

【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10月6日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 杉原 規之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	One ETF トピックス
【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】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 (東京都中央区日本橋兜町2番1号)

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

One ETF トピックス(以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。)

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権(以下「受益権」といいます。)

当初元本は1口当たり1,475円とします。

信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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

(3)【発行(売出)価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4)【発行(売出)価格】

取得申込受付日の基準価額 とします。

「基準価額」とは、純資産総額(ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額)を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。当ファンドの基準価額は100口当たりで表示されます。

<基準価額の照会方法等>

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

コールセンター:0120-104-694(受付時間:営業日の午前9時から午後5時まで)

(5)【申込手数料】

販売会社が定める額とします。

消費税および地方消費税に相当する金額(「消費税等相当額」といいます。)がかかります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(6) 【申込単位】

1ユニット以上1ユニット単位とします。

「ユニット」とは、東証株価指数(TOPIX)(以下、「対象指数」という場合があります。)に連動すると委託会社が想定する現物株式ポートフォリオの1単位に相当する口数の受益権をいいます。

取得申込口数は、100口の整数倍とし、現物株式ポートフォリオ1単位の評価額を取得申込受付日の基準価額で除して得た口数をもとに、取得申込受付日に委託会社が定めます。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2023年10月7日から2024年4月8日まで

(12) その他の記載に該当する場合には、取得申込の受付を行わない場合があります。

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694(受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで)

(9) 【払込期日】

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに、原則としてその保有する現物株式ポートフォリオ等を販売会社に引き渡すものとします。

振替受益権にかかる各取得申込受付日の発行価額の総額に相当する現物株式ポートフォリオ等は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、受託会社の指定するファンド口座に移管されます。

現物株式ポートフォリオ等に金銭が含まれる場合は、当該金銭については、販売会社によって、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社の定める方法により、その保有する現物株式ポートフォリオ等を販売会社に引き渡すものとします。

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694(受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで)

(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】

・お申込の受付

取得申込みの受付は原則として販売会社の毎営業日に行われます。

取得申込みの受付は原則として正午までにお申込みが行われ、かつ、取得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のお申込みとして取扱います。

原則として、以下の日を取得申込受付日とする申込みはできません。ただし、下記1.から4.に該当する場合であっても、委託会社の判断により、受益権の取得申込みを受け付けることがあります。

- 1.対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内
- 2.対象指数の銘柄変更実施日および銘柄株数変更実施日の各々3営業日前から起算して4営業日以内
- 3.計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内(ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内)
- 4.ファンドが終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
- 5.上記1.から4.のほか、委託会社が、運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めるとき

・お申込方法

- ・受益権の取得は、原則として委託会社が事前に提示する現物株式ポートフォリオによる設定に限定します。
- ・委託会社は、取得申込受付日の2営業日前までに、取得申込日に適用される現物株式ポートフォリオの銘柄および数量を申込みユニット数に応じて決定し提示します。
- ・現物株式ポートフォリオの評価額が、取得申込口数に取得申込受付日の基準価額を乗じて得た額に満たない場合は、その差額に相当する金額について金銭を充当するものとします。
- ・取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに、原則として取得申込のユニット数に応じた現物株式ポートフォリオおよび金銭(「現物株式ポートフォリオ等」という場合があります。)を販売会社に引き渡すものとします。

対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内に該当する日において、委託会社の判断により取得申込みを受け付けるときには、当該取得申込みにかかる有価証券のうち、配当落または権利落対象銘柄の株式の個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを受け付けることができるものとします。この場合において、委託会社は、配当落または権利落対象銘柄の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額として委託会社が定める金額(当該時価総額の0.05%)を徴することができるものとします。

取得申込者が対象指数に採用されている銘柄の株式の発行会社またはその子会社(会社法第2条第3号に規定する子会社をいい、当該発行会社を含めて以下「発行会社等」といいます。)である場合には、取得申込みにかかる有価証券のうち当該発行会社等の株式の個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを受け付けることができるものとします。この場合において、委託会社は、当該発行会社の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額として委託会社が定める金額(当該時価総額の0.05%)を徴することができるものとします。また、取得申込みを当該取得申込者から受け付けた販売会社は、取得申込みを取り次ぐ際に委託会社にその旨を通知するものとします。この通知が取得申込みの取次

ぎの際に行われなかった場合において、そのことによって信託財産その他に損害が生じたときには、取得申込みを取り次いだ販売会社はその責を負うものとします。

・その他

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得のお申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたファンドのお申込みの受付を取り消すことがあります。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、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、当該取得申込みにかかる現物株式ポートフォリオ等の受渡または支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。また、株式会社日本証券クリアリング機構(金融商品取引法第2条第29項に規定する金融商品取引清算機関とし、以下、「清算機関」といいます。)の業務方法書に定めるところにより、取得申込みを受付けた販売会社が、当該取得申込みの受付によって生じる現物株式ポートフォリオ等の委託会社への受渡または支払いの債務の負担を清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、振替機関等における当該清算機関の名義の口座に口数の増加の記載または記録が行われ、取得申込者が自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座における口数の増加の記載または記録は、当該清算機関と販売会社(販売会社による清算機関への債務の負担の申込みにおいて、当該販売会社の委託を受けて金融商品取引法第2条第27項に定める有価証券等清算取次ぎが行われる場合には、当該有価証券等清算取次ぎを行う金融商品取引業者または登録金融機関を含みます。)との間で振替機関等を介して行われます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託にかかる現物株式ポートフォリオ等について受入れまたは振替済の通知を受けた場合には、振替機関に対し追加信託が行われた旨を通知するものとします。ただし、清算機関の業務方法書に定めるところにより、当該現物株式ポートフォリオ等の委託会社への受渡または支払いの債務を清算機関が負担する場合には、受託会社は、委託会社の指図に基づき、当該現物株式ポートフォリオ等についての受入れまたは振替済の通知にかかわらず、振替機関に対し追加信託が行われた旨を通知するものとします。

振替受益権について

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

ファンドの収益分配金、交換有価証券は、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い、交付されます。

（参考）

投資信託振替制度

投資信託振替制度とは、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するものです。ファンドの設定、交換等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われますので、受益証券は発行されません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、東証株価指数（TOPIX）（以下、「対象指数」という場合があります。）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

信託財産の1口当たりの純資産額の変動率をTOPIXの変動率に一致させることを目的として、TOPIXに採用されている銘柄（採用予定の銘柄を含む。）の株式に対する投資として運用を行います。

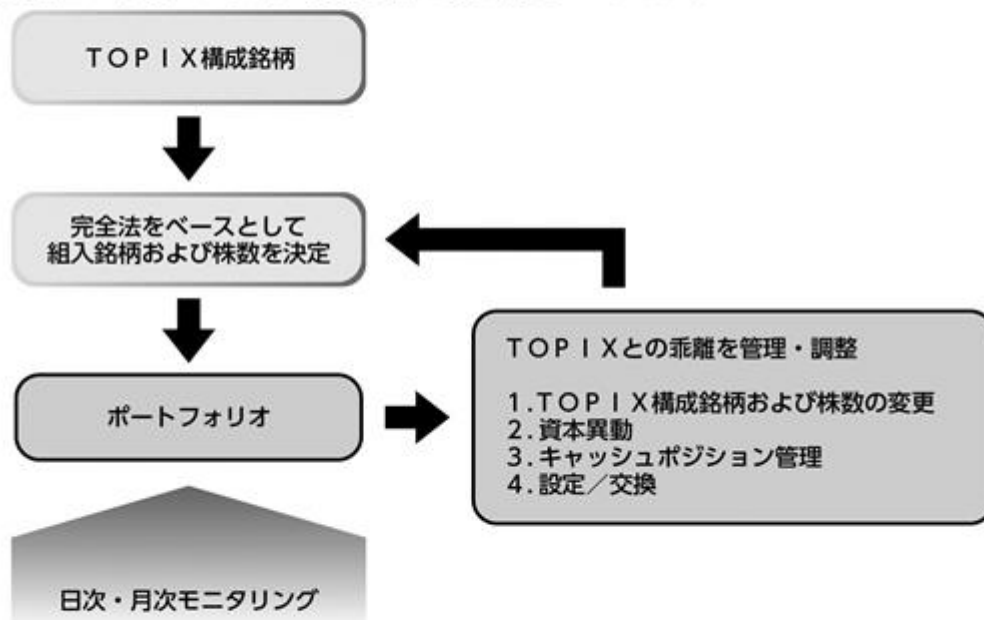
信託財産中に占める個別銘柄の株数の比率は、TOPIXにおける個別銘柄の時価総額構成比率から算出される株数の比率程度を維持することを原則とします。

当ファンドの信託の限度額は、10兆円相当額とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1 東証株価指数(TOPIX) (以下、「対象指数」という場合があります。)に連動する投資成果をめざして運用を行います。

- 信託財産の1口当たりの純資産額の変動率をTOPIXの変動率に一致させることを目的として、TOPIXに採用されている銘柄(採用予定の銘柄を含む。)の株式に対する投資として運用を行います。
 - 信託財産中に占める個別銘柄の株数の比率は、TOPIXにおける個別銘柄の時価総額構成比率から算出される株数の比率程度を維持することを原則とします。
- ※信託財産で保有する株式の貸付取引を行う場合があります。



- 対象指数から除外された銘柄は、市場動向等を勘案し速やかに売却することを基本としますが、当該銘柄の流動性等によっては、速やかに売却できない場合があります。
- 対象指数に連動する投資成果を目指すため、信託財産の構成を調整するための指図を行うこと、および補完的に有価証券指数等先物取引等を行うことができます。

2 当ファンドは投資信託及び投資法人に関する法律により定められる投資信託ですが、通常の投資信託とは異なる仕組みを有しています。

- 当ファンドの受益権は東京証券取引所に上場され、市場価格で売買することができます。
 - 売買単位は10口単位です。
 - 取引方法は原則として株式と同様です。
 - 売買手数料等詳しくは第一種金融商品取引業者にお問い合わせください。
- 取得申込み(追加設定)は株式によって行われます。
 - 委託会社は、あらかじめ取得申込みに必要な株式の銘柄およびそれぞれの株数を指定します。取得申込者はこれらの株式を提供することで、引換えに受益権を取得することができます。
 - 所定の条件に該当する場合を除き、金銭による取得申込みを行うことはできません。
- 受益権を株式と交換することができます。
 - 一定口数以上の受益権を保有する受益者は、それに相当する信託財産中の株式と交換することができます。
 - 通常の投資信託における換金手続きの「解約請求」は、当ファンドでは行うことができません。

東証株価指数(TOPIX)について

- ①TOPIXの指数値および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TOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよび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。
- ②JPXは、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止または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。
- ③JPXは、TOPIXの指数値および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。
- ④JPXは、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、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。
- ⑥JPX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。
- ⑦JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを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。

■ 分配方針

年2回の決算時(毎年1月、7月の8日)に収益分配を行います。

分配金額は、経費控除後の配当等収益の全額を原則とします。

- 将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- 分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型投信	国内	株式	MMF	インデックス型
追加型投信	海外	債券	MRF	
	内外	不動産投信	ETF	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

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
国内	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
株式	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

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

(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

株式・一般	大型株、中小型株の属性にあてはまらない全てのものをいいます。
年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
日本	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) でご覧いただけます。

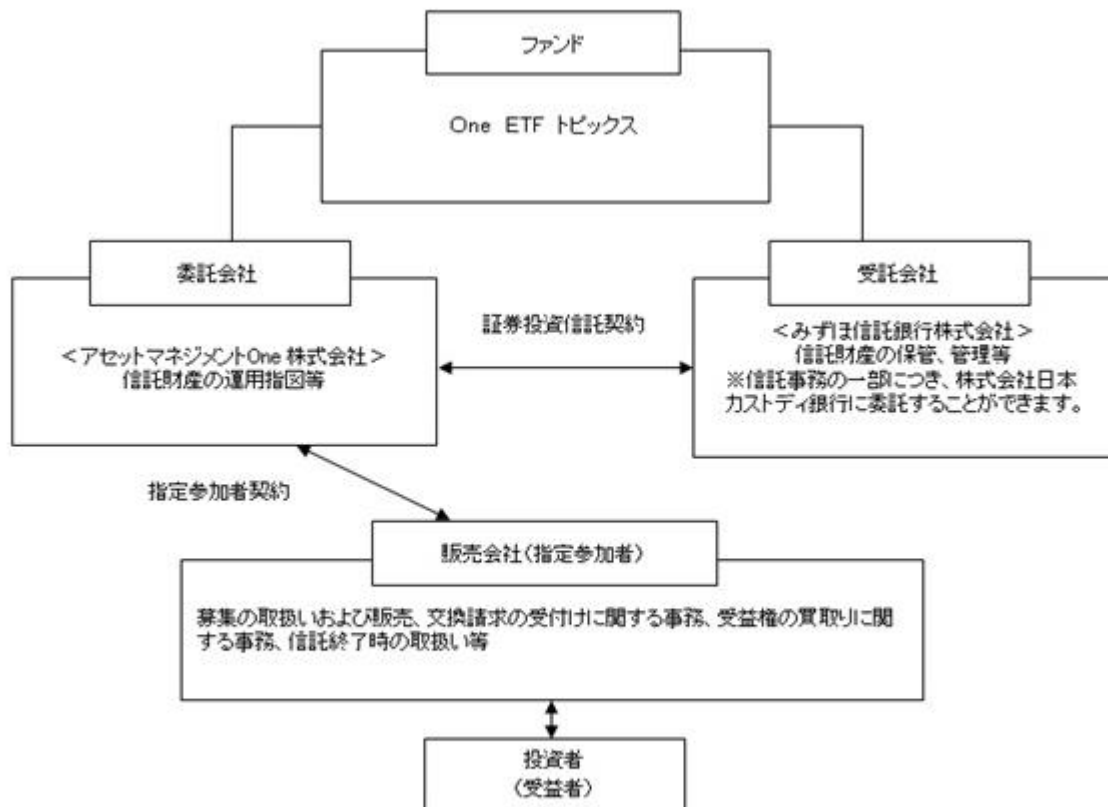
（２）【ファンドの沿革】

2015年9月4日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

2015年9月7日 ファンドの受益権を東京証券取引所へ上場

2017年4月5日 ファンドの名称を「DIAM ETF トピックス」から「One ETF トピックス」に変更

（３）【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドにかかる証券投資信託契約を締結します。当該契約の内容は、当ファンドの運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

・「指定参加者契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、指定参加者契約を締結します。募集の取扱いおよび販売、交換請求の受付、受益権の買取りに関する事務、信託終了時の取扱いにかかる事務の内容等が定められています。

委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2023年7月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2023年7月31日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

委託会社は、信託財産の運用にあたっては、以下に掲げる運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

- この信託は、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象指数の変動率に一致させることを目的として、対象指数に採用されている銘柄（採用予定の銘柄を含みます。）の株式に対する投資として運用を行います。
- 信託財産中に占める個別銘柄の株数の比率は、対象指数における個別銘柄の時価総額構成比率から算出される株数の比率程度を維持することを原則とします。なお、対象指数から除外された銘

柄は、市場動向等を勘案し速やかに売却することを基本としますが、当該銘柄の流動性等によつては、速やかに売却できない場合があります。

3. 1.の方針に沿うよう、信託財産の構成を調整するための指図を行うこと、および補完的に有価証券指数等先物取引等を行うことができます。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、価格変動および金利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。
4. 市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
5. 株式への投資割合には、制限を設けません。
6. 外貨建資産への投資は、行いません。
7. 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。

当ファンドが対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、前記ファンド情報 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 <ファンドの特色>をご参照ください。

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第18条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げる特定資産(「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項に定めるものをいいます。以下同じ。)とします。

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引にかかる権利(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24条に定めるものに限ります。)

ハ.金銭債権

運用の指図範囲等(約款第19条第1項)

委託会社は信託財産を主として株式に投資することを指図します。

運用の指図範囲等(約款第19条第2項)

上記の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託財産を、上記に掲げる株式のほか、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の指図ができます。

1.預金

2.コール・ローン

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2023年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

1 収益分配方針

毎決算時(毎年1月、7月の8日。)に、以下の方針に基づき収益分配を行います。

経費控除後の配当等収益(配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。)の全額を分配することを原則とします。

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。

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

2 収益分配方式

(1)信託財産から生じる配当等収益と前期から繰り越した分配準備積立金は、諸費用および監査費用等ならびに当該諸費用および監査費用等にかかる消費税および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。)、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等相当額を控除し、前期から繰り越した負数の分配準備積立金があるときはその全額を補てんした後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。また、収益分配金額の調整のためその一部または全部を信託財産内に留保したときは分配準備積立金として積み立て、次期以降の分配にあてることができます。なお、諸費用および監査費用等ならびに当該諸費用および監査費用等にかかる消費税等相当額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等相当額を控除しきれないときは、その差額を負数の分配準備積立金として次期に繰り越します。

(2)毎計算期末に信託財産から生じた1.に掲げる利益の合計額は、2.に掲げる損失を控除し、繰越欠損金があるときは、その全額を補てんした後、次期に繰り越します。

1.有価証券売買益(評価益を含みます。)、先物取引等取引益(評価益を含みます。)、交換(解約)差益金、追加信託差益金

2. 有価証券売買損（評価損を含みます。）、先物取引等取引損（評価損を含みます。）、交換（解約）差損金、追加信託差損金

3 収益分配金の支払い

- (1) 受託会社は、計算期間終了日において受益者名簿に名義登録されている者を計算期間終了日における受益者（以下「名義登録受益者」といいます。）として、当該名義登録受益者に収益分配金を支払います。
- (2) 受託会社は、収益分配金の支払いについて、受益者名簿の作成を委託した者にこれを委託することができます。
- (3) 上記(1)に規定する収益分配金の支払いは、原則として、毎計算期間終了日から起算して40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定する預金口座等に当該収益分配金を振り込む方式または同日から分配金領収証等により行うものとします。なお、名義登録受益者が金融商品取引所の会員と別途収益分配金の取扱いにかかる契約を締結している場合は、当該契約にしたがい支払われるものとします。

(5) 【投資制限】

株式への投資割合には、制限を設けません。（約款第21条）

外貨建資産への投資は、行いません。（約款第21条）

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、価格変動および金利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。（約款第21条）

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したがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（約款第21条）

投資する株式等の範囲（約款第23条）

1) 委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。

2) 上記1)の規定にかかわらず、上場予定の株式で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができます。

先物取引等の運用指図（約款第24条）

委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品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。

デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第25条）

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

有価証券の貸付の指図および範囲（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を貸付時点において、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範囲内で貸付の指図をすることができます。
- 2) 上記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、株式の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律 第9条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。）の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドは株式に投資をしますので、株式市場が下落した場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

信用リスク

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

当ファンドが投資する株式の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

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。

当ファンドにおいて有価証券等を売却または取得する際に、市場規模、取引量、取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性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。損失を被る可能性を排除できるものではありません。

当ファンドは、基準価額が対象指数と連動する投資成果を目指しますが、主として次のような要因があるため、対象指数と一致した推移をすることを運用上お約束できるものではありません。

- ・対象指数の構成銘柄について、指数の算出方法どおりの評価価格若しくは構成銘柄異動のタイミングで取引できない場合があること
- ・当ファンドと対象指数の個別銘柄毎の構成比率が完全に一致しないこと
- ・追加設定の一部が金銭にて行われた場合、または組入銘柄の配当金や権利処理等によって、信託財産に現金が発生すること
- ・先物を利用した場合、先物価格と同指数との間に価格差があること
- ・信託報酬等のコスト負担があること

当ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。

資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込の受付または交換請求の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付または交換請求の受付を取り消すことができます。

当ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権の口数が200万口を下回ることとなった場合、または、やむを得ない事情が発生した場合は、信託を終了(繰上償還)する場合があります。

委託会社は、信託期間中において下記に該当することとなった場合は、受託会社と合意のうえ、信託を終了(繰上償還)させます。

1. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合
2. 対象指数が廃止された場合

3.対象指数の計算方法の変更等に伴って委託会社または受託会社が必要と認めた約款の変更が書面決議により否決された場合

なお、1.に掲げる事由によりこの信託契約を解約する場合には、その廃止された日に信託を終了（繰上償還）するための手続きを開始するものとします。

・注意事項

イ.当ファンドは、株式などの値動きのある有価証券に投資しますので、基準価額は変動します。

ロ.投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

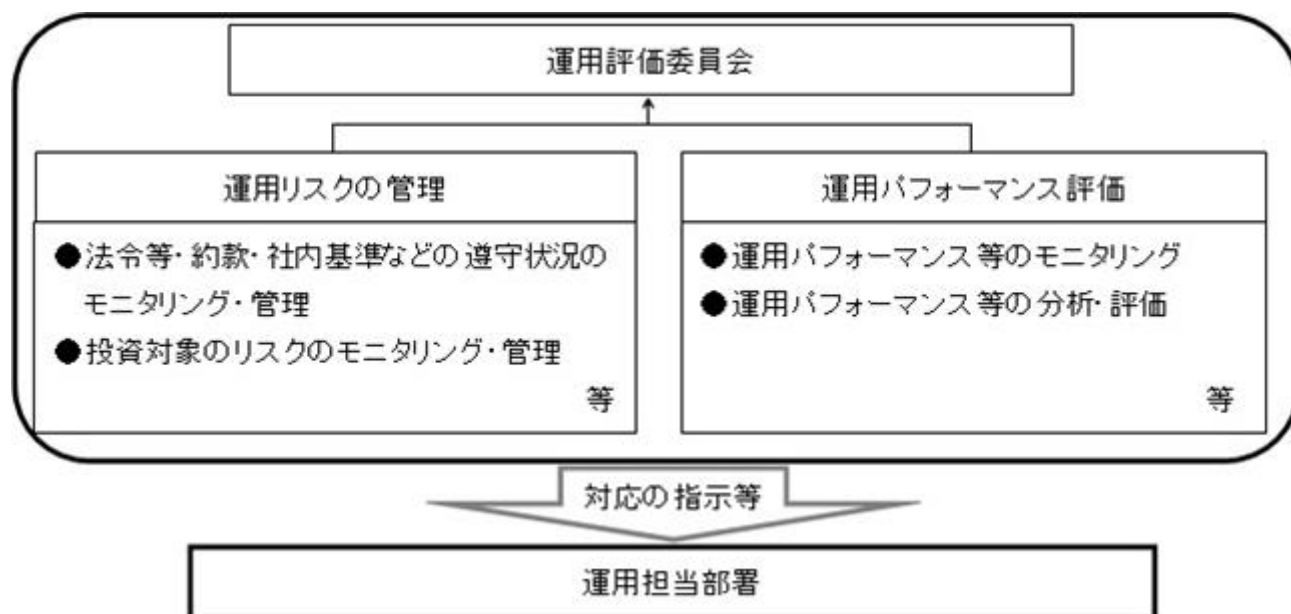
ハ.投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

ニ.投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<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2023年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

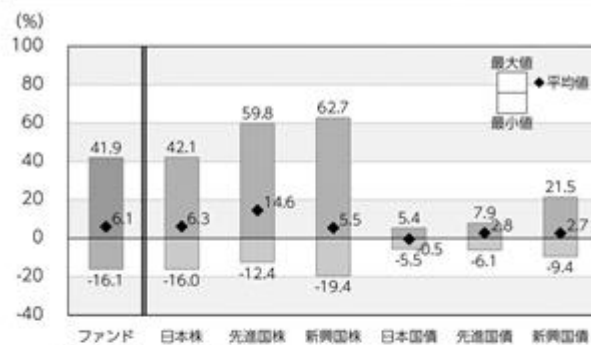
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村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・ディバースィファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド」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】

販売会社が定める額とします。

消費税等相当額がかかります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

コールセンター:0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

お申込手数料は、商品や投資環境の説明および情報提供等、ならびに取得に関する事務手続き等にかかる費用の対価として、販売会社に支払われます。

(2)【換金（解約）手数料】

販売会社が定める額とします。

消費税等相当額がかかります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

コールセンター:0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

交換手数料は、受益権の交換または受益権の買取りに関する事務手続き等にかかる費用の対価として、販売会社に支払われます。

(3)【信託報酬等】

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、以下により計算される と の合計額とします。

ただし、 により計算される額（税抜）と により計算される額（税抜）の合計額は、各計算期間においてファンドの純資産総額に対して年率0.25%（税抜）を乗じて得た額を超えないものとします。

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.0858%（税抜0.078%）以内の率を乗じて得た額

2023年10月6日現在は、年率0.0858%（税抜0.078%）になります。配分は以下の通りです。

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.050%	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
受託会社	年率0.028%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行、名義登録事務・分配金支払関係事務等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

株式の貸付の指図を行った場合は、その品貸料に55%（税抜 50%）以内の率を乗じた額につき、委託会社と受託会社で折半します。

信託報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4) 【その他の手数料等】

信託財産留保額

ありません。

その他の費用

その他費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

受益権の上場にかかる費用(年間上場料(毎年末の純資産総額に対して0.00825%(税抜0.0075%))、追加上場料(追加上場時の増加額(毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額)に対して0.00825%(税抜0.0075%))は、信託財産から支払うことができるものとします。

対象指数についての商標(これに類する商標を含みます。)の使用料(信託財産の純資産総額に対して最大年率0.033%(税抜0.030%)、ただし165万円(税抜150万円)を下回る場合は165万円(税抜150万円))は、信託財産から支払うことができるものとします。

お申込時に要するその他の費用

- ・対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内に該当する日において、委託会社の判断により取得申込みを受け付けるときには、配当落または権利落対象銘柄の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額として委託会社が定める金額(当該時価総額の0.05%)を徴することができるものとします。
- ・取得申込者が現物株式ポートフォリオに含まれる株式の発行会社等である場合には、原則として当該株式の時価総額に相当する金額を金銭にて支払います。この場合、当該株式を取得するために必要な経費に相当する金額(当該時価総額の0.05%)を金銭にて支払うものとします。

上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

2023年10月6日現在。

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）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「特定株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

受益権の売却時

売却時の差益（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。

売却価額から取得費用（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

収益分配時

収益分配金は配当所得として課税されます。

原則として、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（申告不要）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。

受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記と同様の取扱いとなります。

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

特定株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入したETFなどから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設する（特定株式投資信託の場合、収益分配金の受取方法として、非課税口座を開設する金融機関等経由で受領する「株式数比例配分方式」を選択する必要があります。）など、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

<2024年1月1日以降>

少額投資非課税制度（NISA）をご利用の場合、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入したETFなどから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設する(特定株式投資信託の場合、収益分配金の受取方法として、非課税口座を開設する金融機関等経由で受領する「株式数比例配分方式」を選択する必要があります。)など、一定の条件に該当する方が対象となります。また、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

当ファンドは、NISAの「成長投資枠(特定非課税管理勘定)」の対象となる予定ですが、販売会社により取扱いが異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。

法人の受益者に対する課税

受益権の売却時

通常の株式の売却時と同様に、譲渡益について、他の法人所得と合算して課税されます。

収益分配金の受取り時

収益分配金については、15.315%(所得税15.315%(復興特別所得税を含みます。))の税率で源泉徴収されます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。なお、当ファンドは、原則として、益金不算入制度の適用が可能です。

受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記と同様の取扱いとなります。

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、2023年7月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	504,372,792,750	98.72
内 日本	504,372,792,750	98.72
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,551,932,695	1.28
純資産総額	510,924,725,445	100.00

その他資産の投資状況

2023年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	6,538,870,000	1.28
内 日本	6,538,870,000	1.28

（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】

2023年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	8,384,700	2,299.55 19,281,113,900	2,386.00 20,005,894,200	- -	3.92
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	1,080,200	13,005.32 14,048,354,972	13,315.00 14,382,863,000	- -	2.82
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	9,418,600	1,057.86 9,963,605,450	1,146.00 10,793,715,600	- -	2.11
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	152,800	65,973.66 10,080,775,685	63,760.00 9,742,528,000	- -	1.91
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	49,059,300	166.17 8,152,381,380	162.90 7,991,759,970	- -	1.56
6	三菱商事 日本	株式 卸売業	985,000	6,833.24 6,730,743,956	7,265.00 7,156,025,000	- -	1.40
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,068,900	6,200.05 6,627,235,394	6,694.00 7,155,216,600	- -	1.40
8	日立製作所 日本	株式 電気機器	750,000	8,824.49 6,618,371,528	9,298.00 6,973,500,000	- -	1.36
9	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	323,200	20,208.00 6,531,225,920	21,245.00 6,866,384,000	- -	1.34
10	三井物産 日本	株式 卸売業	1,146,600	5,236.86 6,004,588,070	5,541.00 6,353,310,600	- -	1.24

11	任天堂	日本	株式 その他製品	964,100	6,351.09 6,123,094,632	6,450.00 6,218,445,000	- -	1.22
12	信越化学工業	日本	株式 化学	1,271,400	4,596.84 5,844,422,422	4,679.00 5,948,880,600	- -	1.16
13	武田薬品工業	日本	株式 医薬品	1,355,300	4,409.59 5,976,329,565	4,341.00 5,883,357,300	- -	1.15
14	第一三共	日本	株式 医薬品	1,334,200	4,132.88 5,514,096,256	4,347.00 5,799,767,400	- -	1.14
15	リクルートホールディングス	日本	株式 サービス業	1,162,100	4,533.65 5,268,561,616	4,933.00 5,732,639,300	- -	1.12
16	伊藤忠商事	日本	株式 卸売業	995,500	5,540.21 5,515,287,206	5,750.00 5,724,125,000	- -	1.12
17	本田技研工業	日本	株式 輸送用機器	1,241,300	4,291.61 5,327,181,569	4,513.00 5,601,986,900	- -	1.10
18	ソフトバンクグループ	日本	株式 情報・通信業	755,500	6,725.99 5,081,490,508	7,242.00 5,471,331,000	- -	1.07
19	HOYA	日本	株式 精密機器	323,500	16,312.87 5,277,213,948	16,530.00 5,347,455,000	- -	1.05
20	ダイキン工業	日本	株式 機械	184,100	29,107.00 5,358,599,215	28,690.00 5,281,829,000	- -	1.03
21	みずほフィナンシャルグループ	日本	株式 銀行業	2,175,000	2,211.78 4,810,636,800	2,404.00 5,228,700,000	- -	1.02
22	KDDI	日本	株式 情報・通信業	1,183,400	4,290.93 5,077,895,388	4,187.00 4,954,895,800	- -	0.97
23	東京海上ホールディングス	日本	株式 保険業	1,486,500	3,283.59 4,881,064,284	3,259.00 4,844,503,500	- -	0.95
24	オリエンタルランド	日本	株式 サービス業	830,700	5,568.42 4,625,694,073	5,450.00 4,527,315,000	- -	0.89
25	ソフトバンク	日本	株式 情報・通信業	2,461,400	1,536.61 3,782,228,900	1,578.00 3,884,089,200	- -	0.76
26	村田製作所	日本	株式 電気機器	463,100	8,089.47 3,746,235,712	8,325.00 3,855,307,500	- -	0.75
27	SMC	日本	株式 機械	50,000	76,893.28 3,844,664,000	74,150.00 3,707,500,000	- -	0.73
28	セブン&アイ・ホールディングス	日本	株式 小売業	556,800	6,022.04 3,353,072,934	5,893.00 3,281,222,400	- -	0.64
29	三菱電機	日本	株式 電気機器	1,594,000	1,999.76 3,187,617,842	2,051.00 3,269,294,000	- -	0.64
30	ファナック	日本	株式 電気機器	744,600	4,752.70 3,538,866,535	4,348.00 3,237,520,800	- -	0.63

(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

2023年7月31日現在

種類	投資比率（％）
株式	98.72
合計	98.72

（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

2023年7月31日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
電気機器	国内	17.77
情報・通信業		7.99
輸送用機器		7.99
卸売業		6.86
銀行業		6.48
化学		5.90
機械		5.45
医薬品		4.89
サービス業		4.85
小売業		4.30
食料品		3.21
陸運業		2.87
精密機器		2.49
保険業		2.27
その他製品		2.27
建設業		2.02
不動産業		1.80
電気・ガス業		1.29
その他金融業		1.15
鉄鋼		0.93
証券、商品先物取引業		0.73
ゴム製品		0.69
非鉄金属		0.67
ガラス・土石製品		0.67
海運業		0.59
金属製品		0.51
空運業		0.50
石油・石炭製品		0.43
繊維製品		0.43
鉱業		0.33
パルプ・紙		0.17
倉庫・運輸関連業		0.14
水産・農林業	0.08	
合計	98.72	

（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。

【その他投資資産の主要なもの】

2023年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0509月	買建	281	6,335,336,320	6,538,870,000	1.28

(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(2023年7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)	東京証券取引所 市場相場
第1計算期間末 (2016年1月8日)	40,584	40,937	1,447.21	1,459.81	1,450
第2計算期間末 (2016年7月8日)	44,899	45,464	1,208.07	1,223.27	-
第3計算期間末 (2017年1月8日)	56,557	57,023	1,552.83	1,565.63	1,549
第4計算期間末 (2017年7月8日)	91,052	91,952	1,608.21	1,624.11	1,606
第5計算期間末 (2018年1月8日)	120,051	120,757	1,887.27	1,898.37	1,882
第6計算期間末 (2018年7月8日)	140,726	142,050	1,700.57	1,716.57	1,706
第7計算期間末 (2019年1月8日)	142,613	144,146	1,525.21	1,541.61	1,533
第8計算期間末 (2019年7月8日)	171,217	173,344	1,586.07	1,605.77	1,586
第9計算期間末 (2020年1月8日)	201,916	203,981	1,711.25	1,728.75	1,710
第10計算期間末 (2020年7月8日)	234,565	237,149	1,570.66	1,587.96	1,573
第11計算期間末 (2021年1月8日)	308,912	311,185	1,874.98	1,888.78	1,870
第12計算期間末 (2021年7月8日)	412,040	415,621	1,944.36	1,961.26	1,947
第13計算期間末 (2022年1月8日)	410,434	414,457	2,020.03	2,039.83	2,018
第14計算期間末 (2022年7月8日)	371,064	376,214	1,909.68	1,936.18	1,915
第15計算期間末 (2023年1月8日)	424,851	430,043	1,898.20	1,921.40	1,920
第16計算期間末 (2023年7月8日)	500,317	506,315	2,285.48	2,312.88	2,286
2022年7月末日	375,650	-	1,963.13	-	1,959

8月末日	440,124	-	1,986.61	-	1,984
9月末日	421,119	-	1,877.38	-	1,879
10月末日	442,537	-	1,972.89	-	1,971
11月末日	455,528	-	2,030.81	-	2,031
12月末日	433,723	-	1,937.84	-	1,941
2023年1月末日	446,406	-	1,998.94	-	1,997
2月末日	448,590	-	2,017.70	-	2,017
3月末日	452,160	-	2,051.86	-	2,051
4月末日	460,198	-	2,107.01	-	2,106
5月末日	474,618	-	2,182.86	-	2,178
6月末日	513,664	-	2,347.51	-	2,345
7月末日	510,924	-	2,354.18	-	2,352

（注）計算期間末日が休業日の場合は、前営業日の市場相場を記載しています。

【分配の推移】

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	12.60
第2計算期間	15.20
第3計算期間	12.80
第4計算期間	15.90
第5計算期間	11.10
第6計算期間	16.00
第7計算期間	16.40
第8計算期間	19.70
第9計算期間	17.50
第10計算期間	17.30
第11計算期間	13.80
第12計算期間	16.90
第13計算期間	19.80
第14計算期間	26.50
第15計算期間	23.20
第16計算期間	27.40

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	1.0
第2計算期間	15.5
第3計算期間	29.6
第4計算期間	4.6
第5計算期間	18.0
第6計算期間	9.0
第7計算期間	9.3
第8計算期間	5.3
第9計算期間	9.0
第10計算期間	7.2
第11計算期間	20.3
第12計算期間	4.6
第13計算期間	4.9
第14計算期間	4.2

第15計算期間	0.6
第16計算期間	21.8

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	35,858,160	7,815,108
第2計算期間	24,924,100	15,800,837
第3計算期間	24,942,000	25,686,378
第4計算期間	51,843,900	31,648,350
第5計算期間	42,764,100	35,770,629
第6計算期間	54,811,700	35,670,362
第7計算期間	24,523,700	13,771,799
第8計算期間	20,383,600	5,937,088
第9計算期間	14,005,300	3,962,287
第10計算期間	81,712,800	50,364,192
第11計算期間	57,846,700	42,434,261
第12計算期間	101,344,000	54,183,516
第13計算期間	76,116,600	84,849,298
第14計算期間	41,382,200	50,257,264
第15計算期間	39,357,900	9,847,648
第16計算期間	1,980,600	6,887,040

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

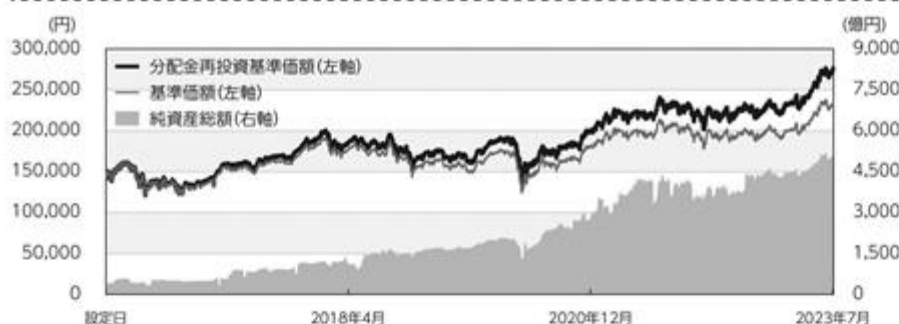
(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注3) 解約口数は交換口数を表示しています。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2023年7月31日

基準価額・純資産の推移 (2015年9月4日~2023年7月31日)



※基準価額は100口当たり・信託報酬控除後の価額です。設定当初の投資元本は147,500円(100口当たり)です。
 ※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:2015年9月4日)

分配の推移(税引前)

2021年 7月	1,690円
2022年 1月	1,980円
2022年 7月	2,650円
2023年 1月	2,320円
2023年 7月	2,740円
設定来累計	28,210円

※分配金は100口当たりです。

主要な資産の状況

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

資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	98.72
内 日本	98.72
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.28
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)	1.28

株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	17.77
2	情報・通信業	7.99
3	輸送用機器	7.99
4	卸売業	6.86
5	銀行業	6.48

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	3.92
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.82
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.11
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.91
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.56
6	三菱商事	株式	日本	卸売業	1.40
7	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.40
8	日立製作所	株式	日本	電気機器	1.36
9	東京エレクトロン	株式	日本	電気機器	1.34
10	三井物産	株式	日本	卸売業	1.24

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。
 ※2015年は設定日から年末までの収益率、および2023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。
 ※2014年は、ベンチマークの収益率を表示しています。当ファンドのベンチマークは「東証株価指数(TOPIX)」です。

- 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。
- ベンチマークの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
- 委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

・お申込の受付

取得申込みの受付は原則として販売会社の毎営業日に行われます。

取得申込みの受付は原則として正午までにお申込みが行われ、かつ、取得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のお申込みとして取扱います。

原則として、以下の日を取得申込受付日とする申込みはできません。ただし、下記1.から4.に該当する場合であっても、委託会社の判断により、受益権の取得申込みを受け付けることがあります。

- 1.対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内
- 2.対象指数の銘柄変更実施日および銘柄株数変更実施日の各々3営業日前から起算して4営業日以内
- 3.計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内）
- 4.ファンドが終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
- 5.上記1.から4.のほか、委託会社が、運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めるとき

・お申込単位

1ユニット以上1ユニット単位とします。

「ユニット」とは、対象指数に連動すると委託会社が想定する現物株式ポートフォリオの1単位に相当する口数の受益権をいいます。

取得申込口数は、100口の整数倍とし、現物株式ポートフォリオ1単位の評価額を取得申込受付日の基準価額で除して得た口数をもとに、取得申込受付日に委託会社が定めます。

・お申込価額

取得申込受付日の基準価額 とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。当ファンドの基準価額は100口当たりで表示されます。

< 基準価額の照会方法等 >

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

コールセンター:0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

・お申込方法

受益権の取得は、原則として委託会社が事前に提示する現物株式ポートフォリオによる設定に限定します。

委託会社は、取得申込受付日の2営業日前までに、取得申込日に適用される現物株式ポートフォリオの銘柄および数量を申込みユニット数に応じて決定し、提示します。

現物株式ポートフォリオの評価額が、取得申込口数に取得申込受付日の基準価額を乗じて得た額に満たない場合は、その差額に相当する金額について金銭を充当するものとします。

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに、原則として取得申込のユニット数に応じた現物株式ポートフォリオおよび金銭（現物株式ポートフォリオ等）を販売会社に引き渡すものとします。

対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内に該当する日において、委託会社の判断により取得申込みを受け付けるときには、当該取得申込みにかかる有価証券のうち、配当落または権利落対象銘柄の株式の個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを受け付けることができるものとします。この場合において、委託会社は、配当落または権利落対象銘柄の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額として委託会社が定める金額（当該時価総額の0.05%）を徴することができるものとします。

取得申込者が対象指数に採用されている銘柄の株式の発行会社またはその子会社（会社法第2条第3号に規定する子会社をいい、当該発行会社を含めて以下「発行会社等」といいます。）である場合には、取得申込みにかかる有価証券のうち当該発行会社等の株式の個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを受け付けることができるものとします。この場合において、委託会社は、当該発行会社の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額として委託会社が定める金額（当該時価総額の0.05%）を徴することができるものとします。また、取得申込みを当該取得申込者から受け付けた販売会社は、取得申込みを取り次ぐ際に委託会社にその旨を通知するものとします。この通知が取得申込みの取次ぎの際に行われなかった場合において、そのことによって信託財産その他に損害が生じたときには、取得申込みを取り次いだ販売会社はその責を負うものとします。

・ 申込手数料

販売会社が定める額とします。

消費税等相当額がかかります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・ 委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

コールセンター:0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

・ その他

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受け付けを中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受け付けを取り消すことができます。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、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、当該取得申込みにかかる現物株式ポートフォリオ等の受渡または支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載

または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託にかかる現物株式ポートフォリオ等について受入れまたは振替済の通知を受けた場合には、振替機関に対し追加信託が行われた旨を通知するものとします。ただし、清算機関の業務方法書に定めるところにより、当該現物株式ポートフォリオ等の委託会社への受渡または支払いの債務を清算機関が負担する場合には、受託会社は、委託会社の指図に基づき、当該現物株式ポートフォリオ等についての受入れまたは振替済の通知にかかわらず、振替機関に対し追加信託が行われた旨を通知するものとします。

2【換金(解約)手続等】

・解約の受付

解約の請求はできません。

・交換の受付

受益者は、毎営業日、自己に帰属する受益権と信託財産に属する有価証券との交換(「交換」といいます。)を請求できます。受益者が交換の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

交換請求の受付は、原則として正午までに交換請求が行われ、かつ、交換請求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該交換請求受付日の請求として取扱います。

原則として、以下の日を交換請求受付日とする請求はできません。ただし、下記1.から4.に該当する場合であっても、委託会社の判断により、受益権の交換請求を受け付けることがあります。

- 1.対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日
 - 2.対象指数の銘柄変更実施日および銘柄株数変更実施日の各々3営業日前から起算して6営業日以内
 - 3.計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内(ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内)
 - 4.ファンドが終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
 - 5.上記1.から4.のほか、委託会社が、約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めたとき
- また、委託会社は約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合に、大口の交換請求に制限を設ける場合があります。

・交換単位

委託会社が定める口数(最小交換口数)の整数倍とします。

「最小交換口数」は、委託会社が交換請求受付日の2営業日前までに提示します。

・交換価額

交換にかかる受益権の評価額は交換請求受付日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額(ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額)を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。

<基準価額の照会方法等>

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

コールセンター:0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

・ 交換の方法

委託会社は、交換の請求を受け付けた場合には、受益者から提示された口数から受益者が取得できる個別銘柄の有価証券の数と、交換に要する受益権の口数を計算します。

委託会社は、受託会社に対し、上記により計算された口数の受益権と信託財産に属する有価証券のうち取引所売買単位（金融商品取引所が定める一売買単位をいいます。）の整数倍となる有価証券を交換するよう指図します。

受益者への交換有価証券の交付に際しては、原則として交換請求受付日から起算して3営業日目から振替機関等の口座に交換請求を行った受益者にかかる有価証券の増加の記載または記録が行われます。

交換の請求を行った受益者が対象指数に採用されている銘柄の株式の発行会社等である場合には、原則として、委託会社は、交換に要する受益権の口数から当該発行会社の株式の個別銘柄時価総額に相当する口数を除いた口数の受益権と、取引所売買単位の整数倍となる有価証券（当該発行会社の株式を除きます。）を交換するよう指図するものとします。なお、この場合、当該交換の請求を受益者から受け付けた販売会社は、交換の請求を取り次ぐ際に委託会社にその旨を通知するものとします。この通知が交換の請求の取次ぎの際に行われなかった場合において、そのことによって信託財産その他に損害が生じたときには、交換の請求を取り次いだ販売会社はその責を負うものとします。

対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日に該当する日において、委託会社の判断により、受益権の交換請求を受け付けた場合には、交換に要する受益権の口数と信託財産に属する有価証券のうち取引所売買単位の整数倍となる有価証券（当該配当落または権利落対象銘柄（以下、「対象銘柄」という場合があります。）を除きます。）および当該対象銘柄の個別銘柄時価総額に相当する金銭を交換するよう指図します。

・ 交換手数料

販売会社が定める額とします。

消費税等相当額がかかります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。販売会社は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

コールセンター:0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

・ その他

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、交換請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた交換請求の受付を取り消すことがあります。交換請求の受付を中止された場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の交換請求を撤回できます。ただし、受益者がその交換請求を撤回しない場合には、当該受益権の交換価額は、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交換請求を受け付けたものとして計算した価額とします。

販売会社は、振替機関の定める方法により、振替受益権の抹消にかかる手続きを行うものとします。なお、清算機関の業務方法書に定めるところにより、当該販売会社が、振替受益権の委託会社への受渡しの債務の負担を清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、当該清算機関が振替受益権の抹消にかかる手続きを行います。当該抹消にかかる手続きおよび交換有価証券にかかる振替の請求が行われた後に、振替機関は、当該交換にかかる受益権の口数と同口数の振替受益権を抹消するものとし、社振法の規定にしたがい振替機関等の口座に交換の請求を行った受益者にかかる当該口数の減少の記載または記録が行われます。委託会社は、交換請求の受付日の翌営業日以降、交換によって抹消されることとなる振替受益権と同口数の受益権を失効したものとして取り扱うこととし、受託会社は委託会社の交換の指図に基づいて、交換にかかる振替受益権については、振替口座簿における抹消の手続きおよび交換有価証券の振替日における抹消の確認をもって、当該振替受益権を受入れ抹消したのものと取り扱います。

受託会社は、交換のための振替受益権の抹消にかかる手続きが行われたことを確認した場合に、委託会社の指図にしたがい、振替機関の定める方法により信託財産に属する交換有価証券にかかる振替の請求等を行うものとします。ただし、清算機関の業務方法書に定めるところにより、上記の交換の請求を受け付けた販売会社が、振替受益権の委託会社への受渡しの債務の負担を当該清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、受託会社は、当該手続きにかかわらず、委託会社の指図にしたがい、振替機関の定める方法により信託財産に属する交換有価証券にかかる振替請求を行うものとします。

・買取り

販売会社は、次に該当する場合で受益者の請求があるときは、受益権を買い取ります。

買取請求の受付は、原則として販売会社の定める時刻までに買取請求が行われ、かつ、買取請求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の買取請求受付分とします。

ただし、2.の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。

1. 交換により生じた取引所売買単位未満の振替受益権
2. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になったとき

受益権の買取価額は、買取請求の受付日の基準価額とします。

販売会社は、受益権の買取りを行うときは、販売会社が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を徴することができるものとします。

販売会社は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて受益権の買取りを停止することおよびすでに受け付けた受益権の買取りを取り消すことができます。

受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取停止以前に行った当日の買取請求を撤回できません。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、買取停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受け付けたものとしします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場

なお、当ファンドの基準価額は100口当たりで表示されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

コールセンター:0120-104-694(受付時間:営業日の午前9時から午後5時まで)

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、2015年9月4日から無期限です。

ただし、下記「(5)その他 イ.償還規定」の場合には信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

計算期間は、原則として毎年1月9日から7月8日まで、および7月9日から翌年1月8日までとすることを原則とし、最終計算期間の終了日は信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ.償還規定

- a.委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、信託財産の一部を受益権と交換することにより受益権の口数が200万口を下回ることとなった場合、または、やむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- b. 委託会社は、信託期間中において次の1.から3.に該当することとなった場合は、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出るものとします。
1. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合
 2. 対象指数が廃止された場合
 3. 対象指数の計算方法の変更等に伴って委託会社または受託会社が必要と認めた約款の変更が書面決議により否決された場合
- なお、1.に掲げる事由によりこの信託契約を解約する場合には、その廃止された日に信託を終了するための手続きを開始するものとします。
- c. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れ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。
- d. 上記c.の書面決議において、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かかる受益者としての受託会社を除きます。以下本d.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れ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。
- e. 上記c.の書面決議は議決権を行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。
- f. 上記c.からe.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記c.からe.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- g. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- h. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、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、下記「ロ．信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、その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。
- i. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に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請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ．信託約款の変更等」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、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- j. 信託契約の解約を行う場合には、書面決議において当該解約に反対した受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続きに関する事項は、上記c.に規定する書面に付記します。

ロ．信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合（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出ます。なお、約款はa.からg.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します。
- b. 委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあっては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあっては、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。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れ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発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、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かかる受益者としての受託会社を除きます。以下本c.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、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れ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。
- d. 上記b.の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。
- e. 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。
- f. 上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a.からf.の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合にかかる一また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。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがい約款を変更します。
- i. 重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、上記b.に規定する書面に付記します。

ハ．関係法人との契約の更改

証券投資信託の指定参加者契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として期間満了の3ヶ月前までに当事者間の別段の意思表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

ニ．公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページに掲載します。

(URL <https://www.am-one.co.jp/>)

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

ホ．運用報告書

運用報告書は作成しません。

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権および名義登録

受益者(計算期間終了日において受益者名簿に名義登録されている受益者(「名義登録受益者」といいます。))とします。)は、収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失います。

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40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定する預金口座等に当該収益分配金を振り込む方式または同日から分配金領収証等により支払われます。

(注) 受託会社は、ファンドにかかる受益者名簿を作成し、受益者について、その氏名または名称、住所および個人番号(行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律(平成二十五年法律第二十七号)第二条第五項に規定する個人番号をいう。以下同じ。))または法人番号(同条第十五項に規定する法人番号をいう。以下同じ。))(個人番号または法人番号を有しない者にあつては、氏名または名称および住所。)、その他受託会社が定める事項を、受益者名簿に名義登録するものとします。また、計算期間終了日において、社振法等関係法令、諸規則等に基づき、振替機関より通知を受けた受益権の帰属者を振替機関等の振替口座簿に記載または記録された受益権にかかる受益者として、その氏名または名称、住所および個人番号または法人番号(個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所。)、その他受託会社の定める事項を受益者名簿に登録するものとします。なお、受託会社は他の証券代行会社等、受託会社が適当と認める者と委託契約を締結し、受益者名簿の作成および受益者名簿への名義登録を委託することができます。

受益者は、ファンドの受益権が上場されている金融商品取引所の会員(口座管理機関であるものに限ります。)を経由して受益者名簿の名義登録を請求することができます。この場合、当該会員は、当該会員が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を徴することができるものとします。ただし、証券金融会社等は登録を受託会社(受託会社が受益者名簿の作成を委託した場合は、その委託をした者)に対して直接に行うことができます。

名義登録は、毎計算期間の末日の翌日から15日間停止するものとします。また、ファンドが終了することとなる場合は、信託終了日の直前5営業日間において名義登録を停止するものとします。

(2) 信託終了時の交換請求権

受益者は、信託が終了するときは、持ち分に応じて交換を請求する権利を有します。

委託会社は、この信託が終了するときは、委託会社が別に定める一定口数以上の受益権を有する受益者に対しては、信託財産に属する有価証券を当該受益権として振替口座簿に記載または記録されている振替受益権と引換えに交換するものとします。この場合、受益者が取得する個別銘柄の株数は、信託終了日の5営業日前の日の基準価額に基づいて計算された株数とし、取引所売買単位の整数倍とします。その他の事項については、「2 換金(解約)手続等」の規定に準じるものとします。

販売会社は、委託会社が別に定める一定口数未満の受益権について買取るものとします。この場合には、当該販売会社が別に定める手数料および当該手数料に対する消費税等相当額を徴することができるものとします。

この信託が終了するときは、販売会社は、その所有にかかるすべての受益権を交換請求するものとします。交換により引渡される株式に当該販売会社の発行する株式または当該販売会社が子会社となる株式が含まれる場合には、委託会社は、受託会社に対しこれを売却する指図をするとともに、当該株式等の評価額に相当する口数の受益権を、受託会社は信託財産をもって買取るものとします。

受益者が、信託終了時における交換による有価証券、信託終了にかかる金銭および買取りにかかる金銭について信託終了日から10年間その受渡しを請求しないときは、その権利を失います。

(3) 交換請求権および買取請求権

受益者は、保有する受益権について、交換または買取りを請求する権利を有します。権利行使の方法等については、「2 換金(解約)手続等」をご参照下さい。

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期計算期間(2023年1月9日から2023年7月8日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【One ETF トピックス】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第15期 2023年1月8日現在	第16期 2023年7月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	95,885,344,975	155,586,209,585
株式	420,611,980,850	494,066,725,840
派生商品評価勘定	-	85,771,840
未収入金	-	89,739,600
未収配当金	593,195,858	551,754,423
未収利息	5,507,657	15,308,271
前払金	395,895,000	-
その他未収収益	165,908,507	141,003,252
差入委託証拠金	399,885,000	488,700,000
流動資産合計	518,057,717,847	651,025,212,811
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	147,494,250	14,148,580
前受金	-	264,985,000
未払金	200,037,680	-
未払収益分配金	5,192,571,637	5,998,169,702
未払受託者報酬	77,698,866	83,025,098
未払委託者報酬	129,541,936	138,545,752
未払利息	286,563	485,804
受入担保金	87,400,567,116	144,083,684,103
その他未払費用	58,304,501	125,076,561
流動負債合計	93,206,502,549	150,708,120,600
純資産の部		
元本等		
元本	330,131,170,925	322,894,171,925
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	94,720,044,373	177,422,920,286
(分配準備積立金)	5,338,818	3,558,302
元本等合計	424,851,215,298	500,317,092,211
純資産合計	424,851,215,298	500,317,092,211
負債純資産合計	518,057,717,847	651,025,212,811

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第15期 自 2022年7月9日 至 2023年1月8日	第16期 自 2023年1月9日 至 2023年7月8日
営業収益		
受取配当金	4,840,464,323	5,556,559,155
受取利息	28,548,458	31,914,272
有価証券売買等損益	5,434,160,405	83,488,207,292
派生商品取引等損益	65,981,870	1,727,189,190
その他収益	638,520,125	749,783,819
営業収益合計	139,354,371	91,553,653,728
営業費用		
支払利息	29,927,836	33,220,105
受託者報酬	77,698,866	83,025,098
委託者報酬	129,541,936	138,545,752
その他費用	80,059,908	87,077,105
営業費用合計	317,228,546	341,868,060
営業利益又は営業損失()	177,874,175	91,211,785,668
経常利益又は経常損失()	177,874,175	91,211,785,668
当期純利益又は当期純損失()	177,874,175	91,211,785,668
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額()	-	-
期首剰余金又は期首欠損金()	84,461,333,199	94,720,044,373
剰余金増加額又は欠損金減少額	20,603,792,046	1,492,777,417
当期一部交換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	20,603,792,046	1,492,777,417
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,974,635,060	4,003,517,470
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,974,635,060	4,003,517,470
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	5,192,571,637	5,998,169,702
期末剰余金又は期末欠損金()	94,720,044,373	177,422,920,286

(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16期	
	自 2023年1月9日	至 2023年7月8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	第15期	第16期
	2023年1月8日現在	2023年7月8日現在
1. 期首元本額	286,603,549,225円	330,131,170,925円
期中追加設定元本額	58,052,902,500円	2,921,385,000円
期中一部交換元本額	14,525,280,800円	10,158,384,000円
2. 受益権の総数	223,817,743口	218,911,303口
3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	83,444,257,900円	133,834,708,390円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第15期	第16期
	自 2022年7月9日 至 2023年1月8日	自 2023年1月9日 至 2023年7月8日
1. その他費用	その他費用の内訳は、監査費用（547,768円）、ライセンス料（61,111,477円）、その他（18,400,663円）となっております。	その他費用の内訳は、監査費用（538,837円）、ライセンス料（67,344,021円）、その他（19,194,247円）となっております。

2. 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当金等収益額（5,477,605,070円）及び分配準備積立金（7,606,095円）の合計額から、経費（287,300,710円）を控除して計算される分配対象額は5,197,910,455円（100口当たり2,322円）であり、うち5,192,571,637円（100口当たり2,320円）を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当金等収益額（6,305,037,141円）及び分配準備積立金（5,338,818円）の合計額から、経費（308,647,955円）を控除して計算される分配対象額は6,001,728,004円（100口当たり2,741円）であり、うち5,998,169,702円（100口当たり2,740円）を分配金額としております。
-------------	---	---

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第15期 自 2022年7月9日 至 2023年1月8日	第16期 自 2023年1月9日 至 2023年7月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。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。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第15期	第16期
	2023年1月8日現在	2023年7月8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 「(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。	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。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第15期	第16期
	2023年1月8日現在	2023年7月8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)
株式	6,101,756,265	82,178,439,274
合計	6,101,756,265	82,178,439,274

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	第15期			
	2023年1月8日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	4,359,420,000	-	4,212,000,000	147,420,000

合計	4,359,420,000	-	4,212,000,000	147,420,000
----	---------------	---	---------------	-------------

種類	第16期 2023年7月8日現在			
	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	6,194,405,000	-	6,266,120,000	71,715,000
合計	6,194,405,000	-	6,266,120,000	71,715,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

1. 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第15期 2023年1月8日現在	第16期 2023年7月8日現在
1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	1,898.20円 (189,820円)	2,285.48円 (228,548円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年7月8日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	8,100	3,610.00	29,241,000	
ニッスイ	215,000	643.00	138,245,000	
マルハニチロ	31,900	2,441.00	77,867,900	
雪国まいたけ	18,300	937.00	17,147,100	貸付株式数 10,000株
カネコ種苗	6,600	1,404.00	9,266,400	
サカタのタネ	24,500	4,125.00	101,062,500	貸付株式数 4,900株
ホクト	19,100	1,823.00	34,819,300	貸付株式数 4,700株
ホクリヨウ	2,400	882.00	2,116,800	貸付株式数 1,200株
ショーボンドホールディングス	29,300	5,551.00	162,644,300	貸付株式数 2,500株
ミライト・ワン	71,100	1,783.00	126,771,300	
タマホーム	13,500	3,290.00	44,415,000	貸付株式数 8,700株

サンヨーホームズ	2,000	726.00	1,452,000	貸付株式数 1,300株
日本アクア	7,000	870.00	6,090,000	貸付株式数 4,700株
ファーストコーポレーション	4,300	793.00	3,409,900	貸付株式数 2,900株
ベステラ	3,600	1,190.00	4,284,000	貸付株式数 2,200株
Robot Home	36,600	190.00	6,954,000	
キャンディル	3,000	593.00	1,779,000	貸付株式数 1,600株
住石ホールディングス	26,000	362.00	9,412,000	貸付株式数 17,700株
日鉄鉱業	8,600	4,595.00	39,517,000	貸付株式数 4,700株
三井松島ホールディングス	9,700	2,729.00	26,471,300	貸付株式数 5,300株
INPEX	795,100	1,602.00	1,273,750,200	
石油資源開発	24,900	4,360.00	108,564,000	
K&Oエナジーグループ	9,700	2,272.00	22,038,400	
ダイセキ環境ソリューション	3,400	1,353.00	4,600,200	
第一カッター興業	5,500	1,382.00	7,601,000	
明豊ファシリティワークス	6,200	777.00	4,817,400	
安藤・間	124,600	1,065.00	132,699,000	貸付株式数 26,400株
東急建設	61,200	730.00	44,676,000	貸付株式数 5,500株
コムシスホールディングス	68,600	2,746.50	188,409,900	貸付株式数 4,500株
ピーアールホールディングス	34,100	388.00	13,230,800	貸付株式数 500株
高松コンストラクショングループ	14,000	2,507.00	35,098,000	貸付株式数 7,600株
東建コーポレーション	6,200	7,430.00	46,066,000	貸付株式数 3,400株
ソネック	1,800	971.00	1,747,800	貸付株式数 900株
ヤマウラ	10,900	1,138.00	12,404,200	貸付株式数 4,400株
オリエンタル白石	77,300	295.00	22,803,500	
大成建設	140,700	5,014.00	705,469,800	貸付株式数 81,000株
大林組	537,800	1,225.50	659,073,900	貸付株式数 320,500株
清水建設	426,400	899.60	383,589,440	貸付株式数 191,700株
飛鳥建設	16,600	1,267.00	21,032,200	
長谷工コーポレーション	155,200	1,762.50	273,540,000	
松井建設	14,000	707.00	9,898,000	貸付株式数 2,200株

銭高組	1,500	3,085.00	4,627,500	貸付株式数 600株
鹿島建設	333,400	2,152.50	717,643,500	
不動テトラ	10,400	1,852.00	19,260,800	
大末建設	4,300	1,340.00	5,762,000	
鉄建建設	10,800	2,033.00	21,956,400	貸付株式数 4,600株
西松建設	25,500	3,515.00	89,632,500	貸付株式数 14,000株 (4,400株)
三井住友建設	121,300	372.00	45,123,600	貸付株式数 34,700株
大豊建設	6,200	3,840.00	23,808,000	貸付株式数 3,400株
佐田建設	7,500	468.00	3,510,000	
ナカノフドー建設	8,300	392.00	3,253,600	
奥村組	24,400	4,055.00	98,942,000	貸付株式数 3,800株
東鉄工業	20,700	2,626.00	54,358,200	貸付株式数 800株
イチケン	2,600	1,955.00	5,083,000	
富士ピー・エス	5,200	445.00	2,314,000	貸付株式数 2,700株
浅沼組	12,000	3,305.00	39,660,000	貸付株式数 5,000株
戸田建設	185,000	770.70	142,579,500	貸付株式数 31,700株
熊谷組	25,200	3,065.00	77,238,000	貸付株式数 15,300株
北野建設	2,200	3,035.00	6,677,000	
植木組	3,300	1,399.00	4,616,700	
矢作建設工業	20,500	1,223.00	25,071,500	
ピーエス三菱	19,100	757.00	14,458,700	
日本ハウスホールディングス	29,800	363.00	10,817,400	貸付株式数 16,500株 (10,400株)
大東建託	55,300	14,340.00	793,002,000	
新日本建設	21,100	1,225.00	25,847,500	
東亜道路工業	6,000	4,540.00	27,240,000	
日本道路	3,000	8,690.00	26,070,000	
東亜建設工業	12,900	3,080.00	39,732,000	
日本国土開発	42,800	571.00	24,438,800	貸付株式数 23,300株
若築建設	6,700	2,941.00	19,704,700	
東洋建設	48,700	1,040.00	50,648,000	貸付株式数 25,300株
五洋建設	213,200	751.20	160,155,840	
世紀東急工業	19,300	1,420.00	27,406,000	
福田組	5,700	4,730.00	26,961,000	貸付株式数 3,100株

日本ドライケミカル	2,900	1,818.00	5,272,200	貸付株式数 1,800株
住友林業	116,100	3,350.00	388,935,000	
日本基礎技術	7,100	504.00	3,578,400	
バコーポレーション	13,100	499.00	6,536,900	
大和ハウス工業	415,800	3,697.00	1,537,212,600	貸付株式数 6,500株
ライト工業	27,800	1,968.00	54,710,400	
積水ハウス	456,000	2,865.00	1,306,440,000	貸付株式数 252,200株
日特建設	14,300	1,063.00	15,200,900	貸付株式数 700株
北陸電気工事	10,300	930.00	9,579,000	
ユアテック	33,100	865.00	28,631,500	
日本リーテック	13,200	1,348.00	17,793,600	貸付株式数 7,200株
四電工	6,300	2,212.00	13,935,600	
中電工	23,300	2,280.00	53,124,000	貸付株式数 800株
関電工	82,400	1,180.00	97,232,000	貸付株式数 5,500株
きんでん	105,900	1,973.50	208,993,650	貸付株式数 26,200株
東京エネシス	15,000	947.00	14,205,000	貸付株式数 1,200株
トーエネック	5,000	3,615.00	18,075,000	
住友電設	14,300	3,145.00	44,973,500	
日本電設工業	24,700	1,991.00	49,177,700	
エクシオグループ	69,300	2,820.00	195,426,000	貸付株式数 13,900株
新日本空調	8,400	2,320.00	19,488,000	貸付株式数 5,500株 (5,500株)
九電工	36,600	3,969.00	145,265,400	貸付株式数 4,400株
三機工業	33,300	1,501.00	49,983,300	貸付株式数 1,100株
日揮ホールディングス	148,700	1,812.00	269,444,400	貸付株式数 77,400株
中外炉工業	4,900	1,998.00	9,790,200	
ヤマト	9,700	913.00	8,856,100	貸付株式数 6,100株 (6,100株)
太平電業	9,300	4,265.00	39,664,500	
高砂熱学工業	36,200	2,400.00	86,880,000	貸付株式数 5,700株
三晃金属工業	1,400	4,470.00	6,258,000	
NEC ネットエスアイ	51,400	1,906.00	97,968,400	貸付株式数 4,900株
朝日工業社	6,200	2,370.00	14,694,000	

明星工業	25,900	952.00	24,656,800	
大気社	17,300	3,975.00	68,767,500	貸付株式数 2,600株
ダイダン	9,900	2,745.00	27,175,500	
日比谷総合設備	12,900	2,147.00	27,696,300	
ニッポン	40,700	1,826.00	74,318,200	
日清製粉グループ本社	139,600	1,695.00	236,622,000	
日東富士製粉	2,700	4,570.00	12,339,000	
昭和産業	13,200	2,628.00	34,689,600	貸付株式数 700株
鳥越製粉	9,400	615.00	5,781,000	貸付株式数 900株
中部飼料	20,900	1,071.00	22,383,900	貸付株式数 11,300株
フィード・ワン	22,100	749.00	16,552,900	
東洋精糖	2,200	1,746.00	3,841,200	貸付株式数 1,200株
日本甜菜製糖	8,800	1,871.00	16,464,800	
D M三井製糖ホールディングス	15,000	2,726.00	40,890,000	貸付株式数 6,700株
塩水港精糖	14,000	212.00	2,968,000	
ウェルネオシュガー	7,800	2,035.00	15,873,000	貸付株式数 4,200株
L I F U L L	53,900	294.00	15,846,600	
M I X I	35,900	2,600.00	93,340,000	
ジェイエイシーリクルートメント	14,200	2,555.00	36,281,000	貸付株式数 5,300株
日本M & Aセンターホールディングス	270,500	1,047.00	283,213,500	貸付株式数 70,200株
メンバーズ	4,600	1,620.00	7,452,000	貸付株式数 2,500株
中広	1,700	414.00	703,800	貸付株式数 1,100株
UTグループ	23,100	2,843.00	65,673,300	
アイティメディア	6,000	1,297.00	7,782,000	貸付株式数 3,300株
E・Jホールディングス	9,200	1,565.00	14,398,000	貸付株式数 5,000株
オープンアップグループ	47,300	2,026.00	95,829,800	貸付株式数 600株
コシダカホールディングス	47,200	1,158.00	54,657,600	貸付株式数 25,700株
アルトナー	3,000	1,842.00	5,526,000	貸付株式数 100株
パソナグループ	19,100	1,662.00	31,744,200	貸付株式数 4,200株
C D S	3,100	1,767.00	5,477,700	
リンクアンドモチベーション	45,400	422.00	19,158,800	貸付株式数 28,600株

エス・エム・エス	60,000	2,708.00	162,480,000	貸付株式数 31,900株
サニーサイドアップグループ	3,700	766.00	2,834,200	貸付株式数 2,400株
パーソルホールディングス	173,800	2,610.00	453,618,000	貸付株式数 8,700株
リニカル	7,000	801.00	5,607,000	
クックパッド	43,100	166.00	7,154,600	貸付株式数 7,400株
エスクリ	5,000	422.00	2,110,000	貸付株式数 3,300株 (100株)
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,000	592.00	3,552,000	貸付株式数 3,900株
森永製菓	27,600	4,551.00	125,607,600	貸付株式数 100株
中村屋	3,800	3,060.00	11,628,000	貸付株式数 2,000株
江崎グリコ	43,200	3,662.00	158,198,400	貸付株式数 16,800株
名糖産業	5,900	1,628.00	9,605,200	貸付株式数 2,600株
井村屋グループ	8,300	2,219.00	18,417,700	貸付株式数 4,100株
不二家	10,300	2,424.00	24,967,200	貸付株式数 5,600株
山崎製パン	101,000	1,995.50	201,545,500	
第一屋製パン	2,200	389.00	855,800	貸付株式数 200株
モロゾフ	4,900	3,740.00	18,326,000	貸付株式数 2,600株
亀田製菓	9,600	4,245.00	40,752,000	貸付株式数 5,200株
寿スピリッツ	16,100	10,030.00	161,483,000	
カルビー	69,100	2,720.00	187,952,000	貸付株式数 39,500株
森永乳業	27,400	4,749.00	130,122,600	貸付株式数 3,100株
六甲バター	11,100	1,298.00	14,407,800	貸付株式数 6,000株
ヤクルト本社	107,900	8,850.00	954,915,000	
明治ホールディングス	185,100	3,266.00	604,536,600	
雪印メグミルク	36,500	1,928.00	70,372,000	
プリマハム	20,300	2,162.00	43,888,600	貸付株式数 11,300株
日本ハム	59,000	3,916.00	231,044,000	
林兼産業	3,600	491.00	1,767,600	貸付株式数 200株
丸大食品	15,200	1,480.00	22,496,000	貸付株式数 7,400株

S Foods	16,700	3,095.00	51,686,500	貸付株式数 6,700株
柿安本店	5,900	2,321.00	13,693,900	貸付株式数 3,100株 (2,700株)
伊藤ハム米久ホールディングス	115,300	719.00	82,900,700	貸付株式数 1,000株
学情	7,100	1,896.00	13,461,600	貸付株式数 3,900株
スタジオアリス	7,900	2,160.00	17,064,000	貸付株式数 4,200株 (900株)
クロスキャット	8,800	1,131.00	9,952,800	貸付株式数 4,800株
シミックホールディングス	7,600	1,920.00	14,592,000	貸付株式数 4,300株
エプコ	2,600	725.00	1,885,000	貸付株式数 1,400株
システナ	258,500	286.00	73,931,000	
N J S	3,500	2,682.00	9,387,000	貸付株式数 1,800株
デジタルアーツ	9,700	5,620.00	54,514,000	
日鉄ソリューションズ	26,200	3,955.00	103,621,000	貸付株式数 10,900株
総合警備保障	292,500	810.00	236,925,000	
キューブシステム	9,100	1,200.00	10,920,000	貸付株式数 5,000株
いちご	173,900	284.00	49,387,600	貸付株式数 100株
日本駐車場開発	159,800	226.00	36,114,800	
コア	6,800	1,715.00	11,662,000	
カカクコム	115,700	2,034.00	235,333,800	
アイロムグループ	5,700	1,940.00	11,058,000	貸付株式数 3,100株
セントケア・ホールディング	10,000	759.00	7,590,000	貸付株式数 5,100株
サイネックス	2,100	662.00	1,390,200	貸付株式数 1,300株
ルネサンス	11,000	893.00	9,823,000	貸付株式数 5,800株
ディップ	27,600	3,530.00	97,428,000	貸付株式数 13,100株
S B S ホールディングス	13,700	3,220.00	44,114,000	
デジタルホールディングス	12,300	1,047.00	12,878,100	貸付株式数 6,700株
新日本科学	16,700	2,089.00	34,886,300	貸付株式数 9,700株
キャリアデザインセンター	2,500	1,646.00	4,115,000	貸付株式数 1,300株

ベネフィット・ワン	73,000	1,411.50	103,039,500	貸付株式数 24,200株
エムスリー	311,500	3,006.00	936,369,000	貸付株式数 154,800株
ツカダ・グローバルホールディング	7,900	459.00	3,626,100	貸付株式数 4,200株
プラス	1,400	961.00	1,345,400	貸付株式数 800株
アウトソーシング	93,900	1,339.00	125,732,100	
ウェルネット	9,300	579.00	5,384,700	貸付株式数 5,100株
ワールドホールディングス	7,100	2,610.00	18,531,000	貸付株式数 3,800株
ディー・エヌ・エー	63,000	1,825.00	114,975,000	貸付株式数 3,900株
博報堂DYホールディングス	201,000	1,421.00	285,621,000	貸付株式数 59,600株
ぐるなび	29,000	349.00	10,121,000	貸付株式数 13,200株
タカミヤ	21,400	536.00	11,470,400	貸付株式数 500株
ジャパンベストレスキューシステム	7,800	718.00	5,600,400	貸付株式数 5,300株
ファンコミュニケーションズ	30,900	400.00	12,360,000	貸付株式数 11,700株 (3,200株)
ライク	5,900	1,669.00	9,847,100	貸付株式数 3,200株
ビジネス・ブレークスルー	4,600	448.00	2,060,800	貸付株式数 2,500株
エスプール	45,300	637.00	28,856,100	
WDBホールディングス	8,100	2,044.00	16,556,400	
手間いらず	2,600	3,790.00	9,854,000	貸付株式数 1,400株
ティア	7,200	453.00	3,261,600	
CDG	1,300	1,390.00	1,807,000	貸付株式数 700株
アドウェイズ	21,700	654.00	14,191,800	
バリューコマース	11,900	1,317.00	15,672,300	
インフォマート	163,600	334.00	54,642,400	貸付株式数 22,400株
サッポロホールディングス	49,700	3,611.00	179,466,700	貸付株式数 28,700株
アサヒグループホールディングス	348,900	5,558.00	1,939,186,200	
麒麟ホールディングス	681,300	2,085.00	1,420,510,500	
宝ホールディングス	103,100	1,137.00	117,224,700	貸付株式数 100株
オエノンホールディングス	45,100	337.00	15,198,700	貸付株式数 25,100株
養命酒製造	5,000	1,844.00	9,220,000	

コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	118,300	1,536.00	181,708,800	
サントリー食品インターナショナル	106,300	5,091.00	541,173,300	
ダイドーグループホールディングス	8,600	5,030.00	43,258,000	貸付株式数 4,200株 (500株)
伊藤園	51,200	3,827.00	195,942,400	
キーコーヒー	16,900	2,045.00	34,560,500	貸付株式数 9,200株
ユニカフェ	3,900	915.00	3,568,500	貸付株式数 2,400株
ジャパンフーズ	1,800	1,072.00	1,929,600	
日清オイリオグループ	21,300	3,635.00	77,425,500	
不二製油グループ本社	35,100	1,982.00	69,568,200	
かどや製油	1,400	3,440.00	4,816,000	
J - オイルミルズ	15,400	1,609.00	24,778,600	貸付株式数 6,100株
ローソン	40,300	6,322.00	254,776,600	貸付株式数 1,300株
サンエー	12,400	4,580.00	56,792,000	貸付株式数 6,800株
カワチ薬品	12,700	2,182.00	27,711,400	貸付株式数 6,900株
エービーシー・マート	23,700	7,884.00	186,850,800	
ハードオフコーポレーション	5,000	1,506.00	7,530,000	
高千穂交易	4,500	3,150.00	14,175,000	貸付株式数 2,500株
アスクル	33,600	2,166.00	72,777,600	貸付株式数 21,800株
ゲオホールディングス	15,900	1,924.00	30,591,600	貸付株式数 9,800株
アダストリア	19,600	2,955.00	57,918,000	貸付株式数 9,800株
ジーフット	8,500	276.00	2,346,000	貸付株式数 4,900株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,600	538.00	860,800	貸付株式数 800株
オルパヘルスケアホールディングス	1,900	1,753.00	3,330,700	貸付株式数 1,200株
伊藤忠食品	3,600	5,090.00	18,324,000	貸付株式数 1,300株
くら寿司	19,000	3,030.00	57,570,000	貸付株式数 10,700株
キャンドウ	5,800	2,502.00	14,511,600	貸付株式数 3,000株
エレマテック	14,600	1,820.00	26,572,000	
I Kホールディングス	4,000	376.00	1,504,000	貸付株式数 2,200株
パルグループホールディングス	15,900	3,790.00	60,261,000	

エディオン	64,200	1,424.00	91,420,800	貸付株式数 40,500株 (29,000株)
あらた	12,400	4,605.00	57,102,000	貸付株式数 600株
サーラコーポレーション	34,100	769.00	26,222,900	貸付株式数 19,000株
ワッツ	6,100	715.00	4,361,500	貸付株式数 3,800株
トーメンデバイス	2,300	4,950.00	11,385,000	貸付株式数 1,200株
ハローズ	7,400	3,615.00	26,751,000	貸付株式数 3,600株
J Pホールディングス	45,300	321.00	14,541,300	貸付株式数 25,000株
フジオフードグループ本社	18,000	1,415.00	25,470,000	貸付株式数 11,400株 (100株)
あみやき亭	3,900	3,310.00	12,909,000	貸付株式数 1,900株
東京エレクトロン デバイス	6,000	10,190.00	61,140,000	
ひらまつ	27,000	253.00	6,831,000	
円谷フィールズホールディングス	27,900	2,914.00	81,300,600	貸付株式数 15,100株
双日	161,700	3,193.00	516,308,100	
アルフレッサ ホールディングス	162,800	2,134.00	347,415,200	
大黒天物産	5,000	6,310.00	31,550,000	貸付株式数 2,700株
ハニーズホールディングス	12,800	1,732.00	22,169,600	貸付株式数 6,100株
ファーマライズホールディングス	2,700	616.00	1,663,200	貸付株式数 1,800株
キッコーマン	100,100	7,966.00	797,396,600	貸付株式数 57,300株
味の素	364,500	5,616.00	2,047,032,000	貸付株式数 55,300株
ブルドックソース	8,000	1,941.00	15,528,000	貸付株式数 4,400株
キューピー	81,100	2,451.00	198,776,100	貸付株式数 44,400株 (22,200株)
ハウス食品グループ本社	46,200	3,276.00	151,351,200	
カゴメ	70,300	3,117.00	219,125,100	貸付株式数 41,000株 (8,700株)
焼津水産化学工業	4,600	811.00	3,730,600	貸付株式数 2,500株
アリアケジャパン	13,200	5,285.00	69,762,000	貸付株式数 1,300株

ピエトロ	1,700	1,827.00	3,105,900	貸付株式数 1,100株
エバラ食品工業	4,100	2,880.00	11,808,000	貸付株式数 2,200株
やまみ	1,100	1,318.00	1,449,800	貸付株式数 600株
ニチレイ	69,200	3,052.00	211,198,400	
横浜冷凍	44,200	1,174.00	51,890,800	貸付株式数 1,300株
東洋水産	76,300	6,115.00	466,574,500	貸付株式数 6,200株
イトアンドホールディングス	6,500	2,129.00	13,838,500	貸付株式数 3,500株
大冷	1,400	1,955.00	2,737,000	貸付株式数 500株
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,600	880.00	8,448,000	貸付株式数 5,200株
日清食品ホールディングス	53,100	11,915.00	632,686,500	貸付株式数 3,700株
永谷園ホールディングス	7,400	2,114.00	15,643,600	貸付株式数 4,000株
一正蒲鉾	5,000	739.00	3,695,000	貸付株式数 3,400株
フジッコ	15,500	1,880.00	29,140,000	貸付株式数 5,100株
ロック・フィールド	16,900	1,470.00	24,843,000	貸付株式数 9,200株
日本たばこ産業	993,900	3,096.00	3,077,114,400	
ケンコーマヨネーズ	10,400	1,311.00	13,634,400	
わらべや日洋ホールディングス	11,100	2,742.00	30,436,200	
なとり	9,500	1,944.00	18,468,000	貸付株式数 5,200株
イフジ産業	2,000	1,107.00	2,214,000	貸付株式数 1,000株
ファーマフーズ	21,700	1,928.00	41,837,600	貸付株式数 13,200株
北の達人コーポレーション	64,700	278.00	17,986,600	貸付株式数 33,200株 (9,800株)
ユーグレナ	97,600	881.00	85,985,600	貸付株式数 54,500株
紀文食品	11,800	1,032.00	12,177,600	貸付株式数 7,700株
ピクルスホールディングス	8,800	1,284.00	11,299,200	貸付株式数 4,900株
スター・マイカ・ホールディングス	13,600	615.00	8,364,000	貸付株式数 800株
SREホールディングス	7,400	3,580.00	26,492,000	貸付株式数 4,400株

A Dワークスグループ	29,600	203.00	6,008,800	貸付株式数 3,700株
片倉工業	14,100	1,609.00	22,686,900	貸付株式数 7,700株
グンゼ	10,900	4,370.00	47,633,000	
ヒューリック	352,300	1,223.00	430,862,900	
神栄	1,700	1,067.00	1,813,900	貸付株式数 1,100株
ラサ商事	5,800	1,461.00	8,473,800	貸付株式数 3,900株
アルペン	13,400	1,966.00	26,344,400	貸付株式数 7,300株 (4,600株)
ハブ	4,100	813.00	3,333,300	貸付株式数 2,200株
ラクーンホールディングス	12,700	702.00	8,915,400	貸付株式数 7,700株
クオールホールディングス	22,300	1,729.00	38,556,700	貸付株式数 2,500株
アルコニックス	21,300	1,373.00	29,244,900	
神戸物産	125,500	3,576.00	448,788,000	貸付株式数 66,400株
ソリトンシステムズ	7,900	1,248.00	9,859,200	貸付株式数 4,400株
ジンズホールディングス	9,600	3,250.00	31,200,000	貸付株式数 5,200株
ビックカメラ	86,300	1,059.00	91,391,700	貸付株式数 47,300株
D C Mホールディングス	94,300	1,185.00	111,745,500	貸付株式数 51,800株
ペッパーフードサービス	40,200	126.00	5,065,200	貸付株式数 25,800株
ハイパー	2,400	446.00	1,070,400	貸付株式数 1,600株
MonotaRO	230,000	1,774.00	408,020,000	
東京一番フーズ	2,900	506.00	1,467,400	貸付株式数 1,700株
DDグループ	8,100	1,334.00	10,805,400	貸付株式数 4,700株
あいホールディングス	26,000	2,233.00	58,058,000	貸付株式数 14,100株
ディーブイエックス	3,500	889.00	3,111,500	貸付株式数 2,300株
きちりホールディングス	3,000	855.00	2,565,000	貸付株式数 1,600株
アークランドサービスホールディングス	13,300	2,880.00	38,304,000	
J・フロントリテイリング	201,700	1,386.50	279,657,050	
ドトール・日レスホールディングス	28,800	2,063.00	59,414,400	貸付株式数 11,700株

マツキヨココカラ & カンパニー	98,400	7,914.00	778,737,600	
ブロンコビリー	8,600	2,713.00	23,331,800	貸付株式数 4,800株
Z O Z O	107,200	2,878.00	308,521,600	貸付株式数 9,000株
トレジャー・ファクトリー	7,800	1,704.00	13,291,200	貸付株式数 4,800株
物語コーポレーション	27,100	3,415.00	92,546,500	貸付株式数 15,000株
三越伊勢丹ホールディングス	273,100	1,468.00	400,910,800	
東洋紡	66,400	1,085.50	72,077,200	
ユニチカ	46,400	233.00	10,811,200	貸付株式数 12,300株
富士紡ホールディングス	6,000	3,170.00	19,020,000	
日清紡ホールディングス	126,100	1,212.00	152,833,200	貸付株式数 200株
倉敷紡績	11,500	2,246.00	25,829,000	
ダイワボウホールディングス	66,300	2,696.00	178,744,800	
シキボウ	6,600	1,020.00	6,732,000	貸付株式数 4,500株 (4,500株)
日東紡績	17,300	2,331.00	40,326,300	貸付株式数 8,100株
トヨタ紡織	64,600	2,604.50	168,250,700	
マクニカホールディングス	38,400	5,790.00	222,336,000	貸付株式数 300株
H a m e e	5,600	961.00	5,381,600	貸付株式数 3,600株
マーケットエンタープライズ	1,300	1,507.00	1,959,100	
ラクト・ジャパン	6,300	2,032.00	12,801,600	貸付株式数 3,400株
ウエルシアホールディングス	84,200	3,031.00	255,210,200	
クリエイトSDホールディングス	26,800	3,425.00	91,790,000	貸付株式数 15,900株
グリムス	6,800	2,948.00	20,046,400	貸付株式数 3,700株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	23,700	908.00	21,519,600	
八洲電機	13,100	1,351.00	17,698,100	貸付株式数 7,200株
メディアスホールディングス	10,400	788.00	8,195,200	貸付株式数 5,800株
レスターホールディングス	15,500	2,374.00	36,797,000	
ジューテックホールディングス	2,900	1,193.00	3,459,700	貸付株式数 1,500株
丸善CHIホールディングス	14,900	356.00	5,304,400	貸付株式数 9,300株
大光	5,300	591.00	3,132,300	貸付株式数 3,300株

OCCHIホールディングス	2,900	1,281.00	3,714,900	貸付株式数 1,800株
TOKAIホールディングス	80,100	889.00	71,208,900	貸付株式数 4,300株
黒谷	3,500	617.00	2,159,500	貸付株式数 2,000株
ミサワ	2,300	615.00	1,414,500	貸付株式数 1,200株
ティーライフ	1,700	1,610.00	2,737,000	貸付株式数 1,100株
Cominix	2,500	851.00	2,127,500	貸付株式数 1,600株
エー・ピーホールディングス	2,600	826.00	2,147,600	貸付株式数 1,700株
三洋貿易	18,300	1,342.00	24,558,600	貸付株式数 5,700株
チムニー	3,900	1,357.00	5,292,300	貸付株式数 2,500株
シュッピン	12,100	1,155.00	13,975,500	貸付株式数 7,000株
ビューティガレージ	2,600	4,535.00	11,791,000	貸付株式数 1,400株
オイシックス・ラ・大地	21,800	2,353.00	51,295,400	貸付株式数 13,300株
ウイン・パートナーズ	11,800	1,041.00	12,283,800	貸付株式数 5,400株
ネクステージ	37,000	3,700.00	136,900,000	貸付株式数 19,800株 (4,200株)
ジョイフル本田	47,200	1,635.00	77,172,000	貸付株式数 26,200株
鳥貴族ホールディングス	6,000	2,585.00	15,510,000	貸付株式数 3,300株
ホットランド	12,400	1,628.00	20,187,200	貸付株式数 1,900株
すかいらーくホールディングス	221,800	1,770.00	392,586,000	貸付株式数 122,100株
SFPホールディングス	8,900	2,141.00	19,054,900	貸付株式数 4,800株
綿半ホールディングス	12,500	1,345.00	16,812,500	貸付株式数 6,600株
日本毛織	40,500	1,020.00	41,310,000	貸付株式数 21,800株
ダイトウボウ	19,500	92.00	1,794,000	
トーア紡コーポレーション	4,700	442.00	2,077,400	
ダイドーリミテッド	17,200	301.00	5,177,200	貸付株式数 9,400株
ヨシックスホールディングス	2,500	2,517.00	6,292,500	貸付株式数 1,100株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	52,900	1,100.00	58,190,000	貸付株式数 29,400株

三栄建築設計	7,300	1,430.00	10,439,000	
野村不動産ホールディングス	94,400	3,450.00	325,680,000	
三重交通グループホールディングス	32,300	551.00	17,797,300	貸付株式数 17,600株
サムティ	24,000	2,240.00	53,760,000	貸付株式数 13,300株
ディア・ライフ	25,700	834.00	21,433,800	
コーセーアールイー	3,700	800.00	2,960,000	貸付株式数 2,000株
地主	11,500	1,869.00	21,493,500	貸付株式数 6,400株
プレサンスコーポレーション	23,800	2,000.00	47,600,000	貸付株式数 5,200株
フィル・カンパニー	2,700	947.00	2,556,900	貸付株式数 700株
THEグローバル社	6,800	285.00	1,938,000	貸付株式数 4,600株
ハウスコム	1,900	918.00	1,744,200	貸付株式数 1,200株
JPMC	7,600	1,090.00	8,284,000	
サンセイランディック	3,400	967.00	3,287,800	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
エストラスト	1,500	682.00	1,023,000	貸付株式数 800株
フージャースホールディングス	23,300	988.00	23,020,400	
オープンハウスグループ	55,300	4,984.00	275,615,200	
東急不動産ホールディングス	454,000	815.90	370,418,600	
飯田グループホールディングス	132,300	2,425.50	320,893,650	貸付株式数 76,200株
イーグランド	1,800	1,525.00	2,745,000	貸付株式数 300株
ムゲンエステート	7,800	708.00	5,522,400	貸付株式数 4,600株
帝国繊維	17,300	1,644.00	28,441,200	貸付株式数 9,600株
日本コークス工業	138,700	117.00	16,227,900	
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,300	801.00	5,847,300	貸付株式数 4,000株
ミタチ産業	3,200	1,359.00	4,348,800	貸付株式数 100株
B E E N O S	6,900	2,003.00	13,820,700	貸付株式数 4,600株
あさひ	13,500	1,250.00	16,875,000	貸付株式数 900株
日本調剤	11,000	1,181.00	12,991,000	貸付株式数 6,100株 (1,200株)
コスモス薬品	16,100	14,570.00	234,577,000	貸付株式数 10,100株

シップヘルスケアホールディングス	58,300	2,321.50	135,343,450	貸付株式数 34,400株
トーエル	5,600	738.00	4,132,800	貸付株式数 3,000株
ソフトクリエイトホールディングス	12,600	1,712.00	21,571,200	
セブン&アイ・ホールディングス	559,100	6,023.00	3,367,459,300	貸付株式数 305,300株
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	122,000	980.00	119,560,000	貸付株式数 78,800株
明治電機工業	6,000	1,451.00	8,706,000	貸付株式数 600株
ツルハホールディングス	34,100	10,695.00	364,699,500	貸付株式数 3,700株
デリカフーズホールディングス	4,900	601.00	2,944,900	貸付株式数 2,600株
スターティアホールディングス	2,500	1,324.00	3,310,000	貸付株式数 1,300株
サンマルクホールディングス	13,100	1,861.00	24,379,100	貸付株式数 7,100株
フェリシモ	2,800	1,006.00	2,816,800	貸付株式数 1,400株
トリドールホールディングス	40,300	3,185.00	128,355,500	貸付株式数 22,200株
帝人	147,600	1,476.00	217,857,600	
東レ	1,029,000	798.40	821,553,600	
クラレ	244,200	1,384.00	337,972,800	
旭化成	959,100	979.80	939,726,180	貸付株式数 98,400株 (98,400株)
T O K Y O B A S E	16,700	349.00	5,828,300	貸付株式数 9,200株
稲葉製作所	8,200	1,618.00	13,267,600	貸付株式数 5,100株
宮地エンジニアリンググループ	4,400	3,945.00	17,358,000	
トーカロ	42,100	1,441.00	60,666,100	貸付株式数 9,800株
アルファ	4,500	1,292.00	5,814,000	貸付株式数 2,800株
S U M C O	301,200	2,000.00	602,400,000	
川田テクノロジーズ	3,700	5,700.00	21,090,000	
R S T e c h n o l o g i e s	10,600	3,050.00	32,330,000	
ジェイテックコーポレーション	1,700	2,239.00	3,806,300	貸付株式数 1,000株
信和	6,800	761.00	5,174,800	
ビーロッド	8,000	718.00	5,744,000	貸付株式数 5,100株
ファーストブラザーズ	2,300	983.00	2,260,900	貸付株式数 1,500株
A n d D o ホールディングス	9,000	1,083.00	9,747,000	貸付株式数 4,800株

シーアールイー	8,400	1,352.00	11,356,800	貸付株式数 4,500株
プロパティエージェント	1,500	1,209.00	1,813,500	
ケイアイスター不動産	7,300	4,765.00	34,784,500	貸付株式数 4,600株
アグレ都市デザイン	2,100	1,581.00	3,320,100	貸付株式数 1,300株
グッドコムアセット	14,000	809.00	11,326,000	貸付株式数 7,700株
ジェイ・エス・ビー	3,700	4,965.00	18,370,500	貸付株式数 400株
ロードスターキャピタル	8,600	1,608.00	13,828,800	貸付株式数 4,700株
テンポイノベーション	3,500	1,150.00	4,025,000	
グローバル・リンク・マネジメント	2,200	1,486.00	3,269,200	貸付株式数 1,200株
フェイスネットワーク	3,200	1,508.00	4,825,600	貸付株式数 1,700株
住江織物	2,500	2,326.00	5,815,000	貸付株式数 1,500株
日本フェルト	6,600	416.00	2,745,600	
イチカワ	1,500	1,352.00	2,028,000	
エコナックホールディングス	21,200	96.00	2,035,200	
日東製網	1,300	1,386.00	1,801,800	
芦森工業	2,200	1,908.00	4,197,600	
アツギ	7,000	416.00	2,912,000	貸付株式数 3,100株
ウイルプラスホールディングス	2,000	1,228.00	2,456,000	貸付株式数 1,100株
J Mホールディングス	12,200	1,965.00	23,973,000	貸付株式数 6,600株
コメダホールディングス	39,800	2,682.00	106,743,600	貸付株式数 21,700株
サツドラホールディングス	5,700	778.00	4,434,600	貸付株式数 3,400株
アレンザホールディングス	12,100	985.00	11,918,500	貸付株式数 6,700株
串カツ田中ホールディングス	4,300	1,641.00	7,056,300	貸付株式数 2,300株
パロックジャパンリミテッド	10,500	885.00	9,292,500	貸付株式数 6,900株
クスリのアオキホールディングス	14,500	7,928.00	114,956,000	
ダイニック	3,100	775.00	2,402,500	貸付株式数 1,700株
共和レザー	6,900	593.00	4,091,700	
ピーバンドットコム	1,800	466.00	838,800	貸付株式数 900株
力の源ホールディングス	7,200	2,086.00	15,019,200	貸付株式数 3,900株

FOOD & LIFE COMPANIES	86,500	2,658.00	229,917,000	
アセンテック	5,400	676.00	3,650,400	
セーレン	29,600	2,433.00	72,016,800	貸付株式数 12,300株
ソトー	3,800	773.00	2,937,400	貸付株式数 2,300株
東海染工	1,200	1,087.00	1,304,400	貸付株式数 600株
小松マテーレ	22,300	672.00	14,985,600	
ワコールホールディングス	28,000	2,921.50	81,802,000	貸付株式数 6,000株
ホギメディカル	20,600	3,075.00	63,345,000	貸付株式数 3,500株
クラウディアホールディングス	2,700	837.00	2,259,900	貸付株式数 1,400株
T S Iホールディングス	51,700	805.00	41,618,500	貸付株式数 28,700株
マツオカコーポレーション	3,200	1,248.00	3,993,600	貸付株式数 1,700株
ワールド	19,700	1,715.00	33,785,500	
T I S	168,200	3,559.00	598,623,800	貸付株式数 19,200株
J N Sホールディングス	5,500	563.00	3,096,500	貸付株式数 3,600株
グリー	41,200	612.00	25,214,400	貸付株式数 23,900株
G M Oペパボ	2,200	1,705.00	3,751,000	貸付株式数 1,200株
コーエーテクモホールディングス	96,400	2,356.00	227,118,400	貸付株式数 53,300株
三菱総合研究所	7,500	5,330.00	39,975,000	貸付株式数 3,200株
ボルテージ	3,400	330.00	1,122,000	貸付株式数 2,300株
電算	1,400	1,596.00	2,234,400	貸付株式数 300株
A G S	5,000	736.00	3,680,000	
ファインデックス	12,200	613.00	7,478,600	貸付株式数 6,700株
ブレインパッド	11,500	935.00	10,752,500	貸付株式数 6,300株
K L a b	30,600	314.00	9,608,400	貸付株式数 16,600株 (13,900株)
ポルトウウィンホールディングス	26,300	746.00	19,619,800	貸付株式数 16,400株 (11,900株)
ネクソン	391,700	2,583.50	1,011,956,950	
アイスタイル	44,700	525.00	23,467,500	貸付株式数 24,800株

エムアップホールディングス	18,800	1,110.00	20,868,000	貸付株式数 10,300株
エイチーム	9,100	691.00	6,288,100	貸付株式数 6,200株
エニグモ	19,600	407.00	7,977,200	貸付株式数 10,900株
テクノスジャパン	9,800	672.00	6,585,600	貸付株式数 6,700株
e n i s h	9,000	341.00	3,069,000	貸付株式数 5,700株
コロプラ	59,700	632.00	37,730,400	貸付株式数 31,000株
オルトプラス	10,000	220.00	2,200,000	貸付株式数 6,200株
ブロードリーフ	89,800	430.00	38,614,000	貸付株式数 48,400株
クロス・マーケティンググループ	7,200	836.00	6,019,200	貸付株式数 3,900株
デジタルハーツホールディングス	9,600	1,304.00	12,518,400	貸付株式数 5,100株 (1,800株)
システム情報	12,200	753.00	9,186,600	貸付株式数 7,500株
メディアドゥ	6,100	1,440.00	8,784,000	貸付株式数 3,300株
じげん	44,800	762.00	34,137,600	貸付株式数 700株
ブイキューブ	18,400	464.00	8,537,600	貸付株式数 11,100株
エンカレッジ・テクノロジー	2,800	513.00	1,436,400	貸付株式数 1,900株
サイバーリンクス	3,800	732.00	2,781,600	貸付株式数 2,000株
ディー・エル・イー	8,500	264.00	2,244,000	貸付株式数 5,500株
フィックスターズ	17,400	1,421.00	24,725,400	
C A R T A H O L D I N G S	7,200	1,215.00	8,748,000	貸付株式数 4,000株
オブティム	12,600	967.00	12,184,200	貸付株式数 6,900株 (2,600株)
セレス	6,200	1,008.00	6,249,600	貸付株式数 3,400株
S H I F T	10,200	25,155.00	256,581,000	貸付株式数 1,000株
特種東海製紙	6,900	3,195.00	22,045,500	貸付株式数 3,700株
ティーガイア	16,100	1,714.00	27,595,400	貸付株式数 10,000株
セック	1,600	3,165.00	5,064,000	貸付株式数 700株

テクマトリックス	28,100	1,697.00	47,685,700	
プロシップ	6,700	1,372.00	9,192,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,000	2,686.00	120,870,000	貸付株式数 2,000株
GMOペイメントゲートウェイ	30,700	10,715.00	328,950,500	貸付株式数 2,500株
ザッパラス	3,300	347.00	1,145,100	貸付株式数 100株
システムリサーチ	4,800	2,679.00	12,859,200	
インターネットイニシアティブ	84,000	2,590.00	217,560,000	
さくらインターネット	17,300	1,211.00	20,950,300	貸付株式数 11,000株
ヴィンクス	3,600	1,340.00	4,824,000	貸付株式数 1,400株
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,700	2,980.00	14,006,000	貸付株式数 2,400株
SRAホールディングス	7,900	3,160.00	24,964,000	
システムインテグレータ	3,600	438.00	1,576,800	貸付株式数 2,300株
朝日ネット	16,500	634.00	10,461,000	
eBASE	21,600	723.00	15,616,800	貸付株式数 1,200株
アバントグループ	19,400	1,363.00	26,442,200	貸付株式数 100株
アドソル日進	6,500	1,657.00	10,770,500	貸付株式数 2,100株
ODKソリューションズ	2,600	562.00	1,461,200	貸付株式数 1,200株
フリービット	8,100	1,316.00	10,659,600	貸付株式数 4,800株
コムチュア	20,300	1,922.00	39,016,600	貸付株式数 1,500株
サイバーコム	1,900	1,430.00	2,717,000	貸付株式数 1,000株
アステリア	12,000	750.00	9,000,000	貸付株式数 6,700株
アイル	7,200	2,775.00	19,980,000	貸付株式数 3,900株
王子ホールディングス	639,800	517.40	331,032,520	貸付株式数 60,900株
日本製紙	80,000	1,184.00	94,720,000	貸付株式数 47,400株
三菱製紙	14,400	567.00	8,164,800	貸付株式数 7,800株
北越コーポレーション	97,000	825.00	80,025,000	貸付株式数 59,200株
中越パルプ工業	4,800	1,356.00	6,508,800	貸付株式数 2,600株
巴川製紙所	3,800	728.00	2,766,400	貸付株式数 2,500株

大王製紙	67,800	1,119.00	75,868,200	
阿波製紙	2,900	600.00	1,740,000	貸付株式数 1,900株
マークライNZ	8,300	2,375.00	19,712,500	
メディカル・データ・ビジョン	23,000	708.00	16,284,000	貸付株式数 12,500株
g u m i	22,600	699.00	15,797,400	貸付株式数 14,000株
ショーケース	2,800	374.00	1,047,200	貸付株式数 1,800株
モバイルファクトリー	2,500	848.00	2,120,000	貸付株式数 1,300株
テラスカイ	6,600	2,578.00	17,014,800	貸付株式数 3,600株
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,900	1,573.00	13,999,700	貸付株式数 4,800株
P C Iホールディングス	4,600	1,171.00	5,386,600	
アイビーシー	1,800	583.00	1,049,400	貸付株式数 1,200株
ネオジャパン	5,100	1,014.00	5,171,400	貸付株式数 2,800株
P R T I M E S	3,900	1,410.00	5,499,000	貸付株式数 2,100株
ラクス	72,700	2,283.00	165,974,100	
ランドコンピュータ	2,900	1,282.00	3,717,800	貸付株式数 1,900株
ダブルスタンダード	6,200	2,417.00	14,985,400	貸付株式数 3,400株
オープンドア	10,800	1,239.00	13,381,200	貸付株式数 5,900株
マイネット	3,800	338.00	1,284,400	貸付株式数 2,500株
アカツキ	7,300	2,018.00	14,731,400	貸付株式数 4,000株
ベネフィットジャパン	700	1,233.00	863,100	貸付株式数 400株
U b i c o mホールディングス	4,800	1,480.00	7,104,000	貸付株式数 2,500株
カナミックネットワーク	16,600	455.00	7,553,000	貸付株式数 500株
ノムラシステムコーポレーション	11,200	122.00	1,366,400	貸付株式数 7,600株
レンゴー	139,900	864.30	120,915,570	
トーモク	8,900	2,074.00	18,458,600	
ザ・パック	11,400	3,030.00	34,542,000	貸付株式数 6,200株
チェンジホールディングス	37,700	2,215.00	83,505,500	貸付株式数 21,900株
シンクロ・フード	7,600	682.00	5,183,200	貸付株式数 4,700株

オークネット	7,600	1,701.00	12,927,600	貸付株式数 4,200株
キャピタル・アセット・プランニング	2,300	802.00	1,844,600	貸付株式数 1,400株
セグエグループ	3,300	1,085.00	3,580,500	貸付株式数 2,200株
エイトレッド	1,800	1,435.00	2,583,000	貸付株式数 700株
マクロミル	30,200	809.00	24,431,800	貸付株式数 16,600株
ピーグリー	2,000	1,120.00	2,240,000	貸付株式数 1,300株
オロ	4,600	1,941.00	8,928,600	貸付株式数 2,500株
ユーザーローカル	5,500	2,407.00	13,238,500	貸付株式数 3,500株
テモナ	2,700	296.00	799,200	貸付株式数 1,500株
ニーズウェル	6,500	774.00	5,031,000	貸付株式数 3,500株
マネーフォワード	37,200	5,544.00	206,236,800	貸付株式数 15,800株
サインポスト	4,600	545.00	2,507,000	貸付株式数 3,100株
レゾナック・ホールディングス	148,400	2,285.50	339,168,200	貸付株式数 84,500株
住友化学	1,139,400	435.70	496,436,580	貸付株式数 632,900株
住友精化	6,400	4,425.00	28,320,000	
日産化学	72,600	6,117.00	444,094,200	
ラサ工業	5,900	2,110.00	12,449,000	
クレハ	13,100	8,200.00	107,420,000	貸付株式数 3,200株
多木化学	6,000	4,105.00	24,630,000	貸付株式数 3,300株
テイカ	10,300	1,355.00	13,956,500	
石原産業	27,800	1,267.00	35,222,600	
片倉コープアグリ	2,400	1,221.00	2,930,400	
日本曹達	16,500	5,120.00	84,480,000	貸付株式数 800株
東ソー	205,000	1,688.00	346,040,000	
トクヤマ	49,600	2,355.00	116,808,000	貸付株式数 27,800株
セントラル硝子	24,600	3,100.00	76,260,000	
東亜合成	77,000	1,296.00	99,792,000	
大阪ソーダ	9,200	5,560.00	51,152,000	貸付株式数 5,000株
関東電化工業	29,700	986.00	29,284,200	貸付株式数 16,200株

SUN A S T E R I S K	10,900	1,207.00	13,156,300	貸付株式数 5,900株
デンカ	55,900	2,692.50	150,510,750	
イビデン	88,800	8,155.00	724,164,000	貸付株式数 12,600株
信越化学工業	1,276,700	4,597.00	5,868,989,900	貸付株式数 731,400株
日本カーバイド工業	4,500	1,424.00	6,408,000	
電算システムホールディングス	7,400	3,095.00	22,903,000	貸付株式数 4,100株
堺化学工業	11,700	1,900.00	22,230,000	貸付株式数 3,800株
第一稀元素化学工業	14,000	969.00	13,566,000	貸付株式数 7,700株
エア・ウォーター	144,900	1,956.00	283,424,400	
日本酸素ホールディングス	149,000	3,083.00	459,367,000	貸付株式数 74,100株
日本化学工業	5,100	1,919.00	9,786,900	
東邦アセチレン	2,500	1,416.00	3,540,000	貸付株式数 1,500株
日本パーカライズング	76,000	1,058.00	80,408,000	
高圧ガス工業	22,300	714.00	15,922,200	
チタン工業	1,500	1,388.00	2,082,000	
四国化成ホールディングス	18,200	1,444.00	26,280,800	
戸田工業	3,500	2,272.00	7,952,000	貸付株式数 1,800株
ステラ ケミファ	9,100	3,085.00	28,073,500	貸付株式数 4,900株
保土谷化学工業	4,300	3,395.00	14,598,500	
日本触媒	23,400	5,311.00	124,277,400	
大日精化工業	10,700	2,120.00	22,684,000	
カネカ	35,100	4,014.00	140,891,400	貸付株式数 19,100株
協和キリン	185,800	2,624.50	487,632,100	
A P P I E R G R O U P	58,300	1,727.00	100,684,100	
三菱瓦斯化学	114,700	2,127.50	244,024,250	
三井化学	126,600	4,128.00	522,604,800	
J S R	143,200	4,099.00	586,976,800	貸付株式数 1,800株
東京応化工業	26,900	8,682.00	233,545,800	貸付株式数 3,100株
大阪有機化学工業	11,600	2,883.00	33,442,800	貸付株式数 5,000株
三菱ケミカルグループ	1,036,400	851.10	882,080,040	
K H ネオケム	25,600	2,283.00	58,444,800	貸付株式数 700株
ダイセル	213,900	1,298.00	277,642,200	
住友ベークライト	22,700	5,619.00	127,551,300	貸付株式数 12,400株
積水化学工業	311,400	2,020.50	629,183,700	

日本ゼオン	92,100	1,366.00	125,808,600	貸付株式数 50,300株
アイカ工業	38,800	3,120.00	121,056,000	貸付株式数 23,300株
UBE	79,200	2,495.50	197,643,600	
積水樹脂	21,300	2,239.00	47,690,700	貸付株式数 8,100株
タキロンシーアイ	33,600	569.00	19,118,400	貸付株式数 18,400株
旭有機材	10,200	4,305.00	43,911,000	
ニチバン	9,500	1,873.00	17,793,500	貸付株式数 2,700株 (500株)
リケンテクノス	33,100	645.00	21,349,500	
大倉工業	7,100	2,179.00	15,470,900	貸付株式数 3,900株
積水化成成品工業	21,600	446.00	9,633,600	貸付株式数 2,000株
群栄化学工業	3,600	2,868.00	10,324,800	
タイガースポリマー	5,400	694.00	3,747,600	
ミライアル	3,700	1,598.00	5,912,600	貸付株式数 2,500株
ダイキアクシス	4,400	714.00	3,141,600	貸付株式数 2,900株
ダイキョーニシカワ	33,900	778.00	26,374,200	貸付株式数 200株
竹本容器	4,000	822.00	3,288,000	貸付株式数 2,200株
森六ホールディングス	7,800	2,072.00	16,161,600	貸付株式数 4,200株
恵和	9,900	1,080.00	10,692,000	貸付株式数 5,400株
日本化薬	117,300	1,196.00	140,290,800	貸付株式数 1,200株
カーリットホールディングス	13,800	807.00	11,136,600	
ソルクシーズ	9,700	426.00	4,132,200	貸付株式数 6,400株
CLホールディングス	4,400	809.00	3,559,600	貸付株式数 2,400株
プレステージ・インターナショナル	66,300	588.00	38,984,400	貸付株式数 36,100株
フェイス	3,300	511.00	1,686,300	
プロトコーポレーション	19,200	1,176.00	22,579,200	
ハイマックス	4,800	1,398.00	6,710,400	貸付株式数 2,600株
アミューズ	8,500	1,779.00	15,121,500	貸付株式数 3,200株
野村総合研究所	306,400	3,824.00	1,171,673,600	貸付株式数 18,800株

ドリームインキュベータ	4,800	2,761.00	13,252,800	貸付株式数 2,400株
サイバネットシステム	12,900	815.00	10,513,500	貸付株式数 7,200株 (7,200株)
クイック	12,000	2,257.00	27,084,000	
T A C	5,900	202.00	1,191,800	貸付株式数 700株
C Eホールディングス	6,200	656.00	4,067,200	
日本システム技術	5,000	2,454.00	12,270,000	
電通グループ	154,900	4,600.00	712,540,000	
インテージホールディングス	17,400	1,599.00	27,822,600	貸付株式数 7,400株
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,700	1,180.00	5,546,000	貸付株式数 2,800株
東邦システムサイエンス	3,300	1,209.00	3,989,700	貸付株式数 1,500株
ぴあ	5,300	3,280.00	17,384,000	貸付株式数 2,900株
イオンファンタジー	6,800	3,150.00	21,420,000	貸付株式数 3,400株
ソースネクスト	78,200	193.00	15,092,600	貸付株式数 48,200株
シーティーエス	17,400	737.00	12,823,800	貸付株式数 600株 (600株)
ネクシィーズグループ	3,800	639.00	2,428,200	
インフォコム	19,800	2,223.00	44,015,400	
メディカルシステムネットワーク	14,100	366.00	5,160,600	
日本精化	8,700	2,922.00	25,421,400	貸付株式数 4,500株
扶桑化学工業	14,300	4,500.00	64,350,000	貸付株式数 7,800株
トリケミカル研究所	20,500	2,719.00	55,739,500	貸付株式数 8,000株
シンプレクス・ホールディングス	26,300	2,541.00	66,828,300	貸付株式数 3,800株
H E R O Z	5,200	1,999.00	10,394,800	貸付株式数 3,300株
ラクスル	36,900	1,456.00	53,726,400	貸付株式数 7,200株
メルカリ	92,600	3,340.00	309,284,000	
I P S	5,000	2,279.00	11,395,000	貸付株式数 2,700株
F I G	13,800	276.00	3,808,800	貸付株式数 9,400株
システムサポート	6,000	2,036.00	12,216,000	
A D E K A	53,600	2,744.50	147,105,200	
日油	47,500	5,880.00	279,300,000	
ミヨシ油脂	4,100	1,025.00	4,202,500	

新日本理化	16,500	239.00	3,943,500	貸付株式数 11,200株
ハリマ化成グループ	8,400	873.00	7,333,200	貸付株式数 4,700株
イーソル	9,800	853.00	8,359,400	貸付株式数 5,500株
アルテリア・ネットワークス	14,200	1,976.00	28,059,200	
東海ソフト	1,800	1,125.00	2,025,000	貸付株式数 900株
ウイングアーク1st	15,900	2,282.00	36,283,800	貸付株式数 3,300株
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,100	1,505.00	6,170,500	貸付株式数 2,200株
サーバーワークス	3,100	2,884.00	8,940,400	貸付株式数 1,600株
東名	900	2,652.00	2,386,800	貸付株式数 500株
ヴィッツ	1,200	1,458.00	1,749,600	貸付株式数 600株
トピラシステムズ	3,000	927.00	2,781,000	貸付株式数 1,900株
Sansan	50,300	1,508.50	75,877,550	
Link-U	2,800	1,013.00	2,836,400	貸付株式数 1,400株
ギフトィ	16,800	1,725.00	28,980,000	貸付株式数 9,100株
花王	374,000	5,358.00	2,003,892,000	
第一工業製薬	5,500	1,834.00	10,087,000	
石原ケミカル	7,000	1,637.00	11,459,000	
日華化学	4,800	849.00	4,075,200	貸付株式数 3,000株
ニイタカ	2,100	2,067.00	4,340,700	貸付株式数 1,400株
三洋化成工業	9,400	4,200.00	39,480,000	
メドレー	20,600	5,210.00	107,326,000	貸付株式数 200株
ベース	5,200	5,350.00	27,820,000	
JMDC	25,300	5,499.00	139,124,700	貸付株式数 13,800株
武田薬品工業	1,361,000	4,410.00	6,002,010,000	貸付株式数 893,600株
アステラス製薬	1,452,700	2,061.00	2,994,014,700	貸付株式数 798,600株
住友ファーマ	114,100	661.90	75,522,790	
塩野義製薬	193,900	5,919.00	1,147,694,100	
わかもと製薬	11,200	232.00	2,598,400	貸付株式数 900株
日本新薬	36,300	5,424.00	196,891,200	貸付株式数 100株
中外製薬	481,400	3,907.00	1,880,829,800	

科研製薬	26,300	3,545.00	93,233,500	貸付株式数 4,300株
エーザイ	187,100	9,382.00	1,755,372,200	貸付株式数 29,800株
理研ビタミン	13,000	2,018.00	26,234,000	貸付株式数 7,100株
ロート製薬	149,000	3,134.00	466,966,000	
小野薬品工業	296,700	2,527.00	749,760,900	貸付株式数 168,200株
久光製薬	34,200	3,697.00	126,437,400	貸付株式数 21,500株
有機合成薬品工業	8,800	309.00	2,719,200	
持田製薬	17,700	3,210.00	56,817,000	貸付株式数 9,600株
参天製薬	280,200	1,210.00	339,042,000	貸付株式数 161,200株
扶桑薬品工業	4,900	1,988.00	9,741,200	
日本ケミファ	1,200	1,894.00	2,272,800	
ツムラ	48,400	2,638.50	127,703,400	貸付株式数 200株
テルモ	471,600	4,321.00	2,037,783,600	貸付株式数 267,900株
H.U.グループホールディングス	46,100	2,699.00	124,423,900	貸付株式数 10,100株
キッセイ薬品工業	23,800	2,946.00	70,114,800	
生化学工業	29,300	743.00	21,769,900	貸付株式数 800株
栄研化学	25,000	1,538.00	38,450,000	貸付株式数 2,700株
鳥居薬品	8,300	3,620.00	30,046,000	貸付株式数 100株
JCRファーマ	52,100	1,232.00	64,187,200	貸付株式数 29,200株
東和薬品	23,600	1,737.00	40,993,200	貸付株式数 13,200株
富士製薬工業	11,400	1,129.00	12,870,600	
ゼリア新薬工業	21,300	2,353.00	50,118,900	貸付株式数 700株
そーせいグループ	52,800	1,506.00	79,516,800	貸付株式数 33,900株
第一三共	1,339,700	4,133.00	5,536,980,100	貸付株式数 772,900株
杏林製薬	33,300	1,722.00	57,342,600	貸付株式数 18,200株
大幸薬品	30,000	351.00	10,530,000	貸付株式数 16,400株
ダイト	10,700	2,215.00	23,700,500	
大塚ホールディングス	351,800	5,216.00	1,834,988,800	貸付株式数 500株

大正製薬ホールディングス	34,200	5,324.00	182,080,800	貸付株式数 11,200株
ペプチドリーム	74,500	1,985.00	147,882,500	貸付株式数 2,800株
大日本塗料	18,700	929.00	17,372,300	貸付株式数 9,400株
日本ペイントホールディングス	679,600	1,129.50	767,608,200	
関西ペイント	140,700	2,090.00	294,063,000	貸付株式数 67,300株
神東塗料	10,000	124.00	1,240,000	貸付株式数 200株
中国塗料	25,200	1,178.00	29,685,600	
日本特殊塗料	7,600	1,123.00	8,534,800	
藤倉化成	20,600	459.00	9,455,400	
太陽ホールディングス	23,400	2,654.00	62,103,600	貸付株式数 5,300株
D I C	60,000	2,623.00	157,380,000	貸付株式数 6,700株
サカタインクス	34,200	1,233.00	42,168,600	貸付株式数 5,000株
東洋インキS Cホールディングス	30,100	2,126.00	63,992,600	
T & K T O K A	13,600	1,174.00	15,966,400	貸付株式数 4,200株 (2,100株)
アルプス技研	13,700	2,787.00	38,181,900	貸付株式数 7,300株
サニックス	25,200	337.00	8,492,400	貸付株式数 13,900株
日本空調サービス	16,900	742.00	12,539,800	
オリエンタルランド	834,200	5,569.00	4,645,659,800	貸付株式数 442,800株
フォーカスシステムズ	11,200	1,028.00	11,513,600	
ダスキン	35,100	3,202.00	112,390,200	貸付株式数 19,200株
パーク24	117,700	1,822.50	214,508,250	貸付株式数 50,000株
明光ネットワークジャパン	19,100	645.00	12,319,500	貸付株式数 11,400株 (4,700株)
ファルコホールディングス	7,100	1,842.00	13,078,200	貸付株式数 3,700株 (3,400株)
クレスコ	11,900	1,946.00	23,157,400	
フジ・メディア・ホールディングス	147,700	1,551.00	229,082,700	貸付株式数 95,000株
秀英予備校	2,700	411.00	1,109,700	貸付株式数 100株
田谷	2,000	481.00	962,000	貸付株式数 900株
ラウンドワン	131,800	592.00	78,025,600	

リゾートトラスト	62,200	2,143.00	133,294,600	貸付株式数 17,500株
オービック	51,400	22,515.00	1,157,271,000	
ジャストシステム	22,100	3,932.00	86,897,200	
TDCソフト	13,000	1,751.00	22,763,000	
Zホールディングス	2,188,500	368.60	806,681,100	
ビー・エム・エル	19,400	2,771.00	53,757,400	貸付株式数 8,300株
トレンドマイクロ	88,800	6,821.00	605,704,800	貸付株式数 53,900株
りらいあコミュニケーションズ	25,800	1,462.00	37,719,600	
IDホールディングス	10,400	1,254.00	13,041,600	
リソー教育	71,700	266.00	19,072,200	貸付株式数 39,400株
日本オラクル	29,400	10,035.00	295,029,000	貸付株式数 16,600株
早稲田アカデミー	8,700	1,326.00	11,536,200	貸付株式数 4,800株
アルファシステムズ	4,800	3,315.00	15,912,000	貸付株式数 200株
フューチャー	38,300	1,718.00	65,799,400	
CAC Holdings	9,400	1,654.00	15,547,600	
SBテクノロジー	6,500	2,656.00	17,264,000	
トーセ	3,400	753.00	2,560,200	貸付株式数 2,200株 (1,000株)
ユー・エス・エス	162,100	2,367.00	383,690,700	
オービックビジネスコンサルタント	30,300	5,160.00	156,348,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	82,600	3,529.00	291,495,400	貸付株式数 14,500株
アイティフォー	20,300	1,063.00	21,578,900	
東京個別指導学院	18,700	506.00	9,462,200	貸付株式数 10,200株
東計電算	2,100	6,080.00	12,768,000	貸付株式数 1,000株
サイバーエージェント	348,200	1,013.50	352,900,700	貸付株式数 160,800株
楽天グループ	946,600	528.90	500,656,740	貸付株式数 590,000株 (104,900株)
エクスネット	1,700	1,015.00	1,725,500	貸付株式数 1,000株
クリーク・アンド・リバー社	9,200	2,018.00	18,565,600	貸付株式数 5,000株
SBIグローバルアセットマネジメント	25,700	514.00	13,209,800	貸付株式数 13,900株
テー・オー・ダブリュー	30,900	308.00	9,517,200	貸付株式数 16,200株
大塚商会	87,200	5,478.00	477,681,600	貸付株式数 900株

サイボウズ	21,200	2,236.00	47,403,200	貸付株式数 1,000株
山田コンサルティンググループ	8,000	1,585.00	12,680,000	貸付株式数 2,800株
セントラルスポーツ	5,900	2,352.00	13,876,800	貸付株式数 3,400株
パラカ	5,300	1,934.00	10,250,200	貸付株式数 2,700株
電通国際情報サービス	18,700	5,120.00	95,744,000	
A C C E S S	18,200	926.00	16,853,200	
デジタルガレージ	27,300	4,065.00	110,974,500	貸付株式数 500株
イーエムシステムズ	25,600	793.00	20,300,800	貸付株式数 15,800株 (1,800株)
ウェザーニューズ	4,800	6,510.00	31,248,000	貸付株式数 3,000株
C I J	25,500	565.00	14,407,500	貸付株式数 14,000株 (10,800株)
ビジネスエンジニアリング	2,500	3,125.00	7,812,500	貸付株式数 1,100株
日本エンタープライズ	12,400	146.00	1,810,400	貸付株式数 8,300株
WOWOW	11,600	1,128.00	13,084,800	貸付株式数 2,600株
スカラ	14,200	741.00	10,522,200	
インテリジェント ウェイブ	6,300	754.00	4,750,200	貸付株式数 4,000株
フルキャストホールディングス	15,000	2,259.00	33,885,000	
エン・ジャパン	28,500	2,429.00	69,226,500	貸付株式数 1,800株
あすか製薬ホールディングス	15,800	1,417.00	22,388,600	
サワイグループホールディングス	35,200	3,644.00	128,268,800	貸付株式数 19,400株
富士フイルムホールディングス	295,100	8,298.00	2,448,739,800	貸付株式数 165,400株
コニカミノルタ	345,900	498.80	172,534,920	貸付株式数 2,700株
資生堂	321,100	6,290.00	2,019,719,000	
ライオン	184,500	1,339.50	247,137,750	
高砂香料工業	10,400	2,662.00	27,684,800	
マンダム	33,200	1,385.00	45,982,000	貸付株式数 18,400株
ミルボン	22,800	4,908.00	111,902,400	貸付株式数 400株
ファンケル	67,300	2,522.50	169,764,250	貸付株式数 4,200株
コーセー	31,300	13,575.00	424,897,500	貸付株式数 2,100株

コタ	14,200	1,607.00	22,819,400	貸付株式数 1,200株
シーボン	1,500	1,553.00	2,329,500	貸付株式数 600株
ポーラ・オルビスホールディングス	78,800	2,128.00	167,686,400	貸付株式数 34,600株
ノエビアホールディングス	13,700	5,450.00	74,665,000	貸付株式数 1,400株
アジュバンホールディングス	2,900	938.00	2,720,200	貸付株式数 1,600株
新日本製薬	8,800	1,396.00	12,284,800	貸付株式数 4,600株
アクシージア	7,800	1,317.00	10,272,600	貸付株式数 4,100株
エステー	11,900	1,493.00	17,766,700	貸付株式数 1,100株
アグロ カネショウ	6,100	1,636.00	9,979,600	貸付株式数 3,200株
コニシ	25,700	2,170.00	55,769,000	貸付株式数 1,600株
長谷川香料	29,400	3,400.00	99,960,000	貸付株式数 9,200株
星光PMC	6,100	579.00	3,531,900	貸付株式数 4,200株
小林製薬	44,800	7,609.00	340,883,200	
荒川化学工業	13,000	989.00	12,857,000	
メック	12,700	3,640.00	46,228,000	貸付株式数 6,900株
日本高純度化学	3,800	2,519.00	9,572,200	
タカラバイオ	41,400	1,618.00	66,985,200	貸付株式数 13,500株
JCU	17,200	3,300.00	56,760,000	貸付株式数 7,200株
新田ゼラチン	7,400	736.00	5,446,400	貸付株式数 4,000株
OATアグリオ	4,900	1,954.00	9,574,600	
デクセリアルズ	42,000	3,088.00	129,696,000	貸付株式数 23,000株
アース製薬	13,900	4,960.00	68,944,000	貸付株式数 4,100株
北興化学工業	15,500	1,011.00	15,670,500	貸付株式数 8,400株
大成ラミック	4,800	2,926.00	14,044,800	
クミアイ化学工業	61,100	1,079.00	65,926,900	
日本農薬	28,200	699.00	19,711,800	
富士興産	2,800	1,614.00	4,519,200	貸付株式数 1,900株
ニチレキ	18,200	1,875.00	34,125,000	
ユシロ化学工業	8,000	1,042.00	8,336,000	

ピーピー・カストロール	4,600	872.00	4,011,200	貸付株式数 2,500株
富士石油	31,400	273.00	8,572,200	
MORESCO	3,900	1,175.00	4,582,500	貸付株式数 900株
出光興産	170,800	2,889.00	493,441,200	貸付株式数 1,700株
ENEOSホールディングス	2,608,600	496.90	1,296,213,340	
コスモエネルギーホールディングス	60,800	3,946.00	239,916,800	貸付株式数 400株
テスホールディングス	32,400	727.00	23,554,800	貸付株式数 21,000株 (1,000株)
インフロニア・ホールディングス	157,600	1,331.00	209,765,600	貸付株式数 100株
横浜ゴム	87,500	3,075.00	269,062,500	貸付株式数 52,400株
TOYO TIRE	88,400	1,869.00	165,219,600	
ブリヂストン	491,100	5,750.00	2,823,825,000	貸付株式数 100株
住友ゴム工業	150,800	1,397.00	210,667,600	貸付株式数 14,700株
藤倉コンポジット	8,500	967.00	8,219,500	
オカモト	8,300	3,880.00	32,204,000	
アキレス	9,700	1,437.00	13,938,900	貸付株式数 2,700株
フコク	8,100	1,456.00	11,793,600	
ニッタ	15,600	3,120.00	48,672,000	
クリエートメディック	3,900	884.00	3,447,600	
住友理工	29,800	834.00	24,853,200	
三ツ星ベルト	22,400	4,500.00	100,800,000	
バンドー化学	24,400	1,450.00	35,380,000	
AGC	156,500	4,959.00	776,083,500	貸付株式数 96,200株
日本板硝子	78,400	645.00	50,568,000	貸付株式数 41,100株
石塚硝子	1,900	1,586.00	3,013,400	貸付株式数 1,100株
有沢製作所	25,000	1,106.00	27,650,000	貸付株式数 13,600株
日本山村硝子	4,500	1,116.00	5,022,000	
日本電気硝子	62,800	2,506.50	157,408,200	貸付株式数 36,600株
オハラ	7,300	1,430.00	10,439,000	貸付株式数 4,000株
住友大阪セメント	21,700	3,646.00	79,118,200	貸付株式数 700株
太平洋セメント	97,900	2,777.00	271,868,300	

リソルホールディングス	1,100	4,780.00	5,258,000	貸付株式数 700株 (100株)
日本ヒューム	13,500	732.00	9,882,000	貸付株式数 400株
日本コンクリート工業	29,800	325.00	9,685,000	貸付株式数 16,600株 (16,600株)
三谷セキサン	6,400	4,415.00	28,256,000	貸付株式数 300株
アジアパイルホールディングス	24,000	605.00	14,520,000	
東海カーボン	129,000	1,274.00	164,346,000	
日本カーボン	8,800	4,190.00	36,872,000	
東洋炭素	9,600	5,230.00	50,208,000	貸付株式数 5,300株
ノリタケカンパニーリミテド	7,700	5,440.00	41,888,000	
TOTO	101,500	4,197.00	425,995,500	貸付株式数 52,500株 (52,500株)
日本碍子	178,800	1,654.50	295,824,600	貸付株式数 18,100株
日本特殊陶業	117,100	2,936.00	343,805,600	
ダントーホールディングス	8,400	772.00	6,484,800	貸付株式数 4,700株
MARUWA	5,700	21,980.00	125,286,000	貸付株式数 3,100株
品川リフクトリーズ	4,300	5,570.00	23,951,000	
黒崎播磨	3,100	8,860.00	27,466,000	
ヨータイ	8,300	1,435.00	11,910,500	貸付株式数 100株
東京窯業	11,000	349.00	3,839,000	
ニッカトー	5,400	669.00	3,612,600	
フジインコーポレーテッド	36,700	3,485.00	127,899,500	貸付株式数 8,700株
クニミネ工業	3,500	1,018.00	3,563,000	
エーアンドエーマテリアル	2,200	1,104.00	2,428,800	貸付株式数 100株
ニチアス	38,900	2,907.00	113,082,300	貸付株式数 700株
日本製鉄	708,400	2,993.50	2,120,595,400	貸付株式数 243,400株 (243,400株)
神戸製鋼所	318,200	1,395.00	443,889,000	
中山製鋼所	32,600	857.00	27,938,200	
合同製鐵	7,900	3,680.00	29,072,000	
JFEホールディングス	422,800	1,989.50	841,160,600	
東京製鐵	44,500	1,301.00	57,894,500	
共英製鋼	18,000	1,973.00	35,514,000	貸付株式数 7,400株
大和工業	26,100	6,121.00	159,758,100	

東京鐵鋼	7,500	3,250.00	24,375,000	貸付株式数 4,100株
大阪製鐵	7,300	1,373.00	10,022,900	貸付株式数 4,000株
淀川製鋼所	18,000	3,245.00	58,410,000	
中部鋼鈹	13,000	1,878.00	24,414,000	貸付株式数 7,000株
丸一鋼管	48,200	3,215.00	154,963,000	
モリ工業	2,800	3,410.00	9,548,000	貸付株式数 500株
大同特殊鋼	19,900	5,952.00	118,444,800	貸付株式数 10,300株
日本高周波鋼業	4,100	366.00	1,500,600	貸付株式数 600株
日本冶金工業	11,600	4,195.00	48,662,000	貸付株式数 6,300株
山陽特殊製鋼	15,600	2,772.00	43,243,200	貸付株式数 4,600株
愛知製鋼	9,100	3,120.00	28,392,000	
日本金属	2,700	950.00	2,565,000	貸付株式数 1,400株
大平洋金属	11,200	1,520.00	17,024,000	貸付株式数 7,000株
新日本電工	94,400	282.00	26,620,800	貸付株式数 34,000株
栗本鐵工所	7,500	2,286.00	17,145,000	
虹 技	1,500	1,220.00	1,830,000	
日本鑄鉄管	1,200	1,075.00	1,290,000	
日本製鋼所	42,700	2,989.50	127,651,650	貸付株式数 100株
三菱製鋼	9,900	1,443.00	14,285,700	
日垂鋼業	12,500	320.00	4,000,000	貸付株式数 6,800株
日本精線	2,200	4,860.00	10,692,000	貸付株式数 1,300株
エンピプロ・ホールディングス	8,500	542.00	4,607,000	貸付株式数 5,300株
大紀アルミニウム工業所	22,500	1,464.00	32,940,000	
日本輕金属ホールディングス	42,700	1,456.00	62,171,200	貸付株式数 8,000株
三井金属鈹業	46,000	3,248.00	149,408,000	貸付株式数 8,700株
東邦亜鉛	9,300	1,701.00	15,819,300	貸付株式数 5,000株
三菱マテリアル	105,600	2,534.00	267,590,400	
住友金属鈹山	183,400	4,577.00	839,421,800	貸付株式数 62,400株
DOWAホールディングス	35,500	4,516.00	160,318,000	貸付株式数 23,200株
古河機械金属	23,200	1,522.00	35,310,400	

エス・サイエンス	73,900	24.00	1,773,600	貸付株式数 34,500株
大阪チタニウムテクノロジーズ	23,200	3,045.00	70,644,000	貸付株式数 14,800株
東邦チタニウム	28,600	1,667.00	47,676,200	貸付株式数 18,800株
U A C J	22,200	2,743.00	60,894,600	貸付株式数 12,100株
C Kサンエツ	3,800	4,125.00	15,675,000	
古河電気工業	52,700	2,556.50	134,727,550	貸付株式数 500株
住友電気工業	546,300	1,716.00	937,450,800	貸付株式数 307,500株
フジクラ	169,600	1,178.00	199,788,800	貸付株式数 13,700株
S W C C	17,700	1,936.00	34,267,200	貸付株式数 1,300株
タツタ電線	31,900	706.00	22,521,400	
カナレ電気	1,900	1,354.00	2,572,600	貸付株式数 900株
平河ヒューテック	9,100	1,563.00	14,223,300	貸付株式数 5,000株
いよぎんホールディングス	179,700	828.90	148,953,330	貸付株式数 36,900株
しずおかフィナンシャルグループ	335,500	1,046.50	351,100,750	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	127,100	879.40	111,771,740	
楽天銀行	52,500	1,866.00	97,965,000	貸付株式数 28,800株
リョービ	16,800	2,065.00	34,692,000	貸付株式数 400株
アーレスティ	13,600	695.00	9,452,000	
A R E ホールディングス	64,000	1,920.00	122,880,000	貸付株式数 2,100株
東洋製罐グループホールディングス	94,400	2,089.50	197,248,800	貸付株式数 28,100株
ホッカンホールディングス	8,500	1,383.00	11,755,500	貸付株式数 100株
コロナ	8,800	905.00	7,964,000	
横河ブリッジホールディングス	19,800	2,526.00	50,014,800	貸付株式数 4,700株
駒井ハルテック	2,000	1,859.00	3,718,000	
高田機工	1,000	2,707.00	2,707,000	貸付株式数 500株
三和ホールディングス	145,700	1,849.00	269,399,300	貸付株式数 21,300株
文化シャッター	45,500	1,086.00	49,413,000	貸付株式数 30,000株 (6,300株)
三協立山	18,100	807.00	14,606,700	

アルインコ	12,100	990.00	11,979,000	貸付株式数 6,600株
東洋シャッター	2,800	621.00	1,738,800	貸付株式数 100株
L I X I L	230,500	1,793.50	413,401,750	
日本ファイルコン	8,000	467.00	3,736,000	貸付株式数 5,100株
ノーリツ	23,300	1,689.00	39,353,700	
長府製作所	15,900	2,500.00	39,750,000	貸付株式数 8,500株
リンナイ	86,000	3,049.00	262,214,000	貸付株式数 2,900株
ユニプレス	27,500	1,135.00	31,212,500	貸付株式数 14,700株
ダイニチ工業	6,100	727.00	4,434,700	貸付株式数 2,200株
日東精工	22,900	619.00	14,175,100	貸付株式数 100株
三洋工業	1,400	1,954.00	2,735,600	
岡部	25,400	737.00	18,719,800	貸付株式数 14,100株
ジーテクト	17,600	1,795.00	31,592,000	
東ブレ	27,900	1,606.00	44,807,400	貸付株式数 10,200株
高周波熱錬	24,400	982.00	23,960,800	貸付株式数 4,400株 (4,400株)
東京製綱	9,300	1,155.00	10,741,500	
サンコール	10,900	536.00	5,842,400	
モリテックスチール	9,100	288.00	2,620,800	貸付株式数 6,200株
パイオラックス	21,800	2,191.00	47,763,800	貸付株式数 300株
エイチワン	16,300	818.00	13,333,400	
日本発条	139,900	1,046.50	146,405,350	貸付株式数 3,500株
中央発條	11,700	694.00	8,119,800	貸付株式数 4,900株 (4,900株)
アドパネクス	1,500	1,000.00	1,500,000	貸付株式数 1,000株
三浦工業	64,700	3,577.00	231,431,900	貸付株式数 15,100株
タクマ	47,600	1,421.00	67,639,600	
テクノプロ・ホールディングス	93,300	3,104.00	289,603,200	
アトラグループ	2,800	179.00	501,200	貸付株式数 1,800株
インターワークス	3,100	334.00	1,035,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	8,200	1,699.00	13,931,800	貸付株式数 4,300株

Keepers 技研	9,700	5,430.00	52,671,000	貸付株式数 4,800株
ファーストロジック	1,400	1,009.00	1,412,600	貸付株式数 900株
三機サービス	1,800	1,240.00	2,232,000	貸付株式数 1,100株
Gunosy	12,500	602.00	7,525,000	貸付株式数 6,800株 (2,100株)
デザインワン・ジャパン	3,000	178.00	534,000	貸付株式数 1,600株
イー・ガーディアン	6,000	2,080.00	12,480,000	貸付株式数 3,300株
リブセンス	5,700	295.00	1,681,500	貸付株式数 3,900株
ジャパンマテリアル	48,200	2,302.00	110,956,400	貸付株式数 25,000株
ベクトル	24,700	1,315.00	32,480,500	貸付株式数 13,500株
ウチヤマホールディングス	5,200	356.00	1,851,200	貸付株式数 2,800株
チャーム・ケア・コーポレーション	13,100	1,285.00	16,833,500	貸付株式数 7,200株
キャリアリンク	5,800	2,875.00	16,675,000	貸付株式数 3,100株
I B J	9,600	653.00	6,268,800	貸付株式数 5,100株
アサンテ	7,800	1,689.00	13,174,200	貸付株式数 4,200株
バリューHR	13,800	1,306.00	18,022,800	貸付株式数 7,500株
M&Aキャピタルパートナーズ	12,700	3,060.00	38,862,000	貸付株式数 7,500株
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,600	1,029.00	5,762,400	貸付株式数 3,000株
E R Iホールディングス	3,100	1,325.00	4,107,500	
アビスト	1,900	3,325.00	6,317,500	
シグマクシス・ホールディングス	23,900	1,300.00	31,070,000	貸付株式数 1,200株
ウィルグループ	13,200	1,080.00	14,256,000	貸付株式数 7,200株
エスクロー・エージェント・ジャパン	12,900	155.00	1,999,500	貸付株式数 400株
メドピア	13,800	977.00	13,482,600	貸付株式数 7,800株
レアジョブ	2,400	1,015.00	2,436,000	貸付株式数 1,300株
リクルートホールディングス	1,167,000	4,532.00	5,288,844,000	貸付株式数 469,900株
エラン	20,800	850.00	17,680,000	貸付株式数 11,400株

ツガミ	34,400	1,326.00	45,614,400	貸付株式数 19,200株
オークマ	15,500	7,391.00	114,560,500	
芝浦機械	15,500	4,740.00	73,470,000	
アマダ	247,100	1,385.50	342,357,050	貸付株式数 2,200株
アイダエンジニアリング	31,900	935.00	29,826,500	貸付株式数 6,600株
TAKISAWA	3,200	1,342.00	4,294,400	
FUJI	67,300	2,608.00	175,518,400	貸付株式数 5,900株
牧野フライス製作所	17,100	5,440.00	93,024,000	貸付株式数 9,300株
オーエスジー	73,900	1,912.00	141,296,800	貸付株式数 2,000株
ダイジェット工業	1,200	877.00	1,052,400	貸付株式数 600株
旭ダイヤモンド工業	43,300	866.00	37,497,800	
DMG森精機	93,900	2,410.00	226,299,000	貸付株式数 26,600株
ソディック	40,800	704.00	28,723,200	貸付株式数 300株
ディスコ	74,500	23,105.00	1,721,322,500	貸付株式数 42,400株
日東工器	7,500	1,923.00	14,422,500	
日進工具	12,900	1,095.00	14,125,500	貸付株式数 6,600株
パンチ工業	10,900	490.00	5,341,000	貸付株式数 5,900株
富士ダイス	5,600	655.00	3,668,000	貸付株式数 3,700株
土木管理総合試験所	5,100	336.00	1,713,600	貸付株式数 1,300株
日本郵政	1,896,600	1,043.00	1,978,153,800	
ベルシステム24ホールディングス	21,100	1,355.00	28,590,500	貸付株式数 8,100株
鎌倉新書	17,900	706.00	12,637,400	貸付株式数 10,400株
S MN	2,900	449.00	1,302,100	
一蔵	1,500	601.00	901,500	貸付株式数 900株
グローバルキッズCOMPANY	2,300	692.00	1,591,600	貸付株式数 1,100株
エアトリ	11,500	2,688.00	30,912,000	貸付株式数 6,200株
アトラエ	9,300	754.00	7,012,200	貸付株式数 6,000株
ストライク	6,700	3,275.00	21,942,500	貸付株式数 4,100株

ソラスト	43,400	668.00	28,991,200	貸付株式数 1,100株
セラク	4,800	1,580.00	7,584,000	貸付株式数 3,000株
インソース	34,200	1,130.00	38,646,000	貸付株式数 8,100株
豊田自動織機	112,100	10,085.00	1,130,528,500	
豊和工業	6,500	805.00	5,232,500	貸付株式数 3,300株 (3,200株)
石川製作所	3,100	1,352.00	4,191,200	貸付株式数 2,100株
東洋機械金属	8,300	695.00	5,768,500	
津田駒工業	2,200	444.00	976,800	貸付株式数 1,500株
エンシュウ	2,600	829.00	2,155,400	
島精機製作所	24,600	1,817.00	44,698,200	貸付株式数 13,400株
オプトラン	22,900	2,288.00	52,395,200	
NCホールディングス	2,400	2,223.00	5,335,200	
イワキ	10,300	1,372.00	14,131,600	
フリー	16,200	1,267.00	20,525,400	貸付株式数 200株
ヤマシンフィルタ	36,900	300.00	11,070,000	貸付株式数 20,100株
日阪製作所	15,000	912.00	13,680,000	
やまびこ	25,300	1,553.00	39,290,900	
野村マイクロ・サイエンス	5,200	6,430.00	33,436,000	貸付株式数 1,400株
平田機工	7,400	8,340.00	61,716,000	貸付株式数 3,200株
PEGASUS	17,100	577.00	9,866,700	貸付株式数 4,800株
マルマエ	6,700	1,768.00	11,845,600	貸付株式数 3,900株
タツモ	8,500	2,316.00	19,686,000	貸付株式数 4,500株
ナブテスコ	97,200	3,055.00	296,946,000	貸付株式数 40,000株
三井海洋開発	19,400	1,560.00	30,264,000	貸付株式数 3,200株
レオン自動機	16,300	1,392.00	22,689,600	
S M C	50,200	76,900.00	3,860,380,000	貸付株式数 27,400株
ホソカワミクロン	9,900	3,480.00	34,452,000	
ユニオンツール	6,800	3,245.00	22,066,000	
瑞光	11,100	1,170.00	12,987,000	貸付株式数 6,100株
オイレス工業	21,600	1,943.00	41,968,800	貸付株式数 12,000株

日精エー・エス・ピー機械	6,200	4,025.00	24,955,000	貸付株式数 3,300株
サトーホールディングス	22,000	1,911.00	42,042,000	貸付株式数 9,900株
技研製作所	14,600	1,989.00	29,039,400	貸付株式数 9,000株
日本エアテック	7,800	1,208.00	9,422,400	貸付株式数 3,500株
カワタ	3,500	1,125.00	3,937,500	
日精樹脂工業	11,500	976.00	11,224,000	貸付株式数 900株
オカダアイヨン	3,700	2,332.00	8,628,400	
ワイエイシーホールディングス	5,100	2,780.00	14,178,000	貸付株式数 3,400株
小松製作所	725,600	3,727.00	2,704,311,200	
住友重機械工業	91,600	3,359.00	307,684,400	貸付株式数 52,500株
日立建機	61,700	3,898.00	240,506,600	貸付株式数 32,500株
日工	22,900	653.00	14,953,700	貸付株式数 12,100株
巴工業	6,600	2,762.00	18,229,200	貸付株式数 3,700株
井関農機	14,500	1,233.00	17,878,500	
TOWA	15,800	2,525.00	39,895,000	貸付株式数 800株
丸山製作所	2,000	1,935.00	3,870,000	貸付株式数 1,200株
北川鉄工所	6,100	1,140.00	6,954,000	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
シンニッタン	13,200	255.00	3,366,000	貸付株式数 200株
ローツェ	8,100	12,030.00	97,443,000	貸付株式数 4,600株
タカキタ	3,400	474.00	1,611,600	貸付株式数 1,800株
クボタ	819,500	2,011.50	1,648,424,250	
荏原実業	7,400	2,838.00	21,001,200	貸付株式数 1,000株
東洋エンジニアリング	19,900	565.00	11,243,500	
三菱化工機	5,000	2,700.00	13,500,000	
月島ホールディングス	20,900	1,247.00	26,062,300	貸付株式数 6,400株
帝国電機製作所	10,900	2,594.00	28,274,600	貸付株式数 1,200株
東京機械製作所	2,800	472.00	1,321,600	貸付株式数 1,500株
新東工業	31,300	1,058.00	33,115,400	貸付株式数 5,000株

澁谷工業	14,500	2,553.00	37,018,500	
アイチコーポレーション	21,600	850.00	18,360,000	
小森コーポレーション	35,900	1,001.00	35,935,900	貸付株式数 16,700株 (8,600株)
鶴見製作所	11,800	2,697.00	31,824,600	
日本ギア工業	4,000	370.00	1,480,000	貸付株式数 2,500株
酒井重工業	1,900	5,250.00	9,975,000	
荏原製作所	63,400	6,906.00	437,840,400	貸付株式数 37,200株
石井鐵工所	1,400	2,471.00	3,459,400	
西島製作所	13,300	1,844.00	24,525,200	貸付株式数 8,300株
北越工業	15,600	1,475.00	23,010,000	貸付株式数 8,400株
ダイキン工業	184,900	29,110.00	5,382,439,000	貸付株式数 107,400株
オルガノ	21,300	4,130.00	87,969,000	貸付株式数 4,900株
トーヨーカネツ	5,900	3,530.00	20,827,000	
栗田工業	86,600	5,423.00	469,631,800	貸付株式数 45,700株
椿本チエイン	22,000	3,715.00	81,730,000	
大同工業	4,800	749.00	3,595,200	貸付株式数 3,200株
日機装	35,700	884.00	31,558,800	貸付株式数 19,600株
木村化工機	11,800	697.00	8,224,600	貸付株式数 6,400株
レイズネクスト	21,700	1,430.00	31,031,000	
アネスト岩田	26,300	1,176.00	30,928,800	貸付株式数 14,400株 (14,400株)
ダイフク	239,600	2,942.50	705,023,000	
サムコ	4,200	5,580.00	23,436,000	貸付株式数 2,200株
加藤製作所	5,700	1,191.00	6,788,700	
油研工業	1,800	2,058.00	3,704,400	
タダノ	81,700	1,105.00	90,278,500	貸付株式数 12,300株
フジテック	54,300	3,535.00	191,950,500	貸付株式数 8,000株
C K D	42,800	2,238.00	95,786,400	貸付株式数 20,600株
平和	51,500	2,441.00	125,711,500	貸付株式数 14,500株
理想科学工業	12,400	2,309.00	28,631,600	貸付株式数 6,700株

SANKYO	30,400	5,693.00	173,067,200	貸付株式数 19,200株
日本金銭機械	17,000	1,164.00	19,788,000	貸付株式数 9,200株
マースグループホールディングス	9,100	2,782.00	25,316,200	貸付株式数 5,000株
フクシマガリレイ	11,400	4,840.00	55,176,000	貸付株式数 5,300株
オーイズミ	4,500	486.00	2,187,000	貸付株式数 2,800株
ダイコク電機	8,500	3,965.00	33,702,500	貸付株式数 4,600株
竹内製作所	28,100	4,525.00	127,152,500	
アマノ	44,000	3,003.00	132,132,000	貸付株式数 22,100株
JUKI	24,000	582.00	13,968,000	貸付株式数 8,600株
サンデン	17,900	195.00	3,490,500	貸付株式数 11,400株 (11,400株)
ジャノメ	15,700	649.00	10,189,300	貸付株式数 8,700株 (8,700株)
ブラザー工業	206,900	2,009.00	415,662,100	貸付株式数 13,400株
マックス	19,100	2,661.00	50,825,100	
モリタホールディングス	26,900	1,513.00	40,699,700	
グローリー	37,200	2,805.50	104,364,600	貸付株式数 2,300株
新晃工業	15,600	2,015.00	31,434,000	貸付株式数 1,000株
大和冷機工業	23,700	1,370.00	32,469,000	
セガサミーホールディングス	124,500	3,009.00	374,620,500	貸付株式数 65,500株
日本ピストンリング	4,000	1,720.00	6,880,000	
リケン	6,100	3,350.00	20,435,000	
T P R	17,700	1,770.00	31,329,000	貸付株式数 9,800株
ツバキ・ナカシマ	38,200	809.00	30,903,800	貸付株式数 22,300株
ホシザキ	99,700	5,024.00	500,892,800	
大豊工業	13,400	895.00	11,993,000	
日本精工	284,500	896.40	255,025,800	貸付株式数 2,000株
NTN	305,300	303.20	92,566,960	貸付株式数 34,500株 (34,500株)
ジェイテクト	137,800	1,309.50	180,449,100	貸付株式数 82,900株

不二越	11,400	4,150.00	47,310,000	貸付株式数 7,000株
ミネベアミツミ	269,400	2,557.00	688,855,800	貸付株式数 133,300株
日本トムソン	37,900	584.00	22,133,600	
THK	89,400	2,811.00	251,303,400	貸付株式数 46,500株
ユーシン精機	12,300	705.00	8,671,500	
前澤給装工業	10,900	1,103.00	12,022,700	貸付株式数 6,000株
イーグル工業	17,100	1,765.00	30,181,500	
前澤工業	6,900	811.00	5,595,900	
日本ピラー工業	14,400	4,450.00	64,080,000	貸付株式数 7,900株
キッツ	57,000	1,078.00	61,446,000	
日立製作所	753,100	8,825.00	6,646,107,500	
東芝	295,600	4,530.00	1,339,068,000	
三菱電機	1,600,600	1,999.50	3,200,399,700	貸付株式数 858,400株
富士電機	94,200	5,985.00	563,787,000	
東洋電機製造	3,900	953.00	3,716,700	
安川電機	183,500	6,217.00	1,140,819,500	貸付株式数 101,200株
シンフォニアテクノロジー	17,100	1,685.00	28,813,500	貸付株式数 400株
明電舎	23,500	2,031.00	47,728,500	
オリジン	2,700	1,310.00	3,537,000	貸付株式数 100株
山洋電気	6,700	7,480.00	50,116,000	貸付株式数 1,100株
デンヨー	11,800	1,991.00	23,493,800	貸付株式数 100株
PHCホールディングス	21,600	1,503.00	32,464,800	貸付株式数 1,600株 (1,000株)
ソシオネクスト	21,800	17,480.00	381,064,000	貸付株式数 13,600株
ベイカレント・コンサルティング	124,800	5,225.00	652,080,000	貸付株式数 3,100株
Orchestra Holdings	3,400	1,174.00	3,991,600	
アイモバイル	7,000	1,300.00	9,100,000	貸付株式数 3,800株
キャリアインデックス	4,200	309.00	1,297,800	貸付株式数 2,800株
MS-Japan	4,000	1,117.00	4,468,000	
船場	2,100	747.00	1,568,700	貸付株式数 200株
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	56,200	1,839.00	103,351,800	

フルテック	1,700	1,121.00	1,905,700	貸付株式数 900株
グリーンズ	4,100	1,322.00	5,420,200	貸付株式数 2,800株
ツナググループ・ホールディングス	3,400	621.00	2,111,400	貸付株式数 2,200株
G A M E W I T H	3,700	349.00	1,291,300	貸付株式数 2,400株
M S & C o n s u l t i n g	1,500	655.00	982,500	貸付株式数 900株
ウェルビー	11,600	457.00	5,301,200	貸付株式数 6,400株
エル・ティー・エス	2,000	3,655.00	7,310,000	貸付株式数 1,100株
ミダックホールディングス	9,600	1,732.00	16,627,200	貸付株式数 5,300株
日総工産	11,800	883.00	10,419,400	貸付株式数 2,300株 (2,300株)
キュービーネットホールディングス	7,500	1,522.00	11,415,000	
R P A ホールディングス	21,300	402.00	8,562,600	
三櫻工業	23,400	864.00	20,217,600	
マキタ	192,700	3,991.00	769,065,700	
東芝テック	23,100	3,935.00	90,898,500	貸付株式数 13,700株
芝浦メカトロニクス	2,700	22,980.00	62,046,000	貸付株式数 1,000株
マブチモーター	38,500	3,794.00	146,069,000	
ニデック	376,800	7,520.00	2,833,536,000	貸付株式数 32,800株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,400	559.00	6,372,600	貸付株式数 6,200株
トレックス・セミコンダクター	7,300	2,327.00	16,987,100	貸付株式数 3,900株
東光高岳	9,300	2,103.00	19,557,900	
ダブル・スコープ	50,700	1,325.00	67,177,500	貸付株式数 32,800株
宮越ホールディングス	6,900	838.00	5,782,200	貸付株式数 3,700株
ダイヘン	14,000	5,470.00	76,580,000	貸付株式数 3,900株
ヤーマン	26,800	1,033.00	27,684,400	貸付株式数 16,500株
J V C ケンウッド	141,100	475.00	67,022,500	貸付株式数 42,900株
ミマキエンジニアリング	14,700	891.00	13,097,700	貸付株式数 8,400株
I - P E X	8,600	1,324.00	11,386,400	貸付株式数 200株
大崎電気工業	36,700	540.00	19,818,000	

オムロン	141,900	8,509.00	1,207,427,100	貸付株式数 30,400株
日東工業	20,900	3,535.00	73,881,500	
I D E C	22,900	3,145.00	72,020,500	貸付株式数 11,800株
正興電機製作所	4,600	1,042.00	4,793,200	貸付株式数 2,900株
不二電機工業	2,400	1,180.00	2,832,000	貸付株式数 1,500株
ジーエス・ユアサ コーポレーション	50,800	2,850.00	144,780,000	
サクサホールディングス	2,500	2,260.00	5,650,000	
メルコホールディングス	3,900	3,130.00	12,207,000	貸付株式数 100株
テクノメディカ	3,800	1,989.00	7,558,200	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	5,200	835.00	4,342,000	貸付株式数 2,600株
日本電気	219,000	6,942.00	1,520,298,000	
富士通	154,300	18,255.00	2,816,746,500	貸付株式数 84,200株
沖電気工業	70,000	884.00	61,880,000	
岩崎通信機	5,300	797.00	4,224,100	
電気興業	6,200	2,276.00	14,111,200	貸付株式数 500株
サンケン電気	14,400	12,450.00	179,280,000	貸付株式数 1,000株
ナカヨ	1,900	1,139.00	2,164,100	貸付株式数 1,000株
アイホン	9,400	2,409.00	22,644,600	
ルネサスエレクトロニクス	1,010,500	2,688.50	2,716,729,250	
セイコーエプソン	198,700	2,196.00	436,345,200	貸付株式数 108,500株
ワコム	117,800	600.00	70,680,000	貸付株式数 65,600株
アルバック	36,800	5,847.00	215,169,600	貸付株式数 15,400株
アクセル	4,500	1,687.00	7,591,500	貸付株式数 2,400株
E I Z O	11,300	4,645.00	52,488,500	貸付株式数 200株
ジャパンディスプレイ	594,500	40.00	23,780,000	貸付株式数 327,700株
日本信号	35,300	1,039.00	36,676,700	貸付株式数 1,300株
京三製作所	32,400	510.00	16,524,000	
能美防災	20,900	1,755.00	36,679,500	貸付株式数 12,500株
ホーチキ	11,600	1,724.00	19,998,400	
星和電機	4,800	546.00	2,620,800	貸付株式数 3,000株
エレコム	37,000	1,479.00	54,723,000	

パナソニック ホールディングス	1,829,300	1,719.00	3,144,566,700	貸付株式数 63,600株
シャープ	186,500	790.20	147,372,300	貸付株式数 120,700株
アンリツ	109,100	1,235.50	134,793,050	貸付株式数 64,200株
富士通ゼネラル	43,900	3,143.00	137,977,700	貸付株式数 1,000株
ソニーグループ	1,084,700	13,005.00	14,106,523,500	
T D K	245,200	5,410.00	1,326,532,000	貸付株式数 139,500株
帝国通信工業	7,000	1,635.00	11,445,000	
タムラ製作所	66,400	629.00	41,765,600	貸付株式数 5,000株
アルプスアルパイン	138,300	1,221.50	168,933,450	貸付株式数 80,000株
池上通信機	3,800	701.00	2,663,800	貸付株式数 2,200株
日本電波工業	18,600	1,207.00	22,450,200	貸付株式数 10,200株
鈴木	8,300	947.00	7,860,100	
メイコー	16,900	2,610.00	44,109,000	貸付株式数 9,200株
日本トリム	3,500	3,315.00	11,602,500	
ローランド ディー・ジー	8,500	3,540.00	30,090,000	貸付株式数 1,400株
フォスター電機	14,300	925.00	13,227,500	
S M K	3,700	2,543.00	9,409,100	貸付株式数 100株 (100株)
ヨコオ	12,300	1,862.00	22,902,600	貸付株式数 6,400株
ティアック	18,600	117.00	2,176,200	貸付株式数 12,500株
ホシデン	36,100	1,740.00	62,814,000	貸付株式数 19,700株
ヒロセ電機	24,900	18,380.00	457,662,000	貸付株式数 600株
日本航空電子工業	31,800	3,045.00	96,831,000	貸付株式数 4,100株
T O A	17,600	969.00	17,054,400	
マクセル	31,300	1,592.00	49,829,600	貸付株式数 17,100株
古野電気	20,100	1,062.00	21,346,200	貸付株式数 900株
スミダコーポレーション	16,600	1,465.00	24,319,000	貸付株式数 200株
アイコム	6,000	2,812.00	16,872,000	貸付株式数 3,100株 (3,100株)

リオン	6,400	1,889.00	12,089,600	
横河電機	169,400	2,645.00	448,063,000	貸付株式数 97,100株
新電元工業	5,900	3,245.00	19,145,500	
アズビル	107,100	4,440.00	475,524,000	貸付株式数 20,900株
東亜ディーケーケー	5,600	846.00	4,737,600	貸付株式数 3,700株
日本光電工業	70,800	3,686.00	260,968,800	貸付株式数 9,100株
チノー	6,400	2,388.00	15,283,200	貸付株式数 2,300株
共和電業	11,100	366.00	4,062,600	
日本電子材料	10,100	1,872.00	18,907,200	
堀場製作所	34,100	8,058.00	274,777,800	貸付株式数 2,100株
アドバンテスト	120,800	19,970.00	2,412,376,000	貸付株式数 32,400株
小野測器	4,400	459.00	2,019,600	
エスベック	12,300	2,274.00	27,970,200	
キーエンス	153,400	65,970.00	10,119,798,000	貸付株式数 65,100株
日置電機	8,000	8,920.00	71,360,000	貸付株式数 4,400株
シスメックス	132,300	9,615.00	1,272,064,500	
日本マイクロニクス	25,200	2,120.00	53,424,000	
メガチップス	12,600	3,690.00	46,494,000	貸付株式数 6,000株
OBARA GROUP	8,400	4,090.00	34,356,000	貸付株式数 4,100株
IMAGICA GROUP	12,800	678.00	8,678,400	貸付株式数 7,000株
澤藤電機	1,400	1,285.00	1,799,000	貸付株式数 900株
デンソー	316,300	9,569.00	3,026,674,700	貸付株式数 175,400株
原田工業	5,200	817.00	4,248,400	貸付株式数 2,800株
コーセル	18,400	1,223.00	22,503,200	
イリソ電子工業	14,100	4,030.00	56,823,000	貸付株式数 7,600株
オブテックスグループ	28,100	1,930.00	54,233,000	貸付株式数 15,400株
千代田インテグレ	5,300	2,386.00	12,645,800	
レーザーテック	70,300	20,935.00	1,471,730,500	
スタンレー電気	109,100	2,673.50	291,678,850	貸付株式数 59,700株
ウシオ電機	77,900	1,906.00	148,477,400	貸付株式数 50,000株

岡谷電機産業	9,200	279.00	2,566,800	貸付株式数 5,000株
ヘリオス テクノ ホールディング	11,000	772.00	8,492,000	貸付株式数 7,500株
エノモト	3,000	1,743.00	5,229,000	貸付株式数 2,000株
日本セラミック	15,600	2,655.00	41,418,000	貸付株式数 7,100株
遠藤照明	5,300	1,268.00	6,720,400	
古河電池	11,300	1,009.00	11,401,700	貸付株式数 400株 (100株)
双信電機	4,800	364.00	1,747,200	貸付株式数 3,100株
山一電機	12,500	2,321.00	29,012,500	貸付株式数 6,000株
図研	13,300	3,815.00	50,739,500	貸付株式数 500株
日本電子	38,400	4,851.00	186,278,400	貸付株式数 6,900株
カシオ計算機	114,200	1,171.00	133,728,200	貸付株式数 62,800株
ファナック	747,700	4,753.00	3,553,818,100	貸付株式数 317,200株
日本シイエムケイ	32,600	549.00	17,897,400	
エンプラス	4,500	5,460.00	24,570,000	
大真空	18,700	646.00	12,080,200	貸付株式数 2,100株
ローム	70,900	13,675.00	969,557,500	貸付株式数 37,900株 (5,700株)
浜松ホトニクス	123,000	6,837.00	840,951,000	
三井ハイテック	15,800	9,330.00	147,414,000	貸付株式数 9,800株
新光電気工業	54,300	5,916.00	321,238,800	貸付株式数 29,600株
京セラ	238,200	7,584.00	1,806,508,800	貸付株式数 130,000株
協栄産業	1,200	2,037.00	2,444,400	貸付株式数 100株
太陽誘電	74,700	4,182.00	312,395,400	貸付株式数 35,500株
村田製作所	465,000	8,089.00	3,761,385,000	貸付株式数 221,400株
双葉電子工業	29,200	497.00	14,512,400	
日東電工	111,600	10,040.00	1,120,464,000	
北陸電気工業	4,500	1,221.00	5,494,500	
東海理化電機製作所	43,200	2,137.00	92,318,400	

ニチコン	31,300	1,471.00	46,042,300	貸付株式数 17,100株 (17,100株)
日本ケミコン	15,100	1,242.00	18,754,200	貸付株式数 8,300株
K O A	23,200	1,832.00	42,502,400	貸付株式数 1,000株
三井E & S	73,400	514.00	37,727,600	貸付株式数 34,500株
日立造船	126,900	914.00	115,986,600	貸付株式数 84,100株
三菱重工業	270,800	6,627.00	1,794,591,600	
川崎重工業	115,500	3,718.00	429,429,000	
I H I	97,600	3,891.00	379,761,600	
名村造船所	30,600	617.00	18,880,200	貸付株式数 20,900株
サノヤホールディングス	16,100	140.00	2,254,000	貸付株式数 10,300株
スプリックス	3,500	800.00	2,800,000	貸付株式数 1,700株 (900株)
マネジメントソリューションズ	8,700	3,875.00	33,712,500	貸付株式数 4,700株
プロレド・パートナーズ	3,900	516.00	2,012,400	貸付株式数 100株
a n d f a c t o r y	3,600	438.00	1,576,800	貸付株式数 1,900株
テノ・ホールディングス	1,500	682.00	1,023,000	貸付株式数 1,000株
フロンティア・マネジメント	5,300	1,368.00	7,250,400	貸付株式数 300株
ピアラ	2,000	487.00	974,000	貸付株式数 1,200株
コプロ・ホールディングス	2,000	2,012.00	4,024,000	貸付株式数 1,300株
ギークス	1,700	744.00	1,264,800	貸付株式数 1,100株
アンビスホールディングス	16,800	2,980.00	50,064,000	貸付株式数 500株
カーブスホールディングス	43,100	752.00	32,411,200	貸付株式数 23,300株
フォーラムエンジニアリング	9,200	1,163.00	10,699,600	貸付株式数 100株
F A S T F I T N E S S J A P A N	5,400	1,301.00	7,025,400	貸付株式数 2,700株
日本車輛製造	5,900	1,991.00	11,746,900	貸付株式数 3,300株
三菱ロジスネクスト	24,500	1,224.00	29,988,000	貸付株式数 500株
近畿車輛	1,700	1,677.00	2,850,900	貸付株式数 500株

一家ホールディングス	2,800	645.00	1,806,000	貸付株式数 1,100株
フルサト・マルカホールディングス	16,100	2,407.00	38,752,700	貸付株式数 7,000株
ヤマエグループホールディングス	9,200	2,873.00	26,431,600	
ジャパクラフトホールディングス	7,300	248.00	1,810,400	貸付株式数 4,200株
F P G	51,100	1,284.00	65,612,400	貸付株式数 23,700株
島根銀行	4,100	486.00	1,992,600	貸付株式数 2,500株
じもとホールディングス	10,400	398.00	4,139,200	
全国保証	39,500	4,902.00	193,629,000	貸付株式数 21,600株 (15,100株)
めぶきフィナンシャルグループ	749,400	346.60	259,742,040	
ジャパンインベストメントアドバイザー	12,300	1,176.00	14,464,800	貸付株式数 6,800株
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,300	3,320.00	64,076,000	
九州フィナンシャルグループ	265,700	647.30	171,987,610	貸付株式数 138,400株
かんぼ生命保険	175,800	2,231.00	392,209,800	
ゆうちょ銀行	414,900	1,127.50	467,799,750	貸付株式数 227,900株
あんしん保証	5,800	305.00	1,769,000	貸付株式数 3,600株
富山第一銀行	47,900	769.00	36,835,100	貸付株式数 27,500株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	810,300	588.70	477,023,610	
ジェイリース	3,900	2,302.00	8,977,800	貸付株式数 2,100株
西日本フィナンシャルホールディングス	93,700	1,419.00	132,960,300	貸付株式数 51,500株
イントラスト	4,500	930.00	4,185,000	貸付株式数 2,200株
日本モーゲージサービス	6,500	574.00	3,731,000	貸付株式数 4,400株
C A S A	4,500	925.00	4,162,500	貸付株式数 2,400株
アルヒ	18,600	982.00	18,265,200	貸付株式数 10,300株
プレミアグループ	25,400	1,740.00	44,196,000	
日産自動車	2,178,100	597.10	1,300,543,510	貸付株式数 1,164,600株
いすゞ自動車	445,800	1,757.50	783,493,500	
トヨタ自動車	8,419,500	2,299.50	19,360,640,250	貸付株式数 1,858,900株
日野自動車	197,700	597.60	118,145,520	貸付株式数 93,900株

三菱自動車工業	598,200	503.30	301,074,060	貸付株式数 33,400株
エフテック	8,300	948.00	7,868,400	貸付株式数 5,400株
レシップホールディングス	4,700	540.00	2,538,000	貸付株式数 2,000株
GMB	2,300	1,576.00	3,624,800	貸付株式数 1,200株
ファルテック	1,900	613.00	1,164,700	貸付株式数 1,000株
武蔵精密工業	37,500	1,757.00	65,887,500	貸付株式数 4,500株
日産車体	27,000	914.00	24,678,000	貸付株式数 14,900株 (14,000株)
新明和工業	48,200	1,316.00	63,431,200	
極東開発工業	25,300	1,711.00	43,288,300	貸付株式数 13,700株
トピー工業	12,400	2,290.00	28,396,000	
ティラド	3,800	1,837.00	6,980,600	貸付株式数 500株
曙ブレーキ工業	93,600	145.00	13,572,000	貸付株式数 51,900株
タチエス	24,200	1,573.00	38,066,600	貸付株式数 7,000株
NOK	59,600	2,081.00	124,027,600	貸付株式数 32,700株
フタバ産業	41,100	550.00	22,605,000	
KYB	14,800	5,070.00	75,036,000	
市光工業	22,100	529.00	11,690,900	貸付株式数 10,500株
大同メタル工業	30,000	570.00	17,100,000	貸付株式数 7,000株
プレス工業	68,500	624.00	42,744,000	
ミクニ	13,700	518.00	7,096,600	
太平洋工業	35,200	1,295.00	45,584,000	
河西工業	15,900	168.00	2,671,200	貸付株式数 8,600株
アイシン	118,300	4,550.00	538,265,000	貸付株式数 6,200株
マツダ	507,200	1,368.00	693,849,600	
今仙電機製作所	7,500	650.00	4,875,000	
本田技研工業	1,246,400	4,291.00	5,348,302,400	貸付株式数 730,700株
スズキ	281,600	5,462.00	1,538,099,200	貸付株式数 167,900株 (167,900株)
SUBARU	485,200	2,615.50	1,269,040,600	貸付株式数 320,000株

安永	5,200	957.00	4,976,400	貸付株式数 3,400株
ヤマハ発動機	241,000	4,076.00	982,316,000	貸付株式数 22,600株
小糸製作所	184,400	2,518.00	464,319,200	貸付株式数 70,000株
T B K	11,800	416.00	4,908,800	貸付株式数 6,400株
エクセディ	25,100	2,419.00	60,716,900	
ミツバ	28,800	835.00	24,048,000	貸付株式数 700株
豊田合成	44,700	2,756.00	123,193,200	貸付株式数 24,500株
愛三工業	25,300	1,161.00	29,373,300	
盟和産業	1,700	1,030.00	1,751,000	
日本プラスト	9,300	460.00	4,278,000	貸付株式数 5,100株
ヨロズ	14,400	935.00	13,464,000	
エフ・シー・シー	27,200	1,890.00	51,408,000	
新家工業	2,700	2,349.00	6,342,300	貸付株式数 1,700株
シマノ	62,200	23,525.00	1,463,255,000	
テイ・エス テック	70,200	1,837.00	128,957,400	貸付株式数 5,400株
三十三フィナンシャルグループ	13,500	1,623.00	21,910,500	
第四北越フィナンシャルグループ	23,700	3,205.00	75,958,500	
ひろぎんホールディングス	197,000	849.90	167,430,300	
マーキュリアホールディングス	6,900	800.00	5,520,000	
おきなわフィナンシャルグループ	13,900	2,183.00	30,343,700	貸付株式数 7,300株
ダイレクトマーケティングミックス	18,900	867.00	16,386,300	貸付株式数 1,200株
ポピンズ	2,300	1,458.00	3,353,400	
L I T A L I C O	12,300	2,234.00	27,478,200	
十六フィナンシャルグループ	19,600	3,175.00	62,230,000	貸付株式数 10,700株
北國フィナンシャルホールディングス	15,900	4,265.00	67,813,500	貸付株式数 5,200株
ネットプロテクションズホールディングス	50,000	330.00	16,500,000	貸付株式数 5,000株
プロクレアホールディングス	18,500	2,077.00	38,424,500	貸付株式数 10,100株
あいちフィナンシャルグループ	21,100	2,233.00	47,116,300	
ジャムコ	6,500	1,521.00	9,886,500	貸付株式数 3,600株
小野建	15,900	1,609.00	25,583,100	
はるやまホールディングス	5,300	505.00	2,676,500	貸付株式数 1,400株
南陽	2,400	2,171.00	5,210,400	貸付株式数 1,400株

ノジマ	52,900	1,350.00	71,415,000	
佐島電機	7,900	1,661.00	13,121,900	
カップ・クリエイト	25,500	1,513.00	38,581,500	貸付株式数 13,900株
エコトレーディング	2,400	842.00	2,020,800	貸付株式数 900株
伯東	9,300	5,660.00	52,638,000	貸付株式数 1,200株
コンドーテック	12,500	1,193.00	14,912,500	貸付株式数 6,900株
中山福	6,700	345.00	2,311,500	
ライトオン	9,500	597.00	5,671,500	貸付株式数 6,300株
ナガイレーベン	20,500	2,223.00	45,571,500	貸付株式数 11,200株
三菱食品	15,000	3,685.00	55,275,000	
良品計画	177,100	1,372.50	243,069,750	
パリミキホールディングス	15,800	326.00	5,150,800	
松田産業	12,300	2,241.00	27,564,300	貸付株式数 6,800株
第一興商	62,800	2,649.50	166,388,600	貸付株式数 3,800株
メディバルホールディングス	155,100	2,310.50	358,358,550	貸付株式数 87,500株
アドヴァングループ	15,400	987.00	15,199,800	貸付株式数 7,500株
S P K	7,200	1,776.00	12,787,200	貸付株式数 100株
萩原電気ホールディングス	6,300	3,460.00	21,798,000	
アルピス	5,300	2,389.00	12,661,700	貸付株式数 1,700株
アズワン	23,100	5,278.00	121,921,800	貸付株式数 11,500株
スズデン	5,700	2,199.00	12,534,300	
尾家産業	3,000	1,329.00	3,987,000	貸付株式数 1,800株
シモジマ	11,100	1,058.00	11,743,800	貸付株式数 3,300株
ドウシシャ	17,100	2,234.00	38,201,400	
小津産業	2,800	1,571.00	4,398,800	貸付株式数 1,700株
コナカ	13,800	401.00	5,533,800	
高速	8,400	2,015.00	16,926,000	
ハウス オブ ローゼ	1,600	1,612.00	2,579,200	貸付株式数 300株
G - 7ホールディングス	20,200	1,229.00	24,825,800	
たけびし	6,200	1,715.00	10,633,000	貸付株式数 3,400株
イオン北海道	24,000	873.00	20,952,000	貸付株式数 13,200株

コジマ	26,800	588.00	15,758,400	貸付株式数 17,100株
ヒマラヤ	4,000	952.00	3,808,000	貸付株式数 2,600株
コーナン商事	21,900	3,445.00	75,445,500	貸付株式数 12,100株
ネットワンシステムズ	57,300	2,981.50	170,839,950	
エコス	6,000	1,853.00	11,118,000	貸付株式数 3,300株
ワタミ	19,600	887.00	17,385,200	貸付株式数 10,700株
マルシェ	4,100	257.00	1,053,700	貸付株式数 2,700株
リックス	2,600	3,130.00	8,138,000	貸付株式数 1,600株
システムソフト	53,500	78.00	4,173,000	
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	327,500	2,588.50	847,733,750	
丸文	14,500	1,286.00	18,647,000	
西松屋チェーン	35,900	1,629.00	58,481,100	貸付株式数 20,400株
ゼンショーホールディングス	88,800	6,535.00	580,308,000	貸付株式数 11,000株
ハピネット	13,800	2,190.00	30,222,000	貸付株式数 7,600株
幸楽苑ホールディングス	10,600	1,007.00	10,674,200	貸付株式数 5,800株
ハークスレイ	4,400	635.00	2,794,000	
橋本総業ホールディングス	6,400	1,186.00	7,590,400	貸付株式数 3,500株
日本ライフライン	47,500	986.00	46,835,000	
サイゼリヤ	24,000	3,555.00	85,320,000	貸付株式数 15,400株
タカショー	14,100	680.00	9,588,000	貸付株式数 7,800株
VTホールディングス	61,600	532.00	32,771,200	貸付株式数 33,800株
アルゴグラフィックス	14,100	3,755.00	52,945,500	貸付株式数 300株
魚力	5,000	2,173.00	10,865,000	貸付株式数 1,800株
IDOM	49,000	936.00	45,864,000	貸付株式数 28,400株 (24,500株)
日本エム・ディ・エム	9,100	977.00	8,890,700	
ポプラ	3,300	212.00	699,600	貸付株式数 2,000株
フジ・コーポレーション	9,200	1,624.00	14,940,800	貸付株式数 1,200株

ユナイテッドアローズ	17,300	2,477.00	42,852,100	貸付株式数 6,600株
進和	9,900	2,387.00	23,631,300	貸付株式数 5,500株
エスケイジャパン	3,100	549.00	1,701,900	貸付株式数 2,000株
ダイترون	6,400	2,993.00	19,155,200	
ハイデイ日高	24,100	2,460.00	59,286,000	貸付株式数 13,200株
シークス	23,100	1,520.00	35,112,000	貸付株式数 12,700株
YU - WA CREATION HO LDINGS	7,500	191.00	1,432,500	貸付株式数 100株
コロワイド	74,700	2,022.00	151,043,400	貸付株式数 41,200株
ピーシーデポコーポレーション	18,000	478.00	8,604,000	
田中商事	3,500	642.00	2,247,000	貸付株式数 100株
オーハシテクニカ	7,800	1,555.00	12,129,000	貸付株式数 300株
壱番屋	12,800	5,370.00	68,736,000	貸付株式数 6,900株
白銅	5,900	2,294.00	13,534,600	貸付株式数 3,100株
トップカルチャー	4,100	190.00	779,000	貸付株式数 2,200株
P L A N T	2,900	725.00	2,102,500	貸付株式数 1,400株
スギホールディングス	32,700	6,283.00	205,454,100	貸付株式数 800株
ダイコー通産	1,300	1,126.00	1,463,800	貸付株式数 800株
薬王堂ホールディングス	9,100	2,462.00	22,404,200	貸付株式数 4,500株
島津製作所	186,700	4,351.00	812,331,700	
J M S	14,200	581.00	8,250,200	
クボテック	2,800	356.00	996,800	貸付株式数 1,800株
長野計器	11,100	2,164.00	24,020,400	
ブイ・テクノロジー	7,500	2,426.00	18,195,000	貸付株式数 4,100株 (4,100株)
スター精密	29,200	1,759.00	51,362,800	貸付株式数 13,100株
東京計器	11,700	1,285.00	15,034,500	貸付株式数 4,800株
愛知時計電機	6,000	1,521.00	9,126,000	
インターアクション	7,300	1,372.00	10,015,600	貸付株式数 3,900株

オーバル	10,500	402.00	4,221,000	貸付株式数 6,900株
東京精密	33,700	7,810.00	263,197,000	貸付株式数 13,300株
マニー	61,300	1,614.00	98,938,200	
ニコン	221,700	1,827.00	405,045,900	貸付株式数 2,700株
トプコン	80,700	2,049.50	165,394,650	貸付株式数 28,900株
オリンパス	943,800	2,222.00	2,097,123,600	貸付株式数 310,000株
理研計器	9,500	5,550.00	52,725,000	貸付株式数 100株
S C R E E Nホールディングス	26,200	15,630.00	409,506,000	貸付株式数 17,400株 (15,500株)
キヤノン電子	16,900	1,932.00	32,650,800	
タムロン	11,500	3,920.00	45,080,000	
H O Y A	324,900	16,315.00	5,300,743,500	貸付株式数 183,900株
シード	6,000	575.00	3,450,000	貸付株式数 2,100株
ノーリツ鋼機	14,500	2,278.00	33,031,000	
A & Dホロンホールディングス	22,400	1,808.00	40,499,200	
朝日インテック	171,300	2,722.50	466,364,250	貸付株式数 4,400株
キヤノン	841,300	3,725.00	3,133,842,500	
リコー	384,500	1,216.00	467,552,000	
シチズン時計	168,600	880.00	148,368,000	貸付株式数 88,000株
リズム	3,700	1,597.00	5,908,900	貸付株式数 2,000株
大研医器	8,900	509.00	4,530,100	貸付株式数 4,800株
メニコン	52,700	2,411.50	127,086,050	貸付株式数 29,600株
シンシア	1,100	567.00	623,700	貸付株式数 500株
K Y O R I T S U	17,700	179.00	3,168,300	
中本パックス	3,600	1,645.00	5,922,000	貸付株式数 1,900株
スノーピーク	26,200	1,778.00	46,583,600	貸付株式数 16,600株 (700株)
パラマウントベッドホールディングス	35,400	2,281.00	80,747,400	貸付株式数 19,400株 (16,900株)
トランザクション	10,100	1,788.00	18,058,800	貸付株式数 800株

粧美堂	3,200	443.00	1,417,600	貸付株式数 1,500株
ニホンフラッシュ	14,400	948.00	13,651,200	貸付株式数 7,000株
前田工織	12,900	3,020.00	38,958,000	貸付株式数 8,500株 (8,200株)
永大産業	12,700	218.00	2,768,600	貸付株式数 6,900株
アートネイチャー	15,800	770.00	12,166,000	貸付株式数 1,200株
バンダイナムコホールディングス	420,100	3,161.00	1,327,936,100	貸付株式数 246,200株
アイフィスジャパン	3,300	615.00	2,029,500	貸付株式数 100株
SHOEI	34,600	2,461.00	85,150,600	貸付株式数 18,900株
フランスベッドホールディングス	17,600	1,140.00	20,064,000	貸付株式数 10,500株
マーベラス	25,000	670.00	16,750,000	
パイロットコーポレーション	24,000	4,510.00	108,240,000	貸付株式数 13,200株
萩原工業	10,300	1,438.00	14,811,400	貸付株式数 5,300株 (100株)
エイベックス	26,100	1,531.00	39,959,100	貸付株式数 5,300株
フジシールインターナショナル	31,000	1,501.00	46,531,000	貸付株式数 17,200株
タカラトミー	70,500	1,785.00	125,842,500	貸付株式数 100株
広済堂ホールディングス	8,000	2,399.00	19,192,000	貸付株式数 1,100株
エステールホールディングス	2,800	627.00	1,755,600	貸付株式数 1,700株
レック	21,900	841.00	18,417,900	
タカノ	4,400	828.00	3,643,200	貸付株式数 2,800株
三光合成	19,400	702.00	13,618,800	
プロネクス	12,700	997.00	12,661,900	
ホクシン	9,100	146.00	1,328,600	貸付株式数 2,700株 (2,700株)
ウッドワン	4,000	1,270.00	5,080,000	貸付株式数 2,100株
大建工業	9,300	2,278.00	21,185,400	
きもと	17,600	193.00	3,396,800	
凸版印刷	188,500	3,099.00	584,161,500	
大日本印刷	167,600	3,966.00	664,701,600	貸付株式数 96,200株

共同印刷	4,300	3,055.00	13,136,500	貸付株式数 2,200株
N I S S H A	29,200	1,728.00	50,457,600	
光村印刷	1,000	1,215.00	1,215,000	貸付株式数 600株
藤森工業	12,200	3,515.00	42,883,000	貸付株式数 6,700株
ヴィア・ホールディングス	19,600	85.00	1,666,000	貸付株式数 12,300株
T A K A R A & C O M P A N Y	9,800	2,340.00	22,932,000	貸付株式数 5,300株
前澤化成工業	9,900	1,500.00	14,850,000	貸付株式数 5,400株
未来工業	5,500	2,683.00	14,756,500	
アシックス	141,500	4,343.00	614,534,500	
ツツミ	2,700	2,334.00	6,301,800	貸付株式数 100株
ウェーブロックホールディングス	3,600	599.00	2,156,400	貸付株式数 2,400株
J S P	10,800	1,888.00	20,390,400	貸付株式数 1,500株
ニチハ	19,300	3,050.00	58,865,000	貸付株式数 6,000株
ローランド	11,300	4,105.00	46,386,500	貸付株式数 800株
エフピコ	29,100	2,886.00	83,982,600	
小松ウオール工業	5,600	2,620.00	14,672,000	
ヤマハ	96,700	5,270.00	509,609,000	貸付株式数 56,400株
河合楽器製作所	4,100	3,610.00	14,801,000	
クリナップ	17,200	729.00	12,538,800	
ピジョン	97,700	1,998.00	195,204,600	貸付株式数 13,100株
天馬	12,500	2,555.00	31,937,500	貸付株式数 400株
キングジム	13,500	875.00	11,812,500	貸付株式数 8,900株
象印マホービン	45,800	2,069.00	94,760,200	貸付株式数 23,800株
リンテック	30,800	2,294.50	70,670,600	
信越ポリマー	28,400	1,460.00	41,464,000	
東リ	26,800	340.00	9,112,000	
イトーキ	31,400	1,053.00	33,064,200	
任天堂	968,100	6,351.00	6,148,403,100	貸付株式数 251,900株
三菱鉛筆	21,800	1,686.00	36,754,800	貸付株式数 11,900株
松風	6,900	2,244.00	15,483,600	貸付株式数 1,200株

タカラスタANDARD	28,200	1,856.00	52,339,200	貸付株式数 200株
コクヨ	73,800	2,010.00	148,338,000	貸付株式数 1,100株
ナカバヤシ	16,500	512.00	8,448,000	貸付株式数 2,300株
ニフコ	55,500	4,081.00	226,495,500	
立川ブラインド工業	7,100	1,241.00	8,811,100	貸付株式数 600株
グロープライド	12,400	2,222.00	27,552,800	貸付株式数 6,700株
オカムラ	46,200	1,940.00	89,628,000	貸付株式数 8,400株
バルカー	12,900	3,835.00	49,471,500	貸付株式数 4,200株
MUTOHホールディングス	1,600	1,758.00	2,812,800	貸付株式数 500株
伊藤忠商事	999,700	5,540.00	5,538,338,000	貸付株式数 570,500株
丸紅	1,266,000	2,400.50	3,039,033,000	貸付株式数 63,500株
スクロール	24,100	932.00	22,461,200	貸付株式数 10,400株
高島	2,000	3,480.00	6,960,000	貸付株式数 100株
ヨンドシーホールディングス	14,000	1,934.00	27,076,000	貸付株式数 5,700株
三陽商会	4,600	2,007.00	9,232,200	貸付株式数 3,000株
長瀬産業	74,400	2,386.00	177,518,400	
ナイガイ	4,000	294.00	1,176,000	貸付株式数 2,500株
蝶理	8,700	2,992.00	26,030,400	
豊田通商	142,100	7,168.00	1,018,572,800	
オンワードホールディングス	99,600	502.00	49,999,200	
三共生興	23,300	580.00	13,514,000	
兼松	63,000	2,002.00	126,126,000	貸付株式数 500株
美津濃	15,200	3,730.00	56,696,000	
ツカモトコーポレーション	1,800	1,351.00	2,431,800	貸付株式数 100株
ルックホールディングス	3,400	2,499.00	8,496,600	貸付株式数 2,300株
三井物産	1,151,300	5,236.00	6,028,206,800	貸付株式数 660,900株
日本紙パルプ商事	8,600	4,705.00	40,463,000	貸付株式数 600株
東京エレクトロン	324,500	20,205.00	6,556,522,500	貸付株式数 197,200株
カメイ	17,200	1,465.00	25,198,000	

東都水産	600	6,570.00	3,942,000	貸付株式数 300株
OUGホールディングス	1,800	2,450.00	4,410,000	
スターゼン	12,300	2,268.00	27,896,400	
セイコーグループ	23,700	2,623.00	62,165,100	
山善	43,700	1,101.00	48,113,700	
椿本興業	2,600	4,105.00	10,673,000	貸付株式数 500株
住友商事	1,004,700	2,973.00	2,986,973,100	貸付株式数 569,300株
BIPROGY	56,600	3,396.00	192,213,600	
内田洋行	6,600	5,700.00	37,620,000	
三菱商事	989,100	6,832.00	6,757,531,200	貸付株式数 571,600株
第一実業	5,700	5,280.00	30,096,000	
キャノンマーケティングジャパン	37,600	3,576.00	134,457,600	貸付株式数 7,700株
西華産業	6,400	1,974.00	12,633,600	
佐藤商事	11,200	1,438.00	16,105,600	貸付株式数 2,900株
菱洋エレクトロ	13,800	3,645.00	50,301,000	貸付株式数 7,500株
東京産業	14,800	867.00	12,831,600	貸付株式数 2,800株
ユアサ商事	13,900	4,445.00	61,785,500	貸付株式数 200株
神鋼商事	4,100	5,780.00	23,698,000	
トルク	6,700	254.00	1,701,800	
阪和興業	29,100	4,460.00	129,786,000	
正栄食品工業	10,800	4,225.00	45,630,000	貸付株式数 6,000株
カナデン	10,800	1,269.00	13,705,200	貸付株式数 7,300株
RYODEN	13,100	2,208.00	28,924,800	
ニプロ	127,800	1,008.00	128,822,400	貸付株式数 69,700株
岩谷産業	36,900	7,460.00	275,274,000	貸付株式数 20,200株
ナイス	3,400	1,488.00	5,059,200	貸付株式数 2,000株
ニチモウ	1,600	3,950.00	6,320,000	
極東貿易	9,700	1,745.00	16,926,500	貸付株式数 5,700株 (4,200株)
アステナホールディングス	28,100	444.00	12,476,400	貸付株式数 7,100株
三愛オブリ	42,900	1,497.00	64,221,300	
稲畑産業	32,700	3,110.00	101,697,000	貸付株式数 800株

GSイクレオス	9,400	1,970.00	18,518,000	貸付株式数 5,100株
明和産業	21,600	664.00	14,342,400	貸付株式数 13,100株
クワザワホールディングス	4,000	568.00	2,272,000	貸付株式数 2,300株
キムラタン	71,300	20.00	1,426,000	貸付株式数 38,500株 (23,700株)
ゴールドウイン	27,200	11,870.00	322,864,000	貸付株式数 2,600株
ユニ・チャーム	320,400	5,397.00	1,729,198,800	貸付株式数 154,200株
デサント	26,500	4,025.00	106,662,500	
キング	5,200	635.00	3,302,000	貸付株式数 3,300株
ワキタ	29,800	1,276.00	38,024,800	貸付株式数 1,500株
ヤマトインターナショナル	9,400	311.00	2,923,400	貸付株式数 6,200株
東邦ホールディングス	40,400	2,624.50	106,029,800	貸付株式数 22,200株
サンゲツ	40,700	2,454.00	99,877,800	貸付株式数 2,900株
ミツウロコグループホールディングス	20,700	1,358.00	28,110,600	
シナネンホールディングス	5,200	3,785.00	19,682,000	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
伊藤忠エネクス	40,200	1,258.00	50,571,600	
サンリオ	46,000	6,211.00	285,706,000	
サンワテクノス	8,300	2,365.00	19,629,500	
リョーサン	17,200	4,355.00	74,906,000	貸付株式数 4,800株
新光商事	21,800	1,157.00	25,222,600	貸付株式数 100株
トーヨー	6,900	2,794.00	19,278,600	貸付株式数 3,800株
三信電気	6,500	2,137.00	13,890,500	貸付株式数 1,800株
東陽テクニカ	16,500	1,382.00	22,803,000	
モスフードサービス	23,900	3,200.00	76,480,000	貸付株式数 900株
加賀電子	13,200	6,400.00	84,480,000	
三益半導体工業	12,200	3,005.00	36,661,000	貸付株式数 900株
都築電気	8,100	1,900.00	15,390,000	
ソーダニッカ	9,200	822.00	7,562,400	
立花エレテック	11,800	2,858.00	33,724,400	貸付株式数 5,500株

木曽路	24,600	2,415.00	59,409,000	貸付株式数 13,500株
S R Sホールディングス	26,800	945.00	25,326,000	貸付株式数 14,500株
千趣会	29,800	391.00	11,651,800	貸付株式数 16,200株
タカキュー	8,800	84.00	739,200	貸付株式数 6,000株
リテールパートナーズ	24,100	1,569.00	37,812,900	貸付株式数 13,000株
ケーヨー	26,100	815.00	21,271,500	貸付株式数 8,100株
上新電機	14,400	1,962.00	28,252,800	貸付株式数 7,900株
日本瓦斯	86,000	1,942.50	167,055,000	
ロイヤルホールディングス	31,400	2,550.00	80,070,000	貸付株式数 17,400株
東天紅	900	781.00	702,900	貸付株式数 600株
いなげや	15,800	1,470.00	23,226,000	貸付株式数 10,100株
チヨダ	15,500	888.00	13,764,000	貸付株式数 2,600株
ライフコーポレーション	14,200	3,060.00	43,452,000	
リンガーハット	20,900	2,472.00	51,664,800	貸付株式数 11,500株
MrMaxHD	22,700	626.00	14,210,200	貸付株式数 700株
テンアライド	14,300	285.00	4,075,500	貸付株式数 9,200株
AOKIホールディングス	29,800	904.00	26,939,200	貸付株式数 1,000株
オークワ	25,900	833.00	21,574,700	貸付株式数 7,400株
コメリ	25,000	2,844.00	71,100,000	貸付株式数 7,400株
青山商事	34,700	1,281.00	44,450,700	
しまむら	19,000	13,155.00	249,945,000	貸付株式数 300株
はせがわ	6,000	382.00	2,292,000	
高島屋	122,300	1,989.00	243,254,700	貸付株式数 70,600株 (1,900株)
松屋	27,500	1,159.00	31,872,500	貸付株式数 14,300株
エイチ・ツー・オー リテイリング	79,000	1,485.00	117,315,000	貸付株式数 35,700株
近鉄百貨店	7,000	2,426.00	16,982,000	貸付株式数 1,500株

丸井グループ	119,600	2,451.00	293,139,600	貸付株式数 59,600株
クレディセゾン	95,700	2,243.00	214,655,100	貸付株式数 49,700株
アクシアル リテイリング	11,100	3,550.00	39,405,000	貸付株式数 3,800株
井筒屋	6,000	335.00	2,010,000	貸付株式数 3,800株
イオン	550,000	2,960.00	1,628,000,000	貸付株式数 313,200株
イズミ	24,700	3,294.00	81,361,800	貸付株式数 14,800株
フォーバル	6,400	1,117.00	7,148,800	貸付株式数 3,400株
平和堂	27,100	2,283.00	61,869,300	貸付株式数 15,100株
フジ	24,900	1,811.00	45,093,900	貸付株式数 14,000株
ヤオコー	18,400	7,168.00	131,891,200	貸付株式数 11,500株 (6,100株)
ゼビオホールディングス	22,000	1,075.00	23,650,000	
ケーズホールディングス	114,700	1,235.50	141,711,850	貸付株式数 73,200株
PALTA C	25,500	4,763.00	121,456,500	貸付株式数 5,900株
三谷産業	28,300	316.00	8,942,800	貸付株式数 4,700株
Olympicグループ	4,700	549.00	2,580,300	貸付株式数 3,100株
日産東京販売ホールディングス	16,000	385.00	6,160,000	貸付株式数 8,700株
SBI新生銀行	35,000	2,810.00	98,350,000	
あおぞら銀行	95,000	2,707.50	257,212,500	貸付株式数 58,700株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,457,700	1,057.50	10,001,517,750	
りそなホールディングス	1,908,700	716.30	1,367,201,810	
三井住友トラスト・ホールディングス	274,400	5,332.00	1,463,100,800	貸付株式数 101,900株
三井住友フィナンシャルグループ	1,103,500	6,200.00	6,841,700,000	
千葉銀行	420,900	912.90	384,239,610	
群馬銀行	293,000	549.40	160,974,200	
武蔵野銀行	19,400	2,355.00	45,687,000	貸付株式数 5,600株
千葉興業銀行	27,500	679.00	18,672,500	
筑波銀行	66,300	211.00	13,989,300	貸付株式数 13,900株
七十七銀行	48,300	2,725.00	131,617,500	
秋田銀行	10,100	1,698.00	17,149,800	

山形銀行	16,800	1,064.00	17,875,200	貸付株式数 6,000株
岩手銀行	10,300	2,122.00	21,856,600	貸付株式数 4,200株
東邦銀行	119,400	231.00	27,581,400	
東北銀行	5,700	1,040.00	5,928,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	120,600	3,095.00	373,257,000	
スルガ銀行	133,100	578.00	76,931,800	貸付株式数 5,200株
八十二銀行	319,000	658.00	209,902,000	
山梨中央銀行	15,500	1,307.00	20,258,500	
大垣共立銀行	28,800	1,867.00	53,769,600	貸付株式数 9,900株
福井銀行	13,500	1,471.00	19,858,500	
清水銀行	6,000	1,462.00	8,772,000	
富山銀行	1,800	1,699.00	3,058,200	貸付株式数 600株
滋賀銀行	25,100	2,784.00	69,878,400	
南都銀行	22,700	2,473.00	56,137,100	
百五銀行	142,100	443.00	62,950,300	
京都銀行	47,800	7,493.00	358,165,400	貸付株式数 2,900株
紀陽銀行	54,000	1,478.00	79,812,000	貸付株式数 12,600株
ほくほくフィナンシャルグループ	96,000	1,211.50	116,304,000	
山陰合同銀行	94,500	848.00	80,136,000	貸付株式数 7,800株
鳥取銀行	3,800	1,173.00	4,457,400	貸付株式数 2,000株
百十四銀行	13,800	1,929.00	26,620,200	貸付株式数 1,000株
四国銀行	24,000	882.00	21,168,000	
阿波銀行	21,200	2,023.00	42,887,600	貸付株式数 100株
大分銀行	9,100	2,233.00	20,320,300	
宮崎銀行	9,900	2,420.00	23,958,000	
佐賀銀行	8,800	1,698.00	14,942,400	貸付株式数 4,200株
琉球銀行	34,600	965.00	33,389,000	
セブン銀行	541,000	288.90	156,294,900	貸付株式数 74,300株 (74,300株)
みずほフィナンシャルグループ	2,184,000	2,211.00	4,828,824,000	
高知銀行	4,000	733.00	2,932,000	
山口フィナンシャルグループ	166,700	1,038.50	173,117,950	
芙蓉総合リース	13,900	11,030.00	153,317,000	貸付株式数 1,300株
みずほリース	22,500	4,680.00	105,300,000	貸付株式数 6,900株

東京センチュリー	28,200	5,134.00	144,778,800	貸付株式数 11,000株
SBIホールディングス	218,600	2,845.50	622,026,300	貸付株式数 47,100株
日本証券金融	55,500	1,083.00	60,106,500	貸付株式数 30,300株
アイフル	250,100	335.00	83,783,500	貸付株式数 8,500株
日本アジア投資	9,300	247.00	2,297,100	貸付株式数 5,900株
名古屋銀行	10,000	3,475.00	34,750,000	貸付株式数 5,700株
北洋銀行	228,800	287.00	65,665,600	
大光銀行	3,500	1,081.00	3,783,500	貸付株式数 600株
愛媛銀行	20,300	826.00	16,767,800	
トマト銀行	3,900	1,055.00	4,114,500	貸付株式数 2,100株
京葉銀行	69,100	556.00	38,419,600	
栃木銀行	69,100	261.00	18,035,100	貸付株式数 9,200株
北日本銀行	5,300	2,046.00	10,843,800	貸付株式数 2,900株
東和銀行	27,700	547.00	15,151,900	
福島銀行	12,400	215.00	2,666,000	
大東銀行	4,600	646.00	2,971,600	
リコーリース	14,300	4,235.00	60,560,500	貸付株式数 7,800株
イオンフィナンシャルサービス	86,700	1,267.00	109,848,900	
アコム	269,500	355.00	95,672,500	
ジャックス	16,100	5,030.00	80,983,000	
オリエントコーポレーション	39,400	1,141.00	44,955,400	貸付株式数 24,000株
オリックス	991,300	2,571.00	2,548,632,300	貸付株式数 556,000株
三菱HCキャピタル	588,800	864.50	509,017,600	
ジャフコグループ	50,400	1,792.50	90,342,000	貸付株式数 6,400株
九州リースサービス	5,500	894.00	4,917,000	貸付株式数 3,700株
トモニホールディングス	122,000	375.00	45,750,000	
大和証券グループ本社	1,079,900	723.30	781,091,670	
野村ホールディングス	2,781,200	542.20	1,507,966,640	
岡三証券グループ	132,600	480.00	63,648,000	貸付株式数 52,500株
丸三証券	50,200	438.00	21,987,600	貸付株式数 24,300株 (18,300株)
東洋証券	50,100	300.00	15,030,000	貸付株式数 10,400株

東海東京フィナンシャル・ホールディングス	164,400	392.00	64,444,800	貸付株式数 80,800株
光世証券	2,700	577.00	1,557,900	貸付株式数 1,800株 (300株)
水戸証券	40,500	339.00	13,729,500	
いちよし証券	27,800	608.00	16,902,400	
松井証券	89,200	801.00	71,449,200	貸付株式数 2,800株
SOMPOホールディングス	259,200	6,556.00	1,699,315,200	
日本取引所グループ	424,300	2,364.00	1,003,045,200	貸付株式数 18,400株
マネックスグループ	162,700	541.00	88,020,700	貸付株式数 85,500株
極東証券	18,800	649.00	12,201,200	
岩井コスモホールディングス	17,200	1,464.00	25,180,800	
アイザワ証券グループ	21,800	800.00	17,440,000	貸付株式数 7,800株
フィデアホールディングス	15,600	1,416.00	22,089,600	貸付株式数 6,400株
池田泉州ホールディングス	193,400	246.00	47,576,400	貸付株式数 7,800株
アニコムホールディングス	51,300	634.00	32,524,200	貸付株式数 3,400株
MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス	307,300	5,226.00	1,605,949,800	
マネーパートナーズグループ	12,200	270.00	3,294,000	
スパークス・グループ	16,800	1,495.00	25,116,000	貸付株式数 9,200株
小林洋行	5,000	239.00	1,195,000	貸付株式数 2,700株
第一生命ホールディングス	737,800	2,859.00	2,109,370,200	貸付株式数 93,800株
東京海上ホールディングス	1,492,700	3,284.00	4,902,026,800	
アドバンテッジリスクマネジメント	5,500	607.00	3,338,500	貸付株式数 3,000株
イー・ギャランティ	24,500	1,904.00	46,648,000	貸付株式数 400株
アサックス	5,300	647.00	3,429,100	貸付株式数 3,600株
NECキャピタルソリューション	7,400	3,175.00	23,495,000	
T & Dホールディングス	405,300	2,242.00	908,682,600	貸付株式数 225,400株
アドバンスクリエイト	8,700	1,229.00	10,692,300	貸付株式数 4,800株
三井不動産	644,400	2,827.50	1,822,041,000	貸付株式数 349,000株
三菱地所	911,200	1,711.50	1,559,518,800	
平和不動産	24,500	3,785.00	92,732,500	貸付株式数 300株

東京建物	143,900	1,851.50	266,430,850	貸付株式数 87,800株
京阪神ビルディング	25,400	1,143.00	29,032,200	貸付株式数 600株
住友不動産	273,000	3,528.00	963,144,000	貸付株式数 59,100株
太平洋興発	4,400	761.00	3,348,400	
テーオーシー	27,300	615.00	16,789,500	貸付株式数 15,000株
東京楽天地	2,500	4,130.00	10,325,000	貸付株式数 1,200株
レオパレス21	170,000	307.00	52,190,000	貸付株式数 101,000株
スターツコーポレーション	21,700	2,847.00	61,779,900	貸付株式数 1,700株
フジ住宅	21,100	675.00	14,242,500	
空港施設	18,200	553.00	10,064,600	貸付株式数 10,000株
明和地所	5,600	1,038.00	5,812,800	貸付株式数 3,000株
ゴールドクレスト	14,400	1,834.00	26,409,600	貸付株式数 7,800株
リログループ	87,700	1,928.00	169,085,600	貸付株式数 37,200株
エスリード	7,100	2,625.00	18,637,500	貸付株式数 3,800株
日神グループホールディングス	24,200	504.00	12,196,800	貸付株式数 12,500株
日本エスコン	33,900	807.00	27,357,300	貸付株式数 9,800株
MIRARTHホールディングス	76,300	450.00	34,335,000	
AVANTIA	6,600	876.00	5,781,600	貸付株式数 3,800株
イオンモール	78,300	1,862.00	145,794,600	貸付株式数 2,000株
毎日コムネット	4,300	751.00	3,229,300	貸付株式数 2,700株 (100株)
ファースト住建	4,700	1,101.00	5,174,700	貸付株式数 3,200株
ランド	908,900	8.00	7,271,200	貸付株式数 100株
カチタス	40,600	2,490.00	101,094,000	貸付株式数 18,500株
東祥	11,000	1,294.00	14,234,000	貸付株式数 5,900株
トーセイ	25,100	1,795.00	45,054,500	貸付株式数 14,000株
穴吹興産	2,300	2,183.00	5,020,900	貸付株式数 1,600株

サンフロンティア不動産	25,200	1,399.00	35,254,800	貸付株式数 6,500株
FJネクストホールディングス	15,900	1,008.00	16,027,200	貸付株式数 5,000株
インテリックス	2,900	521.00	1,510,900	貸付株式数 1,500株
ランドビジネス	4,300	264.00	1,135,200	
サンネクスタグループ	3,500	976.00	3,416,000	貸付株式数 2,300株
グランディハウス	9,900	584.00	5,781,600	
東武鉄道	168,400	3,657.00	615,838,800	
相鉄ホールディングス	50,600	2,481.00	125,538,600	貸付株式数 3,300株
東急	430,000	1,703.00	732,290,000	貸付株式数 236,200株
京浜急行電鉄	173,900	1,291.50	224,591,850	
小田急電鉄	232,400	1,872.00	435,052,800	貸付株式数 115,700株
京王電鉄	81,100	4,241.00	343,945,100	貸付株式数 46,400株
京成電鉄	98,900	5,822.00	575,795,800	貸付株式数 43,500株
富士急行	18,900	5,360.00	101,304,000	貸付株式数 10,300株
東日本旅客鉄道	260,000	7,850.00	2,041,000,000	貸付株式数 148,300株 (99,600株)
西日本旅客鉄道	195,900	5,843.00	1,144,643,700	貸付株式数 16,300株
東海旅客鉄道	118,100	17,730.00	2,093,913,000	
西武ホールディングス	185,500	1,472.50	273,148,750	
鴻池運輸	26,100	1,739.00	45,387,900	
西日本鉄道	41,000	2,435.50	99,855,500	貸付株式数 1,200株
ハマキョウレックス	12,000	3,740.00	44,880,000	
サカイ引越センター	7,300	4,925.00	35,952,500	
近鉄グループホールディングス	153,100	4,732.00	724,469,200	
阪急阪神ホールディングス	204,100	4,604.00	939,676,400	
南海電気鉄道	73,200	3,073.00	224,943,600	
京阪ホールディングス	84,400	3,682.00	310,760,800	貸付株式数 46,000株
神戸電鉄	4,200	2,978.00	12,507,600	貸付株式数 2,300株
名古屋鉄道	169,200	2,242.50	379,431,000	貸付株式数 17,300株
山陽電気鉄道	11,500	2,176.00	25,024,000	貸付株式数 6,300株
アルプス物流	12,200	1,533.00	18,702,600	貸付株式数 6,700株

トランコム	4,400	6,790.00	29,876,000	貸付株式数 1,800株
ヤマトホールディングス	196,000	2,601.50	509,894,000	貸付株式数 112,600株
山九	39,000	4,775.00	186,225,000	
日新	11,600	2,494.00	28,930,400	
丸運	5,800	239.00	1,386,200	
丸全昭和運輸	9,500	3,945.00	37,477,500	
センコーグループホールディングス	81,100	1,014.00	82,235,400	貸付株式数 6,200株
トナミホールディングス	3,400	4,905.00	16,677,000	
ニッコンホールディングス	49,000	2,852.50	139,772,500	
日本石油輸送	1,200	2,818.00	3,381,600	
福山通運	11,600	3,955.00	45,878,000	貸付株式数 5,400株
セイノーホールディングス	95,300	2,135.50	203,513,150	貸付株式数 59,100株 (600株)
エスライングループ本社	3,300	871.00	2,874,300	貸付株式数 1,700株
神奈川中央交通	4,300	3,120.00	13,416,000	貸付株式数 1,800株
A Z - C O M丸和ホールディングス	37,000	2,029.00	75,073,000	貸付株式数 10,600株
C & F ロジホールディングス	14,700	1,237.00	18,183,900	貸付株式数 1,000株
日本郵船	409,500	3,352.00	1,372,644,000	貸付株式数 224,000株
商船三井	269,900	3,678.00	992,692,200	貸付株式数 137,500株
川崎汽船	115,000	3,877.00	445,855,000	貸付株式数 68,500株
N S ユナイテッド海運	8,200	3,545.00	29,069,000	貸付株式数 4,500株
明治海運	11,600	584.00	6,774,400	貸付株式数 7,800株
飯野海運	56,200	889.00	49,961,800	貸付株式数 30,900株
共栄タンカー	2,100	860.00	1,806,000	貸付株式数 1,400株
九州旅客鉄道	108,200	3,089.00	334,229,800	
S Gホールディングス	293,800	2,068.50	607,725,300	貸付株式数 11,400株
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	57,100	8,070.00	460,797,000	貸付株式数 33,500株
I D & E ホールディングス	9,500	3,125.00	29,687,500	貸付株式数 3,100株
日本航空	376,000	3,134.00	1,178,384,000	貸付株式数 168,700株

ANAホールディングス	416,500	3,427.00	1,427,345,500	貸付株式数 232,200株 (43,600株)
ビーウィズ	4,000	2,286.00	9,144,000	
パスコ	2,300	1,846.00	4,245,800	貸付株式数 1,300株
TREホールディングス	33,200	1,223.00	40,603,600	貸付株式数 18,200株
人・夢・技術グループ	5,900	1,632.00	9,628,800	貸付株式数 500株
西本Wismettacホールディングス	4,100	4,445.00	18,224,500	貸付株式数 1,800株
シルバーライフ	3,100	1,426.00	4,420,600	貸付株式数 2,000株
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	2,064.00	2,064,000	貸付株式数 300株
Genky DrugStores	7,100	4,055.00	28,790,500	貸付株式数 3,900株
コア商事ホールディングス	9,100	646.00	5,878,600	貸付株式数 6,100株
KPPグループホールディングス	37,800	633.00	23,927,400	
ナルミヤ・インターナショナル	2,000	1,005.00	2,010,000	貸付株式数 1,300株
ブックオフグループホールディングス	8,200	1,266.00	10,381,200	貸付株式数 5,400株
ギフトホールディングス	3,400	4,745.00	16,133,000	貸付株式数 2,000株
三菱倉庫	32,900	3,458.00	113,768,200	
三井倉庫ホールディングス	14,300	3,490.00	49,907,000	
住友倉庫	41,300	2,377.00	98,170,100	貸付株式数 22,100株
澁澤倉庫	6,100	2,810.00	17,141,000	
ヤマタネ	7,200	1,709.00	12,304,800	
東陽倉庫	15,800	271.00	4,281,800	
乾汽船	19,400	1,296.00	25,142,400	貸付株式数 10,700株
日本トランスシティ	30,800	627.00	19,311,600	貸付株式数 16,700株
ケイヒン	2,100	1,761.00	3,698,100	
中央倉庫	7,400	1,086.00	8,036,400	貸付株式数 3,500株
川西倉庫	2,000	1,038.00	2,076,000	貸付株式数 700株
安田倉庫	10,400	987.00	10,264,800	貸付株式数 5,800株
ファイズホールディングス	2,200	1,204.00	2,648,800	貸付株式数 1,300株
大栄環境	40,100	2,409.00	96,600,900	貸付株式数 9,200株
日本管財ホールディングス	16,500	2,580.00	42,570,000	

東洋埠頭	3,400	1,414.00	4,807,600	貸付株式数 1,800株
上組	73,400	3,224.00	236,641,600	貸付株式数 6,800株
サンリツ	2,700	750.00	2,025,000	
キムラユニティー	5,700	1,327.00	7,563,900	貸付株式数 3,900株
キューソー流通システム	7,100	920.00	6,532,000	貸付株式数 3,900株
東海運	7,000	291.00	2,037,000	貸付株式数 4,700株
エーアイティー	9,600	1,840.00	17,664,000	貸付株式数 5,300株
内外トランスライン	5,500	2,545.00	13,997,500	貸付株式数 3,000株
ショーエイコーポレーション	3,500	596.00	2,086,000	貸付株式数 1,900株
日本コンセプト	4,800	1,767.00	8,481,600	貸付株式数 2,600株
TBSホールディングス	78,700	2,620.50	206,233,350	貸付株式数 13,300株
日本テレビホールディングス	136,100	1,338.00	182,101,800	貸付株式数 87,800株
朝日放送グループホールディングス	14,400	660.00	9,504,000	貸付株式数 7,800株
テレビ朝日ホールディングス	37,300	1,693.00	63,148,900	
スカパーJ S A Tホールディングス	136,400	580.00	79,112,000	
テレビ東京ホールディングス	11,100	3,405.00	37,795,500	貸付株式数 6,000株
日本BS放送	4,300	930.00	3,999,000	貸付株式数 2,900株
ビジョン	20,300	1,780.00	36,134,000	
スマートバリュー	2,900	387.00	1,122,300	貸付株式数 1,800株
USEN-NEXT HOLDINGS	17,200	3,325.00	57,190,000	貸付株式数 9,800株
ワイヤレスゲート	5,200	223.00	1,159,600	
日本通信	141,900	240.00	34,056,000	貸付株式数 77,900株
クロップス	1,900	1,037.00	1,970,300	貸付株式数 100株
日本電信電話	49,263,000	166.20	8,187,510,600	貸付株式数 1,125,900株
KDDI	1,188,300	4,291.00	5,098,995,300	貸付株式数 771,000株
ソフトバンク	2,471,300	1,536.50	3,797,152,450	貸付株式数 1,349,300株
光通信	18,100	20,595.00	372,769,500	貸付株式数 300株

エムティーアイ	10,500	557.00	5,848,500	貸付株式数 5,800株 (2,400株)
GMOインターネットグループ	56,800	2,701.50	153,445,200	貸付株式数 20,000株
ファイバークラウド	8,300	1,416.00	11,752,800	貸付株式数 4,500株
アイドママーケティングコミュニケーション	2,700	273.00	737,100	貸付株式数 1,600株
KADOKAWA	81,300	3,426.00	278,533,800	貸付株式数 10,000株
学研ホールディングス	25,600	865.00	22,144,000	貸付株式数 11,400株
ゼンリン	26,300	925.00	24,327,500	貸付株式数 16,800株
昭文社ホールディングス	5,100	298.00	1,519,800	貸付株式数 700株
インプレスホールディングス	10,500	234.00	2,457,000	貸付株式数 5,700株
東京電力ホールディングス	1,382,200	525.10	725,793,220	貸付株式数 800,200株
中部電力	565,000	1,717.50	970,387,500	貸付株式数 313,800株 (313,800株)
関西電力	592,100	1,781.00	1,054,530,100	貸付株式数 325,200株
中国電力	244,200	978.20	238,876,440	貸付株式数 34,000株
北陸電力	144,700	766.00	110,840,200	貸付株式数 79,500株 (75,700株)
東北電力	374,900	887.80	332,836,220	貸付株式数 220,000株
四国電力	130,900	971.90	127,221,710	
九州電力	353,500	915.50	323,629,250	貸付株式数 21,500株
北海道電力	148,100	582.50	86,268,250	
沖縄電力	35,900	1,153.00	41,392,700	貸付株式数 19,600株
電源開発	115,500	2,153.00	248,671,500	貸付株式数 300株
エフオン	9,900	540.00	5,346,000	貸付株式数 2,800株
イーレックス	27,200	1,115.00	30,328,000	貸付株式数 16,900株
レノバ	40,800	1,536.00	62,668,800	貸付株式数 26,000株
東京瓦斯	324,200	3,115.00	1,009,883,000	貸付株式数 179,300株
大阪瓦斯	310,600	2,145.50	666,392,300	

東邦瓦斯	60,400	2,436.50	147,164,600	貸付株式数 500株
北海道瓦斯	9,200	2,316.00	21,307,200	貸付株式数 4,200株
広島ガス	32,300	370.00	11,951,000	
西部ガスホールディングス	14,400	2,030.00	29,232,000	
静岡ガス	35,000	1,067.00	37,345,000	貸付株式数 19,100株
メタウォーター	18,400	1,777.00	32,696,800	貸付株式数 4,300株
アイネット	9,300	1,640.00	15,252,000	貸付株式数 3,700株
松竹	8,800	10,535.00	92,708,000	貸付株式数 4,700株
東宝	96,200	5,370.00	516,594,000	
エイチ・アイ・エス	41,200	1,997.00	82,276,400	貸付株式数 22,600株
東映	4,200	17,870.00	75,054,000	貸付株式数 900株
ラックランド	6,600	3,035.00	20,031,000	貸付株式数 3,500株
NTTデータグループ	482,500	1,923.00	927,847,500	貸付株式数 138,200株
共立メンテナンス	27,000	5,447.00	147,069,000	貸付株式数 16,600株 (11,700株)
イチネンホールディングス	16,700	1,339.00	22,361,300	貸付株式数 100株
建設技術研究所	8,100	3,395.00	27,499,500	
スペース	11,400	1,035.00	11,799,000	
アインホールディングス	22,300	5,061.00	112,860,300	貸付株式数 7,000株
燦ホールディングス	6,700	2,134.00	14,297,800	
ピー・シー・エー	8,800	1,398.00	12,302,400	貸付株式数 1,700株 (800株)
スバル興業	700	9,920.00	6,944,000	貸付株式数 300株
東京テアトル	4,500	1,125.00	5,062,500	貸付株式数 2,900株
タナベコンサルティンググループ	4,700	1,013.00	4,761,100	
ビジネスブレイン太田昭和	6,600	2,248.00	14,836,800	貸付株式数 700株
ナガワ	4,200	6,730.00	28,266,000	貸付株式数 2,300株
東京都競馬	13,200	3,840.00	50,688,000	貸付株式数 7,300株
常盤興産	4,200	1,236.00	5,191,200	貸付株式数 2,800株

カナモト	28,900	2,307.00	66,672,300	貸付株式数 8,000株
D T S	32,700	3,240.00	105,948,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	77,300	6,421.00	496,343,300	
シーイーシー	21,600	1,739.00	37,562,400	
カブコン	152,800	5,592.00	854,457,600	貸付株式数 2,700株
ニシオホールディングス	14,700	3,390.00	49,833,000	
アイ・エス・ビー	7,800	1,566.00	12,214,800	貸付株式数 800株
アゴーラ ホスピタリティグループ	67,800	25.00	1,695,000	貸付株式数 42,600株
日本空港ビルデング	53,400	6,344.00	338,769,600	貸付株式数 8,500株
トランス・コスモス	19,600	3,365.00	65,954,000	貸付株式数 10,500株 (3,000株)
乃村工藝社	68,700	949.00	65,196,300	貸付株式数 33,000株
ジャステック	9,400	1,313.00	12,342,200	
S C S K	125,500	2,220.50	278,672,750	貸付株式数 24,000株
藤田観光	7,000	3,305.00	23,135,000	貸付株式数 3,800株
K N T - C Tホールディングス	9,400	1,426.00	13,404,400	貸付株式数 5,100株
トーカイ	13,900	1,882.00	26,159,800	
白洋舎	1,600	2,850.00	4,560,000	貸付株式数 500株
セコム	160,500	9,469.00	1,519,774,500	貸付株式数 86,800株
N S W	6,000	2,362.00	14,172,000	
セントラル警備保障	8,500	2,878.00	24,463,000	貸付株式数 4,700株
アイネス	10,800	1,461.00	15,778,800	
丹青社	30,500	780.00	23,790,000	貸付株式数 6,800株
メイテック	61,500	2,413.50	148,430,250	貸付株式数 16,100株
T K C	24,500	3,740.00	91,630,000	貸付株式数 600株
富士ソフト	34,800	4,445.00	154,686,000	貸付株式数 6,200株
応用地質	14,700	2,129.00	31,296,300	貸付株式数 4,400株
船井総研ホールディングス	32,800	2,457.00	80,589,600	貸付株式数 7,100株
N S D	54,900	2,764.00	151,743,600	

進学会ホールディングス	4,000	292.00	1,168,000	貸付株式数 2,400株
丸紅建材リース	1,100	2,460.00	2,706,000	
オオバ	7,600	761.00	5,783,600	
コナミグループ	65,800	7,328.00	482,182,400	貸付株式数 37,700株
いであ	2,700	1,695.00	4,576,500	貸付株式数 400株
学究社	6,300	2,055.00	12,946,500	貸付株式数 100株
ベネッセホールディングス	58,800	1,820.00	107,016,000	貸付株式数 32,700株
イオンディライト	17,400	2,998.00	52,165,200	貸付株式数 9,900株
ナック	7,000	955.00	6,685,000	貸付株式数 3,600株
福井コンピュータホールディングス	10,700	2,665.00	28,515,500	貸付株式数 4,900株
ダイセキ	32,200	4,085.00	131,537,000	貸付株式数 17,700株
ステップ	5,700	1,755.00	10,003,500	
泉州電業	8,100	3,650.00	29,565,000	貸付株式数 4,500株
元気寿司	4,600	3,285.00	15,111,000	貸付株式数 2,400株
トラスコ中山	34,100	2,229.00	76,008,900	貸付株式数 3,100株
ヤマダホールディングス	665,200	419.90	279,317,480	
オートバックスセブン	56,500	1,533.00	86,614,500	貸付株式数 19,000株
モリト	11,600	1,061.00	12,307,600	貸付株式数 6,300株
アークランズ	23,700	1,552.00	36,782,400	貸付株式数 12,900株
ニトリホールディングス	65,600	15,830.00	1,038,448,000	貸付株式数 4,700株
グルメ杵屋	13,100	1,021.00	13,375,100	貸付株式数 7,200株
愛眼	9,300	184.00	1,711,200	
ケーユーホールディングス	9,500	1,195.00	11,352,500	
吉野家ホールディングス	63,500	2,555.00	162,242,500	貸付株式数 40,400株
加藤産業	20,100	3,795.00	76,279,500	貸付株式数 100株
北恵	2,800	779.00	2,181,200	貸付株式数 500株
イノテック	10,200	1,611.00	16,432,200	貸付株式数 100株
イエローハット	28,600	1,818.00	51,994,800	貸付株式数 15,400株

松屋フーズホールディングス	7,700	4,105.00	31,608,500	貸付株式数 3,200株
J B C Cホールディングス	11,200	2,431.00	27,227,200	
J Kホールディングス	12,500	969.00	12,112,500	貸付株式数 1,000株
サガミホールディングス	26,100	1,254.00	32,729,400	貸付株式数 14,300株
日伝	9,600	2,437.00	23,395,200	貸付株式数 5,200株
関西フードマーケット	14,600	1,403.00	20,483,800	貸付株式数 8,100株
ミロク情報サービス	14,000	1,571.00	21,994,000	貸付株式数 200株
北沢産業	6,700	369.00	2,472,300	貸付株式数 4,500株
杉本商事	7,200	2,148.00	15,465,600	貸付株式数 200株
因幡電機産業	42,100	3,130.00	131,773,000	
王将フードサービス	10,700	6,500.00	69,550,000	貸付株式数 5,300株
ミニストップ	11,800	1,444.00	17,039,200	貸付株式数 6,500株
アークス	29,800	2,468.00	73,546,400	貸付株式数 13,500株
バローホールディングス	31,000	1,996.00	61,876,000	貸付株式数 5,900株
東テク	5,400	5,280.00	28,512,000	
ミスミグループ本社	244,900	2,774.00	679,352,600	
アルテック	7,000	256.00	1,792,000	貸付株式数 4,700株
ベルク	8,100	6,220.00	50,382,000	貸付株式数 500株
大 庄	6,800	1,152.00	7,833,600	貸付株式数 4,600株
タキヒヨー	3,100	1,028.00	3,186,800	貸付株式数 1,900株
ファーストリテイリング	73,000	34,560.00	2,522,880,000	貸付株式数 46,700株
ソフトバンクグループ	758,600	6,724.00	5,100,826,400	貸付株式数 178,100株
蔵王産業	2,100	2,401.00	5,042,100	貸付株式数 100株
スズケン	47,500	3,856.00	183,160,000	貸付株式数 12,200株
サンドラッグ	61,600	4,177.00	257,303,200	貸付株式数 1,000株
サクスパー ホールディングス	15,400	979.00	15,076,600	貸付株式数 9,000株
ジェコス	9,700	883.00	8,565,100	

ヤマザワ	2,300	1,276.00	2,934,800	貸付株式数 1,500株
やまや	2,600	2,691.00	6,996,600	貸付株式数 1,500株
グローセル	15,200	419.00	6,368,800	貸付株式数 9,000株
ペルーナ	39,000	696.00	27,144,000	貸付株式数 16,800株
合計	228,967,100		494,066,725,840	

(注) 貸付株式数のうち(括弧書)の数値は、委託者の利害関係人であるみずほ証券株式会社に対する貸付であります。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2023年7月31日現在

資産総額	669,129,982,153円
負債総額	158,205,256,708円
純資産総額(-)	510,924,725,445円
発行済数量	217,028,884口
1口当たり純資産額(/)	2,354.18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) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 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た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。

(4) 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。

(5) 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。

(6) 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、交換請求の受付、交換有価証券の交付および信託終了にかかる金銭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（2023年7月31日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2023年7月31日現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年7月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,552,827,736,355
追加型株式投資信託	783	15,353,432,764,987
単位型公社債投資信託	22	38,793,354,246
単位型株式投資信託	208	1,109,369,905,668
合計	1,039	18,054,423,761,256

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第38期事業年度（自2022年4月1日至2023年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	31,421	33,770
金銭の信託	30,332	29,184
未収委託者報酬	17,567	16,279
未収運用受託報酬	4,348	3,307
未収投資助言報酬	309	283
未収収益	5	15
前払費用	1,167	1,129
その他	2,673	2,377
流動資産計	87,826	86,346
固定資産		
有形固定資産		
建物	1,109	1,001
器具備品	158	118
リース資産	-	7
無形固定資産		
ソフトウェア	3,107	3,367
ソフトウェア仮勘定	1,449	1,651
電話加入権	3	2
投資その他の資産		
投資有価証券	241	182
関係会社株式	5,349	5,810
長期差入保証金	1,102	775
繰延税金資産	3,092	2,895
その他	367	104
固定資産計	15,983	15,918
資産合計	103,810	102,265

(単位:百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,445	1,481
リース債務	-	1
未払金	7,616	7,246
未払収益分配金	0	0
未払償還金	9	-
未払手数料	7,430	7,005
その他未払金	175	240
未払費用	8,501	7,716
未払法人税等	2,683	1,958
未払消費税等	1,330	277
賞与引当金	1,933	1,730
役員賞与引当金	69	48
流動負債計	23,581	20,460
固定負債		
リース債務	-	6
退職給付引当金	2,507	2,654
時効後支払損引当金	147	108
固定負債計	2,655	2,769
負債合計	26,236	23,230
(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	56,020	57,481
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	55,896	57,358
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	24,216	25,678
株主資本計	77,573	79,034
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	77,573	79,034
負債・純資産合計	103,810	102,265

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	108,563		95,739	
運用受託報酬	16,716		16,150	
投資助言報酬	1,587		2,048	
その他営業収益	12		23	
営業収益計		126,879		113,962
営業費用				
支払手数料	45,172		41,073	
広告宣伝費	391		216	
公告費	0		0	
調査費	36,488		33,177	
調査費	10,963		12,294	
委託調査費	25,525		20,882	
委託計算費	557		548	
営業雑経費	842		733	
通信費	35		36	
印刷費	606		504	
協会費	66		69	
諸会費	26		29	
支払販売手数料	106		92	
営業費用計		83,453		75,749
一般管理費				
給料	10,377		10,484	
役員報酬	168		168	
給料・手当	8,995		9,199	
賞与	1,213		1,115	
交際費	6		17	
寄付金	15		11	
旅費交通費	40		128	
租税公課	367		330	
不動産賃借料	1,674		1,006	
退職給付費用	495		437	
固定資産減価償却費	1,389		1,388	
福利厚生費	42		47	
修繕費	0		1	
賞与引当金繰入額	1,933		1,730	
役員賞与引当金繰入額	69		48	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,901		4,074	
事務用消耗品費	45		37	
器具備品費	0		1	
諸経費	217		334	
一般管理費計		20,578		20,078
営業利益		22,848		18,135

（単位：百万円）

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）		第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	
営業外収益				
受取利息		13		10
受取配当金	1	559	1	2,400
時効成立分配金・償還金		0		0
為替差益		7		-
雑収入		19		10
時効後支払損引当金戻入額		10		24
営業外収益計		610		2,446
営業外費用				
為替差損		-		3
金銭の信託運用損		743		1,003
早期割増退職金		20		24
雑損失		-		47
営業外費用計		764		1,079
経常利益		22,694		19,502
特別利益				
固定資産売却益		0		-
投資有価証券売却益		-		4
特別利益計		0		4
特別損失				
固定資産除却損		5		12
投資有価証券売却損		6		9
ゴルフ会員権売却損		3		-
オフィス再編費用	2	509		-
関係会社株式評価損		-		584
特別損失計		525		606
税引前当期純利益		22,169		18,900
法人税、住民税及び事業税		6,085		4,881
法人税等調整額		584		197
法人税等合計		6,669		5,078
当期純利益		15,499		13,821

（３）【株主資本等変動計算書】

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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573
当期変動額									
剰余金の配当							12,360	12,360	12,360
当期純利益							13,821	13,821	13,821
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,461	1,461	1,461
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034

	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	77,573
当期変動額			
剰余金の配当			12,360
当期純利益			13,821
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	1,461
当期末残高	0	0	79,034

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(リース資産を除く) 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(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)に基づく定額法を採用しております。</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、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2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。）を当事業年度の期首から適用し、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、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

また、（金融商品会計）注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27 - 3項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

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37期 （2022年3月31日現在）	第38期 （2023年3月31日現在）
建物	415	523
器具備品	966	934
リース資産	-	1

（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37期 （自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）	第38期 （自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）
受取配当金	543	2,393

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

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					

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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
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

2023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
2023年6月16日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19日
	A種種類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第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	-

第38期（2023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	29,184	29,184	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	29,186	29,186	-

(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	-	-

第38期（2023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	33,770	-	-	-
(2) 金銭の信託	29,184	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,279	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,307	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	82,540	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

第37期（2022年3月31日現在）

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。

第38期（2023年3月31日現在）

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	-	29,184	-	29,184
(2) 投資有価証券	-	-	-	-
その他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	29,186	-	29,186

（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。

投資有価証券

投資有価証券は市場における取引価格が存在しない投資信託であり、基準価額を時価としております。

（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37期 （2022年3月31日現在）	第38期 （2023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	239	180
関係会社株式		
非上場株式	5,349	5,810

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（第37期の貸借対照表計上額5,349百万円、第38期の貸借対照表計上額5,810百万円）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 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 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。

第38期（2023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 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 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。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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	54	4	9

4. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、有価証券について584百万円（関係会社株式584百万円）減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度（非積立型制度であります）を採用しております。確定拠出型の制度としては確定拠出年金制度を採用しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,479	2,576
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	14	31
退職給付の支払額	185	191
退職給付債務の期末残高	2,576	2,698

(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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,576	2,698
未積立退職給付債務	2,576	2,698
未認識数理計算上の差異	35	44
未認識過去勤務費用	33	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654
退職給付引当金	2,507	2,654
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	34	22
過去勤務費用の費用処理額	69	34
その他	3	4
確定給付制度に係る退職給付費用	398	334

(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20百万円、当事業年度において24百万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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023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% ~ 3.56%

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97百万円、当事業年度103百万円であります。

（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37期	第38期
	(2022年3月31日現在)	(2023年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	156	121
未払事業所税	10	9
賞与引当金	592	529
未払法定福利費	92	94
運用受託報酬	845	390
資産除去債務	13	15
減価償却超過額（一括償却資産）	12	21
減価償却超過額	58	198
繰延資産償却超過額（税法上）	292	297
退職給付引当金	767	812
時効後支払損引当金	45	33
ゴルフ会員権評価損	7	7
関係会社株式評価損	166	345
投資有価証券評価損	28	4
その他	2	13
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	3,092	2,895
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	3,092	2,895

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

	第37期	第38期
	(2022年3月31日現在)	(2023年3月31日現在)
法定実効税率	-	30.62 %
（調整）		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	3.69 %
その他	-	0.06 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	26.87 %

（注）前事業年度は、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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
流動資産	- 百万円	- 百万円
固定資産	76,763百万円	68,921百万円
資産合計	76,763百万円	68,921百万円
流動負債	- 百万円	- 百万円
固定負債	4,740百万円	3,643百万円
負債合計	4,740百万円	3,643百万円
純資産	72,022百万円	65,278百万円

(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	55,263百万円	51,451百万円
顧客関連資産	25,175百万円	20,947百万円

(2) 損益計算書項目

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	8,429百万円	8,039百万円
経常利益	8,429百万円	8,039百万円
税引前当期純利益	8,429百万円	8,039百万円
当期純利益	7,015百万円	6,744百万円
1株当たり当期純利益	175,380円68銭	168,617円97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	4,618百万円	4,228百万円

（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

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）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
委託者報酬	108,259百万円	95,739百万円
運用受託報酬	14,425百万円	14,651百万円
投資助言報酬	1,587百万円	2,048百万円
成功報酬（注）	2,594百万円	1,499百万円
その他営業収益	12百万円	23百万円
合計	126,879百万円	113,962百万円

（注）成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の委託者報酬及び運用受託報酬、当事業年度においては損益計算書の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37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）及び第38期（自 2022年4月1日 至 2023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。

（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。

(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37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

第38期(自 2022年4月1日 至 2023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37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

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。

第38期(自 2022年4月1日 至 2023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	7,474	未払 手数料	1,579
	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	13,932	未払 手数料	2,404

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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	1,939,327円79銭	1,975,862円96銭
1株当たり当期純利益金額	387,499円36銭	345,535円19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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益金額	15,499百万円	13,821百万円
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	15,499百万円	13,821百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2023年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の「販売会社一覧表」の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
みずほ証券株式会社	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。
JPMorgan証券株式会社	73,272	「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。
ジェフリーズ・ジャパン・リミテッド	(1) 2,004	「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。
UBS証券株式会社	(2) 34,708	「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。
ソシエテ・ジェネラル証券株式会社	35,765	「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。
シティグループ証券株式会社	96,307	「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。
大和証券株式会社	100,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
東海東京証券株式会社	6,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
SMB C日興証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
野村証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
バークレイズ証券株式会社	(2) 38,945	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
BNPパリバ証券株式会社	102,025	「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。
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	5,505	「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。

B o f A証券株式会社	(2) 83,140	「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。
モルガン・スタンレーM U F G証券株式会社	62,149	「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2023年3月末日現在

(1) 2022年11月30日現在

(2) 2022年12月31日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2) 信託財産の計算
- (3) 信託財産に関する報告書の作成
- (4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集販売の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 交換請求の受付
- (4) 受益権の買取りに関する事務
- (5) 信託終了時の取扱い
- (6) その他上記に付帯する業務

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

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

- ・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
- ・委託会社の金融商品取引業者登録番号
- ・詳細情報の入手方法
委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など
請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
- ・目論見書の使用開始日
- ・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
- ・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
- ・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2023年5月25日

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

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2023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。

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2023年9月8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 伊加井 真弓
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているOne ETF トピックスの2023年1月9日から2023年7月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、One ETF トピックスの2023年7月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、経営者に対して、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するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以 上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。