

**【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11月7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】	積木 利浩
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	One DC 国内株式インデックスファンド
【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】

One DC 国内株式インデックスファンド  
（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

お申込日の基準価額 とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

#### < 基準価額の照会方法等 >

基準価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

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

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

（ 6 ） 【 申込単位 】

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

ただし、収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位

（ 7 ） 【 申込期間 】

継続申込期間：2024年11月8日から2025年5月7日まで

ただし、お申込みの取扱いは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。

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

（ 8 ） 【 申込取扱場所 】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

（ 9 ） 【 払込期日 】

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

（ 1 0 ） 【 払込取扱場所 】

取得申込者は、販売会社の定める方法により、販売会社を買付代金を支払うものとします。

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

（ 1 1 ） 【 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

（ 1 2 ） 【 その他 】

お申込みの方法

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」に従って分配金累積投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

お申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時30分までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。また、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができます。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係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、振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### 振替受益権について

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

ファンドの収益分配金、償還金、解約代金は、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。

#### （参考）

##### 投資信託振替制度

投資信託振替制度とは、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するものです。ファンドの設定、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ので、受益証券は発行されません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、東証株価指数(TOPIX)(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。

当ファンドの信託金の限度額は、1兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

## 1 主に国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資を行い、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。

#### 指数の著作権等

東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。

JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出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。

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。

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。

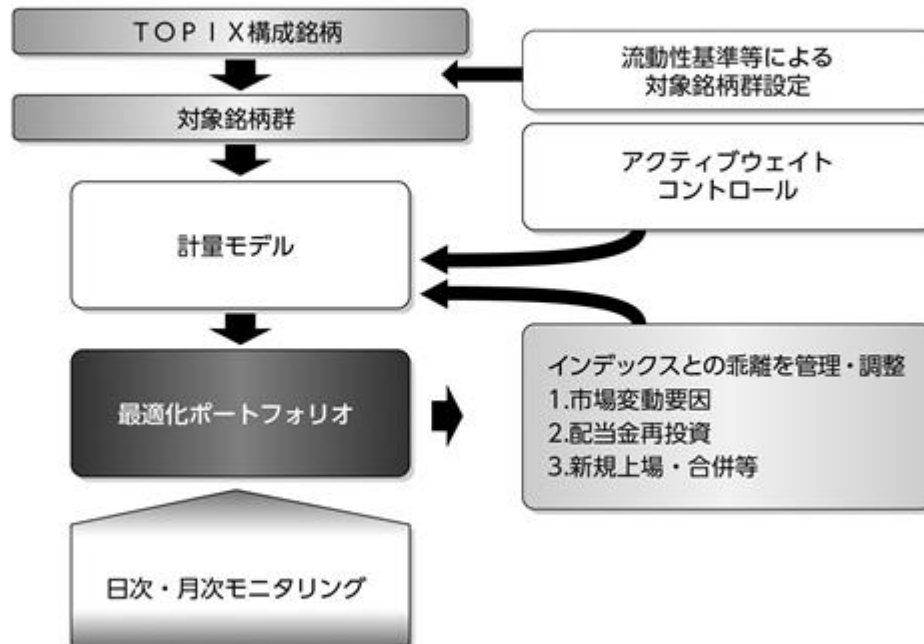
本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。

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。

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。

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。

**2** 流動性基準等により投資対象銘柄を設定し、インデックス（東証株価指数（TOPIX）（配当込み））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。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。



**3** 株式（株価指数先物取引を含みます。）の実質組入比率は、原則として高位を維持します。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。株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。

## ■ 分配方針

年1回の決算時（毎年2月7日（休業日の場合は翌営業日。））に、経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類定義

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

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分定義

その他資産 (投資信託証券 (株式))	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として株式へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。 (注) 商品分類表の投資対象資産は株式に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産(投資信託証券(株式))に分類されます。
年1回	目論見書また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います。
日本	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリーファンド	目論見書また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います。

上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

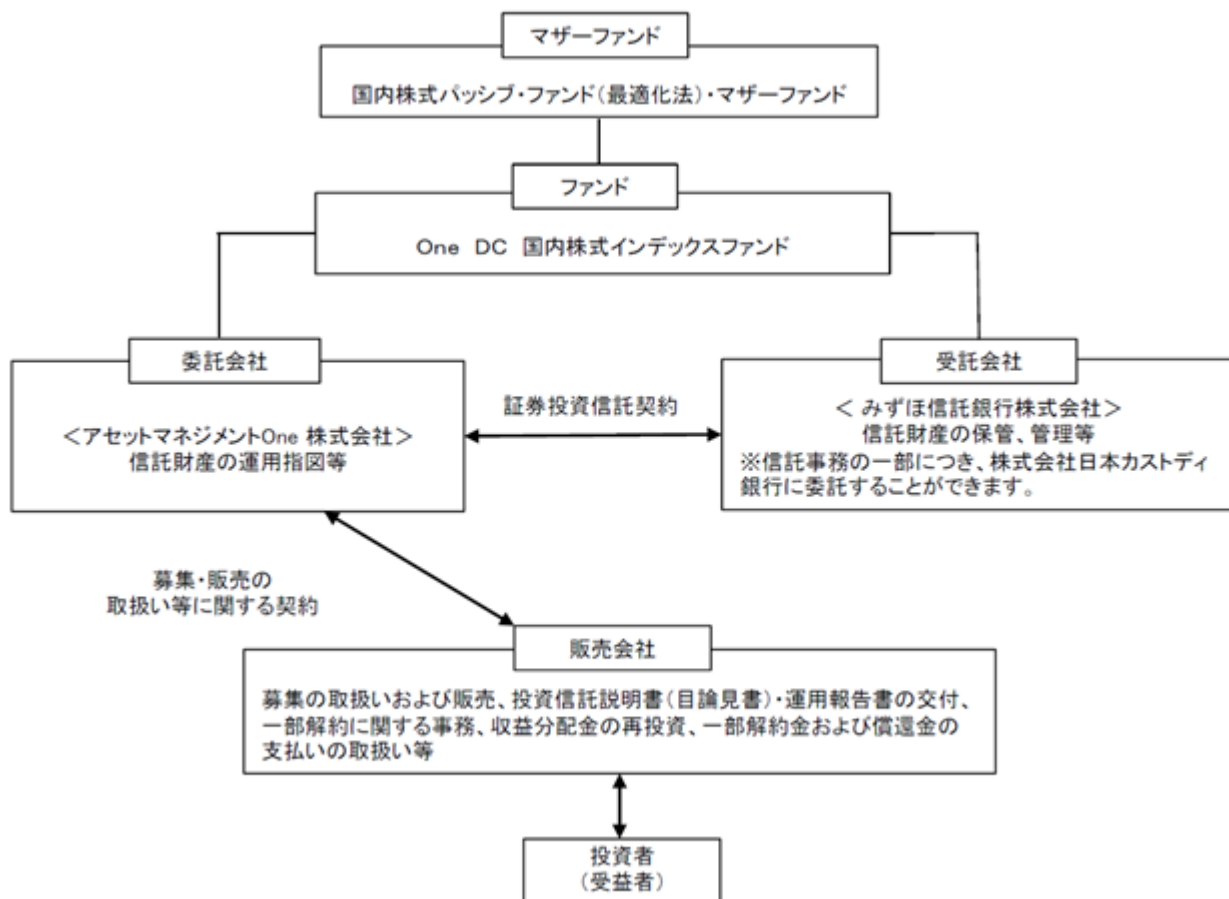


上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ  
(<https://www.toushin.or.jp/>)でご覧いただけます。

## (2) 【ファンドの沿革】

2007年9月27日	信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
2014年8月29日	信託報酬率の変更
2015年8月28日	信託報酬率の変更
2019年4月1日	信託報酬率の変更
2019年10月1日	ファンドの名称を「DIAM DC 国内株式インデックスファンド」から 「One DC 国内株式インデックスファンド」に変更 信託報酬率の変更

## (3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。

当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

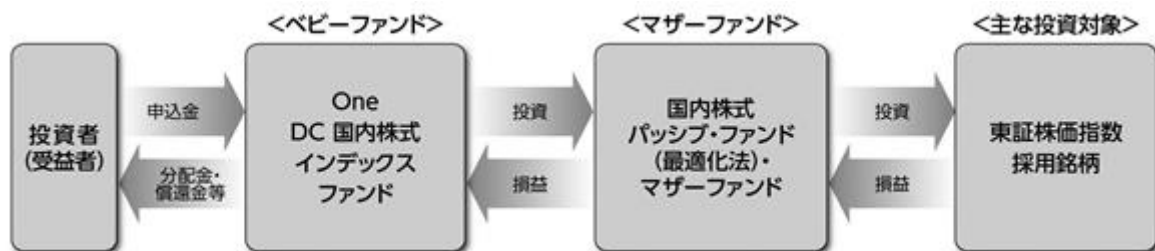
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約事務、収益分配金の再投資、一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド受益証券に投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行います。



## 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

## 資本金の額

20億円（2024年8月30日現在）

## 委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブルユ・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8月30日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### イ.基本方針

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

#### ロ.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。

#### ハ.投資態度

- ・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)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・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。
- ・株式(株価指数先物取引を含みます。)の実質組入比率は、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。
- ・株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。

当ファンドが対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、上記1ファンドの性格(1)ファンドの目的及び基本的性格<ファンドの特色>をご参照ください。

### (2)【投資対象】

#### 1.投資の対象とする資産(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

a.次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます、以下同じ。)

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条に定めるものに限りません。)

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

b.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

## 2. 有価証券の指図範囲 (約款第17条第1項)

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のほか、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
- 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) 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1)~10)の証券または証書の性質を有するもの
- 12) 外国貸付債権信託受益権(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 13) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。)
- 14) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 15) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 16) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
- 17) 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。)
- 18) 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
- 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの

なお、1)の証券または証書、11)ならびに14)の証券または証書のうち1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券および11)ならびに14)の証券または証書のうち2)から6)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。

## 3. 金融商品の指図範囲（約款第17条第2項）

委託会社は、信託金を、上記2.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。

- 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
- 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

4. 上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3.の1)から4)まで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。（約款第17条第3項）

## （参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

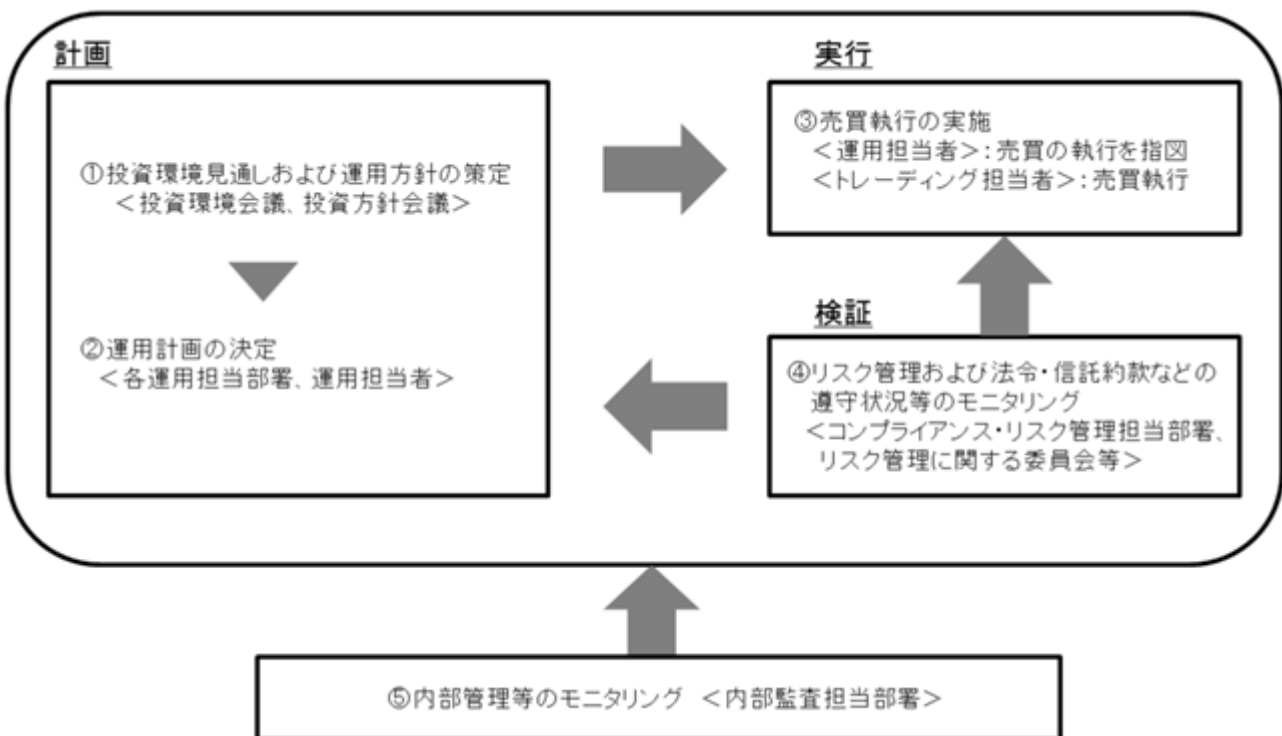
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
---------------	---

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

### （3）【運用体制】

#### a. ファンドの運用体制



#### 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

#### 運用計画の決定

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

#### 売買執行の実施

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

#### モニタリング

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

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

#### 内部管理等のモニタリング

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

#### b. ファンドの関係法人に関する管理

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

#### c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2024年8月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。



#### (4) 【分配方針】

##### 収益分配方針

毎決算時(原則として毎年2月7日。ただし、休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

##### 1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

##### 2) 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

##### 3) 留保金の運用方針

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

##### 収益の分配方式

##### 1) 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 信託財産に属する配当等収益(利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。)とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。)との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
3. 上記1.および2.におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

##### 2) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

##### 収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資されます。

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。)に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。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。

## (5) 【投資制限】

## 1) 株式への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

## 2) 外貨建資産への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

## 3) マザーファンドの受益証券への投資割合には制限を設けません。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

## 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。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

## 5) 投資する株式等の範囲(約款第20条)

(a) 委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品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、株主割または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

(b) 上記(a)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

## 6) 信用取引の指図範囲(約款第21条)

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(b) 上記(a)の信用取引の指図は、次の1.~5.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.~5.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券

2. 株式分割により取得する株券

3. 有償増資により取得する株券

4. 売り出しにより取得する株券

5. 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(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)の新株予約権に限りません。)の行使により取得可能な株券

## 7) 先物取引等の運用指図(約款第22条)

(a) 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および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号八に掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)

(b) 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、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

(c) 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、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。

8) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第23条)

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

(b) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当該ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(c) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

(d) 委託会社は、金利先渡取引および為替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。

9) デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第23条の2)

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

10) 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第24条)

(a) 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1)~2)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

1) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

2) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

(b) 上記(a)1)2)で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。

(c) 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、担保の受入の指図を行うものとします。

11) 特別な場合の外貨建資産への投資制限(約款第26条)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

12) 外貨為替予約の指図および範囲(約款第27条)

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引を指図することができます。

(b) 上記(a)の予約取引の指図は、信託財産に属する為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドに信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に

属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

- (c) 上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

### 13) 資金の借入れ(約款第34条)

- (a) 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を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (b) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- (c) 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。
- (d) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

## 3【投資リスク】

### < 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

### 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドは実質的に株式に投資します。株式の価格は一般に大きく変動します。株式市場全体の価格変動あるいは個別銘柄の価格変動により当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

#### 信用リスク

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

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

収益分配は、計算期間中に発生した運用収益(経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。))を超えて行われる場合があります。したがって、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。

受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、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。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。

分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、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。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に連動する投資成果をめざして運用を行います。当該インデックス採用全銘柄を組入れない場合があること、資金流入から組入株式の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と当該インデックスが乖離する場合があります。

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。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。

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。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

当ファンドは、受益者のため有利と認められる場合、対象インデックスが改廃された場合、その他やむを得ない事情がある場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了(繰上償還)する場合があります。

#### 注意事項

- イ. 当ファンドは、実質的に株式など値動きのある有価証券(外貨建資産へ投資する場合には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。
- ロ. 投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ニ. 投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。

### <リスク管理体制>

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

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



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

リスク管理体制は2024年8月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <参考情報>

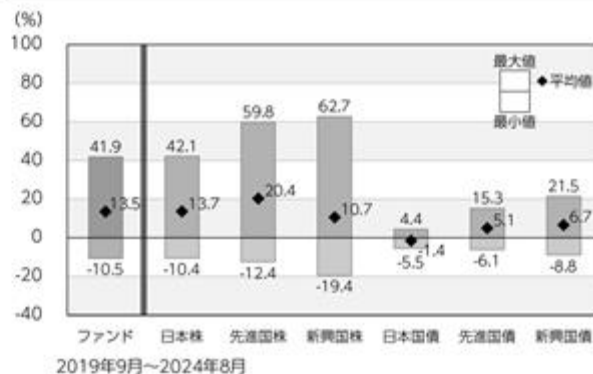
### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

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

### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。



## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

## (3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.154%（税抜0.14%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.06%	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	年率0.06%	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	年率0.02%	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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎年8月7日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## (4)【その他の手数料等】

## イ. 信託財産留保額

ありません。

## ロ. その他の費用

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

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

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎年8月7日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に関する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に関する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

##### 個人の受益者に対する課税

###### 収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

###### 解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

###### 損益通算について

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

##### 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8月末現在のものであります。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
0.16%	0.15%	0.00%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2023年2月8日～2024年2月7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8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	162,642,746,447	100.00
内 日本	162,642,746,447	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,495,023	0.00
純資産総額	162,650,241,470	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8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	572,747,197,440	97.59
内 日本	572,747,197,440	97.59
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	14,153,268,339	2.41
純資産総額	586,900,465,779	100.00

その他資産の投資状況

2024年8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	13,740,430,000	2.34
内 日本	13,740,430,000	2.34

（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8月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	33,951,100,396	4.4804 152,115,746,887	4.7905 162,642,746,447	- -	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年8月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2024年8月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,971,700	3,243.28 25,854,489,189	2,759.50 21,997,906,150	- -	3.75
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	1,050,200	14,155.09 14,865,684,032	14,200.00 14,912,840,000	- -	2.54
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,994,900	1,415.86 12,735,586,906	1,528.00 13,744,207,200	- -	2.34
4	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,639,500	2,419.85 8,807,052,562	3,572.00 13,000,294,000	- -	2.22
5	キーエンス 日本	株式 電気機器	150,100	64,310.37 9,652,987,618	69,610.00 10,448,461,000	- -	1.78
6	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,110,300	5,949.27 6,605,482,998	9,047.00 10,044,884,100	- -	1.71
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,034,300	7,848.15 8,117,349,236	9,550.00 9,877,565,000	- -	1.68
8	三菱商事 日本	株式 卸売業	3,046,700	2,823.87 8,603,509,587	3,013.00 9,179,707,100	- -	1.56
9	信越化学工業 日本	株式 化学	1,347,000	5,852.78 7,883,697,696	6,422.00 8,650,434,000	- -	1.47
10	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,066,700	6,757.19 7,207,902,143	7,706.00 8,219,990,200	- -	1.40
11	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	317,500	28,784.84 9,139,189,430	25,805.00 8,193,087,500	- -	1.40
12	第一三共 日本	株式 医薬品	1,310,300	4,592.51 6,017,574,938	6,108.00 8,003,312,400	- -	1.36
13	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,442,100	3,992.45 5,757,516,467	5,506.00 7,940,202,600	- -	1.35
14	任天堂 日本	株式 その他製品	946,900	8,317.19 7,875,556,230	7,902.00 7,482,403,800	- -	1.27
15	三井物産 日本	株式 卸売業	2,376,700	2,959.63 7,034,166,158	3,123.00 7,422,434,100	- -	1.26
16	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	44,739,500	181.05 8,100,392,860	155.70 6,965,940,150	- -	1.19
17	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	741,900	6,779.22 5,029,503,785	8,405.00 6,235,669,500	- -	1.06

18	HOYA 日本	株式 精密機器	295,200	18,437.71 5,442,813,054	20,595.00 6,079,644,000	- -	1.04
19	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,993,700	2,749.39 5,481,460,844	3,009.00 5,999,043,300	- -	1.02
20	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,331,300	4,219.12 5,616,917,124	4,333.00 5,768,522,900	- -	0.98
21	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	3,553,300	1,706.46 6,063,598,483	1,588.00 5,642,640,400	- -	0.96
22	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,106,200	4,588.91 5,076,252,298	4,911.00 5,432,548,200	- -	0.93
23	三菱重工業 日本	株式 機械	2,648,800	1,098.05 2,908,516,431	1,942.50 5,145,294,000	- -	0.88
24	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,403,100	1,940.54 4,663,330,366	2,038.00 4,897,517,800	- -	0.83
25	ファーストリテイリング 日本	株式 小売業	89,200	39,554.79 3,528,287,556	46,650.00 4,161,180,000	- -	0.71
26	村田製作所 日本	株式 電気機器	1,339,500	2,975.12 3,985,184,728	3,033.00 4,062,703,500	- -	0.69
27	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,659,100	2,048.69 3,398,987,768	2,441.00 4,049,863,100	- -	0.69
28	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	897,300	3,958.43 3,551,899,614	4,203.00 3,771,351,900	- -	0.64
29	キヤノン 日本	株式 電気機器	748,000	4,131.27 3,090,190,539	5,017.00 3,752,716,000	- -	0.64
30	富士通 日本	株式 電気機器	1,393,800	2,314.72 3,226,263,512	2,677.50 3,731,899,500	- -	0.64

(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。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2024年8月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	97.59
合計	97.59

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

2024年8月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	17.13
銀行業		7.39
輸送用機器		7.33
情報・通信業		7.28
卸売業		7.14
化学		5.56
機械		5.22
医薬品		4.98
サービス業		4.66

小売業	4.20
食料品	3.08
保険業	3.05
その他製品	2.41
精密機器	2.36
陸運業	2.27
建設業	2.10
不動産業	2.00
電気・ガス業	1.40
その他金融業	1.18
証券、商品先物取引業	0.85
鉄鋼	0.84
海運業	0.79
非鉄金属	0.75
ガラス・土石製品	0.65
ゴム製品	0.59
石油・石炭製品	0.54
金属製品	0.48
繊維製品	0.36
空運業	0.36
鉱業	0.29
パルプ・紙	0.14
倉庫・運輸関連業	0.14
水産・農林業	0.08
合計	97.59

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2024年8月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0609月	買建	506	13,178,606,980	13,740,430,000	2.34

（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8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8計算期間末 (2015年2月9日)	8,261	8,261	1.0056	1.0056
第9計算期間末 (2016年2月8日)	11,225	11,225	0.9911	0.9911
第10計算期間末 (2017年2月7日)	13,968	13,968	1.1107	1.1107
第11計算期間末 (2018年2月7日)	22,544	22,544	1.3067	1.3067
第12計算期間末 (2019年2月7日)	30,214	30,214	1.1958	1.1958
第13計算期間末 (2020年2月7日)	37,717	37,717	1.3513	1.3513
第14計算期間末 (2021年2月8日)	49,849	49,849	1.5351	1.5351
第15計算期間末 (2022年2月7日)	65,141	65,141	1.5668	1.5668
第16計算期間末 (2023年2月7日)	83,858	83,858	1.6554	1.6554
第17計算期間末 (2024年2月7日)	137,089	137,089	2.1789	2.1789
2023年8月末日	113,233	-	1.9726	-
9月末日	116,291	-	1.9827	-
10月末日	115,873	-	1.9231	-
11月末日	123,011	-	2.0269	-
12月末日	124,556	-	2.0223	-
2024年1月末日	136,621	-	2.1800	-
2月末日	146,266	-	2.2871	-
3月末日	154,144	-	2.3881	-
4月末日	155,613	-	2.3665	-
5月末日	159,653	-	2.3929	-
6月末日	163,384	-	2.4273	-
7月末日	164,332	-	2.4139	-
8月末日	162,650	-	2.3439	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000

第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
2024年2月8日～2024年8月7日	-

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第8計算期間	22.0
第9計算期間	1.4
第10計算期間	12.1
第11計算期間	17.6
第12計算期間	8.5
第13計算期間	13.0
第14計算期間	13.6
第15計算期間	2.1
第16計算期間	5.7
第17計算期間	31.6
2024年2月8日～2024年8月7日	1.3

（注）収益率は期間騰落率です。

## （４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第8計算期間	5,119,097,831	4,880,240,628
第9計算期間	8,364,610,514	5,254,249,325
第10計算期間	7,572,230,014	6,321,925,379
第11計算期間	11,590,956,335	6,914,819,396
第12計算期間	14,073,136,483	6,058,109,779
第13計算期間	10,454,492,002	7,809,755,170
第14計算期間	13,421,884,000	8,860,777,863
第15計算期間	16,850,759,487	7,748,660,236
第16計算期間	18,140,275,590	9,057,542,219
第17計算期間	25,348,174,227	13,089,309,325
2024年2月8日～ 2024年8月7日	13,447,170,136	8,388,145,632

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2024年8月30日

## 基準価額・純資産の推移 (2014年8月29日～2024年8月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

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

(設定日:2007年9月27日)

## 分配の推移 (税引前)

2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
2022年 2月	0円
2023年 2月	0円
2024年 2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

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

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

資産の状況

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

その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.34

株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	17.13
2	銀行業	7.39
3	輸送用機器	7.33
4	情報・通信業	7.28
5	卸売業	7.14

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.75
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.54
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.34
4	日立製作所	株式	日本	電気機器	2.22
5	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.78
6	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.71
7	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.68
8	三菱商事	株式	日本	卸売業	1.56
9	信越化学工業	株式	日本	化学	1.47
10	伊藤忠商事	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。

○掲載データ等はい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】

#### お申込みの方法

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。  
当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。
- ・当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」に従って分配金累積投資に関する契約を締結します。  
なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。
- ・当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時30分までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- ・委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、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係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### お申込価額（発行価格）

お申込日の基準価額 とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

#### < 基準価額の照会方法等 >

基準価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

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

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

お申込単位

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

ただし、収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位

お申込手数料

ありません。

払込期日

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

## 2【換金（解約）手続等】

### 解約のお申込み方法

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に1口単位をもって解約の請求をすることができます。

受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時30分までに行われ、かつ、解約の受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

解約の請求を行う受益者は、その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係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約に係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。

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

**解約価額**

解約価額は、解約請求受付日の基準価額とします。

解約価額は委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

**解約代金の受渡日**

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して5営業日目から販売会社の営業所等においてお支払いします。

**3【資産管理等の概要】****(1)【資産の評価】**

基準価額とは、純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）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	計算日における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日において、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

**(2)【保管】**

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は2007年9月27日から無期限です。

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

(4)【計算期間】

a. 計算期間は原則として毎年2月8日から翌年2月7日までとします。

b. 上記a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、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】

イ. 償還規定

- a. 委託会社は、信託終了前にこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃の場合、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、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。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係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係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。
- b. 委託会社は上記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. 上記a.につき、上記b.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- d. 委託会社は信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの内容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、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。
- e. 上記b.～d.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、上記b.の一定の期間が一月を下らずにその公告及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. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 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き継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更d.」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。

- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、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、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更」の規定に従い、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。
- i. 上記b.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し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い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

#### ロ.信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、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出ます。
- b. 委託会社は、上記a.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およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係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。
- c. 委託会社は上記b.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異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更を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、これらの内容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、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。
- f. 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a.~e.の規定に従います。
- g. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し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い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

#### ハ.関係法人との契約の更改

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



## 二．公告

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

（URL <https://www.am-one.co.jp/>）

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

## ホ．運用報告書

・委託会社は、毎年2月7日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

（URL <https://www.am-one.co.jp/>）

## 4【受益者の権利等】

### 収益分配金請求権

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付され、販売会社により自動的に再投資されます。

販売会社は、累積投資約款に基づき、毎計算期間の末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計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に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けを行います。当該売付け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。

### 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、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

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

#### 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。

#### 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17期計算期間(2023年2月8日から2024年2月7日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【One DC 国内株式インデックスファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 2023年2月7日現在	第17期 2024年2月7日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	264,167,212	365,807,687
親投資信託受益証券	83,855,522,086	137,084,376,892
未収入金	20,219,000	-
流動資産合計	84,139,908,298	137,450,184,579
資産合計	84,139,908,298	137,450,184,579
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	221,459,749	266,788,932
未払受託者報酬	8,481,178	13,326,135
未払委託者報酬	50,887,250	79,957,089
その他未払費用	379,306	551,725
流動負債合計	281,207,483	360,623,881
負債合計	281,207,483	360,623,881
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	50,657,997,778	62,916,862,680
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	33,200,703,037	74,172,698,018
（分配準備積立金）	11,053,520,359	35,676,182,361
元本等合計	83,858,700,815	137,089,560,698
純資産合計	83,858,700,815	137,089,560,698
負債純資産合計	84,139,908,298	137,450,184,579

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期 自 2022年2月8日 至 2023年2月7日	第17期 自 2023年2月8日 至 2024年2月7日
<b>営業収益</b>		
受取利息	1,699	2,789
有価証券売買等損益	4,516,931,857	29,981,192,806
営業収益合計	4,516,933,556	29,981,195,595
<b>営業費用</b>		
支払利息	67,712	130,776
受託者報酬	15,893,277	23,710,119
委託者報酬	95,360,042	142,261,137
その他費用	720,239	997,722
営業費用合計	112,041,270	167,099,754
営業利益又は営業損失（ ）	4,404,892,286	29,814,095,841
経常利益又は経常損失（ ）	4,404,892,286	29,814,095,841
当期純利益又は当期純損失（ ）	4,404,892,286	29,814,095,841
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（ ）	202,546,302	2,903,477,530
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	23,566,324,934	33,200,703,037
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,566,539,046	23,103,644,615
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	10,566,539,046	23,103,644,615
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,134,506,927	9,042,267,945
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,134,506,927	9,042,267,945
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	33,200,703,037	74,172,698,018

## (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17期	
	自 2023年2月8日	至 2024年2月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第16期	第17期
	2023年2月7日現在	2024年2月7日現在
1. 期首元本額	41,575,264,407円	50,657,997,778円
期中追加設定元本額	18,140,275,590円	25,348,174,227円
期中一部解約元本額	9,057,542,219円	13,089,309,325円
2. 受益権の総数	50,657,997,778口	62,916,862,680口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第16期	第17期
	自 2022年2月8日 至 2023年2月7日	自 2023年2月8日 至 2024年2月7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(1,796,011,592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(1,923,491,679円)、信託約款に規定される収益調整金(37,401,893,495円)及び分配準備積立金(7,334,017,088円)より分配対象収益は48,455,413,854円(1万口当たり9,565.20円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,518,242,328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(24,392,375,983円)、信託約款に規定される収益調整金(51,473,520,078円)及び分配準備積立金(8,765,564,050円)より分配対象収益は87,149,702,439円(1万口当たり13,851.56円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第16期	第17期
	自 2022年2月8日 至 2023年2月7日	自 2023年2月8日 至 2024年2月7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16期 2023年2月7日現在	第17期 2024年2月7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16期 2023年2月7日現在	第17期 2024年2月7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	4,475,281,266	29,746,811,107
合計	4,475,281,266	29,746,811,107

(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16期 2023年2月7日現在	第17期 2024年2月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6554円 (16,554円)	2.1789円 (21,789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2月7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	30,809,632,061	137,084,376,892	
親投資信託受益証券	合計	30,809,632,061	137,084,376,892	
合計			137,084,376,892	

(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2月7日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,373,197,806
株式	528,947,749,730
派生商品評価勘定	569,122,720
未収配当金	703,427,711
差入委託証拠金	621,359,617
流動資産合計	543,214,857,584
資産合計	543,214,857,584
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	107,310
前受金	491,893,000
未払解約金	592,021,000
流動負債合計	1,084,021,310
負債合計	1,084,021,310
純資産の部	
元本等	
元本	121,842,817,407
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	420,288,018,867
元本等合計	542,130,836,274
純資産合計	542,130,836,274
負債純資産合計	543,214,857,584

## 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2月8日 至 2024年2月7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2月7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	117,622,712,134円
同期中追加設定元本額	59,907,077,380円
同期中一部解約元本額	55,686,972,107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	2,457,094,087円
たわらノーロード 国内株式<ラップ専用>	3,281,412,558円
One DC 国内株式インデックスファンド	30,809,632,061円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,610,201,313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)	9,370,446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)	21,608,149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	2,226,070,109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)	49,358,924円
たわらノーロード バランス(標準型)	360,326,830円
たわらノーロード バランス(積極型)	607,683,019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)	2,285,856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)	141,103,494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)	406,039,337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)	347,897,665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)	481,585,965円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	365,246円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,354,848円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	27,592,829円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,404,483円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,596,034円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,412,337,171円
Oneグローバルバランス	41,793,827円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	914,089,354円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,328,302,555円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,866,884,412円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	294,884,221円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	964,080,357円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,090,311,381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)	283,994,414円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	332,963,584円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	563,739,113円
投資のソムリエ	8,462,984,252円
クルーズコントロール	331,322,523円
投資のソムリエ<DC年金>	830,639,366円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	315,192,706円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,094,963,321円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	940,176,992円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,070,818,810円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	79,256,153円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	40,575,661円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	8,224,956円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	177,810,319円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	506,884,540円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,363,308,339円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	230,928,569円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	80,685,240円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	43,107,354円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	26,468,340円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	499,441,883円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	6,256,314円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	1,630,752円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	32,054,533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)	1,852,453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)	1,973,535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)	1,168,057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)	1,140,141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)	21,514,902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)	4,850,093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)	179,053,363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)	1,676,651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)	82,171,987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)	373,974,618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)	3,244,839円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	271,164,256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)	13,265,462円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	22,573,361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)	42,437,517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)	3,180,848円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	3,641,563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)	34,738,163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)	67,464,810円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,592,057円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	10,658,140円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,391,442円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	80,001円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	1,346,974円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	17,271,356円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	278,577,105円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	397,261,876円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,219,167,945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)	10,308,559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)	14,774,714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)	148,488,928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)	28,546,667円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	53,149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)	157,074,573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)	8,107,544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)	38,324,573円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	100,737,648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)	130,670,328円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	17,344,200円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	7,096,700円
動的パッケージファンド<DC年金>	26,832,017円
コア資産形成ファンド	13,890,277円
MHAMトピックスファンド	785,854,154円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	44,680,531円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	3,152,105,329円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,885,462,391円
計	121,842,817,407円

2. 受益権の総数

121,842,817,407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2月8日 至 2024年2月7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2月7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2月7日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	101,966,767,592
合計	101,966,767,592

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	2024年2月7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	12,759,467,000	-	13,328,655,000	569,188,000
合計	12,759,467,000	-	13,328,655,000	569,188,000

## （注）時価の算定方法

## 株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## （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2月7日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	4.4494円 (44,494円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## （1）株式

2024年2月7日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	7,800	4,105.00	32,019,000	
ニッスイ	205,000	901.80	184,869,000	
マルハニチロ	30,400	2,998.00	91,139,200	
雪国まいたけ	17,500	965.00	16,887,500	
カネコ種苗	5,800	1,432.00	8,305,600	
サカタのタネ	23,300	3,500.00	81,550,000	
ホクト	16,400	1,781.00	29,208,400	
ホクリヨウ	1,500	1,051.00	1,576,500	
ショーボンドホールディングス	27,900	6,521.00	181,935,900	
ミライト・ワン	67,800	1,970.50	133,599,900	
タマホーム	12,900	4,010.00	51,729,000	
サンヨーホームズ	1,100	765.00	841,500	
日本アクア	3,800	1,037.00	3,940,600	
ファーストコーポレーション	2,600	800.00	2,080,000	
ベステラ	2,200	980.00	2,156,000	
Robot Home	39,900	170.00	6,783,000	
キャンディル	1,700	585.00	994,500	
住石ホールディングス	23,200	1,795.00	41,644,000	

日鉄鉱業	8,200	5,150.00	42,230,000
三井松島ホールディングス	12,100	2,794.00	33,807,400
I N P E X	758,200	2,024.50	1,534,975,900
石油資源開発	23,800	6,030.00	143,514,000
K & O エナジーグループ	9,300	2,286.00	21,259,800
ダイセキ環境ソリューション	1,800	1,036.00	1,864,800
第一カッター興業	5,900	1,470.00	8,673,000
明豊ファシリティワークス	3,300	943.00	3,111,900
安藤・間	118,700	1,237.00	146,831,900
東急建設	64,200	830.00	53,286,000
コムシスホールディングス	65,500	3,199.00	209,534,500
ビーアールホールディングス	30,100	372.00	11,197,200
高松コンストラクショングループ	15,200	2,968.00	45,113,600
東建コーポレーション	5,200	9,560.00	49,712,000
ソネック	1,000	946.00	946,000
ヤマウラ	10,400	1,579.00	16,421,600
オリエンタル白石	75,800	360.00	27,288,000
大成建設	134,200	5,592.00	750,446,400
大林組	512,800	1,431.00	733,816,800
清水建設	406,600	1,048.00	426,116,800
飛島建設	14,800	1,511.00	22,362,800
長谷工コーポレーション	131,600	1,918.00	252,408,800
松井建設	13,400	850.00	11,390,000
銭高組	1,000	4,605.00	4,605,000
鹿島建設	318,000	2,774.00	882,132,000
不動テトラ	9,900	2,265.00	22,423,500
大末建設	2,500	1,449.00	3,622,500
鉄建建設	10,300	2,218.00	22,845,400
西松建設	27,400	4,458.00	122,149,200
三井住友建設	106,600	413.00	44,025,800
大豊建設	4,900	3,835.00	18,791,500
佐田建設	4,100	725.00	2,972,500
ナカノフドー建設	4,500	521.00	2,344,500
奥村組	23,200	5,270.00	122,264,000
東鉄工業	17,800	2,988.00	53,186,400
イチケン	1,600	2,409.00	3,854,400
富士ピー・エス	2,900	445.00	1,290,500
浅沼組	10,600	4,285.00	45,421,000
戸田建設	194,100	957.10	185,773,110
熊谷組	23,700	3,940.00	93,378,000
北野建設	1,200	3,100.00	3,720,000
植木組	1,800	1,757.00	3,162,600
矢作建設工業	19,500	1,458.00	28,431,000
ピーエス三菱	18,200	1,008.00	18,345,600
日本ハウスホールディングス	30,500	303.00	9,241,500
大東建託	52,800	16,985.00	896,808,000
新日本建設	20,100	1,274.00	25,607,400
東亜道路工業	5,700	6,870.00	39,159,000
日本道路	16,800	2,085.00	35,028,000
東亜建設工業	11,100	3,785.00	42,013,500

日本国土開発	40,800	529.00	21,583,200
若築建設	5,000	3,075.00	15,375,000
東洋建設	36,100	1,257.00	45,377,700
五洋建設	203,300	810.40	164,754,320
世紀東急工業	18,400	1,975.00	36,340,000
福田組	5,400	5,390.00	29,106,000
日本ドライケミカル	1,600	2,912.00	4,659,200
住友林業	123,900	4,329.00	536,363,100
日本基礎技術	3,800	490.00	1,862,000
巴コーポレーション	8,100	612.00	4,957,200
大和ハウス工業	396,600	4,400.00	1,745,040,000
ライト工業	29,500	2,060.00	60,770,000
積水ハウス	434,900	3,263.00	1,419,078,700
日特建設	13,700	1,213.00	16,618,100
北陸電気工事	9,800	1,273.00	12,475,400
ユアテック	31,600	1,374.00	43,418,400
日本リーテック	11,200	1,319.00	14,772,800
四電工	6,000	3,920.00	23,520,000
中電工	22,300	2,880.00	64,224,000
関電工	89,900	1,617.00	145,368,300
きんでん	101,000	2,664.50	269,114,500
東京エネシス	14,300	1,151.00	16,459,300
トーエネック	4,700	5,400.00	25,380,000
住友電設	13,700	3,195.00	43,771,500
日本電設工業	26,900	2,090.00	56,221,000
エクシオグループ	70,100	3,306.00	231,750,600
新日本空調	9,300	2,679.00	24,914,700
九電工	31,000	5,818.00	180,358,000
三機工業	31,000	1,878.00	58,218,000
日揮ホールディングス	141,900	1,746.00	247,757,400
中外炉工業	4,700	2,664.00	12,520,800
ヤマト	5,300	993.00	5,262,900
太平電業	8,900	4,425.00	39,382,500
高砂熱学工業	38,400	3,655.00	140,352,000
三晃金属工業	900	4,925.00	4,432,500
NEC ネットエスアイ	57,200	2,329.00	133,218,800
朝日工業社	6,700	3,190.00	21,373,000
明星工業	27,800	1,136.00	31,580,800
大気社	16,500	4,485.00	74,002,500
ダイダン	18,900	1,718.00	32,470,200
日比谷総合設備	10,400	2,665.00	27,716,000
ニッポン	43,100	2,294.00	98,871,400
日清製粉グループ本社	133,100	2,087.00	277,779,700
日東富士製粉	2,300	5,210.00	11,983,000
昭和産業	14,000	3,325.00	46,550,000
鳥越製粉	5,600	708.00	3,964,800
中部飼料	19,900	1,205.00	23,979,500
フィード・ワン	21,000	988.00	20,748,000
東洋精糖	1,200	2,320.00	2,784,000
日本甜菜製糖	8,400	2,154.00	18,093,600



D M三井製糖ホールディングス	14,300	3,270.00	46,761,000
塩水港精糖	8,400	304.00	2,553,600
ウェルネオシュガー	7,200	2,313.00	16,653,600
L I F U L L	51,300	192.00	9,849,600
M I X I	32,200	2,509.00	80,789,800
ジェイエイシーリクルートメント	54,300	689.00	37,412,700
日本M&Aセンターホールディングス	239,500	915.60	219,286,200
メンバーズ	5,100	952.00	4,855,200
中広	1,000	413.00	413,000
U Tグループ	19,400	2,490.00	48,306,000
アイティメディア	5,700	1,979.00	11,280,300
ケアネット	23,100	707.00	16,331,700
E・Jホールディングス	8,800	1,673.00	14,722,400
オープンアップグループ	45,100	2,318.00	104,541,800
コシダカホールディングス	45,000	936.00	42,120,000
アルトナー	2,800	2,203.00	6,168,400
パソナグループ	18,200	2,705.00	49,231,000
C D S	1,700	1,711.00	2,908,700
リンクアンドモチベーション	43,300	568.00	24,594,400
エス・エム・エス	52,700	2,461.00	129,694,700
サニーサイドアップグループ	2,300	595.00	1,368,500
パーソルホールディングス	1,530,100	237.80	363,857,780
リニカル	4,300	520.00	2,236,000
クックパッド	41,100	120.00	4,932,000
エスクリ	2,700	287.00	774,900
アイ・ケイ・ケイホールディングス	3,300	727.00	2,399,100
森永製菓	61,600	2,830.00	174,328,000
中村屋	3,500	3,130.00	10,955,000
江崎グリコ	41,200	4,260.00	175,512,000
名糖産業	5,700	1,760.00	10,032,000
井村屋グループ	8,600	2,468.00	21,224,800
不二家	9,900	2,461.00	24,363,900
山崎製パン	96,400	3,571.00	344,244,400
第一屋製パン	1,200	778.00	933,600
モロゾフ	4,600	4,010.00	18,446,000
亀田製菓	8,200	4,540.00	37,228,000
寿スピリッツ	68,100	1,925.00	131,092,500
カルビー	65,900	3,146.00	207,321,400
森永乳業	50,300	2,991.50	150,472,450
六甲バター	10,600	1,324.00	14,034,400
ヤクルト本社	205,700	3,140.00	645,898,000
明治ホールディングス	176,500	3,615.00	638,047,500
雪印メグミルク	34,800	2,304.00	80,179,200
プリマハム	19,300	2,327.00	44,911,100
日本ハム	61,900	5,218.00	322,994,200
林兼産業	2,200	589.00	1,295,800
丸大食品	14,500	1,689.00	24,490,500
S F o o d s	15,900	3,230.00	51,357,000
柿安本店	5,600	2,590.00	14,504,000
伊藤ハム米久ホールディングス	22,000	4,215.00	92,730,000

学情	7,700	1,805.00	13,898,500
スタジオアリス	7,500	2,098.00	15,735,000
クロスキャット	9,300	1,174.00	10,918,200
エブコ	1,800	944.00	1,699,200
システナ	221,900	288.00	63,907,200
N J S	3,300	2,735.00	9,025,500
デジタルアーツ	9,300	4,220.00	39,246,000
日鉄ソリューションズ	25,000	4,975.00	124,375,000
総合警備保障	251,100	798.70	200,553,570
キューブシステム	7,800	1,139.00	8,884,200
いちご	165,900	386.00	64,037,400
日本駐車場開発	152,400	179.00	27,279,600
コア	6,500	1,792.00	11,648,000
カカクコム	99,300	1,790.50	177,796,650
アイロムグループ	6,100	2,057.00	12,547,700
セントケア・ホールディング	11,000	974.00	10,714,000
サイネックス	1,100	834.00	917,400
ルネサンス	11,700	929.00	10,869,300
ディップ	23,000	2,659.00	61,157,000
S B Sホールディングス	13,000	2,474.00	32,162,000
デジタルホールディングス	7,800	1,249.00	9,742,200
新日本科学	13,700	1,557.00	21,330,900
キャリアデザインセンター	1,400	1,801.00	2,521,400
ベネフィット・ワン	52,200	2,097.00	109,463,400
エムスリー	297,000	1,977.50	587,317,500
ツカダ・グローバルホールディング	4,300	428.00	1,840,400
プラス	700	719.00	503,300
アウトソーシング	96,500	1,740.50	167,958,250
ウェルネット	5,900	556.00	3,280,400
ワールドホールディングス	6,800	3,040.00	20,672,000
ディー・エヌ・エー	53,400	1,528.50	81,621,900
博報堂DYホールディングス	191,700	1,193.50	228,793,950
ぐるなび	28,000	264.00	7,392,000
タカミヤ	20,400	487.00	9,934,800
ファンコミュニケーションズ	21,000	399.00	8,379,000
ライク	5,600	1,525.00	8,540,000
A o b a B B T	2,500	412.00	1,030,000
エスプール	43,200	307.00	13,262,400
W D Bホールディングス	7,700	2,285.00	17,594,500
手間いらず	2,500	2,678.00	6,695,000
ティア	3,900	484.00	1,887,600
C D G	800	1,237.00	989,600
アドウェイズ	20,700	511.00	10,577,700
バリューコマース	13,200	1,228.00	16,209,600
インフォマート	156,000	389.00	60,684,000
サッポロホールディングス	47,400	6,705.00	317,817,000
アサヒグループホールディングス	332,700	5,600.00	1,863,120,000
麒麟ホールディングス	599,700	2,126.00	1,274,962,200
宝ホールディングス	98,300	1,229.50	120,859,850
オエノンホールディングス	43,000	369.00	15,867,000

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	1,992.00	224,697,600
ライフドリンク カンパニー	2,100	5,980.00	12,558,000
サントリー食品インターナショナル	101,400	4,922.00	499,090,800
ダイドーグループホールディングス	16,300	2,911.00	47,449,300
伊藤園	48,800	4,234.00	206,619,200
キーコーヒー	16,100	2,061.00	33,182,100
ユニカフェ	2,200	905.00	1,991,000
ジャパンフーズ	1,000	1,408.00	1,408,000
日清オイリオグループ	20,300	4,610.00	93,583,000
不二製油グループ本社	33,500	2,358.00	78,993,000
かどや製油	800	3,810.00	3,048,000
J - オイルミルズ	16,500	2,086.00	34,419,000
ローソン	32,900	10,270.00	337,883,000
サンエー	11,800	4,580.00	54,044,000
カワチ薬品	12,100	2,713.00	32,827,300
エービーシー・マート	67,700	2,608.00	176,561,600
ハードオフコーポレーション	5,500	1,835.00	10,092,500
高千穂交易	4,900	3,985.00	19,526,500
アスクル	37,300	1,980.00	73,854,000
ゲオホールディングス	17,400	2,379.00	41,394,600
アダストリア	18,700	3,615.00	67,600,500
ジーフット	5,700	297.00	1,692,900
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	900	763.00	686,700
オルパヘルスケアホールディングス	1,100	1,873.00	2,060,300
伊藤忠食品	3,500	7,830.00	27,405,000
くら寿司	18,100	3,940.00	71,314,000
キャンドゥ	5,500	2,687.00	14,778,500
エレマテック	13,900	1,807.00	25,117,300
I Kホールディングス	2,300	382.00	878,600
パルグループホールディングス	30,400	2,283.00	69,403,200
エディオン	61,200	1,539.00	94,186,800
あらた	23,700	3,105.00	73,588,500
サーラコーポレーション	32,500	803.00	26,097,500
ワッツ	3,300	588.00	1,940,400
トーメンデバイス	2,200	5,330.00	11,726,000
ハローズ	7,000	4,295.00	30,065,000
J Pホールディングス	38,400	433.00	16,627,200
フジオフードグループ本社	17,400	1,438.00	25,021,200
あみやき亭	3,700	4,505.00	16,668,500
東京エレクトロン デバイス	15,400	6,530.00	100,562,000
ひらまつ	16,400	270.00	4,428,000
円谷フィールズホールディングス	26,600	1,786.00	47,507,600
双日	172,300	3,722.00	641,300,600
アルフレッサ ホールディングス	155,300	2,394.50	371,865,850
大黒天物産	4,800	8,770.00	42,096,000
ハニーズホールディングス	13,700	1,696.00	23,235,200
ファーマライズホールディングス	1,600	654.00	1,046,400
キッコーマン	95,400	9,072.00	865,468,800

味の素	342,100	5,658.00	1,935,601,800	
ブルドックソース	7,600	2,110.00	16,036,000	
キューピー	77,400	2,627.50	203,368,500	
ハウス食品グループ本社	49,600	3,142.00	155,843,200	
カゴメ	61,900	3,638.00	225,192,200	
焼津水産化学工業	2,800	1,348.00	3,774,400	
アリアケジャパン	14,400	4,610.00	66,384,000	
ピエトロ	900	1,808.00	1,627,200	
エバラ食品工業	3,400	2,941.00	9,999,400	
やまみ	900	4,085.00	3,676,500	
ニチレイ	66,000	3,750.00	247,500,000	
横浜冷凍	42,100	1,110.00	46,731,000	
東洋水産	72,800	8,053.00	586,258,400	
イトアンドホールディングス	6,800	2,137.00	14,531,600	
大冷	1,000	1,945.00	1,945,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,500	1,172.00	7,618,000	
日清食品ホールディングス	151,900	4,733.00	718,942,700	
永谷園ホールディングス	7,100	2,269.00	16,109,900	
一正蒲鉾	2,800	738.00	2,066,400	
フジッコ	14,800	1,966.00	29,096,800	
ロック・フィールド	17,600	1,615.00	28,424,000	
日本たばこ産業	874,800	3,939.00	3,445,837,200	
ケンコーマヨネーズ	9,900	1,827.00	18,087,300	
わらべや日洋ホールディングス	9,600	2,841.00	27,273,600	
なとり	9,100	2,177.00	19,810,700	
イフジ産業	1,200	1,414.00	1,696,800	
ファーマフーズ	20,700	997.00	20,637,900	
北の達人コーポレーション	61,700	232.00	14,314,400	
ユーグレナ	89,600	658.00	58,956,800	
紀文食品	12,500	1,172.00	14,650,000	
ピクルスホールディングス	8,400	1,295.00	10,878,000	
スター・マイカ・ホールディングス	16,700	545.00	9,101,500	
SREホールディングス	6,200	3,320.00	20,584,000	
ADワークスグループ	16,100	234.00	3,767,400	
片倉工業	13,500	1,787.00	24,124,500	
ゲンゼ	10,400	5,560.00	57,824,000	
ヒューリック	335,900	1,594.00	535,424,600	
神栄	1,000	1,712.00	1,712,000	
ラサ商事	6,300	1,686.00	10,621,800	
アルペン	12,700	2,008.00	25,501,600	
ハブ	2,200	732.00	1,610,400	
ラクーンホールディングス	10,900	692.00	7,542,800	
クオールホールディングス	21,300	1,627.00	34,655,100	
アルコニックス	20,400	1,401.00	28,580,400	
神戸物産	119,700	3,708.00	443,847,600	
ソリトンシステムズ	7,600	1,410.00	10,716,000	
ジーンズホールディングス	9,200	4,130.00	37,996,000	
ピックカメラ	82,300	1,345.00	110,693,500	
DCMホールディングス	81,800	1,373.00	112,311,400	
ペッパーフードサービス	35,800	93.00	3,329,400	

ハイパー	1,600	301.00	481,600
MonotaRO	219,300	1,381.50	302,962,950
東京一番フーズ	1,700	532.00	904,400
DDグループ	4,400	1,520.00	6,688,000
あいホールディングス	24,800	2,461.00	61,032,800
ディービーエックス	1,900	1,072.00	2,036,800
きちりホールディングス	1,800	1,027.00	1,848,600
J.フロントリテイリング	177,500	1,503.50	266,871,250
ドトール・日レスホールディングス	27,400	2,149.00	58,882,600
マツキヨココカラ&カンパニー	281,400	2,777.50	781,588,500
ブロンコビリー	9,100	3,335.00	30,348,500
ZOZO	98,600	3,367.00	331,986,200
トレジャー・ファクトリー	8,500	1,449.00	12,316,500
物語コーポレーション	25,800	5,280.00	136,224,000
三越伊勢丹ホールディングス	260,500	1,957.50	509,928,750
東洋紡	63,300	1,114.00	70,516,200
ユニチカ	47,300	165.00	7,804,500
富士紡ホールディングス	6,400	4,280.00	27,392,000
日清紡ホールディングス	111,000	1,244.50	138,139,500
倉敷紡績	10,400	3,060.00	31,824,000
ダイワボウホールディングス	68,500	3,144.00	215,364,000
シキボウ	7,700	1,202.00	9,255,400
日東紡績	18,600	5,020.00	93,372,000
トヨタ紡織	61,600	2,361.50	145,468,400
マクニカホールディングス	36,600	8,065.00	295,179,000
Hamee	6,200	1,093.00	6,776,600
マーケットエンタープライズ	600	1,028.00	616,800
ラクト・ジャパン	6,000	2,252.00	13,512,000
ウエルシアホールディングス	80,200	2,621.50	210,244,300
クリエイトSDホールディングス	21,900	3,230.00	70,737,000
グリムス	6,500	2,054.00	13,351,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	23,400	1,195.00	27,963,000
八洲電機	12,500	1,294.00	16,175,000
メディアスホールディングス	9,000	745.00	6,705,000
レスターホールディングス	13,200	3,025.00	39,930,000
ジオリーブグループ	1,600	1,334.00	2,134,400
丸善CHIホールディングス	8,300	326.00	2,705,800
大光	3,600	639.00	2,300,400
OCHIホールディングス	1,600	1,600.00	2,560,000
TOKAIホールディングス	84,000	1,005.00	84,420,000
黒谷	2,200	611.00	1,344,200
ミサワ	1,500	619.00	928,500
ティーライフ	900	1,409.00	1,268,100
Cominix	1,400	849.00	1,188,600
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	1,286.00	22,505,000
チムニー	2,100	1,457.00	3,059,700
シュッピン	14,000	1,013.00	14,182,000
ビューティガレージ	4,900	2,147.00	10,520,300

オイシックス・ラ・大地	20,800	1,374.00	28,579,200
ウイン・パートナーズ	10,100	1,260.00	12,726,000
ネクステージ	35,300	2,388.00	84,296,400
ジョイフル本田	45,000	1,942.00	87,390,000
鳥貴族ホールディングス	5,700	3,685.00	21,004,500
ホットランド	11,800	2,021.00	23,847,800
すかいらーくホールディングス	211,400	2,373.00	501,652,200
SFPホールディングス	8,500	2,125.00	18,062,500
綿半ホールディングス	12,000	1,480.00	17,760,000
日本毛織	37,500	1,404.00	52,650,000
ダイトウボウ	10,400	90.00	936,000
トーア紡コーポレーション	2,500	434.00	1,085,000
ダイドーリミテッド	9,400	585.00	5,499,000
ヨシックスホールディングス	3,200	2,962.00	9,478,400
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	1,001.00	43,143,100
野村不動産ホールディングス	80,100	3,739.00	299,493,900
三重交通グループホールディングス	30,900	610.00	18,849,000
サムティ	22,900	2,502.00	57,295,800
ディア・ライフ	24,500	980.00	24,010,000
コーセーアールイー	2,000	913.00	1,826,000
地主	11,000	2,262.00	24,882,000
プレサンスコーポレーション	22,900	1,704.00	39,021,600
フィル・カンパニー	2,200	782.00	1,720,400
THEグローバル社	4,300	386.00	1,659,800
ハウスコム	1,000	907.00	907,000
JPMC	8,300	1,144.00	9,495,200
サンセイランディック	1,900	1,102.00	2,093,800
エストラスト	700	645.00	451,500
フージャースホールディングス	22,200	1,143.00	25,374,600
オープンハウスグループ	52,700	4,681.00	246,688,700
東急不動産ホールディングス	432,900	995.00	430,735,500
飯田グループホールディングス	138,000	2,139.50	295,251,000
イーグランド	1,000	1,587.00	1,587,000
ムゲンエステート	4,300	1,151.00	4,949,300
帝国繊維	16,500	2,150.00	35,475,000
日本コークス工業	148,700	128.00	19,033,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,000	620.00	4,340,000
ミタチ産業	1,900	1,123.00	2,133,700
B E E N O S	6,300	1,444.00	9,097,200
あさひ	14,300	1,305.00	18,661,500
日本調剤	10,500	1,460.00	15,330,000
コスモス薬品	13,100	16,000.00	209,600,000
シップヘルスケアホールディングス	55,600	2,218.00	123,320,800
トーエル	3,100	793.00	2,458,300
ソフトクリエイイトホールディングス	12,100	1,788.00	21,634,800
セブン&アイ・ホールディングス	533,100	6,074.00	3,238,049,400
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	104,700	1,092.00	114,332,400
明治電機工業	5,800	1,462.00	8,479,600

ツルハホールディングス	32,500	11,005.00	357,662,500	
デリカフーズホールディングス	3,000	594.00	1,782,000	
スターティアホールディングス	1,800	1,579.00	2,842,200	
サンマルクホールディングス	12,500	2,240.00	28,000,000	
フェリシモ	1,500	917.00	1,375,500	
トリドールホールディングス	43,400	4,498.00	195,213,200	
帝人	140,700	1,364.00	191,914,800	
東レ	981,200	746.50	732,465,800	
クラレ	213,400	1,553.00	331,410,200	
旭化成	990,800	1,038.50	1,028,945,800	
T O K Y O B A S E	18,500	309.00	5,716,500	
稲葉製作所	7,500	1,517.00	11,377,500	
宮地エンジニアリンググループ	7,600	3,510.00	26,676,000	
トーカロ	43,600	1,529.00	66,664,400	
アルファ	2,400	1,602.00	3,844,800	
S U M C O	268,000	2,260.00	605,680,000	
川田テクノロジーズ	3,600	7,590.00	27,324,000	
R S T e c h n o l o g i e s	10,100	2,802.00	28,300,200	
ジェイテックコーポレーション	1,200	2,034.00	2,440,800	
信和	4,300	762.00	3,276,600	
ビーロッド	4,400	1,052.00	4,628,800	
ファーストブラザーズ	1,300	1,256.00	1,632,800	
A n d D o ホールディングス	8,700	1,118.00	9,726,600	
シーアールイー	8,000	1,388.00	11,104,000	
ケイアイスター不動産	6,900	3,410.00	23,529,000	
アグレ都市デザイン	1,100	1,620.00	1,782,000	
グッドコムアセット	13,400	788.00	10,559,200	
ジェイ・エス・ビー	7,200	2,711.00	19,519,200	
ロードスターキャピタル	9,400	1,944.00	18,273,600	
テンポイノベーション	1,900	936.00	1,778,400	
グローバル・リンク・マネジメント	1,200	2,481.00	2,977,200	
フェイスネットワーク	1,700	1,581.00	2,687,700	
霞ヶ関キャピタル	3,900	11,680.00	45,552,000	
住江織物	1,300	2,416.00	3,140,800	
日本フェルト	3,700	433.00	1,602,100	
イチカワ	800	1,775.00	1,420,000	
エコナックホールディングス	5,800	129.00	748,200	
日東製網	700	1,566.00	1,096,200	
芦森工業	1,300	2,400.00	3,120,000	
アツギ	4,500	554.00	2,493,000	
ウイルプラスホールディングス	1,400	1,029.00	1,440,600	
J Mホールディングス	11,700	2,356.00	27,565,200	
コメダホールディングス	37,900	2,767.00	104,869,300	
サツドラホールディングス	2,800	804.00	2,251,200	
アレンザホールディングス	11,600	1,164.00	13,502,400	
串カツ田中ホールディングス	4,100	1,970.00	8,077,000	
バロックジャパンリミテッド	12,000	819.00	9,828,000	
クスリのアオキホールディングス	46,600	3,139.00	146,277,400	
ダイニック	2,100	704.00	1,478,400	
共和レザー	3,800	807.00	3,066,600	

ピーバンドットコム	900	404.00	363,600	
力の源ホールディングス	7,900	1,456.00	11,502,400	
FOOD & LIFE COMPANIES	82,500	2,855.50	235,578,750	
アセンテック	5,900	570.00	3,363,000	
セーレン	28,300	2,458.00	69,561,400	
ソトー	2,100	689.00	1,446,900	
東海染工	600	822.00	493,200	
小松マテーレ	21,200	784.00	16,620,800	
ワコールホールディングス	30,000	3,474.00	104,220,000	
ホギメディカル	19,300	3,395.00	65,523,500	
クラウドシアホールディングス	1,500	406.00	609,000	
T S Iホールディングス	47,600	680.00	32,368,000	
マツオカコーポレーション	2,000	1,710.00	3,420,000	
ワールド	20,700	1,990.00	41,193,000	
T I S	160,400	3,409.00	546,803,600	
テクミラホールディングス	3,000	474.00	1,422,000	
グリー	49,100	579.00	28,428,900	
G M Oペパボ	1,800	1,194.00	2,149,200	
コーエーテクモホールディングス	91,900	1,796.50	165,098,350	
三菱総合研究所	7,200	4,910.00	35,352,000	
ボルテージ	1,800	271.00	487,800	
電算	800	1,497.00	1,197,600	
A G S	2,700	911.00	2,459,700	
ファインデックス	11,600	1,015.00	11,774,000	
ブレインパッド	12,200	1,262.00	15,396,400	
K L a b	26,900	359.00	9,657,100	
ポルトゥウィンホールディングス	25,000	485.00	12,125,000	
ネクソン	328,200	2,890.50	948,662,100	
アイスタイル	47,800	409.00	19,550,200	
エムアップホールディングス	18,000	998.00	17,964,000	
エイチーム	8,700	559.00	4,863,300	
エニグモ	18,600	350.00	6,510,000	
テクノスジャパン	5,800	638.00	3,700,400	
e n i s h	6,600	184.00	1,214,400	
コロブラ	56,900	627.00	35,676,300	
オルトプラス	5,800	152.00	881,600	
ブロードリーフ	69,600	628.00	43,708,800	
クロス・マーケティンググループ	3,100	574.00	1,779,400	
デジタルハーツホールディングス	9,100	1,044.00	9,500,400	
メディアドゥ	6,600	1,244.00	8,210,400	
じげん	42,800	520.00	22,256,000	
ブイキューブ	17,500	302.00	5,285,000	
エンカレッジ・テクノロジー	1,500	639.00	958,500	
サイバーリンクス	2,500	809.00	2,022,500	
ディー・エル・イー	4,600	184.00	846,400	
フィックスターズ	16,500	1,599.00	26,383,500	
C A R T A H O L D I N G S	6,900	1,556.00	10,736,400	
オブティム	15,100	915.00	13,816,500	
セレス	5,900	1,246.00	7,351,400	



SHIFT	9,700	27,485.00	266,604,500	
特種東海製紙	8,000	3,940.00	31,520,000	
ティーガイア	15,400	2,035.00	31,339,000	
セック	1,800	5,100.00	9,180,000	
テクマトリックス	26,800	1,901.00	50,946,800	
プロシップ	7,100	1,407.00	9,989,700	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	38,200	2,486.50	94,984,300	
GMOペイメントゲートウェイ	29,300	8,814.00	258,250,200	
ザッパラス	1,500	433.00	649,500	
システムリサーチ	5,000	3,425.00	17,125,000	
インターネットイニシアティブ	70,100	2,827.50	198,207,750	
さくらインターネット	16,500	3,785.00	62,452,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,500	2,749.00	12,370,500	
SRAホールディングス	7,500	3,880.00	29,100,000	
システムインテグレータ	2,000	434.00	868,000	
朝日ネット	15,800	629.00	9,938,200	
eBASE	20,700	711.00	14,717,700	
アバントグループ	18,500	1,369.00	25,326,500	
アドソル日進	6,200	1,597.00	9,901,400	
ODKソリューションズ	1,300	602.00	782,600	
フリービット	6,400	1,431.00	9,158,400	
コムチュア	21,200	1,833.00	38,859,600	
アステリア	11,500	629.00	7,233,500	
アイル	6,800	3,230.00	21,964,000	
王子ホールディングス	610,000	576.20	351,482,000	
日本製紙	82,600	1,376.00	113,657,600	
三菱製紙	8,800	619.00	5,447,200	
北越コーポレーション	72,000	1,373.00	98,856,000	
中越パルプ工業	2,600	2,008.00	5,220,800	
巴川コーポレーション	1,800	952.00	1,713,600	
大王製紙	64,700	1,143.00	73,952,100	
阿波製紙	1,800	480.00	864,000	
マークライnz	7,900	3,000.00	23,700,000	
メディカル・データ・ビジョン	17,500	634.00	11,095,000	
gumi	23,800	399.00	9,496,200	
ショーケース	1,500	333.00	499,500	
モバイルファクトリー	1,400	726.00	1,016,400	
テラスカイ	6,300	1,527.00	9,620,100	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,600	1,778.00	13,512,800	
PCIホールディングス	2,400	1,014.00	2,433,600	
アイビーシー	1,000	468.00	468,000	
ネオジャパン	4,900	1,055.00	5,169,500	
PR TIMES	2,900	2,146.00	6,223,400	
ラクス	69,400	2,384.50	165,484,300	
ランドコンピュータ	3,100	887.00	2,749,700	
ダブルスタンダード	4,500	1,642.00	7,389,000	
オーブンドア	8,500	942.00	8,007,000	

マイネット	2,100	278.00	583,800
アカツキ	7,000	2,504.00	17,528,000
ベネフィットジャパン	400	1,245.00	498,000
Ubicomホールディングス	4,600	1,602.00	7,369,200
カナミックネットワーク	15,800	424.00	6,699,200
ノムラシステムコーポレーション	7,100	114.00	809,400
レンゴー	133,400	1,030.00	137,402,000
トーモク	8,500	2,295.00	19,507,500
ザ・パック	10,900	3,380.00	36,842,000
チェンジホールディングス	31,900	1,374.00	43,830,600
シンクロ・フード	4,100	654.00	2,681,400
オークネット	5,400	2,127.00	11,485,800
キャピタル・アセット・プランニング	1,300	753.00	978,900
セグエグループ	2,100	922.00	1,936,200
エイトレッド	1,000	1,416.00	1,416,000
マクロミル	28,800	775.00	22,320,000
ビーグリー	1,400	1,275.00	1,785,000
オロ	5,300	2,865.00	15,184,500
ユーザーローカル	6,200	2,084.00	12,920,800
テモナ	1,500	256.00	384,000
ニーズウェル	3,600	795.00	2,862,000
マネーフォワード	32,700	5,736.00	187,567,200
サインポスト	2,500	512.00	1,280,000
レゾナック・ホールディングス	141,500	2,952.50	417,778,750
住友化学	1,086,700	307.50	334,160,250
住友精化	6,900	4,980.00	34,362,000
日産化学	68,800	6,142.00	422,569,600
ラサ工業	5,600	2,281.00	12,773,600
クレハ	32,000	2,825.00	90,400,000
多木化学	5,700	3,170.00	18,069,000
テイカ	12,700	1,414.00	17,957,800
石原産業	24,300	1,567.00	38,078,100
片倉コープアグリ	1,600	1,118.00	1,788,800
日本曹達	17,300	5,770.00	99,821,000
東ソー	195,500	1,913.50	374,089,250
トクヤマ	47,300	2,258.50	106,827,050
セントラル硝子	15,600	2,911.00	45,411,600
東亜合成	70,500	1,539.50	108,534,750
大阪ソーダ	10,200	10,890.00	111,078,000
関東電化工業	28,300	909.00	25,724,700
SUNASTERISK	10,400	961.00	9,994,400
デンカ	53,300	2,441.00	130,105,300
イビデン	77,000	7,222.00	556,094,000
信越化学工業	1,328,100	5,828.00	7,740,166,800
日本カーバイド工業	6,200	1,562.00	9,684,400
プラスアルファ・コンサルティング	8,700	2,440.00	21,228,000
電算システムホールディングス	6,500	2,957.00	19,220,500
堺化学工業	11,100	1,924.00	21,356,400
第一稀元素化学工業	16,000	971.00	15,536,000
エア・ウォーター	138,200	2,034.00	281,098,800

日本酸素ホールディングス	142,100	4,148.00	589,430,800	
日本化学工業	5,300	1,965.00	10,414,500	
東邦アセチレン	6,900	375.00	2,587,500	
日本パーカライジング	65,300	1,234.00	80,580,200	
高压ガス工業	21,400	864.00	18,489,600	
チタン工業	900	1,124.00	1,011,600	
四国化成ホールディングス	18,700	1,759.00	32,893,300	
戸田工業	3,300	1,617.00	5,336,100	
ステラ ケミファ	7,900	3,290.00	25,991,000	
保土谷化学工業	4,600	3,585.00	16,491,000	
日本触媒	21,300	5,583.00	118,917,900	
大日精化工業	10,200	2,736.00	27,907,200	
カネカ	37,200	3,575.00	132,990,000	
協和キリン	177,200	2,268.00	401,889,600	
A P P I E R G R O U P	50,100	1,710.00	85,671,000	
三菱瓦斯化学	109,400	2,356.00	257,746,400	
三井化学	120,800	4,150.00	501,320,000	
J S R	159,500	3,980.00	634,810,000	
東京応化工業	69,900	3,519.00	245,978,100	
大阪有機化学工業	12,300	3,005.00	36,961,500	
三菱ケミカルグループ	1,070,700	860.30	921,123,210	
K H ネオケム	22,300	2,370.00	52,851,000	
ビジョナル	11,200	9,180.00	102,816,000	
ダイセル	188,300	1,446.00	272,281,800	
住友ベークライト	20,500	7,469.00	153,114,500	
積水化学工業	294,300	2,060.00	606,258,000	
日本ゼオン	100,400	1,281.50	128,662,600	
アイカ工業	37,000	3,480.00	128,760,000	
U B E	69,700	2,527.50	176,166,750	
積水樹脂	21,900	2,576.00	56,414,400	
タキロンシーアイ	37,400	622.00	23,262,800	
旭有機材	9,700	3,805.00	36,908,500	
ニチパン	7,900	1,762.00	13,919,800	
リケンテクノス	31,600	981.00	30,999,600	
大倉工業	6,800	3,000.00	20,400,000	
積水化成品工業	20,700	458.00	9,480,600	
群栄化学工業	3,400	3,500.00	11,900,000	
タイガースポリマー	3,000	982.00	2,946,000	
ミライアル	2,200	1,520.00	3,344,000	
ダイキアクシス	2,700	717.00	1,935,900	
ダイキョーニシカワ	32,400	741.00	24,008,400	
竹本容器	2,600	784.00	2,038,400	
森六ホールディングス	7,600	2,868.00	21,796,800	
恵和	10,500	1,429.00	15,004,500	
日本化薬	111,900	1,274.50	142,616,550	
カーリットホールディングス	15,800	978.00	15,452,400	
ソルクシーズ	5,300	404.00	2,141,200	
C L ホールディングス	3,500	935.00	3,272,500	
プレステージ・インターナショナル	70,400	585.00	41,184,000	
フェイス	1,800	486.00	874,800	

プロトコーポレーション	16,100	1,364.00	21,960,400
ハイマックス	4,500	1,402.00	6,309,000
アミューズ	9,200	1,605.00	14,766,000
野村総合研究所	324,900	4,230.00	1,374,327,000
ドリームインキュベータ	5,200	3,035.00	15,782,000
クイック	10,400	2,416.00	25,126,400
T A C	3,300	190.00	627,000
C Eホールディングス	3,400	608.00	2,067,200
日本システム技術	5,400	3,255.00	17,577,000
電通グループ	147,700	3,962.00	585,187,400
インテージホールディングス	16,600	1,720.00	28,552,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,800	1,198.00	6,948,400
東邦システムサイエンス	5,500	1,254.00	6,897,000
ぴあ	5,000	3,360.00	16,800,000
イオンファンタジー	5,400	2,449.00	13,224,600
ソースネクスト	67,100	144.00	9,662,400
シーティーエス	19,000	734.00	13,946,000
N E X Y Z . G r o u p	2,100	698.00	1,465,800
インフォコム	18,900	2,201.00	41,598,900
メディカルシステムネットワーク	16,800	579.00	9,727,200
日本精化	9,700	2,831.00	27,460,700
扶桑化学工業	15,500	4,590.00	71,145,000
トリケミカル研究所	17,800	3,795.00	67,551,000
シンプレクス・ホールディングス	22,100	2,515.00	55,581,500
H E R O Z	5,800	1,568.00	9,094,400
ラクスル	35,300	1,063.00	37,523,900
メルカリ	71,400	2,437.50	174,037,500
I P S	4,200	2,027.00	8,513,400
F I G	7,600	301.00	2,287,600
システムサポート	5,700	1,903.00	10,847,100
A D E K A	51,100	2,876.50	146,989,150
日油	44,200	7,100.00	313,820,000
ミヨシ油脂	2,500	1,325.00	3,312,500
新日本理化	8,900	202.00	1,797,800
ハリマ化成グループ	9,100	896.00	8,153,600
イーソル	10,600	584.00	6,190,400
東海ソフト	1,100	1,167.00	1,283,700
ウイングアーク1 s t	15,200	2,852.00	43,350,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,900	1,164.00	4,539,600
サーバーワークス	3,000	4,040.00	12,120,000
東名	500	2,281.00	1,140,500
ヴィッツ	600	823.00	493,800
トピラシステムズ	1,900	871.00	1,654,900
S a n s a n	48,100	1,409.00	67,772,900
L i n k - U	1,600	634.00	1,014,400
ギフトィ	12,900	1,540.00	19,866,000
花王	331,200	5,748.00	1,903,737,600
第一工業製薬	5,800	2,966.00	17,202,800
石原ケミカル	6,600	1,898.00	12,526,800

日華化学	2,600	912.00	2,371,200	
ニイタカ	1,300	1,892.00	2,459,600	
三洋化成工業	9,000	4,180.00	37,620,000	
メドレー	19,700	4,615.00	90,915,500	
ベース	5,100	3,195.00	16,294,500	
J M D C	25,000	3,676.00	91,900,000	
武田薬品工業	1,297,800	4,219.00	5,475,418,200	
アステラス製薬	1,286,300	1,621.50	2,085,735,450	
住友ファーマ	108,800	345.00	37,536,000	
塩野義製薬	184,900	7,049.00	1,303,360,100	
わかもと製薬	6,800	209.00	1,421,200	
日本新薬	38,400	5,110.00	196,224,000	
中外製薬	459,000	5,193.00	2,383,587,000	
科研製薬	25,100	3,511.00	88,126,100	
エーザイ	178,400	6,521.00	1,163,346,400	
理研ビタミン	12,500	2,322.00	29,025,000	
ロート製薬	142,100	3,018.00	428,857,800	
小野薬品工業	311,200	2,517.50	783,446,000	
久光製薬	32,600	4,164.00	135,746,400	
有機合成薬品工業	5,200	288.00	1,497,600	
持田製薬	16,900	3,170.00	53,573,000	
参天製薬	267,200	1,433.50	383,031,200	
扶桑薬品工業	5,200	2,212.00	11,502,400	
日本ケミファ	700	1,605.00	1,123,500	
ツムラ	46,200	2,933.50	135,527,700	
テルモ	408,800	5,073.00	2,073,842,400	
H . U . グループホールディングス	44,000	2,678.00	117,832,000	
キッセイ薬品工業	24,300	3,160.00	76,788,000	
生化学工業	24,900	773.00	19,247,700	
栄研化学	26,900	1,939.00	52,159,100	
鳥居薬品	7,900	3,675.00	29,032,500	
J C R ファーマ	49,600	1,000.00	49,600,000	
東和薬品	22,500	2,667.00	60,007,500	
富士製薬工業	10,800	1,975.00	21,330,000	
ゼリア新薬工業	20,300	2,211.00	44,883,300	
そーせいグループ	48,100	1,430.00	68,783,000	
第一三共	1,277,500	4,512.00	5,764,080,000	
杏林製薬	31,800	1,764.00	56,095,200	
大幸薬品	30,300	306.00	9,271,800	
ダイト	11,300	1,976.00	22,328,800	
大塚ホールディングス	305,000	5,630.00	1,717,150,000	
大正製薬ホールディングス	32,600	8,598.00	280,294,800	
ペプチドリーム	71,100	1,301.50	92,536,650	
大日本塗料	16,300	1,156.00	18,842,800	
日本ペイントホールディングス	777,700	1,164.00	905,242,800	
関西ペイント	143,500	2,345.00	336,507,500	
神東塗料	5,300	127.00	673,100	
中国塗料	30,100	1,947.00	58,604,700	
日本特殊塗料	4,700	1,360.00	6,392,000	
藤倉化成	16,800	469.00	7,879,200	

太陽ホールディングス	25,500	3,060.00	78,030,000
D I C	57,200	2,801.50	160,245,800
サカティンクス	32,600	1,421.00	46,324,600
a r t i e n c e	31,900	2,772.00	88,426,800
T & K T O K A	14,000	1,407.00	19,698,000
アルプス技研	14,300	2,894.00	41,384,200
サニックス	24,100	288.00	6,940,800
日本空調サービス	16,200	896.00	14,515,200
オリエンタルランド	795,400	5,112.00	4,066,084,800
フォーカスシステムズ	9,800	1,049.00	10,280,200
ダスキン	33,500	3,455.00	115,742,500
パーク24	93,500	1,924.50	179,940,750
明光ネットワークジャパン	18,200	716.00	13,031,200
ファルコホールディングス	6,800	2,056.00	13,980,800
クレスコ	12,000	1,967.00	23,604,000
フジ・メディア・ホールディングス	140,900	1,965.50	276,938,950
秀英予備校	1,500	308.00	462,000
田谷	1,200	422.00	506,400
ラウンドワン	141,400	686.00	97,000,400
リゾートトラスト	65,300	2,559.00	167,102,700
オービック	49,000	22,435.00	1,099,315,000
ジャストシステム	21,100	2,954.00	62,329,400
T D C ソフト	13,700	2,123.00	29,085,100
L I N E ヤフー	2,087,700	433.30	904,600,410
ビー・エム・エル	18,500	2,856.00	52,836,000
トレンドマイクロ	69,300	8,258.00	572,279,400
I D ホールディングス	9,900	1,695.00	16,780,500
リソー教育	76,800	240.00	18,432,000
日本オラクル	28,100	11,275.00	316,827,500
早稲田アカデミー	8,300	1,748.00	14,508,400
アルファシステムズ	3,900	3,140.00	12,246,000
フューチャー	31,300	1,703.00	53,303,900
C A C H o l d i n g s	7,900	1,795.00	14,180,500
S B テクノロジー	6,200	2,196.00	13,615,200
トーセ	1,900	708.00	1,345,200
ユー・エス・エス	168,600	2,688.00	453,196,800
オービックビジネスコンサルタント	20,600	7,062.00	145,477,200
アイティフォー	18,800	1,209.00	22,729,200
東京個別指導学院	17,900	450.00	8,055,000
東計電算	4,100	3,680.00	15,088,000
サイバーエージェント	332,100	1,023.00	339,738,300
楽天グループ	1,288,300	635.00	818,070,500
エクスネット	1,000	1,105.00	1,105,000
クリーク・アンド・リバー社	7,600	1,998.00	15,184,800
S B I グローバルアセットマネジメント	29,400	695.00	20,433,000
テー・オー・ダブリュー	29,400	343.00	10,084,200
大塚商会	72,700	5,983.00	434,964,100
サイボウズ	20,200	2,253.00	45,510,600
山田コンサルティンググループ	6,500	1,751.00	11,381,500

セントラルスポーツ	5,600	2,489.00	13,938,400	
パラカ	5,100	2,005.00	10,225,500	
電通総研	17,800	5,430.00	96,654,000	
A C C E S S	15,200	840.00	12,768,000	
デジタルガレージ	23,400	3,515.00	82,251,000	
イーエムシステムズ	24,500	682.00	16,709,000	
ウェザーニューズ	4,500	5,110.00	22,995,000	
C I J	24,400	685.00	16,714,000	
ビジネスエンジニアリング	2,800	4,455.00	12,474,000	
日本エンタープライズ	6,600	124.00	818,400	
WOWOW	11,000	1,160.00	12,760,000	
スカラ	13,500	760.00	10,260,000	
インテリジェント ウェイブ	3,500	1,124.00	3,934,000	
フルキャストホールディングス	14,400	1,790.00	25,776,000	
エン・ジャパン	24,500	2,741.00	67,154,500	
セルソース	4,100	1,308.00	5,362,800	
あすか製薬ホールディングス	15,000	1,902.00	28,530,000	
サワイグループホールディングス	33,500	5,695.00	190,782,500	
富士フイルムホールディングス	272,000	9,832.00	2,674,304,000	
コニカミノルタ	329,800	482.10	158,996,580	
資生堂	306,200	4,220.00	1,292,164,000	
ライオン	191,900	1,304.50	250,333,550	
高砂香料工業	11,000	3,635.00	39,985,000	
マンダム	31,700	1,315.00	41,685,500	
ミルボン	19,900	3,482.00	69,291,800	
ファンケル	64,100	2,217.00	142,109,700	
コーセー	29,800	9,384.00	279,643,200	
コタ	13,500	1,569.00	21,181,500	
シーボン	900	1,492.00	1,342,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	75,200	1,538.00	115,657,600	
ノエビアホールディングス	13,100	5,180.00	67,858,000	
アジュバンホールディングス	1,600	931.00	1,489,600	
新日本製薬	8,400	1,786.00	15,002,400	
I - n e	2,900	2,352.00	6,820,800	
アクシージア	7,200	847.00	6,098,400	
エステー	11,300	1,529.00	17,277,700	
アグロ カネショウ	5,900	1,319.00	7,782,100	
コニシ	42,400	1,319.00	55,925,600	
長谷川香料	28,000	3,315.00	92,820,000	
小林製薬	42,700	6,360.00	271,572,000	
荒川化学工業	12,400	1,122.00	13,912,800	
メック	12,100	4,345.00	52,574,500	
日本高純度化学	3,300	2,691.00	8,880,300	
タカラバイオ	39,500	1,228.00	48,506,000	
J C U	16,400	3,795.00	62,238,000	
新田ゼラチン	4,400	758.00	3,335,200	
O A T アグリオ	4,800	1,899.00	9,115,200	
デクセリアルズ	36,800	5,364.00	197,395,200	
アース製薬	13,300	4,590.00	61,047,000	
北興化学工業	14,800	1,051.00	15,554,800	

大成ラミック	4,200	3,090.00	12,978,000
クミアイ化学工業	58,300	842.00	49,088,600
日本農薬	26,900	683.00	18,372,700
富士興産	1,900	2,182.00	4,145,800
ニチレキ	19,100	2,445.00	46,699,500
ユシロ化学工業	7,600	2,068.00	15,716,800
ピーピー・カストロール	2,500	866.00	2,165,000
富士石油	42,700	370.00	15,799,000
MORESCO	2,300	1,436.00	3,302,800
出光興産	814,300	814.60	663,328,780
ENEOSホールディングス	2,321,700	594.70	1,380,714,990
コスモエネルギーホールディングス	43,500	6,035.00	262,522,500
ANYCOLOR	15,500	3,380.00	52,390,000
テスホールディングス	30,900	447.00	13,812,300
インフロニア・ホールディングス	165,300	1,536.00	253,900,800
横浜ゴム	74,200	3,545.00	263,039,000
TOYO TIRE	84,300	2,556.00	215,470,800
ブリヂストン	429,200	6,341.00	2,721,557,200
住友ゴム工業	143,800	1,740.00	250,212,000
藤倉コンポジット	11,300	1,441.00	16,283,300
オカモト	6,900	4,875.00	33,637,500
アキレス	9,300	1,566.00	14,563,800
フコク	7,700	1,497.00	11,526,900
ニッタ	14,900	3,695.00	55,055,500
クリエートメディック	2,100	891.00	1,871,100
住友理工	22,800	1,202.00	27,405,600
三ツ星ベルト	17,800	4,775.00	84,995,000
バンドー化学	21,800	1,760.00	38,368,000
AGC	130,800	5,677.00	742,551,600
日本板硝子	69,900	608.00	42,499,200
石塚硝子	1,100	3,510.00	3,861,000
有沢製作所	25,700	1,123.00	28,861,100
日本山村硝子	2,400	1,462.00	3,508,800
日本電気硝子	59,800	3,523.00	210,675,400
オハラ	7,000	1,155.00	8,085,000
住友大阪セメント	24,400	3,745.00	91,378,000
太平洋セメント	86,700	3,113.00	269,897,100
リソルホールディングス	600	6,110.00	3,666,000
日本ヒューム	12,800	904.00	11,571,200
日本コンクリート工業	28,400	473.00	13,433,200
三谷セキサン	5,900	5,240.00	30,916,000
アジアパイルホールディングス	20,800	812.00	16,889,600
東海カーボン	135,300	1,031.00	139,494,300
日本カーボン	7,800	4,420.00	34,476,000
東洋炭素	10,300	5,020.00	51,706,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,100	7,890.00	63,909,000
TOTO	96,800	3,743.00	362,322,400
日本碍子	170,600	1,860.00	317,316,000
日本特殊陶業	122,800	4,229.00	519,321,200
ダントーホールディングス	4,300	948.00	4,076,400



MARUWA	5,400	30,700.00	165,780,000	
品川リフラクトリーズ	18,100	2,039.00	36,905,900	
黒崎播磨	3,000	12,890.00	38,670,000	
ヨータイ	9,100	1,459.00	13,276,900	
東京窯業	7,000	517.00	3,619,000	
ニッカトー	3,000	582.00	1,746,000	
フジインコーポレーテッド	39,400	3,375.00	132,975,000	
クニミネ工業	1,900	1,018.00	1,934,200	
エーアンドエーマテリアル	1,400	1,385.00	1,939,000	
ニチアス	37,100	3,440.00	127,624,000	
日本製鉄	675,600	3,565.00	2,408,514,000	
神戸製鋼所	303,400	2,068.00	627,431,200	
中山製鋼所	34,600	943.00	32,627,800	
合同製鐵	8,500	5,860.00	49,810,000	
JFEホールディングス	419,600	2,320.50	973,681,800	
東京製鐵	42,500	1,741.00	73,992,500	
共英製鋼	17,300	2,142.00	37,056,600	
大和工業	28,500	8,469.00	241,366,500	
東京鐵鋼	6,700	5,380.00	36,046,000	
大阪製鐵	7,000	2,208.00	15,456,000	
淀川製鋼所	17,200	3,940.00	67,768,000	
中部鋼鈹	9,900	2,439.00	24,146,100	
丸一鋼管	46,000	3,821.00	175,766,000	
モリ工業	2,600	4,885.00	12,701,000	
大同特殊鋼	95,100	1,678.50	159,625,350	
日本高周波鋼業	2,700	554.00	1,495,800	
日本冶金工業	11,000	4,260.00	46,860,000	
山陽特殊製鋼	15,000	2,209.00	33,135,000	
愛知製鋼	8,700	3,465.00	30,145,500	
日本金属	1,900	882.00	1,675,800	
ミガロホールディングス	1,000	1,481.00	1,481,000	
大平洋金属	12,900	1,358.00	17,518,200	
新日本電工	75,400	283.00	21,338,200	
栗本鐵工所	7,000	3,670.00	25,690,000	
虹 技	900	1,495.00	1,345,500	
日本鑄鉄管	800	1,178.00	942,400	
日本製鋼所	40,700	2,345.50	95,461,850	
三菱製鋼	11,200	1,671.00	18,715,200	
日亜鋼業	7,400	333.00	2,464,200	
日本精線	2,100	5,510.00	11,571,000	
エンビプロ・ホールディングス	11,900	591.00	7,032,900	
大紀アルミニウム工業所	19,200	1,229.00	23,596,800	
日本輕金属ホールディングス	44,200	1,722.00	76,112,400	
三井金属鋳業	43,900	4,864.00	213,529,600	
東邦亜鉛	9,800	1,119.00	10,966,200	
三菱マテリアル	108,000	2,771.00	299,268,000	
住友金属鋳山	174,900	4,004.00	700,299,600	
DOWAホールディングス	37,300	5,084.00	189,633,200	
古河機械金属	20,000	1,920.00	38,400,000	
エス・サイエンス	41,900	22.00	921,800	

大阪チタニウムテクノロジーズ	26,200	2,791.00	73,124,200
東邦チタニウム	31,200	1,860.00	58,032,000
UACJ	21,200	4,145.00	87,874,000
CKサンエツ	2,700	3,850.00	10,395,000
古河電気工業	50,200	2,759.50	138,526,900
住友電気工業	564,400	2,073.50	1,170,283,400
フジクラ	177,900	1,242.00	220,951,800
SWCC	16,900	3,120.00	52,728,000
タツタ電線	26,800	688.00	18,438,400
カナレ電気	1,100	1,691.00	1,860,100
平河ビューテック	9,600	1,366.00	13,113,600
いよぎんホールディングス	171,400	1,019.00	174,656,600
しずおかフィナンシャルグループ	320,000	1,404.50	449,440,000
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	121,300	1,077.50	130,700,750
楽天銀行	50,100	2,333.00	116,883,300
京都フィナンシャルグループ	182,500	2,436.00	444,570,000
リョービ	16,100	2,761.00	44,452,100
アーレスティ	7,400	768.00	5,683,200
AREホールディングス	56,800	1,939.00	110,135,200
東洋製罐グループホールディングス	86,600	2,404.00	208,186,400
ホッカインホールディングス	7,400	1,852.00	13,704,800
コロナ	8,600	953.00	8,195,800
横河ブリッジホールディングス	23,600	2,847.00	67,189,200
駒井ハルテック	1,200	2,093.00	2,511,600
高田機工	500	3,665.00	1,832,500
三和ホールディングス	151,600	2,358.50	357,548,600
文化シャッター	39,500	1,488.00	58,776,000
三協立山	19,000	913.00	17,347,000
アルインコ	11,500	1,043.00	11,994,500
東洋シャッター	1,500	731.00	1,096,500
LIXIL	235,500	1,960.00	461,580,000
日本フィルコン	4,400	549.00	2,415,600
ノーリツ	25,000	1,577.00	39,425,000
長府製作所	15,000	2,105.00	31,575,000
リンナイ	72,200	3,249.00	234,577,800
ユニプレス	26,200	1,109.00	29,055,800
ダイニチ工業	3,500	705.00	2,467,500
日東精工	21,900	547.00	11,979,300
三洋工業	800	3,285.00	2,628,000
岡部	26,900	797.00	21,439,300
ジーテクト	19,200	2,113.00	40,569,600
東プレ	26,600	2,235.00	59,451,000
高周波熱錬	23,300	1,058.00	24,651,400
東京製網	9,800	1,358.00	13,308,400
サンコール	13,400	480.00	6,432,000
モリテックスチール	6,100	288.00	1,756,800
パイオラックス	18,700	2,664.00	49,816,800
エイチワン	15,500	898.00	13,919,000
日本発条	133,500	1,240.00	165,540,000
中央発条	11,200	747.00	8,366,400

アドバネクス	800	1,074.00	859,200	
三浦工業	61,700	2,793.50	172,358,950	
タクマ	49,900	1,728.00	86,227,200	
テクノプロ・ホールディングス	88,000	3,365.00	296,120,000	
アトラグループ	2,000	181.00	362,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	7,800	1,321.00	10,303,800	
Keeper 技研	9,300	6,520.00	60,636,000	
ファーストロジック	1,600	503.00	804,800	
三機サービス	1,200	1,346.00	1,615,200	
Gunosy	11,900	730.00	8,687,000	
デザインワン・ジャパン	1,600	133.00	212,800	
イー・ガーディアン	5,700	1,409.00	8,031,300	
リブセンス	3,100	243.00	753,300	
ジャパンマテリアル	46,000	2,575.00	118,450,000	
ベクトル	18,400	1,185.00	21,804,000	
ウチヤマホールディングス	2,800	383.00	1,072,400	
チャーム・ケア・コーポレーション	12,500	1,373.00	17,162,500	
キャリアリンク	5,500	2,631.00	14,470,500	
IBJ	11,500	680.00	7,820,000	
アサンテ	7,400	1,665.00	12,321,000	
バリューHR	13,100	1,391.00	18,222,100	
M&Aキャピタルパートナーズ	12,200	2,394.00	29,206,800	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,000	1,037.00	6,222,000	
ERIホールディングス	1,900	1,875.00	3,562,500	
アビスト	1,000	3,115.00	3,115,000	
シグマクス・ホールディングス	20,300	1,684.00	34,185,200	
ウィルグループ	12,500	1,192.00	14,900,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	7,900	140.00	1,106,000	
メドピア	13,200	688.00	9,081,600	
レアジョブ	1,300	913.00	1,186,900	
リクルートホールディングス	1,112,800	5,783.00	6,435,322,400	
エラン	19,900	1,059.00	21,074,100	
ツガミ	32,800	1,209.00	39,655,200	
オークマ	12,900	6,908.00	89,113,200	
芝浦機械	14,700	3,375.00	49,612,500	
アマダ	235,600	1,589.00	374,368,400	
アイダエンジニアリング	34,200	844.00	28,864,800	
FUJI	69,500	2,474.00	171,943,000	
牧野フライス製作所	16,300	5,710.00	93,073,000	
オーエスジー	65,100	2,003.50	130,427,850	
ダイジェット工業	700	826.00	578,200	
旭ダイヤモンド工業	34,000	866.00	29,444,000	
DMG森精機	89,500	3,272.00	292,844,000	
ソディック	35,900	720.00	25,848,000	
ディスコ	71,100	42,850.00	3,046,635,000	
日東工器	7,200	1,974.00	14,212,800	
日進工具	13,700	1,032.00	14,138,400	
パンチ工業	6,400	433.00	2,771,200	

富士ダイス	8,700	712.00	6,194,400
土木管理総合試験所	3,100	326.00	1,010,600
日本郵政	1,766,200	1,416.00	2,500,939,200
ベルシステム24ホールディングス	16,100	1,789.00	28,802,900
鎌倉新書	12,800	620.00	7,936,000
S MN	1,300	324.00	421,200
一蔵	800	618.00	494,400
グローバルキッズCOMPANY	1,200	655.00	786,000
エアトリ	11,000	1,819.00	20,009,000
アトラエ	8,900	665.00	5,918,500
ストライク	6,400	4,840.00	30,976,000
ソラスト	41,400	570.00	23,598,000
セラク	4,600	1,119.00	5,147,400
インソース	32,600	779.00	25,395,400
豊田自動織機	124,700	13,515.00	1,685,320,500
豊和工業	3,600	773.00	2,782,800
石川製作所	1,700	1,150.00	1,955,000
リケンNPR	16,000	2,742.00	43,872,000
東洋機械金属	5,400	718.00	3,877,200
津田駒工業	1,200	388.00	465,600
エンシュウ	1,500	706.00	1,059,000
島精機製作所	23,500	1,404.00	32,994,000
オプトラン	24,300	1,742.00	42,330,600
NCホールディングス	1,600	1,600.00	2,560,000
イワキ	9,800	2,309.00	22,628,200
フリー	13,900	1,288.00	17,903,200
ヤマシンフィルタ	35,500	361.00	12,815,500
日阪製作所	16,100	997.00	16,051,700
やまびこ	24,100	1,617.00	38,969,700
野村マイクロ・サイエンス	5,000	13,250.00	66,250,000
平田機工	7,100	6,990.00	49,629,000
PEGASUS	16,300	444.00	7,237,200
マルマエ	6,400	1,802.00	11,532,800
タツモ	8,900	3,090.00	27,501,000
ナブテスコ	92,700	2,819.50	261,367,650
三井海洋開発	18,700	2,284.00	42,710,800
レオン自動機	17,100	1,501.00	25,667,100
S MC	44,200	79,080.00	3,495,336,000
ホソカワミクロン	9,500	4,625.00	43,937,500
ユニオンツール	6,500	3,275.00	21,287,500
瑞光	10,600	1,864.00	19,758,400
オイレス工業	20,100	2,078.00	41,767,800
日精エー・エス・ビー機械	5,900	4,195.00	24,750,500
サトーホールディングス	21,000	2,124.00	44,604,000
技研製作所	13,900	2,057.00	28,592,300
日本エアーテック	6,900	1,223.00	8,438,700
カワタ	2,000	1,028.00	2,056,000
日精樹脂工業	11,000	1,168.00	12,848,000
オカダアイヨン	2,200	2,724.00	5,992,800
ワイエイシイホールディングス	5,500	2,325.00	12,787,500

小松製作所	692,200	4,299.00	2,975,767,800
住友重機械工業	87,400	3,933.00	343,744,200
日立建機	58,800	4,227.00	248,547,600
日工	21,900	761.00	16,665,900
巴工業	5,800	3,630.00	21,054,000
井関農機	13,800	1,192.00	16,449,600
TOWA	16,400	7,730.00	126,772,000
丸山製作所	1,100	2,776.00	3,053,600
北川鉄工所	5,800	1,490.00	8,642,000
シンニッタン	8,600	274.00	2,356,400
ローツェ	7,700	18,220.00	140,294,000
タカキタ	2,200	497.00	1,093,400
クボタ	772,000	2,217.50	1,711,910,000
荏原実業	7,800	3,210.00	25,038,000
東洋エンジニアリング	21,100	809.00	17,069,900
三菱化工機	5,200	3,685.00	19,162,000
月島ホールディングス	20,000	1,358.00	27,160,000
帝国電機製作所	10,400	2,886.00	30,014,400
東京機械製作所	1,700	468.00	795,600
新東工業	29,900	1,114.00	33,308,600
澁谷工業	13,900	2,481.00	34,485,900
アイチコーポレーション	20,600	1,106.00	22,783,600
小森コーポレーション	36,400	1,279.00	46,555,600
鶴見製作所	11,300	3,550.00	40,115,000
日本ギア工業	2,500	667.00	1,667,500
酒井重工業	2,300	6,810.00	15,663,000
荏原製作所	60,600	9,487.00	574,912,200
石井鐵工所	800	2,708.00	2,166,400
西島製作所	12,700	2,495.00	31,686,500
北越工業	14,800	2,453.00	36,304,400
ダイキン工業	176,300	21,165.00	3,731,389,500
オルガノ	17,700	6,430.00	113,811,000
トーヨーカネツ	5,000	4,275.00	21,375,000
栗田工業	82,600	5,499.00	454,217,400
椿本チエイン	20,900	4,665.00	97,498,500
大同工業	2,900	751.00	2,177,900
日機装	34,100	1,126.00	38,396,600
木村化工機	11,300	728.00	8,226,400
レイズネクスト	20,800	1,575.00	32,760,000
アネスト岩田	22,800	1,299.00	29,617,200
ダイフク	249,200	2,867.50	714,581,000
サムコ	4,000	4,710.00	18,840,000
加藤製作所	3,300	1,520.00	5,016,000
油研工業	1,100	2,319.00	2,550,900
タダノ	85,000	1,175.50	99,917,500
フジテック	34,500	3,650.00	125,925,000
C K D	40,900	2,519.00	103,027,100
平和	43,700	2,194.00	95,877,800
理想科学工業	11,800	3,020.00	35,636,000
SANKYO	34,000	9,000.00	306,000,000

日本金銭機械	17,800	1,444.00	25,703,200
マースグループホールディングス	7,500	2,705.00	20,287,500
フクシマガリレイ	9,700	5,110.00	49,567,000
オーイズミ	2,500	450.00	1,125,000
ダイコク電機	7,300	3,590.00	26,207,000
竹内製作所	26,800	5,080.00	136,144,000
アマノ	41,900	3,664.00	153,521,600
JUKI	22,800	461.00	10,510,800
サンデン	9,800	191.00	1,871,800
ジャノメ	15,000	719.00	10,785,000
ブラザー工業	197,300	2,637.50	520,378,750
マックス	20,800	3,140.00	65,312,000
モリタホールディングス	25,700	1,541.00	39,603,700
グローリー	35,400	2,952.00	104,500,800
新晃工業	14,900	2,936.00	43,746,400
大和冷機工業	22,700	1,526.00	34,640,200
セガサミーホールディングス	131,900	2,184.00	288,069,600
T P R	18,700	2,104.00	39,344,800
ツバキ・ナカシマ	29,700	746.00	22,156,200
ホシザキ	87,100	5,377.00	468,336,700
大豊工業	12,800	831.00	10,636,800
日本精工	273,400	797.30	217,981,820
NTN	320,300	283.40	90,773,020
ジェイテクト	131,400	1,392.50	182,974,500
不二越	10,900	3,390.00	36,951,000
ミネベアミツミ	256,900	2,916.50	749,248,850
日本トムソン	40,300	594.00	23,938,200
THK	85,200	2,690.50	229,230,600
ユーシン精機	11,800	687.00	8,106,600
前澤給装工業	11,300	1,360.00	15,368,000
イーグル工業	16,300	1,720.00	28,036,000
前澤工業	4,200	1,082.00	4,544,400
日本ピラー工業	13,700	4,640.00	63,568,000
キッツ	49,500	1,221.00	60,439,500
日立製作所	709,700	11,720.00	8,317,684,000
三菱電機	1,643,600	2,015.00	3,311,854,000
富士電機	89,800	8,090.00	726,482,000
東洋電機製造	2,300	1,048.00	2,410,400
安川電機	160,400	5,316.00	852,686,400
シンフォニアテクノロジー	16,300	2,204.00	35,925,200
明電舎	27,400	2,776.00	76,062,400
オリジン	1,500	1,220.00	1,830,000
山洋電気	6,400	5,820.00	37,248,000
デンヨー	11,300	2,285.00	25,820,500
PHCホールディングス	27,600	1,506.00	41,565,600
KOKUSAI ELECTRIC	57,100	3,980.00	227,258,000
ソシオネクスト	107,200	3,673.00	393,745,600
ベイカレント・コンサルティング	110,500	3,129.00	345,754,500
Orchestra Holdings	3,200	990.00	3,168,000

アイモバイル	20,100	453.00	9,105,300
キャリアインデックス	2,300	199.00	457,700
MS - J a p a n	5,500	1,266.00	6,963,000
船場	1,400	985.00	1,379,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	48,700	2,164.00	105,386,800
フルテック	1,000	1,128.00	1,128,000
グリーンズ	2,400	2,049.00	4,917,600
ツナググループ・ホールディングス	1,900	868.00	1,649,200
G A M E W I T H	2,800	312.00	873,600
MS & C o n s u l t i n g	1,000	590.00	590,000
ウェルビー	7,500	851.00	6,382,500
エル・ティール・エス	1,700	2,863.00	4,867,100
ミダックホールディングス	9,100	1,691.00	15,388,100
キュービーネットホールディングス	8,600	1,480.00	12,728,000
R P A ホールディングス	20,400	264.00	5,385,600
三櫻工業	22,300	889.00	19,824,700
マキタ	168,400	3,808.00	641,267,200
東芝テック	18,900	3,210.00	60,669,000
芝浦メカトロニクス	8,400	7,610.00	63,924,000
マブチモーター	72,600	2,537.00	184,186,200
ニデック	326,000	5,469.00	1,782,894,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,300	347.00	3,227,100
トレックス・セミコンダクター	7,600	1,718.00	13,056,800
東光高岳	8,900	2,373.00	21,119,700
ダブル・スコープ	42,300	726.00	30,709,800
宮越ホールディングス	6,600	1,081.00	7,134,600
ダイヘン	14,800	6,470.00	95,756,000
ヤーマン	28,700	1,004.00	28,814,800
J V C ケンウッド	116,600	657.00	76,606,200
ミマキエンジニアリング	14,000	960.00	13,440,000
I - P E X	10,200	1,756.00	17,911,200
大崎電気工業	32,300	678.00	21,899,400
オムロン	112,800	5,542.00	625,137,600
日東工業	19,900	4,270.00	84,973,000
I D E C	21,800	2,783.00	60,669,400
正興電機製作所	2,200	1,117.00	2,457,400
不二電機工業	1,300	1,148.00	1,492,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	57,600	2,575.50	148,348,800
サクサホールディングス	1,500	2,835.00	4,252,500
メルコホールディングス	4,600	3,250.00	14,950,000
テクノメディカ	3,500	1,910.00	6,685,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	5,500	698.00	3,839,000
日本電気	193,900	9,464.00	1,835,069,600
富士通	135,900	22,995.00	3,125,020,500
沖電気工業	66,800	1,076.00	71,876,800
岩崎通信機	3,100	695.00	2,154,500
電気興業	6,600	2,369.00	15,635,400
サンケン電気	13,700	7,800.00	106,860,000

ナカヨ	1,100	1,147.00	1,261,700	
アイホン	8,000	2,867.00	22,936,000	
ルネサスエレクトロニクス	963,800	2,374.00	2,288,061,200	
セイコーエプソン	189,500	2,367.00	448,546,500	
ワコム	112,300	743.00	83,438,900	
アルバック	32,400	7,559.00	244,911,600	
アクセル	5,900	2,278.00	13,440,200	
E I Z O	10,800	4,950.00	53,460,000	
ジャパンディスプレイ	636,300	20.00	12,726,000	
日本信号	33,700	955.00	32,183,500	
京三製作所	30,900	465.00	14,368,500	
能美防災	20,000	2,302.00	46,040,000	
ホーチキ	11,000	2,126.00	23,386,000	
星和電機	2,900	480.00	1,392,000	
エレコム	35,300	1,687.00	59,551,100	
パナソニック ホールディングス	1,744,500	1,430.50	2,495,507,250	
シャープ	248,900	862.10	214,576,690	
アンリツ	104,000	1,164.50	121,108,000	
富士通ゼネラル	41,900	2,100.00	87,990,000	
ソニーグループ	1,034,300	14,300.00	14,790,490,000	
T D K	233,800	7,599.00	1,776,646,200	
帝国通信工業	6,500	1,949.00	12,668,500	
タムラ製作所	58,800	541.00	31,810,800	
アルプスアルパイン	131,900	1,070.00	141,133,000	
池上通信機	2,000	898.00	1,796,000	
日本電波工業	17,700	1,196.00	21,169,200	
鈴木	7,900	1,250.00	9,875,000	
メイコー	14,700	4,580.00	67,326,000	
日本トリム	3,300	3,310.00	10,923,000	
ローランド ディー・ジー	8,100	3,890.00	31,509,000	
フォスター電機	10,900	1,131.00	12,327,900	
S M K	3,800	2,500.00	9,500,000	
ヨコオ	13,000	1,428.00	18,564,000	
ティアック	10,600	99.00	1,049,400	
ホシデン	33,600	1,795.00	60,312,000	
ヒロセ電機	21,800	16,240.00	354,032,000	
日本航空電子工業	35,300	2,457.00	86,732,100	
T O A	16,800	1,125.00	18,900,000	
マクセル	32,600	1,570.00	51,182,000	
古野電気	19,200	2,034.00	39,052,800	
スミダコーポレーション	19,800	1,158.00	22,928,400	
アイコム	5,700	3,595.00	20,491,500	
リオン	6,100	2,543.00	15,512,300	
横河電機	161,600	2,923.00	472,356,800	
新電元工業	5,600	3,150.00	17,640,000	
アズビル	100,600	4,603.00	463,061,800	
東亜ディーケーケー	3,100	947.00	2,935,700	
日本光電工業	62,700	3,987.00	249,984,900	
チノー	6,100	2,395.00	14,609,500	
共和電業	6,100	423.00	2,580,300	



日本電子材料	9,000	1,912.00	17,208,000
堀場製作所	27,900	12,365.00	344,983,500
アドバンテスト	418,900	6,115.00	2,561,573,500
小野測器	2,700	460.00	1,242,000
エスベック	11,700	2,554.00	29,881,800
キーエンス	146,300	64,180.00	9,389,534,000
日置電機	6,900	6,540.00	45,126,000
シスメックス	126,200	7,613.00	960,760,600
日本マイクロニクス	26,300	4,180.00	109,934,000
メガチップス	11,600	4,750.00	55,100,000
OBARA GROUP	8,000	3,940.00	31,520,000
IMAGICA GROUP	14,700	695.00	10,216,500
澤藤電機	800	1,309.00	1,047,200
デンソー	1,206,300	2,522.50	3,042,891,750
原田工業	2,900	752.00	2,180,800
コーセル	15,600	1,462.00	22,807,200
イリソ電子工業	13,400	3,045.00	40,803,000
オブテックスグループ	26,800	1,760.00	47,168,000
千代田インテグレ	5,700	2,737.00	15,600,900
レーザーテック	67,000	39,920.00	2,674,640,000
スタンレー電気	93,600	2,659.50	248,929,200
ウシオ電機	74,300	2,057.00	152,835,100
岡谷電機産業	5,000	286.00	1,430,000
ヘリオス テクノ ホールディング	6,500	532.00	3,458,000
エノモト	1,800	1,623.00	2,921,400
日本セラミック	11,900	2,645.00	31,475,500
遠藤照明	2,900	1,527.00	4,428,300
古河電池	10,700	939.00	10,047,300
双信電機	2,600	295.00	767,000
山一電機	13,100	2,196.00	28,767,600
図研	12,700	4,075.00	51,752,500
日本電子	36,600	6,649.00	243,353,400
カシオ計算機	105,600	1,260.50	133,108,800
ファナック	713,000	3,945.00	2,812,785,000
日本シイエムケイ	31,100	752.00	23,387,200
エンプラス	4,300	10,890.00	46,827,000
大真空	21,800	878.00	19,140,400
ローム	270,300	2,662.00	719,538,600
浜松ホトニクス	117,300	5,636.00	661,102,800
三井ハイテック	12,900	7,394.00	95,382,600
新光電気工業	51,700	5,450.00	281,765,000
京セラ	908,500	2,077.50	1,887,408,750
協栄産業	700	2,991.00	2,093,700
太陽誘電	71,200	3,431.00	244,287,200
村田製作所	1,330,300	2,989.50	3,976,931,850
双葉電子工業	27,800	506.00	14,066,800
日東電工	94,200	12,860.00	1,211,412,000
北陸電気工業	2,400	1,409.00	3,381,600
東海理化電機製作所	41,200	2,298.00	94,677,600
ニチコン	38,400	1,260.00	48,384,000

日本ケミコン	15,600	1,402.00	21,871,200
K O A	22,100	1,457.00	32,199,700
三井E & S	73,300	753.00	55,194,900
日立造船	130,300	1,007.00	131,212,100
三菱重工業	258,200	10,360.00	2,674,952,000
川崎重工業	119,400	3,507.00	418,735,800
I H I	109,900	2,754.50	302,719,550
名村造船所	36,400	1,350.00	49,140,000
サノヤホールディングス	9,600	145.00	1,392,000
スプリックス	1,900	794.00	1,508,600
マネジメントソリューションズ	6,400	2,816.00	18,022,400
プロレド・パートナーズ	3,500	355.00	1,242,500
and factory	2,000	311.00	622,000
テノ・ホールディングス	800	518.00	414,400
フロンティア・マネジメント	3,800	1,555.00	5,909,000
ピアラ	1,200	314.00	376,800
コプロ・ホールディングス	2,200	1,626.00	3,577,200
ギークス	900	503.00	452,700
アンビスホールディングス	16,100	2,755.00	44,355,500
カーブスホールディングス	41,100	751.00	30,866,100
フォーラムエンジニアリング	20,500	797.00	16,338,500
FAST FITNESS JAPAN	5,100	1,104.00	5,630,400
日本車輛製造	4,800	2,286.00	10,972,800
三菱ロジスネクスト	23,300	1,564.00	36,441,200
近畿車輛	900	2,007.00	1,806,300
一家ホールディングス	1,700	704.00	1,196,800
フルサト・マルカホールディングス	13,800	2,471.00	34,099,800
ヤマエグループホールディングス	8,700	3,105.00	27,013,500
ジャパクラフトホールディングス	4,900	168.00	823,200
F P G	48,700	1,776.00	86,491,200
島根銀行	1,900	518.00	984,200
じもとホールディングス	5,600	563.00	3,152,800
全国保証	37,700	5,481.00	206,633,700
めぶきフィナンシャルグループ	714,500	433.10	309,449,950
ジャパンインベストメントアドバイザー	23,400	945.00	22,113,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,400	4,180.00	76,912,000
九州フィナンシャルグループ	278,700	958.50	267,133,950
かんぽ生命保険	146,600	2,735.00	400,951,000
ゆうちょ銀行	1,582,400	1,503.50	2,379,138,400
あんしん保証	2,900	250.00	725,000
富山第一銀行	45,700	849.00	38,799,300
コンコルディア・フィナンシャルグループ	772,700	699.70	540,658,190
ジェイリース	4,300	2,331.00	10,023,300
西日本フィナンシャルホールディングス	81,300	1,708.00	138,860,400
イントラスト	2,500	785.00	1,962,500
日本モーゲージサービス	3,500	533.00	1,865,500

C A S A	2,500	831.00	2,077,500	
S B Iアルヒ	13,800	909.00	12,544,200	
プレミアグループ	24,300	1,686.00	40,969,800	
日産自動車	1,973,100	614.10	1,211,680,710	
いすゞ自動車	425,100	2,044.00	868,904,400	
トヨタ自動車	8,028,600	3,260.00	26,173,236,000	
日野自動車	219,900	466.00	102,473,400	
三菱自動車工業	570,400	455.70	259,931,280	
エフテック	4,500	687.00	3,091,500	
レシップホールディングス	2,800	671.00	1,878,800	
G M B	1,300	1,258.00	1,635,400	
ファルテック	1,300	559.00	726,700	
武蔵精密工業	35,700	1,719.00	61,368,300	
日産車体	14,800	981.00	14,518,800	
新明和工業	42,100	1,166.00	49,088,600	
極東開発工業	24,200	2,397.00	58,007,400	
トビー工業	11,900	2,930.00	34,867,000	
ティラド	3,200	3,775.00	12,080,000	
曙ブレーキ工業	89,100	114.00	10,157,400	
タチエス	27,000	1,980.00	53,460,000	
N O K	56,800	2,052.00	116,553,600	
フタバ産業	39,200	979.00	38,376,800	
カヤバ	14,100	5,040.00	71,064,000	
市光工業	26,400	602.00	15,892,800	
大同メタル工業	28,600	571.00	16,330,600	
プレス工業	58,400	673.00	39,303,200	
ミクニ	8,200	501.00	4,108,200	
太平洋工業	33,500	1,496.00	50,116,000	
河西工業	10,300	188.00	1,936,400	
アイシン	112,800	5,278.00	595,358,400	
マツダ	483,600	1,902.00	919,807,200	
今仙電機製作所	4,100	750.00	3,075,000	
本田技研工業	3,565,600	1,710.50	6,098,958,800	
スズキ	268,500	7,235.00	1,942,597,500	
S U B A R U	453,400	3,095.00	1,403,273,000	
安永	2,800	682.00	1,909,600	
ヤマハ発動機	631,900	1,419.50	896,982,050	
小糸製作所	151,500	2,018.00	305,727,000	
T B K	7,000	423.00	2,961,000	
エクセディ	23,900	2,875.00	68,712,500	
ミツバ	27,400	1,128.00	30,907,200	
豊田合成	41,900	2,953.00	123,730,700	
愛三工業	24,200	1,458.00	35,283,600	
盟和産業	900	1,035.00	931,500	
日本プラスト	5,500	605.00	3,327,500	
ヨロズ	13,700	998.00	13,672,600	
エフ・シー・シー	25,900	2,090.00	54,131,000	
新家工業	1,500	3,205.00	4,807,500	
シマノ	59,100	21,075.00	1,245,532,500	
テイ・エス テック	52,000	1,934.00	100,568,000	

三十三フィナンシャルグループ	12,900	1,907.00	24,600,300	
第四北越フィナンシャルグループ	22,600	4,045.00	91,417,000	
ひろぎんホールディングス	205,000	983.00	201,515,000	
マーキュリアホールディングス	3,300	715.00	2,359,500	
おきなわフィナンシャルグループ	12,300	2,482.00	30,528,600	
ダイレクトマーケティングミックス	15,500	442.00	6,851,000	
ポピンズ	2,200	1,364.00	3,000,800	
LITALICO	11,700	2,167.00	25,353,900	
コンフィデンス・インターワークス	600	1,605.00	963,000	
十六フィナンシャルグループ	18,700	4,175.00	78,072,500	
北國フィナンシャルホールディングス	15,200	4,250.00	64,600,000	
ネットプロテクションズホールディングス	47,700	156.00	7,441,200	
プロクレアホールディングス	16,500	1,841.00	30,376,500	
FPパートナー	2,900	6,500.00	18,850,000	
あいちフィナンシャルグループ	22,200	2,597.00	57,653,400	
ジャムコ	7,100	1,520.00	10,792,000	
小野建	15,400	1,850.00	28,490,000	
はるやまホールディングス	3,300	596.00	1,966,800	
南陽	1,400	2,216.00	3,102,400	
ノジマ	44,900	1,608.00	72,199,200	
佐島電機	8,600	2,324.00	19,986,400	
カップ・クリエイト	24,300	1,725.00	41,917,500	
エコトレーディング	1,300	1,233.00	1,602,900	
伯東	8,900	5,820.00	51,798,000	
コンドーテック	11,900	1,210.00	14,399,000	
中山福	3,900	361.00	1,407,900	
ライトオン	5,200	417.00	2,168,400	
ナガイレーベン	19,600	2,344.00	45,942,400	
三菱食品	14,300	5,080.00	72,644,000	
良品計画	168,900	2,113.00	356,885,700	
パリミキホールディングス	8,600	491.00	4,222,600	
松田産業	11,800	2,646.00	31,222,800	
第一興商	59,900	2,008.00	120,279,200	
メディカルホールディングス	157,300	2,372.50	373,194,250	
アドヴァングループ	14,700	1,062.00	15,611,400	
SPK	6,900	2,012.00	13,882,800	
萩原電気ホールディングス	6,600	5,150.00	33,990,000	
アルピス	5,000	2,669.00	13,345,000	
アズワン	24,200	5,497.00	133,027,400	
スズデン	5,400	2,245.00	12,123,000	
尾家産業	1,600	1,841.00	2,945,600	
シモジマ	10,400	1,296.00	13,478,400	
ドウシシャ	14,300	2,123.00	30,358,900	
小津産業	1,500	1,653.00	2,479,500	
コナカ	7,400	425.00	3,145,000	
高速	9,200	2,356.00	21,675,200	
ハウスオブローゼ	900	1,619.00	1,457,100	
G-7ホールディングス	16,900	1,389.00	23,474,100	
たけびし	5,900	2,010.00	11,859,000	

イオン北海道	45,700	931.00	42,546,700
コジマ	25,600	734.00	18,790,400
ヒマラヤ	2,200	935.00	2,057,000
コーナン商事	19,000	3,960.00	75,240,000
ネットワンシステムズ	59,200	2,704.50	160,106,400
エコス	5,700	2,515.00	14,335,500
ワタミ	16,400	1,013.00	16,613,200
マルシェ	2,500	243.00	607,500
リックス	2,600	3,570.00	9,282,000
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	3,305.00	1,032,482,000
丸文	13,800	1,544.00	21,307,200
西松屋チェーン	30,400	2,134.00	64,873,600
ゼンショーホールディングス	78,800	7,361.00	580,046,800
ハビネット	13,200	2,841.00	37,501,200
幸楽苑ホールディングス	11,400	1,314.00	14,979,600
ハークスレイ	2,400	908.00	2,179,200
橋本総業ホールディングス	6,100	1,298.00	7,917,800
日本ライフライン	45,400	1,311.00	59,519,400
サイゼリヤ	22,900	4,885.00	111,866,500
タカショー	13,500	497.00	6,709,500
V Tホールディングス	58,800	532.00	31,281,600
アルゴグラフィックス	13,500	4,150.00	56,025,000
魚力	5,400	2,416.00	13,046,400
I D O M	40,900	903.00	36,932,700
日本エム・ディ・エム	11,600	728.00	8,444,800
ポブラ	1,800	244.00	439,200
フジ・コーポレーション	7,400	1,769.00	13,090,600
ユナイテッドアローズ	18,200	1,960.00	35,672,000
進和	9,500	2,435.00	23,132,500
エスケイジャパン	1,700	710.00	1,207,000
ダイترون	6,100	3,080.00	18,788,000
ハイデイ日高	22,900	2,860.00	65,494,000
シークス	22,000	1,561.00	34,342,000
Y U - W A C R E A T I O N H O L D I N G S	3,700	145.00	536,500
コロワイド	66,500	2,316.50	154,047,250
田中商事	1,900	829.00	1,575,100
オーハシテクニカ	8,100	1,865.00	15,106,500
壱番屋	12,200	6,290.00	76,738,000
白銅	4,500	2,465.00	11,092,500
トップカルチャー	2,200	157.00	345,400
P L A N T	1,500	1,615.00	2,422,500
スギホールディングス	31,200	6,981.00	217,807,200
ダイコー通産	700	1,208.00	845,600
薬王堂ホールディングス	7,600	2,564.00	19,486,400
島津製作所	194,300	3,862.00	750,386,600
J M S	13,400	522.00	6,994,800
クボテック	1,800	255.00	459,000

長野計器	10,600	2,297.00	24,348,200
バイ・テクノロジー	7,700	2,690.00	20,713,000
スター精密	27,500	1,732.00	47,630,000
東京計器	11,200	1,857.00	20,798,400
愛知時計電機	6,300	2,588.00	16,304,400
インターアクション	8,800	1,125.00	9,900,000
オーバル	5,700	544.00	3,100,800
東京精密	29,900	9,486.00	283,631,400
マニー	58,500	2,055.00	120,217,500
ニコン	211,400	1,509.50	319,108,300
トプコン	71,100	1,716.50	122,043,150
オリンパス	900,000	2,145.00	1,930,500,000
理研計器	10,400	7,930.00	82,472,000
S C R E E Nホールディングス	50,000	16,345.00	817,250,000
キヤノン電子	16,200	2,081.00	33,712,200
タムロン	9,000	5,730.00	51,570,000
H O Y A	287,800	18,400.00	5,295,520,000
シード	3,300	802.00	2,646,600
ノーリツ鋼機	13,900	3,280.00	45,592,000
A & Dホロンホールディングス	21,300	2,120.00	45,156,000
朝日インテック	178,200	2,891.00	515,176,200
キヤノン	729,300	4,087.00	2,980,649,100
リコー	366,600	1,269.50	465,398,700
シチズン時計	134,500	973.00	130,868,500
リズム	1,500	3,570.00	5,355,000
大研医器	5,600	541.00	3,029,600
メニコン	50,300	2,127.50	107,013,250
シンシア	800	586.00	468,800
K Y O R I T S U	9,700	202.00	1,959,400
中本パックス	2,100	1,736.00	3,645,600
スノーピーク	20,800	851.00	17,700,800
パラマウントベッドホールディングス	30,400	2,665.00	81,016,000
トランザクション	9,600	2,464.00	23,654,400
粧美堂	1,800	777.00	1,398,600
ニホンフラッシュ	13,700	957.00	13,110,900
前田工織	12,400	3,125.00	38,750,000
永大産業	7,500	236.00	1,770,000
アートネイチャー	13,200	797.00	10,520,400
フルヤ金属	3,500	9,340.00	32,690,000
バンダイナムコホールディングス	400,600	3,026.00	1,212,215,600
アイフィスジャパン	1,900	603.00	1,145,700
S H O E I	33,100	1,952.00	64,611,200
フランスベッドホールディングス	19,000	1,392.00	26,448,000
マーベラス	23,800	741.00	17,635,800
パイロットコーポレーション	20,600	4,006.00	82,523,600
萩原工業	9,800	1,489.00	14,592,200
エイベックス	25,000	1,409.00	35,225,000
フジシールインターナショナル	29,600	1,740.00	51,504,000
タカラトミー	66,600	2,379.50	158,474,700
広済堂ホールディングス	37,600	739.00	27,786,400

エステールホールディングス	1,700	655.00	1,113,500	
レック	18,800	1,044.00	19,627,200	
タカノ	2,400	1,005.00	2,412,000	
三光合成	18,500	668.00	12,358,000	
プロネクサス	15,200	1,271.00	19,319,200	
ホクシン	4,800	115.00	552,000	
ウッドワン	2,400	1,027.00	2,464,800	
きもと	10,700	211.00	2,257,700	
TOPPANホールディングス	179,700	3,940.00	708,018,000	
大日本印刷	159,800	4,185.00	668,763,000	
共同印刷	4,100	3,400.00	13,940,000	
NISSHA	25,000	1,580.00	39,500,000	
光村印刷	500	1,558.00	779,000	
藤森工業	11,600	4,005.00	46,458,000	
ヴィア・ホールディングス	10,200	153.00	1,560,600	
TAKARA & COMPANY	8,600	2,832.00	24,355,200	
前澤化成工業	9,400	1,605.00	15,087,000	
未来工業	5,300	4,895.00	25,943,500	
アシックス	124,600	4,700.00	585,620,000	
ツツミ	2,400	2,175.00	5,220,000	
ウェーブロックホールディングス	2,400	681.00	1,634,400	
JSP	10,300	2,136.00	22,000,800	
ニチハ	18,400	3,305.00	60,812,000	
ローランド	10,800	4,830.00	52,164,000	
エフピコ	27,700	2,948.00	81,659,600	
小松ウオール工業	6,000	3,235.00	19,410,000	
ヤマハ	92,200	3,437.00	316,891,400	
河合楽器製作所	4,400	3,505.00	15,422,000	
クリナップ	14,300	776.00	11,096,800	
ピジョン	93,100	1,606.50	149,565,150	
天馬	10,700	2,308.00	24,695,600	
キングジム	13,000	871.00	11,323,000	
象印マホービン	39,700	1,421.00	56,413,700	
リンテック	29,400	2,793.00	82,114,200	
信越ポリマー	31,600	1,610.00	50,876,000	
東リ	14,400	399.00	5,745,600	
イトーキ	30,000	1,564.00	46,920,000	
任天堂	923,100	8,369.00	7,725,423,900	
三菱鉛筆	20,800	1,971.00	40,996,800	
松風	6,600	2,685.00	17,721,000	
タカラスタンダード	30,800	1,881.00	57,934,800	
コクヨ	59,900	2,363.50	141,573,650	
ナカバヤシ	15,700	540.00	8,478,000	
ニフコ	43,900	3,792.00	166,468,800	
立川ブラインド工業	6,800	1,482.00	10,077,600	
グローブライド	13,100	2,080.00	27,248,000	
オカムラ	44,100	2,177.00	96,005,700	
パルカー	12,300	4,240.00	52,152,000	
MUTOHホールディングス	900	2,083.00	1,874,700	
伊藤忠商事	1,039,900	6,736.00	7,004,766,400	

丸紅	1,289,800	2,386.00	3,077,462,800	
スクロール	23,000	968.00	22,264,000	
高島	4,700	1,354.00	6,363,800	
ヨンドシーホールディングス	14,600	1,971.00	28,776,600	
三陽商会	5,500	2,833.00	15,581,500	
長瀬産業	70,900	2,406.50	170,620,850	
ナイガイ	2,100	261.00	548,100	
蝶理	9,700	2,951.00	28,624,700	
豊田通商	135,500	9,300.00	1,260,150,000	
オンワードホールディングス	86,300	542.00	46,774,600	
三共生興	21,500	779.00	16,748,500	
兼松	64,700	2,326.00	150,492,200	
美津濃	14,500	4,410.00	63,945,000	
ツカモトコーポレーション	1,000	1,224.00	1,224,000	
ルックホールディングス	4,100	2,688.00	11,020,800	
三井物産	1,165,600	5,840.00	6,807,104,000	
日本紙パルプ商事	7,400	5,070.00	37,518,000	
東京エレクトロン	309,500	28,480.00	8,814,560,000	
カメイ	16,400	1,921.00	31,504,400	
東都水産	400	6,400.00	2,560,000	
OUGホールディングス	1,000	2,435.00	2,435,000	
スターゼン	10,700	2,725.00	29,157,500	
セイコーグループ	20,400	2,688.00	54,835,200	
山善	46,900	1,257.00	58,953,300	
椿本興業	3,100	6,820.00	21,142,000	
住友商事	936,300	3,357.00	3,143,159,100	
BIPROGY	48,000	4,495.00	215,760,000	
内田洋行	6,300	7,830.00	49,329,000	
三菱商事	3,065,300	2,782.00	8,527,664,600	
第一実業	14,600	1,870.00	27,302,000	
キャノンマーケティングジャパン	35,800	4,334.00	155,157,200	
西華産業	6,100	3,210.00	19,581,000	
佐藤商事	10,900	1,699.00	18,519,100	
菱洋エレクトロ	14,700	3,865.00	56,815,500	
東京産業	14,100	749.00	10,560,900	
ユアサ商事	12,100	4,965.00	60,076,500	
神鋼商事	3,900	6,750.00	26,325,000	
トルク	3,700	294.00	1,087,800	
阪和興業	27,800	5,390.00	149,842,000	
正栄食品工業	10,300	4,575.00	47,122,500	
カナデン	11,600	1,500.00	17,400,000	
RYODEN	12,500	2,632.00	32,900,000	
ニプロ	121,900	1,201.50	146,462,850	
岩谷産業	35,200	6,992.00	246,118,400	
ナイス	2,100	1,587.00	3,332,700	
ニチモウ	2,200	2,251.00	4,952,200	
極東貿易	9,200	2,224.00	20,460,800	
アステナホールディングス	29,000	472.00	13,688,000	
三愛オブリ	37,200	1,730.00	64,356,000	
稲畑産業	30,600	3,160.00	96,696,000	



GS Iクレオス	8,300	2,387.00	19,812,100
明和産業	18,300	718.00	13,139,400
クワザワホールディングス	2,500	702.00	1,755,000
キムラタン	42,800	18.00	770,400
ゴールドウイン	25,900	9,427.00	244,159,300
ユニ・チャーム	305,500	5,255.00	1,605,402,500
デサント	25,200	3,300.00	83,160,000
キング	2,500	696.00	1,740,000
ワキタ	25,600	1,596.00	40,857,600
ヤマトインターナショナル	5,100	303.00	1,545,300
東邦ホールディングス	42,800	3,187.00	136,403,600
サンゲツ	35,600	3,260.00	116,056,000
ミツウロコグループホールディングス	19,800	1,634.00	32,353,200
シナネンホールディングス	4,300	4,100.00	17,630,000
伊藤忠エネクス	38,400	1,558.00	59,827,200
サンリオ	43,800	6,269.00	274,582,200
サンワテクノス	7,900	2,256.00	17,822,400
リョーサン	10,900	4,995.00	54,445,500
新光商事	20,800	1,215.00	25,272,000
トーホー	6,000	2,944.00	17,664,000
三信電気	6,200	2,317.00	14,365,400
東陽テクニカ	15,700	1,451.00	22,780,700
モスフードサービス	22,800	3,440.00	78,432,000
加賀電子	14,100	6,790.00	95,739,000
三益半導体工業	13,600	3,205.00	43,588,000
都築電気	7,700	2,421.00	18,641,700
ソーダニッカ	13,100	1,177.00	15,418,700
立花エレテック	10,300	3,120.00	32,136,000
木曽路	23,400	2,614.00	61,167,600
SRSホールディングス	25,500	1,171.00	29,860,500
千趣会	28,400	276.00	7,838,400
リテールパートナーズ	23,000	1,737.00	39,951,000
上新電機	15,300	2,376.00	36,352,800
日本瓦斯	82,000	2,386.50	195,693,000
ロイヤルホールディングス	27,300	2,548.00	69,560,400
東天紅	500	843.00	421,500
いなげや	15,000	1,274.00	19,110,000
チヨダ	14,800	895.00	13,246,000
ライフコーポレーション	16,200	3,765.00	60,993,000
リンガーハット	20,000	2,403.00	48,060,000
MrMaxHD	19,500	630.00	12,285,000
テンアライド	9,100	317.00	2,884,700
AOKIホールディングス	33,200	1,188.00	39,441,600
オークワ	22,200	902.00	20,024,400
コメリ	23,800	3,260.00	77,588,000
青山商事	33,100	1,821.00	60,275,100
しまむら	18,200	16,125.00	293,475,000
はせがわ	3,300	361.00	1,191,300
高島屋	106,900	2,202.00	235,393,800
松屋	26,200	968.00	25,361,600

エイチ・ツー・オー リテイリング	68,500	1,818.00	124,533,000
近鉄百貨店	6,600	2,570.00	16,962,000
丸井グループ	102,700	2,436.00	250,177,200
クレディセゾン	91,300	2,721.00	248,427,300
アクシアル リテイリング	10,600	3,925.00	41,605,000
井筒屋	3,200	356.00	1,139,200
イオン	524,400	3,583.00	1,878,925,200
イズミ	27,400	3,487.00	95,543,800
フォーバル	6,100	1,382.00	8,430,200
平和堂	25,900	2,214.00	57,342,600
フジ	23,700	1,955.00	46,333,500
ヤオコー	17,500	8,553.00	149,677,500
ゼビオホールディングス	21,000	1,004.00	21,084,000
ケーズホールディングス	103,900	1,302.00	135,277,800
PALTAC	20,900	4,386.00	91,667,400
三谷産業	27,000	387.00	10,449,000
Olympicグループ	3,000	548.00	1,644,000
日産東京販売ホールディングス	10,300	494.00	5,088,200
あおぞら銀行	103,500	2,183.50	225,992,250
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,769,700	1,404.00	12,312,658,800
りそなホールディングス	1,679,200	813.60	1,366,197,120
三井住友トラスト・ホールディングス	517,500	2,901.50	1,501,526,250
三井住友フィナンシャルグループ	1,023,900	7,687.00	7,870,719,300
千葉銀行	401,300	1,092.00	438,219,600
群馬銀行	279,500	764.60	213,705,700
武蔵野銀行	20,100	2,715.00	54,571,500
千葉興業銀行	27,200	851.00	23,147,200
筑波銀行	63,100	242.00	15,270,200
七十七銀行	41,900	3,675.00	153,982,500
秋田銀行	9,600	2,046.00	19,641,600
山形銀行	16,000	1,123.00	17,968,000
岩手銀行	9,100	2,495.00	22,704,500
東邦銀行	113,700	310.00	35,247,000
東北銀行	3,100	1,234.00	3,825,400
ふくおかフィナンシャルグループ	125,400	3,698.00	463,729,200
スルガ銀行	126,900	806.00	102,281,400
八十二銀行	309,000	793.80	245,284,200
山梨中央銀行	16,100	1,715.00	27,611,500
大垣共立銀行	27,400	1,956.00	53,594,400
福井銀行	12,900	1,733.00	22,355,700
清水銀行	5,700	1,567.00	8,931,900
富山銀行	1,100	1,726.00	1,898,600
滋賀銀行	24,000	3,835.00	92,040,000
南都銀行	21,700	2,626.00	56,984,200
百五銀行	135,500	561.00	76,015,500
紀陽銀行	51,500	1,732.00	89,198,000
ほくほくフィナンシャルグループ	89,100	1,588.50	141,535,350
山陰合同銀行	90,200	1,017.00	91,733,400
鳥取銀行	2,200	1,403.00	3,086,600
百十四銀行	14,200	2,725.00	38,695,000

四国銀行	21,200	1,059.00	22,450,800
阿波銀行	20,200	2,391.00	48,298,200
大分銀行	8,700	2,658.00	23,124,600
宮崎銀行	8,700	2,742.00	23,855,400
佐賀銀行	8,500	1,936.00	16,456,000
琉球銀行	30,700	1,141.00	35,028,700
セブン銀行	451,400	303.10	136,819,340
みずほフィナンシャルグループ	1,943,700	2,720.00	5,286,864,000
高知銀行	2,200	936.00	2,059,200
山口フィナンシャルグループ	141,200	1,435.50	202,692,600
芙蓉総合リース	13,300	13,525.00	179,882,500
みずほリース	24,100	5,480.00	132,068,000
東京センチュリー	107,600	1,631.00	175,495,600
SBIホールディングス	211,000	3,775.00	796,525,000
日本証券金融	52,900	1,562.00	82,629,800
アイフル	212,000	384.00	81,408,000
日本アジア投資	4,700	280.00	1,316,000
名古屋銀行	9,300	5,650.00	52,545,000
北洋銀行	218,200	377.00	82,261,400
大光銀行	2,100	1,396.00	2,931,600
愛媛銀行	19,400	1,039.00	20,156,600
トマト銀行	2,300	1,210.00	2,783,000
京葉銀行	60,400	709.00	42,823,600
栃木銀行	71,900	306.00	22,001,400
北日本銀行	4,700	2,231.00	10,485,700
東和銀行	26,400	657.00	17,344,800
福島銀行	6,600	232.00	1,531,200
大東銀行	2,700	746.00	2,014,200
リコーリース	13,700	5,050.00	69,185,000
イオンフィナンシャルサービス	82,700	1,338.50	110,693,950
アコム	257,100	362.80	93,275,880
ジャックス	15,300	5,520.00	84,456,000
オリエントコーポレーション	47,000	1,065.00	50,055,000
オリックス	877,700	2,877.00	2,525,142,900
三菱HCキャピタル	641,600	1,045.50	670,792,800
ジャフコグループ	42,900	1,732.00	74,302,800
九州リースサービス	2,600	1,197.00	3,112,200
トモニホールディングス	136,300	391.00	53,293,300
大和証券グループ本社	1,115,500	1,007.50	1,123,866,250
野村ホールディングス	2,421,500	807.70	1,955,845,550
岡三証券グループ	126,500	705.00	89,182,500
丸三証券	47,900	922.00	44,163,800
東洋証券	38,200	331.00	12,644,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	171,000	570.00	97,470,000
光世証券	1,400	587.00	821,800
水戸証券	42,500	451.00	19,167,500
いちよし証券	27,000	748.00	20,196,000
松井証券	70,900	850.00	60,265,000
SOMPOホールディングス	216,600	7,695.00	1,666,737,000

日本取引所グループ	375,700	3,325.00	1,249,202,500	
マネックスグループ	141,000	730.00	102,930,000	
極東証券	19,700	998.00	19,660,600	
岩井コスモホールディングス	16,400	2,113.00	34,653,200	
アイザワ証券グループ	20,800	1,210.00	25,168,000	
フィデアホールディングス	14,900	1,582.00	23,571,800	
池田泉州ホールディングス	199,700	345.00	68,896,500	
アニコムホールディングス	48,900	583.00	28,508,700	
MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス	322,400	5,991.00	1,931,498,400	
マネーパートナーズグループ	6,700	298.00	1,996,600	
スパークス・グループ	16,100	1,772.00	28,529,200	
小林洋行	2,900	255.00	739,500	
第一生命ホールディングス	703,600	3,065.00	2,156,534,000	
東京海上ホールディングス	1,423,400	3,878.00	5,519,945,200	
アドバンテッジリスクマネジメント	3,400	455.00	1,547,000	
イー・ギャランティ	23,400	1,849.00	43,266,600	
アサックス	3,000	719.00	2,157,000	
NECキャピタルソリューション	7,100	3,605.00	25,595,500	
T&Dホールディングス	386,700	2,334.50	902,751,150	
アドバンスクリエイト	8,300	1,029.00	8,540,700	
三井不動産	665,900	3,997.00	2,661,602,300	
三菱地所	941,300	2,098.00	1,974,847,400	
平和不動産	23,400	3,770.00	88,218,000	
東京建物	125,800	2,222.50	279,590,500	
京阪神ビルディング	26,900	1,413.00	38,009,700	
住友不動産	208,200	4,771.00	993,322,200	
太平洋興発	2,500	834.00	2,085,000	
テーオーシー	25,700	669.00	17,193,300	
レオパレス21	144,100	393.00	56,631,300	
スターツコーポレーション	20,700	3,010.00	62,307,000	
フジ住宅	18,100	712.00	12,887,200	
空港施設	20,300	617.00	12,525,100	
明和地所	8,200	1,316.00	10,791,200	
ゴールドクレスト	11,700	2,302.00	26,933,400	
リログループ	75,300	1,575.50	118,635,150	
エスリード	6,800	3,400.00	23,120,000	
日神グループホールディングス	23,100	503.00	11,619,300	
日本エスコン	26,900	988.00	26,577,200	
MIRARTHホールディングス	66,100	502.00	33,182,200	
AVANTIA	3,500	904.00	3,164,000	
イオンモール	74,600	1,853.50	138,271,100	
毎日コムネット	2,400	743.00	1,783,200	
ファースト住建	2,500	1,108.00	2,770,000	
ランド	798,500	7.00	5,589,500	
カチタス	38,700	1,784.00	69,040,800	
東祥	10,500	777.00	8,158,500	
トーセイ	24,000	2,035.00	48,840,000	
穴吹興産	1,500	2,132.00	3,198,000	
サンフロンティア不動産	21,300	1,718.00	36,593,400	

FJネクストホールディングス	15,200	1,286.00	19,547,200
インテリックス	1,500	565.00	847,500
ランドビジネス	2,400	276.00	662,400
サンネクスタグループ	2,100	956.00	2,007,600
グランディハウス	10,800	658.00	7,106,400
東武鉄道	160,600	3,915.00	628,749,000
相鉄ホールディングス	52,300	2,832.50	148,139,750
東急	410,000	1,719.50	704,995,000
京浜急行電鉄	180,900	1,295.00	234,265,500
小田急電鉄	241,800	2,205.50	533,289,900
京王電鉄	70,300	4,188.00	294,416,400
京成電鉄	94,300	6,900.00	650,670,000
富士急行	18,000	4,365.00	78,570,000
東日本旅客鉄道	268,600	9,000.00	2,417,400,000
西日本旅客鉄道	173,400	6,415.00	1,112,361,000
東海旅客鉄道	563,200	3,772.00	2,124,390,400
西武ホールディングス	176,900	2,120.00	375,028,000
鴻池運輸	24,900	1,907.00	47,484,300
西日本鉄道	39,100	2,462.00	96,264,200
ハマキョウレックス	12,500	4,015.00	50,187,500
サカイ引越センター	16,200	2,643.00	42,816,600
近鉄グループホールディングス	146,000	4,501.00	657,146,000
阪急阪神ホールディングス	194,700	4,560.00	887,832,000
南海電気鉄道	65,100	2,978.00	193,867,800
京阪ホールディングス	80,500	3,589.00	288,914,500
神戸電鉄	4,000	2,877.00	11,508,000
名古屋鉄道	150,600	2,262.00	340,657,200
山陽電気鉄道	11,000	2,187.00	24,057,000
アルプス物流	11,700	1,889.00	22,101,300
トランコム	4,200	6,960.00	29,232,000
ヤマトホールディングス	186,900	2,416.00	451,550,400
山九	37,100	5,386.00	199,820,600
日新	11,100	2,694.00	29,903,400
丸運	3,700	280.00	1,036,000
丸全昭和運輸	9,000	4,150.00	37,350,000
センコーグループホールディングス	77,300	1,128.00	87,194,400
トナミホールディングス	3,200	4,645.00	14,864,000
ニッコンホールディングス	46,700	3,189.00	148,926,300
日本石油輸送	700	2,871.00	2,009,700
福山通運	16,700	4,270.00	71,309,000
セイノーホールディングス	82,100	2,159.50	177,294,950
エスライングループ本社	1,800	869.00	1,564,200
神奈川中央交通	4,000	3,110.00	12,440,000
AZ-COM丸和ホールディングス	37,300	1,522.00	56,770,600
C&Fロジホールディングス	14,100	1,755.00	24,745,500
日本郵船	418,400	4,895.00	2,048,068,000
商船三井	316,800	5,285.00	1,674,288,000
川崎汽船	117,200	7,025.00	823,330,000
NSユナイテッド海運	7,900	5,090.00	40,211,000
明海グループ	7,100	779.00	5,530,900

飯野海運	53,600	1,349.00	72,306,400
共栄タンカー	1,200	1,021.00	1,225,200
九州旅客鉄道	103,200	3,373.00	348,093,600
SGホールディングス	245,100	1,880.50	460,910,550
NIPPON EXPRESSホールディングス	49,500	8,668.00	429,066,000
ID&Eホールディングス	9,100	3,680.00	33,488,000
日本航空	358,500	2,792.50	1,001,111,250
ANAホールディングス	397,200	3,242.00	1,287,722,400
ピーウィズ	3,100	1,811.00	5,614,100
パスコ	1,300	1,879.00	2,442,700
TREホールディングス	28,800	1,261.00	36,316,800
人・夢・技術グループ	5,700	1,896.00	10,807,200
西本Wismettacホールディングス	3,900	6,390.00	24,921,000
シルバーライフ	3,000	837.00	2,511,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	600	2,243.00	1,345,800
Genky DrugStores	6,800	6,430.00	43,724,000
コア商事ホールディングス	10,900	745.00	8,120,500
KPPグループホールディングス	40,000	718.00	28,720,000
ナルミヤ・インターナショナル	1,100	1,212.00	1,333,200
ブックオフグループホールディングス	9,000	1,245.00	11,205,000
ギフトホールディングス	6,500	2,810.00	18,265,000
三菱倉庫	35,900	4,415.00	158,498,500
三井倉庫ホールディングス	13,600	4,770.00	64,872,000
住友倉庫	39,400	2,517.00	99,169,800
澁澤倉庫	6,700	3,125.00	20,937,500
ヤマタネ	6,800	2,455.00	16,694,000
東陽倉庫	1,700	1,570.00	2,669,000
乾汽船	17,100	1,074.00	18,365,400
日本トランスシティ	29,400	633.00	18,610,200
ケイヒン	1,100	1,932.00	2,125,200
中央倉庫	7,800	1,162.00	9,063,600
川西倉庫	1,300	1,126.00	1,463,800
安田倉庫	10,000	1,211.00	12,110,000
ファイズホールディングス	900	1,324.00	1,191,600
NISSOホールディングス	13,000	819.00	10,647,000
大栄環境	27,300	2,493.00	68,058,900
日本管財ホールディングス	15,800	2,558.00	40,416,400
東洋埠頭	1,900	1,392.00	2,644,800
上組	67,400	3,392.00	228,620,800
サンリツ	1,600	787.00	1,259,200
キムラユニティー	3,100	1,623.00	5,031,300
キューソー流通システム	6,600	915.00	6,039,000
東海運	3,800	293.00	1,113,400
エーアイティー	9,200	1,854.00	17,056,800
内外トランスライン	5,800	2,417.00	14,018,600
ショーエイコーポレーション	2,100	614.00	1,289,400
日本コンセプト	5,300	1,756.00	9,306,800
TBSホールディングス	73,700	4,040.00	297,748,000

日本テレビホールディングス	129,800	2,241.50	290,946,700
朝日放送グループホールディングス	13,700	702.00	9,617,400
テレビ朝日ホールディングス	35,600	2,205.00	78,498,000
スカパーJ S A Tホールディングス	113,900	833.00	94,878,700
テレビ東京ホールディングス	10,600	3,315.00	35,139,000
日本BS放送	2,400	911.00	2,186,400
ビジョン	22,100	1,134.00	25,061,400
スマートバリュー	1,900	395.00	750,500
USEN-NEXT HOLDINGS	16,400	4,185.00	68,634,000
ワイヤレスゲート	2,800	286.00	800,800
日本通信	144,300	237.00	34,199,100
クロップス	900	1,020.00	918,000
日本電信電話	43,620,300	183.40	7,999,963,020
KDDI	1,133,200	4,599.00	5,211,586,800
ソフトバンク	2,360,000	1,944.50	4,589,020,000
光通信	14,800	26,025.00	385,170,000
エムティーアイ	10,100	614.00	6,201,400
GMOインターネットグループ	54,200	2,615.00	141,733,000
ファイバーゲート	7,900	936.00	7,394,400
アйдママーケティングコミュニケーション	1,800	235.00	423,000
KADOKAWA	77,500	3,238.00	250,945,000
学研ホールディングス	24,400	1,010.00	24,644,000
ゼンリン	25,100	854.00	21,435,400
昭文社ホールディングス	2,900	372.00	1,078,800
インプレスホールディングス	6,600	177.00	1,168,200
東京電力ホールディングス	1,318,000	762.90	1,005,502,200
中部電力	538,800	1,962.50	1,057,395,000
関西電力	564,600	1,913.50	1,080,362,100
中国電力	254,000	988.40	251,053,600
北陸電力	149,500	710.90	106,279,550
東北電力	384,900	1,004.50	386,632,050
四国電力	136,200	1,034.00	140,830,800
九州電力	337,000	1,155.50	389,403,500
北海道電力	141,200	636.50	89,873,800
沖縄電力	37,300	1,093.00	40,768,900
電源開発	120,100	2,569.50	308,596,950
エフオン	10,600	444.00	4,706,400
イーレックス	26,000	769.00	19,994,000
レノバ	39,000	1,223.00	47,697,000
東京瓦斯	309,100	3,305.00	1,021,575,500
大阪瓦斯	296,200	3,101.00	918,516,200
東邦瓦斯	63,300	2,987.50	189,108,750
北海道瓦斯	8,700	2,298.00	19,992,600
広島ガス	30,900	394.00	12,174,600
西部ガスホールディングス	15,300	1,897.00	29,024,100
静岡ガス	29,200	1,020.00	29,784,000
メタウォーター	17,500	2,130.00	37,275,000
M&A総研ホールディングス	7,200	5,950.00	42,840,000

アイネット	8,900	1,925.00	17,132,500
松竹	7,600	10,205.00	77,558,000
東宝	81,600	4,734.00	386,294,400
エイチ・アイ・エス	43,700	1,774.00	77,523,800
東映	4,800	20,130.00	96,624,000
ラックランド	6,800	2,612.00	17,761,600
NTTデータグループ	383,400	2,088.50	800,730,900
共立メンテナンス	23,600	6,174.00	145,706,400
イチネンホールディングス	16,000	1,596.00	25,536,000
建設技術研究所	7,700	6,090.00	46,893,000
スペース	9,800	945.00	9,261,000
アインホールディングス	21,300	4,733.00	100,812,900
燦ホールディングス	14,100	1,119.00	15,777,900
ピー・シー・エー	8,400	1,578.00	13,255,200
スバル興業	3,000	3,140.00	9,420,000
東京テアトル	2,400	1,136.00	2,726,400
タナベコンサルティンググループ	5,200	1,079.00	5,610,800
ビジネスブレイン太田昭和	5,700	2,240.00	12,768,000
ナガワ	4,700	7,190.00	33,793,000
東京都競馬	12,600	4,580.00	57,708,000
常磐興産	2,500	1,237.00	3,092,500
カナモト	23,300	2,880.00	67,104,000
D T S	30,900	3,645.00	112,630,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	67,000	6,218.00	416,606,000
シーイーシー	18,500	1,659.00	30,691,500
カブコン	131,100	5,634.00	738,617,400
ニシオホールディングス	14,000	3,935.00	55,090,000
アイ・エス・ビー	7,500	1,572.00	11,790,000
アゴラ ホスピタリティグループ	43,400	23.00	998,200
日本空港ビルデング	50,900	5,883.00	299,444,700
トランス・コスモス	18,700	2,950.00	55,165,000
乃村工藝社	65,600	868.00	56,940,800
ジャステック	9,000	1,326.00	11,934,000
S C S K	102,600	2,651.50	272,043,900
藤田観光	6,000	6,700.00	40,200,000
K N T - C Tホールディングス	9,000	1,307.00	11,763,000
トーカイ	13,300	2,121.00	28,209,300
白洋舎	1,000	2,736.00	2,736,000
セコム	153,100	10,710.00	1,639,701,000
N S W	6,300	2,966.00	18,685,800
セントラル警備保障	8,100	2,573.00	20,841,300
アイネス	11,400	1,484.00	16,917,600
丹青社	29,100	807.00	23,483,700
メイテックグループホールディングス	54,100	3,044.00	164,680,400
T K C	23,300	3,790.00	88,307,000
富士ソフト	29,500	6,400.00	188,800,000
応用地質	14,000	2,156.00	30,184,000
船井総研ホールディングス	31,300	2,472.00	77,373,600



NSD	52,300	2,684.00	140,373,200
進学会ホールディングス	1,700	255.00	433,500
丸紅建材リース	500	2,859.00	1,429,500
オオバ	4,500	1,009.00	4,540,500
コナミグループ	54,900	9,237.00	507,111,300
いであ	1,800	2,130.00	3,834,000
学究社	6,000	2,081.00	12,486,000
ベネッセホールディングス	50,500	2,599.00	131,249,500
イオンディライト	16,100	3,755.00	60,455,500
ナック	12,800	542.00	6,937,600
福井コンピュータホールディングス	9,100	2,554.00	23,241,400
ダイセキ	30,700	4,035.00	123,874,500
ステップ	5,500	2,016.00	11,088,000
泉州電業	7,200	3,785.00	27,252,000
元気寿司	8,700	3,560.00	30,972,000
トラスコ中山	32,500	2,432.00	79,040,000
ヤマダホールディングス	475,700	444.80	211,591,360
オートバックスセブン	53,900	1,625.00	87,587,500
モリト	11,100	1,416.00	15,717,600
アークランズ	46,000	1,668.00	76,728,000
ニトリホールディングス	56,300	19,695.00	1,108,828,500
グルメ杵屋	12,600	1,079.00	13,595,400
愛眼	5,000	183.00	915,000
ケーユーホールディングス	7,300	1,199.00	8,752,700
吉野家ホールディングス	57,000	3,282.00	187,074,000
加藤産業	19,200	4,655.00	89,376,000
北恵	1,700	861.00	1,463,700
イノテック	9,700	1,868.00	18,119,600
イエローハット	24,600	1,883.00	46,321,800
松屋フーズホールディングス	7,300	5,610.00	40,953,000
JBCホールディングス	9,700	3,930.00	38,121,000
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	1,546.00	35,867,200
日伝	10,500	2,724.00	28,602,000
関西フードマーケット	10,500	1,529.00	16,054,500
ミロク情報サービス	13,300	1,952.00	25,961,600
北沢産業	4,200	310.00	1,302,000
杉本商事	7,300	2,252.00	16,439,600
因幡電機産業	40,100	3,500.00	140,350,000
王将フードサービス	11,500	7,780.00	89,470,000
ミニストップ	11,200	1,613.00	18,065,600
アークス	28,400	2,914.00	82,757,600
パローホールディングス	29,500	2,528.00	74,576,000
東テック	5,100	6,570.00	33,507,000
ミスミグループ本社	233,600	2,321.50	542,302,400
アルテック	3,700	250.00	925,000
ベルク	7,700	6,540.00	50,358,000
大庄	7,400	1,340.00	9,916,000
タキヒヨー	1,600	1,206.00	1,929,600
ファーストリテイリング	69,600	38,750.00	2,697,000,000

ソフトバンクグループ	723,400	6,618.00	4,787,461,200	
蔵王産業	1,200	2,570.00	3,084,000	
スズケン	58,900	4,617.00	271,941,300	
サンドラッグ	52,200	4,479.00	233,803,800	
サックスパー ホールディングス	13,100	844.00	11,056,400	
ジェコス	9,300	1,192.00	11,085,600	
ヤマザワ	1,400	1,264.00	1,769,600	
やまや	1,500	3,295.00	4,942,500	
グローセル	18,100	748.00	13,538,800	
ベルーナ	37,200	617.00	22,952,400	
合計	226,079,000		528,947,749,730	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

- ( 1 ) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- ( 2 ) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期中間計算期間(2024年2月8日から2024年8月7日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## 【One DC 国内株式インデックスファンド】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第17期 2024年2月7日現在	第18期中間計算期間末 2024年8月7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	365,807,687	920,799,179
親投資信託受益証券	137,084,376,892	146,160,943,873
未収入金	-	400,452,000
流動資産合計	137,450,184,579	147,482,195,052
資産合計	137,450,184,579	147,482,195,052
負債の部		
流動負債		
未払解約金	266,788,932	1,196,900,701
未払受託者報酬	13,326,135	16,891,982
未払委託者報酬	79,957,089	101,352,129
その他未払費用	551,725	677,244
流動負債合計	360,623,881	1,315,822,056
負債合計	360,623,881	1,315,822,056
純資産の部		
元本等		
元本	62,916,862,680	67,975,887,184
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	74,172,698,018	78,190,485,812
(分配準備積立金)	35,676,182,361	31,398,073,131
元本等合計	137,089,560,698	146,166,372,996
純資産合計	137,089,560,698	146,166,372,996
負債純資産合計	137,450,184,579	147,482,195,052

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第17期中間計算期間 自 2023年2月8日 至 2023年8月7日	第18期中間計算期間 自 2024年2月8日 至 2024年8月7日
<b>営業収益</b>		
受取利息	1,796	139,043
有価証券売買等損益	14,839,339,458	2,732,353,019
<b>営業収益合計</b>	<b>14,839,341,254</b>	<b>2,732,213,976</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	77,884	3,165
受託者報酬	10,383,984	16,891,982
委託者報酬	62,304,048	101,352,129
その他費用	445,997	677,244
<b>営業費用合計</b>	<b>73,211,913</b>	<b>118,924,520</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>14,766,129,341</b>	<b>2,851,138,496</b>
<b>経常利益又は経常損失( )</b>	<b>14,766,129,341</b>	<b>2,851,138,496</b>
<b>中間純利益又は中間純損失( )</b>	<b>14,766,129,341</b>	<b>2,851,138,496</b>
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	870,491,374	1,197,958,114
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>33,200,703,037</b>	<b>74,172,698,018</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>9,758,119,733</b>	<b>18,078,114,314</b>
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	9,758,119,733	18,078,114,314
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>4,239,142,518</b>	<b>10,011,229,910</b>
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,239,142,518	10,011,229,910
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
<b>分配金</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>中間剰余金又は中間欠損金( )</b>	<b>52,615,318,219</b>	<b>78,190,485,812</b>

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第18期中間計算期間	
	自 2024年2月8日	至 2024年8月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第17期	第18期中間計算期間末
	2024年2月7日現在	2024年8月7日現在
1. 期首元本額	50,657,997,778円	62,916,862,680円
期中追加設定元本額	25,348,174,227円	13,447,170,136円
期中一部解約元本額	13,089,309,325円	8,388,145,632円
2. 受益権の総数	62,916,862,680口	67,975,887,184口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第17期	第18期中間計算期間末
	2024年2月7日現在	2024年8月7日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第17期 2024年2月7日現在	第18期中間計算期間末 2024年8月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,178.9円 (21,789円)	2,150.3円 (21,503円)

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2024年8月7日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,341,432,100
株式	496,694,668,800
派生商品評価勘定	291,570,170
未収入金	28,012,199,338
未収配当金	712,669,819
前払金	1,057,370,000
差入委託証拠金	1,360,947,173
流動資産合計	538,470,857,400
資産合計	538,470,857,400
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,015,583,450
未払解約金	10,720,704,000
流動負債合計	11,736,287,450
負債合計	11,736,287,450
純資産の部	
元本等	
元本	119,868,212,897
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	406,866,357,053
元本等合計	526,734,569,950
純資産合計	526,734,569,950
負債純資産合計	538,470,857,400



## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2024年2月8日 至 2024年8月7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8月7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	121,842,817,407円
同期中追加設定元本額	17,251,514,017円
同期中一部解約元本額	19,226,118,527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	2,388,257,401円
たわらノーロード 国内株式<ラップ専用>	5,811,937,837円
One DC 国内株式インデックスファンド	33,261,485,077円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,459,726,920円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,958,569円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	7,816,793円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	18,939,455円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	25,971,845円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	24,226,143円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	12,969,457円
たわらノーロード TOPIX	2,903,776,811円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,851,135,582円
たわらノーロード バランス(堅実型)	51,981,446円
たわらノーロード バランス(標準型)	420,473,037円
たわらノーロード バランス(積極型)	758,696,889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)	2,379,124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)	134,928,627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)	408,790,804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)	374,370,239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)	557,302,304円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	246,406円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,104,019円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	26,516,253円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,249,011円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	15,118,347円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(安定型)	10,674円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(バランス型)	31,556円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(積極型)	52,580円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,012,109,573円
Oneグローバルバランス	79,324,596円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	850,970,215円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,116,563,231円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,809,741,494円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	241,996,423円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	851,939,319円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,017,106,457円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	26,070,549円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	977,266,719円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	12,880,508円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	256,031,078円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	323,772,291円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	569,803,529円
投資のソムリエ	5,852,920,421円
クルーズコントロール	35,585,879円
投資のソムリエ<DC年金>	659,637,461円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	364,341,592円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,350,283,152円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	449,730,821円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,320,305,172円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	87,190,652円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	45,187,006円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,320,707円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	169,042,021円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	560,537,771円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	189,500,191円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	215,380,618円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	83,112,314円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	49,223,152円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	30,014,895円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	660,129,702円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	7,688,024円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	998,332円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	29,139,124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)	19,340,158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)	19,300,226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)	1,374,895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)	11,642,697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)	21,170,803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)	48,872,454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)	63,099,453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)	13,339,591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)	56,923,651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)	346,171,924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)	32,013,935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)2024-05(適格機関投資家限定)	348,588,445円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	98,892,256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)	981,164円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	20,282,286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)	35,824,908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)	32,069,355円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	3,360,141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)	31,558,641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)	57,656,041円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,410,106円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	9,125,908円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,846,683円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	76,013円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	509,693円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,481,342円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	230,509,323円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	353,719,988円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,098,390,404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)	9,459,792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)	12,623,430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)	119,096,905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)	23,471,923円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	49,836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)	113,893,631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)	6,884,335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)	28,666,571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)	58,889,120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)	115,801,110円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	15,265,822円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	5,873,361円
動的パッケージファンド<DC年金>	18,137,220円
コア資産形成ファンド	8,629,417円
MHAMトピックスファンド	773,467,291円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	43,995,562円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	2,048,816,523円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,432,424,737円

計	119,868,212,897円
2. 受益権の総数	119,868,212,897口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年8月7日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	2024年8月7日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	16,000,610,000	-	15,276,800,000	723,810,000
合計	16,000,610,000	-	15,276,800,000	723,810,000

## (注)時価の算定方法

## 株価指数先物取引

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

## (1口当たり情報に関する注記)

	2024年8月7日現在
1口当たり純資産額	4.3943円
(1万口当たり純資産額)	(43,943円)

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2024年8月30日現在

資産総額	162,974,908,062円
負債総額	324,666,592円
純資産総額( - )	162,650,241,470円
発行済数量	69,392,819,234口
1口当たり純資産額( / )	2.3439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8月30日現在

資産総額	587,744,531,053円
負債総額	844,065,274円
純資産総額( - )	586,900,465,779円
発行済数量	122,512,674,820口
1口当たり純資産額( / )	4.7905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8月30日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構(2024年8月30日現在)

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

##### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

##### 2. 運用計画、売買計画の決定

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



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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年8月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,455,299,141,596
追加型株式投資信託	770	16,616,529,639,752
単位型公社債投資信託	21	30,883,481,518
単位型株式投資信託	194	1,065,722,864,899
合計	1,011	19,168,435,127,765

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第39期事業年度(自2023年4月1日至2024年3月31日)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：百万円 )

	第38期 ( 2023年3月31日現在 )	第39期 ( 2024年3月31日現在 )
( 資産の部 )		
流動資産		
現金・預金	33,770	41,183
金銭の信託	29,184	28,143
未収委託者報酬	16,279	19,018
未収運用受託報酬	3,307	3,577
未収投資助言報酬	283	315
未収収益	15	6
前払費用	1,129	1,510
その他	2,377	2,088
流動資産計	86,346	95,843
固定資産		
有形固定資産		
建物	1,001	918
器具備品	118	130
リース資産	7	5
建設仮勘定	-	39
無形固定資産		
ソフトウェア	3,367	2,951
ソフトウェア仮勘定	1,651	1,543
電話加入権	2	0
投資その他の資産		
投資有価証券	182	184
関係会社株式	5,810	4,447
長期差入保証金	775	768
繰延税金資産	2,895	3,406
その他	104	128
固定資産計	15,918	14,524
資産合計	102,265	110,368

(単位:百万円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,481	1,982
リース債務	1	1
未払金	7,246	8,970
未払収益分配金	0	1
未払償還金	-	0
未払手数料	7,005	8,246
その他未払金	240	721
未払費用	7,716	8,616
未払法人税等	1,958	3,676
未払消費税等	277	1,497
賞与引当金	1,730	1,927
役員賞与引当金	48	52
流動負債計	20,460	26,725
固定負債		
リース債務	6	4
退職給付引当金	2,654	2,719
時効後支払損引当金	108	73
固定負債計	2,769	2,796
負債合計	23,230	29,521
(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	57,481	59,294
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	57,358	59,170
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	25,678	27,490
株主資本計	79,034	80,846
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	79,034	80,846
負債・純資産合計	102,265	110,368

## （ 2 ） 【 損益計算書 】

（ 単位：百万円 ）

	第38期 （ 自 2022年4月1日 至 2023年3月31日 ）		第39期 （ 自 2023年4月1日 至 2024年3月31日 ）	
	営業収益			
委託者報酬	95,739		102,113	
運用受託報酬	16,150		17,155	
投資助言報酬	2,048		2,211	
その他営業収益	23		26	
営業収益計		113,962		121,507
営業費用				
支払手数料	41,073		44,366	
広告宣伝費	216		329	
公告費	0		0	
調査費	33,177		35,468	
調査費	12,294		13,277	
委託調査費	20,882		22,190	
委託計算費	548		558	
営業雑経費	733		823	
通信費	36		36	
印刷費	504		598	
協会費	69		65	
諸会費	29		44	
支払販売手数料	92		78	
営業費用計		75,749		81,545
一般管理費				
給料	10,484		10,763	
役員報酬	168		164	
給料・手当	9,199		9,425	
賞与	1,115		1,173	
交際費	17		34	
寄付金	11		15	
旅費交通費	128		162	
租税公課	330		489	
不動産賃借料	1,006		1,030	
退職給付費用	437		412	
固定資産減価償却費	1,388		1,567	
福利厚生費	47		46	
修繕費	1		1	
賞与引当金繰入額	1,730		1,927	
役員賞与引当金繰入額	48		52	
機器リース料	0		0	
事務委託費	4,074		3,379	
事務用消耗品費	37		46	
器具備品費	1		3	
諸経費	334		240	
一般管理費計		20,078		20,172
営業利益		18,135		19,788

（単位：百万円）

	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）		第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）	
営業外収益				
受取利息		10		4
受取配当金	1	2,400	1	899
時効成立分配金・償還金		0		0
雑収入		10		18
時効後支払損引当金戻入額		24		35
営業外収益計		2,446		959
営業外費用				
為替差損		3		19
金銭の信託運用損		1,003		1,008
早期割増退職金		24		6
雑損失		47		0
営業外費用計		1,079		1,034
経常利益		19,502		19,712
特別利益				
投資有価証券売却益		4		-
特別利益計		4		-
特別損失				
固定資産除却損		12		6
投資有価証券売却損		9		-
関係会社株式評価損		584		1,362
減損損失		-	2	231
特別損失計		606		1,601
税引前当期純利益		18,900		18,111
法人税、住民税及び事業税		4,881		5,769
法人税等調整額		197		510
法人税等合計		5,078		5,258
当期純利益		13,821		12,852

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024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	25,678	57,481	79,034
当期変動額									
剰余金の配当							11,040	11,040	11,040
当期純利益							12,852	12,852	12,852
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,812	1,812	1,812
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	27,490	59,294	80,846

	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	79,034
当期変動額			
剰余金の配当			11,040
当期純利益			12,852
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	1,812
当期末残高	0	0	80,846



## 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、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

## 6. 収益及び費用の計上基準

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**

## （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38期 （2023年3月31日現在）	第39期 （2024年3月31日現在）
建物	523	630
器具備品	934	769
リース資産	1	3

## （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38期 （自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日）
受取配当金	2,393	895

## 2. 減損損失

当事業年度において、以下の資産について減損損失を計上しました。

（百万円）

場所	用途	種類	減損損失
本社	事業用資産	ソフトウェア仮勘定	231

当社は、キャッシュ・フローを生み出す最小単位として、主として事業別に資産をグルーピングしております。当社の資産運用業に係るソフトウェア開発計画の大幅な延期に伴い、当該計画に係るソフトウェア仮勘定について、回収可能額まで減額し、当該減少額231百万円を減損損失として特別損失に計上いたしました。なお、当該資産の回収可能額は使用価値により測定しており、使用価値については、将来キャッシュ・フローが見込まれないため、備忘価額の1円として評価しております。

## （株主資本等変動計算書関係）

## 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

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(予定)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					

## 第39期（自 2023年4月1日 至 2024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
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

2024年6月17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(予定)日
2024年6月17日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	10,280	257,000	2024年3月31日	2024年6月18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あります。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

## 第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	-

## 第39期（2024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	28,143	28,143	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	28,145	28,145	-

(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	-	-

## 第39期（2024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	41,183	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,143	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	19,018	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,577	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	91,923	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 其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	29,186	-	29,186

#### 第39期（2024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	-	28,143	-	28,143
(2) 投資有価証券 其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	28,145	-	28,145

(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（預金・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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
投資有価証券（其他有価証券）		
非上場株式	180	182
関係会社株式		
非上場株式	5,810	4,447

## （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38期の貸借対照表計上額5,810百万円、第39期の貸借対照表計上額4,447百万円）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。

第39期（2024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。



## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

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

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

## 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。

当事業年度において、有価証券について1,362百万円(関係会社株式1,362百万円)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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,576	2,698
勤務費用	279	296
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	31	9
退職給付の支払額	191	246
退職給付債務の期末残高	2,698	2,760

(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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,698	2,760
未積立退職給付債務	2,698	2,760
未認識数理計算上の差異	44	40
未認識過去勤務費用	0	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,654	2,719
退職給付引当金	2,654	2,719
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,654	2,719

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
勤務費用	279	296
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	22	13
過去勤務費用の費用処理額	34	0
その他	4	4
確定給付制度に係る退職給付費用	334	307

(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24百万円、当事業年度において6百万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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 3.56%	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103百万円、当事業年度104百万円であります。

## (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38期	第39期
	(2023年3月31日現在)	(2024年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	121	195
未払事業所税	9	9
賞与引当金	529	590
未払法定福利費	94	98
運用受託報酬	390	351
資産除去債務	15	17
減価償却超過額(一括償却資産)	21	12
減価償却超過額	198	91
繰延資産償却超過額(税法上)	297	331
退職給付引当金	812	832
時効後支払損引当金	33	22
ゴルフ会員権評価損	7	6
関係会社株式評価損	345	761
投資有価証券評価損	4	4
減損損失	-	70
その他	13	8
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	2,895	3,406
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	2,895	3,406

## 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38期	第39期
	(2023年3月31日現在)	(2024年3月31日現在)
法定実効税率	30.62 %	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 %	1.44 %
その他	0.06 %	0.14 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.87 %	29.04 %

## (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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
流動資産	- 百万円	- 百万円
固定資産	68,921百万円	60,761百万円
資産合計	68,921百万円	60,761百万円
流動負債	- 百万円	- 百万円
固定負債	3,643百万円	1,957百万円
負債合計	3,643百万円	1,957百万円
純資産	65,278百万円	58,804百万円

(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	51,451百万円	47,640百万円
顧客関連資産	20,947百万円	17,109百万円

## (2) 損益計算書項目

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	8,039百万円	7,649百万円
経常利益	8,039百万円	7,649百万円
税引前当期純利益	8,039百万円	7,649百万円
当期純利益	6,744百万円	6,474百万円
1株当たり当期純利益	168,617円97銭	161,850円28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	4,228百万円	3,837百万円

（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38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
委託者報酬	95,739百万円	102,113百万円
運用受託報酬	14,651百万円	15,156百万円
投資助言報酬	2,048百万円	2,211百万円
成功報酬（注）	1,499百万円	1,999百万円
その他営業収益	23百万円	26百万円
<b>合計</b>	<b>113,962百万円</b>	<b>121,507百万円</b>

（注）成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の運用受託報酬、当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38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）及び第39期（自 2023年4月1日 至 2024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38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

第39期(自 2023年4月1日 至 2024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38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

第39期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

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。

第39期(自 2023年4月1日 至 2024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	8,140	未払 手数料	1,870
	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	16,655	未払 手数料	3,137

## 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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	1,975,862円96銭	2,021,173円74銭
1株当たり当期純利益金額	345,535円19銭	321,310円79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38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益金額	13,821百万円	12,852百万円
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	13,821百万円	12,852百万円
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種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円(2024年3月末日現在)
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

## (2) 販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社武蔵野銀行	45,743	日本において銀行業務を営んでおります。
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。
株式会社京葉銀行	49,700	日本において銀行業務を営んでおります。
信金中央金庫	( 1 ) 890,998	日本において全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の受給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
マネックス証券株式会社	13,195	「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。
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000	「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。

(注) 資本金の額は2024年3月末日現在

## (1) 出資の総額

## 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集販売の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する一部解約金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付
- (7) その他上記に付帯する業務

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【その他】

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

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

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

## 独立監査人の監査報告書

2024年5月23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

## 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2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

## 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去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) 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

2024年4月5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 稲葉 宏和  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているOne DC 国内株式インデックスファンドの2023年2月8日から2024年2月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、One DC 国内株式インデックスファンドの2024年2月7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

2024年10月11日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているOne DC 国内株式インデックスファンドの2024年2月8日から2024年8月7日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、One DC 国内株式インデックスファンドの2024年8月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年2月8日から2024年8月7日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に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、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。