

## 【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】	2024年6月11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】

2024年6月12日から2024年12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  債券  不動産投信	インデックス型
	海外  内外	その他資産 ( )  資産複合	特殊型

(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 ) 年12回 ( 毎月 )	北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 ( 中東 ) エマージング	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 )	日々 その他		対象インデックス
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型	( )		日経225 TOPIX その他 ( )

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## ・属性区分定義

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

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

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

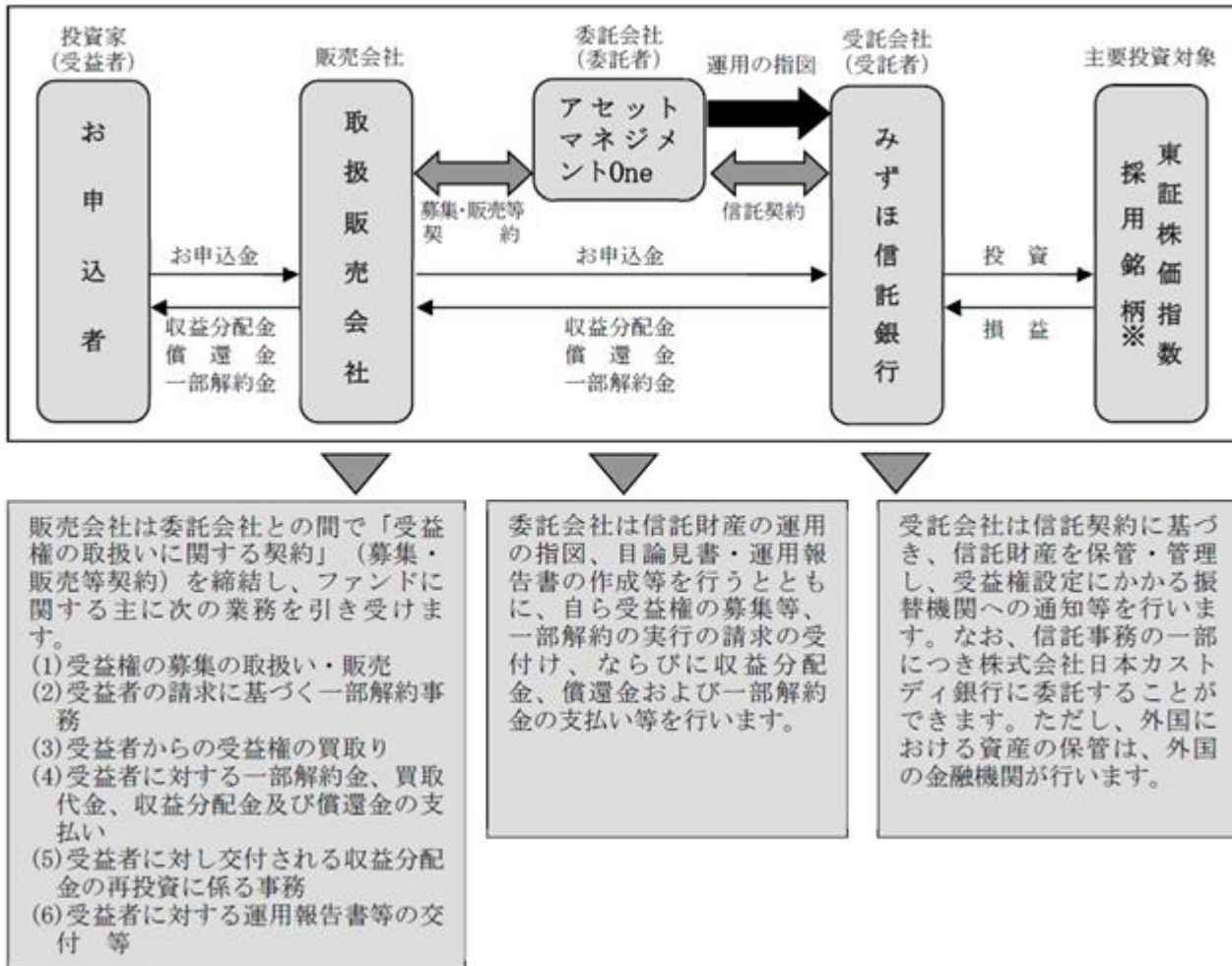
## （2）【ファンドの沿革】

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（2024年3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

（2024年3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。

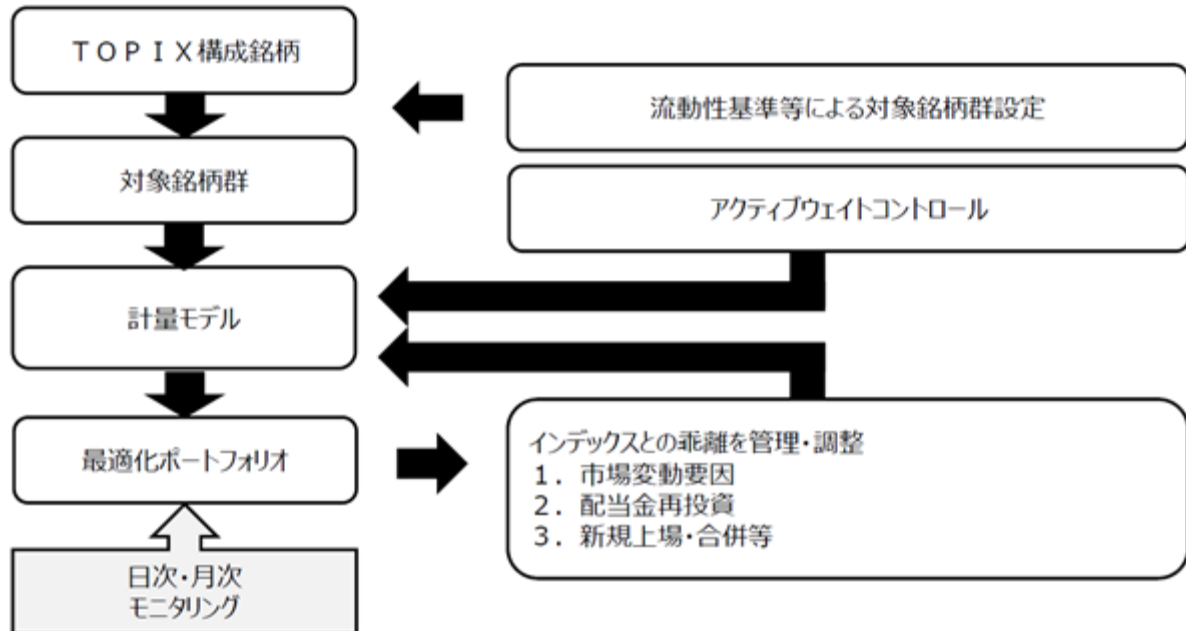
## 2. 投資態度

- 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

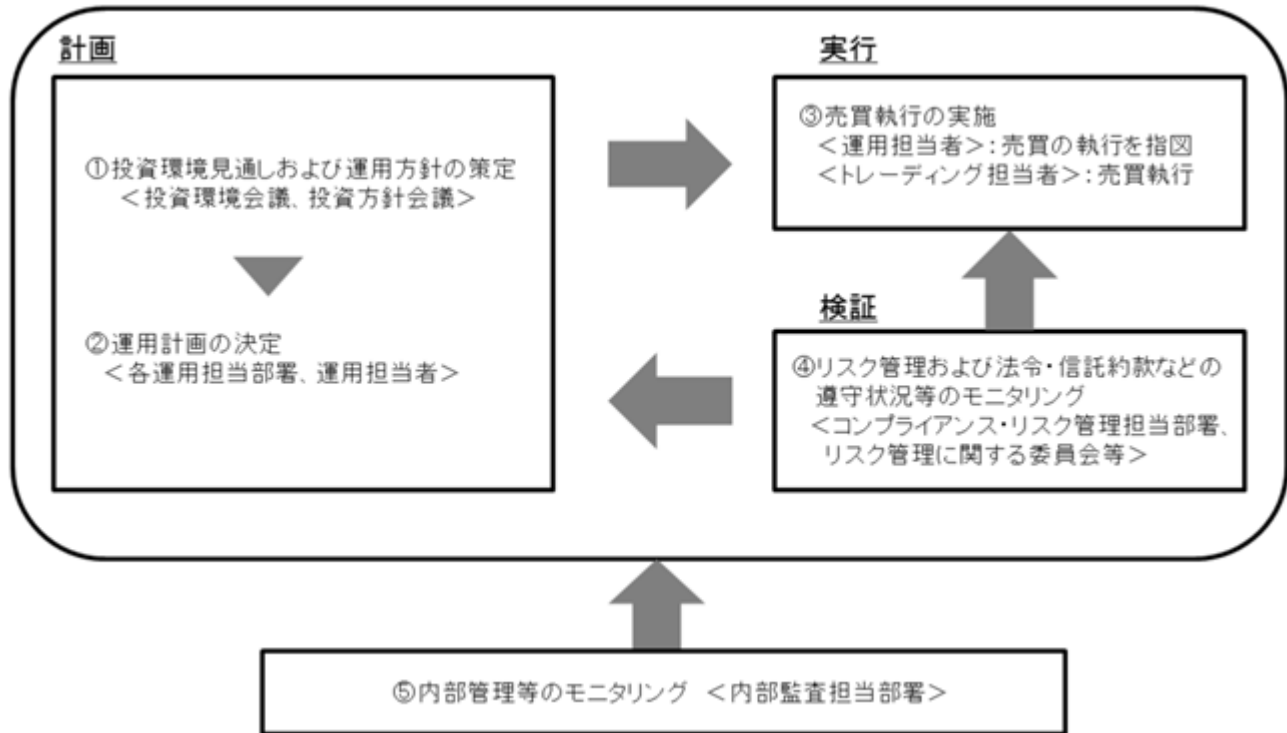
有価証券先物取引等を行うことができます。

## 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2024年3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があり、当ファンドの基準価額に大きな影響を及ぼすことがあります。

なお、当ファンドでは、株式と株価指数先物取引等の合計の組入比率を原則として高位に維持するため、株式市場の動向により基準価額は大きく変動します。また、当ファンドでは、追加設定・一部解約に伴う資金の流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が影響を受ける場合があります。
- ・当ファンドは、証券取引所における取引の停止等があるときには、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことがあります。
- ・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。

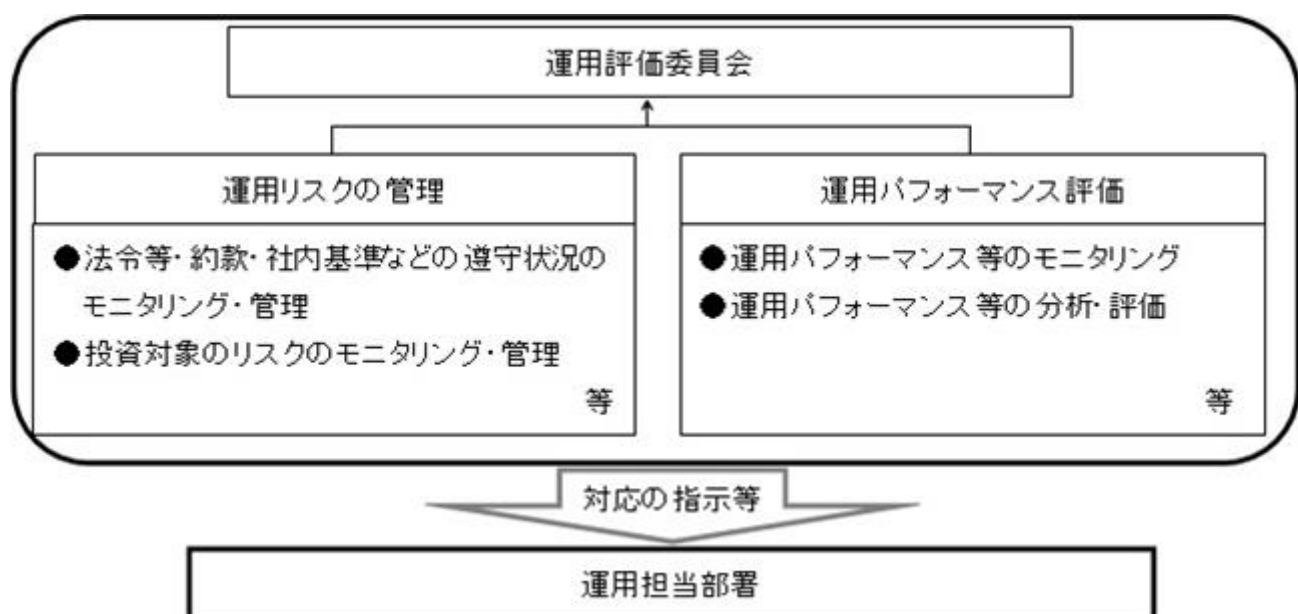
#### < 収益分配金に関する留意点 >

- ・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。

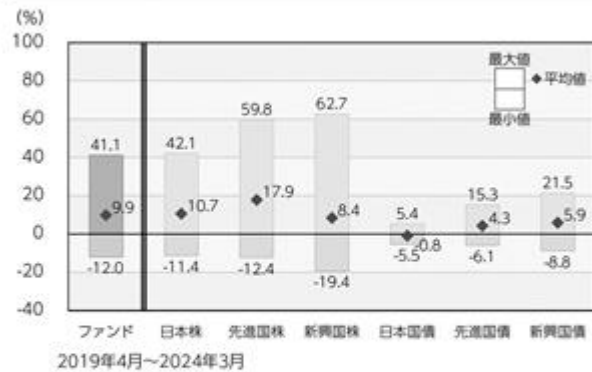
リスク管理体制は2024年3月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <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)」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、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し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、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。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、2024年3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:2023年3月11日～2024年3月11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】

2024年3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	11,822,282,056	99.98
内 日本	11,822,282,056	99.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,336,809	0.02
純資産総額	11,824,618,865	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

2024年3月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	567,037,867,660	97.64
内 日本	567,037,867,660	97.64
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	13,725,098,848	2.36
純資産総額	580,762,966,508	100.00

その他資産の投資状況

2024年3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）	14,071,600,000	2.42
内 日本	14,071,600,000	2.42

（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】

2024年3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	2,423,741,119	4.6551 11,282,863,871	4.8777 11,822,282,056	- -	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

2024年3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

2024年3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	7,955,700	3,260.00 25,935,582,000	3,792.00 30,168,014,400	- -	5.19
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,690,000	1,404.00 12,200,760,000	1,557.00 13,530,330,000	- -	2.33
3	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	1,024,900	14,300.00 14,656,070,000	12,985.00 13,308,326,500	- -	2.29
4	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	306,700	28,480.00 8,734,816,000	39,570.00 12,136,119,000	- -	2.09
5	三菱商事 日本	株式 卸売業	2,943,300	2,782.00 8,188,260,600	3,487.00 10,263,287,100	- -	1.77
6	キーエンス 日本	株式 電気機器	145,000	64,180.00 9,306,100,000	69,540.00 10,083,300,000	- -	1.74
7	日立製作所 日本	株式 電気機器	703,300	11,720.00 8,242,676,000	13,905.00 9,779,386,500	- -	1.68
8	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,014,600	7,687.00 7,799,230,200	8,909.00 9,039,071,400	- -	1.56
9	信越化学工業 日本	株式 化学	1,301,400	5,828.00 7,584,559,200	6,584.00 8,568,417,600	- -	1.48
10	三井物産 日本	株式 卸売業	1,148,100	5,840.00 6,704,904,000	7,106.00 8,158,398,600	- -	1.40
11	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	43,224,000	183.40 7,927,281,600	179.80 7,771,675,200	- -	1.34
12	任天堂 日本	株式 その他製品	914,700	8,369.00 7,655,124,300	8,196.00 7,496,881,200	- -	1.29
13	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,102,700	5,783.00 6,376,914,100	6,707.00 7,395,808,900	- -	1.27
14	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,030,500	6,736.00 6,941,448,000	6,466.00 6,663,213,000	- -	1.15
15	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,410,500	3,878.00 5,469,919,000	4,703.00 6,633,581,500	- -	1.14
16	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	3,433,200	1,710.50 5,872,488,600	1,891.00 6,492,181,200	- -	1.12
17	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	716,800	6,618.00 4,743,782,400	8,962.00 6,423,961,600	- -	1.11

18	第一三共 日本	株式 医薬品	1,265,900	4,512.00 5,711,740,800	4,777.00 6,047,204,300	- -	1.04
19	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,926,000	2,720.00 5,238,720,000	3,046.00 5,866,596,000	- -	1.01
20	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,286,000	4,219.00 5,425,634,000	4,184.00 5,380,624,000	- -	0.93
21	HOYA 日本	株式 精密機器	285,200	18,400.00 5,247,680,000	18,740.00 5,344,648,000	- -	0.92
22	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,122,900	4,599.00 5,164,217,100	4,482.00 5,032,837,800	- -	0.87
23	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,340,200	1,944.50 4,550,532,338	1,951.00 4,565,730,200	- -	0.79
24	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,628,700	2,015.00 3,281,830,500	2,512.00 4,091,294,400	- -	0.70
25	ディスコ 日本	株式 機械	70,500	42,850.00 3,020,925,000	57,190.00 4,031,895,000	- -	0.69
26	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	788,200	5,112.00 4,029,278,400	4,849.00 3,821,981,800	- -	0.66
27	村田製作所 日本	株式 電気機器	1,318,200	2,989.50 3,940,758,900	2,824.00 3,722,596,800	- -	0.64
28	SMC 日本	株式 機械	43,800	79,080.00 3,463,704,000	84,830.00 3,715,554,000	- -	0.64
29	三菱重工業 日本	株式 機械	2,559,000	1,036.00 2,651,124,000	1,448.50 3,706,711,500	- -	0.64
30	ダイキン工業 日本	株式 機械	174,700	21,165.00 3,697,525,500	20,600.00 3,598,820,000	- -	0.62

(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

2024年3月29日現在

種類	投資比率(%)
株式	97.64
合計	97.64

(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

2024年3月29日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	16.99
輸送用機器		9.28
卸売業		7.23
銀行業		7.23
情報・通信業		7.08
化学		5.58
機械		5.48
サービス業		4.33
医薬品		4.16

小売業	4.12
食料品	3.01
保険業	2.66
陸運業	2.44
その他製品	2.23
精密機器	2.16
不動産業	2.09
建設業	2.04
電気・ガス業	1.36
その他金融業	1.17
鉄鋼	0.92
証券、商品先物取引業	0.91
非鉄金属	0.69
海運業	0.68
ガラス・土石製品	0.67
ゴム製品	0.67
石油・石炭製品	0.51
金属製品	0.50
空運業	0.40
繊維製品	0.35
鉱業	0.33
パルプ・紙	0.16
倉庫・運輸関連業	0.13
水産・農林業	0.08
合計	97.64

（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

2024年3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 0606月	買建	508	13,732,791,640	14,071,600,000	2.42

（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（2024年3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
第26計算期間末 (2024年3月11日)	11,202	11,359	1.7894	1.8144
2023年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	-
10月末日	9,890	-	1.5333	-
11月末日	10,339	-	1.6154	-
12月末日	10,223	-	1.6111	-
2024年1月末日	10,947	-	1.7360	-
2月末日	11,471	-	1.8205	-
3月末日	11,824	-	1.8744	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
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
第26計算期間	0.0250

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
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
第26計算期間	33.7

（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】

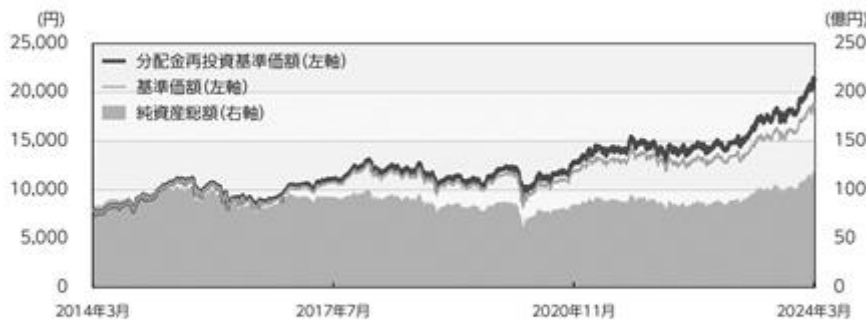
	設定口数	解約口数
第17計算期間	1,297,591,952	2,399,371,648
第18計算期間	1,764,811,465	2,076,291,110
第19計算期間	1,243,083,227	1,762,450,093
第20計算期間	1,277,274,100	2,299,730,471
第21計算期間	1,138,643,487	1,174,485,331
第22計算期間	1,083,065,008	1,646,604,346
第23計算期間	1,239,609,441	1,688,249,680
第24計算期間	1,042,960,494	1,294,065,701
第25計算期間	866,476,295	906,274,102
第26計算期間	951,775,933	1,280,435,563

（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:2024年3月29日

## 基準価額・純資産の推移 (2014年3月31日～2024年3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)

2020年 3月	180円
2021年 3月	150円
2022年 3月	190円
2023年 3月	250円
2024年 3月	250円
設定来累計	6,010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	97.64
内 日本	97.64
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.36
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)	2.42

## 株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	16.99
2	輸送用機器	9.28
3	卸売業	7.23
4	銀行業	7.23
5	情報・通信業	7.08

## 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	5.19
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.33
3	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.29
4	東京エレクトロン	株式	日本	電気機器	2.09
5	三菱商事	株式	日本	卸売業	1.77
6	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.74
7	日立製作所	株式	日本	電気機器	1.68
8	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.56
9	信越化学工業	株式	日本	化学	1.48
10	三井物産	株式	日本	卸売業	1.40

## 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。

※2024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（2024年11月5日より午後2時30分までとなる予定です。なお、申込締切時間は販売会社によって異なる場合があります。）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) 解約請求の受付けについては、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後2時まで（2024年11月5日より午後2時30分までとなる予定です。なお、申込締切時間は販売会社によって異なる場合があります。）に解約のお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付けにかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日分のお申込みとします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については、翌営業日のお取扱いとなります。
- (4) 解約の価額は、解約請求受付日の基準価額とします。詳しくは、販売会社または委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

- (5) 解約代金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、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けを中止すること、およびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことができます。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、前記（4）の規定に準じた価額とします。
- (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5億口を下回ることとなる場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。
  - a. この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その

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

- b. 前記 a. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一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るべき旨を請求することができます。なお、買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社の協議により決定するものとします。
2. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
  3. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、この信託は、「信託約款の変更4.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
  4. 受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 信託約款の変更

1. 委託会社は、信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更できるものとし、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26期計算期間(2023年3月11日から2024年3月11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25期 2023年3月10日現在	第26期 2024年3月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	41,782,246	87,643,296
親投資信託受益証券	8,937,978,471	11,200,659,647
未収入金	165,530,000	161,883,000
流動資産合計	9,145,290,717	11,450,185,943
資産合計	9,145,290,717	11,450,185,943
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	164,724,708	156,508,217
未払解約金	13,088,657	56,446,156
未払受託者報酬	2,854,028	3,462,473
未払委託者報酬	25,686,483	31,162,659
その他未払費用	67,456	81,864
流動負債合計	206,421,332	247,661,369
負債合計	206,421,332	247,661,369
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,588,988,344	6,260,328,714
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,349,881,041	4,942,195,860
（分配準備積立金）	2,165,683,764	4,325,859,231
元本等合計	8,938,869,385	11,202,524,574
純資産合計	8,938,869,385	11,202,524,574
負債純資産合計	9,145,290,717	11,450,185,943

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第25期		第26期	
	自	2022年3月11日 2023年3月10日	自	2023年3月11日 2024年3月11日
<b>営業収益</b>				
受取利息		206		327
有価証券売買等損益		1,139,961,667		3,039,712,176
その他収益		6		57,762
<b>営業収益合計</b>		<b>1,139,961,879</b>		<b>3,039,770,265</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		8,683		13,152
受託者報酬		5,700,680		6,670,431
委託者報酬		51,306,680		60,034,617
その他費用		134,736		159,463
<b>営業費用合計</b>		<b>57,150,779</b>		<b>66,877,663</b>
営業利益又は営業損失( )		1,082,811,100		2,972,892,602
経常利益又は経常損失( )		1,082,811,100		2,972,892,602
当期純利益又は当期純損失( )		1,082,811,100		2,972,892,602
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( )		74,760,753		267,910,943
期首剰余金又は期首欠損金( )		1,454,470,814		2,349,881,041
剰余金増加額又は欠損金減少額		254,311,036		511,377,037
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		254,311,036		511,377,037
剰余金減少額又は欠損金増加額		202,226,448		467,535,660
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		202,226,448		467,535,660
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		164,724,708		156,508,217
期末剰余金又は期末欠損金( )		2,349,881,041		4,942,195,860

## (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26期	
	自 2023年3月11日	至 2024年3月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年3月10日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を2024年3月11日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第25期	第26期
	2023年3月10日現在	2024年3月11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	951,775,933円
期中一部解約元本額	906,274,102円	1,280,435,563円
2. 受益権の総数	6,588,988,344口	6,260,328,714口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第25期	第26期
	自 2022年3月11日 至 2023年3月10日	自 2023年3月11日 至 2024年3月11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(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(224,637,109円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(2,480,344,550円)、信託約款に規定される収益調整金(3,822,281,733円)及び分配準備積立金(1,777,385,789円)より分配対象収益は8,304,649,181円(1万口当たり13,265.51円)であり、うち156,508,217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25期	第26期
	自 2022年3月11日 至 2023年3月10日	自 2023年3月11日 至 2024年3月11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25期 2023年3月10日現在	第26期 2024年3月11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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第25期 2023年3月10日現在	第26期 2024年3月11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	1,076,052,336	2,834,084,309
合計	1,076,052,336	2,834,084,309

（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25期 2023年3月10日現在	第26期 2024年3月11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)

#### （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

2024年3月11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	2,406,156,745	11,200,659,647	
親投資信託受益証券	合計	2,406,156,745	11,200,659,647	
合計			11,200,659,647	

（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)

2024年3月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,552,508,976
株式	552,430,865,410
未収入金	151,040,000
未収配当金	824,669,226
差入委託証拠金	188,366,470
流動資産合計	557,147,450,082
資産合計	557,147,450,082
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	72,110,210
前受金	17,225,000
未払金	7,079,240
未払解約金	621,208,000
流動負債合計	717,622,450
負債合計	717,622,450
純資産の部	
元本等	
元本	119,533,482,625
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	436,896,345,007
元本等合計	556,429,827,632
純資産合計	556,429,827,632
負債純資産合計	557,147,450,082



## 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 2024年3月11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	2024年3月11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	56,395,772,177円
同期中一部解約元本額	57,297,438,567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	2,406,156,745円
たわらノーロード 国内株式<ラップ専用>	3,798,908,883円
One DC 国内株式インデックスファンド	31,416,434,664円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,589,394,170円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,572,967円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	8,952,801円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	21,079,024円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	21,229,561円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	28,800,675円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	17,989,649円
たわらノーロード TOPIX	2,301,669,566円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,698,970,509円
たわらノーロード バランス(堅実型)	45,999,549円
たわらノーロード バランス(標準型)	343,637,106円
たわらノーロード バランス(積極型)	596,261,922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)	2,176,132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)	135,993,571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)	393,889,932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)	343,717,190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)	479,222,558円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	351,849円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,314,206円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	26,173,248円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,975,024円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,291,891円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,450,896,083円
Oneグローバルバランス	47,706,820円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	886,333,060円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,285,944,674円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,838,341,625円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	285,684,942円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	952,267,543円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,083,325,759円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,196,964円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,070,522,519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)	275,895,063円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	330,045,853円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	555,148,066円
投資のソムリエ	7,425,491,210円
クルーズコントロール	376,994,748円
投資のソムリエ<DC年金>	740,007,699円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	373,824,441円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,095,993,715円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	695,786,110円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,245,694,106円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	74,627,658円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	38,110,231円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	6,144,353円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	129,212,188円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	503,163,784円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	605,706,951円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	218,461,024円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	74,933,981円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	40,857,597円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	24,829,654円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	501,631,121円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	6,032,184円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	1,609,480円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	30,225,928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)	348,992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)	282,142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)	1,140,019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)	200,478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)	20,948,989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)	715,577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)	143,247,305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)	173,190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)	75,853,270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)	352,912,231円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01(適格機関投資家限定)	427,966円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	243,760,134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)	11,580,471円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	21,683,258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)	76,736,840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)	361,860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)	2,987,134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)	33,738,800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)	66,106,652円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,503,989円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	9,989,221円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,983,765円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	78,072円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	527,239円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	16,058,745円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	264,896,458円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	382,110,036円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,179,828,325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)	10,098,008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)	14,307,224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)	139,619,346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)	27,196,102円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	51,649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)	148,169,717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)	7,621,803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)	36,279,078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)	97,349,190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)	125,351,341円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	16,684,614円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	6,225,559円
動的パッケージファンド<DC年金>	25,746,688円
コア資産形成ファンド	13,022,014円
MHAMトピックスファンド	779,617,727円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	44,602,590円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	3,030,548,533円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,852,195,020円
計	119,533,482,625円

2. 受益権の総数

119,533,482,625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 2023年3月11日 至 2024年3月11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	2024年3月11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	2024年3月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	24,197,221,220
合計	24,197,221,220

(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(2024年2月8日から2024年3月11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	2024年3月11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	3,692,290,000	-	3,620,225,000	72,065,000
合計	3,692,290,000	-	3,620,225,000	72,065,000

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

- 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2024年3月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.6550円 (46,550円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年3月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	7,800	3,655.00	28,509,000	
ニッセイ	205,000	940.80	192,864,000	
マルハニチロ	30,400	2,835.00	86,184,000	
雪国まいたけ	17,500	1,000.00	17,500,000	
カネコ種苗	5,800	1,412.00	8,189,600	
サカタのタネ	23,300	3,655.00	85,161,500	
ホクト	16,400	1,925.00	31,570,000	
ホクリヨウ	1,500	1,102.00	1,653,000	
ショーボンドホールディングス	27,900	6,247.00	174,291,300	
ミライト・ワン	67,800	1,828.50	123,972,300	
タマホーム	12,900	4,130.00	53,277,000	
サンヨーホームズ	1,100	764.00	840,400	
日本アクア	3,800	979.00	3,720,200	
ファーストコーポレーション	2,600	788.00	2,048,800	
ベステラ	2,200	1,008.00	2,217,600	
Robot Home	39,900	159.00	6,344,100	

キャンディル	1,700	584.00	992,800
住石ホールディングス	23,200	3,470.00	80,504,000
日鉄鉱業	8,200	4,940.00	40,508,000
三井松島ホールディングス	12,100	3,045.00	36,844,500
I N P E X	688,400	2,059.50	1,417,759,800
石油資源開発	23,800	6,090.00	144,942,000
K & O エナジーグループ	9,300	2,461.00	22,887,300
ダイセキ環境ソリューション	1,800	960.00	1,728,000
第一カッター興業	5,900	1,511.00	8,914,900
明豊ファシリティワークス	3,300	881.00	2,907,300
安藤・間	118,700	1,205.00	143,033,500
東急建設	64,200	840.00	53,928,000
コムシスホールディングス	65,500	3,461.00	226,695,500
ビーアールホールディングス	30,100	373.00	11,227,300
高松コンストラクショングループ	15,200	2,854.00	43,380,800
東建コーポレーション	5,200	9,390.00	48,828,000
ソネック	1,000	935.00	935,000
ヤマウラ	10,400	1,537.00	15,984,800
オリエンタル白石	75,800	390.00	29,562,000
大成建設	134,200	5,359.00	719,177,800
大林組	512,800	1,757.00	900,989,600
清水建設	406,600	945.60	384,480,960
飛島建設	14,800	1,565.00	23,162,000
長谷工コーポレーション	131,600	1,818.00	239,248,800
松井建設	13,400	881.00	11,805,400
銭高組	1,000	4,285.00	4,285,000
鹿島建設	318,000	3,013.00	958,134,000
不動テトラ	9,900	2,169.00	21,473,100
大末建設	2,500	1,585.00	3,962,500
鉄建建設	10,300	2,531.00	26,069,300
西松建設	27,400	4,486.00	122,916,400
三井住友建設	106,600	434.00	46,264,400
大豊建設	4,900	3,400.00	16,660,000
佐田建設	4,100	729.00	2,988,900
ナカノフドー建設	4,500	655.00	2,947,500
奥村組	23,200	5,130.00	119,016,000
東鉄工業	17,800	3,010.00	53,578,000
イチケン	1,600	2,432.00	3,891,200
富士ピー・エス	2,900	453.00	1,313,700
浅沼組	10,600	4,270.00	45,262,000
戸田建設	194,100	999.20	193,944,720
熊谷組	23,700	4,050.00	95,985,000
北野建設	1,200	3,320.00	3,984,000
植木組	1,800	1,710.00	3,078,000
矢作建設工業	19,500	1,532.00	29,874,000
ピーエス三菱	18,200	1,054.00	19,182,800
日本ハウスホールディングス	30,500	313.00	9,546,500
大東建託	52,800	17,400.00	918,720,000
新日本建設	20,100	1,423.00	28,602,300
東亜道路工業	5,700	6,280.00	35,796,000

日本道路	16,800	1,991.00	33,448,800
東亜建設工業	11,100	4,970.00	55,167,000
日本国土開発	40,800	516.00	21,052,800
若築建設	5,000	3,250.00	16,250,000
東洋建設	36,100	1,377.00	49,709,700
五洋建設	203,300	782.20	159,021,260
世紀東急工業	18,400	1,881.00	34,610,400
福田組	5,400	5,440.00	29,376,000
日本ドライケミカル	1,600	2,619.00	4,190,400
住友林業	123,900	4,223.00	523,229,700
日本基礎技術	3,800	513.00	1,949,400
巴コーポレーション	8,100	652.00	5,281,200
大和ハウス工業	396,600	4,267.00	1,692,292,200
ライト工業	29,500	1,917.00	56,551,500
積水ハウス	434,900	3,321.00	1,444,302,900
日特建設	13,700	1,158.00	15,864,600
北陸電気工事	9,800	1,186.00	11,622,800
ユアテック	31,600	1,353.00	42,754,800
日本リーテック	11,200	1,296.00	14,515,200
四電工	6,000	3,950.00	23,700,000
中電工	22,300	2,971.00	66,253,300
関電工	89,900	1,737.00	156,156,300
きんでん	101,000	2,694.50	272,144,500
東京エネシス	14,300	1,199.00	17,145,700
トーエネック	4,700	5,260.00	24,722,000
住友電設	13,700	3,215.00	44,045,500
日本電設工業	26,900	1,987.00	53,450,300
エクシオグループ	70,100	3,197.00	224,109,700
新日本空調	9,300	2,881.00	26,793,300
九電工	31,000	5,999.00	185,969,000
三機工業	31,000	2,044.00	63,364,000
日揮ホールディングス	141,900	1,387.00	196,815,300
中外炉工業	4,700	2,930.00	13,771,000
ヤマト	5,300	969.00	5,135,700
太平電業	8,900	4,335.00	38,581,500
高砂熱学工業	38,400	4,415.00	169,536,000
三晃金属工業	900	4,980.00	4,482,000
N E C ネットズエスアイ	57,200	2,564.00	146,660,800
朝日工業社	6,700	3,270.00	21,909,000
明星工業	27,800	1,287.00	35,778,600
大気社	16,500	4,595.00	75,817,500
ダイダン	18,900	1,936.00	36,590,400
日比谷総合設備	10,400	2,697.00	28,048,800
ニッポン	43,100	2,342.00	100,940,200
日清製粉グループ本社	133,100	2,045.50	272,256,050
日東富士製粉	2,300	5,390.00	12,397,000
昭和産業	14,000	3,435.00	48,090,000
鳥越製粉	5,600	686.00	3,841,600
中部飼料	19,900	1,251.00	24,894,900
フィード・ワン	21,000	1,024.00	21,504,000

東洋精糖	1,200	2,507.00	3,008,400	
日本甜菜製糖	8,400	2,083.00	17,497,200	
D M三井製糖ホールディングス	14,300	3,310.00	47,333,000	
塩水港精糖	8,400	301.00	2,528,400	
ウェルネオシュガー	7,200	2,287.00	16,466,400	
L I F U L L	51,300	173.00	8,874,900	
M I X I	32,200	2,465.00	79,373,000	
ジェイエイシーリクルートメント	54,300	718.00	38,987,400	
日本M&Aセンターホールディングス	239,500	950.10	227,548,950	
メンバーズ	5,100	905.00	4,615,500	
中広	1,000	412.00	412,000	
U Tグループ	19,400	3,620.00	70,228,000	
アイティメディア	5,700	1,919.00	10,938,300	
ケアネット	23,100	694.00	16,031,400	
E・Jホールディングス	8,800	1,674.00	14,731,200	
オープンアップグループ	45,100	2,068.00	93,266,800	
コシダカホールディングス	45,000	914.00	41,130,000	
アルトナー	2,800	2,467.00	6,907,600	
パソナグループ	18,200	2,840.00	51,688,000	
C D S	1,700	1,706.00	2,900,200	
リンクアンドモチベーション	43,300	607.00	26,283,100	
エス・エム・エス	52,700	2,490.00	131,223,000	
サニーサイドアップグループ	2,300	688.00	1,582,400	
パーソルホールディングス	1,530,100	202.80	310,304,280	
リニカル	4,300	379.00	1,629,700	
クックパッド	41,100	123.00	5,055,300	
エスクリ	2,700	305.00	823,500	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	3,300	760.00	2,508,000	
森永製菓	61,600	2,593.50	159,759,600	
中村屋	3,500	3,070.00	10,745,000	
江崎グリコ	41,200	4,392.00	180,950,400	
名糖産業	5,700	1,850.00	10,545,000	
井村屋グループ	8,600	2,498.00	21,482,800	
不二家	9,900	2,447.00	24,225,300	
山崎製パン	96,400	3,897.00	375,670,800	
第一屋製パン	1,200	685.00	822,000	
モロゾフ	4,600	4,190.00	19,274,000	
亀田製菓	8,200	4,330.00	35,506,000	
寿スピリッツ	68,100	1,823.00	124,146,300	
カルビー	65,900	3,424.00	225,641,600	
森永乳業	50,300	3,179.00	159,903,700	
六甲バター	10,600	1,353.00	14,341,800	
ヤクルト本社	205,700	3,233.00	665,028,100	
明治ホールディングス	176,500	3,403.00	600,629,500	
雪印メグミルク	34,800	2,220.00	77,256,000	
プリマハム	19,300	2,280.00	44,004,000	
日本ハム	61,900	5,180.00	320,642,000	
林兼産業	2,200	557.00	1,225,400	
丸大食品	14,500	1,632.00	23,664,000	
S F o o d s	15,900	3,195.00	50,800,500	



柿安本店	5,600	2,665.00	14,924,000
伊藤ハム米久ホールディングス	22,000	4,150.00	91,300,000
学情	7,700	1,746.00	13,444,200
スタジオアリス	7,500	2,043.00	15,322,500
クロスキャット	9,300	1,739.00	16,172,700
エブコ	1,800	839.00	1,510,200
システナ	221,900	287.00	63,685,300
N J S	3,300	2,920.00	9,636,000
デジタルアーツ	9,300	4,360.00	40,548,000
日鉄ソリューションズ	25,000	4,950.00	123,750,000
総合警備保障	251,100	848.20	212,983,020
キューブシステム	7,800	1,089.00	8,494,200
いちご	165,900	405.00	67,189,500
日本駐車場開発	152,400	191.00	29,108,400
コア	6,500	1,900.00	12,350,000
カカクコム	99,300	1,748.50	173,626,050
アイロムグループ	6,100	1,823.00	11,120,300
セントケア・ホールディング	11,000	871.00	9,581,000
サイネックス	1,100	808.00	888,800
ルネサンス	11,700	1,046.00	12,238,200
ディップ	23,000	2,592.00	59,616,000
S B Sホールディングス	13,000	2,277.00	29,601,000
デジタルホールディングス	7,800	1,121.00	8,743,800
新日本科学	13,700	1,543.00	21,139,100
キャリアデザインセンター	1,400	1,698.00	2,377,200
ベネフィット・ワン	52,200	2,163.00	112,908,600
エムスリー	297,000	2,082.50	618,502,500
ツカダ・グローバルホールディング	4,300	401.00	1,724,300
プラス	700	663.00	464,100
アウトソーシング	96,500	1,747.00	168,585,500
ウェルネット	5,900	538.00	3,174,200
ワールドホールディングス	6,800	2,373.00	16,136,400
ディー・エヌ・エー	53,400	1,397.50	74,626,500
博報堂D Yホールディングス	191,700	1,359.00	260,520,300
ぐるなび	28,000	282.00	7,896,000
タカミヤ	20,400	568.00	11,587,200
ファンコミュニケーションズ	21,000	404.00	8,484,000
ライク	5,600	1,567.00	8,775,200
A o b a B B T	2,500	391.00	977,500
エスプール	43,200	317.00	13,694,400
W D Bホールディングス	7,700	2,266.00	17,448,200
手間いらず	2,500	2,940.00	7,350,000
ティア	3,900	454.00	1,770,600
C D G	800	1,232.00	985,600
アドウェイズ	20,700	447.00	9,252,900
パリュコマース	13,200	1,054.00	13,912,800
インフォマート	156,000	385.00	60,060,000
サッポロホールディングス	47,400	6,333.00	300,184,200
アサヒグループホールディングス	332,700	5,222.00	1,737,359,400
キリンホールディングス	599,700	2,048.50	1,228,485,450

宝ホールディングス	98,300	1,110.00	109,113,000	
オエノンホールディングス	43,000	340.00	14,620,000	
養命酒製造	4,800	1,876.00	9,004,800	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	112,800	2,244.50	253,179,600	
ライフドリンク カンパニー	2,100	4,315.00	9,061,500	
サントリー食品インターナショナル	101,400	4,833.00	490,066,200	
ダイドーグループホールディングス	16,300	2,768.00	45,118,400	
伊藤園	48,800	3,735.00	182,268,000	
キーコーヒー	16,100	2,036.00	32,779,600	
ユニカフェ	2,200	909.00	1,999,800	
ジャパンフーズ	1,000	1,465.00	1,465,000	
日清オイリオグループ	20,300	5,140.00	104,342,000	
不二製油グループ本社	33,500	2,345.50	78,574,250	
かどや製油	800	3,865.00	3,092,000	
J - オイルミルズ	16,500	1,988.00	32,802,000	
ローソン	32,900	10,300.00	338,870,000	
サンエー	11,800	4,590.00	54,162,000	
カワチ薬品	12,100	2,708.00	32,766,800	
エービーシー・マート	67,700	2,782.50	188,375,250	
ハードオフコーポレーション	5,500	1,685.00	9,267,500	
高千穂交易	4,900	3,765.00	18,448,500	
アスクル	37,300	1,995.00	74,413,500	
ゲオホールディングス	17,400	1,857.00	32,311,800	
アダストリア	18,700	3,785.00	70,779,500	
ジーフット	5,700	280.00	1,596,000	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	900	675.00	607,500	
オルパヘルスケアホールディングス	1,100	1,878.00	2,065,800	
伊藤忠食品	3,500	7,490.00	26,215,000	
くら寿司	18,100	4,320.00	78,192,000	
キャンドウ	5,500	2,717.00	14,943,500	
エレマテック	13,900	1,870.00	25,993,000	
IKホールディングス	2,300	375.00	862,500	
パルグループホールディングス	30,400	2,529.00	76,881,600	
エディオン	61,200	1,536.00	94,003,200	
あらた	23,700	3,230.00	76,551,000	
サーラコーポレーション	32,500	790.00	25,675,000	
ワッツ	3,300	648.00	2,138,400	
トーメンデバイス	2,200	5,630.00	12,386,000	
ハローズ	7,000	4,520.00	31,640,000	
J Pホールディングス	38,400	474.00	18,201,600	
フジオフードグループ本社	17,400	1,307.00	22,741,800	
あみやき亭	3,700	4,730.00	17,501,000	
東京エレクトロン デバイス	15,400	7,100.00	109,340,000	
ひらまつ	16,400	247.00	4,050,800	
円谷フィールズホールディングス	26,600	1,496.00	39,793,600	
双日	172,300	3,850.00	663,355,000	
アルフレッサ ホールディングス	155,300	2,186.50	339,563,450	
大黒天物産	4,800	9,510.00	45,648,000	
ハニーズホールディングス	13,700	1,697.00	23,248,900	

ファーマライズホールディングス	1,600	647.00	1,035,200	
キッコーマン	95,400	9,392.00	895,996,800	
味の素	342,100	5,478.00	1,874,023,800	
ブルドックソース	7,600	2,152.00	16,355,200	
キュービー	77,400	2,767.00	214,165,800	
ハウス食品グループ本社	49,600	3,077.00	152,619,200	
カゴメ	61,900	3,347.00	207,179,300	
焼津水産化学工業	2,800	1,343.00	3,760,400	
アリアケジャパン	14,400	5,310.00	76,464,000	
ピエトロ	900	1,826.00	1,643,400	
エバラ食品工業	3,400	2,982.00	10,138,800	
やまみ	900	3,555.00	3,199,500	
ニチレイ	66,000	3,972.00	262,152,000	
横浜冷凍	42,100	1,051.00	44,247,100	
東洋水産	72,800	8,564.00	623,459,200	
イートアンドホールディングス	6,800	2,022.00	13,749,600	
大冷	1,000	1,915.00	1,915,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,500	1,265.00	8,222,500	
日清食品ホールディングス	151,900	4,184.00	635,549,600	
永谷園ホールディングス	7,100	2,209.00	15,683,900	
一正蒲鉾	2,800	737.00	2,063,600	
フジッコ	14,800	1,925.00	28,490,000	
ロック・フィールド	17,600	1,579.00	27,790,400	
日本たばこ産業	874,800	3,824.00	3,345,235,200	
ケンコーマヨネーズ	9,900	2,025.00	20,047,500	
わらべや日洋ホールディングス	9,600	2,664.00	25,574,400	
なとり	9,100	2,117.00	19,264,700	
イフジ産業	1,200	1,485.00	1,782,000	
ファーマフーズ	20,700	958.00	19,830,600	
北の達人コーポレーション	61,700	200.00	12,340,000	
ユーグレナ	89,600	603.00	54,028,800	
紀文食品	12,500	1,239.00	15,487,500	
ピクルスホールディングス	8,400	1,155.00	9,702,000	
スター・マイカ・ホールディングス	16,700	542.00	9,051,400	
SREホールディングス	6,200	3,835.00	23,777,000	
ADワークスグループ	16,100	233.00	3,751,300	
片倉工業	13,500	1,771.00	23,908,500	
ゲンゼ	10,400	5,490.00	57,096,000	
ヒューリック	335,900	1,488.50	499,987,150	
神栄	1,000	1,640.00	1,640,000	
ラサ商事	6,300	1,965.00	12,379,500	
アルペン	12,700	1,955.00	24,828,500	
ハブ	2,200	722.00	1,588,400	
ラクーンホールディングス	10,900	588.00	6,409,200	
クオールホールディングス	21,300	1,678.00	35,741,400	
アルコニックス	20,400	1,415.00	28,866,000	
神戸物産	119,700	4,072.00	487,418,400	
ソリトンシステムズ	7,600	1,351.00	10,267,600	
ジンズホールディングス	9,200	4,305.00	39,606,000	
ビックカメラ	82,300	1,262.00	103,862,600	

DCMホールディングス	81,800	1,451.00	118,691,800
ペッパーフードサービス	35,800	120.00	4,296,000
ハイパー	1,600	303.00	484,800
MonotaRO	219,300	1,485.50	325,770,150
東京一番フーズ	1,700	522.00	887,400
DDグループ	4,400	1,190.00	5,236,000
あいホールディングス	24,800	2,261.00	56,072,800
ディーブイエックス	1,900	1,067.00	2,027,300
きちりホールディングス	1,800	900.00	1,620,000
J.フロントリテイリング	177,500	1,463.50	259,771,250
ドトール・日レスホールディングス	27,400	2,010.00	55,074,000
マツキヨココカラ&カンパニー	281,400	2,347.50	660,586,500
ブロンコビリー	9,100	3,395.00	30,894,500
ZOZO	98,600	3,676.00	362,453,600
トレジャー・ファクトリー	8,500	1,389.00	11,806,500
物語コーポレーション	25,800	4,455.00	114,939,000
三越伊勢丹ホールディングス	260,500	2,208.50	575,314,250
東洋紡	63,300	1,112.00	70,389,600
ユニチカ	47,300	169.00	7,993,700
富士紡ホールディングス	6,400	4,420.00	28,288,000
日清紡ホールディングス	111,000	1,183.00	131,313,000
倉敷紡績	10,400	3,270.00	34,008,000
ダイワボウホールディングス	68,500	2,503.50	171,489,750
シキボウ	7,700	1,214.00	9,347,800
日東紡績	18,600	5,440.00	101,184,000
トヨタ紡織	61,600	2,294.50	141,341,200
マクニカホールディングス	36,600	7,591.00	277,830,600
Hamee	6,200	1,118.00	6,931,600
マーケットエンタープライズ	600	820.00	492,000
ラクト・ジャパン	6,000	2,396.00	14,376,000
ウエルシアホールディングス	80,200	2,684.00	215,256,800
クリエイトSDホールディングス	21,900	3,240.00	70,956,000
グリムス	6,500	2,135.00	13,877,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	23,400	1,215.00	28,431,000
八洲電機	12,500	1,572.00	19,650,000
メディアスホールディングス	9,000	735.00	6,615,000
レスターホールディングス	13,200	2,888.00	38,121,600
ジオリーブグループ	1,600	1,380.00	2,208,000
丸善CHIホールディングス	8,300	329.00	2,730,700
大光	3,600	634.00	2,282,400
OCHIホールディングス	1,600	1,699.00	2,718,400
TOKAIホールディングス	84,000	1,000.00	84,000,000
黒谷	2,200	594.00	1,306,800
ミサワ	1,500	617.00	925,500
ティーライフ	900	1,373.00	1,235,700
Cominix	1,400	890.00	1,246,000
エー・ピーホールディングス	1,700	973.00	1,654,100
三洋貿易	17,500	1,216.00	21,280,000
チムニー	2,100	1,414.00	2,969,400

シュッピン	14,000	1,162.00	16,268,000
ビューティガレージ	4,900	2,131.00	10,441,900
オイシックス・ラ・大地	20,800	1,301.00	27,060,800
ウイン・パートナーズ	10,100	1,256.00	12,685,600
ネクステージ	35,300	2,581.00	91,109,300
ジョイフル本田	45,000	2,135.00	96,075,000
鳥貴族ホールディングス	5,700	4,565.00	26,020,500
ホットランド	11,800	1,827.00	21,558,600
すかいらくホールディングス	211,400	2,209.50	467,088,300
SFPホールディングス	8,500	1,875.00	15,937,500
綿半ホールディングス	12,000	1,515.00	18,180,000
日本毛織	37,500	1,388.00	52,050,000
ダイトウボウ	10,400	93.00	967,200
トーア紡コーポレーション	2,500	439.00	1,097,500
ダイドーリミテッド	9,400	679.00	6,382,600
ヨシックスホールディングス	3,200	2,929.00	9,372,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	43,100	983.00	42,367,300
野村不動産ホールディングス	80,100	3,711.00	297,251,100
三重交通グループホールディングス	30,900	625.00	19,312,500
サムティ	22,900	2,423.00	55,486,700
ディア・ライフ	24,500	926.00	22,687,000
コーセーアールイー	2,000	866.00	1,732,000
地主	11,000	2,148.00	23,628,000
プレサンスコーポレーション	22,900	1,689.00	38,678,100
フィル・カンパニー	2,200	808.00	1,777,600
THEグローバル社	4,300	400.00	1,720,000
ハウスコム	1,000	978.00	978,000
JPMC	8,300	1,185.00	9,835,500
サンセイランディック	1,900	998.00	1,896,200
エストラスト	700	637.00	445,900
フージャースホールディングス	22,200	1,068.00	23,709,600
オープンハウスグループ	52,700	4,384.00	231,036,800
東急不動産ホールディングス	432,900	984.80	426,319,920
飯田グループホールディングス	138,000	1,926.00	265,788,000
イーグランド	1,000	1,577.00	1,577,000
ムゲンエステート	4,300	1,321.00	5,680,300
帝国繊維	16,500	2,250.00	37,125,000
日本コークス工業	148,700	142.00	21,115,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,000	592.00	4,144,000
ミタチ産業	1,900	1,184.00	2,249,600
B E E N O S	6,300	1,920.00	12,096,000
あさひ	14,300	1,306.00	18,675,800
日本調剤	10,500	1,610.00	16,905,000
コスモス薬品	13,100	13,650.00	178,815,000
シップヘルスケアホールディングス	55,600	2,231.00	124,043,600
トーエル	3,100	788.00	2,442,800
ソフトクリエイイトホールディングス	12,100	1,897.00	22,953,700
セブン&アイ・ホールディングス	1,599,300	2,103.50	3,364,127,550

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	104,700	1,010.00	105,747,000	
明治電機工業	5,800	1,496.00	8,676,800	
ツルハホールディングス	32,500	11,480.00	373,100,000	
デリカフーズホールディングス	3,000	579.00	1,737,000	
スターティアホールディングス	1,800	1,456.00	2,620,800	
サンマルクホールディングス	12,500	2,188.00	27,350,000	
フェリシモ	1,500	918.00	1,377,000	
トリドールホールディングス	43,400	4,069.00	176,594,600	
帝人	140,700	1,367.50	192,407,250	
東レ	981,200	696.50	683,405,800	
クラレ	213,400	1,468.50	313,377,900	
旭化成	990,800	1,060.00	1,050,248,000	
TOKYO BASE	18,500	303.00	5,605,500	
稲葉製作所	7,500	1,486.00	11,145,000	
宮地エンジニアリンググループ	7,600	4,220.00	32,072,000	
トーカコ	43,600	1,692.00	73,771,200	
アルファ	2,400	1,587.00	3,808,800	
SUMCO	268,000	2,390.50	640,654,000	
川田テクノロジーズ	3,600	9,210.00	33,156,000	
RS Technologies	10,100	2,824.00	28,522,400	
ジェイテックコーポレーション	1,200	2,021.00	2,425,200	
信和	4,300	754.00	3,242,200	
ピーロット	4,400	905.00	3,982,000	
ファーストブラザーズ	1,300	1,270.00	1,651,000	
And Doホールディングス	8,700	1,116.00	9,709,200	
シーアールイー	8,000	1,293.00	10,344,000	
ケイアイスター不動産	6,900	3,480.00	24,012,000	
アグレ都市デザイン	1,100	1,712.00	1,883,200	
グッドコムアセット	13,400	746.00	9,996,400	
ジェイ・エス・ビー	7,200	2,666.00	19,195,200	
ロードスターキャピタル	9,400	2,261.00	21,253,400	
テンポイノベーション	1,900	905.00	1,719,500	
グローバル・リンク・マネジメント	1,200	2,590.00	3,108,000	
フェイスネットワーク	1,700	1,443.00	2,453,100	
霞ヶ関キャピタル	3,900	12,770.00	49,803,000	
住江織物	1,300	2,417.00	3,142,100	
日本フェルト	3,700	438.00	1,620,600	
イチカワ	800	1,769.00	1,415,200	
エコナックホールディングス	5,800	138.00	800,400	
日東製網	700	1,585.00	1,109,500	
芦森工業	1,300	2,657.00	3,454,100	
アツギ	4,500	589.00	2,650,500	
ウイルプラスホールディングス	1,400	980.00	1,372,000	
JMホールディングス	11,700	2,501.00	29,261,700	
コメダホールディングス	37,900	2,675.00	101,382,500	
サツドラホールディングス	2,800	822.00	2,301,600	
アレンザホールディングス	11,600	1,033.00	11,982,800	
串カツ田中ホールディングス	4,100	1,709.00	7,006,900	
パロックジャパンリミテッド	12,000	743.00	8,916,000	

クスリのアオキホールディングス	46,600	3,226.00	150,331,600	
ダイニック	2,100	761.00	1,598,100	
共和レザー	3,800	814.00	3,093,200	
ピーバンドットコム	900	383.00	344,700	
力の源ホールディングス	7,900	1,561.00	12,331,900	
FOOD & LIFE COMPANIES	82,500	2,894.50	238,796,250	
アセンテック	5,900	689.00	4,065,100	
セーレン	28,300	2,461.00	69,646,300	
ソトー	2,100	701.00	1,472,100	
東海染工	600	823.00	493,800	
小松マテーレ	21,200	761.00	16,133,200	
ワコールホールディングス	30,000	3,715.00	111,450,000	
ホギメディカル	19,300	3,880.00	74,884,000	
クラウドシアホールディングス	1,500	397.00	595,500	
T S Iホールディングス	47,600	659.00	31,368,400	
マツオカコーポレーション	2,000	1,529.00	3,058,000	
ワールド	20,700	1,913.00	39,599,100	
T I S	160,400	3,287.00	527,234,800	
テクミラホールディングス	3,000	555.00	1,665,000	
グリー	49,100	481.00	23,617,100	
G M Oペパボ	1,800	1,335.00	2,403,000	
コーエーテックモホールディングス	91,900	1,766.00	162,295,400	
三菱総合研究所	7,200	5,110.00	36,792,000	
ボルテージ	1,800	263.00	473,400	
電算	800	1,494.00	1,195,200	
A G S	2,700	889.00	2,400,300	
ファインデックス	11,600	1,226.00	14,221,600	
ブレインパッド	12,200	1,454.00	17,738,800	
K L a b	26,900	358.00	9,630,200	
ポールトゥウィンホールディングス	25,000	516.00	12,900,000	
ネクソン	328,200	2,528.00	829,689,600	
アイスタイル	47,800	519.00	24,808,200	
エムアップホールディングス	18,000	1,076.00	19,368,000	
エイチーム	8,700	616.00	5,359,200	
エニグモ	18,600	357.00	6,640,200	
テクノスジャパン	5,800	625.00	3,625,000	
e n i s h	6,600	258.00	1,702,800	
コロプラ	56,900	592.00	33,684,800	
オルトプラス	5,800	136.00	788,800	
ブロードリーフ	69,600	582.00	40,507,200	
クロス・マーケティンググループ	3,100	540.00	1,674,000	
デジタルハーツホールディングス	9,100	910.00	8,281,000	
メディアドゥ	6,600	1,438.00	9,490,800	
じげん	42,800	587.00	25,123,600	
ブイキューブ	17,500	277.00	4,847,500	
エンカレッジ・テクノロジー	1,500	633.00	949,500	
サイバーリンクス	2,500	867.00	2,167,500	
ディー・エル・イー	4,600	227.00	1,044,200	
フィックスターズ	16,500	2,208.00	36,432,000	

CARTA HOLDINGS	6,900	1,475.00	10,177,500
オブティム	15,100	1,136.00	17,153,600
セレス	5,900	1,682.00	9,923,800
SHIFT	9,700	26,105.00	253,218,500
特種東海製紙	8,000	3,900.00	31,200,000
ティーガイア	15,400	2,077.00	31,985,800
セック	1,800	4,740.00	8,532,000
テクマトリックス	26,800	1,926.00	51,616,800
プロシップ	7,100	1,451.00	10,302,100
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	38,200	2,192.50	83,753,500
GMOペイメントゲートウェイ	29,300	10,380.00	304,134,000
ザッパラス	1,500	447.00	670,500
システムリサーチ	5,000	3,230.00	16,150,000
インターネットイニシアティブ	70,100	2,921.50	204,797,150
さくらインターネット	16,500	6,620.00	109,230,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,500	2,814.00	12,663,000
SRAホールディングス	7,500	4,015.00	30,112,500
システムインテグレータ	2,000	401.00	802,000
朝日ネット	15,800	621.00	9,811,800
eBASE	20,700	742.00	15,359,400
アバントグループ	18,500	1,300.00	24,050,000
アドソル日進	6,200	1,654.00	10,254,800
ODKソリューションズ	1,300	612.00	795,600
フリービット	6,400	1,399.00	8,953,600
コムチュア	21,200	1,997.00	42,336,400
アステリア	11,500	658.00	7,567,000
アイル	6,800	3,110.00	21,148,000
王子ホールディングス	610,000	608.30	371,063,000
日本製紙	82,600	1,142.00	94,329,200
三菱製紙	8,800	565.00	4,972,000
北越コーポレーション	72,000	1,619.00	116,568,000
中越パルプ工業	2,600	1,955.00	5,083,000
巴川コーポレーション	1,800	839.00	1,510,200
大王製紙	64,700	1,177.50	76,184,250
阿波製紙	1,800	545.00	981,000
マークライنز	7,900	3,245.00	25,635,500
メディカル・データ・ビジョン	17,500	555.00	9,712,500
gumi	23,800	445.00	10,591,000
ショーケース	1,500	326.00	489,000
モバイルファクトリー	1,400	717.00	1,003,800
テラスカイ	6,300	1,526.00	9,613,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	7,600	1,825.00	13,870,000
PCIホールディングス	2,400	926.00	2,222,400
アイビーシー	1,000	425.00	425,000
ネオジャパン	4,900	1,111.00	5,443,900
PR TIMES	2,900	1,962.00	5,689,800
ラクス	69,400	2,069.00	143,588,600



ランドコンピュータ	3,100	847.00	2,625,700
ダブルスタンダード	4,500	1,810.00	8,145,000
オープンドア	8,500	799.00	6,791,500
マイネット	2,100	336.00	705,600
アカツキ	7,000	2,440.00	17,080,000
ベネフィットジャパン	400	1,276.00	510,400
Ubicomホールディングス	4,600	1,257.00	5,782,200
カナミックネットワーク	15,800	476.00	7,520,800
ノムラシステムコーポレーション	7,100	116.00	823,600
レンゴー	133,400	1,170.50	156,144,700
トーモク	8,500	2,491.00	21,173,500
ザ・バック	10,900	3,630.00	39,567,000
チェンジホールディングス	31,900	1,152.00	36,748,800
シンクロ・フード	4,100	634.00	2,599,400
オークネット	5,400	2,185.00	11,799,000
キャピタル・アセット・プランニング	1,300	758.00	985,400
セグエグループ	6,300	650.00	4,095,000
エイトレッド	1,000	1,408.00	1,408,000
マクロミル	28,800	705.00	20,304,000
ピーグリー	1,400	1,119.00	1,566,600
オロ	5,300	2,806.00	14,871,800
ユーザーローカル	6,200	2,432.00	15,078,400
テモナ	1,500	224.00	336,000
ニーズウェル	3,600	1,036.00	3,729,600
マネーフォワード	32,700	6,431.00	210,293,700
サインポスト	2,500	604.00	1,510,000
レゾナック・ホールディングス	141,500	3,310.00	468,365,000
住友化学	1,086,700	306.70	333,290,890
住友精化	6,900	4,930.00	34,017,000
日産化学	68,800	5,874.00	404,131,200
ラサ工業	5,600	2,509.00	14,050,400
クレハ	32,000	2,664.00	85,248,000
多木化学	5,700	3,480.00	19,836,000
テイカ	12,700	1,567.00	19,900,900
石原産業	24,300	1,536.00	37,324,800
片倉コープアグリ	1,600	1,048.00	1,676,800
日本曹達	17,300	6,020.00	104,146,000
東ソー	195,500	2,023.00	395,496,500
トクヤマ	47,300	2,546.00	120,425,800
セントラル硝子	15,600	2,781.00	43,383,600
東亜合成	70,500	1,491.00	105,115,500
大阪ソーダ	10,200	10,840.00	110,568,000
関東電化工業	28,300	985.00	27,875,500
SUN ASTERISK	10,400	965.00	10,036,000
デンカ	53,300	2,424.50	129,225,850
イビデン	77,000	6,773.00	521,521,000
信越化学工業	1,313,300	6,384.00	8,384,107,200
日本カーパイド工業	6,200	1,885.00	11,687,000
プラスアルファ・コンサルティング	8,700	2,489.00	21,654,300
電算システムホールディングス	6,500	2,586.00	16,809,000

堺化学工業	11,100	1,881.00	20,879,100
第一稀元素化学工業	16,000	935.00	14,960,000
エア・ウォーター	138,200	2,270.00	313,714,000
日本酸素ホールディングス	142,100	4,781.00	679,380,100
日本化学工業	5,300	2,301.00	12,195,300
東邦アセチレン	6,900	392.00	2,704,800
日本パーカライジング	65,300	1,223.00	79,861,900
高圧ガス工業	21,400	903.00	19,324,200
チタン工業	900	1,080.00	972,000
四国化成ホールディングス	18,700	1,785.00	33,379,500
戸田工業	3,300	1,719.00	5,672,700
ステラ ケミファ	7,900	3,790.00	29,941,000
保土谷化学工業	4,600	3,445.00	15,847,000
日本触媒	21,300	5,651.00	120,366,300
大日精化工業	10,200	2,654.00	27,070,800
カネカ	37,200	3,692.00	137,342,400
協和キリン	177,200	2,862.00	507,146,400
A P P I E R G R O U P	50,100	1,615.00	80,911,500
三菱瓦斯化学	106,900	2,464.50	263,455,050
三井化学	120,800	4,153.00	501,682,400
J S R	159,500	4,277.00	682,181,500
東京応化工業	69,900	4,336.00	303,086,400
大阪有機化学工業	12,300	3,195.00	39,298,500
三菱ケミカルグループ	1,070,700	849.60	909,666,720
K H ネオケム	22,300	2,195.00	48,948,500
ビジョナル	11,200	8,990.00	100,688,000
ダイセル	188,300	1,433.00	269,833,900
住友ベークライト	20,500	8,762.00	179,621,000
積水化学工業	294,300	2,129.50	626,711,850
日本ゼオン	100,400	1,259.00	126,403,600
アイカ工業	37,000	3,540.00	130,980,000
U B E	69,700	2,543.50	177,281,950
積水樹脂	21,900	2,525.00	55,297,500
タキロンシーアイ	37,400	649.00	24,272,600
旭有機材	9,700	4,740.00	45,978,000
ニチバン	7,900	1,901.00	15,017,900
リケンテクノス	31,600	942.00	29,767,200
大倉工業	6,800	3,035.00	20,638,000
積水化成成品工業	20,700	470.00	9,729,000
群栄化学工業	3,400	3,580.00	12,172,000
タイガースポリマー	3,000	1,093.00	3,279,000
ミライアル	2,200	1,590.00	3,498,000
ダイキアクシス	2,700	691.00	1,865,700
ダイキョーニシカワ	32,400	750.00	24,300,000
竹本容器	2,600	771.00	2,004,600
森六ホールディングス	7,600	2,647.00	20,117,200
恵和	10,500	1,110.00	11,655,000
日本化薬	111,900	1,283.00	143,567,700
カーリットホールディングス	15,800	1,021.00	16,131,800
ソルクシーズ	5,300	333.00	1,764,900

CLホールディングス	3,500	1,006.00	3,521,000
プレステージ・インターナショナル	70,400	632.00	44,492,800
フェイス	1,800	455.00	819,000
プロトコーポレーション	16,100	1,324.00	21,316,400
ハイマックス	4,500	1,418.00	6,381,000
アミューズ	9,200	1,467.00	13,496,400
野村総合研究所	324,900	4,267.00	1,386,348,300
ドリームインキュベータ	5,200	2,845.00	14,794,000
クイック	10,400	2,418.00	25,147,200
TAC	3,300	193.00	636,900
CEホールディングス	3,400	532.00	1,808,800
日本システム技術	5,400	3,985.00	21,519,000
電通グループ	147,700	4,027.00	594,787,900
インテージホールディングス	16,600	1,610.00	26,726,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,800	1,081.00	6,269,800
東邦システムサイエンス	5,500	1,247.00	6,858,500
ぴあ	5,000	3,120.00	15,600,000
イオンファンタジー	5,400	2,349.00	12,684,600
ソースネクスト	67,100	281.00	18,855,100
シーティーエス	19,000	756.00	14,364,000
NEXYZ・Group	2,100	578.00	1,213,800
インフォコム	18,900	2,685.00	50,746,500
メディカルシステムネットワーク	16,800	637.00	10,701,600
日本精化	9,700	2,666.00	25,860,200
扶桑化学工業	15,500	4,750.00	73,625,000
トリケミカル研究所	17,800	4,525.00	80,545,000
シンプレクス・ホールディングス	22,100	2,830.00	62,543,000
HEROZ	5,800	1,691.00	9,807,800
ラクスル	35,300	1,118.00	39,465,400
メルカリ	71,400	1,985.50	141,764,700
IPS	4,200	2,363.00	9,924,600
FIG	7,600	319.00	2,424,400
システムサポート	5,700	2,019.00	11,508,300
ADEKA	51,100	3,159.00	161,424,900
日油	44,200	6,648.00	293,841,600
ミヨシ油脂	2,500	1,270.00	3,175,000
新日本理化	8,900	210.00	1,869,000
ハリマ化成グループ	9,100	900.00	8,190,000
イーソル	10,600	840.00	8,904,000
東海ソフト	1,100	1,187.00	1,305,700
ウイングアーク1st	15,200	3,030.00	46,056,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,900	1,124.00	4,383,600
サーバーワークス	3,000	3,930.00	11,790,000
東名	500	2,297.00	1,148,500
ヴィッツ	600	793.00	475,800
トピラスシステムズ	1,900	812.00	1,542,800
Sansan	48,100	1,726.00	83,020,600
Link-Uグループ	1,600	695.00	1,112,000
ギフトイ	12,900	1,339.00	17,273,100

花王	331,200	5,628.00	1,863,993,600	
第一工業製薬	5,800	3,735.00	21,663,000	
石原ケミカル	6,600	1,838.00	12,130,800	
日華化学	2,600	900.00	2,340,000	
ニイタカ	1,300	1,893.00	2,460,900	
三洋化成工業	9,000	4,170.00	37,530,000	
メドレー	19,700	4,905.00	96,628,500	
ベース	5,100	3,335.00	17,008,500	
J M D C	25,000	3,672.00	91,800,000	
武田薬品工業	1,297,800	4,314.00	5,598,709,200	
アステラス製薬	1,286,300	1,598.00	2,055,507,400	
住友ファーマ	108,800	369.00	40,147,200	
塩野義製薬	184,900	7,866.00	1,454,423,400	
わかもと製薬	6,800	215.00	1,462,000	
日本新薬	38,400	4,556.00	174,950,400	
中外製薬	459,000	6,513.00	2,989,467,000	
科研製薬	25,100	3,539.00	88,828,900	
エーザイ	178,400	6,372.00	1,136,764,800	
理研ビタミン	12,500	2,526.00	31,575,000	
ロート製薬	142,100	2,898.00	411,805,800	
小野薬品工業	311,200	2,459.00	765,240,800	
久光製薬	32,600	3,821.00	124,564,600	
有機合成薬品工業	5,200	319.00	1,658,800	
持田製薬	16,900	3,195.00	53,995,500	
参天製薬	267,200	1,444.50	385,970,400	
扶桑薬品工業	5,200	2,270.00	11,804,000	
日本ケミファ	700	1,616.00	1,131,200	
ツムラ	46,200	3,684.00	170,200,800	
テルモ	408,800	5,713.00	2,335,474,400	
H . U . グループホールディングス	44,000	2,543.00	111,892,000	
キッセイ薬品工業	24,300	3,650.00	88,695,000	
生化学工業	24,900	758.00	18,874,200	
栄研化学	26,900	2,010.00	54,069,000	
鳥居薬品	7,900	4,315.00	34,088,500	
J C R ファーマ	49,600	864.00	42,854,400	
東和薬品	22,500	2,899.00	65,227,500	
富士製薬工業	10,800	1,645.00	17,766,000	
ゼリア新薬工業	20,300	2,134.00	43,320,200	
そーせいグループ	48,100	1,735.00	83,453,500	
第一三共	1,277,500	4,829.00	6,169,047,500	
杏林製薬	31,800	1,788.00	56,858,400	
大幸薬品	30,300	367.00	11,120,100	
ダイト	11,300	2,229.00	25,187,700	
大塚ホールディングス	305,000	5,957.00	1,816,885,000	
大正製薬ホールディングス	32,600	8,595.00	280,197,000	
ペプチドリーム	71,100	1,406.50	100,002,150	
大日本塗料	16,300	1,102.00	17,962,600	
日本ペイントホールディングス	777,700	1,111.50	864,413,550	
関西ペイント	143,500	2,155.50	309,314,250	
神東塗料	5,300	128.00	678,400	

中国塗料	30,100	2,068.00	62,246,800
日本特殊塗料	4,700	1,354.00	6,363,800
藤倉化成	16,800	460.00	7,728,000
太陽ホールディングス	25,500	3,215.00	81,982,500
D I C	57,200	2,882.00	164,850,400
サカタインクス	32,600	1,334.00	43,488,400
a r t i e n c e	31,900	2,823.00	90,053,700
アルプス技研	14,300	2,745.00	39,253,500
サニックス	24,100	297.00	7,157,700
日本空調サービス	16,200	864.00	13,996,800
オリエンタルランド	795,400	4,919.00	3,912,572,600
フォーカスシステムズ	9,800	1,211.00	11,867,800
ダスキン	33,500	3,313.00	110,985,500
パーク24	93,500	1,721.50	160,960,250
明光ネットワークジャパン	18,200	703.00	12,794,600
ファルコホールディングス	6,800	2,290.00	15,572,000
クレスコ	12,000	2,088.00	25,056,000
フジ・メディア・ホールディングス	140,900	1,814.50	255,663,050
秀英予備校	1,500	308.00	462,000
田谷	1,200	416.00	499,200
ラウンドワン	141,400	744.00	105,201,600
リゾートトラスト	65,300	2,452.00	160,115,600
オービック	49,000	22,815.00	1,117,935,000
ジャストシステム	21,100	2,557.00	53,952,700
T D C ソフト	13,700	2,329.00	31,907,300
L I N E ヤフー	2,087,700	377.60	788,315,520
ビー・エム・エル	18,500	2,868.00	53,058,000
トレンドマイクロ	69,300	7,555.00	523,561,500
I D ホールディングス	9,900	1,532.00	15,166,800
リソー教育	76,800	217.00	16,665,600
日本オラクル	28,100	11,465.00	322,166,500
早稲田アカデミー	8,300	1,577.00	13,089,100
アルファシステムズ	3,900	3,320.00	12,948,000
フューチャー	31,300	1,690.00	52,897,000
C A C H o l d i n g s	7,900	1,813.00	14,322,700
S B テクノロジー	6,200	2,082.00	12,908,400
トーセ	1,900	700.00	1,330,000
ユー・エス・エス	168,600	2,647.00	446,284,200
オービックビジネスコンサルタント	20,600	6,942.00	143,005,200
アイティフォー	18,800	1,393.00	26,188,400
東京個別指導学院	17,900	426.00	7,625,400
東計電算	4,100	3,340.00	13,694,000
サイバーエージェント	332,100	1,037.50	344,553,750
楽天グループ	1,288,300	826.90	1,065,295,270
エクスネット	1,000	1,149.00	1,149,000
クリーク・アンド・リバー社	7,600	1,893.00	14,386,800
S B I グローバルアセットマネジメント	29,400	729.00	21,432,600
テー・オー・ダブリュー	29,400	373.00	10,966,200
大塚商会	72,700	6,483.00	471,314,100

サイボウズ	20,200	1,968.00	39,753,600
山田コンサルティンググループ	6,500	1,737.00	11,290,500
セントラルスポーツ	5,600	2,464.00	13,798,400
パラカ	5,100	1,936.00	9,873,600
電通総研	17,800	5,280.00	93,984,000
A C C E S S	15,200	1,297.00	19,714,400
デジタルガレージ	23,400	3,300.00	77,220,000
イーエムシステムズ	24,500	754.00	18,473,000
ウェザーニューズ	4,500	5,200.00	23,400,000
C I J	24,400	785.00	19,154,000
ビジネスエンジニアリング	2,800	3,855.00	10,794,000
日本エンタープライズ	6,600	125.00	825,000
WOWOW	11,000	1,135.00	12,485,000
スカラ	13,500	733.00	9,895,500
インテリジェント ウェイブ	3,500	1,164.00	4,074,000
フルキャストホールディングス	14,400	1,430.00	20,592,000
エン・ジャパン	24,500	2,654.00	65,023,000
セルソース	4,100	1,405.00	5,760,500
あすか製薬ホールディングス	15,000	2,118.00	31,770,000
サワイグループホールディングス	33,500	6,217.00	208,269,500
富士フイルムホールディングス	272,000	9,645.00	2,623,440,000
コニカミノルタ	329,800	494.50	163,086,100
資生堂	306,200	4,070.00	1,246,234,000
ライオン	191,900	1,344.00	257,913,600
高砂香料工業	11,000	3,305.00	36,355,000
マンダム	31,700	1,328.00	42,097,600
ミルボン	19,900	3,326.00	66,187,400
ファンケル	64,100	2,068.50	132,590,850
コーセー	29,800	7,533.00	224,483,400
コタ	13,500	1,651.00	22,288,500
シーボン	900	1,491.00	1,341,900
ポーラ・オルビスホールディングス	75,200	1,488.50	111,935,200
ノエビアホールディングス	13,100	5,130.00	67,203,000
アジュバンホールディングス	1,600	960.00	1,536,000
新日本製薬	8,400	1,651.00	13,868,400
I - n e	2,900	1,746.00	5,063,400
アクシージア	7,200	816.00	5,875,200
エステー	11,300	1,561.00	17,639,300
アグロ カネショウ	5,900	1,219.00	7,192,100
コニシ	42,400	1,543.00	65,423,200
長谷川香料	28,000	2,986.00	83,608,000
小林製薬	42,700	6,053.00	258,463,100
荒川化学工業	12,400	1,128.00	13,987,200
メック	12,100	4,045.00	48,944,500
日本高純度化学	3,300	2,858.00	9,431,400
タカラバイオ	39,500	1,000.00	39,500,000
J C U	16,400	3,910.00	64,124,000
新田ゼラチン	4,400	749.00	3,295,600
O A T アグリオ	4,800	1,732.00	8,313,600
デクセリアルズ	36,800	5,849.00	215,243,200

アース製薬	13,300	4,310.00	57,323,000
北興化学工業	14,800	1,165.00	17,242,000
大成ラミック	4,200	2,999.00	12,595,800
クミアイ化学工業	58,300	787.00	45,882,100
日本農薬	26,900	740.00	19,906,000
富士興産	1,900	1,998.00	3,796,200
ニチレキ	19,100	2,439.00	46,584,900
ユシロ化学工業	7,600	2,036.00	15,473,600
ビービー・カストロール	2,500	934.00	2,335,000
富士石油	42,700	342.00	14,603,400
MORESCO	2,300	1,352.00	3,109,600
出光興産	814,300	957.80	779,936,540
ENEOSホールディングス	2,321,700	652.20	1,514,212,740
コスモエネルギーホールディングス	43,500	6,704.00	291,624,000
ANYCOLOR	15,500	3,240.00	50,220,000
テスホールディングス	30,900	448.00	13,843,200
インフロンニア・ホールディングス	165,300	1,547.00	255,719,100
横浜ゴム	74,200	3,824.00	283,740,800
TOYO TIRE	84,300	2,590.00	218,337,000
ブリヂストン	429,200	6,154.00	2,641,296,800
住友ゴム工業	143,800	1,711.00	246,041,800
藤倉コンポジット	11,300	1,389.00	15,695,700
オカモト	6,900	4,895.00	33,775,500
アキレス	9,300	1,565.00	14,554,500
フコク	7,700	1,752.00	13,490,400
ニッタ	14,900	3,715.00	55,353,500
クリエートメディック	2,100	951.00	1,997,100
住友理工	22,800	1,190.00	27,132,000
三ツ星ベルト	17,800	4,660.00	82,948,000
バンドー化学	21,800	1,781.00	38,825,800
AGC	130,800	5,281.00	690,754,800
日本板硝子	69,900	499.00	34,880,100
石塚硝子	1,100	2,885.00	3,173,500
有沢製作所	25,700	1,132.00	29,092,400
日本山村硝子	2,400	1,593.00	3,823,200
日本電気硝子	59,800	3,644.00	217,911,200
オハラ	7,000	1,255.00	8,785,000
住友大阪セメント	24,400	3,837.00	93,622,800
太平洋セメント	86,700	3,330.00	288,711,000
リソルホールディングス	600	5,570.00	3,342,000
日本ヒューム	12,800	874.00	11,187,200
日本コンクリート工業	28,400	425.00	12,070,000
三谷セキサン	5,900	5,410.00	31,919,000
アジアパイルホールディングス	20,800	790.00	16,432,000
東海カーボン	135,300	960.90	130,009,770
日本カーボン	7,800	5,180.00	40,404,000
東洋炭素	10,300	7,560.00	77,868,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,100	8,170.00	66,177,000
TOTO	96,800	4,155.00	402,204,000
日本碍子	170,600	1,909.50	325,760,700

日本特殊陶業	122,800	4,500.00	552,600,000
ダントーホールディングス	4,300	958.00	4,119,400
MARUWA	5,400	31,050.00	167,670,000
品川リフラクトリーズ	18,100	1,871.00	33,865,100
黒崎播磨	3,000	13,990.00	41,970,000
ヨータイ	9,100	1,455.00	13,240,500
東京窯業	7,000	471.00	3,297,000
ニッカトー	3,000	584.00	1,752,000
フジインコーポレーテッド	39,400	3,625.00	142,825,000
クニミネ工業	1,900	1,027.00	1,951,300
エーアンドエーマテリアル	1,400	1,332.00	1,864,800
ニチアス	37,100	3,905.00	144,875,500
日本製鉄	675,600	3,643.00	2,461,210,800
神戸製鋼所	303,400	1,961.00	594,967,400
中山製鋼所	34,600	924.00	31,970,400
合同製鐵	8,500	5,710.00	48,535,000
JFEホールディングス	419,600	2,437.00	1,022,565,200
東京製鐵	42,500	1,648.00	70,040,000
共英製鋼	17,300	2,361.00	40,845,300
大和工業	28,500	8,218.00	234,213,000
東京鐵鋼	6,700	5,490.00	36,783,000
大阪製鐵	7,000	2,216.00	15,512,000
淀川製鋼所	17,200	4,685.00	80,582,000
中部鋼鈹	9,900	2,582.00	25,561,800
丸一鋼管	46,000	3,894.00	179,124,000
モリ工業	2,600	5,400.00	14,040,000
大同特殊鋼	95,100	1,785.00	169,753,500
日本高周波鋼業	2,700	592.00	1,598,400
日本冶金工業	11,000	4,665.00	51,315,000
山陽特殊製鋼	15,000	2,254.00	33,810,000
愛知製鋼	8,700	3,725.00	32,407,500
日本金属	1,900	843.00	1,601,700
ミガロホールディングス	1,000	1,796.00	1,796,000
大平洋金属	12,900	1,349.00	17,402,100
新日本電工	75,400	303.00	22,846,200
栗本鐵工所	7,000	3,715.00	26,005,000
虹技	900	1,470.00	1,323,000
日本鑄鐵管	800	1,141.00	912,800
日本製鋼所	40,700	2,913.50	118,579,450
三菱製鋼	11,200	1,424.00	15,948,800
日亜鋼業	7,400	336.00	2,486,400
日本精線	2,100	6,400.00	13,440,000
エンビプロ・ホールディングス	11,900	508.00	6,045,200
大紀アルミニウム工業所	19,200	1,209.00	23,212,800
日本輕金属ホールディングス	44,200	1,756.00	77,615,200
三井金属鋳業	43,900	4,277.00	187,760,300
東邦亜鉛	9,800	1,023.00	10,025,400
三菱マテリアル	108,000	2,607.50	281,610,000
住友金属鋳山	174,900	4,002.00	699,949,800
DOWAホールディングス	37,300	5,195.00	193,773,500



古河機械金属	20,000	1,743.00	34,860,000
エス・サイエンス	41,900	25.00	1,047,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	26,200	2,464.00	64,556,800
東邦チタニウム	31,200	1,519.00	47,392,800
U A C J	21,200	4,110.00	87,132,000
C Kサンエツ	2,700	3,795.00	10,246,500
古河電気工業	50,200	2,936.00	147,387,200
住友電気工業	564,400	2,197.50	1,240,269,000
フジクラ	177,900	1,898.00	337,654,200
S W C C	16,900	3,410.00	57,629,000
タツタ電線	26,800	699.00	18,733,200
カナレ電気	1,100	1,778.00	1,955,800
平河ヒューテック	9,600	1,346.00	12,921,600
いよぎんホールディングス	171,400	1,135.50	194,624,700
しずおかフィナンシャルグループ	320,000	1,482.00	474,240,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	121,300	1,188.50	144,165,050
楽天銀行	50,100	2,984.00	149,498,400
京都フィナンシャルグループ	182,500	2,809.50	512,733,750
リョービ	16,100	2,685.00	43,228,500
アーレスティ	7,400	791.00	5,853,400
A R E ホールディングス	56,800	1,928.00	109,510,400
東洋製罐グループホールディングス	86,600	2,457.50	212,819,500
ホッカンホールディングス	7,400	1,922.00	14,222,800
コロナ	8,600	966.00	8,307,600
横河ブリッジホールディングス	23,600	2,889.00	68,180,400
駒井ハルテック	1,200	2,011.00	2,413,200
高田機工	500	3,400.00	1,700,000
三和ホールディングス	151,600	2,501.50	379,227,400
文化シャッター	39,500	1,640.00	64,780,000
三協立山	19,000	888.00	16,872,000
アルインコ	11,500	1,045.00	12,017,500
東洋シャッター	1,500	710.00	1,065,000
L I X I L	235,500	1,908.50	449,451,750
日本フィルコン	4,400	531.00	2,336,400
ノーリツ	25,000	1,682.00	42,050,000
長府製作所	15,000	2,129.00	31,935,000
リンナイ	72,200	3,402.00	245,624,400
ユニプレス	26,200	1,154.00	30,234,800
ダイニチ工業	3,500	704.00	2,464,000
日東精工	21,900	599.00	13,118,100
三洋工業	800	3,265.00	2,612,000
岡部	26,900	735.00	19,771,500
ジーテクト	19,200	2,022.00	38,822,400
東プレ	26,600	2,416.00	64,265,600
高周波熱錬	23,300	1,084.00	25,257,200
東京製網	9,800	1,426.00	13,974,800
サンコール	13,400	481.00	6,445,400
モリテックスチール	6,100	254.00	1,549,400
パイオラックス	18,700	2,677.00	50,059,900
エイチワン	15,500	684.00	10,602,000

日本発条	133,500	1,411.50	188,435,250
中央発條	11,200	869.00	9,732,800
アドバネクス	800	1,347.00	1,077,600
三浦工業	61,700	2,995.00	184,791,500
タクマ	49,900	1,856.00	92,614,400
テクノプロ・ホールディングス	88,000	2,996.00	263,648,000
アトラグループ	2,000	170.00	340,000
アイ・アールジャパンホールディングス	7,800	1,354.00	10,561,200
KeepPer 技研	9,300	5,080.00	47,244,000
ファーストロジック	1,600	491.00	785,600
三機サービス	1,200	1,432.00	1,718,400
Gunosy	11,900	761.00	9,055,900
デザインワン・ジャパン	1,600	132.00	211,200
イー・ガーディアン	5,700	1,337.00	7,620,900
リブセンス	3,100	224.00	694,400
ジャパンマテリアル	46,000	2,373.00	109,158,000
ベクトル	18,400	1,155.00	21,252,000
ウチヤマホールディングス	2,800	381.00	1,066,800
チャーム・ケア・コーポレーション	12,500	1,462.00	18,275,000
キャリアリンク	5,500	2,656.00	14,608,000
IBJ	11,500	559.00	6,428,500
アサンテ	7,400	1,667.00	12,335,800
パリュールHR	13,100	1,300.00	17,030,000
M&Aキャピタルパートナーズ	12,200	2,439.00	29,755,800
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,000	1,101.00	6,606,000
ERIホールディングス	1,900	1,791.00	3,402,900
アビスト	1,000	3,190.00	3,190,000
シグマクシス・ホールディングス	20,300	1,779.00	36,113,700
ウィルグループ	12,500	1,118.00	13,975,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	7,900	139.00	1,098,100
メドピア	13,200	762.00	10,058,400
レアジョブ	1,300	844.00	1,097,200
リクルートホールディングス	1,112,800	6,415.00	7,138,612,000
エラン	19,900	925.00	18,407,500
ツガミ	32,800	1,133.00	37,162,400
オークマ	12,900	6,947.00	89,616,300
芝浦機械	14,700	3,445.00	50,641,500
アマダ	235,600	1,666.00	392,509,600
アイダエンジニアリング	34,200	843.00	28,830,600
FUJI	69,500	2,674.50	185,877,750
牧野フライス製作所	16,300	5,800.00	94,540,000
オーエスジー	65,100	2,106.00	137,100,600
ダイジェット工業	700	843.00	590,100
旭ダイヤモンド工業	34,000	939.00	31,926,000
DMG森精機	89,500	3,564.00	318,978,000
ソディック	35,900	712.00	25,560,800
ディスコ	71,100	49,650.00	3,530,115,000
日東工器	7,200	1,979.00	14,248,800

日進工具	13,700	985.00	13,494,500
パンチ工業	6,400	445.00	2,848,000
富士ダイス	8,700	675.00	5,872,500
土木管理総合試験所	3,100	329.00	1,019,900
日本郵政	1,766,200	1,483.00	2,619,274,600
ベルシステム24ホールディングス	16,100	1,560.00	25,116,000
鎌倉新書	12,800	585.00	7,488,000
S MN	1,300	387.00	503,100
一蔵	800	601.00	480,800
グローバルキッズCOMPANY	1,200	657.00	788,400
エアトリ	11,000	1,475.00	16,225,000
アトラエ	8,900	432.00	3,844,800
ストライク	6,400	5,060.00	32,384,000
ソラスト	41,400	523.00	21,652,200
セラク	4,600	1,102.00	5,069,200
インソース	32,600	823.00	26,829,800
豊田自動織機	124,700	14,905.00	1,858,653,500
豊和工業	3,600	822.00	2,959,200
石川製作所	1,700	1,347.00	2,289,900
リケンNPR	16,000	2,959.00	47,344,000
東洋機械金属	5,400	745.00	4,023,000
津田駒工業	1,200	401.00	481,200
エンシュウ	1,500	677.00	1,015,500
島精機製作所	23,500	1,348.00	31,678,000
オプトラン	24,300	2,036.00	49,474,800
NCホールディングス	1,600	1,690.00	2,704,000
イワキ	9,800	2,670.00	26,166,000
フリー	13,900	1,192.00	16,568,800
ヤマシンフィルタ	35,500	404.00	14,342,000
日阪製作所	16,100	1,034.00	16,647,400
やまびこ	24,100	1,857.00	44,753,700
野村マイクロ・サイエンス	5,000	19,640.00	98,200,000
平田機工	7,100	7,880.00	55,948,000
PEGASUS	16,300	520.00	8,476,000
マルマエ	6,400	2,092.00	13,388,800
タツモ	8,900	3,645.00	32,440,500
ナブテスコ	92,700	2,423.50	224,658,450
三井海洋開発	18,700	2,971.00	55,557,700
レオン自動機	17,100	1,399.00	23,922,900
S MC	44,200	86,530.00	3,824,626,000
ホソカワミクロン	9,500	4,505.00	42,797,500
ユニオンツール	6,500	4,345.00	28,242,500
瑞光	10,600	1,471.00	15,592,600
オイレス工業	20,100	2,229.00	44,802,900
日精エー・エス・ビー機械	5,900	4,575.00	26,992,500
サトーホールディングス	21,000	2,248.00	47,208,000
技研製作所	13,900	1,996.00	27,744,400
日本エアーテック	6,900	1,149.00	7,928,100
カワタ	2,000	1,045.00	2,090,000
日精樹脂工業	11,000	1,138.00	12,518,000

オカダアイヨン	2,200	2,844.00	6,256,800
ワイエイシイホールディングス	5,500	2,326.00	12,793,000
小松製作所	692,200	4,192.00	2,901,702,400
住友重機械工業	87,400	4,583.00	400,554,200
日立建機	58,800	4,226.00	248,488,800
日工	21,900	780.00	17,082,000
巴工業	5,800	3,840.00	22,272,000
井関農機	13,800	1,012.00	13,965,600
T O W A	16,400	9,270.00	152,028,000
丸山製作所	1,100	2,286.00	2,514,600
北川鉄工所	5,800	1,551.00	8,995,800
シンニッタン	8,600	286.00	2,459,600
ローツェ	7,700	20,900.00	160,930,000
タカキタ	2,200	482.00	1,060,400
クボタ	772,000	2,194.50	1,694,154,000
荏原実業	7,800	3,630.00	28,314,000
東洋エンジニアリング	21,100	890.00	18,779,000
三菱化工機	5,200	3,785.00	19,682,000
月島ホールディングス	20,000	1,431.00	28,620,000
帝国電機製作所	10,400	2,526.00	26,270,400
東京機械製作所	1,700	450.00	765,000
新東工業	29,900	1,134.00	33,906,600
澁谷工業	13,900	3,190.00	44,341,000
アイチコーポレーション	20,600	1,105.00	22,763,000
小森コーポレーション	36,400	1,263.00	45,973,200
鶴見製作所	11,300	3,590.00	40,567,000
日本ギア工業	2,500	591.00	1,477,500
酒井重工業	2,300	6,540.00	15,042,000
荏原製作所	60,600	13,375.00	810,525,000
石井鐵工所	800	2,720.00	2,176,000
西島製作所	12,700	2,621.00	33,286,700
北越工業	14,800	1,952.00	28,889,600
ダイキン工業	176,300	20,180.00	3,557,734,000
オルガノ	17,700	7,560.00	133,812,000
トーヨーカネツ	5,000	4,440.00	22,200,000
栗田工業	82,600	6,343.00	523,931,800
椿本チエイン	20,900	4,910.00	102,619,000
大同工業	2,900	754.00	2,186,600
日機装	34,100	1,248.00	42,556,800
木村化工機	11,300	693.00	7,830,900
レイズネクスト	20,800	2,236.00	46,508,800
アネスト岩田	22,800	1,272.00	29,001,600
ダイフク	249,200	3,388.00	844,289,600
サムコ	4,000	5,330.00	21,320,000
加藤製作所	3,300	1,432.00	4,725,600
油研工業	1,100	2,356.00	2,591,600
タダノ	85,000	1,244.00	105,740,000
フジテック	34,500	3,715.00	128,167,500
C K D	40,900	3,225.00	131,902,500
平和	43,700	2,028.00	88,623,600

理想科学工業	11,800	3,180.00	37,524,000
SANKYO	170,000	1,677.50	285,175,000
日本金銭機械	17,800	1,306.00	23,246,800
マースグループホールディングス	7,500	3,180.00	23,850,000
フクシマガリレイ	9,700	5,860.00	56,842,000
オーイズミ	2,500	396.00	990,000
ダイコク電機	7,300	3,970.00	28,981,000
竹内製作所	26,800	5,430.00	145,524,000
アマノ	41,900	3,645.00	152,725,500
JUKI	22,800	510.00	11,628,000
サンデン	9,800	160.00	1,568,000
ジャノメ	15,000	685.00	10,275,000
ブラザー工業	197,300	2,550.00	503,115,000
マックス	20,800	3,125.00	65,000,000
モリタホールディングス	25,700	1,618.00	41,582,600
グローリー	35,400	2,784.00	98,553,600
新晃工業	14,900	3,255.00	48,499,500
大和冷機工業	22,700	1,440.00	32,688,000
セガサミーホールディングス	131,900	1,798.50	237,222,150
TPR	18,700	2,092.00	39,120,400
ツバキ・ナカシマ	29,700	759.00	22,542,300
ホシザキ	87,100	4,879.00	424,960,900
大豊工業	12,800	868.00	11,110,400
日本精工	273,400	800.20	218,774,680
NTN	320,300	299.20	95,833,760
ジェイテクト	131,400	1,325.00	174,105,000
不二越	10,900	3,345.00	36,460,500
ミネベアミツミ	256,900	3,001.00	770,956,900
日本トムソン	40,300	638.00	25,711,400
THK	85,200	3,376.00	287,635,200
ユーシン精機	11,800	671.00	7,917,800
前澤給装工業	11,300	1,265.00	14,294,500
イーグル工業	16,300	1,770.00	28,851,000
前澤工業	4,200	1,059.00	4,447,800
日本ピラー工業	13,700	5,510.00	75,487,000
キッツ	49,500	1,291.00	63,904,500
日立製作所	709,700	12,485.00	8,860,604,500
三菱電機	1,643,600	2,443.50	4,016,136,600
富士電機	89,800	8,954.00	804,069,200
東洋電機製造	2,300	1,080.00	2,484,000
安川電機	160,400	6,382.00	1,023,672,800
シンフォニアテクノロジー	16,300	2,710.00	44,173,000
明電舎	27,400	2,733.00	74,884,200
オリジン	1,500	1,205.00	1,807,500
山洋電気	6,400	6,950.00	44,480,000
デンヨー	11,300	2,361.00	26,679,300
PHCホールディングス	27,600	1,243.00	34,306,800
KOKUSAI ELECTRIC	57,100	3,960.00	226,116,000
ソシオネクスト	107,200	3,645.00	390,744,000
ベイカレント・コンサルティング	110,500	3,170.00	350,285,000

Orchestra Holdings	3,200	1,032.00	3,302,400	
アイモバイル	20,100	416.00	8,361,600	
キャリアインデックス	2,300	187.00	430,100	
MS - Japan	5,500	1,182.00	6,501,000	
船場	1,400	1,259.00	1,762,600	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	48,700	2,357.00	114,785,900	
フルテック	1,000	1,106.00	1,106,000	
グリーンズ	2,400	2,098.00	5,035,200	
ツナググループ・ホールディングス	1,900	685.00	1,301,500	
GAMEWITH	2,800	298.00	834,400	
MS&Consulting	1,000	597.00	597,000	
ウェルビー	7,500	1,085.00	8,137,500	
エル・ティール・エス	1,700	2,587.00	4,397,900	
ミダックホールディングス	9,100	1,547.00	14,077,700	
キュービーネットホールディングス	8,600	1,212.00	10,423,200	
RPAホールディングス	20,400	277.00	5,650,800	
三櫻工業	22,300	1,038.00	23,147,400	
マキタ	168,400	3,991.00	672,084,400	
東芝テック	18,900	2,962.00	55,981,800	
芝浦メカトロニクス	8,400	6,230.00	52,332,000	
マブチモーター	72,600	2,707.50	196,564,500	
ニデック	326,000	5,581.00	1,819,406,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,300	353.00	3,282,900	
トレックス・セミコンダクター	7,600	1,860.00	14,136,000	
東光高岳	8,900	2,439.00	21,707,100	
ダブル・スコープ	42,300	705.00	29,821,500	
宮越ホールディングス	6,600	1,275.00	8,415,000	
ダイヘン	14,800	8,460.00	125,208,000	
ヤーマン	28,700	988.00	28,355,600	
JVCケンウッド	116,600	855.00	99,693,000	
ミマキエンジニアリング	14,000	1,049.00	14,686,000	
I - PEX	10,200	1,791.00	18,268,200	
大崎電気工業	32,300	666.00	21,511,800	
オムロン	112,800	5,583.00	629,762,400	
日東工業	19,900	4,330.00	86,167,000	
I D E C	21,800	2,738.00	59,688,400	
正興電機製作所	2,200	1,164.00	2,560,800	
不二電機工業	1,300	1,132.00	1,471,600	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	57,600	2,877.00	165,715,200	
サクサホールディングス	1,500	3,120.00	4,680,000	
メルコホールディングス	4,600	3,115.00	14,329,000	
テクノメディカ	3,500	1,746.00	6,111,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	5,500	643.00	3,536,500	
日本電気	193,900	9,921.00	1,923,681,900	
富士通	135,900	24,310.00	3,303,729,000	
沖電気工業	66,800	1,078.00	72,010,400	
岩崎通信機	3,100	646.00	2,002,600	

電気興業	6,600	2,072.00	13,675,200
サンケン電気	13,700	7,379.00	101,092,300
ナカヨ	1,100	1,165.00	1,281,500
アイホン	8,000	2,956.00	23,648,000
ルネサスエレクトロニクス	963,800	2,530.00	2,438,414,000
セイコーエプソン	189,500	2,402.00	455,179,000
ワコム	112,300	695.00	78,048,500
アルバック	32,400	9,370.00	303,588,000
アクセル	5,900	2,218.00	13,086,200
E I Z O	10,800	5,100.00	55,080,000
ジャパンディスプレイ	636,300	21.00	13,362,300
日本信号	33,700	998.00	33,632,600
京三製作所	30,900	499.00	15,419,100
能美防災	20,000	2,193.00	43,860,000
ホーチキ	11,000	2,175.00	23,925,000
星和電機	2,900	522.00	1,513,800
エレコム	35,300	1,546.00	54,573,800
パナソニック ホールディングス	1,744,500	1,396.00	2,435,322,000
シャープ	248,900	795.10	197,900,390
アンリツ	104,000	1,274.50	132,548,000
富士通ゼネラル	41,900	1,911.50	80,091,850
ソニーグループ	1,034,300	12,745.00	13,182,153,500
T D K	233,800	7,449.00	1,741,576,200
帝国通信工業	6,500	1,875.00	12,187,500
タムラ製作所	58,800	547.00	32,163,600
アルプスアルパイン	131,900	1,092.50	144,100,750
池上通信機	2,000	794.00	1,588,000
日本電波工業	17,700	1,317.00	23,310,900
鈴木	7,900	1,149.00	9,077,100
メイコー	14,700	4,885.00	71,809,500
日本トリム	3,300	3,745.00	12,358,500
ローランド ディー . ジー .	8,100	5,020.00	40,662,000
フォスター電機	10,900	1,139.00	12,415,100
S M K	3,800	2,535.00	9,633,000
ヨコオ	13,000	1,571.00	20,423,000
ティアック	10,600	100.00	1,060,000
ホシデン	33,600	1,895.00	63,672,000
ヒロセ電機	21,800	14,865.00	324,057,000
日本航空電子工業	35,300	2,535.00	89,485,500
T O A	16,800	1,123.00	18,866,400
マクセル	32,600	1,543.00	50,301,800
古野電気	19,200	2,202.00	42,278,400
スミダコーポレーション	19,800	1,146.00	22,690,800
アイコム	5,700	3,295.00	18,781,500
リオン	6,100	3,020.00	18,422,000
横河電機	161,600	3,362.00	543,299,200
新電元工業	5,600	3,065.00	17,164,000
アズビル	100,600	4,100.00	412,460,000
東亜ディーケーケー	3,100	928.00	2,876,800
日本光電工業	62,700	4,082.00	255,941,400

チノー	6,100	2,426.00	14,798,600
共和電業	6,100	408.00	2,488,800
日本電子材料	9,000	2,645.00	23,805,000
堀場製作所	27,900	14,760.00	411,804,000
アドバンテスト	418,900	6,599.00	2,764,321,100
小野測器	2,700	598.00	1,614,600
エスベック	11,700	2,830.00	33,111,000
キーエンス	146,300	70,780.00	10,355,114,000
日置電機	6,900	6,690.00	46,161,000
シスメックス	126,200	8,100.00	1,022,220,000
日本マイクロニクス	26,300	7,330.00	192,779,000
メガチップス	11,600	4,165.00	48,314,000
OBARA GROUP	8,000	3,685.00	29,480,000
IMAGICA GROUP	14,700	680.00	9,996,000
澤藤電機	800	1,289.00	1,031,200
デンソー	1,206,300	2,690.00	3,244,947,000
原田工業	2,900	748.00	2,169,200
コーセル	15,600	1,529.00	23,852,400
イリソ電子工業	13,400	3,035.00	40,669,000
オブテックスグループ	26,800	1,813.00	48,588,400
千代田インテグレ	5,700	2,575.00	14,677,500
レーザーテック	67,000	37,810.00	2,533,270,000
スタンレー電気	93,600	2,620.00	245,232,000
ウシオ電機	74,300	1,973.00	146,593,900
岡谷電機産業	5,000	273.00	1,365,000
ヘリオス テクノ ホールディング	6,500	569.00	3,698,500
エノモト	1,800	1,574.00	2,833,200
日本セラミック	11,900	2,618.00	31,154,200
遠藤照明	2,900	1,449.00	4,202,100
古河電池	10,700	984.00	10,528,800
双信電機	2,600	303.00	787,800
山一電機	13,100	2,262.00	29,632,200
図研	12,700	4,560.00	57,912,000
日本電子	36,600	6,281.00	229,884,600
カシオ計算機	105,600	1,180.00	124,608,000
ファナック	713,000	4,339.00	3,093,707,000
日本シイエムケイ	31,100	620.00	19,282,000
エンプラス	4,300	7,820.00	33,626,000
大真空	21,800	816.00	17,788,800
ローム	270,300	2,447.00	661,424,100
浜松ホトニクス	117,300	5,212.00	611,367,600
三井ハイテック	12,900	9,678.00	124,846,200
新光電気工業	51,700	5,665.00	292,880,500
京セラ	908,500	2,084.00	1,893,314,000
協栄産業	700	2,872.00	2,010,400
太陽誘電	71,200	3,295.00	234,604,000
村田製作所	1,330,300	2,848.50	3,789,359,550
双葉電子工業	27,800	501.00	13,927,800
日東電工	94,200	13,590.00	1,280,178,000
北陸電気工業	2,400	1,402.00	3,364,800



東海理化電機製作所	41,200	2,388.00	98,385,600	
ニチコン	38,400	1,238.00	47,539,200	
日本ケミコン	15,600	1,355.00	21,138,000	
K O A	22,100	1,462.00	32,310,200	
三井E & S	73,300	2,053.00	150,484,900	
日立造船	130,300	1,236.00	161,050,800	
三菱重工業	258,200	12,145.00	3,135,839,000	
川崎重工業	119,400	4,606.00	549,956,400	
I H I	109,900	3,507.00	385,419,300	
名村造船所	36,400	1,952.00	71,052,800	
サノヤホールディングス	9,600	233.00	2,236,800	
スプリックス	1,900	814.00	1,546,600	
マネジメントソリューションズ	6,400	2,804.00	17,945,600	
プロレド・パートナーズ	3,500	390.00	1,365,000	
and factory	2,000	310.00	620,000	
テノ・ホールディングス	800	451.00	360,800	
フロンティア・マネジメント	3,800	1,715.00	6,517,000	
ピアラ	1,200	315.00	378,000	
コプロ・ホールディングス	2,200	1,813.00	3,988,600	
ギークス	900	442.00	397,800	
アンビスホールディングス	16,100	2,432.00	39,155,200	
カーブスホールディングス	41,100	732.00	30,085,200	
フォーラムエンジニアリング	20,500	971.00	19,905,500	
FAST FITNESS JAPAN	5,100	899.00	4,584,900	
日本車輛製造	4,800	2,414.00	11,587,200	
三菱ロジスネクスト	23,300	1,680.00	39,144,000	
近畿車輛	900	2,534.00	2,280,600	
一家ホールディングス	1,700	707.00	1,201,900	
フルサト・マルカホールディングス	13,800	2,185.00	30,153,000	
ヤマエグループホールディングス	8,700	2,549.00	22,176,300	
ジャパクラフトホールディングス	4,900	166.00	813,400	
F P G	48,700	1,851.00	90,143,700	
島根銀行	1,900	553.00	1,050,700	
じもとホールディングス	5,600	673.00	3,768,800	
全国保証	37,700	5,399.00	203,542,300	
めぶきフィナンシャルグループ	714,500	475.20	339,530,400	
ジャパンインベストメントアドバイザー	23,400	909.00	21,270,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,400	4,725.00	86,940,000	
九州フィナンシャルグループ	278,700	1,138.50	317,299,950	
かんぽ生命保険	146,600	2,822.00	413,705,200	
ゆうちょ銀行	1,582,400	1,652.00	2,614,124,800	
あんしん保証	2,900	253.00	733,700	
富山第一銀行	45,700	974.00	44,511,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	772,700	751.30	580,529,510	
ジェイリース	8,600	1,299.00	11,171,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	81,300	1,964.00	159,673,200	

イントラスト	2,500	802.00	2,005,000	
日本モーゲージサービス	3,500	525.00	1,837,500	
CASA	2,500	805.00	2,012,500	
SBIアルヒ	13,800	925.00	12,765,000	
プレミアグループ	24,300	1,860.00	45,198,000	
日産自動車	1,973,100	530.70	1,047,124,170	
いすゞ自動車	425,100	1,961.50	833,833,650	
トヨタ自動車	8,028,600	3,498.00	28,084,042,800	
日野自動車	219,900	479.20	105,376,080	
三菱自動車工業	570,400	443.00	252,687,200	
エフテック	4,500	705.00	3,172,500	
レシップホールディングス	2,800	663.00	1,856,400	
GMB	1,300	1,097.00	1,426,100	
ファルテック	1,300	543.00	705,900	
武蔵精密工業	35,700	1,533.00	54,728,100	
日産車体	14,800	956.00	14,148,800	
新明和工業	42,100	1,197.00	50,393,700	
極東開発工業	24,200	2,492.00	60,306,400	
トビー工業	11,900	2,844.00	33,843,600	
ティラド	3,200	3,765.00	12,048,000	
曙ブレーキ工業	89,100	136.00	12,117,600	
タチエス	27,000	1,949.00	52,623,000	
NOK	56,800	1,991.50	113,117,200	
フタバ産業	39,200	1,016.00	39,827,200	
カヤバ	14,100	4,980.00	70,218,000	
市光工業	26,400	560.00	14,784,000	
大同メタル工業	28,600	606.00	17,331,600	
プレス工業	58,400	653.00	38,135,200	
ミクニ	8,200	466.00	3,821,200	
太平洋工業	33,500	1,442.00	48,307,000	
河西工業	10,300	224.00	2,307,200	
アイシン	112,800	5,442.00	613,857,600	
マツダ	483,600	1,579.00	763,604,400	
今仙電機製作所	4,100	635.00	2,603,500	
本田技研工業	3,565,600	1,725.00	6,150,660,000	
スズキ	268,500	6,128.00	1,645,368,000	
SUBARU	453,400	3,069.00	1,391,484,600	
安永	2,800	708.00	1,982,400	
ヤマハ発動機	631,900	1,328.50	839,479,150	
小糸製作所	151,500	1,875.00	284,062,500	
TBK	7,000	397.00	2,779,000	
エクセディ	23,900	2,913.00	69,620,700	
ミツバ	27,400	1,393.00	38,168,200	
豊田合成	41,900	2,991.50	125,343,850	
愛三工業	24,200	1,503.00	36,372,600	
盟和産業	900	1,021.00	918,900	
日本プラスト	5,500	544.00	2,992,000	
ヨロズ	13,700	954.00	13,069,800	
エフ・シー・シー	25,900	2,081.00	53,897,900	
新家工業	1,500	3,930.00	5,895,000	

シマノ	59,100	20,800.00	1,229,280,000	
テイ・エス テック	52,000	1,903.50	98,982,000	
三十三フィナンシャルグループ	12,900	1,999.00	25,787,100	
第四北越フィナンシャルグループ	22,600	4,360.00	98,536,000	
ひろぎんホールディングス	205,000	1,045.00	214,225,000	
マーキュリアホールディングス	3,300	893.00	2,946,900	
おきなわフィナンシャルグループ	12,300	2,620.00	32,226,000	
ダイレクトマーケティングミックス	15,500	319.00	4,944,500	
ポピンズ	2,200	1,393.00	3,064,600	
LITALICO	11,700	2,143.00	25,073,100	
コンフィデンス・インターワークス	600	1,639.00	983,400	
十六フィナンシャルグループ	18,700	4,700.00	87,890,000	
北國フィナンシャルホールディングス	15,200	4,805.00	73,036,000	
ネットプロテクションズホールディングス	47,700	222.00	10,589,400	
プロクレアホールディングス	16,500	1,901.00	31,366,500	
F Pパートナー	2,900	7,200.00	20,880,000	
あいちフィナンシャルグループ	22,200	2,606.00	57,853,200	
ジャムコ	7,100	1,188.00	8,434,800	
小野建	15,400	1,806.00	27,812,400	
はるやまホールディングス	3,300	652.00	2,151,600	
南陽	1,400	2,633.00	3,686,200	
ノジマ	44,900	1,665.00	74,758,500	
佐鳥電機	8,600	2,437.00	20,958,200	
カッパ・クリエイト	24,300	1,629.00	39,584,700	
エコートレーディング	1,300	1,190.00	1,547,000	
伯東	8,900	5,720.00	50,908,000	
コンドーテック	11,900	1,284.00	15,279,600	
中山福	3,900	364.00	1,419,600	
ライトオン	5,200	417.00	2,168,400	
ナガイレーベン	19,600	2,254.00	44,178,400	
三菱食品	14,300	5,380.00	76,934,000	
良品計画	168,900	2,315.50	391,087,950	
パリミキホールディングス	8,600	420.00	3,612,000	
松田産業	11,800	2,405.00	28,379,000	
第一興商	59,900	1,904.00	114,049,600	
メディバルホールディングス	157,300	2,200.50	346,138,650	
アドヴァングループ	14,700	1,211.00	17,801,700	
S P K	6,900	2,019.00	13,931,100	
萩原電気ホールディングス	6,600	4,390.00	28,974,000	
アルピス	5,000	2,669.00	13,345,000	
アズワン	24,200	5,060.00	122,452,000	
スズデン	5,400	2,158.00	11,653,200	
尾家産業	1,600	1,679.00	2,686,400	
シモジマ	10,400	1,336.00	13,894,400	
ドウシシャ	14,300	2,115.00	30,244,500	
小津産業	1,500	1,704.00	2,556,000	
コナカ	7,400	408.00	3,019,200	
高速	9,200	2,405.00	22,126,000	
ハウス オブ ローゼ	900	1,639.00	1,475,100	

G - 7ホールディングス	16,900	1,347.00	22,764,300
たけびし	5,900	1,917.00	11,310,300
イオン北海道	45,700	889.00	40,627,300
コジマ	25,600	740.00	18,944,000
ヒマラヤ	2,200	911.00	2,004,200
コーナン商事	19,000	4,000.00	76,000,000
ネットワンシステムズ	59,200	2,715.50	160,757,600
エコス	5,700	2,230.00	12,711,000
ワタミ	16,400	979.00	16,055,600
マルシェ	2,500	235.00	587,500
リックス	2,600	3,880.00	10,088,000
システムソフト	50,800	58.00	2,946,400
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	312,400	3,521.00	1,099,960,400
丸文	13,800	1,441.00	19,885,800
西松屋チェーン	30,400	2,429.00	73,841,600
ゼンショーホールディングス	78,800	6,246.00	492,184,800
ハビネット	13,200	3,160.00	41,712,000
幸楽苑ホールディングス	11,400	1,422.00	16,210,800
ハークスレイ	2,400	893.00	2,143,200
橋本総業ホールディングス	6,100	1,441.00	8,790,100
日本ライフライン	45,400	1,243.00	56,432,200
サイゼリヤ	22,900	5,050.00	115,645,000
タカショー	13,500	551.00	7,438,500
V Tホールディングス	58,800	517.00	30,399,600
アルゴグラフィックス	13,500	4,185.00	56,497,500
魚力	5,400	2,373.00	12,814,200
I D O M	40,900	958.00	39,182,200
日本エム・ディ・エム	11,600	707.00	8,201,200
ポブラ	1,800	261.00	469,800
フジ・コーポレーション	7,400	1,689.00	12,498,600
ユナイテッドアローズ	18,200	1,900.00	34,580,000
進和	9,500	2,516.00	23,902,000
エスケイジャパン	1,700	695.00	1,181,500
ダイトロン	6,100	3,240.00	19,764,000
ハイデイ日高	22,900	2,545.00	58,280,500
シークス	22,000	1,618.00	35,596,000
Y U - W A C R E A T I O N H O L D I N G S	3,700	153.00	566,100
コロワイド	66,500	2,208.50	146,865,250
田中商事	1,900	821.00	1,559,900
オーハシテクニカ	8,100	1,699.00	13,761,900
壱番屋	61,000	1,196.00	72,956,000
白銅	4,500	2,576.00	11,592,000
トップカルチャー	2,200	159.00	349,800
P L A N T	1,500	1,760.00	2,640,000
スギホールディングス	93,600	2,461.50	230,396,400
ダイコー通産	700	1,244.00	870,800
薬王堂ホールディングス	7,600	2,740.00	20,824,000
島津製作所	194,300	4,185.00	813,145,500

JMS	13,400	536.00	7,182,400
クボテック	1,800	227.00	408,600
長野計器	10,600	2,338.00	24,782,800
ブイ・テクノロジー	7,700	2,501.00	19,257,700
スター精密	27,500	1,747.00	48,042,500
東京計器	11,200	2,532.00	28,358,400
愛知時計電機	6,300	2,370.00	14,931,000
インターアクション	8,800	1,227.00	10,797,600
オーバル	5,700	539.00	3,072,300
東京精密	29,900	11,420.00	341,458,000
マニー	58,500	2,031.00	118,813,500
ニコン	211,400	1,541.00	325,767,400
トプコン	71,100	1,688.50	120,052,350
オリンパス	900,000	2,195.50	1,975,950,000
理研計器	10,400	7,420.00	77,168,000
SCREENホールディングス	50,000	17,625.00	881,250,000
キヤノン電子	16,200	2,469.00	39,997,800
タムロン	9,000	6,430.00	57,870,000
HOYA	287,800	19,270.00	5,545,906,000
シード	3,300	658.00	2,171,400
ノーリツ鋼機	13,900	3,040.00	42,256,000
A&Dホロンホールディングス	21,300	2,401.00	51,141,300
朝日インテック	178,200	2,984.50	531,837,900
キヤノン	729,300	4,403.00	3,211,107,900
リコー	366,600	1,251.50	458,799,900
シチズン時計	134,500	993.00	133,558,500
リズム	1,500	3,830.00	5,745,000
大研医器	5,600	556.00	3,113,600
メニコン	50,300	1,599.00	80,429,700
シンシア	800	509.00	407,200
KYORITSU	9,700	188.00	1,823,600
中本パックス	2,100	1,636.00	3,435,600
スノーピーク	20,800	1,247.00	25,937,600
パラマウントベッドホールディングス	30,400	2,539.00	77,185,600
トランザクション	9,600	2,322.00	22,291,200
粧美堂	1,800	620.00	1,116,000
ニホンフラッシュ	13,700	963.00	13,193,100
前田工織	12,400	3,485.00	43,214,000
永大産業	7,500	285.00	2,137,500
アートネイチャー	13,200	758.00	10,005,600
フルヤ金属	3,500	10,330.00	36,155,000
バンダイナムコホールディングス	400,600	2,887.00	1,156,532,200
アイフィスジャパン	1,900	616.00	1,170,400
SHOEI	33,100	2,109.00	69,807,900
フランスベッドホールディングス	19,000	1,288.00	24,472,000
マーベラス	23,800	713.00	16,969,400
パイロットコーポレーション	20,600	3,729.00	76,817,400
萩原工業	9,800	1,479.00	14,494,200
エイベックス	25,000	1,287.00	32,175,000
フジシールインターナショナル	29,600	1,956.00	57,897,600

タカラトミー	66,600	2,675.50	178,188,300
広済堂ホールディングス	37,600	640.00	24,064,000
エステールホールディングス	1,700	664.00	1,128,800
レック	18,800	1,107.00	20,811,600
タカノ	2,400	996.00	2,390,400
三光合成	18,500	672.00	12,432,000
プロネクサス	15,200	1,231.00	18,711,200
ホクシン	4,800	118.00	566,400
ウッドワン	2,400	1,017.00	2,440,800
きもと	10,700	223.00	2,386,100
TOPPANホールディングス	179,700	3,557.00	639,192,900
大日本印刷	159,800	4,550.00	727,090,000
共同印刷	4,100	3,290.00	13,489,000
NISSHA	25,000	1,401.00	35,025,000
光村印刷	500	1,594.00	797,000
藤森工業	11,600	3,830.00	44,428,000
ヴィア・ホールディングス	10,200	129.00	1,315,800
TAKARA & COMPANY	8,600	2,790.00	23,994,000
前澤化成工業	9,400	1,659.00	15,594,600
未来工業	5,300	4,640.00	24,592,000
アシックス	124,600	6,299.00	784,855,400
ツツミ	2,400	2,086.00	5,006,400
ウェーブロックホールディングス	2,400	671.00	1,610,400
JSP	10,300	2,156.00	22,206,800
ニチハ	18,400	3,375.00	62,100,000
ローランド	10,800	4,665.00	50,382,000
エフピコ	27,700	2,763.00	76,535,100
小松ウオール工業	6,000	3,285.00	19,710,000
ヤマハ	92,200	3,193.00	294,394,600
河合楽器製作所	4,400	3,405.00	14,982,000
クリナップ	14,300	775.00	11,082,500
ピジョン	93,100	1,526.50	142,117,150
天馬	10,700	2,325.00	24,877,500
キングジム	13,000	883.00	11,479,000
象印マホービン	39,700	1,417.00	56,254,900
リンテック	29,400	3,170.00	93,198,000
信越ポリマー	31,600	1,508.00	47,652,800
東リ	14,400	390.00	5,616,000
イトーキ	30,000	1,558.00	46,740,000
任天堂	923,100	8,312.00	7,672,807,200
三菱鉛筆	20,800	2,417.00	50,273,600
松風	6,600	2,714.00	17,912,400
タカラスタANDARD	30,800	1,879.00	57,873,200
コクヨ	59,900	2,351.00	140,824,900
ナカバヤシ	15,700	537.00	8,430,900
ニフコ	43,900	3,621.00	158,961,900
立川ブラインド工業	6,800	1,492.00	10,145,600
グローブライド	13,100	1,997.00	26,160,700
オカムラ	44,100	2,114.00	93,227,400
バルカー	12,300	4,825.00	59,347,500

MUTOHホールディングス	900	2,275.00	2,047,500	
伊藤忠商事	1,039,900	6,385.00	6,639,761,500	
丸紅	1,289,800	2,434.00	3,139,373,200	
スクロール	23,000	947.00	21,781,000	
高島	4,700	1,298.00	6,100,600	
ヨンドシーホールディングス	14,600	1,873.00	27,345,800	
三陽商会	5,500	2,567.00	14,118,500	
長瀬産業	70,900	2,475.00	175,477,500	
ナイガイ	2,100	261.00	548,100	
蝶理	9,700	3,205.00	31,088,500	
豊田通商	135,500	9,411.00	1,275,190,500	
オンワードホールディングス	86,300	522.00	45,048,600	
三共生興	21,500	766.00	16,469,000	
兼松	64,700	2,452.00	158,644,400	
美津濃	14,500	5,520.00	80,040,000	
ツカモトコーポレーション	1,000	1,291.00	1,291,000	
ルックホールディングス	4,100	2,524.00	10,348,400	
三井物産	1,165,600	6,522.00	7,602,043,200	
日本紙パルプ商事	7,400	5,220.00	38,628,000	
東京エレクトロン	309,500	37,150.00	11,497,925,000	
カメイ	16,400	2,019.00	33,111,600	
東都水産	400	6,600.00	2,640,000	
OUGホールディングス	1,000	2,522.00	2,522,000	
スターゼン	10,700	2,783.00	29,778,100	
セイコーグループ	20,400	3,885.00	79,254,000	
山善	46,900	1,309.00	61,392,100	
椿本興業	3,100	6,730.00	20,863,000	
住友商事	936,300	3,462.00	3,241,470,600	
BIPROGY	48,000	4,565.00	219,120,000	
内田洋行	6,300	6,910.00	43,533,000	
三菱商事	2,970,300	3,235.00	9,608,920,500	
第一実業	14,600	2,112.00	30,835,200	
キヤノンマーケティングジャパン	35,800	4,361.00	156,123,800	
西華産業	6,100	3,175.00	19,367,500	
佐藤商事	10,900	1,740.00	18,966,000	
菱洋エレクトロ	14,700	3,850.00	56,595,000	
東京産業	14,100	715.00	10,081,500	
ユアサ商事	12,100	4,850.00	58,685,000	
神鋼商事	3,900	6,920.00	26,988,000	
トルク	3,700	291.00	1,076,700	
阪和興業	27,800	5,490.00	152,622,000	
正栄食品工業	10,300	4,730.00	48,719,000	
カナデン	11,600	1,501.00	17,411,600	
RYODEN	12,500	2,556.00	31,950,000	
ニプロ	121,900	1,187.50	144,756,250	
岩谷産業	35,200	7,847.00	276,214,400	
ナイス	2,100	1,576.00	3,309,600	
ニチモウ	2,200	2,165.00	4,763,000	
極東貿易	9,200	2,174.00	20,000,800	
アステナホールディングス	29,000	471.00	13,659,000	

三愛オブリ	37,200	2,014.00	74,920,800
稲畑産業	30,600	3,125.00	95,625,000
G S Iクレオス	8,300	2,343.00	19,446,900
明和産業	18,300	641.00	11,730,300
クワザワホールディングス	2,500	844.00	2,110,000
キムラタン	42,800	18.00	770,400
ゴールドウイン	25,900	9,728.00	251,955,200
ユニ・チャーム	305,500	4,885.00	1,492,367,500
デサント	25,200	3,465.00	87,318,000
キング	2,500	702.00	1,755,000
ワキタ	25,600	1,535.00	39,296,000
ヤマトインターナショナル	5,100	298.00	1,519,800
東邦ホールディングス	42,800	3,337.00	142,823,600
サンゲツ	35,600	3,300.00	117,480,000
ミツウロコグループホールディングス	19,800	1,401.00	27,739,800
シナネンホールディングス	4,300	4,560.00	19,608,000
伊藤忠エネクス	38,400	1,522.00	58,444,800
サンリオ	43,800	8,394.00	367,657,200
サンワテクノス	7,900	2,343.00	18,509,700
リョーサン	10,900	5,000.00	54,500,000
新光商事	20,800	1,198.00	24,918,400
トーヨー	6,000	2,921.00	17,526,000
三信電気	6,200	2,206.00	13,677,200
東陽テクニカ	15,700	1,475.00	23,157,500
モスフードサービス	22,800	3,490.00	79,572,000
加賀電子	14,100	6,220.00	87,702,000
三益半導体工業	13,600	3,095.00	42,092,000
都築電気	7,700	2,375.00	18,287,500
ソーダニッカ	13,100	1,217.00	15,942,700
立花エレテック	10,300	3,125.00	32,187,500
木曾路	23,400	2,699.00	63,156,600
S R Sホールディングス	25,500	1,209.00	30,829,500
千趣会	28,400	283.00	8,037,200
リテールパートナーズ	23,000	1,740.00	40,020,000
上新電機	15,300	2,317.00	35,450,100
日本瓦斯	82,000	2,508.00	205,656,000
ロイヤルホールディングス	27,300	2,416.00	65,956,800
東天紅	500	868.00	434,000
いなげや	15,000	1,349.00	20,235,000
チヨダ	14,800	865.00	12,802,000
ライフコーポレーション	16,200	3,770.00	61,074,000
リンガーハット	20,000	2,350.00	47,000,000
MrMaxHD	19,500	608.00	11,856,000
テンアライド	9,100	311.00	2,830,100
A O K Iホールディングス	33,200	1,095.00	36,354,000
オークワ	22,200	859.00	19,069,800
コメリ	23,800	3,430.00	81,634,000
青山商事	33,100	1,638.00	54,217,800
しまむら	36,400	8,468.00	308,235,200
はせがわ	3,300	348.00	1,148,400



高島屋	106,900	2,182.50	233,309,250
松屋	26,200	976.00	25,571,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	68,500	1,782.00	122,067,000
近鉄百貨店	6,600	2,375.00	15,675,000
丸井グループ	102,700	2,362.50	242,628,750
クレディセゾン	91,300	3,037.00	277,278,100
アクシアル リテイリング	10,600	4,075.00	43,195,000
井筒屋	3,200	343.00	1,097,600
イオン	524,400	3,644.00	1,910,913,600
イズミ	27,400	3,465.00	94,941,000
フォーバル	6,100	1,190.00	7,259,000
平和堂	25,900	2,015.00	52,188,500
フジ	23,700	1,851.00	43,868,700
ヤオコー	17,500	8,948.00	156,590,000
ゼビオホールディングス	21,000	978.00	20,538,000
ケーズホールディングス	103,900	1,296.50	134,706,350
PALTAC	20,900	4,099.00	85,669,100
三谷産業	27,000	393.00	10,611,000
Olympicグループ	3,000	510.00	1,530,000
日産東京販売ホールディングス	10,300	510.00	5,253,000
あおぞら銀行	103,500	2,566.00	265,581,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,769,700	1,568.00	13,750,889,600
りそなホールディングス	1,665,300	897.10	1,493,940,630
三井住友トラスト・ホールディングス	517,500	3,228.00	1,670,490,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,023,900	8,772.00	8,981,650,800
千葉銀行	401,300	1,228.50	492,997,050
群馬銀行	279,500	841.90	235,311,050
武蔵野銀行	20,100	2,963.00	59,556,300
千葉興業銀行	27,200	1,032.00	28,070,400
筑波銀行	63,100	312.00	19,687,200
七十七銀行	41,900	3,905.00	163,619,500
秋田銀行	9,600	2,128.00	20,428,800
山形銀行	16,000	1,199.00	19,184,000
岩手銀行	9,100	2,619.00	23,832,900
東邦銀行	113,700	349.00	39,681,300
東北銀行	3,100	1,272.00	3,943,200
ふくおかフィナンシャルグループ	125,400	4,057.00	508,747,800
スルガ銀行	126,900	856.00	108,626,400
八十二銀行	309,000	997.10	308,103,900
山梨中央銀行	16,100	1,942.00	31,266,200
大垣共立銀行	27,400	2,222.00	60,882,800
福井銀行	12,900	1,913.00	24,677,700
清水銀行	5,700	1,597.00	9,102,900
富山銀行	1,100	1,872.00	2,059,200
滋賀銀行	24,000	4,050.00	97,200,000
南都銀行	21,700	2,936.00	63,711,200
百五銀行	135,500	668.00	90,514,000
紀陽銀行	51,500	1,833.00	94,399,500
ほくほくフィナンシャルグループ	89,100	1,847.00	164,567,700
山陰合同銀行	90,200	1,195.00	107,789,000

鳥取銀行	2,200	1,486.00	3,269,200
百十四銀行	14,200	2,869.00	40,739,800
四国銀行	21,200	1,197.00	25,376,400
阿波銀行	20,200	2,782.00	56,196,400
大分銀行	8,700	2,890.00	25,143,000
宮崎銀行	8,700	2,907.00	25,290,900
佐賀銀行	8,500	2,092.00	17,782,000
琉球銀行	30,700	1,195.00	36,686,500
セブン銀行	451,400	297.50	134,291,500
みずほフィナンシャルグループ	1,943,700	3,002.00	5,834,987,400
高知銀行	2,200	1,017.00	2,237,400
山口フィナンシャルグループ	141,200	1,592.50	224,861,000
芙蓉総合リース	13,300	12,925.00	171,902,500
みずほリース	24,100	5,250.00	126,525,000
東京センチュリー	107,600	1,515.00	163,014,000
SBIホールディングス	211,000	3,828.00	807,708,000
日本証券金融	52,900	1,634.00	86,438,600
アイフル	212,000	401.00	85,012,000
日本アジア投資	4,700	229.00	1,076,300
名古屋銀行	9,300	6,760.00	62,868,000
北洋銀行	218,200	460.00	100,372,000
大光銀行	2,100	1,542.00	3,238,200
愛媛銀行	19,400	1,122.00	21,766,800
トマト銀行	2,300	1,336.00	3,072,800
京葉銀行	60,400	763.00	46,085,200
栃木銀行	71,900	369.00	26,531,100
北日本銀行	4,700	2,336.00	10,979,200
東和銀行	26,400	700.00	18,480,000
福島銀行	6,600	284.00	1,874,400
大東銀行	2,700	788.00	2,127,600
リコーリース	13,700	5,210.00	71,377,000
イオンフィナンシャルサービス	82,700	1,305.00	107,923,500
アコム	257,100	387.00	99,497,700
ジャックス	15,300	5,300.00	81,090,000
オリエントコーポレーション	47,000	1,070.00	50,290,000
オリックス	863,600	3,150.00	2,720,340,000
三菱HCキャピタル	641,600	1,019.00	653,790,400
ジャフコグループ	42,900	1,734.00	74,388,600
九州リースサービス	2,600	1,493.00	3,881,800
トモニホールディングス	136,300	421.00	57,382,300
大和証券グループ本社	1,115,500	1,079.00	1,203,624,500
野村ホールディングス	2,421,500	885.80	2,144,964,700
岡三証券グループ	126,500	777.00	98,290,500
丸三証券	47,900	1,006.00	48,187,400
東洋証券	38,200	391.00	14,936,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	171,000	596.00	101,916,000
光世証券	1,400	761.00	1,065,400
水戸証券	42,500	486.00	20,655,000
いちよし証券	27,000	807.00	21,789,000

松井証券	70,900	847.00	60,052,300
S O M P Oホールディングス	216,600	9,195.00	1,991,637,000
日本取引所グループ	375,700	3,953.00	1,485,142,100
マネックスグループ	141,000	915.00	129,015,000
極東証券	19,700	1,083.00	21,335,100
岩井コスモホールディングス	16,400	2,226.00	36,506,400
アイザワ証券グループ	20,800	1,201.00	24,980,800
フィデアホールディングス	14,900	1,613.00	24,033,700
池田泉州ホールディングス	199,700	398.00	79,480,600
アニコムホールディングス	48,900	568.00	27,775,200
M S & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	322,400	7,850.00	2,530,840,000
マネーパートナーズグループ	6,700	294.00	1,969,800
スパークス・グループ	16,100	1,916.00	30,847,600
小林洋行	2,900	281.00	814,900
第一生命ホールディングス	703,600	3,621.00	2,547,735,600
東京海上ホールディングス	1,423,400	4,455.00	6,341,247,000
アドバンテッジリスクマネジメント	3,400	422.00	1,434,800
イー・ギャランティ	23,400	1,890.00	44,226,000
アサックス	3,000	757.00	2,271,000
N E Cキャピタルソリューション	7,100	3,805.00	27,015,500
T & Dホールディングス	386,700	2,646.50	1,023,401,550
アドバンスクリエイト	8,300	1,007.00	8,358,100
三井不動産	665,900	4,181.00	2,784,127,900
三菱地所	941,300	2,383.00	2,243,117,900
平和不動産	23,400	3,625.00	84,825,000
東京建物	125,800	2,080.00	261,664,000
京阪神ビルディング	26,900	1,480.00	39,812,000
住友不動産	208,200	4,391.00	914,206,200
太平洋興発	2,500	832.00	2,080,000
テーオーシー	25,700	645.00	16,576,500
レオパレス21	144,100	480.00	69,168,000
スターツコーポレーション	20,700	2,860.00	59,202,000
フジ住宅	18,100	712.00	12,887,200
空港施設	20,300	601.00	12,200,300
明和地所	8,200	1,060.00	8,692,000
ゴールドクレスト	11,700	2,239.00	26,196,300
リログループ	75,300	1,178.00	88,703,400
エスリード	6,800	3,430.00	23,324,000
日神グループホールディングス	23,100	515.00	11,896,500
日本エスコン	26,900	994.00	26,738,600
M I R A R T Hホールディングス	66,100	483.00	31,926,300
A V A N T I A	3,500	835.00	2,922,500
イオンモール	74,600	1,736.50	129,542,900
毎日コムネット	2,400	760.00	1,824,000
ファースト住建	2,500	1,079.00	2,697,500
ランド	798,500	7.00	5,589,500
カチタス	38,700	1,946.00	75,310,200
東祥	10,500	750.00	7,875,000
トーセイ	24,000	2,088.00	50,112,000

穴吹興産	1,500	2,041.00	3,061,500
サンフロンティア不動産	21,300	1,628.00	34,676,400
FJネクストホールディングス	15,200	1,312.00	19,942,400
インテリックス	1,500	553.00	829,500
ランドビジネス	2,400	265.00	636,000
サンネクスタグループ	2,100	1,016.00	2,133,600
グランディハウス	10,800	652.00	7,041,600
東武鉄道	160,600	3,858.00	619,594,800
相鉄ホールディングス	52,300	2,679.00	140,111,700
東急	410,000	1,930.50	791,505,000
京浜急行電鉄	180,900	1,285.50	232,546,950
小田急電鉄	241,800	2,087.50	504,757,500
京王電鉄	70,300	4,167.00	292,940,100
京成電鉄	94,300	6,507.00	613,610,100
富士急行	18,000	3,870.00	69,660,000
東日本旅客鉄道	268,600	8,764.00	2,354,010,400
西日本旅客鉄道	173,400	6,190.00	1,073,346,000
東海旅客鉄道	563,200	3,816.00	2,149,171,200
西武ホールディングス	176,900	2,167.00	383,342,300
鴻池運輸	24,900	1,843.00	45,890,700
西日本鉄道	39,100	2,361.00	92,315,100
ハマキョウレックス	12,500	3,615.00	45,187,500
サカイ引越センター	16,200	2,531.00	41,002,200
近鉄グループホールディングス	146,000	4,499.00	656,854,000
阪急阪神ホールディングス	194,700	4,345.00	845,971,500
南海電気鉄道	65,100	3,064.00	199,466,400
京阪ホールディングス	80,500	3,351.00	269,755,500
神戸電鉄	4,000	2,870.00	11,480,000
名古屋鉄道	150,600	2,128.50	320,552,100
山陽電気鉄道	11,000	2,128.00	23,408,000
アルプス物流	11,700	2,624.00	30,700,800
トランコム	4,200	6,020.00	25,284,000
ヤマトホールディングス	186,900	2,162.50	404,171,250
山九	37,100	5,199.00	192,882,900
日新	11,100	2,800.00	31,080,000
丸運	3,700	278.00	1,028,600
丸全昭和運輸	9,000	4,540.00	40,860,000
センコーグループホールディングス	77,300	1,105.00	85,416,500
トナミホールディングス	3,200	4,325.00	13,840,000
ニッコンホールディングス	46,700	2,946.00	137,578,200
日本石油輸送	700	2,821.00	1,974,700
福山通運	16,700	3,935.00	65,714,500
セイノーホールディングス	82,100	2,118.00	173,887,800
エスライングループ本社	1,800	893.00	1,607,400
神奈川中央交通	4,000	3,065.00	12,260,000
AZ-COM丸和ホールディングス	37,300	1,383.00	51,585,900
C&Fロジホールディングス	14,100	1,927.00	27,170,700
日本郵船	418,400	4,452.00	1,862,716,800
商船三井	316,800	4,789.00	1,517,155,200
川崎汽船	117,200	6,699.00	785,122,800

NSユニテッド海運	7,900	5,020.00	39,658,000
明海グループ	7,100	795.00	5,644,500
飯野海運	53,600	1,262.00	67,643,200
共栄タンカー	1,200	1,095.00	1,314,000
九州旅客鉄道	103,200	3,505.00	361,716,000
SGホールディングス	245,100	1,922.50	471,204,750
NIPPON EXPRESSホールディングス	49,500	7,565.00	374,467,500
ID&Eホールディングス	9,100	3,865.00	35,171,500
日本航空	358,500	2,736.00	980,856,000
ANAホールディングス	397,200	3,124.00	1,240,852,800
ビーウィズ	3,100	2,093.00	6,488,300
パスコ	1,300	1,853.00	2,408,900
TREホールディングス	28,800	1,232.00	35,481,600
人・夢・技術グループ	5,700	1,707.00	9,729,900
西本Wismettacホールディングス	3,900	5,600.00	21,840,000
シルバーライフ	3,000	860.00	2,580,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	600	2,510.00	1,506,000
Genky DrugStores	6,800	6,350.00	43,180,000
コア商事ホールディングス	10,900	772.00	8,414,800
KPPグループホールディングス	40,000	683.00	27,320,000
ナルミヤ・インターナショナル	1,100	1,144.00	1,258,400
ブックオフグループホールディングス	9,000	1,322.00	11,898,000
ギフトホールディングス	6,500	2,952.00	19,188,000
三菱倉庫	35,900	4,600.00	165,140,000
三井倉庫ホールディングス	13,600	4,530.00	61,608,000
住友倉庫	39,400	2,525.00	99,485,000
澁澤倉庫	6,700	2,928.00	19,617,600
ヤマタネ	6,800	2,745.00	18,666,000
東陽倉庫	1,700	1,508.00	2,563,600
乾汽船	17,100	1,024.00	17,510,400
日本トランスシティ	29,400	625.00	18,375,000
ケイヒン	1,100	1,975.00	2,172,500
中央倉庫	7,800	1,140.00	8,892,000
川西倉庫	1,300	1,176.00	1,528,800
安田倉庫	10,000	1,206.00	12,060,000
ファイズホールディングス	900	1,153.00	1,037,700
NISSOホールディングス	13,000	856.00	11,128,000
大栄環境	27,300	2,589.00	70,679,700
日本管財ホールディングス	15,800	2,576.00	40,700,800
東洋埠頭	1,900	1,365.00	2,593,500
上組	67,400	3,310.00	223,094,000
サンリツ	1,600	778.00	1,244,800
キムラユニティー	3,100	1,580.00	4,898,000
キューソー流通システム	6,600	1,011.00	6,672,600
東海運	3,800	302.00	1,147,600
エーアイティー	9,200	1,695.00	15,594,000
内外トランスライン	5,800	2,346.00	13,606,800
ショーエイコーポレーション	2,100	624.00	1,310,400

日本コンセプト	5,300	1,766.00	9,359,800
TBSホールディングス	73,700	3,964.00	292,146,800
日本テレビホールディングス	129,800	2,171.50	281,860,700
朝日放送グループホールディングス	13,700	667.00	9,137,900
テレビ朝日ホールディングス	35,600	2,015.00	71,734,000
スカパーJ S A Tホールディングス	113,900	934.00	106,382,600
テレビ東京ホールディングス	10,600	2,969.00	31,471,400
日本BS放送	2,400	889.00	2,133,600
ビジョン	22,100	1,173.00	25,923,300
スマートバリュー	1,900	408.00	775,200
USEN-NEXT HOLDINGS	16,400	4,670.00	76,588,000
ワイヤレスゲート	2,800	214.00	599,200
日本通信	144,300	212.00	30,591,600
クロップス	900	1,008.00	907,200
日本電信電話	43,620,300	182.40	7,956,342,720
KDDI	1,133,200	4,565.00	5,173,058,000
ソフトバンク	2,360,000	1,974.50	4,659,820,000
光通信	14,800	26,530.00	392,644,000
エムティーアイ	10,100	741.00	7,484,100
GMOインターネットグループ	54,200	2,858.00	154,903,600
ファイバーゲート	7,900	1,034.00	8,168,600
アйдママーケティングコミュニケーション	1,800	237.00	426,600
KADOKAWA	77,500	2,789.50	216,186,250
学研ホールディングス	24,400	930.00	22,692,000
ゼンリン	25,100	835.00	20,958,500
昭文社ホールディングス	2,900	387.00	1,122,300
インプレスホールディングス	6,600	172.00	1,135,200
東京電力ホールディングス	1,318,000	789.80	1,040,956,400
中部電力	538,800	1,878.00	1,011,866,400
関西電力	564,600	1,936.00	1,093,065,600
中国電力	254,000	1,067.50	271,145,000
北陸電力	149,500	749.40	112,035,300
東北電力	384,900	1,063.50	409,341,150
四国電力	136,200	1,121.00	152,680,200
九州電力	337,000	1,266.50	426,810,500
北海道電力	141,200	723.00	102,087,600
沖縄電力	37,300	1,123.00	41,887,900
電源開発	120,100	2,505.50	300,910,550
エフオン	10,600	405.00	4,293,000
イーレックス	26,000	720.00	18,720,000
レノバ	39,000	1,130.00	44,070,000
東京瓦斯	309,100	3,407.00	1,053,103,700
大阪瓦斯	296,200	3,360.00	995,232,000
東邦瓦斯	63,300	3,158.00	199,901,400
北海道瓦斯	8,700	2,302.00	20,027,400
広島ガス	30,900	383.00	11,834,700
西部ガスホールディングス	15,300	1,908.00	29,192,400
静岡ガス	29,200	930.00	27,156,000

メタウォーター	17,500	2,232.00	39,060,000
M & A 総研ホールディングス	7,200	6,970.00	50,184,000
アイネット	8,900	2,068.00	18,405,200
松竹	7,600	9,910.00	75,316,000
東宝	81,600	4,902.00	400,003,200
エイチ・アイ・エス	43,700	1,760.00	76,912,000
東映	4,800	19,100.00	91,680,000
ラックランド	6,800	2,299.00	15,633,200
NTTデータグループ	383,400	2,369.00	908,274,600
共立メンテナンス	23,600	6,066.00	143,157,600
イチネンホールディングス	16,000	1,625.00	26,000,000
建設技術研究所	7,700	5,360.00	41,272,000
スペース	9,800	1,031.00	10,103,800
アインホールディングス	21,300	5,496.00	117,064,800
燦ホールディングス	14,100	1,015.00	14,311,500
ピー・シー・エー	8,400	1,651.00	13,868,400
スバル興業	3,000	3,060.00	9,180,000
東京テアトル	2,400	1,132.00	2,716,800
タナベコンサルティンググループ	5,200	1,027.00	5,340,400
ビジネスブレイン太田昭和	5,700	2,165.00	12,340,500
ナガワ	4,700	7,250.00	34,075,000
東京都競馬	12,600	4,285.00	53,991,000
常磐興産	2,500	1,243.00	3,107,500
カナモト	23,300	2,614.00	60,906,200
D T S	30,900	3,995.00	123,445,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	67,000	6,008.00	402,536,000
シーイーシー	18,500	1,551.00	28,693,500
カブコン	131,100	6,132.00	803,905,200
ニシオホールディングス	14,000	3,875.00	54,250,000
アイ・エス・ビー	7,500	1,391.00	10,432,500
アゴラ ホスピタリティグループ	43,400	55.00	2,387,000
日本空港ビルデング	50,900	5,643.00	287,228,700
トランス・コスモス	18,700	3,055.00	57,128,500
乃村工藝社	65,600	884.00	57,990,400
ジャステック	9,000	1,400.00	12,600,000
S C S K	102,600	2,811.00	288,408,600
藤田観光	6,000	6,120.00	36,720,000
K N T - C Tホールディングス	9,000	1,243.00	11,187,000
トーカイ	13,300	2,173.00	28,900,900
白洋舎	1,000	2,645.00	2,645,000
セコム	153,100	11,235.00	1,720,078,500
N S W	6,300	3,190.00	20,097,000
セントラル警備保障	8,100	2,552.00	20,671,200
アイネス	11,400	1,600.00	18,240,000
丹青社	29,100	899.00	26,160,900
メイテックグループホールディングス	54,100	2,998.50	162,218,850
T K C	23,300	3,620.00	84,346,000
富士ソフト	29,500	6,260.00	184,670,000

応用地質	14,000	2,195.00	30,730,000
船井総研ホールディングス	31,300	2,419.00	75,714,700
NSD	52,300	2,866.00	149,891,800
進学会ホールディングス	1,700	273.00	464,100
丸紅建材リース	500	2,804.00	1,402,000
オオバ	4,500	964.00	4,338,000
コナミグループ	54,900	9,993.00	548,615,700
いであ	1,800	2,235.00	4,023,000
学究社	6,000	2,051.00	12,306,000
イオンディライト	16,100	3,485.00	56,108,500
ナック	12,800	563.00	7,206,400
福井コンピュータホールディングス	9,100	2,620.00	23,842,000
ダイセキ	30,700	3,735.00	114,664,500
ステップ	5,500	1,993.00	10,961,500
泉州電業	7,200	4,200.00	30,240,000
元気寿司	8,700	3,370.00	29,319,000
トラスコ中山	32,500	2,238.00	72,735,000
ヤマダホールディングス	475,700	428.30	203,742,310
オートバックスセブン	53,900	1,626.50	87,668,350
モリト	11,100	1,396.00	15,495,600
アー克蘭ズ	46,000	1,667.00	76,682,000
ニトリホールディングス	56,300	23,850.00	1,342,755,000
グルメ杵屋	12,600	1,113.00	14,023,800
愛眼	5,000	186.00	930,000
ケーユーホールディングス	7,300	1,151.00	8,402,300
吉野家ホールディングス	57,000	3,227.00	183,939,000
加藤産業	19,200	4,575.00	87,840,000
北恵	1,700	853.00	1,450,100
イノテック	9,700	2,021.00	19,603,700
イエローハット	24,600	1,898.00	46,690,800
松屋フーズホールディングス	7,300	5,860.00	42,778,000
JBCホールディングス	9,700	3,310.00	32,107,000
JKホールディングス	11,900	1,035.00	12,316,500
サガミホールディングス	23,200	1,543.00	35,797,600
日伝	10,500	2,680.00	28,140,000
関西フードマーケット	10,500	1,705.00	17,902,500
ミロク情報サービス	13,300	1,838.00	24,445,400
北沢産業	4,200	343.00	1,440,600
杉本商事	7,300	2,216.00	16,176,800
因幡電機産業	40,100	3,400.00	136,340,000
王将フードサービス	11,500	7,730.00	88,895,000
ミニストップ	11,200	1,538.00	17,225,600
アークス	28,400	3,095.00	87,898,000
パローホールディングス	29,500	2,453.00	72,363,500
東テック	5,100	7,720.00	39,372,000
ミスグループ本社	233,600	2,299.00	537,046,400
アルテック	3,700	292.00	1,080,400
ベルク	7,700	6,430.00	49,511,000
大庄	7,400	1,241.00	9,183,400
タキヒヨー	1,600	1,129.00	1,806,400



ファーストリテイリング	69,600	42,870.00	2,983,752,000	
ソフトバンクグループ	723,400	8,625.00	6,239,325,000	
蔵王産業	1,200	2,553.00	3,063,600	
スズケン	58,900	4,531.00	266,875,900	
サンドラッグ	52,200	4,844.00	252,856,800	
サクスパー ホールディングス	13,100	892.00	11,685,200	
ジェコス	9,300	1,120.00	10,416,000	
ヤマザワ	1,400	1,245.00	1,743,000	
やまや	1,500	3,275.00	4,912,500	
ベルーナ	37,200	609.00	22,654,800	
合計	227,126,400		552,430,865,410	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2024年3月29日現在

資産総額	11,861,214,902円
負債総額	36,596,037円
純資産総額( - )	11,824,618,865円
発行済数量	6,308,380,856口
1口当たり純資産額( / )	1.8744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

2024年3月29日現在

資産総額	581,644,072,468円
負債総額	881,105,960円
純資産総額( - )	580,762,966,508円
発行済数量	119,065,934,990口
1口当たり純資産額( / )	4.8777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(2024年3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(2024年3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。

2024年3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	1,568,631,628,093
追加型株式投資信託	782	16,548,026,663,425
単位型公社債投資信託	21	34,479,319,590
単位型株式投資信託	199	1,065,363,345,162
合計	1,028	19,216,500,956,270

### 3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。  
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第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、第39期中間会計期間（自2023年4月1日至2023年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 百万円 )

	第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			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	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あります。

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

## 第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。

## (1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

		第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		28,013
金銭の信託		28,384
未収委託者報酬		17,669
未収運用受託報酬		3,747
未収投資助言報酬		305
未収収益		13
前払費用		1,318
その他		2,504
	流動資産計	81,956
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	947
器具備品	1	100
リース資産	1	6
無形固定資産		
ソフトウェア		4,959
ソフトウェア仮勘定		2,954
電話加入権		2,002
電話加入権		2
投資その他の資産		
投資有価証券		8,557
関係会社株式		184
長期差入保証金		4,888
長期差入保証金		772
繰延税金資産		2,592
その他		120
	固定資産計	14,572
資産合計		96,529

(単位:百万円)

	第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	418
リース債務	1
未払金	7,850
未払収益分配金	1
未払償還金	0
未払手数料	7,654
その他未払金	193
未払費用	7,452
未払法人税等	2,372
未払消費税等	1,076
契約負債	20
賞与引当金	861
役員賞与引当金	26
	流動負債計
	20,081
固定負債	
リース債務	5
退職給付引当金	2,701
時効後支払損引当金	72
	固定負債計
	2,780
負債合計	22,861
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	19,552
資本準備金	2,428
その他資本剰余金	17,124
利益剰余金	52,115
利益準備金	123
その他利益剰余金	51,991
別途積立金	31,680
繰越利益剰余金	20,311
	株主資本計
	73,668
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	0
	評価・換算差額等計
	0
純資産合計	73,668
負債・純資産合計	96,529



## (2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

	第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	49,984	
運用受託報酬	8,063	
投資助言報酬	1,082	
その他営業収益	13	
		営業収益計 59,144
営業費用		
支払手数料	21,623	
広告宣伝費	107	
公告費	0	
調査費	17,657	
調査費	6,728	
委託調査費	10,928	
委託計算費	280	
営業雑経費	372	
通信費	17	
印刷費	253	
協会費	33	
諸会費	29	
支払販売手数料	38	
		営業費用計 40,042
一般管理費		
給料	4,831	
役員報酬	77	
給料・手当	4,735	
賞与	19	
交際費	14	
寄付金	3	
旅費交通費	63	
租税公課	175	
不動産賃借料	508	
退職給付費用	206	
固定資産減価償却費	1 749	
福利厚生費	17	
修繕費	0	
賞与引当金繰入額	861	
役員賞与引当金繰入額	26	
機器リース料	0	
事務委託費	1,714	
事務用消耗品費	24	
器具備品費	0	
諸経費	120	
		一般管理費計 9,319
営業利益		9,782

(単位:百万円)

	第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	3	
受取配当金	3	
時効成立分配金・償還金	0	
時効後支払損引当金戻入額	35	
雑収入	10	
営業外収益計		53
営業外費用		
為替差損	7	
金銭の信託運用損	785	
早期割増退職金	0	
雑損失	3	
営業外費用計		797
経常利益		9,038
特別損失		
固定資産除却損	2	
関係会社株式評価損	922	
特別損失計		924
税引前中間純利益		8,113
法人税、住民税及び事業税		2,136
法人税等調整額		303
法人税等合計		2,440
中間純利益		5,673

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678
当中間期変動額							
剰余金の配当							11,040
中間純利益							5,673
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	5,366
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	20,311

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	57,481	79,034	0	0	79,034
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,040	11,040			11,040
中間純利益	5,673	5,673			5,673
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額 合計	5,366	5,366	0	0	5,366
当中間期末残高	52,115	73,668	0	0	73,668

## 重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <p>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、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

## 6. 収益及び費用の計上基準

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。

## (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。

## (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。

## (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。

## (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。

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

項目	第39期中間会計期間末 （2023年9月30日現在）		
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	...	577百万円
	器具備品	...	764百万円
	リース資産	...	2百万円

## （中間損益計算書関係）

項目	第39期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）		
1.減価償却実施額	有形固定資産	...	71百万円
	無形固定資産	...	678百万円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

## 1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2.配当に関する事項

## （1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （百万円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
2023年6月16日 定時株主総会	普通株式	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19日
	A種種類 株式				

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

（金融商品関係）

第39期中間会計期間末（2023年9月30日現在）

### 1.金融商品の時価等に関する事項

2023年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額 （百万円）	時価 （百万円）	差額 （百万円）
(1) 金銭の信託	28,384	28,384	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	28,386	28,386	-

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

### 2.金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	-	28,384	-	28,384
投資有価証券	-	-	-	-
其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	28,386	-	28,386

（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、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開  
示している表中には含めておりません。

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券（その他有価証券）	
非上場株式	182
関係会社株式	
非上場株式	4,888

（有価証券関係）

第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)			
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（中間貸借対照表計上額4,888百万円）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			
区 分	中間貸借対照表 計上額（百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0
（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額182百万円）については、市場価格がないことから、上 表に含めておりません。			

（持分法損益等）

当社は2022年8月1日付でPayPayアセットマネジメント株式会社の株式を取得し持分法適用関連会社と  
しておりますが、重要性が乏しいため、関連会社に対する投資の金額等の記載を省略しております。



## （企業結合等関係）

当社（以下「AMOne」という）は、2016年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社（以下「DIAM」という）、みずほ投信投資顧問株式会社（以下「MHAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及び新光投信株式会社（以下「新光投信」という）（以下総称して「統合4社」という）間の「統合契約書」に基づき、2016年10月1日付で統合いたしました。

## 1. 結合当事企業

結合当事企業	DIAM	MHAM	TB	新光投信
事業の内容	投資運用業務、投資助言・代理業務	投資運用業務、投資助言・代理業務	信託業務、銀行業務、投資運用業務	投資運用業務、投資助言・代理業務

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

当社は、株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という）及び第一生命ホールディングス株式会社（以下「第一生命」という）の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、MHFGと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

会社名	DIAM (存続会社)	MHAM (消滅会社)
合併比率(*)	1	0.0154

(\*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社であるMHFGに対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないIA種種類株式15,510株を交付しました。

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率 50.00%

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるMHFGが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

## 10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」(企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分)に基づき、「3. 企業結合の方法」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理しております。

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2023年4月1日から2023年9月30日まで

## (2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

## (3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

## (4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

## b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

## c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

流動資産	- 百万円
固定資産	65,400百万円
資産合計	65,400百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	3,358百万円
負債合計	3,358百万円
純資産	62,041百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額49,546百万円及び顧客関連資産の金額19,028百万円が含まれております。

## (2) 損益計算書項目

営業収益	- 百万円
営業利益	3,824百万円
経常利益	3,824百万円
税引前中間純利益	3,824百万円
中間純利益	3,237百万円
1株当たり中間純利益	80,925円14銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額1,918百万円が含まれております。

## (資産除去債務関係)

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

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

## (収益認識関係)

## 1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第39期中間会計期間  
(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

委託者報酬	49,984百万円
運用受託報酬	7,464百万円
投資助言報酬	1,082百万円
成功報酬(注)	599百万円
その他営業収益	13百万円
合計	59,144百万円

(注) 成功報酬は、中間損益計算書において委託者報酬及び運用受託報酬に含めて表示しております。

## 2. 収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は「重要な会計方針 6. 収益及び費用の計上基準」に記載の通りであります。

(セグメント情報等)

第39期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

(1)サービスごとの情報

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,841,700円33銭
1株当たり中間純利益金額	141,837円37銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
中間純利益金額	5,673百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	5,673百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

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

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、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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

#### 利害関係

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

以上

---

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

2024年5月17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

## 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11日から2024年3月11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2024年3月11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22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 森重 俊寛指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 稲葉 宏和

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間(2023年4月1日から2023年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2023年4月1日から2023年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

#### 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。