

## 【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12月8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】	MHAM TOPIXオープン
【届出の対象とした募集(売出) 内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

MHAM TOPIXオープン(以下「当ファンド」といいます。)

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込日の基準価額とします。

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

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

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

注：電話番号はコールセンターのものであります（以下同じ）。

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

### （５）【申込手数料】

通常のお申込みのお取扱い

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

確定拠出年金制度に基づくお申込みのお取扱い

無手数料とします。

申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。

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

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

#### (6) 【申込単位】

申込単位は、各販売会社が定める単位とします。

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

申込単位および取扱コースについては、販売会社にお問い合わせください。

当初元本は1口当たり1円です。

#### (7) 【申込期間】

2023年12月9日から2024年6月11日まで

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

#### (8) 【申込取扱場所】

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

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

#### (9) 【払込期日】

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

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

#### (10) 【払込取扱場所】

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

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

#### (11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

## 株式会社証券保管振替機構

## (12)【その他】

## 投資信託振替制度における振替受益権について

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

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

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

## 確定拠出年金制度に基づくお申込みのお取扱い

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

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

##### <ファンドの特色>

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

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

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

< 商品分類 >

・商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・商品分類定義

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

## &lt; 属性区分 &gt;

## ・属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## ・属性区分定義

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

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

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

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

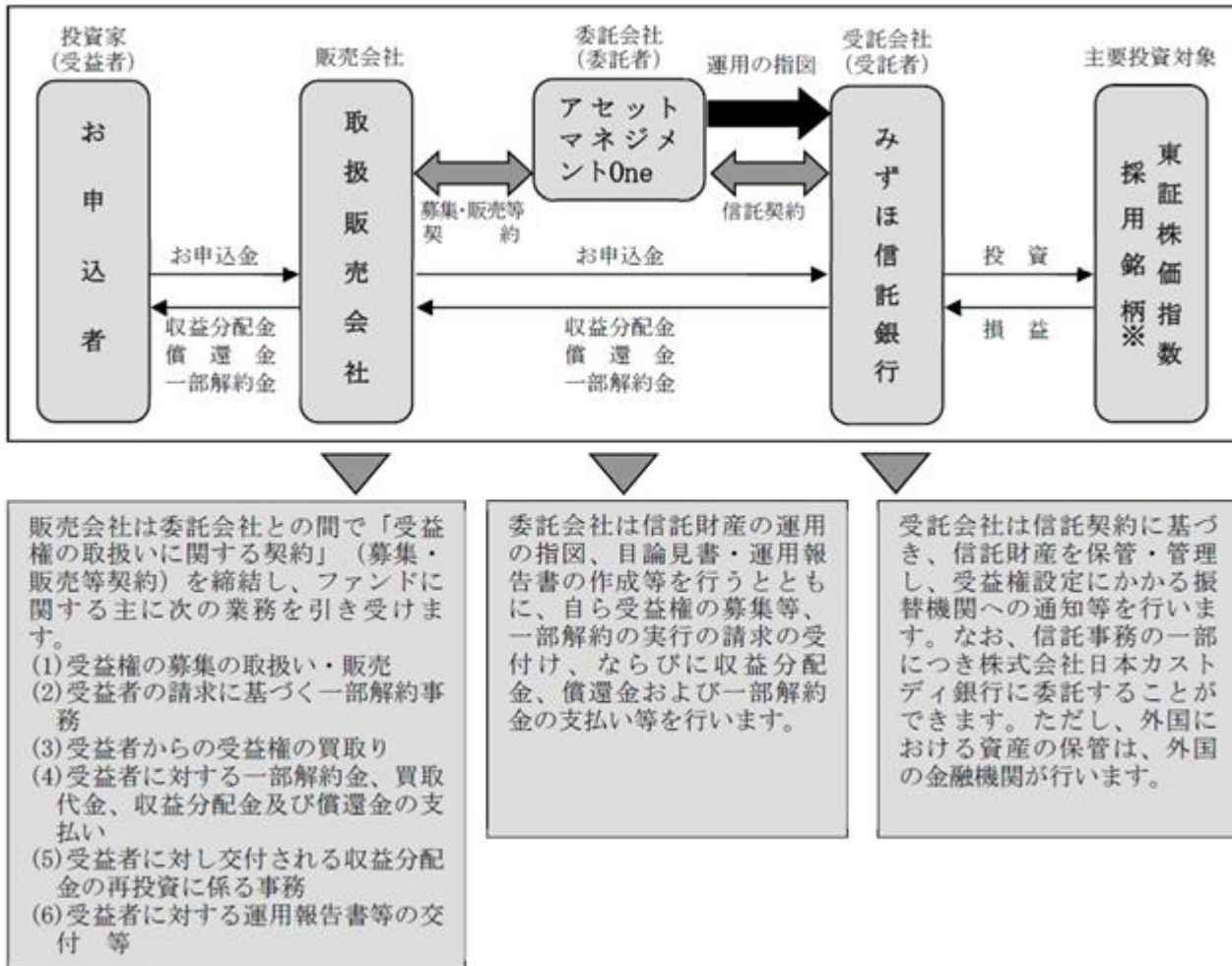
## （2）【ファンドの沿革】

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



## (3) 【ファンドの仕組み】

## 当ファンドの運営の仕組み



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

## ファミリーファンド方式の仕組み

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

## ファミリーファンド方式



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

マザーファンドのほかに、株式等に直接投資する場合があります。

## 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

#### 資本金の額

20億円（2023年9月29日現在）

#### 委託会社の沿革

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

#### 大株主の状況

（2023年9月29日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

#### 基本方針

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

#### 運用方法

##### 1．主要投資対象

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。

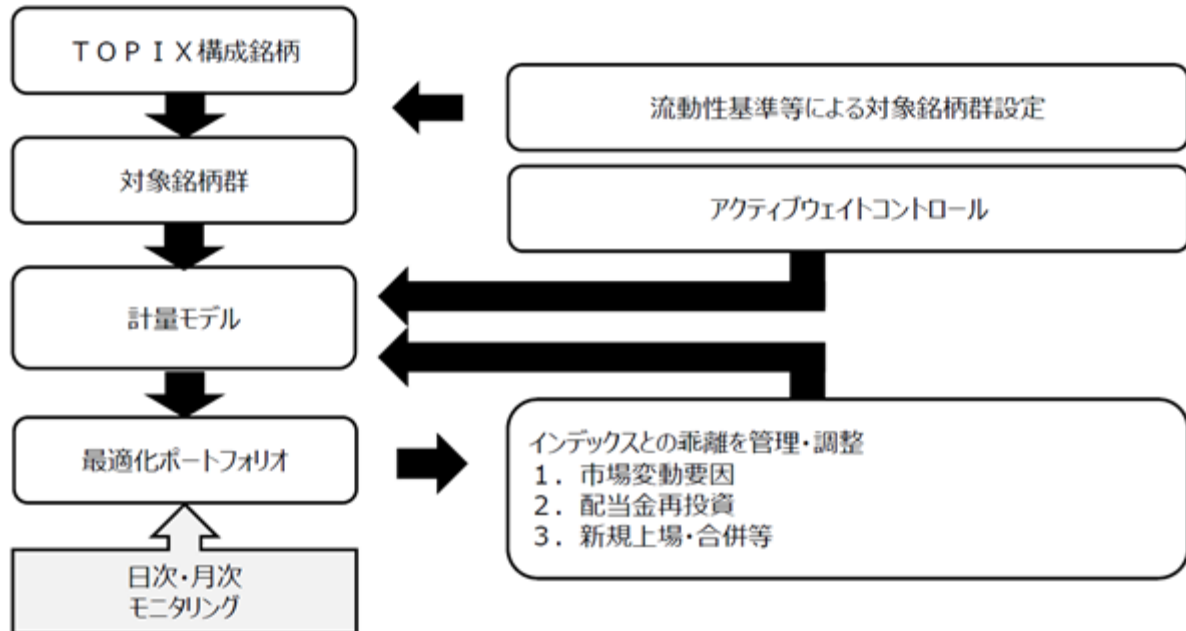
## 2. 投資態度

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

## ファンドの投資プロセス

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

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



#### 1. 流動性基準等による対象銘柄群設定

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

#### 2. 最適化法によるポートフォリオの構築

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

#### 3. インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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

## (2) 【投資対象】

### 有価証券の指図範囲

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

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

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

### 金融商品の指図範囲

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

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

### その他の投資対象

1. 有価証券先物取引等

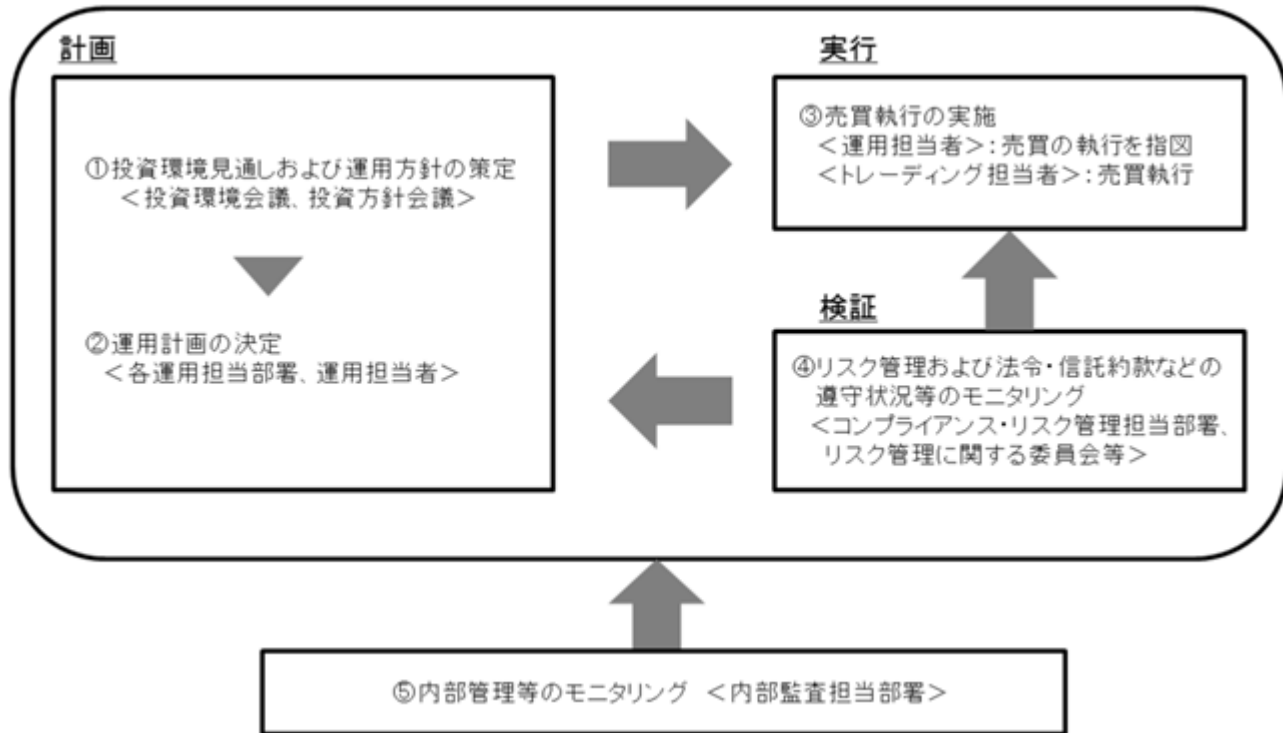
有価証券先物取引等を行うことができます。

## 2. スワップ取引および金利先渡取引

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

### (3) 【運用体制】

#### a. ファンドの運用体制



#### 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

#### 運用計画の決定

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

#### 売買執行の実施

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

#### モニタリング

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

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

#### 内部管理等のモニタリング

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

#### b. ファンドの関係法人に関する管理

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

#### c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2023年9月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

### (4) 【分配方針】

#### 収益分配方針

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

##### 1. 分配対象収益の範囲

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

##### 2. 分配対象収益についての分配方針

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

##### 3. 留保金の運用方針

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

将来の収益分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

#### 収益分配金の支払い

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

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

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

#### (5) 【投資制限】

##### a. 約款で定める投資制限

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

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

非株式[株式以外の資産](約款 運用の基本方針(2)運用方法 投資態度)

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

外貨建資産への投資(約款 運用の基本方針(3)運用制限)

外貨建資産への投資は行いません。

デリバティブ取引(約款 運用の基本方針(3)運用制限)

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。

信用取引(約款第21条)

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお当該売り付けの決済については、株券の引き渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、且つ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。



- a. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
- b. 株式分割により取得する株券
- c. 有償増資により取得する株券
- d. 売り出しにより取得する株券
- e. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしている新株予約権付社債(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券
- f. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前記e.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

#### 信用リスク集中回避のための投資制限(約款第21条の1の2)

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

#### デリバティブ取引等(約款第21条の2)

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

#### 有価証券先物取引等(約款第22条)

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

#### スワップ取引(約款第23条)

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(「スワップ取引」)を行うことの指図をすることができます。

2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
4. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 金利先渡取引(約款第24条)

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

#### 転換社債等(約款第25条)

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

#### 有価証券の貸付(約款第26条)

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

#### 資金の借入れ(約款第33条)

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約にともなう支払資金の手当て(一部解約にともなう支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

2. 一部解約にともなう支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
4. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

#### b. 法令で定める投資制限

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

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

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

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

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

##### (2) 投資態度

- 1) 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている(または採用予定の)銘柄に投資し、東証株価指数(TOPIX、配当込み)に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。
- 3) 株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 4) 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
- 5) 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。

##### (3) 投資制限

- 1) 株式への投資割合には、制限を設けません。

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

### 3【投資リスク】

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

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

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

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

#### 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

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

## 流動性リスク

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

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

## 信用リスク

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

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

## <その他>

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

## <その他の留意点>

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

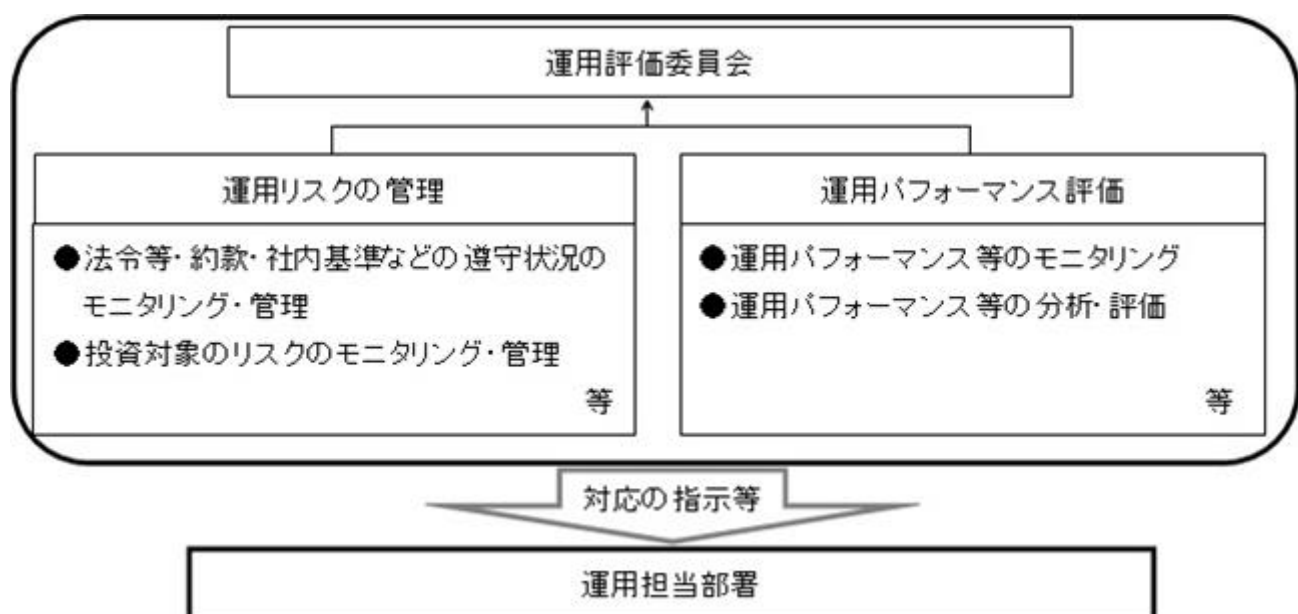
< 収益分配金に関する留意点 >

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

(2) リスク管理体制

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

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



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

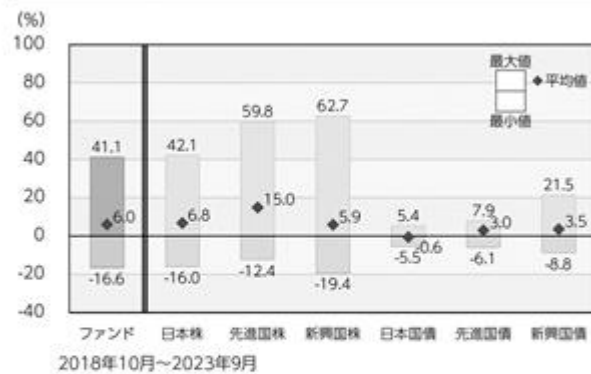
リスク管理体制は2023年9月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <参考情報>

### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



\*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。なお、分配金再投資基準価額は、1999年1月4日の当ファンドの基準価額(9,649円)に合わせて指数化しています。

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

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

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、日本の株式市場を広く網羅し、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・ディバースファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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



## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

通常のお申込みの場合

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

確定拠出年金制度に基づくお申込みの場合

無手数料とします。

申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。

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

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

#### < 申込手数料を対価とする役務の内容 >

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

### (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

### (3)【信託報酬等】

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

その配分（税抜）については、以下の通りとなります。

委託会社	販売会社	受託会社
0.265%	0.275%	0.060%

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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

## &lt; 信託報酬等を対価とする役務の内容 &gt;

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

## (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

## (5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

## 個人の受益者に対する課税

## 収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

## 解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

## 損益通算について

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

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

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

<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公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税(復興特別所得税を含みます。)および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記は、2023年9月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

#### 個別元本方式について

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

#### < 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「一般コース」と「自動けいぞく投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

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

#### < 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

#### (参考情報)ファンドの総経費率

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.66%	0.66%	0.00%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2022年3月11日～2023年3月10日

※対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません。消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)です。

※総経費率には、ファンドにより購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税以外にも計算に含まれない費用が存在する場合があります。

※なお、当ファンドについては、入手し得る情報において計算に含まれていない費用はありません。

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

2023年9月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	10,152,416,462	99.98
内 日本	10,152,416,462	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,039,462	0.02
純資産総額	10,154,455,924	100.00

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

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

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2023年9月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	440,595,712,530	97.59
内 日本	440,595,712,530	97.59
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,896,809,256	2.41
純資産総額	451,492,521,786	100.00

その他資産の投資状況

2023年9月29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)	11,594,265,000	2.57
内 日本	11,594,265,000	2.57

(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9月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,508,999,719	3.4668 8,698,259,284	4.0464 10,152,416,462	- -	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年9月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.98
合計	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年9月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,329,700	1,922.36 14,090,337,846	2,677.50 19,625,271,750	- -	4.35
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	944,200	12,059.62 11,386,695,806	12,240.00 11,557,008,000	- -	2.56
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,233,600	943.73 7,770,304,178	1,268.50 10,444,321,600	- -	2.31
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	42,886,300	155.41 6,665,346,381	176.60 7,573,720,580	- -	1.68
5	キーエンス 日本	株式 電気機器	133,500	61,138.97 8,162,053,449	55,500.00 7,409,250,000	- -	1.64
6	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	934,400	5,671.02 5,299,006,113	7,347.00 6,865,036,800	- -	1.52
7	三菱商事 日本	株式 卸売業	861,100	4,738.94 4,080,703,064	7,128.00 6,137,920,800	- -	1.36
8	日立製作所 日本	株式 電気機器	655,600	7,176.40 4,704,847,853	9,275.00 6,080,690,000	- -	1.35
9	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	282,500	15,866.77 4,482,365,221	20,440.00 5,774,300,000	- -	1.28
10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,184,900	4,210.71 4,989,281,388	4,641.00 5,499,120,900	- -	1.22
11	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	3,255,300	1,119.48 3,644,264,411	1,682.00 5,475,414,600	- -	1.21
12	三井物産 日本	株式 卸売業	988,000	3,999.15 3,951,167,775	5,423.00 5,357,924,000	- -	1.19
13	任天堂 日本	株式 その他製品	842,800	5,626.30 4,741,853,020	6,230.00 5,250,644,000	- -	1.16
14	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,901,300	2,083.99 3,962,302,701	2,541.00 4,831,203,300	- -	1.07
15	信越化学工業 日本	株式 化学	1,111,500	3,906.52 4,342,105,879	4,343.00 4,827,244,500	- -	1.07
16	第一三共 日本	株式 医薬品	1,166,300	4,134.60 4,822,192,486	4,106.00 4,788,827,800	- -	1.06
17	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,034,500	3,994.58 4,132,399,890	4,577.00 4,734,906,500	- -	1.05

18	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	870,300	4,148.34 3,610,305,475	5,406.00 4,704,841,800	- -	1.04
19	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,015,900	4,317.41 4,386,061,714	4,609.00 4,682,283,100	- -	1.04
20	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,299,500	2,743.75 3,565,505,022	3,465.00 4,502,767,500	- -	1.00
21	HOYA 日本	株式 精密機器	282,800	14,331.07 4,052,829,277	15,325.00 4,333,910,000	- -	0.96
22	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	660,300	6,179.39 4,080,254,878	6,335.00 4,183,000,500	- -	0.93
23	ダイキン工業 日本	株式 機械	160,900	23,119.43 3,719,916,772	23,475.00 3,777,127,500	- -	0.84
24	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,151,800	1,535.31 3,303,680,921	1,690.50 3,637,617,900	- -	0.81
25	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	726,300	4,384.99 3,184,819,040	4,909.00 3,565,406,700	- -	0.79
26	村田製作所 日本	株式 電気機器	1,214,500	2,580.10 3,133,531,754	2,734.00 3,320,443,000	- -	0.74
27	S M C 日本	株式 機械	43,800	68,159.65 2,985,392,690	66,980.00 2,933,724,000	- -	0.65
28	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	486,700	5,949.95 2,895,845,449	5,855.00 2,849,628,500	- -	0.63
29	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	798,700	2,684.22 2,143,893,297	3,440.00 2,747,528,000	- -	0.61
30	パナソニックホールディングス 日本	株式 電気機器	1,592,500	1,187.64 1,891,330,990	1,682.00 2,678,585,000	- -	0.59

（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9月29日現在

種類	投資比率（％）
株式	97.59
合計	97.59

（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9月29日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
電気機器	国内	16.44
輸送用機器		8.62
情報・通信業		7.83
銀行業		6.95
卸売業		6.61
化学		5.63

機械	5.20
医薬品	4.97
サービス業	4.59
小売業	4.22
食料品	3.31
陸運業	2.84
保険業	2.37
精密機器	2.22
その他製品	2.19
建設業	2.09
不動産業	1.89
電気・ガス業	1.36
その他金融業	1.19
鉄鋼	0.99
証券、商品先物取引業	0.77
ゴム製品	0.70
ガラス・土石製品	0.66
海運業	0.66
非鉄金属	0.64
金属製品	0.49
石油・石炭製品	0.49
空運業	0.46
繊維製品	0.41
鉱業	0.39
パルプ・紙	0.18
倉庫・運輸関連業	0.14
水産・農林業	0.08
合計	97.59

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年9月29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 0512月	買建	499	11,814,629,670	11,594,265,000	2.57

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

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第16計算期間末 (2014年 3月10日)	8,735	8,833	0.8027	0.8117
第17計算期間末 (2015年 3月10日)	9,788	9,877	1.0008	1.0098
第18計算期間末 (2016年 3月10日)	8,408	8,502	0.8879	0.8979
第19計算期間末 (2017年 3月10日)	9,275	9,383	1.0364	1.0484
第20計算期間末 (2018年 3月12日)	9,108	9,211	1.1489	1.1619
第21計算期間末 (2019年 3月11日)	8,288	8,359	1.0502	1.0592
第22計算期間末 (2020年3月10日)	6,843	6,975	0.9339	0.9519
第23計算期間末 (2021年3月10日)	8,814	8,917	1.2812	1.2962
第24計算期間末 (2022年3月10日)	8,083	8,209	1.2194	1.2384
第25計算期間末 (2023年3月10日)	8,938	9,103	1.3566	1.3816
2022年9月末日	8,268	-	1.2490	-
10月末日	8,721	-	1.3119	-
11月末日	8,914	-	1.3498	-
12月末日	8,512	-	1.2875	-
2023年1月末日	8,909	-	1.3436	-
2月末日	8,956	-	1.3556	-
3月末日	9,075	-	1.3532	-
4月末日	9,269	-	1.3890	-
5月末日	9,518	-	1.4382	-
6月末日	10,144	-	1.5461	-
7月末日	10,258	-	1.5683	-
8月末日	10,275	-	1.5741	-
9月末日	10,154	-	1.5815	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第16計算期間	0.0090
第17計算期間	0.0090
第18計算期間	0.0100
第19計算期間	0.0120
第20計算期間	0.0130
第21計算期間	0.0090

第22計算期間	0.0180
第23計算期間	0.0150
第24計算期間	0.0190
第25計算期間	0.0250
2023年3月11日～2023年9月10日	-

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第16計算期間	19.44
第17計算期間	25.80
第18計算期間	10.28
第19計算期間	18.08
第20計算期間	12.11
第21計算期間	7.81
第22計算期間	9.4
第23計算期間	38.8
第24計算期間	3.3
第25計算期間	13.3
2023年3月11日～2023年9月10日	17.4

（注1）収益率は期間騰落率です。

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

## （４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第16計算期間	1,720,491,029	4,684,522,874
第17計算期間	1,297,591,952	2,399,371,648
第18計算期間	1,764,811,465	2,076,291,110
第19計算期間	1,243,083,227	1,762,450,093
第20計算期間	1,277,274,100	2,299,730,471
第21計算期間	1,138,643,487	1,174,485,331
第22計算期間	1,083,065,008	1,646,604,346
第23計算期間	1,239,609,441	1,688,249,680
第24計算期間	1,042,960,494	1,294,065,701
第25計算期間	866,476,295	906,274,102
2023年3月11日～ 2023年9月10日	533,869,834	619,775,579

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

## 参考情報

データの基準日:2023年9月29日

## 基準価額・純資産の推移 (2013年9月30日～2023年9月29日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

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

## 分配の推移 (税引前)

2019年 3月	90円
2020年 3月	180円
2021年 3月	150円
2022年 3月	190円
2023年 3月	250円
設定来累計	5,760円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

## ■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

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

## ■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

## 資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	97.59
内 日本	97.59
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.41
合計(純資産総額)	100.00

## その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.57

## 株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	16.44
2	輸送用機器	8.62
3	情報・通信業	7.83
4	銀行業	6.95
5	卸売業	6.61

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.35
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.56
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.31
4	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.68
5	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.64
6	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.52
7	三菱商事	株式	日本	卸売業	1.36
8	日立製作所	株式	日本	電気機器	1.35
9	東京エレクトロン	株式	日本	電気機器	1.28
10	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.22

## 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。

※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。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

解約単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

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

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

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

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

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

1998年10月22日から無期限とします。

#### (4)【計算期間】

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

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

#### (5)【その他】

信託契約の解約

以下の場合には信託契約を解約し信託を終了することがあります。

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

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

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

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

#### 信託約款の変更

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

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

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

#### 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

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

#### 関係法人との契約の更改および受託会社の辞任または解任に伴う取扱い

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

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

#### 信託事務処理の再信託

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

#### 公告

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

<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ます。

#### 運用報告書

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金請求権

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



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

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

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

## (2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

## (3) 一部解約請求権

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

## (4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
- なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第25期計算期間(2022年3月11日から2023年3月10日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【MHAM TOPIXオープン】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第24期 2022年3月10日現在	第25期 2023年3月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	42,616,576	41,782,246
親投資信託受益証券	8,081,710,804	8,937,978,471
未収入金	138,704,000	165,530,000
流動資産合計	8,263,031,380	9,145,290,717
資産合計	8,263,031,380	9,145,290,717
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	125,946,936	164,724,708
未払解約金	23,182,609	13,088,657
未払受託者報酬	3,308,757	2,854,028
未払委託者報酬	27,266,807	25,686,483
その他未払費用	69,306	67,456
流動負債合計	179,774,415	206,421,332
負債合計	179,774,415	206,421,332
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,628,786,151	6,588,988,344
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,454,470,814	2,349,881,041
（分配準備積立金）	1,958,983,499	2,165,683,764
元本等合計	8,083,256,965	8,938,869,385
純資産合計	8,083,256,965	8,938,869,385
負債純資産合計	8,263,031,380	9,145,290,717

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第24期		第25期	
	自	2021年3月11日 2022年3月10日	自	2022年3月11日 2023年3月10日
営業収益				
受取利息		139		206
有価証券売買等損益		206,637,255		1,139,961,667
その他収益		-		6
営業収益合計		206,637,116		1,139,961,879
営業費用				
支払利息		6,711		8,683
受託者報酬		7,036,235		5,700,680
委託者報酬		55,844,399		51,306,680
その他費用		139,792		134,736
営業費用合計		63,027,137		57,150,779
営業利益又は営業損失( )		269,664,253		1,082,811,100
経常利益又は経常損失( )		269,664,253		1,082,811,100
当期純利益又は当期純損失( )		269,664,253		1,082,811,100
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		51,409,978		74,760,753
期首剰余金又は期首欠損金( )		1,934,354,326		1,454,470,814
剰余金増加額又は欠損金減少額		334,200,939		254,311,036
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		334,200,939		254,311,036
剰余金減少額又は欠損金増加額		367,063,284		202,226,448
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		367,063,284		202,226,448
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		125,946,936		164,724,708
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,454,470,814		2,349,881,041

## (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25期	
	自 2022年3月11日	至 2023年3月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第24期	第25期
	2022年3月10日現在	2023年3月10日現在
1. 期首元本額	6,879,891,358円	6,628,786,151円
期中追加設定元本額	1,042,960,494円	866,476,295円
期中一部解約元本額	1,294,065,701円	906,274,102円
2. 受益権の総数	6,628,786,151口	6,588,988,344口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第24期	第25期
	自 2021年3月11日 至 2022年3月10日	自 2022年3月11日 至 2023年3月10日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(121,962,087円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(3,507,455,981円)及び分配準備積立金(1,962,968,348円)より分配対象収益は5,592,386,416円(1万口当たり8,436.51円)であり、うち125,946,936円(1万口当たり190円)を分配金額としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(211,023,556円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(410,566,962円)、信託約款に規定される収益調整金(3,726,120,125円)及び分配準備積立金(1,708,817,954円)より分配対象収益は6,056,528,597円(1万口当たり9,191.89円)であり、うち164,724,708円(1万口当たり250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24期	第25期
	自 2021年3月11日 至 2022年3月10日	自 2022年3月11日 至 2023年3月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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24期 2022年3月10日現在	第25期 2023年3月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第24期 2022年3月10日現在	第25期 2023年3月10日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	477,141,361	1,076,052,336
合計	477,141,361	1,076,052,336

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第24期 2022年3月10日現在	第25期 2023年3月10日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2194円 (12,194円)

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2023年3月10日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	2,584,575,349	8,937,978,471	
親投資信託受益証券	合計	2,584,575,349	8,937,978,471	
合計			8,937,978,471	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2023年3月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,553,857,958
株式	408,705,460,470
未収配当金	688,738,942
差入委託証拠金	315,090,000
流動資産合計	417,263,147,370
資産合計	417,263,147,370
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	95,236,060
前受金	70,445,000
未払金	1,544,620
未払解約金	606,274,000
流動負債合計	773,499,680
負債合計	773,499,680
純資産の部	
元本等	
元本	120,435,149,015
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	296,054,498,675
元本等合計	416,489,647,690
純資産合計	416,489,647,690
負債純資産合計	417,263,147,370



## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年3月11日 至 2023年3月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年3月10日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	103,118,786,197円
同期中追加設定元本額	114,270,381,670円
同期中一部解約元本額	96,954,018,852円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOPIXオープン	2,584,575,349円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	3,034,166,254円
One DC 国内株式インデックスファンド	25,127,320,875円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,953,765,506円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,060,345円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	13,908,600円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	36,812,387円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,981,436円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	26,019,229円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	30,218,326円
たわらノーロード TOPIX	1,688,713,439円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,491,149,688円
たわらノーロード バランス(堅実型)	51,580,858円
たわらノーロード バランス(標準型)	346,662,816円
たわらノーロード バランス(積極型)	551,129,071円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	2,949,293円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	172,873,414円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	437,236,325円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	338,033,102円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	452,621,185円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	406,396円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,780,461円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	33,774,827円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,346,236円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,984,275円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,434,917,576円
Oneグローバルバランス	13,020,661円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,047,003,034円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,588,278,299円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,957,702,853円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	335,945,715円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,063,062,310円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,119,128,033円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	31,667,873円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,158,418,676円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	15,484,653円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	298,657,066円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	353,496,358円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	571,085,813円
投資のソムリエ	9,064,821,611円
クルーズコントロール	523,514,121円
投資のソムリエ<DC年金>	679,344,212円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	365,891,718円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	902,354,773円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	935,686,087円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,902,234,781円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	45,523,070円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	22,826,719円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	6,504,009円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	100,473,455円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	492,348,083円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	979,827,827円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	267,533,267円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	42,963,704円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	24,761,747円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	14,927,918円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	379,954,790円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	3,245,596円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	42,303,590円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	43,529,477円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	36,189,878円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	26,640,138円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	41,966,129円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	108,181,099円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	220,073,197円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	37,839,781円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	226,761,085円

マルチアセット・インカム戦略ファンド(日米資産投資・シグナルヘッジ付き)2022-10(適格機関投資家限定)	517,681,315円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	234,190,558円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	41,676,041円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	29,174,799円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	313,171,057円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	72,111,940円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	4,859,131円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	10,695,474円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	44,508,643円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	89,307,293円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,059,293円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	17,964,591円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,086,848円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	90,749円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	5,874,289円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	26,398,970円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	409,407,421円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	512,119,928円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,514,618,866円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	15,491,383円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	20,621,064円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	216,895,989円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	47,070,240円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	64,481円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	271,554,764円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	15,907,033円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	53,436,515円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	121,239,696円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	166,912,632円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	27,654,428円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	14,775,672円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	382,713,058円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,191,581,310円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	48,743,066円
動的パッケージファンド<DC年金>	25,881,642円
コア資産形成ファンド	17,452,381円
MHAMトピックスファンド	761,619,370円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	45,835,231円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	3,477,103,747円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,478,502,000円

計	120,435,149,015円
2. 受益権の総数	120,435,149,015口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年3月11日 至 2023年3月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年3月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2023年3月10日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	9,622,139,340	
合計	9,622,139,340	

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2023年2月8日から2023年3月10日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2023年3月10日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	7,754,210,000	-	7,659,100,000	95,110,000
合計	7,754,210,000	-	7,659,100,000	95,110,000

（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）

2023年3月10日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.4582円 (34,582円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2023年3月10日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	7,500	3,625.00	27,187,500	
ニッセイ	196,400	555.00	109,002,000	
マルハニチロ	29,100	2,456.00	71,469,600	
雪国まいたけ	16,700	1,046.00	17,468,200	
カネコ種苗	6,100	1,676.00	10,223,600	
サカタのタネ	22,400	4,140.00	92,736,000	
ホクト	17,400	1,891.00	32,903,400	
ホクリヨウ	2,600	906.00	2,355,600	
ショーボンドホールディングス	26,800	5,530.00	148,204,000	
ミライト・ワン	68,200	1,689.00	115,189,800	

タマホーム	12,400	3,635.00	45,074,000
サンヨーホームズ	2,300	772.00	1,775,600
日本アクア	7,300	895.00	6,533,500
ファーストコーポレーション	4,400	797.00	3,506,800
ベステラ	3,800	909.00	3,454,200
Robot Home	33,500	192.00	6,432,000
キャンディル	2,800	527.00	1,475,600
住石ホールディングス	27,100	375.00	10,162,500
日鉄鉱業	7,800	3,765.00	29,367,000
三井松島ホールディングス	8,900	3,755.00	33,419,500
I N P E X	726,000	1,471.00	1,067,946,000
石油資源開発	22,800	5,010.00	114,228,000
K & O エナジーグループ	8,900	2,298.00	20,452,200
ダイセキ環境ソリューション	3,500	963.00	3,370,500
第一カッター興業	5,200	1,134.00	5,896,800
明豊ファシリティワークス	6,500	807.00	5,245,500
安藤・間	113,700	897.00	101,988,900
東急建設	56,000	715.00	40,040,000
コムシスホールディングス	66,500	2,540.00	168,910,000
ピーアールホールディングス	31,300	357.00	11,174,100
高松コンストラクショングループ	12,800	2,072.00	26,521,600
東建コーポレーション	5,600	8,030.00	44,968,000
ソネック	2,100	1,005.00	2,110,500
ヤマウラ	10,100	1,141.00	11,524,100
オリエンタル白石	70,500	317.00	22,348,500
大成建設	136,600	4,665.00	637,239,000
大林組	490,900	1,057.00	518,881,300
清水建設	412,800	778.00	321,158,400
飛島建設	15,300	1,131.00	17,304,300
長谷工コーポレーション	141,700	1,620.00	229,554,000
松井建設	12,900	678.00	8,746,200
銭高組	1,500	3,030.00	4,545,000
鹿島建設	304,500	1,659.00	505,165,500
不動テトラ	9,500	1,677.00	15,931,500
大末建設	4,400	1,216.00	5,350,400
鉄建建設	9,800	1,893.00	18,551,400
西松建設	23,300	3,645.00	84,928,500
三井住友建設	110,200	439.00	48,377,800
大豊建設	5,700	4,035.00	22,999,500
佐田建設	7,900	498.00	3,934,200
ナカノフドー建設	8,700	376.00	3,271,200
奥村組	22,300	3,370.00	75,151,000
東鉄工業	19,000	2,799.00	53,181,000
イチケン	2,800	1,860.00	5,208,000
富士ピー・エス	6,300	451.00	2,841,300
浅沼組	11,000	3,495.00	38,445,000
戸田建設	168,800	737.00	124,405,600
熊谷組	23,800	2,917.00	69,424,600
北野建設	2,400	3,175.00	7,620,000
植木組	3,500	1,430.00	5,005,000

矢作建設工業	18,900	856.00	16,178,400
ピーエス三菱	17,600	682.00	12,003,200
日本ハウスホールディングス	27,300	390.00	10,647,000
大東建託	50,500	13,140.00	663,570,000
新日本建設	19,300	983.00	18,971,900
東亜道路工業	2,400	7,550.00	18,120,000
日本道路	2,800	7,640.00	21,392,000
東亜建設工業	11,800	2,797.00	33,004,600
日本国土開発	41,200	603.00	24,843,600
若築建設	6,200	3,560.00	22,072,000
東洋建設	44,500	900.00	40,050,000
五洋建設	194,800	662.00	128,957,600
世紀東急工業	18,200	852.00	15,506,400
福田組	5,200	4,560.00	23,712,000
日本ドライケミカル	3,100	1,768.00	5,480,800
住友林業	105,300	2,690.00	283,257,000
日本基礎技術	7,400	548.00	4,055,200
巴コーポレーション	13,800	443.00	6,113,400
大和ハウス工業	383,700	3,215.00	1,233,595,500
ライト工業	26,200	2,001.00	52,426,200
積水ハウス	430,100	2,771.00	1,191,807,100
日特建設	13,200	1,000.00	13,200,000
北陸電気工事	9,500	784.00	7,448,000
ユアテック	30,700	816.00	25,051,200
日本リーテック	9,100	928.00	8,444,800
四電工	5,800	1,936.00	11,228,800
中電工	21,300	2,221.00	47,307,300
関電工	75,500	932.00	70,366,000
きんでん	96,900	1,645.00	159,400,500
東京エネシス	13,600	913.00	12,416,800
トーエネック	4,500	3,465.00	15,592,500
住友電設	13,100	2,600.00	34,060,000
日本電設工業	22,600	1,613.00	36,453,800
エクシオグループ	63,100	2,471.00	155,920,100
新日本空調	7,600	1,992.00	15,139,200
日本工営	8,700	3,375.00	29,362,500
九電工	33,400	3,555.00	118,737,000
三機工業	30,500	1,551.00	47,305,500
日揮ホールディングス	135,800	1,734.00	235,477,200
中外炉工業	4,500	1,880.00	8,460,000
ヤマト	10,400	886.00	9,214,400
太平電業	8,600	4,190.00	36,034,000
高砂熱学工業	33,100	2,156.00	71,363,600
三晃金属工業	1,400	4,090.00	5,726,000
NEC ネットズエスアイ	46,900	1,658.00	77,760,200
朝日工業社	5,700	2,196.00	12,517,200
明星工業	23,600	805.00	18,998,000
大気社	16,500	3,680.00	60,720,000
ダイダン	9,100	2,466.00	22,440,600
日比谷総合設備	11,800	2,151.00	25,381,800

ニッポン	37,200	1,670.00	62,124,000
日清製粉グループ本社	127,500	1,584.00	201,960,000
日東富士製粉	2,300	4,500.00	10,350,000
昭和産業	12,100	2,567.00	31,060,700
鳥越製粉	10,100	604.00	6,100,400
中部飼料	19,200	1,051.00	20,179,200
フィード・ワン	20,200	691.00	13,958,200
東洋精糖	2,500	917.00	2,292,500
日本甜菜製糖	8,200	1,732.00	14,202,400
D M三井製糖ホールディングス	13,600	2,125.00	28,900,000
塩水港精糖	15,300	204.00	3,121,200
ウェルネオシュガー	7,200	1,717.00	12,362,400
L I F U L L	49,200	224.00	11,020,800
M I X I	32,700	2,771.00	90,611,700
ジェイエイシーリクルートメント	13,000	2,677.00	34,801,000
日本M&Aセンターホールディングス	247,000	1,071.00	264,537,000
メンバーズ	4,200	1,375.00	5,775,000
中広	1,000	408.00	408,000
U Tグループ	21,100	2,382.00	50,260,200
アイティメディア	5,500	1,394.00	7,667,000
E・Jホールディングス	8,400	1,524.00	12,801,600
オープンアップグループ	43,100	1,920.00	82,752,000
コシダカホールディングス	43,100	944.00	40,686,400
アルトナー	3,200	1,083.00	3,465,600
パソナグループ	17,400	1,954.00	33,999,600
C D S	3,300	1,833.00	6,048,900
リンクアンドモチベーション	41,300	529.00	21,847,700
エス・エム・エス	54,800	3,220.00	176,456,000
サニーサイドアップグループ	3,900	600.00	2,340,000
パーソルホールディングス	161,100	2,681.00	431,909,100
リニカル	7,300	738.00	5,387,400
クックパッド	39,400	222.00	8,746,800
エスクリ	5,300	350.00	1,855,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,400	680.00	4,352,000
森永製菓	25,500	3,955.00	100,852,500
中村屋	2,900	3,150.00	9,135,000
江崎グリコ	39,500	3,435.00	135,682,500
名糖産業	5,600	1,703.00	9,536,800
井村屋グループ	7,400	2,245.00	16,613,000
不二家	9,500	2,460.00	23,370,000
山崎製パン	92,300	1,611.00	148,695,300
第一屋製パン	2,300	400.00	920,000
モロゾフ	4,400	3,515.00	15,466,000
亀田製菓	8,800	4,335.00	38,148,000
寿スピリッツ	14,700	9,060.00	133,182,000
カルビー	63,100	2,672.00	168,603,200
森永乳業	25,100	4,815.00	120,856,500
六甲バター	10,200	1,385.00	14,127,000
ヤクルト本社	98,600	9,550.00	941,630,000
明治ホールディングス	85,500	6,380.00	545,490,000



雪印メグミルク	33,400	1,837.00	61,355,800
プリマハム	18,700	2,232.00	41,738,400
日本ハム	53,900	3,840.00	206,976,000
林兼産業	3,800	486.00	1,846,800
丸大食品	13,800	1,529.00	21,100,200
S Foods	15,300	2,851.00	43,620,300
柿安本店	5,400	2,130.00	11,502,000
伊藤ハム米久ホールディングス	107,400	733.00	78,724,200
学情	6,600	1,476.00	9,741,600
スタジオアリス	7,200	2,106.00	15,163,200
クロスキャット	8,000	1,286.00	10,288,000
シミックホールディングス	7,900	2,020.00	15,958,000
エプコ	2,800	721.00	2,018,800
システナ	236,100	318.00	75,079,800
NJS	2,700	2,255.00	6,088,500
デジタルアーツ	8,900	5,260.00	46,814,000
日鉄ソリューションズ	24,000	3,590.00	86,160,000
総合警備保障	53,400	3,660.00	195,444,000
キューブシステム	8,500	1,192.00	10,132,000
いちご	158,800	288.00	45,734,400
日本駐車場開発	164,200	247.00	40,557,400
コア	6,100	1,559.00	9,509,900
カカクコム	105,600	1,881.00	198,633,600
アイロムグループ	5,200	1,867.00	9,708,400
セントケア・ホールディング	9,300	791.00	7,356,300
サイネックス	2,300	596.00	1,370,800
ルネサンス	10,100	931.00	9,403,100
ディップ	25,200	3,580.00	90,216,000
SBSホールディングス	12,500	3,290.00	41,125,000
デジタルホールディングス	11,200	1,183.00	13,249,600
新日本科学	15,300	2,950.00	45,135,000
キャリアデザインセンター	2,700	2,201.00	5,942,700
ベネフィット・ワン	66,700	2,038.00	135,934,600
エムスリー	284,400	3,265.00	928,566,000
ツカダ・グローバルホールディング	8,000	418.00	3,344,000
プラス	1,700	1,178.00	2,002,600
アウトソーシング	85,700	1,390.00	119,123,000
ウェルネット	9,700	658.00	6,382,600
ワールドホールディングス	6,500	2,728.00	17,732,000
ディー・エヌ・エー	61,400	1,787.00	109,721,800
博報堂DYホールディングス	183,500	1,559.00	286,076,500
ぐるなび	26,500	340.00	9,010,000
タカミヤ	19,700	427.00	8,411,900
ジャパンベストレスキューシステム	8,900	772.00	6,870,800
ファンコミュニケーションズ	28,500	410.00	11,685,000
ライク	5,400	1,974.00	10,659,600
ビジネス・ブレークスルー	4,700	392.00	1,842,400
エスプール	41,300	611.00	25,234,300
WDBホールディングス	7,300	2,038.00	14,877,400
手間いらず	2,400	4,915.00	11,796,000

ティア	7,600	441.00	3,351,600
C D G	1,400	1,197.00	1,675,800
アドウェイズ	19,800	707.00	13,998,600
バリューコマース	10,800	1,675.00	18,090,000
インフォマート	149,300	294.00	43,894,200
サッポロホールディングス	45,400	3,325.00	150,955,000
アサヒグループホールディングス	318,500	4,866.00	1,549,821,000
麒麟ホールディングス	622,200	2,081.50	1,295,109,300
宝ホールディングス	94,100	1,074.00	101,063,400
オエノンホールディングス	41,100	276.00	11,343,600
養命酒製造	4,500	1,887.00	8,491,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	108,000	1,428.00	154,224,000
サントリー食品インターナショナル	97,100	4,930.00	478,703,000
ダイドーグループホールディングス	7,800	4,805.00	37,479,000
伊藤園	46,700	4,360.00	203,612,000
キーコーヒー	15,500	2,079.00	32,224,500
ユニカフェ	4,200	900.00	3,780,000
ジャパンフーズ	1,500	1,102.00	1,653,000
日清オイリオグループ	19,500	3,435.00	66,982,500
不二製油グループ本社	32,100	1,956.00	62,787,600
かどや製油	1,200	3,625.00	4,350,000
J - オイルミルズ	14,100	1,582.00	22,306,200
ローソン	36,700	5,510.00	202,217,000
サンエー	11,300	4,210.00	47,573,000
カワチ薬品	11,700	2,352.00	27,518,400
エービーシー・マート	21,600	7,210.00	155,736,000
ハードオフコーポレーション	5,300	1,358.00	7,197,400
高千穂交易	4,600	2,612.00	12,015,200
アスクル	30,600	1,693.00	51,805,800
ゲオホールディングス	15,600	1,714.00	26,738,400
アダストリア	17,800	2,451.00	43,627,800
ジーフット	7,000	282.00	1,974,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,700	419.00	712,300
オルパヘルスケアホールディングス	2,100	1,669.00	3,504,900
伊藤忠食品	2,800	5,170.00	14,476,000
くら寿司	17,300	3,415.00	59,079,500
キャンドウ	5,300	2,465.00	13,064,500
エレマテック	13,300	1,892.00	25,163,600
I Kホールディングス	4,100	399.00	1,635,900
パルグループホールディングス	14,500	2,964.00	42,978,000
エディオン	58,700	1,362.00	79,949,400
あらた	11,300	4,180.00	47,234,000
サーラコーポレーション	31,100	759.00	23,604,900
ワッツ	6,500	699.00	4,543,500
トーマンデバイス	2,200	7,100.00	15,620,000
ハローズ	6,800	3,175.00	21,590,000
J Pホールディングス	41,300	346.00	14,289,800
フジオフードグループ本社	12,400	1,354.00	16,789,600
あみやき亭	3,600	3,105.00	11,178,000

東京エレクトロン デバイス	5,500	8,600.00	47,300,000
ひらまつ	27,900	190.00	5,301,000
円谷フィールズホールディングス	12,700	4,105.00	52,133,500
双日	157,200	2,797.00	439,688,400
アルフレッサ ホールディングス	148,600	1,744.00	259,158,400
大黒天物産	4,500	5,260.00	23,670,000
ハニーズホールディングス	11,700	1,601.00	18,731,700
ファーマライズホールディングス	3,000	619.00	1,857,000
キッコーマン	91,400	6,480.00	592,272,000
味の素	337,400	4,521.00	1,525,385,400
ブルドックソース	5,500	2,026.00	11,143,000
キューピー	74,000	2,216.00	163,984,000
ハウス食品グループ本社	42,400	2,739.00	116,133,600
カゴメ	64,300	3,055.00	196,436,500
焼津水産化学工業	5,700	883.00	5,033,100
アリアケジャパン	12,100	4,930.00	59,653,000
ピエトロ	1,700	1,854.00	3,151,800
エバラ食品工業	3,400	3,190.00	10,846,000
やまみ	1,200	1,360.00	1,632,000
ニチレイ	63,200	2,719.00	171,840,800
横浜冷凍	40,400	1,011.00	40,844,400
東洋水産	69,600	5,710.00	397,416,000
イートアンドホールディングス	5,900	2,240.00	13,216,000
大冷	1,700	1,935.00	3,289,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,800	1,054.00	9,275,200
日清食品ホールディングス	48,500	11,670.00	565,995,000
永谷園ホールディングス	6,900	2,111.00	14,565,900
一正蒲鉾	5,300	734.00	3,890,200
フジッコ	14,300	1,886.00	26,969,800
ロック・フィールド	15,500	1,574.00	24,397,000
日本たばこ産業	907,500	2,778.50	2,521,488,750
ケンコーマヨネーズ	9,500	1,317.00	12,511,500
わらべや日洋ホールディングス	10,200	1,852.00	18,890,400
なとり	8,800	2,030.00	17,864,000
イフジ産業	2,300	981.00	2,256,300
ファーマフーズ	21,200	1,443.00	30,591,600
北の達人コーポレーション	59,100	348.00	20,566,800
ユーグレナ	88,800	949.00	84,271,200
紀文食品	10,800	957.00	10,335,600
ピクルスホールディングス	8,100	1,203.00	9,744,300
スター・マイカ・ホールディングス	12,500	684.00	8,550,000
S R Eホールディングス	6,800	3,705.00	25,194,000
A Dワークスグループ	30,800	165.00	5,082,000
片倉工業	12,900	1,851.00	23,877,900
ゲンゼ	10,500	4,685.00	49,192,500
ヒューリック	321,400	1,105.00	355,147,000
神栄	1,800	913.00	1,643,400
ラサ商事	5,900	1,509.00	8,903,100
アルペン	12,200	1,988.00	24,253,600
ハブ	4,200	868.00	3,645,600

ラクーンホールディングス	11,700	943.00	11,033,100
クオールホールディングス	20,400	1,178.00	24,031,200
アルコニックス	19,500	1,396.00	27,222,000
神戸物産	114,700	3,525.00	404,317,500
ソリトンシステムズ	7,200	1,010.00	7,272,000
ジーンズホールディングス	8,800	3,725.00	32,780,000
ピックカメラ	98,500	1,167.00	114,949,500
DCMホールディングス	90,400	1,156.00	104,502,400
ペッパーフードサービス	31,000	170.00	5,270,000
ハイパー	2,600	445.00	1,157,000
Monotaro	209,900	1,820.00	382,018,000
東京一番フーズ	3,200	503.00	1,609,600
DDホールディングス	8,500	730.00	6,205,000
あいホールディングス	23,700	2,278.00	53,988,600
ディーブイエックス	3,600	1,064.00	3,830,400
きちりホールディングス	3,200	652.00	2,086,400
アークランドサービスホールディングス	12,100	2,254.00	27,273,400
J.フロントリテイリング	184,100	1,338.00	246,325,800
ドトール・日レスホールディングス	26,300	1,905.00	50,101,500
マツキヨココカラ&カンパニー	89,800	6,740.00	605,252,000
ブロンコビリー	7,800	2,461.00	19,195,800
ZOZO	97,900	3,015.00	295,168,500
トレジャー・ファクトリー	8,000	1,288.00	10,304,000
物語コーポレーション	24,600	2,712.00	66,715,200
三越伊勢丹ホールディングス	249,300	1,480.00	368,964,000
東洋紡	60,500	1,073.00	64,916,500
ユニチカ	42,500	226.00	9,605,000
富士紡ホールディングス	5,500	3,210.00	17,655,000
日清紡ホールディングス	115,000	1,042.00	119,830,000
倉敷紡績	10,500	2,638.00	27,699,000
ダイワボウホールディングス	60,500	2,257.00	136,548,500
シキボウ	7,000	1,085.00	7,595,000
日東紡績	15,800	2,125.00	33,575,000
トヨタ紡織	59,000	2,152.00	126,968,000
マクニカホールディングス	36,300	3,690.00	133,947,000
Hamee	5,100	855.00	4,360,500
マーケットエンタープライズ	1,300	1,150.00	1,495,000
ラクト・ジャパン	5,800	1,940.00	11,252,000
ウエルシアホールディングス	76,800	2,819.00	216,499,200
クリエイトSDホールディングス	24,400	3,420.00	83,448,000
グリムス	6,200	2,469.00	15,307,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,600	982.00	21,211,200
八洲電機	12,100	1,186.00	14,350,600
メディアスホールディングス	9,400	797.00	7,491,800
レスターホールディングス	14,200	2,395.00	34,009,000
ジューテックホールディングス	2,800	1,296.00	3,628,800
丸善CHIホールディングス	15,800	355.00	5,609,000
大光	5,300	605.00	3,206,500

OCHIホールディングス	3,000	1,335.00	4,005,000	
TOKAIホールディングス	73,100	887.00	64,839,700	
黒谷	3,800	604.00	2,295,200	
ミサワ	2,500	609.00	1,522,500	
ティーライフ	1,700	1,294.00	2,199,800	
Cominix	2,500	793.00	1,982,500	
エー・ピーホールディングス	1,900	792.00	1,504,800	
三洋貿易	15,300	1,179.00	18,038,700	
チムニー	4,100	1,199.00	4,915,900	
シュッピン	11,000	901.00	9,911,000	
ビューティガレージ	2,400	3,920.00	9,408,000	
オイシックス・ラ・大地	19,900	2,205.00	43,879,500	
ウイン・パートナーズ	10,800	1,077.00	11,631,600	
ネクステージ	33,700	2,891.00	97,426,700	
ジョイフル本田	43,900	1,771.00	77,746,900	
鳥貴族ホールディングス	5,500	2,028.00	11,154,000	
ホットランド	11,300	1,450.00	16,385,000	
すかいらーくホールディングス	202,400	1,632.00	330,316,800	
SFPホールディングス	8,100	1,765.00	14,296,500	
綿半ホールディングス	11,700	1,450.00	16,965,000	
日本毛織	36,900	997.00	36,789,300	
ダイトウボウ	22,000	85.00	1,870,000	
トーア紡コーポレーション	4,300	360.00	1,548,000	
ダイドーリミテッド	19,100	278.00	5,309,800	
ヨシックスホールディングス	2,700	2,143.00	5,786,100	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	48,400	1,116.00	54,014,400	
三栄建築設計	6,700	1,543.00	10,338,100	
野村不動産ホールディングス	86,100	3,060.00	263,466,000	
三重交通グループホールディングス	29,500	552.00	16,284,000	
サムティ	21,900	2,181.00	47,763,900	
ディア・ライフ	21,200	660.00	13,992,000	
コーセーアールイー	3,800	745.00	2,831,000	
地主	10,500	1,908.00	20,034,000	
プレサンスコーポレーション	18,100	1,803.00	32,634,300	
フィル・カンパニー	2,500	1,100.00	2,750,000	
THEグローバル社	7,200	215.00	1,548,000	
ハウスコム	2,100	1,121.00	2,354,100	
JPMC	7,000	1,020.00	7,140,000	
サンセイランディック	3,800	836.00	3,176,800	
エストラスト	1,500	593.00	889,500	
フージャースホールディングス	21,100	867.00	18,293,700	
オープンハウスグループ	50,500	4,995.00	252,247,500	
東急不動産ホールディングス	414,400	665.00	275,576,000	
飯田グループホールディングス	120,800	2,284.00	275,907,200	
イーランド	1,900	1,546.00	2,937,400	
ムゲンエステート	8,100	562.00	4,552,200	
帝国繊維	15,800	1,698.00	26,828,400	
日本コークス工業	126,700	89.00	11,276,300	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,700	997.00	6,679,900	

ミタチ産業	3,400	1,415.00	4,811,000
B E E N O S	8,400	2,411.00	20,252,400
あさひ	12,400	1,365.00	16,926,000
日本調剤	10,200	1,189.00	12,127,800
コスモス薬品	14,600	11,870.00	173,302,000
シップヘルスケアホールディングス	53,200	2,428.00	129,169,600
トーエル	5,900	825.00	4,867,500
ソフトクリエイイトホールディングス	5,800	3,755.00	21,779,000
セブン&アイ・ホールディングス	510,500	6,200.00	3,165,100,000
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	111,500	1,063.00	118,524,500
明治電機工業	5,600	1,217.00	6,815,200
ツルハホールディングス	31,100	8,740.00	271,814,000
デリカフーズホールディングス	5,300	540.00	2,862,000
スターティアホールディングス	2,600	1,412.00	3,671,200
サンマルクホールディングス	12,000	1,801.00	21,612,000
フェリシモ	3,000	1,005.00	3,015,000
トリドールホールディングス	36,800	2,792.00	102,745,600
帝人	135,000	1,481.00	199,935,000
東レ	939,700	782.50	735,315,250
クラレ	222,900	1,270.00	283,083,000
旭化成	875,700	973.20	852,231,240
T O K Y O B A S E	15,200	488.00	7,417,600
稲葉製作所	8,500	1,519.00	12,911,500
宮地エンジニアリンググループ	4,000	3,780.00	15,120,000
トーカロ	39,700	1,302.00	51,689,400
アルファ	4,600	1,017.00	4,678,200
S U M C O	275,000	1,932.00	531,300,000
川田テクノロジーズ	3,400	3,780.00	12,852,000
R S T e c h n o l o g i e s	9,600	3,265.00	31,344,000
ジェイテックコーポレーション	1,700	2,990.00	5,083,000
信和	7,000	751.00	5,257,000
ビーロット	8,500	585.00	4,972,500
ファーストブラザーズ	2,400	873.00	2,095,200
A n d D o ホールディングス	8,200	901.00	7,388,200
シーアールイー	6,300	1,172.00	7,383,600
プロパティエージェント	1,500	1,238.00	1,857,000
ケイアイスター不動産	6,700	4,395.00	29,446,500
アグレ都市デザイン	2,300	1,675.00	3,852,500
グッドコムアセット	12,800	872.00	11,161,600
ジェイ・エス・ビー	3,400	4,240.00	14,416,000
ロードスターキャピタル	5,900	1,416.00	8,354,400
テンポイノベーション	3,800	1,304.00	4,955,200
グローバル・リンク・マネジメント	2,400	1,273.00	3,055,200
フェイスネットワーク	1,700	1,804.00	3,066,800
住江織物	2,600	2,008.00	5,220,800
日本フェルト	6,900	422.00	2,911,800
イチカワ	1,500	1,364.00	2,046,000
エコナックホールディングス	22,600	93.00	2,101,800
日東製網	1,300	1,590.00	2,067,000

芦森工業	2,400	1,529.00	3,669,600
アツギ	7,300	401.00	2,927,300
ウイルプラスホールディングス	2,200	1,179.00	2,593,800
J Mホールディングス	12,600	1,908.00	24,040,800
コメダホールディングス	36,200	2,376.00	86,011,200
サツドラホールディングス	5,900	833.00	4,914,700
アレンザホールディングス	11,100	988.00	10,966,800
串カツ田中ホールディングス	3,900	1,630.00	6,357,000
パロックジャパンリミテッド	9,600	807.00	7,747,200
クスリのアオキホールディングス	13,200	6,770.00	89,364,000
ダイニック	3,100	819.00	2,538,900
共和レザー	7,300	534.00	3,898,200
ピーバンドットコム	1,700	558.00	948,600
力の源ホールディングス	7,600	1,476.00	11,217,600
FOOD & LIFE COMPANIES	85,100	3,670.00	312,317,000
アセンテック	4,800	515.00	2,472,000
セーレン	27,100	2,427.00	65,771,700
ソトー	4,000	810.00	3,240,000
東海染工	1,300	1,119.00	1,454,700
小松マテーレ	20,400	722.00	14,728,800
ワコールホールディングス	27,000	2,580.00	69,660,000
ホギメディカル	18,900	3,270.00	61,803,000
クラウドシアホールディングス	2,800	372.00	1,041,600
T S Iホールディングス	47,200	660.00	31,152,000
マツオカコーポレーション	3,400	1,393.00	4,736,200
ワールド	17,900	1,506.00	26,957,400
T I S	157,800	3,535.00	557,823,000
J N Sホールディングス	5,700	339.00	1,932,300
グリー	37,600	705.00	26,508,000
G M Oペパボ	2,100	1,870.00	3,927,000
コーエーテクモホールディングス	88,000	2,303.00	202,664,000
三菱総合研究所	6,900	5,070.00	34,983,000
ボルテージ	3,700	314.00	1,161,800
電算	800	1,922.00	1,537,600
A G S	5,400	709.00	3,828,600
ファインデックス	11,000	683.00	7,513,000
ブレインパッド	10,500	666.00	6,993,000
K L a b	27,900	387.00	10,797,300
ポールトゥウィンホールディングス	24,000	910.00	21,840,000
ネクソン	363,100	3,060.00	1,111,086,000
アイスタイル	40,800	466.00	19,012,800
エムアップホールディングス	17,100	1,054.00	18,023,400
エイチーム	10,200	773.00	7,884,600
エニグモ	17,800	588.00	10,466,400
テクノスジャパン	10,300	611.00	6,293,300
e n i s h	9,400	389.00	3,656,600
コロプラ	54,600	605.00	33,033,000
オルトプラス	9,400	210.00	1,974,000
ブロードリーフ	81,900	437.00	35,790,300

クロス・マーケティンググループ	7,500	676.00	5,070,000
デジタルハーツホールディングス	8,800	1,516.00	13,340,800
システム情報	12,400	828.00	10,267,200
メディアドゥ	5,600	1,474.00	8,254,400
じげん	40,900	435.00	17,791,500
ブイキューブ	16,800	564.00	9,475,200
エンカレッジ・テクノロジー	3,000	506.00	1,518,000
サイバーリンクス	4,000	861.00	3,444,000
ディー・エル・イー	9,000	260.00	2,340,000
フィックスターズ	15,900	1,459.00	23,198,100
CARTA HOLDINGS	6,600	1,474.00	9,728,400
オブティム	11,500	977.00	11,235,500
セレス	5,600	1,080.00	6,048,000
SHIFT	10,300	22,000.00	226,600,000
特種東海製紙	6,300	3,060.00	19,278,000
ティーガイア	14,700	1,671.00	24,563,700
セック	1,700	3,430.00	5,831,000
テクマトリックス	25,600	1,489.00	38,118,400
プロシップ	6,200	1,412.00	8,754,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	43,000	2,573.00	110,639,000
GMOペイメントゲートウェイ	32,100	11,100.00	356,310,000
ザッパラス	3,500	389.00	1,361,500
システムリサーチ	4,300	2,219.00	9,541,700
インターネットイニシアティブ	78,400	2,712.00	212,620,800
さくらインターネット	15,700	631.00	9,906,700
ヴィンクス	3,700	1,368.00	5,061,600
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,300	4,025.00	17,307,500
SRAホールディングス	7,200	3,090.00	22,248,000
システムインテグレータ	3,800	430.00	1,634,000
朝日ネット	15,200	595.00	9,044,000
eBASE	19,800	681.00	13,483,800
アバントグループ	17,700	1,418.00	25,098,600
アドソル日進	5,900	1,589.00	9,375,100
ODKソリューションズ	2,800	618.00	1,730,400
フリービット	7,300	1,172.00	8,555,600
コムチュア	18,600	2,177.00	40,492,200
サイバーコム	2,100	1,417.00	2,975,700
アステリア	11,000	739.00	8,129,000
アイル	7,800	2,297.00	17,916,600
王子ホールディングス	584,400	557.00	325,510,800
日本製紙	72,900	1,093.00	79,679,700
三菱製紙	15,500	356.00	5,518,000
北越コーポレーション	88,600	897.00	79,474,200
中越パルプ工業	4,800	1,053.00	5,054,400
巴川製紙所	3,900	730.00	2,847,000
大王製紙	61,800	1,069.00	66,064,200
阿波製紙	3,000	665.00	1,995,000
マークライnz	7,600	2,574.00	19,562,400



メディカル・データ・ビジョン	20,900	901.00	18,830,900	
gumi	20,500	794.00	16,277,000	
ショーケース	3,100	330.00	1,023,000	
モバイルファクトリー	2,700	913.00	2,465,100	
テラスカイ	6,100	1,947.00	11,876,700	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,100	1,641.00	13,292,100	
PCIホールディングス	5,200	1,004.00	5,220,800	
アイピーシー	1,900	401.00	761,900	
ネオジャパン	4,600	936.00	4,305,600	
PR TIMES	3,500	1,911.00	6,688,500	
ラクス	66,400	1,732.00	115,004,800	
ランドコンピュータ	3,100	1,027.00	3,183,700	
ダブルスタンダード	5,700	2,063.00	11,759,100	
オーブンドア	9,800	1,606.00	15,738,800	
マイネット	4,100	389.00	1,594,900	
アカツキ	6,700	2,238.00	14,994,600	
ベネフィットジャパン	800	1,233.00	986,400	
Ubicomホールディングス	4,300	1,955.00	8,406,500	
カナミックネットワーク	20,200	508.00	10,261,600	
ノムラシステムコーポレーション	12,000	114.00	1,368,000	
レンゴー	127,800	877.00	112,080,600	
トーモク	8,100	1,637.00	13,259,700	
ザ・パック	10,400	3,000.00	31,200,000	
チェンジ	34,400	2,480.00	85,312,000	
シンクロ・フード	7,800	443.00	3,455,400	
オークネット	6,900	1,731.00	11,943,900	
キャピタル・アセット・プランニング	2,500	620.00	1,550,000	
セグエグループ	3,400	775.00	2,635,000	
エイトレッド	1,900	1,531.00	2,908,900	
マクロミル	27,500	969.00	26,647,500	
ビーグリー	2,200	1,235.00	2,717,000	
オロ	4,200	2,192.00	9,206,400	
ユーザーローカル	5,100	1,710.00	8,721,000	
テモナ	2,400	314.00	753,600	
ニーズウェル	3,800	943.00	3,583,400	
マネーフォワード	33,700	4,600.00	155,020,000	
サインポスト	4,800	556.00	2,668,800	
レゾナック・ホールディングス	135,500	2,246.00	304,333,000	
住友化学	1,040,400	477.00	496,270,800	
住友精化	5,900	4,585.00	27,051,500	
日産化学	66,600	6,010.00	400,266,000	
ラサ工業	5,400	2,126.00	11,480,400	
クレハ	12,000	8,600.00	103,200,000	
多木化学	5,500	4,615.00	25,382,500	
テイカ	9,400	1,194.00	11,223,600	
石原産業	25,300	1,183.00	29,929,900	
片倉コープアグリ	2,600	1,982.00	5,153,200	
日本曹達	15,100	4,850.00	73,235,000	
東ソー	187,300	1,827.00	342,197,100	

トクヤマ	45,200	2,201.00	99,485,200
セントラル硝子	22,500	3,225.00	72,562,500
東亜合成	70,300	1,292.00	90,827,600
大阪ソーダ	8,400	4,480.00	37,632,000
関東電化工業	27,100	1,045.00	28,319,500
SUN ASTERISK	7,400	1,121.00	8,295,400
デンカ	51,000	2,865.00	146,115,000
イビデン	81,000	4,885.00	395,685,000
信越化学工業	233,100	20,500.00	4,778,550,000
日本カーバイド工業	4,700	1,343.00	6,312,100
電算システムホールディングス	6,800	2,534.00	17,231,200
堺化学工業	10,700	1,831.00	19,591,700
第一稀元素化学工業	12,800	1,014.00	12,979,200
エア・ウォーター	132,300	1,736.00	229,672,800
日本酸素ホールディングス	136,000	2,476.00	336,736,000
日本化学工業	4,600	2,038.00	9,374,800
東邦アセチレン	2,700	1,327.00	3,582,900
日本パーカライジング	69,500	1,034.00	71,863,000
高圧ガス工業	20,600	730.00	15,038,000
チタン工業	1,400	1,501.00	2,101,400
四国化成ホールディングス	16,600	1,340.00	22,244,000
戸田工業	3,200	2,470.00	7,904,000
ステラ ケミファ	8,200	2,751.00	22,558,200
保土谷化学工業	4,000	3,125.00	12,500,000
日本触媒	21,300	5,880.00	125,244,000
大日精化工業	9,800	1,845.00	18,081,000
カネカ	32,100	3,555.00	114,115,500
協和キリン	169,600	2,891.00	490,313,600
APPIER GROUP	39,900	1,867.00	74,493,300
三菱瓦斯化学	104,700	2,014.00	210,865,800
三井化学	115,600	3,375.00	390,150,000
J S R	131,000	3,205.00	419,855,000
東京応化工業	24,500	7,650.00	187,425,000
大阪有機化学工業	10,600	2,126.00	22,535,600
三菱ケミカルグループ	946,400	804.50	761,378,800
KHネオケム	23,300	2,520.00	58,716,000
ダイセル	206,100	1,064.00	219,290,400
住友ベークライト	20,700	4,985.00	103,189,500
積水化学工業	286,900	1,942.00	557,159,800
日本ゼオン	84,100	1,349.00	113,450,900
アイカ工業	35,400	3,120.00	110,448,000
UBE	72,200	2,094.00	151,186,800
積水樹脂	20,400	2,122.00	43,288,800
タキロンシーアイ	31,000	506.00	15,686,000
旭有機材	9,300	2,969.00	27,611,700
ニチバン	8,700	1,886.00	16,408,200
リケンテクノス	30,300	617.00	18,695,100
大倉工業	6,600	1,982.00	13,081,200
積水化成成品工業	19,200	412.00	7,910,400
群栄化学工業	2,800	2,592.00	7,257,600

タイガースポリマー	5,900	438.00	2,584,200
ミライアル	3,800	1,619.00	6,152,200
ダイキアクシス	4,500	709.00	3,190,500
ダイキョーニシカワ	30,900	676.00	20,888,400
竹本容器	4,200	844.00	3,544,800
森六ホールディングス	7,100	1,916.00	13,603,600
恵和	9,100	1,604.00	14,596,400
日本化薬	107,000	1,232.00	131,824,000
カーリットホールディングス	12,600	715.00	9,009,000
ソルクシーズ	10,500	352.00	3,696,000
CLホールディングス	4,000	847.00	3,388,000
プレステージ・インターナショナル	60,500	637.00	38,538,500
フェイス	3,500	510.00	1,785,000
プロトコーポレーション	17,500	1,186.00	20,755,000
ハイマックス	4,400	1,463.00	6,437,200
アミューズ	7,800	1,862.00	14,523,600
野村総合研究所	288,100	2,997.00	863,435,700
ドリームインキュベータ	4,400	3,145.00	13,838,000
サイバネットシステム	11,800	945.00	11,151,000
クイック	11,000	1,828.00	20,108,000
TAC	7,000	204.00	1,428,000
CEホールディングス	6,400	547.00	3,500,800
日本システム技術	5,200	1,669.00	8,678,800
電通グループ	141,400	4,575.00	646,905,000
インテージホールディングス	15,900	1,548.00	24,613,200
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,300	1,394.00	5,994,200
東邦システムサイエンス	3,600	1,102.00	3,967,200
ぴあ	4,800	3,225.00	15,480,000
イオンファンタジー	6,300	2,844.00	17,917,200
ソースネクスト	71,400	233.00	16,636,200
シーティーエス	16,000	763.00	12,208,000
ネクシィーズグループ	3,900	653.00	2,546,700
インフォコム	18,100	2,375.00	42,987,500
メディカルシステムネットワーク	12,900	405.00	5,224,500
日本精化	8,000	2,644.00	21,152,000
扶桑化学工業	13,000	3,835.00	49,855,000
トリケミカル研究所	18,800	2,489.00	46,793,200
シンプレクス・ホールディングス	23,600	2,396.00	56,545,600
HEROZ	4,600	1,266.00	5,823,600
ラクスル	39,700	1,666.00	66,140,200
メルカリ	63,400	2,469.00	156,534,600
IPS	4,500	2,419.00	10,885,500
FIG	14,500	303.00	4,393,500
システムサポート	5,400	1,773.00	9,574,200
ADEKA	48,900	2,302.00	112,567,800
日油	43,400	6,080.00	263,872,000
ミヨシ油脂	4,300	975.00	4,192,500
新日本理化	17,200	219.00	3,766,800
ハリマ化成グループ	8,900	925.00	8,232,500
イーソル	9,000	858.00	7,722,000

アルテリア・ネットワークス	13,000	1,319.00	17,147,000
東海ソフト	1,900	914.00	1,736,600
ウイングアーク1st	14,500	1,872.00	27,144,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,800	1,565.00	5,947,000
サーバーワークス	2,900	2,536.00	7,354,400
東名	900	2,508.00	2,257,200
ヴィッツ	1,200	922.00	1,106,400
トピラシステムズ	3,200	869.00	2,780,800
Sansan	45,800	1,618.00	74,104,400
Link-U	2,400	977.00	2,344,800
ギフトィ	15,300	2,551.00	39,030,300
花王	341,500	5,031.00	1,718,086,500
第一工業製薬	5,100	1,985.00	10,123,500
石原ケミカル	6,500	1,427.00	9,275,500
日華化学	5,100	845.00	4,309,500
ニイタカ	2,300	2,140.00	4,922,000
三洋化成工業	8,700	4,485.00	39,019,500
メドレー	14,100	4,240.00	59,784,000
ベース	4,700	4,945.00	23,241,500
JMDC	23,100	4,300.00	99,330,000
武田薬品工業	1,242,600	4,348.00	5,402,824,800
アステラス製薬	1,345,700	1,905.00	2,563,558,500
住友ファーマ	104,100	828.00	86,194,800
塩野義製薬	179,500	6,126.00	1,099,617,000
わかもと製薬	11,800	230.00	2,714,000
日本新薬	33,100	5,690.00	188,339,000
中外製薬	439,600	3,344.00	1,470,022,400
科研製薬	24,000	3,795.00	91,080,000
エーザイ	170,900	7,368.00	1,259,191,200
理研ビタミン	11,900	2,014.00	23,966,600
ロート製薬	136,000	2,648.00	360,128,000
小野薬品工業	271,000	2,851.00	772,621,000
久光製薬	31,200	3,805.00	118,716,000
有機合成薬品工業	9,400	299.00	2,810,600
持田製薬	16,800	3,460.00	58,128,000
参天製薬	264,200	1,061.00	280,316,200
扶桑薬品工業	4,400	2,001.00	8,804,400
日本ケミファ	1,200	1,801.00	2,161,200
ツムラ	44,200	2,648.00	117,041,600
テルモ	430,500	3,588.00	1,544,634,000
H.U.グループホールディングス	42,200	2,803.00	118,286,600
キッセイ薬品工業	21,700	2,684.00	58,242,800
生化学工業	26,900	822.00	22,111,800
栄研化学	22,800	1,625.00	37,050,000
鳥居薬品	7,500	3,290.00	24,675,000
JCRファーマ	47,500	1,527.00	72,532,500
東和薬品	21,600	1,927.00	41,623,200
富士製薬工業	9,100	1,105.00	10,055,500
ゼリア新薬工業	19,500	2,233.00	43,543,500

第一三共	1,223,200	4,418.00	5,404,097,600	
キョーリン製薬ホールディングス	30,500	1,730.00	52,765,000	
大幸薬品	25,400	391.00	9,931,400	
ダイト	9,800	2,547.00	24,960,600	
大塚ホールディングス	321,300	4,043.00	1,299,015,900	
大正製薬ホールディングス	31,200	5,670.00	176,904,000	
ペプチドリーム	68,100	1,840.00	125,304,000	
大日本塗料	17,300	850.00	14,705,000	
日本ペイントホールディングス	620,600	1,191.00	739,134,600	
関西ペイント	128,500	1,718.00	220,763,000	
神東塗料	10,700	132.00	1,412,400	
中国塗料	23,000	1,085.00	24,955,000	
日本特殊塗料	7,900	957.00	7,560,300	
藤倉化成	19,100	451.00	8,614,100	
太陽ホールディングス	21,200	2,472.00	52,406,400	
D I C	54,900	2,439.00	133,901,100	
サカタインクス	31,100	1,032.00	32,095,200	
東洋インキS Cホールディングス	27,400	1,999.00	54,772,600	
T & K T O K A	12,500	1,175.00	14,687,500	
アルプス技研	12,500	2,518.00	31,475,000	
サニックス	23,300	273.00	6,360,900	
日本空調サービス	15,800	728.00	11,502,400	
オリエンタルランド	152,300	22,120.00	3,368,876,000	
フォーカスシステムズ	10,300	1,030.00	10,609,000	
ダスキン	32,100	3,295.00	105,769,500	
パーク24	107,400	1,935.00	207,819,000	
明光ネットワークジャパン	18,900	633.00	11,963,700	
ファルコホールディングス	6,300	1,996.00	12,574,800	
クレスコ	10,800	1,690.00	18,252,000	
フジ・メディア・ホールディングス	134,800	1,219.00	164,321,200	
秀英予備校	3,200	426.00	1,363,200	
田谷	1,700	535.00	909,500	
ラウンドワン	120,300	532.00	63,999,600	
リゾートトラスト	56,800	2,156.00	122,460,800	
オービック	46,900	20,340.00	953,946,000	
ジャストシステム	20,200	3,415.00	68,983,000	
T D Cソフト	11,900	1,504.00	17,897,600	
Zホールディングス	1,998,200	370.20	739,733,640	
ビー・エム・エル	17,800	3,235.00	57,583,000	
トレンドマイクロ	81,000	6,500.00	526,500,000	
りらいあコミュニケーションズ	23,800	1,458.00	34,700,400	
I Dホールディングス	9,500	988.00	9,386,000	
リソー教育	65,400	327.00	21,385,800	
日本オラクル	26,900	9,040.00	243,176,000	
早稲田アカデミー	8,000	1,251.00	10,008,000	
アルファシステムズ	4,400	4,235.00	18,634,000	
フューチャー	35,000	1,783.00	62,405,000	
C A C Holdings	8,800	1,614.00	14,203,200	
S Bテクノロジー	5,900	2,066.00	12,189,400	
トーセ	3,300	745.00	2,458,500	

ユー・エス・エス	148,000	2,297.00	339,956,000
オービックビジネスコンサルタント	27,600	4,865.00	134,274,000
伊藤忠テクノソリューションズ	75,400	3,175.00	239,395,000
アイティフォー	18,700	864.00	16,156,800
東京個別指導学院	17,100	520.00	8,892,000
東計電算	2,100	6,560.00	13,776,000
サイバーエージェント	344,300	1,129.00	388,714,700
楽天グループ	666,100	653.00	434,963,300
エクスネット	1,800	1,057.00	1,902,600
クリーク・アンド・リバー社	8,500	2,290.00	19,465,000
モーニングスター	23,600	496.00	11,705,600
テー・オー・ダブリュー	27,900	313.00	8,732,700
大塚商会	79,600	4,685.00	372,926,000
サイボウズ	19,400	3,100.00	60,140,000
山田コンサルティンググループ	7,300	1,515.00	11,059,500
セントラルスポーツ	5,400	2,525.00	13,635,000
パラカ	4,800	2,074.00	9,955,200
電通国際情報サービス	17,000	4,855.00	82,535,000
A C C E S S	16,600	993.00	16,483,800
デジタルガレージ	24,900	4,265.00	106,198,500
イーエムシステムズ	23,400	848.00	19,843,200
ウェザーニューズ	4,300	6,750.00	29,025,000
C I J	11,700	1,115.00	13,045,500
ビジネスエンジニアリング	2,700	3,050.00	8,235,000
日本エンタープライズ	12,700	135.00	1,714,500
WOWOW	7,800	1,289.00	10,054,200
スカラ	13,000	734.00	9,542,000
インテリジェント ウェイブ	6,700	708.00	4,743,600
フルキャストホールディングス	13,700	2,457.00	33,660,900
エン・ジャパン	26,000	2,506.00	65,156,000
あすか製薬ホールディングス	14,400	1,194.00	17,193,600
サワイグループホールディングス	32,100	3,765.00	120,856,500
富士フイルムホールディングス	269,400	6,500.00	1,751,100,000
コニカミノルタ	315,700	584.00	184,368,800
資生堂	293,100	6,171.00	1,808,720,100
ライオン	168,500	1,475.00	248,537,500
高砂香料工業	9,500	2,659.00	25,260,500
マンダム	30,300	1,487.00	45,056,100
ミルボン	20,800	5,580.00	116,064,000
ファンケル	61,400	2,470.00	151,658,000
コーセー	28,600	15,320.00	438,152,000
コタ	11,900	1,697.00	20,194,300
シーボン	1,500	1,619.00	2,428,500
ポーラ・オルビスホールディングス	72,000	1,711.00	123,192,000
ノエビアホールディングス	12,500	5,380.00	67,250,000
アジュバンホールディングス	3,100	1,039.00	3,220,900
新日本製薬	8,000	1,437.00	11,496,000
エステー	10,900	1,578.00	17,200,200
アグロ カネショウ	5,600	1,631.00	9,133,600
コニシ	23,500	1,929.00	45,331,500

長谷川香料	29,100	2,996.00	87,183,600
星光PMC	6,600	554.00	3,656,400
小林製薬	40,800	8,140.00	332,112,000
荒川化学工業	12,000	1,027.00	12,324,000
メック	11,500	2,285.00	26,277,500
日本高純度化学	3,500	2,567.00	8,984,500
タカラパイオ	37,800	1,764.00	66,679,200
JCU	15,900	3,455.00	54,934,500
新田ゼラチン	7,700	808.00	6,221,600
OATアグリオ	5,100	1,518.00	7,741,800
デクセリアルズ	40,500	2,714.00	109,917,000
アース製薬	12,700	4,795.00	60,896,500
北興化学工業	14,200	860.00	12,212,000
大成ラミック	4,400	2,940.00	12,936,000
クミアイ化学工業	55,900	876.00	48,968,400
日本農薬	25,700	698.00	17,938,600
富士興産	3,000	1,232.00	3,696,000
ニチレキ	16,700	1,552.00	25,918,400
ユシロ化学工業	7,300	873.00	6,372,900
ピーピー・カストロール	4,700	912.00	4,286,400
富士石油	28,600	266.00	7,607,600
MORESCO	4,100	1,169.00	4,792,900
出光興産	156,000	3,065.00	478,140,000
ENEOSホールディングス	2,536,700	475.90	1,207,215,530
コスモエネルギーホールディングス	55,500	4,055.00	225,052,500
テスホールディングス	14,800	1,109.00	16,413,200
インフロニア・ホールディングス	143,800	1,093.00	157,173,400
横浜ゴム	79,900	2,679.00	214,052,100
TOYO TIRE	80,600	1,604.00	129,282,400
ブリヂストン	448,400	5,378.00	2,411,495,200
住友ゴム工業	137,600	1,243.00	171,036,800
藤倉コンポジット	8,900	1,026.00	9,131,400
オカモト	7,800	4,030.00	31,434,000
WOW WORLD GROUP	2,300	1,488.00	3,422,400
アキレス	9,100	1,416.00	12,885,600
フコク	7,400	1,069.00	7,910,600
ニッタ	14,300	3,055.00	43,686,500
クリエートメディック	4,300	892.00	3,835,600
住友理工	27,400	701.00	19,207,400
三ツ星ベルト	20,500	4,030.00	82,615,000
バンドー化学	22,400	1,055.00	23,632,000
AGC	142,900	5,070.00	724,503,000
日本板硝子	71,600	708.00	50,692,800
石塚硝子	1,900	1,560.00	2,964,000
有沢製作所	23,000	1,383.00	31,809,000
日本山村硝子	4,500	749.00	3,370,500
日本電気硝子	57,200	2,610.00	149,292,000
オハラ	6,700	1,228.00	8,227,600
住友大阪セメント	19,800	3,905.00	77,319,000
太平洋セメント	89,400	2,618.00	234,049,200

リソルホールディングス	1,100	5,070.00	5,577,000	
日本ヒューム	12,800	703.00	8,998,400	
日本コンクリート工業	28,000	256.00	7,168,000	
三谷セキサン	5,900	4,915.00	28,998,500	
アジアパイルホールディングス	22,400	758.00	16,979,200	
東海カーボン	117,800	1,314.00	154,789,200	
日本カーボン	8,000	4,110.00	32,880,000	
東洋炭素	8,800	4,080.00	35,904,000	
ノリタケカンパニーリミテド	7,000	4,635.00	32,445,000	
TOTO	92,700	4,505.00	417,613,500	
日本碍子	166,100	1,843.00	306,122,300	
日本特殊陶業	106,900	2,821.00	301,564,900	
ダントーホールディングス	8,900	436.00	3,880,400	
MARUWA	5,200	17,770.00	92,404,000	
品川リフラクトリーズ	3,900	4,520.00	17,628,000	
黒崎播磨	2,900	6,760.00	19,604,000	
ヨータイ	9,400	1,570.00	14,758,000	
東京窯業	11,900	337.00	4,010,300	
ニッカトー	5,700	607.00	3,459,900	
フジインコーポレーテッド	11,200	6,840.00	76,608,000	
クニミネ工業	3,700	890.00	3,293,000	
エーアンドエーマテリアル	2,500	940.00	2,350,000	
ニチアス	35,500	2,766.00	98,193,000	
日本製鉄	646,800	3,222.00	2,083,989,600	
神戸製鋼所	290,400	1,102.00	320,020,800	
中山製鋼所	29,700	1,102.00	32,729,400	
合同製鐵	7,200	3,765.00	27,108,000	
JFEホールディングス	386,000	1,816.00	700,976,000	
東京製鐵	40,600	1,544.00	62,686,400	
共英製鋼	16,500	1,633.00	26,944,500	
大和工業	23,800	5,740.00	136,612,000	
東京鐵鋼	6,900	1,887.00	13,020,300	
大阪製鐵	6,800	1,375.00	9,350,000	
淀川製鋼所	16,500	2,786.00	45,969,000	
中部鋼鈹	12,000	2,684.00	32,208,000	
丸一鋼管	44,000	3,020.00	132,880,000	
モリ工業	3,000	3,335.00	10,005,000	
大同特殊鋼	18,200	5,480.00	99,736,000	
日本高周波鋼業	4,300	352.00	1,513,600	
日本冶金工業	10,600	4,500.00	47,700,000	
山陽特殊製鋼	14,300	2,652.00	37,923,600	
愛知製鋼	8,400	2,419.00	20,319,600	
日本金属	2,900	969.00	2,810,100	
大平洋金属	10,300	1,989.00	20,486,700	
新日本電工	92,300	371.00	34,243,300	
栗本鐵工所	6,900	2,132.00	14,710,800	
虹 技	1,700	1,042.00	1,771,400	
日本鑄鉄管	1,400	1,005.00	1,407,000	
日本製鋼所	39,000	2,554.00	99,606,000	
三菱製鋼	9,000	1,285.00	11,565,000	



日亜鋼業	13,600	305.00	4,148,000
日本精線	2,100	4,810.00	10,101,000
エンビプロ・ホールディングス	8,900	738.00	6,568,200
大紀アルミニウム工業所	20,500	1,470.00	30,135,000
日本軽金属ホールディングス	39,100	1,501.00	58,689,100
三井金属鉱業	42,000	3,375.00	141,750,000
東邦亜鉛	8,600	2,165.00	18,619,000
三菱マテリアル	96,400	2,204.00	212,465,600
住友金属鉱山	167,600	5,152.00	863,475,200
DOWAホールディングス	32,500	4,550.00	147,875,000
古河機械金属	21,100	1,369.00	28,885,900
エス・サイエンス	78,500	27.00	2,119,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	21,100	3,640.00	76,804,000
東邦チタニウム	26,200	2,466.00	64,609,200
UACJ	20,200	2,701.00	54,560,200
CKサンエツ	2,700	4,295.00	11,596,500
古河電気工業	48,100	2,490.00	119,769,000
住友電気工業	498,800	1,728.00	861,926,400
フジクラ	155,000	979.00	151,745,000
昭和電線ホールディングス	16,200	1,962.00	31,784,400
タツタ電線	29,500	711.00	20,974,500
カナレ電気	2,100	1,302.00	2,734,200
平河ヒューテック	8,400	1,521.00	12,776,400
いよぎんホールディングス	164,200	804.00	132,016,800
しずおかフィナンシャルグループ	311,700	1,055.00	328,843,500
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	116,100	957.00	111,107,700
リョービ	15,400	1,514.00	23,315,600
アーレスティ	14,200	592.00	8,406,400
アサヒホールディングス	58,600	2,073.00	121,477,800
東洋製罐グループホールディングス	95,600	1,886.00	180,301,600
ホッカンホールディングス	7,700	1,350.00	10,395,000
コロナ	8,000	927.00	7,416,000
横河ブリッジホールディングス	19,100	2,148.00	41,026,800
駒井ハルテック	2,200	1,760.00	3,872,000
高田機工	600	2,763.00	1,657,800
三和ホールディングス	132,900	1,447.00	192,306,300
文化シャッター	41,600	1,182.00	49,171,200
三協立山	16,500	772.00	12,738,000
アルインコ	11,100	1,083.00	12,021,300
東洋シャッター	2,300	531.00	1,221,300
LIXIL	210,400	2,345.00	493,388,000
日本ファイルコン	8,400	474.00	3,981,600
ノーリツ	21,200	1,749.00	37,078,800
長府製作所	14,500	2,199.00	31,885,500
リンナイ	26,200	9,630.00	252,306,000
ユニプレス	25,100	932.00	23,393,200
ダイニチ工業	6,700	704.00	4,716,800
日東精工	21,100	560.00	11,816,000
三洋工業	1,400	1,965.00	2,751,000
岡部	23,200	787.00	18,258,400

ジーテクト	16,100	1,498.00	24,117,800
東ブレ	25,500	1,244.00	31,722,000
高周波熱錬	23,400	722.00	16,894,800
東京製綱	8,600	1,248.00	10,732,800
サンコール	11,400	628.00	7,159,200
モリテックスチール	9,600	338.00	3,244,800
パイオラックス	19,900	2,026.00	40,317,400
エイチワン	15,100	661.00	9,981,100
日本発条	127,900	960.00	122,784,000
中央発條	8,000	740.00	5,920,000
アドバネクス	1,500	1,150.00	1,725,000
三浦工業	59,100	3,360.00	198,576,000
タクマ	43,500	1,407.00	61,204,500
テクノプロ・ホールディングス	85,200	3,615.00	307,998,000
アトラグループ	3,100	186.00	576,600
インターワークス	3,300	375.00	1,237,500
アイ・アールジャパンホールディングス	7,500	2,270.00	17,025,000
Keeper 技研	8,900	4,720.00	42,008,000
ファーストロジック	2,100	901.00	1,892,100
三機サービス	2,100	960.00	2,016,000
Gunosy	11,400	620.00	7,068,000
デザインワン・ジャパン	3,800	194.00	737,200
イー・ガーディアン	5,400	2,334.00	12,603,600
リブセンス	5,900	254.00	1,498,600
ジャパンマテリアル	44,000	2,208.00	97,152,000
ベクトル	22,600	1,466.00	33,131,600
ウチヤマホールディングス	5,700	281.00	1,601,700
チャーム・ケア・コーポレーション	12,000	1,073.00	12,876,000
キャリアリンク	5,300	2,247.00	11,909,100
IBJ	8,800	836.00	7,356,800
アサンテ	7,200	1,710.00	12,312,000
バリューHR	12,600	1,671.00	21,054,600
M&Aキャピタルパートナーズ	13,300	3,670.00	48,811,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,200	1,135.00	5,902,000
ERIホールディングス	3,300	1,544.00	5,095,200
アピスト	2,100	3,005.00	6,310,500
シグマクシス・ホールディングス	21,800	1,202.00	26,203,600
ウィルグループ	12,000	1,149.00	13,788,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	13,800	156.00	2,152,800
メドピア	11,300	1,233.00	13,932,900
レアジョブ	2,500	1,171.00	2,927,500
リクルートホールディングス	1,065,600	3,535.00	3,766,896,000
エラン	19,100	1,031.00	19,692,100
ツガミ	31,400	1,491.00	46,817,400
オークマ	14,200	6,150.00	87,330,000
芝浦機械	14,100	3,125.00	44,062,500
アマダ	225,600	1,290.00	291,024,000
アイダエンジニアリング	29,100	830.00	24,153,000

TAKISAWA	3,400	1,235.00	4,199,000
FUJI	61,500	2,276.00	139,974,000
牧野フライス製作所	15,700	5,040.00	79,128,000
オーエスジー	67,500	2,003.00	135,202,500
ダイジェット工業	1,300	858.00	1,115,400
旭ダイヤモンド工業	39,500	882.00	34,839,000
DMG森精機	85,700	2,246.00	192,482,200
ソディック	38,900	789.00	30,692,100
ディスコ	22,700	43,900.00	996,530,000
日東工器	7,000	1,876.00	13,132,000
日進工具	11,900	1,077.00	12,816,300
パンチ工業	11,000	459.00	5,049,000
富士ダイス	6,100	999.00	6,093,900
土木管理総合試験所	5,400	317.00	1,711,800
日本郵政	1,886,200	1,231.50	2,322,855,300
ベルシステム24ホールディングス	19,300	1,501.00	28,969,300
鎌倉新書	16,300	1,009.00	16,446,700
SMN	3,300	461.00	1,521,300
一蔵	1,500	543.00	814,500
グローバルキッズCOMPANY	1,900	805.00	1,529,500
エアトリ	9,300	2,553.00	23,742,900
アトラエ	11,300	882.00	9,966,600
ストライク	7,100	3,760.00	26,696,000
ソラスト	39,700	652.00	25,884,400
セラク	5,100	1,475.00	7,522,500
インソース	35,700	1,410.00	50,337,000
豊田自動織機	102,400	8,630.00	883,712,000
豊和工業	6,800	996.00	6,772,800
石川製作所	3,200	1,443.00	4,617,600
東洋機械金属	8,700	615.00	5,350,500
津田駒工業	2,400	517.00	1,240,800
エンシュウ	2,700	708.00	1,911,600
島精機製作所	22,500	1,934.00	43,515,000
オプトラン	20,900	2,266.00	47,359,400
NCホールディングス	2,600	1,925.00	5,005,000
イワキ	9,500	1,320.00	12,540,000
フリー	14,800	1,230.00	18,204,000
ヤマシンフィルタ	33,600	391.00	13,137,600
日阪製作所	13,600	964.00	13,110,400
やまびこ	23,100	1,335.00	30,838,500
野村マイクロ・サイエンス	4,700	4,265.00	20,045,500
平田機工	6,800	6,710.00	45,628,000
ペガサスミシン製造	15,700	690.00	10,833,000
マルマエ	6,900	1,912.00	13,192,800
タツモ	7,700	2,144.00	16,508,800
ナブテスコ	88,700	3,435.00	304,684,500
三井海洋開発	17,700	1,450.00	25,665,000
レオン自動機	15,000	1,288.00	19,320,000
SMC	45,800	71,110.00	3,256,838,000
ホソカワミクロン	10,900	3,025.00	32,972,500

ユニオンツール	6,300	3,290.00	20,727,000
オイレス工業	19,800	1,714.00	33,937,200
日精エー・エス・ビー機械	6,500	4,145.00	26,942,500
サトーホールディングス	20,100	2,352.00	47,275,200
技研製作所	14,700	2,786.00	40,954,200
日本エアテック	7,200	1,129.00	8,128,800
カワタ	3,700	877.00	3,244,900
日精樹脂工業	10,600	1,027.00	10,886,200
オカダアイヨン	3,900	1,780.00	6,942,000
ワイエイシイホールディングス	5,300	2,684.00	14,225,200
小松製作所	662,500	3,421.00	2,266,412,500
住友重機械工業	83,600	3,365.00	281,314,000
日立建機	56,300	3,320.00	186,916,000
日工	21,100	641.00	13,525,100
巴工業	6,200	2,444.00	15,152,800
井関農機	13,200	1,216.00	16,051,200
TOWA	14,400	2,019.00	29,073,600
丸山製作所	2,300	1,798.00	4,135,400
北川鉄工所	5,500	1,130.00	6,215,000
シンニッタン	14,100	266.00	3,750,600
ローツェ	7,400	11,390.00	84,286,000
タカキタ	3,700	450.00	1,665,000
クボタ	748,300	2,100.50	1,571,804,150
荏原実業	6,800	2,813.00	19,128,400
東洋エンジニアリング	18,200	582.00	10,592,400
三菱化工機	4,500	2,372.00	10,674,000
月島機械	19,200	1,133.00	21,753,600
帝国電機製作所	10,300	2,722.00	28,036,600
東京機械製作所	3,000	550.00	1,650,000
新東工業	28,900	829.00	23,958,100
澁谷工業	13,200	2,490.00	32,868,000
アイチコーポレーション	20,100	821.00	16,502,100
小森コーポレーション	32,700	1,056.00	34,531,200
鶴見製作所	10,800	2,089.00	22,561,200
日本ギア工業	4,100	534.00	2,189,400
酒井重工業	2,100	4,075.00	8,557,500
荏原製作所	57,800	5,850.00	338,130,000
石井鐵工所	1,000	2,317.00	2,317,000
西島製作所	12,300	1,570.00	19,311,000
北越工業	14,200	1,443.00	20,490,600
ダイキン工業	168,800	23,610.00	3,985,368,000
オルガノ	19,500	3,355.00	65,422,500
トーヨーカネツ	5,400	2,796.00	15,098,400
栗田工業	79,100	6,090.00	481,719,000
椿本チエイン	20,000	3,330.00	66,600,000
大同工業	5,100	780.00	3,978,000
日機装	32,600	960.00	31,296,000
木村化工機	10,800	705.00	7,614,000
レイズネクスト	19,900	1,499.00	29,830,100
アネスト岩田	24,000	990.00	23,760,000

ダイフク	72,900	7,460.00	543,834,000
サムコ	4,600	3,505.00	16,123,000
加藤製作所	5,900	1,065.00	6,283,500
油研工業	1,700	2,134.00	3,627,800
タダノ	74,500	1,065.00	79,342,500
フジテック	51,800	3,400.00	176,120,000
C K D	39,100	2,209.00	86,371,900
平和	47,000	2,666.00	125,302,000
理想科学工業	12,600	2,509.00	31,613,400
S A N K Y O	27,800	5,690.00	158,182,000
日本金銭機械	15,600	1,275.00	19,890,000
マースグループホールディングス	8,400	2,801.00	23,528,400
フクシマガリレイ	10,400	4,520.00	47,008,000
オーイズミ	4,700	496.00	2,331,200
ダイコク電機	7,700	3,050.00	23,485,000
竹内製作所	25,600	3,140.00	80,384,000
アマノ	40,100	2,639.00	105,823,900
J U K I	21,900	640.00	14,016,000
サンデン	18,800	215.00	4,042,000
ジャノメ	14,500	654.00	9,483,000
ブラザー工業	188,900	2,032.00	383,844,800
マックス	17,400	2,200.00	38,280,000
モリタホールディングス	24,600	1,289.00	31,709,400
グローリー	36,600	2,931.00	107,274,600
新晃工業	14,200	1,683.00	23,898,600
大和冷機工業	21,700	1,267.00	27,493,900
セガサミーホールディングス	113,600	2,455.00	278,888,000
日本ピストンリング	4,300	1,381.00	5,938,300
リケン	5,600	2,648.00	14,828,800
T P R	16,200	1,430.00	23,166,000
ツバキ・ナカシマ	34,900	1,015.00	35,423,500
ホシザキ	91,000	4,945.00	449,995,000
大豊工業	12,400	655.00	8,122,000
日本精工	259,500	784.00	203,448,000
N T N	278,800	363.00	101,204,400
ジェイテクト	125,800	1,078.00	135,612,400
不二越	10,500	3,935.00	41,317,500
ミネベアミツミ	245,900	2,458.00	604,422,200
日本トムソン	34,600	610.00	21,106,000
T H K	81,600	3,185.00	259,896,000
ユーシン精機	11,100	748.00	8,302,800
前澤給装工業	10,100	1,003.00	10,130,300
イーグル工業	15,700	1,238.00	19,436,600
前澤工業	7,300	659.00	4,810,700
日本ピラー工業	13,100	3,575.00	46,832,500
キッツ	52,000	916.00	47,632,000
日立製作所	687,600	7,050.00	4,847,580,000
東芝	272,100	4,184.00	1,138,466,400
三菱電機	1,461,400	1,573.00	2,298,782,200
富士電機	85,900	5,230.00	449,257,000

東洋電機製造	4,000	903.00	3,612,000
安川電機	167,600	5,580.00	935,208,000
シンフォニアテクノロジー	15,600	1,754.00	27,362,400
明電舎	21,400	1,976.00	42,286,400
オリジン	2,900	1,327.00	3,848,300
山洋電気	6,200	5,960.00	36,952,000
デンヨー	10,800	1,670.00	18,036,000
PHCホールディングス	19,700	1,431.00	28,190,700
ソシオネクスト	14,500	10,040.00	145,580,000
ベイカレント・コンサルティング	113,800	5,550.00	631,590,000
Orchestra Holdings	3,100	1,841.00	5,707,100
アイモバイル	7,500	1,269.00	9,517,500
キャリアインデックス	4,300	343.00	1,474,900
MS-Japan	4,200	1,069.00	4,489,800
船場	1,500	754.00	1,131,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	51,300	1,950.00	100,035,000
フルテック	1,700	1,094.00	1,859,800
グリーンズ	4,300	1,307.00	5,620,100
ツナググループ・ホールディングス	3,600	642.00	2,311,200
GAMEWITH	3,800	357.00	1,356,600
MS&Consulting	1,400	574.00	803,600
ウェルビー	10,600	655.00	6,943,000
エル・ティー・エス	1,900	2,562.00	4,867,800
ミダックホールディングス	8,800	2,645.00	23,276,000
日総工産	10,800	705.00	7,614,000
キュービーネットホールディングス	6,800	1,365.00	9,282,000
RPAホールディングス	19,500	359.00	7,000,500
三櫻工業	21,400	700.00	14,980,000
マキタ	175,900	3,205.00	563,759,500
東芝テック	21,100	3,970.00	83,767,000
芝浦メカトロニクス	2,800	16,320.00	45,696,000
マブチモーター	35,200	3,800.00	133,760,000
日本電産	344,140	6,824.00	2,348,411,360
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	10,200	488.00	4,977,600
トレックス・セミコンダクター	6,700	2,483.00	16,636,100
東光高岳	8,600	2,405.00	20,683,000
ダブル・スコープ	46,300	1,311.00	60,699,300
宮越ホールディングス	6,400	842.00	5,388,800
ダイヘン	12,800	4,440.00	56,832,000
ヤーマン	24,400	1,487.00	36,282,800
JVCケンウッド	128,700	401.00	51,608,700
ミマキエンジニアリング	13,400	632.00	8,468,800
I-PEX	7,800	1,377.00	10,740,600
日新電機	33,800	1,696.00	57,324,800
大崎電気工業	33,300	535.00	17,815,500
オムロン	129,500	7,734.00	1,001,553,000
日東工業	19,100	2,794.00	53,365,400
I D E C	20,800	3,565.00	74,152,000

正興電機製作所	4,700	981.00	4,610,700
不二電機工業	2,600	1,089.00	2,831,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	46,500	2,438.00	113,367,000
サクサホールディングス	2,700	1,601.00	4,322,700
メルコホールディングス	3,800	3,385.00	12,863,000
テクノメディカ	3,400	1,797.00	6,109,800
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,600	874.00	4,020,400
日本電気	200,000	5,100.00	1,020,000,000
富士通	140,900	18,370.00	2,588,333,000
沖電気工業	63,900	739.00	47,222,100
岩崎通信機	5,500	785.00	4,317,500
電気興業	5,600	2,322.00	13,003,200
サンケン電気	13,100	11,680.00	153,008,000
ナカヨ	2,200	1,183.00	2,602,600
アイホン	8,600	2,020.00	17,372,000
ルネサスエレクトロニクス	922,700	1,836.50	1,694,538,550
セイコーエプソン	188,300	1,900.00	357,770,000
ワコム	112,000	692.00	77,504,000
アルバック	33,500	5,270.00	176,545,000
アクセル	4,600	1,777.00	8,174,200
E I Z O	10,400	3,990.00	41,496,000
ジャパンディスプレイ	542,300	40.00	21,692,000
日本信号	32,200	1,063.00	34,228,600
京三製作所	29,700	423.00	12,563,100
能美防災	19,200	1,675.00	32,160,000
ホーチキ	10,600	1,528.00	16,196,800
星和電機	5,300	476.00	2,522,800
エレコム	33,700	1,286.00	43,338,200
パナソニック ホールディングス	1,670,300	1,222.00	2,041,106,600
シャープ	170,200	944.00	160,668,800
アンリツ	99,600	1,257.00	125,197,200
富士通ゼネラル	40,100	3,890.00	155,989,000
ソニーグループ	990,400	11,700.00	11,587,680,000
T D K	224,000	4,770.00	1,068,480,000
帝国通信工業	6,400	1,505.00	9,632,000
タムラ製作所	60,600	795.00	48,177,000
アルプスアルパイン	126,200	1,310.00	165,322,000
池上通信機	4,100	641.00	2,628,100
日本電波工業	16,900	1,387.00	23,440,300
鈴木	7,600	1,064.00	8,086,400
メイコー	15,500	2,913.00	45,151,500
日本トリム	3,200	3,235.00	10,352,000
ローランド ディー・ジー	7,900	3,280.00	25,912,000
フォスター電機	13,100	1,038.00	13,597,800
S M K	3,400	2,550.00	8,670,000
ヨコオ	11,200	2,025.00	22,680,000
ティアック	19,300	115.00	2,219,500
ホシデン	33,000	1,669.00	55,077,000
ヒロセ電機	23,400	17,250.00	403,650,000

日本航空電子工業	29,000	2,294.00	66,526,000
TOA	16,100	828.00	13,330,800
マクセル	30,700	1,480.00	45,436,000
古野電気	18,500	971.00	17,963,500
スミダコーポレーション	12,900	1,563.00	20,162,700
アイコム	5,500	2,591.00	14,250,500
リオン	5,800	1,906.00	11,054,800
横河電機	154,800	2,176.00	336,844,800
新電元工業	5,400	3,810.00	20,574,000
アズビル	97,800	3,610.00	353,058,000
東亜ディーケーケー	6,100	820.00	5,002,000
日本光電工業	64,700	3,615.00	233,890,500
チノー	5,800	2,118.00	12,284,400
共和電業	11,900	354.00	4,212,600
日本電子材料	9,200	1,555.00	14,306,000
堀場製作所	31,100	7,670.00	238,537,000
アドバンテスト	110,200	11,400.00	1,256,280,000
小野測器	4,600	426.00	1,959,600
エスベック	11,200	2,064.00	23,116,800
キーエンス	140,000	60,170.00	8,423,800,000
日置電機	7,300	8,300.00	60,590,000
シスメックス	120,700	8,587.00	1,036,450,900
日本マイクロニクス	23,100	1,333.00	30,792,300
メガチップス	11,500	2,935.00	33,752,500
OBARA GROUP	6,600	4,015.00	26,499,000
IMAGICA GROUP	11,500	650.00	7,475,000
澤藤電機	1,400	1,235.00	1,729,000
デンソー	288,800	7,547.00	2,179,573,600
原田工業	5,600	888.00	4,972,800
コーセル	16,800	1,149.00	19,303,200
イリソ電子工業	12,900	4,925.00	63,532,500
オブテックスグループ	25,700	2,093.00	53,790,100
千代田インテグレ	4,800	2,300.00	11,040,000
レーザーテック	64,100	21,225.00	1,360,522,500
スタンレー電気	99,600	2,968.00	295,612,800
岩崎電気	4,500	4,445.00	20,002,500
ウシオ電機	73,100	1,594.00	116,521,400
岡谷電機産業	10,100	340.00	3,434,000
ヘリオス テクノ ホールディング	11,400	353.00	4,024,200
エノモト	3,200	1,833.00	5,865,600
日本セラミック	14,300	2,765.00	39,539,500
遠藤照明	5,500	851.00	4,680,500
古河電池	10,400	1,133.00	11,783,200
双信電機	5,100	397.00	2,024,700
山一電機	12,200	1,963.00	23,948,600
図研	12,200	3,465.00	42,273,000
日本電子	35,100	4,200.00	147,420,000
カシオ計算機	104,200	1,312.00	136,710,400
ファナック	137,300	24,130.00	3,313,049,000
日本シイエムケイ	29,700	497.00	14,760,900



エンプラス	4,100	4,425.00	18,142,500
大真空	17,000	757.00	12,869,000
ローム	64,700	10,640.00	688,408,000
浜松ホトニクス	112,300	6,740.00	756,902,000
三井ハイテック	14,500	7,060.00	102,370,000
新光電気工業	49,500	3,810.00	188,595,000
京セラ	217,500	6,876.00	1,495,530,000
協栄産業	1,100	2,128.00	2,340,800
太陽誘電	68,200	4,275.00	291,555,000
村田製作所	424,600	7,678.00	3,260,078,800
双葉電子工業	26,500	546.00	14,469,000
日東電工	101,900	8,760.00	892,644,000
北陸電気工業	4,600	1,425.00	6,555,000
東海理化電機製作所	39,600	1,675.00	66,330,000
ニチコン	28,600	1,444.00	41,298,400
日本ケミコン	13,800	2,321.00	32,029,800
K O A	21,100	1,928.00	40,680,800
三井E & Sホールディングス	64,800	433.00	28,058,400
日立造船	115,900	935.00	108,366,500
三菱重工業	247,300	4,954.00	1,225,124,200
川崎重工業	105,500	3,000.00	316,500,000
I H I	89,100	3,480.00	310,068,000
名村造船所	32,000	363.00	11,616,000
サノヤスホールディングス	17,200	133.00	2,287,600
スプリックス	4,400	899.00	3,955,600
マネジメントソリューションズ	7,900	3,425.00	27,057,500
プロレド・パートナーズ	3,400	506.00	1,720,400
and factory	3,700	369.00	1,365,300
テノ・ホールディングス	1,500	801.00	1,201,500
フロンティア・マネジメント	4,800	1,105.00	5,304,000
ピアラ	2,100	643.00	1,350,300
コプロ・ホールディングス	2,200	1,190.00	2,618,000
ギークス	1,800	1,121.00	2,017,800
カーブスホールディングス	44,200	797.00	35,227,400
フォーラムエンジニアリング	8,500	924.00	7,854,000
FAST FITNESS JAPAN	4,800	1,469.00	7,051,200
日本車輛製造	5,400	1,983.00	10,708,200
三菱ロジスネクスト	22,400	848.00	18,995,200
近畿車輛	1,500	1,513.00	2,269,500
一家ホールディングス	2,900	599.00	1,737,100
フルサト・マルカホールディングス	14,700	2,911.00	42,791,700
ヤマエグループホールディングス	8,400	1,835.00	15,414,000
ジャパクラフトホールディングス	4,100	591.00	2,423,100
F P G	55,900	1,175.00	65,682,500
島根銀行	4,300	530.00	2,279,000
じもとホールディングス	8,100	435.00	3,523,500
全国保証	36,100	5,510.00	198,911,000
めぶきフィナンシャルグループ	683,800	367.00	250,954,600

ジャパンインベストメントアドバイザー	11,200	1,057.00	11,838,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,600	2,885.00	50,776,000	
九州フィナンシャルグループ	242,900	519.00	126,065,100	
かんぽ生命保険	167,500	2,429.00	406,857,500	
ゆうちょ銀行	392,700	1,197.00	470,061,900	
あんしん保証	6,200	261.00	1,618,200	
富山第一銀行	34,300	689.00	23,632,700	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	759,800	567.00	430,806,600	
ジェイリース	4,100	2,165.00	8,876,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	87,200	1,116.00	97,315,200	
イントラスト	4,600	1,012.00	4,655,200	
日本モーゲージサービス	6,900	813.00	5,609,700	
CASA	4,600	819.00	3,767,400	
アルヒ	16,900	1,106.00	18,691,400	
プレミアグループ	23,200	1,650.00	38,280,000	
日産自動車	1,988,700	530.90	1,055,800,830	
いすゞ自動車	407,100	1,669.00	679,449,900	
トヨタ自動車	7,687,600	1,896.00	14,575,689,600	
日野自動車	180,300	555.00	100,066,500	
三菱自動車工業	546,200	557.00	304,233,400	
エフテック	8,500	698.00	5,933,000	
レシップホールディングス	4,800	475.00	2,280,000	
GMB	2,500	912.00	2,280,000	
ファルテック	2,200	601.00	1,322,200	
武蔵精密工業	34,200	1,820.00	62,244,000	
日産車体	24,700	908.00	22,427,600	
新明和工業	44,000	1,180.00	51,920,000	
極東開発工業	24,600	1,596.00	39,261,600	
トピー工業	11,400	1,994.00	22,731,600	
ティラド	3,500	2,334.00	8,169,000	
曙ブレーキ工業	85,400	151.00	12,895,400	
タチエス	22,200	1,260.00	27,972,000	
NOK	54,400	1,400.00	76,160,000	
フタバ産業	37,400	432.00	16,156,800	
KYB	13,400	4,025.00	53,935,000	
市光工業	20,200	441.00	8,908,200	
大同メタル工業	27,300	521.00	14,223,300	
プレス工業	62,400	500.00	31,200,000	
ミクニ	14,400	345.00	4,968,000	
太平洋工業	32,100	1,175.00	37,717,500	
河西工業	16,500	200.00	3,300,000	
アイシン	108,100	3,795.00	410,239,500	
マツダ	463,000	1,308.00	605,604,000	
今仙電機製作所	7,900	808.00	6,383,200	
本田技研工業	1,138,100	3,613.00	4,111,955,300	
スズキ	257,200	4,889.00	1,257,450,800	
SUBARU	443,000	2,231.00	988,333,000	

安永	5,500	1,075.00	5,912,500
ヤマハ発動機	220,000	3,600.00	792,000,000
小糸製作所	168,400	2,419.00	407,359,600
T B K	12,000	278.00	3,336,000
エクセディ	22,800	1,854.00	42,271,200
ミツバ	26,300	541.00	14,228,300
豊田合成	40,800	2,312.00	94,329,600
愛三工業	23,200	917.00	21,274,400
盟和産業	1,500	988.00	1,482,000
日本プラスト	9,700	433.00	4,200,100
ヨロズ	12,900	831.00	10,719,900
エフ・シー・シー	24,900	1,547.00	38,520,300
新家工業	2,800	2,449.00	6,857,200
シマノ	57,200	21,460.00	1,227,512,000
テイ・エス テック	64,100	1,752.00	112,303,200
三十三フィナンシャルグループ	12,400	1,736.00	21,526,400
第四北越フィナンシャルグループ	21,700	3,180.00	69,006,000
ひろぎんホールディングス	180,000	698.00	125,640,000
マーキュリアホールディングス	7,300	733.00	5,350,900
おきなわフィナンシャルグループ	13,100	2,300.00	30,130,000
ダイレクトマーケティングミックス	17,200	1,434.00	24,664,800
ポピンズ	2,200	1,780.00	3,916,000
L I T A L I C O	11,200	2,558.00	28,649,600
十六フィナンシャルグループ	17,800	3,255.00	57,939,000
北國フィナンシャルホールディングス	11,700	4,270.00	49,959,000
ネットプロテクションズホールディングス	45,500	574.00	26,117,000
プロクレアホールディングス	17,000	2,265.00	38,505,000
あいちフィナンシャルグループ	19,300	2,458.00	47,439,400
ジャムコ	6,800	1,609.00	10,941,200
小野建	13,700	1,552.00	21,262,400
はるやまホールディングス	5,400	484.00	2,613,600
南陽	2,600	2,298.00	5,974,800
ノジマ	48,400	1,423.00	68,873,200
佐島電機	8,200	1,781.00	14,604,200
カップ・クリエイト	23,400	1,462.00	34,210,800
エコートレーディング	2,600	824.00	2,142,400
伯東	8,500	5,530.00	47,005,000
コンドーテック	11,400	1,073.00	12,232,200
中山福	6,800	347.00	2,359,600
ライトオン	9,900	580.00	5,742,000
ナガイレーベン	18,700	2,013.00	37,643,100
三菱食品	13,700	3,335.00	45,689,500
良品計画	191,100	1,395.00	266,584,500
パリミキホールディングス	16,900	310.00	5,239,000
松田産業	11,200	2,382.00	26,678,400
第一興商	28,600	4,330.00	123,838,000
メディパルホールディングス	153,500	1,881.00	288,733,500
アドヴァングループ	14,200	953.00	13,532,600
S P K	6,600	1,648.00	10,876,800

萩原電気ホールディングス	5,600	3,100.00	17,360,000	
アルビス	4,800	2,470.00	11,856,000	
アズワン	21,100	5,580.00	117,738,000	
スズデン	5,200	2,790.00	14,508,000	
尾家産業	3,200	1,039.00	3,324,800	
シモジマ	10,200	1,005.00	10,251,000	
ドウシシャ	15,700	1,957.00	30,724,900	
小津産業	3,000	1,735.00	5,205,000	
コナカ	14,400	366.00	5,270,400	
高速	7,700	2,000.00	15,400,000	
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,670.00	2,839,000	
G-7ホールディングス	18,500	1,500.00	27,750,000	
たけびし	5,700	1,707.00	9,729,900	
イオン北海道	21,900	836.00	18,308,400	
コジマ	28,700	555.00	15,928,500	
ヒマラヤ	4,200	936.00	3,931,200	
コーナン商事	20,000	3,245.00	64,900,000	
ネットワンシステムズ	52,300	3,095.00	161,868,500	
エコス	5,500	1,850.00	10,175,000	
ワタミ	17,800	913.00	16,251,400	
マルシェ	4,100	391.00	1,603,100	
リックス	2,800	2,617.00	7,327,600	
システムソフト	47,600	86.00	4,093,600	
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	299,000	2,592.00	775,008,000	
丸文	13,200	1,515.00	19,998,000	
西松屋チェーン	32,800	1,618.00	53,070,400	
ゼンショーホールディングス	81,000	4,085.00	330,885,000	
ハビネット	12,600	1,915.00	24,129,000	
幸楽苑ホールディングス	9,700	1,078.00	10,456,600	
ハークスレイ	4,600	757.00	3,482,200	
橋本総業ホールディングス	5,900	1,131.00	6,672,900	
日本ライフライン	43,400	975.00	42,315,000	
サイゼリヤ	24,600	3,350.00	82,410,000	
タカショー	12,800	723.00	9,254,400	
VTホールディングス	56,200	532.00	29,898,400	
アルゴグラフィックス	12,900	3,795.00	48,955,500	
魚力	4,600	2,154.00	9,908,400	
IDOM	44,800	878.00	39,334,400	
日本エム・ディ・エム	8,200	1,062.00	8,708,400	
ポブラ	3,300	138.00	455,400	
フジ・コーポレーション	8,400	1,334.00	11,205,600	
ユナイテッドアローズ	15,800	1,876.00	29,640,800	
進和	9,800	2,182.00	21,383,600	
エスケイジャパン	3,300	540.00	1,782,000	
ダイترون	5,800	2,594.00	15,045,200	
ハイデイ日高	21,900	2,081.00	45,573,900	
シークス	21,000	1,402.00	29,442,000	
YU-WA CREATION HOLDINGS	7,300	208.00	1,518,400	

コロワイド	68,300	1,980.00	135,234,000
ピーシーデボコーポレーション	16,100	305.00	4,910,500
田中商事	4,000	615.00	2,460,000
オーハシテクニカ	7,400	1,585.00	11,729,000
壱番屋	11,800	4,875.00	57,525,000
白銅	5,400	2,658.00	14,353,200
トップカルチャー	4,300	197.00	847,100
P L A N T	3,300	688.00	2,270,400
スギホールディングス	29,800	5,620.00	167,476,000
ダイコー通産	1,400	1,180.00	1,652,000
薬王堂ホールディングス	8,200	2,539.00	20,819,800
島津製作所	170,500	3,990.00	680,295,000
J M S	13,100	532.00	6,969,200
クボテック	3,300	223.00	735,900
長野計器	10,200	1,265.00	12,903,000
ブイ・テクノロジー	6,800	2,490.00	16,932,000
スター精密	26,700	1,785.00	47,659,500
東京計器	10,700	1,306.00	13,974,200
愛知時計電機	5,500	1,480.00	8,140,000
インターアクション	6,600	1,515.00	9,999,000
オーバル	11,000	482.00	5,302,000
東京精密	30,700	5,120.00	157,184,000
マニー	61,600	1,909.00	117,594,400
ニコン	217,700	1,379.00	300,208,300
トプコン	73,600	1,817.00	133,731,200
オリンパス	875,100	2,387.50	2,089,301,250
理研計器	8,700	5,570.00	48,459,000
S C R E E Nホールディングス	23,900	11,380.00	271,982,000
キヤノン電子	15,500	1,847.00	28,628,500
タムロン	10,500	3,360.00	35,280,000
H O Y A	299,000	14,245.00	4,259,255,000
シード	6,400	564.00	3,609,600
ノーリツ鋼機	13,200	2,437.00	32,168,400
A & Dホロンホールディングス	20,400	1,443.00	29,437,200
朝日インテック	156,400	2,353.00	368,009,200
キヤノン	768,200	2,970.00	2,281,554,000
リコー	351,000	1,050.00	368,550,000
シチズン時計	153,700	848.00	130,337,600
リズム	3,900	1,697.00	6,618,300
大研医器	9,500	497.00	4,721,500
メニコン	48,100	2,876.00	138,335,600
シンシア	1,200	581.00	697,200
K Y O R I T S U	18,100	141.00	2,552,100
中本パックス	3,900	1,600.00	6,240,000
スノーピーク	23,900	2,142.00	51,193,800
パラマウントベッドホールディングス	32,400	2,416.00	78,278,400
トランザクション	10,800	1,509.00	16,297,200
粧美堂	3,600	385.00	1,386,000
ニホンフラッシュ	13,200	964.00	12,724,800
前田工織	11,900	3,320.00	39,508,000

永大産業	13,300	232.00	3,085,600
アートネイチャー	14,500	767.00	11,121,500
バンダイナムコホールディングス	127,900	8,421.00	1,077,045,900
アイフィスジャパン	3,600	597.00	2,149,200
SHOEI	14,800	5,510.00	81,548,000
フランスベッドホールディングス	17,200	1,040.00	17,888,000
マーベラス	22,900	706.00	16,167,400
パイロットコーポレーション	21,900	4,275.00	93,622,500
萩原工業	9,300	1,223.00	11,373,900
エイベックス	23,800	1,550.00	36,890,000
フジシールインターナショナル	28,400	1,546.00	43,906,400
タカラトミー	64,500	1,387.00	89,461,500
広済堂ホールディングス	8,400	2,342.00	19,672,800
エステールホールディングス	3,000	639.00	1,917,000
レック	20,000	896.00	17,920,000
タカノ	4,700	734.00	3,449,800
三光合成	17,500	586.00	10,255,000
プロネクス	11,700	979.00	11,454,300
ホクシン	9,600	151.00	1,449,600
ウッドワン	4,100	1,295.00	5,309,500
大建工業	8,500	2,302.00	19,567,000
きもと	18,600	205.00	3,813,000
凸版印刷	183,100	2,767.00	506,637,700
大日本印刷	166,100	3,930.00	652,773,000
共同印刷	3,900	2,819.00	10,994,100
NISSHA	26,700	1,800.00	48,060,000
光村印刷	600	1,319.00	791,400
藤森工業	11,100	3,265.00	36,241,500
ヴィア・ホールディングス	18,400	96.00	1,766,400
TAKARA & COMPANY	9,000	2,281.00	20,529,000
前澤化成工業	9,000	1,502.00	13,518,000
未来工業	5,100	1,601.00	8,165,100
アシックス	129,200	3,630.00	468,996,000
ツツミ	2,500	2,321.00	5,802,500
ウェーブロックホールディングス	3,800	628.00	2,386,400
JSP	9,800	1,635.00	16,023,000
ニチハ	17,500	2,793.00	48,877,500
ローランド	10,300	4,055.00	41,766,500
エフピコ	26,600	3,315.00	88,179,000
小松ウオール工業	5,200	2,074.00	10,784,800
ヤマハ	88,300	5,150.00	454,745,000
河合楽器製作所	3,800	2,751.00	10,453,800
クリナップ	15,800	715.00	11,297,000
ピジョン	89,100	2,022.00	180,160,200
天馬	12,000	2,376.00	28,512,000
兼松サステック	600	2,247.00	1,348,200
キングジム	12,500	891.00	11,137,500
象印マホービン	41,800	1,596.00	66,712,800
リンテック	28,100	2,233.00	62,747,300
信越ポリマー	26,000	1,493.00	38,818,000

東リ	28,300	288.00	8,150,400	
イトーキ	28,600	776.00	22,193,600	
任天堂	883,900	5,148.00	4,550,317,200	
三菱鉛筆	19,900	1,567.00	31,183,300	
松風	6,400	2,126.00	13,606,400	
タカラスタANDARD	27,100	1,526.00	41,354,600	
コクヨ	67,400	1,910.00	128,734,000	
ナカバヤシ	15,400	487.00	7,499,800	
ニフコ	50,700	3,630.00	184,041,000	
立川ブラインド工業	6,600	1,295.00	8,547,000	
グロープライド	11,300	2,541.00	28,713,300	
オカムラ	42,200	1,376.00	58,067,200	
バルカー	11,800	3,455.00	40,769,000	
MUTOHホールディングス	1,700	1,781.00	3,027,700	
伊藤忠商事	912,900	4,283.00	3,909,950,700	
丸紅	1,169,500	1,874.50	2,192,227,750	
スクロール	22,000	830.00	18,260,000	
高島	2,200	2,939.00	6,465,800	
ヨンドシーホールディングス	12,700	1,802.00	22,885,400	
三陽商会	4,700	1,626.00	7,642,200	
長瀬産業	69,600	2,203.00	153,328,800	
ナイガイ	4,200	259.00	1,087,800	
蝶理	8,000	2,656.00	21,248,000	
豊田通商	129,700	5,620.00	728,914,000	
オンワードホールディングス	90,800	368.00	33,414,400	
三共生興	21,200	585.00	12,402,000	
兼松	57,400	1,712.00	98,268,800	
美津濃	13,800	3,545.00	48,921,000	
ツカモトコーポレーション	1,900	1,451.00	2,756,900	
ルックホールディングス	3,600	2,241.00	8,067,600	
三井物産	1,083,800	4,179.00	4,529,200,200	
日本紙パルプ商事	7,800	5,570.00	43,446,000	
東京エレクトロン	98,800	48,030.00	4,745,364,000	
カメイ	15,800	1,523.00	24,063,400	
東都水産	600	6,030.00	3,618,000	
OUGホールディングス	2,100	2,497.00	5,243,700	
スターゼン	11,300	2,291.00	25,888,300	
セイコーグループ	21,700	2,983.00	64,731,100	
山善	39,900	1,075.00	42,892,500	
椿本興業	2,200	4,470.00	9,834,000	
住友商事	917,500	2,418.00	2,218,515,000	
BIPROGY	51,700	3,150.00	162,855,000	
内田洋行	6,600	5,040.00	33,264,000	
三菱商事	926,200	4,991.00	4,622,664,200	
第一実業	5,200	5,340.00	27,768,000	
キャノンマーケティングジャパン	34,300	3,230.00	110,789,000	
西華産業	5,800	1,812.00	10,509,600	
佐藤商事	10,400	1,474.00	15,329,600	
菱洋エレクトロ	12,600	2,728.00	34,372,800	
東京産業	13,600	803.00	10,920,800	

ユアサ商事	13,300	3,885.00	51,670,500
神鋼商事	3,700	6,170.00	22,829,000
トルク	6,800	218.00	1,482,400
阪和興業	26,600	4,000.00	106,400,000
正栄食品工業	9,800	4,355.00	42,679,000
カナデン	12,000	1,214.00	14,568,000
菱電商事	11,900	1,920.00	22,848,000
ニプロ	116,700	1,044.00	121,834,800
岩谷産業	33,700	5,890.00	198,493,000
ナイス	3,600	1,402.00	5,047,200
ニチモウ	1,400	3,190.00	4,466,000
極東貿易	8,900	1,550.00	13,795,000
アステナホールディングス	25,600	432.00	11,059,200
兼松エレクトロニクス	8,700	6,180.00	53,766,000
三愛オブリ	40,800	1,445.00	58,956,000
稲畑産業	29,900	2,777.00	83,032,300
G S Iクレオス	8,700	1,689.00	14,694,300
明和産業	19,700	708.00	13,947,600
クワザワホールディングス	4,500	485.00	2,182,500
キムラタン	74,700	21.00	1,568,700
ゴールドウイン	24,900	11,970.00	298,053,000
ユニ・チャーム	292,500	5,076.00	1,484,730,000
デサント	24,100	4,115.00	99,171,500
キング	5,500	522.00	2,871,000
ワキタ	27,200	1,181.00	32,123,200
ヤマトインターナショナル	10,100	258.00	2,605,800
東邦ホールディングス	36,800	2,341.00	86,148,800
サンゲツ	37,200	2,400.00	89,280,000
ミツウロコグループホールディングス	19,100	1,366.00	26,090,600
シナネンホールディングス	4,700	3,445.00	16,191,500
伊藤忠エネクス	36,700	1,153.00	42,315,100
サンリオ	42,000	4,340.00	182,280,000
サンワテクノス	7,600	2,027.00	15,405,200
リョーサン	15,800	3,315.00	52,377,000
新光商事	19,900	1,323.00	26,327,700
トーヨー	6,400	1,720.00	11,008,000
三信電気	5,900	2,532.00	14,938,800
東陽テクニカ	16,300	1,415.00	23,064,500
モスフードサービス	21,800	3,075.00	67,035,000
加賀電子	12,100	5,170.00	62,557,000
三益半導体工業	11,100	2,814.00	31,235,400
都築電気	7,400	1,559.00	11,536,600
ソーダニッカ	9,600	872.00	8,371,200
立花エレテック	10,800	2,080.00	22,464,000
木曽路	22,500	2,245.00	50,512,500
S R Sホールディングス	24,400	941.00	22,960,400
千趣会	27,800	398.00	11,064,400
タカキュー	9,400	75.00	705,000
リテールパートナーズ	22,000	1,347.00	29,634,000
ケーヨー	24,000	840.00	20,160,000



上新電機	13,200	2,077.00	27,416,400
日本瓦斯	79,400	1,925.00	152,845,000
ロイヤルホールディングス	28,700	2,773.00	79,585,100
東天紅	600	745.00	447,000
いなげや	14,500	1,329.00	19,270,500
チヨダ	14,200	823.00	11,686,600
ライフコーポレーション	12,900	2,629.00	33,914,100
リンガーハット	19,100	2,242.00	42,822,200
MrMaxHD	20,900	678.00	14,170,200
テンアライド	14,100	286.00	4,032,600
AOKIホールディングス	27,500	881.00	24,227,500
オークワ	23,600	855.00	20,178,000
コメリ	22,900	2,742.00	62,791,800
青山商事	31,700	1,017.00	32,238,900
しまむら	17,300	13,400.00	231,820,000
はせがわ	6,400	363.00	2,323,200
高島屋	111,700	1,998.00	223,176,600
松屋	25,100	1,163.00	29,191,300
エイチ・ツー・オー リテイリング	72,100	1,520.00	109,592,000
近鉄百貨店	4,700	2,440.00	11,468,000
丸井グループ	109,200	2,141.00	233,797,200
クレディセゾン	87,300	1,891.00	165,084,300
アクシアル リテイリング	10,200	3,460.00	35,292,000
井筒屋	6,300	353.00	2,223,900
イオン	502,200	2,573.00	1,292,160,600
イズミ	22,600	3,095.00	69,947,000
フォーバル	5,600	1,063.00	5,952,800
平和堂	24,600	2,067.00	50,848,200
フジ	22,800	1,729.00	39,421,200
ヤオコー	16,700	6,870.00	114,729,000
ゼビオホールディングス	20,200	1,047.00	21,149,400
ケースホールディングス	117,800	1,218.00	143,480,400
PALTAC	23,300	4,980.00	116,034,000
三谷産業	25,900	327.00	8,469,300
Olympicグループ	5,300	518.00	2,745,400
日産東京販売ホールディングス	16,800	357.00	5,997,600
SBI新生銀行	40,700	2,485.00	101,139,500
あおぞら銀行	86,600	2,581.00	223,514,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,754,800	932.70	8,165,601,960
りそなホールディングス	1,742,800	733.80	1,278,866,640
三井住友トラスト・ホールディングス	250,700	5,165.00	1,294,865,500
三井住友フィナンシャルグループ	1,007,600	5,915.00	5,959,954,000
千葉銀行	384,300	961.00	369,312,300
群馬銀行	267,300	500.00	133,650,000
武蔵野銀行	17,500	2,491.00	43,592,500
千葉興業銀行	28,700	566.00	16,244,200
筑波銀行	60,600	232.00	14,059,200
七十七銀行	44,100	2,312.00	101,959,200
秋田銀行	9,200	1,939.00	17,838,800
山形銀行	15,400	1,216.00	18,726,400

岩手銀行	9,400	2,444.00	22,973,600	
東邦銀行	109,900	238.00	26,156,200	
東北銀行	6,200	1,023.00	6,342,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	110,000	2,866.00	315,260,000	
スルガ銀行	121,500	428.00	52,002,000	
八十二銀行	282,500	616.00	174,020,000	
山梨中央銀行	14,100	1,309.00	18,456,900	
大垣共立銀行	26,400	2,050.00	54,120,000	
福井銀行	12,300	1,675.00	20,602,500	
清水銀行	5,500	1,518.00	8,349,000	
富山銀行	1,900	1,734.00	3,294,600	
滋賀銀行	23,000	2,889.00	66,447,000	
南都銀行	20,700	2,672.00	55,310,400	
百五銀行	129,800	409.00	53,088,200	
京都銀行	43,700	6,610.00	288,857,000	
紀陽銀行	49,300	1,624.00	80,063,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	87,600	1,062.00	93,031,200	
山陰合同銀行	86,100	831.00	71,549,100	
鳥取銀行	4,000	1,235.00	4,940,000	
百十四銀行	12,500	2,003.00	25,037,500	
四国銀行	21,700	955.00	20,723,500	
阿波銀行	20,400	2,166.00	44,186,400	
大分銀行	8,200	2,283.00	18,720,600	
宮崎銀行	9,000	2,686.00	24,174,000	
佐賀銀行	8,000	1,836.00	14,688,000	
琉球銀行	31,300	1,033.00	32,332,900	
セブン銀行	493,700	274.00	135,273,800	
みずほフィナンシャルグループ	1,994,200	2,115.00	4,217,733,000	
高知銀行	4,200	735.00	3,087,000	
山口フィナンシャルグループ	152,300	917.00	139,659,100	
芙蓉総合リース	12,700	9,590.00	121,793,000	
みずほリース	20,500	3,710.00	76,055,000	
東京センチュリー	25,700	4,775.00	122,717,500	
SBIホールディングス	199,600	2,879.00	574,648,400	
日本証券金融	55,400	1,033.00	57,228,200	
アイフル	228,300	368.00	84,014,400	
日本アジア投資	9,800	271.00	2,655,800	
長野銀行	3,800	1,534.00	5,829,200	
名古屋銀行	9,100	3,465.00	31,531,500	
北洋銀行	209,300	316.00	66,138,800	
大光銀行	3,600	1,226.00	4,413,600	
愛媛銀行	18,600	959.00	17,837,400	
トマト銀行	4,100	1,103.00	4,522,300	
京葉銀行	64,100	643.00	41,216,300	
栃木銀行	63,200	338.00	21,361,600	
北日本銀行	4,800	2,178.00	10,454,400	
東和銀行	25,500	608.00	15,504,000	
福島銀行	13,100	262.00	3,432,200	
大東銀行	4,700	733.00	3,445,100	
リコーリース	13,000	4,105.00	53,365,000	

イオンフィナンシャルサービス	79,100	1,271.00	100,536,100
アコム	246,300	341.00	83,988,300
ジャックス	14,700	4,660.00	68,502,000
オリエントコーポレーション	36,000	1,182.00	42,552,000
オリックス	905,100	2,400.50	2,172,692,550
三菱HCキャピタル	537,200	730.00	392,156,000
ジャフコグループ	46,000	2,242.00	103,132,000
九州リースサービス	5,700	983.00	5,603,100
トモニホールディングス	111,800	391.00	43,713,800
大和証券グループ本社	985,900	650.00	640,835,000
野村ホールディングス	2,539,900	547.80	1,391,357,220
岡三証券グループ	121,400	427.00	51,837,800
丸三証券	45,800	441.00	20,197,800
東洋証券	45,700	348.00	15,903,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	149,900	380.00	56,962,000
光世証券	2,800	421.00	1,178,800
水戸証券	37,100	305.00	11,315,500
いちよし証券	25,200	640.00	16,128,000
松井証券	81,500	811.00	66,096,500
SOMPOホールディングス	236,600	5,844.00	1,382,690,400
日本取引所グループ	387,400	2,033.50	787,777,900
マネックスグループ	153,900	448.00	68,947,200
極東証券	17,200	626.00	10,767,200
岩井コスモホールディングス	15,700	1,376.00	21,603,200
アイザワ証券グループ	19,900	697.00	13,870,300
フィデアホールディングス	14,200	1,495.00	21,229,000
池田泉州ホールディングス	175,200	260.00	45,552,000
アニコムホールディングス	46,900	554.00	25,982,600
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	280,600	4,506.00	1,264,383,600
マネーパートナーズグループ	12,800	252.00	3,225,600
スパークス・グループ	15,400	1,585.00	24,409,000
小林洋行	2,900	237.00	687,300
第一生命ホールディングス	702,000	2,749.00	1,929,798,000
東京海上ホールディングス	1,388,400	2,881.00	3,999,980,400
アドバンテッジリスクマネジメント	5,800	458.00	2,656,400
イー・ギャランティ	22,300	2,152.00	47,989,600
アサックス	5,600	663.00	3,712,800
NECキャピタルソリューション	6,900	2,747.00	18,954,300
T&Dホールディングス	370,100	1,923.00	711,702,300
アドバンスクリエイト	8,000	1,129.00	9,032,000
三井不動産	599,200	2,613.00	1,565,709,600
三菱地所	831,900	1,665.00	1,385,113,500
平和不動産	22,400	3,815.00	85,456,000
東京建物	131,400	1,681.00	220,883,400
京阪神ビルディング	17,300	1,210.00	20,933,000
住友不動産	249,200	3,198.00	796,941,600
太平洋興発	4,500	920.00	4,140,000
テーオーシー	25,100	648.00	16,264,800

東京楽天地	2,500	4,200.00	10,500,000
レオパレス21	155,300	335.00	52,025,500
スターツコーポレーション	19,800	2,650.00	52,470,000
フジ住宅	19,300	693.00	13,374,900
空港施設	16,600	569.00	9,445,400
明和地所	6,300	925.00	5,827,500
ゴールドクレスト	13,100	1,734.00	22,715,400
リログループ	80,100	2,176.00	174,297,600
エスリード	6,600	2,265.00	14,949,000
日神グループホールディングス	22,300	484.00	10,793,200
日本エスコン	31,100	864.00	26,870,400
MIRARTHホールディングス	69,400	385.00	26,719,000
AVANTIA	6,100	808.00	4,928,800
イオンモール	71,500	1,778.00	127,127,000
毎日コムネット	4,600	786.00	3,615,600
ファースト住建	5,100	1,122.00	5,722,200
ランド	831,600	9.00	7,484,400
カチタス	37,000	2,681.00	99,197,000
東祥	10,100	1,187.00	11,988,700
トーセイ	22,900	1,477.00	33,823,300
穴吹興産	2,500	2,242.00	5,605,000
サンフロンティア不動産	23,000	1,278.00	29,394,000
FJネクストホールディングス	14,500	1,021.00	14,804,500
インテリックス	3,200	556.00	1,779,200
ランドビジネス	4,500	236.00	1,062,000
サンネクスタグループ	3,700	994.00	3,677,800
グランディハウス	10,400	606.00	6,302,400
東武鉄道	153,800	3,060.00	470,628,000
相鉄ホールディングス	46,300	2,262.00	104,730,600
東急	392,500	1,733.00	680,202,500
京浜急行電鉄	158,800	1,271.00	201,834,800
小田急電鉄	212,200	1,617.00	343,127,400
京王電鉄	74,000	4,750.00	351,500,000
京成電鉄	90,300	4,015.00	362,554,500
富士急行	17,200	4,330.00	74,476,000
東日本旅客鉄道	237,500	7,261.00	1,724,487,500
西日本旅客鉄道	178,800	5,405.00	966,414,000
東海旅客鉄道	107,900	15,515.00	1,674,068,500
西武ホールディングス	169,300	1,339.00	226,692,700
鴻池運輸	23,900	1,511.00	36,112,900
西日本鉄道	37,300	2,416.00	90,116,800
ハマキョウレックス	11,000	3,250.00	35,750,000
サカイ引越センター	6,700	4,590.00	30,753,000
近鉄グループホールディングス	139,800	4,255.00	594,849,000
阪急阪神ホールディングス	186,300	3,930.00	732,159,000
南海電気鉄道	66,800	2,902.00	193,853,600
京阪ホールディングス	57,700	3,470.00	200,219,000
神戸電鉄	3,800	3,210.00	12,198,000
名古屋鉄道	154,500	2,047.00	316,261,500
山陽電気鉄道	10,600	2,238.00	23,722,800

アルプス物流	11,200	1,286.00	14,403,200
トランコム	4,000	7,090.00	28,360,000
ヤマトホールディングス	179,000	2,301.00	411,879,000
山九	35,600	5,060.00	180,136,000
日新	10,600	2,204.00	23,362,400
丸運	6,700	231.00	1,547,700
丸全昭和運輸	8,700	3,240.00	28,188,000
センコーグループホールディングス	74,000	977.00	72,298,000
トナミホールディングス	2,600	4,040.00	10,504,000
ニッコンホールディングス	44,800	2,595.00	116,256,000
日本石油輸送	800	2,362.00	1,889,600
福山通運	10,700	3,565.00	38,145,500
セイノーホールディングス	87,100	1,455.00	126,730,500
エスライン	3,800	846.00	3,214,800
神奈川中央交通	4,000	3,320.00	13,280,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	33,700	1,913.00	64,468,100
C & F ロジホールディングス	13,500	1,243.00	16,780,500
日本郵船	373,900	3,395.00	1,269,390,500
商船三井	246,300	3,520.00	866,976,000
川崎汽船	119,100	3,350.00	398,985,000
N S ユナイテッド海運	7,500	4,635.00	34,762,500
明治海運	12,100	694.00	8,397,400
飯野海運	51,300	1,131.00	58,020,300
共栄タンカー	2,300	990.00	2,277,000
九州旅客鉄道	98,800	3,015.00	297,882,000
S Gホールディングス	268,300	1,929.00	517,550,700
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	52,200	7,880.00	411,336,000
日本航空	343,400	2,600.00	892,840,000
A N Aホールディングス	380,300	2,793.00	1,062,177,900
ビーウィズ	2,800	1,660.00	4,648,000
パスコ	2,600	1,410.00	3,666,000
T R Eホールディングス	30,300	1,535.00	46,510,500
人・夢・技術グループ	6,500	1,522.00	9,893,000
西本W i s m e t t a cホールディングス	3,700	3,685.00	13,634,500
シルバーライフ	3,400	1,820.00	6,188,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,806.00	1,806,000
Genky Drug Stores	6,500	4,005.00	26,032,500
コア商事ホールディングス	8,400	693.00	5,821,200
K P Pグループホールディングス	34,500	708.00	24,426,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,200	920.00	2,024,000
ブックオフグループホールディングス	8,600	1,277.00	10,982,200
ギフトホールディングス	3,200	4,445.00	14,224,000
三菱倉庫	30,000	3,270.00	98,100,000
三井倉庫ホールディングス	13,000	4,005.00	52,065,000
住友倉庫	38,500	2,265.00	87,202,500
澁澤倉庫	5,600	2,237.00	12,527,200
ヤマタネ	6,600	1,719.00	11,345,400
東陽倉庫	16,800	299.00	5,023,200

乾汽船	17,700	2,146.00	37,984,200
日本トランスシティ	28,300	600.00	16,980,000
ケイヒン	2,300	1,650.00	3,795,000
中央倉庫	6,900	1,119.00	7,721,100
川西倉庫	2,200	1,045.00	2,299,000
安田倉庫	9,700	1,032.00	10,010,400
ファイズホールディングス	2,400	1,272.00	3,052,800
大栄環境	27,400	1,855.00	50,827,000
東洋埠頭	3,600	1,403.00	5,050,800
上組	67,000	2,847.00	190,749,000
サンリツ	2,900	768.00	2,227,200
キムラユニティー	6,100	1,057.00	6,447,700
キューソー流通システム	7,500	963.00	7,222,500
東海運	7,700	297.00	2,286,900
エーアイティー	8,800	1,647.00	14,493,600
内外トランスライン	5,100	2,255.00	11,500,500
ショーエイコーポレーション	3,900	571.00	2,226,900
日本コンセプト	4,300	1,572.00	6,759,600
TBSホールディングス	72,000	1,955.00	140,760,000
日本テレビホールディングス	124,400	1,190.00	148,036,000
朝日放送グループホールディングス	13,300	688.00	9,150,400
テレビ朝日ホールディングス	34,200	1,571.00	53,728,200
スカパーJSAATHホールディングス	124,400	531.00	66,056,400
テレビ東京ホールディングス	10,100	2,425.00	24,492,500
日本BS放送	4,500	928.00	4,176,000
ビジョン	18,600	1,608.00	29,908,800
スマートバリュー	3,100	456.00	1,413,600
USEN-NEXT HOLDINGS	12,600	2,511.00	31,638,600
ワイヤレスゲート	5,600	262.00	1,467,200
日本通信	129,400	252.00	32,608,800
クロップス	2,200	1,232.00	2,710,400
日本電信電話	1,799,300	3,986.00	7,172,009,800
KDDI	1,085,100	4,113.00	4,463,016,300
ソフトバンク	2,255,500	1,547.00	3,489,258,500
光通信	16,500	19,680.00	324,720,000
エムティーアイ	12,800	575.00	7,360,000
GMOインターネットグループ	52,200	2,575.00	134,415,000
ファイバーゲート	7,500	912.00	6,840,000
アйдママーケティングコミュニケーション	3,200	287.00	918,400
KADOKAWA	74,100	2,746.00	203,478,600
学研ホールディングス	23,400	864.00	20,217,600
ゼンリン	23,900	851.00	20,338,900
昭文社ホールディングス	5,700	309.00	1,761,300
インプレスホールディングス	11,100	207.00	2,297,700
東京電力ホールディングス	1,262,100	468.00	590,662,800
中部電力	516,000	1,456.00	751,296,000
関西電力	540,600	1,307.00	706,564,200
中国電力	223,000	694.00	154,762,000

北陸電力	132,000	606.00	79,992,000
東北電力	342,200	675.00	230,985,000
四国電力	119,500	756.00	90,342,000
九州電力	323,100	752.00	242,971,200
北海道電力	135,100	490.00	66,199,000
沖縄電力	32,700	1,067.00	34,890,900
電源開発	105,400	2,220.00	233,988,000
エフオン	9,100	628.00	5,714,800
イーレックス	24,900	1,895.00	47,185,500
レノバ	37,200	2,106.00	78,343,200
東京瓦斯	296,000	2,560.00	757,760,000
大阪瓦斯	283,700	2,233.00	633,502,100
東邦瓦斯	55,200	2,545.00	140,484,000
北海道瓦斯	8,400	1,907.00	16,018,800
広島ガス	29,500	350.00	10,325,000
西部ガスホールディングス	13,100	1,819.00	23,828,900
静岡ガス	32,000	1,156.00	36,992,000
メタウォーター	17,400	1,731.00	30,119,400
アイネット	8,600	1,286.00	11,059,600
松竹	8,000	11,410.00	91,280,000
東宝	87,900	4,940.00	434,226,000
エイチ・アイ・エス	37,600	1,995.00	75,012,000
東映	3,900	17,950.00	70,005,000
ラックランド	4,500	2,926.00	13,167,000
エヌ・ティ・ティ・データ	440,600	1,787.00	787,352,200
共立メンテナンス	24,600	5,490.00	135,054,000
イチネンホールディングス	15,400	1,333.00	20,528,200
建設技術研究所	7,400	3,580.00	26,492,000
スペース	10,300	904.00	9,311,200
アインホールディングス	20,400	5,690.00	116,076,000
燦ホールディングス	6,200	2,128.00	13,193,600
ピー・シー・エー	8,000	1,278.00	10,224,000
スバル興業	600	9,410.00	5,646,000
東京テアトル	4,700	1,131.00	5,315,700
タナベコンサルティンググループ	5,100	896.00	4,569,600
ビジネスブレイン太田昭和	6,100	2,104.00	12,834,400
ナガワ	3,800	7,650.00	29,070,000
東京都競馬	12,100	3,680.00	44,528,000
常磐興産	4,400	1,263.00	5,557,200
カナモト	26,400	2,272.00	59,980,800
D T S	29,800	3,300.00	98,340,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	70,600	6,290.00	444,074,000
シーイーシー	19,700	1,532.00	30,180,400
カブコン	139,500	4,395.00	613,102,500
西尾レントオール	13,300	3,235.00	43,025,500
アイ・エス・ビー	7,200	1,227.00	8,834,400
アゴーラ ホスピタリティグループ	72,000	26.00	1,872,000
日本空港ビルデング	48,800	6,580.00	321,104,000

トランス・コスモス	17,800	3,350.00	59,630,000
乃村工藝社	62,800	908.00	57,022,400
ジャステック	8,600	1,280.00	11,008,000
S C S K	114,600	1,966.00	225,303,600
藤田観光	6,400	3,340.00	21,376,000
K N T - C Tホールディングス	8,600	1,725.00	14,835,000
日本管財	15,200	2,615.00	39,748,000
トーカイ	12,800	2,001.00	25,612,800
白洋舎	1,100	1,629.00	1,791,900
セコム	146,600	8,031.00	1,177,344,600
N S W	5,500	2,197.00	12,083,500
セントラル警備保障	7,700	2,663.00	20,505,100
アイネス	9,700	1,421.00	13,783,700
丹青社	27,700	746.00	20,664,200
メイテック	57,300	2,459.00	140,900,700
T K C	25,200	3,760.00	94,752,000
富士ソフト	15,900	8,330.00	132,447,000
応用地質	13,400	2,246.00	30,096,400
船井総研ホールディングス	30,300	2,855.00	86,506,500
N S D	50,000	2,481.00	124,050,000
進学会ホールディングス	4,300	312.00	1,341,600
丸紅建材リース	800	1,999.00	1,599,200
オオバ	8,100	745.00	6,034,500
コナミグループ	60,100	6,310.00	379,231,000
いであ	2,900	1,580.00	4,582,000
学究社	5,700	2,000.00	11,400,000
ベネッセホールディングス	53,600	2,026.00	108,593,600
イオンディライト	15,900	3,070.00	48,813,000
ナック	6,700	972.00	6,512,400
福井コンピュータホールディングス	9,700	2,745.00	26,626,500
ダイセキ	29,400	4,105.00	120,687,000
ステップ	5,900	1,889.00	11,145,100
日鉄物産	10,200	9,240.00	94,248,000
泉州電業	7,400	3,420.00	25,308,000
元気寿司	4,200	3,075.00	12,915,000
トラスコ中山	31,100	2,198.00	68,357,800
ヤマダホールディングス	607,600	489.00	297,116,400
オートバックスセブン	51,500	1,486.00	76,529,000
モリト	10,700	1,045.00	11,181,500
アーケランズ	21,700	1,486.00	32,246,200
ニトリホールディングス	59,900	15,545.00	931,145,500
グルメ杵屋	12,100	1,031.00	12,475,100
愛眼	7,800	172.00	1,341,600
ケーユーホールディングス	8,700	1,551.00	13,493,700
吉野家ホールディングス	57,800	2,381.00	137,621,800
加藤産業	17,900	3,560.00	63,724,000
北恵	3,000	721.00	2,163,000
イノテック	9,300	1,419.00	13,196,700
イエローハット	26,200	1,833.00	48,024,600
松屋フーズホールディングス	7,000	4,135.00	28,945,000



J B C Cホールディングス	10,200	2,147.00	21,899,400	
J Kホールディングス	11,700	1,148.00	13,431,600	
サガミホールディングス	23,800	1,307.00	31,106,600	
日伝	8,800	2,003.00	17,626,400	
関西フードマーケット	13,300	1,481.00	19,697,300	
ミロク情報サービス	12,800	1,767.00	22,617,600	
北沢産業	7,300	318.00	2,321,400	
杉本商事	6,400	2,059.00	13,177,600	
因幡電機産業	38,400	2,958.00	113,587,200	
王将フードサービス	9,700	6,120.00	59,364,000	
ミニストップ	10,700	1,398.00	14,958,600	
アークス	27,200	2,237.00	60,846,400	
パローホールディングス	28,300	2,038.00	57,675,400	
東テク	5,000	4,570.00	22,850,000	
ミスミグループ本社	223,500	3,330.00	744,255,000	
アルテック	7,300	308.00	2,248,400	
ベルク	7,400	5,580.00	41,292,000	
大 庄	7,100	1,031.00	7,320,100	
タキヒヨー	3,200	1,011.00	3,235,200	
ファーストリテイリング	66,800	28,735.00	1,919,498,000	
ソフトバンクグループ	811,800	5,343.00	4,337,447,400	
蔵王産業	2,300	2,099.00	4,827,700	
スズケン	46,000	3,520.00	161,920,000	
サンドラッグ	56,200	3,570.00	200,634,000	
サックスパー ホールディングス	14,100	813.00	11,463,300	
ジェコス	9,600	919.00	8,822,400	
ヤマザワ	2,400	1,282.00	3,076,800	
やまや	2,900	2,655.00	7,699,500	
グローセル	15,800	432.00	6,825,600	
ペルーナ	34,700	721.00	25,018,700	
合計	163,884,640		408,705,460,470	

## ( 2 ) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

- ( 1 ) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- ( 2 ) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期中間計算期間(2023年3月11日から2023年9月10日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## 【MHAM TOPIXオープン】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第25期 2023年3月10日現在	第26期中間計算期間末 2023年9月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	3,361,767
コール・ローン	41,782,246	62,299,772
親投資信託受益証券	8,937,978,471	10,349,760,854
未収入金	165,530,000	10,572,000
流動資産合計	9,145,290,717	10,425,994,393
資産合計	9,145,290,717	10,425,994,393
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	164,724,708	-
未払解約金	13,088,657	40,142,550
未払受託者報酬	2,854,028	3,207,958
未払委託者報酬	25,686,483	28,871,958
未払利息	-	274
その他未払費用	67,456	75,822
流動負債合計	206,421,332	72,298,562
負債合計	206,421,332	72,298,562
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,588,988,344	6,503,082,599
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	2,349,881,041	3,850,613,232
(分配準備積立金)	2,165,683,764	1,971,567,364
元本等合計	8,938,869,385	10,353,695,831
純資産合計	8,938,869,385	10,353,695,831
負債純資産合計	9,145,290,717	10,425,994,393

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第25期中間計算期間 自 2022年3月11日 至 2022年9月10日	第26期中間計算期間 自 2023年3月11日 至 2023年9月10日
<b>営業収益</b>		
受取利息	98	271
有価証券売買等損益	725,626,274	1,591,249,383
その他収益	6	-
<b>営業収益合計</b>	<b>725,626,378</b>	<b>1,591,249,654</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	3,231	9,956
受託者報酬	2,846,652	3,207,958
委託者報酬	25,620,197	28,871,958
その他費用	67,280	75,822
<b>営業費用合計</b>	<b>28,537,360</b>	<b>32,165,694</b>
営業利益又は営業損失（ ）	697,089,018	1,559,083,960
経常利益又は経常損失（ ）	697,089,018	1,559,083,960
中間純利益又は中間純損失（ ）	697,089,018	1,559,083,960
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	34,300,060	73,747,128
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,454,470,814	2,349,881,041
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>127,502,822</b>	<b>237,662,658</b>
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	127,502,822	237,662,658
剰余金減少額又は欠損金増加額	110,624,792	222,267,299
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	110,624,792	222,267,299
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
<b>分配金</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	<b>2,134,137,802</b>	<b>3,850,613,232</b>

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第26期中間計算期間	
	自	至
	2023年3月11日	2023年9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第25期	第26期中間計算期間末
	2023年3月10日現在	2023年9月10日現在
1. 期首元本額	6,628,786,151円	6,588,988,344円
期中追加設定元本額	866,476,295円	533,869,834円
期中一部解約元本額	906,274,102円	619,775,579円
2. 受益権の総数	6,588,988,344口	6,503,082,599口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第25期	第26期中間計算期間末
	2023年3月10日現在	2023年9月10日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第25期 2023年3月10日現在	第26期中間計算期間末 2023年9月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3566円 (13,566円)	1.5921円 (15,921円)

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

2023年9月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,630,603,139
株式	460,362,623,126
未収配当金	228,938,821
差入委託証拠金	420,360,000
流動資産合計	471,642,525,086
資産合計	471,642,525,086
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	44,044,870
前受金	65,540,000
未払金	1,698,580
未払解約金	570,131,000
未払利息	47,036
流動負債合計	681,461,486
負債合計	681,461,486
純資産の部	
元本等	
元本	115,656,086,063
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	355,304,977,537
元本等合計	470,961,063,600
純資産合計	470,961,063,600
負債純資産合計	471,642,525,086

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年3月11日 至 2023年9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年9月10日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	120,435,149,015円
同期中追加設定元本額	26,185,063,027円
同期中一部解約元本額	30,964,125,979円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOPIXオープン	2,541,627,380円
たわらノーロード 国内株式<ラップ専用>	2,785,474,676円
One DC 国内株式インデックスファンド	28,106,009,947円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,379,439,774円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,401,759円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	8,675,835円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	19,608,862円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	20,126,491円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	26,459,823円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,566,898円
たわらノーロード TOPIX	1,938,333,935円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,610,631,079円
たわらノーロード バランス(堅実型)	49,582,882円
たわらノーロード バランス(標準型)	359,966,995円
たわらノーロード バランス(積極型)	587,942,377円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	2,890,274円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	165,996,074円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	438,710,975円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	356,981,717円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	507,422,204円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	375,209円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,588,321円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	33,044,687円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,879,428円



たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,907,312円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,174,347,014円
Oneグローバルバランス	29,688,078円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	970,572,270円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,463,407,254円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,895,417,294円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	303,426,793円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,010,283,473円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,102,660,299円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,264,986円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,079,733,764円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	14,869,106円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	298,347,123円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	339,930,552円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	562,866,311円
投資のソムリエ	6,971,174,391円
クルーズコントロール	431,973,592円
投資のソムリエ<DC年金>	599,475,973円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	339,816,213円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	998,628,071円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	502,349,134円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,849,445,219円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	78,205,166円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	39,494,328円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,853,561円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	78,730,005円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	496,824,659円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,047,416,295円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	240,156,923円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	83,991,108円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	42,506,678円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	26,205,565円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	453,978,085円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	5,920,237円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	1,784,652円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	41,655,537円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	42,339,295円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	43,552,147円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	29,260,453円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	26,577,244円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	41,979,372円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	107,343,764円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	175,669,633円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	37,922,129円

マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2022-05(適格機関投資家限定)	147,094,024円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(日米資産投資・シグナルヘッジ付き)2022-10(適格機関投資家限定)	456,228,866円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	197,370,553円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	28,812,522円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	25,143,740円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	48,116,712円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	71,036,027円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	2,865,545円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	39,164,844円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	79,335,907円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,770,318円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	12,357,660円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,645,651円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	84,131円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	1,629,549円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	19,406,561円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	332,530,686円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	445,512,789円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,336,732,904円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	11,539,890円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	17,410,915円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	174,002,343円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	31,696,961円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	58,117円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	202,013,902円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	11,847,826円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	43,572,616円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	100,796,171円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	146,776,983円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	19,212,758円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	12,970,887円
動的パッケージファンド<DC年金>	29,113,810円
コア資産形成ファンド	17,444,372円
MHAMトピックスファンド	776,130,123円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	45,247,938円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	3,482,341,044円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,961,446,126円
計	115,656,086,063円
2. 受益権の総数	115,656,086,063口

(金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年9月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	2023年9月10日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	10,318,695,000	-	10,274,795,000	43,900,000
合計	10,318,695,000	-	10,274,795,000	43,900,000

## (注)時価の算定方法

## 株価指数先物取引

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

## (1口当たり情報に関する注記)

	2023年9月10日現在
1口当たり純資産額	4.0721円
(1万口当たり純資産額)	(40,721円)

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2023年9月29日現在

資産総額	10,171,118,803円
負債総額	16,662,879円
純資産総額( - )	10,154,455,924円
発行済数量	6,420,650,351口
1口当たり純資産額( / )	1.5815円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2023年9月29日現在

資産総額	471,873,662,022円
負債総額	20,381,140,236円
純資産総額( - )	451,492,521,786円
発行済数量	111,579,546,421口
1口当たり純資産額( / )	4.0464円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2)受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

### (5)受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6)受益権の再分割

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

### (7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額(2023年9月29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9月29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9月29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	1,544,789,412,081
追加型株式投資信託	783	15,033,053,378,536
単位型公社債投資信託	22	35,513,957,684
単位型株式投資信託	208	1,081,077,305,598
合計	1,039	17,694,434,053,899



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

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

#### （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

#### （3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

#### （4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

## 第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
<b>合計</b>	<b>126,879百万円</b>	<b>113,962百万円</b>

（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

委託会社の関連会社であるPayPayアセットマネジメント株式会社に対する出資比率が、2023年10月6日付で49.9%から23.4%に引き下がりました。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1)受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（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通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行（ 1 ）	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社青森銀行（ 1 ）	19,562	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社みちのく銀行（ 1 ）	36,986	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東邦銀行	23,519	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北陸銀行	140,409	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社大垣共立銀行	46,773	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社広島銀行	54,573	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社西日本シティ銀行	85,745	日本において銀行業務を営んでおります。
みずほ信託銀行株式会社（ 1 ）	247,369	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。
株式会社名古屋銀行	25,090	日本において銀行業務を営んでおります。
a uカブコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社S B I証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
OKB証券株式会社（ 1 ）	1,500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	（ 2 ）19,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
S M B C日興証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
松井証券株式会社	11,945	「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。
丸國證券株式会社	601	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は2023年3月末日現在

（注）確定拠出年金向けの取扱販売会社を含みます。

- ( 1) 新規の取得のお申込みのお取扱いを行っていません。
- ( 2) 2022年12月31日現在

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託会社

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

### (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

## 第3【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・使用する場合があります。

## 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5月12日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

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

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMHAM TOPIXオープンの2022年3月11日から2023年3月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、MHAM TOPIXオープンの2023年3月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。



## 独立監査人の中間監査報告書

2023年11月10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 森重俊寛  
業務執行社員

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMHAM TOPIXオープンの2023年3月1日から2023年9月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、MHAM TOPIXオープンの2023年9月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年3月1日から2023年9月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監

査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。