券	65,700	810.00	53,217,000
SOMPOホールディングス	210,600	5,315.00	1,119,339,000
日本取引所グループ	327,600	1,891.00	619,491,600
マネックスグループ	110,600	550.00	60,830,000
極東証券	17,200	696.00	11,971,200
岩井コスモホールディングス	12,700	1,226.00	15,570,200
アイザワ証券グループ	20,800	642.00	13,353,600
フィデアホールディングス	12,300	1,302.00	16,014,600
池田泉州ホールディングス	149,800	190.00	28,462,000
アニコムホールディングス	41,200	630.00	25,956,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	292,700	3,935.00	1,151,774,500
マネーパートナーズグループ	14,400	241.00	3,470,400

スパークス・グループ	62,000	254.00	15,748,000
小林洋行	2,800	225.00	630,000
第一生命ホールディングス	624,500	2,658.00	1,659,921,000
東京海上ホールディングス	411,800	7,009.00	2,886,306,200
アドバンテッジリスクマネジメント	6,600	477.00	3,148,200
イー・ギャランティ	19,800	2,054.00	40,669,200
アサックス	7,300	582.00	4,248,600
NECキャピタルソリューション	5,500	1,960.00	10,780,000
T&Dホールディングス	331,800	1,699.00	563,728,200
アドバンスクリエイト	6,500	921.00	5,986,500
三井不動産	581,100	2,733.00	1,588,146,300
三菱地所	842,700	1,846.00	1,555,624,200
平和不動産	22,500	3,965.00	89,212,500
東京建物	126,600	1,809.00	229,019,400
京阪神ビルディング	19,700	1,340.00	26,398,000
住友不動産	268,200	3,375.00	905,175,000
太平洋興発	5,100	638.00	3,253,800
テオオーシー	22,900	672.00	15,388,800
東京楽天地	2,100	3,955.00	8,305,500
レオパレス21	139,100	189.00	26,289,900
スターツコーポレーション	18,300	2,376.00	43,480,800
フジ住宅	15,700	617.00	9,686,900
空港施設	13,700	550.00	7,535,000
明和地所	6,400	596.00	3,814,400
ゴールドクレスト	10,600	1,698.00	17,998,800
リログループ	71,100	1,873.00	133,170,300
エスリード	5,300	1,669.00	8,845,700
日神グループホールディングス	22,000	449.00	9,878,000
日本エスコン	25,000	746.00	18,650,000
タカラレーベン	56,600	295.00	16,697,000
A V A N T I A	6,800	845.00	5,746,000
イオンモール	67,300	1,558.00	104,853,400
毎日コムネット	4,700	700.00	3,290,000
ファースト住建	5,000	1,104.00	5,520,000
ランド	730,800	11.00	8,038,800
カチタス	33,200	2,959.00	98,238,800
東祥	9,700	1,628.00	15,791,600
トーセイ	18,500	1,116.00	20,646,000
穴吹興産	3,000	2,246.00	6,738,000
サンフロンティア不動産	18,500	1,076.00	19,906,000
FJネクストホールディングス	13,200	1,006.00	13,279,200
インテリックス	3,100	639.00	1,980,900
ランドビジネス	5,400	237.00	1,279,800
サンネクスタグループ	4,400	1,159.00	5,099,600
グランディハウス	9,300	530.00	4,929,000
東武鉄道	130,000	2,983.00	387,790,000
相鉄ホールディングス	42,500	2,251.00	95,667,500
東急	334,500	1,596.00	533,862,000
京浜急行電鉄	167,000	1,309.00	218,603,000
小田急電鉄	192,000	1,896.00	364,032,000

京王電鉄	67,000	4,770.00	319,590,000
京成電鉄	89,800	3,270.00	293,646,000
富士急行	15,500	3,875.00	60,062,500
新京成電鉄	3,200	2,686.00	8,595,200
東日本旅客鉄道	228,900	6,756.00	1,546,448,400
西日本旅客鉄道	158,100	4,868.00	769,630,800
東海旅客鉄道	107,400	16,540.00	1,776,396,000
西武ホールディングス	173,100	1,321.00	228,665,100
鴻池運輸	20,900	1,154.00	24,118,600
西日本鉄道	36,100	2,595.00	93,679,500
ハマキョウレックス	9,400	2,947.00	27,701,800
サカイ引越センター	6,300	4,650.00	29,295,000
近鉄グループホールディングス	126,200	3,735.00	471,357,000
阪急阪神ホールディングス	157,600	3,460.00	545,296,000
南海電気鉄道	56,300	2,457.00	138,329,100
京阪ホールディングス	55,000	2,918.00	160,490,000
神戸電鉄	3,100	3,235.00	10,028,500
名古屋鉄道	135,800	2,169.00	294,550,200
山陽電気鉄道	9,700	2,071.00	20,088,700
アルプス物流	9,100	1,081.00	9,837,100
トランコム	3,600	6,980.00	25,128,000
ヤマトホールディングス	180,600	2,445.00	441,567,000
山九	33,100	3,980.00	131,738,000
日新	10,000	1,592.00	15,920,000
丸運	7,500	241.00	1,807,500
丸全昭和運輸	9,900	3,245.00	32,125,500
センコーグループホールディングス	64,200	890.00	57,138,000
トナミホールディングス	2,900	3,565.00	10,338,500
ニッコンホールディングス	42,300	1,989.00	84,134,700
日本石油輸送	900	2,564.00	2,307,600
福山通運	19,600	3,730.00	73,108,000
セイノーホールディングス	81,900	1,081.00	88,533,900
エスライン	4,000	874.00	3,496,000
神奈川中央交通	3,200	3,300.00	10,560,000
日立物流	24,900	8,560.00	213,144,000
丸和運輸機関	25,400	1,501.00	38,125,400
C & F ロジホールディングス	12,300	1,129.00	13,886,700
日本郵船	107,800	9,720.00	1,047,816,000
商船三井	209,000	3,300.00	689,700,000
川崎汽船	39,700	7,720.00	306,484,000
NSユナイテッド海運	6,800	3,910.00	26,588,000
明治海運	14,200	742.00	10,536,400
飯野海運	56,800	743.00	42,202,400
共栄タンカー	2,300	1,175.00	2,702,500
九州旅客鉄道	95,200	2,570.00	244,664,000
SGホールディングス	234,500	2,342.00	549,199,000
NIPPON EXPRESSホールディングス	42,500	7,810.00	331,925,000
日本航空	289,300	2,192.00	634,145,600
ANAホールディングス	320,600	2,455.00	787,073,000

ビーウィズ	3,500	1,452.00	5,082,000
パスコ	2,500	1,317.00	3,292,500
TREホールディングス	20,000	2,122.00	42,440,000
人・夢・技術グループ	5,200	2,206.00	11,471,200
西本Wismettacホールディングス	3,000	2,625.00	7,875,000
シルバーライフ	2,700	1,377.00	3,717,900
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	2,055.00	2,055,000
Genky DrugStores	5,900	3,100.00	18,290,000
コア商事ホールディングス	8,400	864.00	7,257,600
国際紙パルプ商事	26,900	295.00	7,935,500
ナルミヤ・インターナショナル	3,000	856.00	2,568,000
ブックオフグループホールディングス	7,800	1,024.00	7,987,200
ギフトホールディングス	2,100	2,142.00	4,498,200
三菱倉庫	38,400	3,140.00	120,576,000
三井倉庫ホールディングス	13,300	2,441.00	32,465,300
住友倉庫	42,500	2,043.00	86,827,500
澁澤倉庫	7,300	2,256.00	16,468,800
ヤマタネ	6,200	1,681.00	10,422,200
東陽倉庫	21,000	301.00	6,321,000
乾汽船	8,400	1,645.00	13,818,000
日本トランスシティ	26,600	605.00	16,093,000
ケイヒン	2,300	1,371.00	3,153,300
中央倉庫	7,600	949.00	7,212,400
川西倉庫	2,500	1,139.00	2,847,500
安田倉庫	10,100	984.00	9,938,400
ファイズホールディングス	2,800	700.00	1,960,000
東洋埠頭	2,800	1,431.00	4,006,800
上組	68,300	2,227.00	152,104,100
サンリツ	3,600	784.00	2,822,400
キムラユニティー	3,500	1,468.00	5,138,000
キューソー流通システム	6,500	1,078.00	7,007,000
近鉄エクスプレス	24,400	3,095.00	75,518,000
東海運	7,700	297.00	2,286,900
エーアイティー	8,100	1,553.00	12,579,300
内外トランスライン	5,000	1,910.00	9,550,000
ショーエイコーポレーション	3,700	585.00	2,164,500
日本コンセプト	4,100	1,341.00	5,498,100
TBSホールディングス	74,900	1,751.00	131,149,900
日本テレビホールディングス	111,500	1,269.00	141,493,500
朝日放送グループホールディングス	12,400	705.00	8,742,000
テレビ朝日ホールディングス	32,100	1,495.00	47,989,500
スカパーJ SATホールディングス	113,200	457.00	51,732,400
テレビ東京ホールディングス	9,000	1,994.00	17,946,000
日本BS放送	4,600	1,020.00	4,692,000
ビジョン	22,200	1,314.00	29,170,800
スマートバリュー	3,100	552.00	1,711,200
USEN-NEXT HOLDINGS	11,800	2,083.00	24,579,400
ワイヤレスゲート	5,500	297.00	1,633,500

コネクシオ	9,500	1,457.00	13,841,500	
日本通信	110,900	172.00	19,074,800	
クロップス	2,500	986.00	2,465,000	
日本電信電話	1,430,200	3,842.00	5,494,828,400	
KDDI	973,600	4,318.00	4,204,004,800	
ソフトバンク	2,022,700	1,508.00	3,050,231,600	
光通信	15,400	15,040.00	231,616,000	
エムティーアイ	12,100	446.00	5,396,600	
GMOインターネット	46,800	2,425.00	113,490,000	
ファイバーゲート	6,100	1,186.00	7,234,600	
アイドママーケティングコミュニケーション	3,100	290.00	899,000	
KADOKAWA	72,600	3,135.00	227,601,000	
学研ホールディングス	18,800	866.00	16,280,800	
ゼンリン	21,700	917.00	19,898,900	
昭文社ホールディングス	4,100	399.00	1,635,900	
インプレスホールディングス	11,200	225.00	2,520,000	
東京電力ホールディングス	1,018,300	525.00	534,607,500	
中部電力	405,700	1,324.00	537,146,800	
関西電力	502,500	1,252.00	629,130,000	
中国電力	207,200	893.00	185,029,600	
北陸電力	121,500	539.00	65,488,500	
東北電力	311,500	748.00	233,002,000	
四国電力	119,400	784.00	93,609,600	
九州電力	273,800	867.00	237,384,600	
北海道電力	118,200	520.00	61,464,000	
沖縄電力	28,900	1,226.00	35,431,400	
電源開発	110,900	1,852.00	205,386,800	
エフオン	8,200	532.00	4,362,400	
イーレックス	19,200	1,870.00	35,904,000	
レノバ	26,700	1,584.00	42,292,800	
東京瓦斯	254,700	2,507.00	638,532,900	
大阪瓦斯	240,600	2,403.00	578,161,800	
東邦瓦斯	59,300	3,000.00	177,900,000	
北海道瓦斯	6,800	1,556.00	10,580,800	
広島ガス	25,700	329.00	8,455,300	
西部ガスホールディングス	14,500	2,048.00	29,696,000	
静岡ガス	34,300	893.00	30,629,900	
メタウォーター	14,200	2,043.00	29,010,600	
アイネット	6,700	1,226.00	8,214,200	
松竹	8,400	12,920.00	108,528,000	
東宝	78,800	4,875.00	384,150,000	
エイチ・アイ・エス	28,200	2,108.00	59,445,600	
東映	4,200	17,100.00	71,820,000	
ラックランド	3,900	2,950.00	11,505,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	355,600	2,440.00	867,664,000	
共立メンテナンス	23,200	4,775.00	110,780,000	
イチネンホールディングス	13,400	1,226.00	16,428,400	
建設技術研究所	7,400	2,299.00	17,012,600	
スペース	9,100	917.00	8,344,700	

アインホールディングス	17,500	5,510.00	96,425,000	
燦ホールディングス	5,700	1,572.00	8,960,400	
ピー・シー・エー	7,800	1,287.00	10,038,600	
スバル興業	700	8,420.00	5,894,000	
東京テアトル	5,200	1,217.00	6,328,400	
タナベ経営	4,400	654.00	2,877,600	
ビジネスブレイン太田昭和	3,900	1,487.00	5,799,300	
ナガワ	4,000	9,010.00	36,040,000	
東京都競馬	9,700	3,880.00	37,636,000	
常磐興産	5,000	1,250.00	6,250,000	
カナモト	22,300	1,946.00	43,395,800	
D T S	24,900	3,015.00	75,073,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	62,100	5,320.00	330,372,000	
シーイーシー	14,300	1,209.00	17,288,700	
カブコン	125,900	3,385.00	426,171,500	
西尾レントオール	11,600	2,791.00	32,375,600	
アイ・エス・ビー	6,200	998.00	6,187,600	
アゴーラ ホスピタリティグループ	73,700	23.00	1,695,100	
日本空港ビルデング	48,500	5,460.00	264,810,000	
トランス・コスモス	16,500	3,175.00	52,387,500	
乃村工藝社	55,700	864.00	48,124,800	
ジャステック	7,800	1,136.00	8,860,800	
S C S K	92,500	2,126.00	196,655,000	
藤田観光	5,700	2,325.00	13,252,500	
K N T - C Tホールディングス	8,100	1,483.00	12,012,300	
日本管財	14,000	2,787.00	39,018,000	
トーカイ	11,000	1,748.00	19,228,000	
白洋舎	1,500	1,230.00	1,845,000	
セコム	128,100	9,134.00	1,170,065,400	
日本システムウエア	5,100	2,281.00	11,633,100	
セントラル警備保障	6,300	2,125.00	13,387,500	
アイネス	12,500	1,515.00	18,937,500	
丹青社	25,900	780.00	20,202,000	
メイテック	15,400	6,430.00	99,022,000	
T K C	21,900	3,480.00	76,212,000	
富士ソフト	13,800	6,820.00	94,116,000	
応用地質	13,900	1,920.00	26,688,000	
船井総研ホールディングス	25,900	2,135.00	55,296,500	
N S D	41,900	2,317.00	97,082,300	
進学会ホールディングス	4,400	317.00	1,394,800	
丸紅建材リース	900	1,744.00	1,569,600	
オオバ	8,700	781.00	6,794,700	
コナミホールディングス	48,500	7,610.00	369,085,000	
いであ	3,400	1,763.00	5,994,200	
学究社	4,200	1,592.00	6,686,400	
ベネッセホールディングス	43,300	2,260.00	97,858,000	
イオンディライト	16,000	2,876.00	46,016,000	
ナック	6,500	952.00	6,188,000	

福井コンピュータホールディングス	6,100	3,260.00	19,886,000
ダイセキ	23,700	4,525.00	107,242,500
ステップ	4,800	1,754.00	8,419,200
日鉄物産	9,100	5,230.00	47,593,000
泉州電業	3,600	4,955.00	17,838,000
元気寿司	3,800	2,463.00	9,359,400
トラスコ中山	27,800	1,942.00	53,987,600
ヤマダホールディングス	501,160	471.00	236,046,360
オートバックスセブン	43,900	1,398.00	61,372,200
モリト	9,900	777.00	7,692,300
アークランドサカモト	20,900	1,550.00	32,395,000
ニトリホールディングス	53,200	12,195.00	648,774,000
グルメ杵屋	10,800	1,002.00	10,821,600
愛眼	7,400	197.00	1,457,800
ケーユーホールディングス	7,100	1,068.00	7,582,800
吉野家ホールディングス	46,800	2,386.00	111,664,800
加藤産業	17,700	3,350.00	59,295,000
北恵	3,500	875.00	3,062,500
イノテック	8,100	1,351.00	10,943,100
イエローハット	22,500	1,634.00	36,765,000
松屋フーズホールディングス	6,500	3,750.00	24,375,000
JBCホールディングス	9,100	1,489.00	13,549,900
JKホールディングス	10,400	1,032.00	10,732,800
サガミホールディングス	20,100	1,098.00	22,069,800
日伝	10,500	2,143.00	22,501,500
関西フードマーケット	12,600	1,342.00	16,909,200
ミロク情報サービス	11,800	1,279.00	15,092,200
北沢産業	6,900	211.00	1,455,900
杉本商事	6,300	2,165.00	13,639,500
因幡電機産業	34,900	2,583.00	90,146,700
王将フードサービス	8,900	6,080.00	54,112,000
プレナス	15,000	1,929.00	28,935,000
ミニストップ	10,000	1,414.00	14,140,000
アークス	25,000	2,061.00	51,525,000
パローホールディングス	28,900	2,001.00	57,828,900
東テク	4,300	2,633.00	11,321,900
ミスミグループ本社	168,200	2,848.00	479,033,600
アルテック	8,900	246.00	2,189,400
ベルク	6,000	5,440.00	32,640,000
大庄	7,300	1,031.00	7,526,300
タキヒヨー	3,900	1,053.00	4,106,700
ファーストリテイリング	17,900	57,480.00	1,028,892,000
ソフトバンクグループ	800,800	4,989.00	3,995,191,200
蔵王産業	2,100	1,949.00	4,092,900
スズケン	51,000	3,950.00	201,450,000
サンドラッグ	50,400	2,926.00	147,470,400
サクスパーホールディングス	12,700	514.00	6,527,800
ジェコス	9,300	792.00	7,365,600
ヤマザワ	2,600	1,501.00	3,902,600
やまや	2,800	2,487.00	6,963,600

グローセル	15,400	406.00	6,252,400	
ペルーナ	28,700	717.00	20,577,900	
合計	146,560,760		342,399,039,710	

(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。

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期中間計算期間(2022年5月10日から2022年11月9日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第15期 2022年5月9日現在	第16期中間計算期間末 2022年11月9日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	25,893,278	14,910,773
親投資信託受益証券	22,105,565,725	13,603,845,878
未収入金	-	4,598,000
流動資産合計	22,131,459,003	13,623,354,651
資産合計	22,131,459,003	13,623,354,651
負債の部		
流動負債		
未払解約金	8,306,276	4,477,564
未払受託者報酬	4,917,473	4,262,062
未払委託者報酬	11,679,036	10,122,475
その他未払費用	164,225	146,223
流動負債合計	25,067,010	19,008,324
負債合計	25,067,010	19,008,324
純資産の部		
元本等		
元本	12,709,705,669	7,442,415,703
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	9,396,686,324	6,161,930,624
(分配準備積立金)	4,854,862,771	2,733,672,772
元本等合計	22,106,391,993	13,604,346,327
純資産合計	22,106,391,993	13,604,346,327
負債純資産合計	22,131,459,003	13,623,354,651

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第15期中間計算期間 自 2021年5月11日 至 2021年11月10日	第16期中間計算期間 自 2022年5月10日 至 2022年11月9日
営業収益		
受取利息	48	76
有価証券売買等損益	887,985,780	1,142,987,153
営業収益合計	887,985,828	1,142,987,229
営業費用		
支払利息	2,616	2,979
受託者報酬	4,974,187	4,262,062
委託者報酬	11,813,789	10,122,475
その他費用	166,944	146,223
営業費用合計	16,957,536	14,533,739
営業利益又は営業損失()	871,028,292	1,128,453,490
経常利益又は経常損失()	871,028,292	1,128,453,490
中間純利益又は中間純損失()	871,028,292	1,128,453,490
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	39,221,704	478,362,628
期首剰余金又は期首欠損金()	9,584,128,250	9,396,686,324
剰余金増加額又は欠損金減少額	837,670,045	340,190,579
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	837,670,045	340,190,579
剰余金減少額又は欠損金増加額	763,385,304	4,225,037,141
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	763,385,304	4,225,037,141
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	10,490,219,579	6,161,930,624

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第16期中間計算期間	
	自	至
	2022年5月10日	2022年11月9日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年5月8日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2022年5月9日、当中間計算期間末日を2022年11月9日としております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第15期	第16期中間計算期間末
	2022年5月9日現在	2022年11月9日現在
1. 期首元本額	12,477,799,096円	12,709,705,669円
期中追加設定元本額	1,902,432,211円	441,533,335円
期中一部解約元本額	1,670,525,638円	5,708,823,301円
2. 受益権の総数	12,709,705,669口	7,442,415,703口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第15期	第16期中間計算期間末
	2022年5月9日現在	2022年11月9日現在
1. 中間貸借対照表計上額、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。	中間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、中間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 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価として おります。	同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	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。
----------------------------	---	--

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第15期 2022年5月9日現在	第16期中間計算期間末 2022年11月9日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7393円 (17,393円)	1.8279円 (18,279円)

(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、中間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11月9日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,609,199,409
株式	358,377,753,210
派生商品評価勘定	127,381,580
未収配当金	3,720,201,051
差入委託証拠金	302,940,000
流動資産合計	366,137,475,250
資産合計	366,137,475,250
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,161,930
前受金	187,345,000
未払解約金	287,387,000
流動負債合計	475,893,930
負債合計	475,893,930
純資産の部	
元本等	
元本	110,442,492,530
剰余金	
剰余金又は欠損金()	255,219,088,790
元本等合計	365,661,581,320
純資産合計	365,661,581,320
負債純資産合計	366,137,475,250

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5月10日 至 2022年11月9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11月9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	111,720,693,843円
同期中追加設定元本額	64,711,281,331円
同期中一部解約元本額	65,989,482,644円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOPIXオープン	2,648,330,651円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	4,108,806,028円
One DC 国内株式インデックスファンド	23,525,408,819円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,858,552,080円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,314,816円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	19,054,777円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	52,565,399円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,211,925円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	19,579,053円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	28,002,126円
たわらノーロード TOPIX	1,598,454,587円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,374,586,071円
たわらノーロード バランス(堅実型)	48,742,603円
たわらノーロード バランス(標準型)	322,789,563円
たわらノーロード バランス(積極型)	508,114,967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)	4,163,482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)	188,097,527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)	456,142,834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)	318,341,039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)	451,872,335円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	658,680円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,856,176円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	45,704,389円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,650,801円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	16,350,173円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,778,764,875円
Oneグローバルバランス	3,268,042円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,080,110,534円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,634,696,398円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,990,876,441円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	346,791,472円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,096,155,174円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,146,566,575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>	1,143,748,865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)	312,476,258円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	358,247,282円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	579,138,973円
投資のソムリエ	5,853,893,573円
クルーズコントロール	472,830,786円
投資のソムリエ<DC年金>	404,634,141円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	362,756,652円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	815,799,590円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	375,780,818円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,710,910,524円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	37,364,785円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	18,676,534円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,538,037円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	68,085,245円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	477,755,844円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	88,414,162円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	269,815,149円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	36,490,417円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	19,205,151円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	12,432,660円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	309,174,567円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	2,351,519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)	23,255,514円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	23,957,057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)	12,773,022円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	14,627,936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)	23,070,411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)	52,598,309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)	139,550,798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)	20,856,849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)	93,420,529円

マルチアセット・インカム戦略ファンド(日米資産投資・シグナルヘッジ付き)2022-10(適格機関投資家限定)	500,696,767円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	151,442,697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)	5,355,744円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	31,042,700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)	49,054,999円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	39,640,070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)	3,195,139円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	4,488,456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)	50,671,328円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	98,264,863円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,816,106円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	24,799,446円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,995,143円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	94,241円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	6,939,768円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	27,735,068円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	467,071,993円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	563,160,299円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,647,914,578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)	16,469,736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)	23,798,158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)	245,409,288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)	61,347,605円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	67,381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)	292,359,203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)	17,193,749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)	57,203,815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)	131,906,920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)	198,347,154円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	32,971,593円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	15,927,213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)	177,619,994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
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,220,307,862円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	48,743,066円
動的パッケージファンド<DC年金>	5,993,725円
コア資産形成ファンド	4,080,157円
MHAMトピックスファンド	771,155,925円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	54,489,889円

MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	794,092,672円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,542,332,531円
計	110,442,492,530円
2. 受益権の総数	110,442,492,530口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月9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)は短時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る場合、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。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2022年11月9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	7,548,500,000	-	7,674,850,000	126,350,000
合計	7,548,500,000	-	7,674,850,000	126,350,000

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

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

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年11月9日現在
1口当たり純資産額	3.3109円
(1万口当たり純資産額)	(33,109円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2022年11月30日現在

資産総額	13,798,442,180円
負債総額	14,654,553円
純資産総額(-)	13,783,787,627円
発行済数量	7,402,398,358口
1口当たり純資産額(/)	1.8621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11月30日現在

資産総額	380,051,320,278円
負債総額	364,386,376円
純資産総額(-)	379,686,933,902円
発行済数量	112,565,730,623口
1口当たり純資産額(/)	3.3730円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5)受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(6)受益権の再分割

委託会社は、社振法に定めるところにしたがい、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2022年11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11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. 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年11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	1,412,515,586,826
追加型株式投資信託	802	14,533,579,135,759
単位型公社債投資信託	25	48,203,973,629
単位型株式投資信託	218	1,119,360,076,721
合計	1,071	17,113,658,772,935

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第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、第38期中間会計期間(自2022年4月1日至2022年9月30日)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

(単位:百万円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

（単位：百万円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			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います。

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

		第38期中間会計期間末 (2022年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		27,934
金銭の信託		29,712
未収委託者報酬		17,398
未収運用受託報酬		3,150
未収投資助言報酬		291
未収収益		16
前払費用		939
その他		2,564
	流動資産計	82,009
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	1,055
器具備品	1	138
リース資産	1	8
無形固定資産		
ソフトウェア		3,151
ソフトウェア仮勘定		1,794
電話加入権		2
投資その他の資産		
投資有価証券		182
関係会社株式		5,810
長期差入保証金		779
繰延税金資産		2,962
その他		411
	固定資産計	16,298
資産合計		98,307

(単位:百万円)

	第38期中間会計期間末 (2022年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	959
リース債務	1
未払金	7,709
未払収益分配金	0
未払手数料	7,486
その他未払金	221
未払費用	9,245
未払法人税等	2,605
未払消費税等	719
契約負債	20
賞与引当金	866
役員賞与引当金	26
流動負債計	22,155
固定負債	
リース債務	7
退職給付引当金	2,600
時効後支払損引当金	108
固定負債計	2,716
負債合計	24,871
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	19,552
資本準備金	2,428
その他資本剰余金	17,124
利益剰余金	51,882
利益準備金	123
その他利益剰余金	51,759
別途積立金	31,680
繰越利益剰余金	20,079
株主資本計	73,435
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	0
評価・換算差額等計	0
純資産合計	73,435
負債・純資産合計	98,307

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

	第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	48,925	
運用受託報酬	7,371	
投資助言報酬	1,029	
その他営業収益	11	
	営業収益計	57,336
営業費用		
支払手数料	20,939	
広告宣伝費	102	
公告費	0	
調査費	16,544	
調査費	5,756	
委託調査費	10,787	
委託計算費	277	
営業雑経費	371	
通信費	17	
印刷費	249	
協会費	34	
諸会費	20	
支払販売手数料	49	
	営業費用計	38,235
一般管理費		
給料	4,691	
役員報酬	81	
給料・手当	4,561	
賞与	49	
交際費	4	
寄付金	4	
旅費交通費	48	
租税公課	243	
不動産賃借料	504	
退職給付費用	235	
固定資産減価償却費	1 655	
福利厚生費	26	
修繕費	0	
賞与引当金繰入額	866	
役員賞与引当金繰入額	26	
機器リース料	0	
事務委託費	2,103	
事務用消耗品費	18	
器具備品費	0	
諸経費	159	
	一般管理費計	9,590
営業利益		9,510

（単位：百万円）

	第38期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
営業外収益		
受取利息	6	
受取配当金	2,400	
時効成立分配金・償還金	0	
時効後支払損引当金戻入額	25	
為替差益	28	
雑収入	2	
		営業外収益計 2,463
営業外費用		
金銭の信託運用損	530	
早期割増退職金	3	
雑損失	28	
		営業外費用計 561
経常利益		11,411
特別利益		
投資有価証券売却益	4	
		特別利益計 4
特別損失		
固定資産除却損	12	
投資有価証券売却損	9	
関係会社株式評価損	584	
		特別損失計 605
税引前中間純利益		10,809
法人税、住民税及び事業税		2,457
法人税等調整額		129
法人税等合計		2,587
中間純利益		8,222

(3) 中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216
当中間期変動額							
剰余金の配当							12,360
中間純利益							8,222
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)							
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	4,137
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	20,079

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	56,020	77,573	0	0	77,573
当中間期変動額					
剰余金の配当	12,360	12,360			12,360
中間純利益	8,222	8,222			8,222
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額合計	4,137	4,137	0	0	4,137
当中間期末残高	51,882	73,435	0	0	73,435

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 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 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(リース資産を除く) 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 ... 8~18年 器具備品 ... 2~20年</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする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、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生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は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 重要な収益及び費用の計上基準	<p>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2回又は4回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
7. 消費税等の会計処理	<p>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。</p>

（会計方針の変更）

「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 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27 - 2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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しております。なお、当該適用指針の適用に伴う、当中間財務諸表への影響はありません。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第38期中間会計期間末 （2022年9月30日現在）		
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	...	469百万円
	器具備品	...	975百万円
	リース資産	...	0百万円

（中間損益計算書関係）

項目	第38期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）		
1.減価償却実施額	有形固定資産	...	74百万円
	無形固定資産	...	580百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （百万円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
2022年6月16日 定時株主総会	普通株式	12,360	309,000	2022年3月31日	2022年6月17日
	A種種類 株式				

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

(金融商品関係)

第38期中間会計期間末(2022年9月30日現在)

1.金融商品の時価等に関する事項

2022年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	29,712	29,712	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	29,714	29,714	-

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

2.金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価(百万円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	-	29,712	-	29,712
投資有価証券	-	-	-	-
其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	29,714	-	29,714

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券（その他有価証券）	
非上場株式	180
関係会社株式	
非上場株式	5,810

（有価証券関係）

第38期中間会計期間末
(2022年9月30日現在)

1. 子会社株式

関係会社株式（中間貸借対照表計上額5,810百万円）で市場価格のあるものはありません。

2. その他有価証券

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

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額180百万円）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。

（持分法損益等）

当社は2022年8月1日付でPayPayアセットマネジメント株式会社の株式を取得し持分法適用関連会社としておりますが、重要性が乏しいため、関連会社に対する投資の金額等の記載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) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2022年4月1日から2022年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

b. 発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

(注) 顧客関連資産に配分された金額及びそれに係る繰延税金負債は、資産の額及び負債の額には含まれておりません。

(5) のれん以外の無形固定資産に配分された金額及び主要な種類別の内訳並びに全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 百万円
固定資産	72,873百万円
資産合計	72,873百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	4,223百万円
負債合計	4,223百万円
純資産	68,650百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額53,357百万円及び顧客関連資産の金額23,061百万円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 百万円
営業利益	4,019百万円
経常利益	4,019百万円
税引前中間純利益	4,019百万円
中間純利益	3,372百万円
1株当たり中間純利益	84,308円98銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額2,114百万円が含まれております。

(資産除去債務関係)

当社は建物所有者との間で不動産賃貸借契約を締結しており、賃借期間終了時に原状回復する義務を有しているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。

なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金(敷金)が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第38期中間会計期間
(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

委託者報酬	48,925百万円
運用受託報酬	7,338百万円
投資助言報酬	1,029百万円
成功報酬(注)	32百万円
その他営業収益	11百万円
合計	57,336百万円

(注) 成功報酬は、中間損益計算書において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. 重要な収益及び費用の計上基準」に記載の通りであります。

(セグメント情報等)

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

(1)サービスごとの情報

サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2)地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

(3)主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

(1株当たり情報)

第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,835,889円89銭
1株当たり中間純利益金額	205,562円11銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
中間純利益金額	8,222百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	8,222百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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
みずほ証券株式会社	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。

(注) 資本金の額は2022年3月末日現在

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

(1)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載する場合があります。また、以下の内容を記載することがあります。

- ・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
- ・委託会社の金融商品取引業者登録番号
- ・詳細情報の入手方法

委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など

請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨

- ・目論見書の使用開始日
- ・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

- ・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
- ・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

(2)有価証券届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」に記載の内容について、投資家の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関する箇所に記載することがあります。また、第二部「ファンド情報」第1「ファンドの状況」5「運用状況」について、有価証券届出書提出後の随時入手可能な直近の情報および同情報についての表での表示に加えて、グラフで表示した情報を目論見書に記載することがあります。

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

(4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。

(6)投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。

(7)有価証券届出書第一部「証券情報」（12）その他 に記載の「ラップ口座にかかる契約に基づいて、ラップ口座の資金を運用するためのファンド」におけるラップ口座については、目論見書において、各販売会社で用いる固有の名称を記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2022年5月26日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

(注1) 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) 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7月15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日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）の2021年5月11日から2022年5月9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日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）の2022年5月9日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注1) 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年11月24日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 丘本 正彦指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 稲葉 宏和

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間(2022年4月1日から2022年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2022年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2022年4月1日から2022年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

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

以上

(注1) 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年1月13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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）の2022年5月10日から2022年11月9日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）の2022年11月9日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年5月10日から2022年11月9日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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) 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。