

【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12月10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】	MHAMスリーウェイオープン
【届出の対象とした募集（売出） 内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

MHAMスリーウェイオープン(以下「当ファンド」といいます。)

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込日の基準価額 とします。

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

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

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

注：電話番号はコールセンターのものであります（以下同じ）。

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

（５）【申込手数料】

通常のお申込みのお取扱い

申込手数料は、取得申込金額（取得申込口数に発行価格を乗じた額）に、1.1%（税抜1.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。なお、申込手数料には、消費税ならびに地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）が課せられます。

確定拠出年金制度に基づくお申込みのお取扱い

無手数料とします。

申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。

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

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

(6) 【申込単位】

申込単位は、各販売会社が定める単位とします。

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

申込単位および取扱コースについては、販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2024年12月11日から2025年6月10日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

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

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

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

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

投資信託振替制度における振替受益権について

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

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

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

確定拠出年金制度に基づくお申込みのお取扱い

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

わが国の金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所をいいます。以下同じ。)に上場(これに準ずるものを含みます。)されている株式・公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、信託財産の安定的な成長を目標として運用を行います。

<ファンドの特色>

・わが国の3資産(株式・債券・短期金融資産)に分散投資します。

・「TAAモデル」の指示により、資産配分を行います。

TAA(タクティカル・アセット・アロケーション)とは、「戦術的資産配分」の意味で、株式や債券等の資産間における相対的な価値を判断し、割安と判断される資産への投資比率を上げ、割高と判断される資産への投資比率を下げる運用手法をいいます(以下同じ。)

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

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

<商品分類>

・商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉となる資産)
単位型 追加型	国内 海外 内外	株式 債券 不動産投信 その他資産 () 資産複合

(注)当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・商品分類定義

追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
国内	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書又は投資信託約款において、「株式」、「債券」、「不動産投信」及び「その他資産」のうち、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

< 属性区分 >

・属性区分表

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

資産複合 (株式、債券、短期金融 資産、その他資産(投 資信託証券(株 式))) 資産配分変更型	目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、括弧内の記載はその該当複数資産を表す。 当ファンドでの株式への投資は、マザーファンド受益証券(投資信託証券)を通じて行うことがあります。
年2回	目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
日本	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。

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

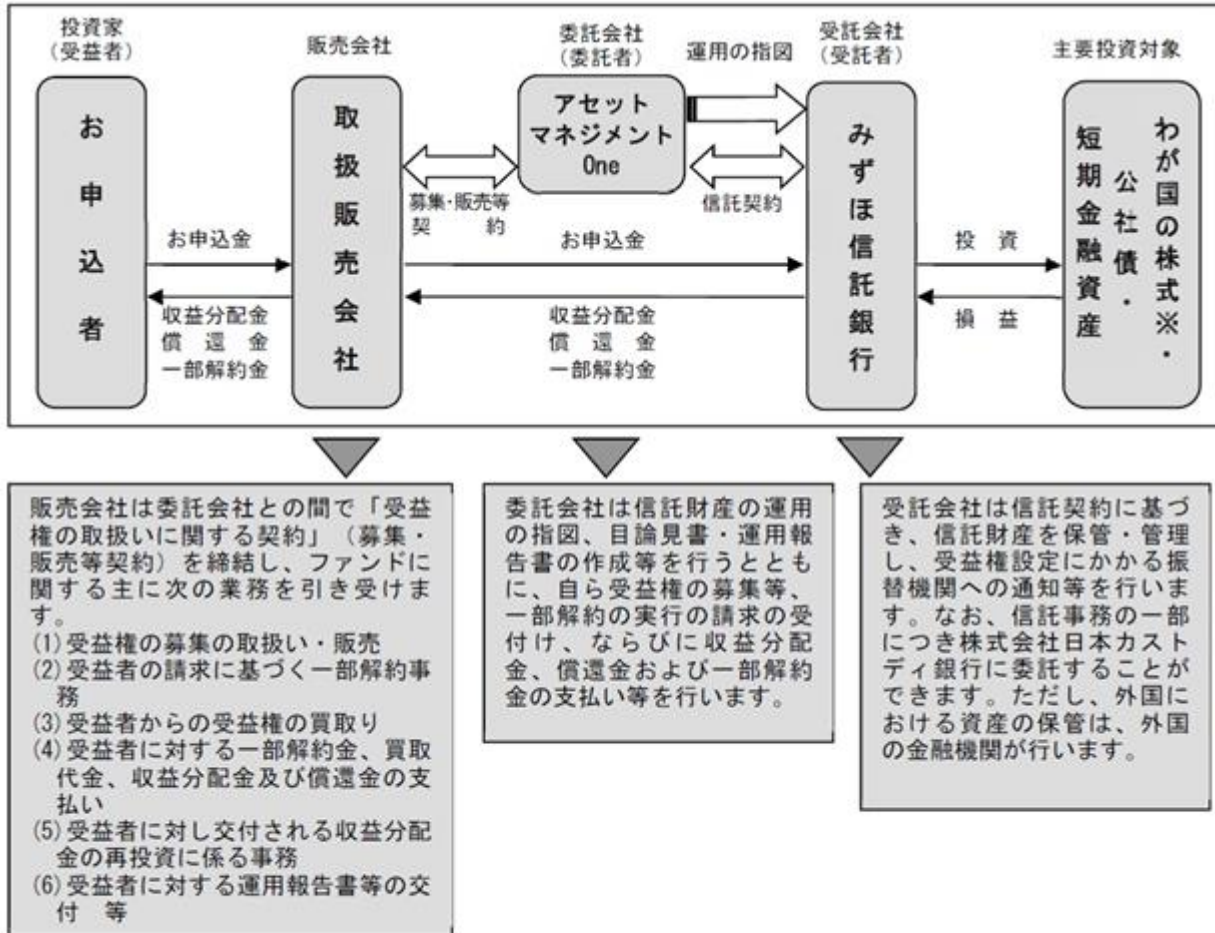
(注2) 当ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)でご覧いただけます。

(2) 【ファンドの沿革】

1993年11月26日	信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
1998年11月30日	当ファンドの信託期間を無期限に変更 当ファンドの決算を年1回(9月10日)から年2回(3月10日および9月10日)に変更 当ファンドの投資対象に「富士TOPIXオープンマザーファンド」を追加
1998年12月1日	1口当たり元本額を1万円から1円に変更するための受益権分割を実施
2007年1月4日	投資信託振替制度へ移行
2007年7月1日	当ファンドの名称を「富士スリーウェイオープン」から「MHAMスリーウェイオープン」に変更
2016年10月1日	ファンドの委託会社としての業務をみずほ投信投資顧問株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継
2021年7月2日	ファンドの主要投資対象に「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」を追加
2021年12月17日	ファンドの主要投資対象から「MHAM TOPIXマザーファンド」を削除

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの運営の仕組み



※ 主要投資対象の内、わが国の株式には、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドを通じて投資を行う場合があります。

委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2024年9月30日現在）

委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。

- 2008年1月1日 「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更
- 2016年10月1日 D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社(資産運用部門)が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

(2024年9月30日現在)

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

1：A種種類株式(15,510株)を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

この投資信託は、わが国の株式、債券および短期金融資産の組入比率の変更を、原則としてT A Aモデル(タクティカル・アセット・アロケーション・モデル)の指示により機動的に行い、信託財産の安定的な成長を目標として運用を行います。

運用方法

1. 主要投資対象

わが国の金融商品取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている株式、公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。なお、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組入れることもあります。

株式への投資は、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への投資を通じて行う場合があります。国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドは、東証株価指数(TOPIX、配当込み)に連動する投資成果を目指します。

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

TOPIXは、機関投資家をはじめ、国内株式運用の実績を測る尺度として広く利用されています。

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。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、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JPXは責任を負いません。

2. 投資態度

- a. 景気指標、市場内部指標、価値指標等のファクターを取り入れたTAAモデルを活用することにより株式・債券・短期金融資産の割高・割安を的確に把握することを目指し、適切なアセット・アロケーションを行うことで安定した収益を追求します。

アロケーションとは、株式や債券等の各資産間の配分をいいます。

分散投資の効果

株式や債券などの異なる資産では、一般的にその値動きも異なります。当ファンドは、様々な景気・金利局面において異なる値動きをする資産を組み合わせ、組入比率を機動的に変更することで、安定的な収益の確保を目指します。

- b. 株式組入比率の上限を30%とし、株式運用部分は東証株価指数(TOPIX、配当込み)を上回る投資成果を目標とする運用を行います。

ただし、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組入れる場合は、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ます。

株価指数先物取引を含む株式の実質組入比率は最大で信託財産の純資産総額の30%とし、株式のリスクを限定したうえで、安定的な運用成果を目指します。

- c. 債券運用部分は債券市中平均利回りにスライドした(債券市場全体の動きに沿った)投資成果を目指します。

- d. TAAモデルの指示により、有価証券の組入比率を変動させる場合、有価証券先物取引等も利用します。

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

- e. 市況動向やファンドの資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドの投資プロセス

当ファンドは、以下の投資プロセスにより運用を行います。

1. 運用方針についての考え方

「資産の配分方法は、運用成績を決定する重要な要素である。」との考え方に基づき運用を行います。

2. モデルの指示に基づく一貫した投資手法

当ファンドは、投資情報の数理的分析等に基づくアセットマネジメントOne独自の投資モデル(TAAモデル)を採用しています。モデルの採用により、より効率的な運用・高度なリスクコントロールの追求が可能になるとともに、運用プロセス全体が明確になります。また、モデルを使ったシステム運用は、常に一貫した手法が用いられるため、運用手法・運用内容が運用担当者の主観や判断および交代などの影響を受けにくいことが特徴です。

3. 機動的なアロケーション変更

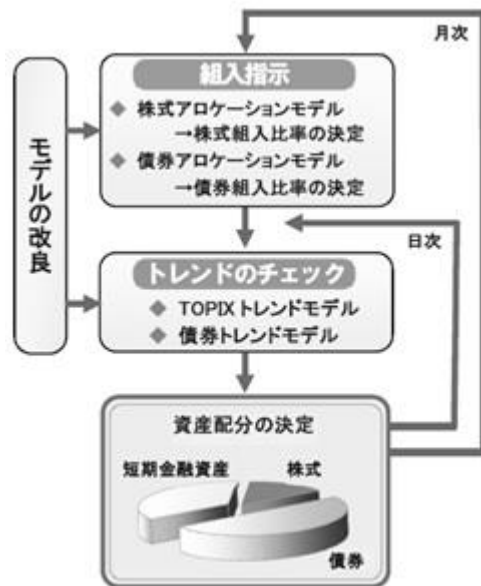
株式・債券の組入比率を月次で決定する2つのモデルに加え、さらに2種類のトレンドモデルを用いて日次で資産配分(アロケーション)の見直しを行うことで、より機動的な資産配分の変更を目指します。

トレンドとは、相場の上昇や下降等の傾向のことをいいます。

4. モデルの改良

モデルの構築には、様々な前提がおかれています。経済構造・市場構造の変化等により前提が崩れると予測される場合には、モデルの修正・改良が必要となります。アセットマネジメントOneでは、実際の運用を通じてモデルの機能を常にチェックし、適宜修正・改良を行っています。

T A Aモデルの構成



株式アロケーションモデル

景気指標および市場データ等を用いた分析により、株式の投資妙味を判断し、月次で株式の組入比率を決定します。

債券アロケーションモデル

景気指標および市場データ等を用いた分析により、債券の投資妙味を判断し、月次で債券の組入比率を決定します。

以上2種類のモデルにより、資産配分比率の月次の基本方針を決定します。

TOPIXトレンドモデル

主に市場データを基に株式市場の方向性とその強さ（トレンド）を統計的手法により分析し、日次で株式組入比率の調整を決定するモデルです。

債券トレンドモデル

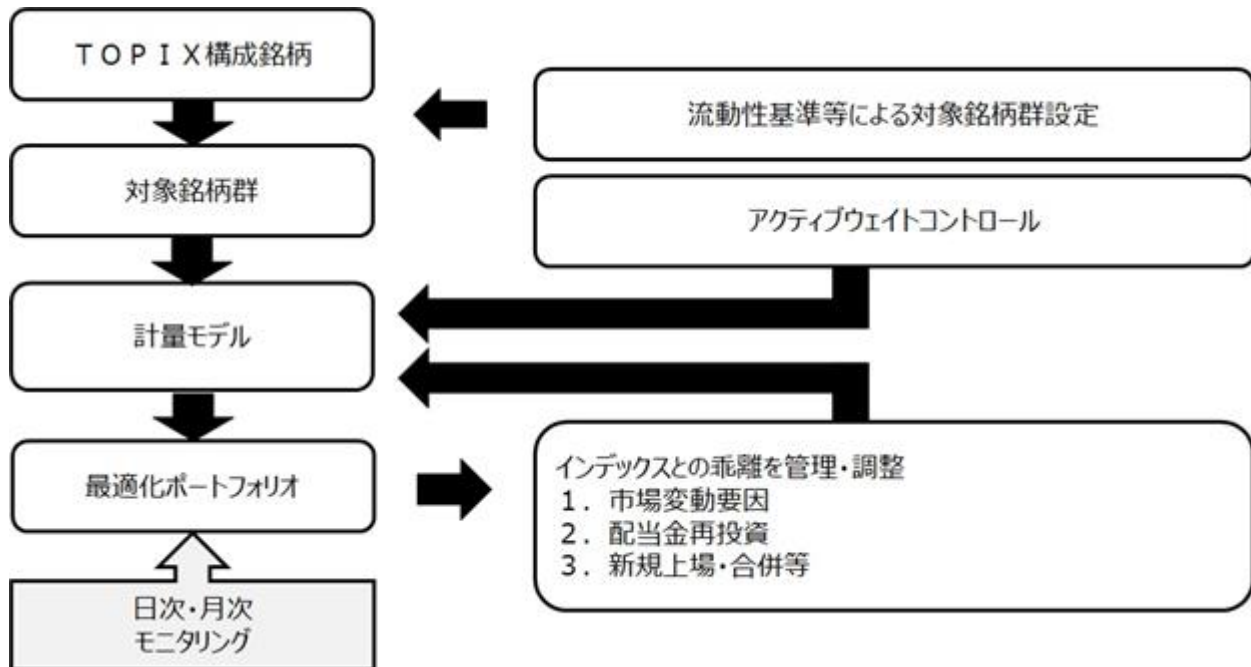
主に市場データを基に債券市場の方向性とその強さ（トレンド）を統計的手法により分析し、日次で債券組入比率の調整を決定するモデルです。

以上2種類のトレンドモデルにより、日次で資産配分比率の変更を行います。

モデルおよび使用するファクターについては、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

<国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの投資プロセス>

当ファンドは、株式運用部分について、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を組入れる場合があります。国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの具体的な投資プロセスは以下の通りです。



1. 流動性基準等による対象銘柄群設定

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

2. 最適化法によるポートフォリオの構築

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

3. インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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

（２）【投資対象】

有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、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（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券および次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

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

金融商品の指図範囲

委託会社は、信託金を前記 に掲げる有価証券のほか、指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）および抵当証券（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。）ならびに次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。また、前記 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を以下に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

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

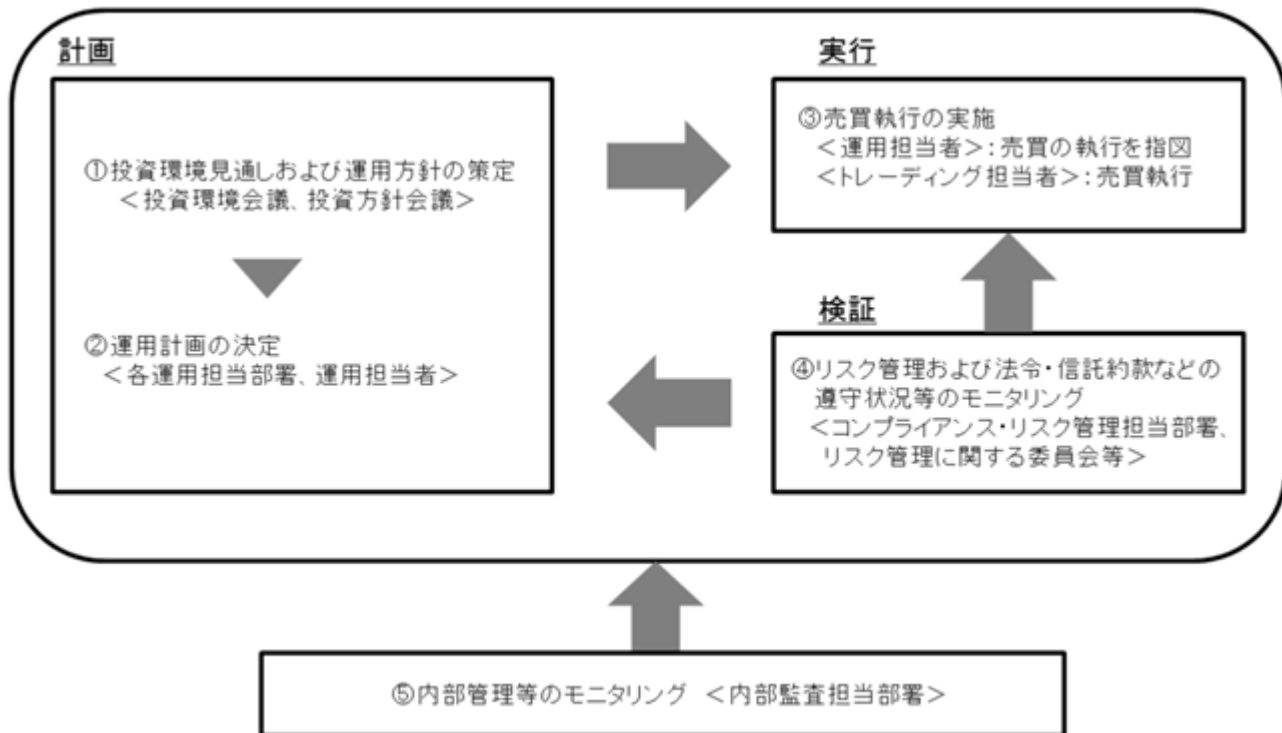
その他の投資対象

有価証券先物取引等

委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を約款に規定する範囲で行うことができます。

（3）【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

定期的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9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3月10日および9月10日。ただし、休業日の場合は翌日以降の最初の営業日)に、原則として次の通り収益分配を行います。

分配対象額の範囲は、配当等収益の他に売買益等も含め、その中から運用実績に応じて分配を行います。

分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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

将来の収益分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

収益分配金の支払い

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

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

(5)【投資制限】

a. 約款で定める投資制限

株式および新株引受権証券等(約款第21条、第22条および第23条)

1. 委託会社は、株式および新株引受権証券等への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図はしません。

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

2. 委託会社は、新株引受権証券等への実質投資割合が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
3. 委託会社は、同一銘柄の株式への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
4. 委託会社は、同一銘柄の新株引受権証券等への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
5. 委託会社が投資することを指図する株式および新株引受権証券等は、わが国の証券取引所(「証券取引所」とは、金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場(以下「取引所」といいます。))のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。)に上場(上場予定を含みます。)されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式および新株引受権証券等についてはこの限りではありません。

転換社債等(約款第26条)

委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに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。(両者および前記(2)投資対象 有価証券の指図範囲8.において同様の性質を有するものを総称して「転換社債等」といいます。))への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図はしません。

信用リスク集中回避のための投資制限(約款第23条の1の2)

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、

原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等(約款第23条の2)

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

有価証券先物取引等(約款第24条)

1. 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の証券取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で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り扱うものとします(以下同じ。)
 - a. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 - b. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに前記(2)投資対象 金融商品の指図範囲1.から4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 - c. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、この で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲とします。
2. 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびにこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、現物オプション取引は預金に限るものとします。
 - a. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前記(2)投資対象 金融商品の指図範囲1.から4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 - b. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに前記(2)投資対象 金融商品の指図範囲1.から4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

- c. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つこので規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

公社債(約款第25条)

委託会社が投資することを指図する公社債のうち、外国または外国法人の発行する邦貨建公社債およびわが国またはわが国法人が外国において発行する邦貨建公社債については、証券取引所に上場(上場予定を含みます。)されている銘柄およびこれに準ずるものとします。ただし、社債権者割当または株主割当により取得する公社債については、この限りではありません。

資金の借入れ(約款第32条の2)

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

b. 法令で定める投資制限

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

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

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

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

(3) 投資制限

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

3【投資リスク】

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

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

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

株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

金利変動リスク

金利の上昇（公社債の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

金利変動リスクとは、金利変動により公社債の価格が下落するリスクをいいます。一般に金利が上昇した場合には、既に発行されて流通している公社債の価格は下落します。金利上昇は、当ファンドが投資する公社債の価格に影響を及ぼし、当ファンドの基準価額を下落させる要因となります。また、金利変動により株式市場と公社債市場の間で資金シフトが起こる場合があり、その場合、金利変動の影響は株式市場にも及びます。

信用リスク

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

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

流動性リスク

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

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

<その他>

- ・当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- ・有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- ・当ファンドの株式運用部分として、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を組入れる場合があります。そのため、同マザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用が影響を受ける場合があります。
- ・当ファンドは、証券取引所における取引の停止等があるときには、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、およびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことがあります。

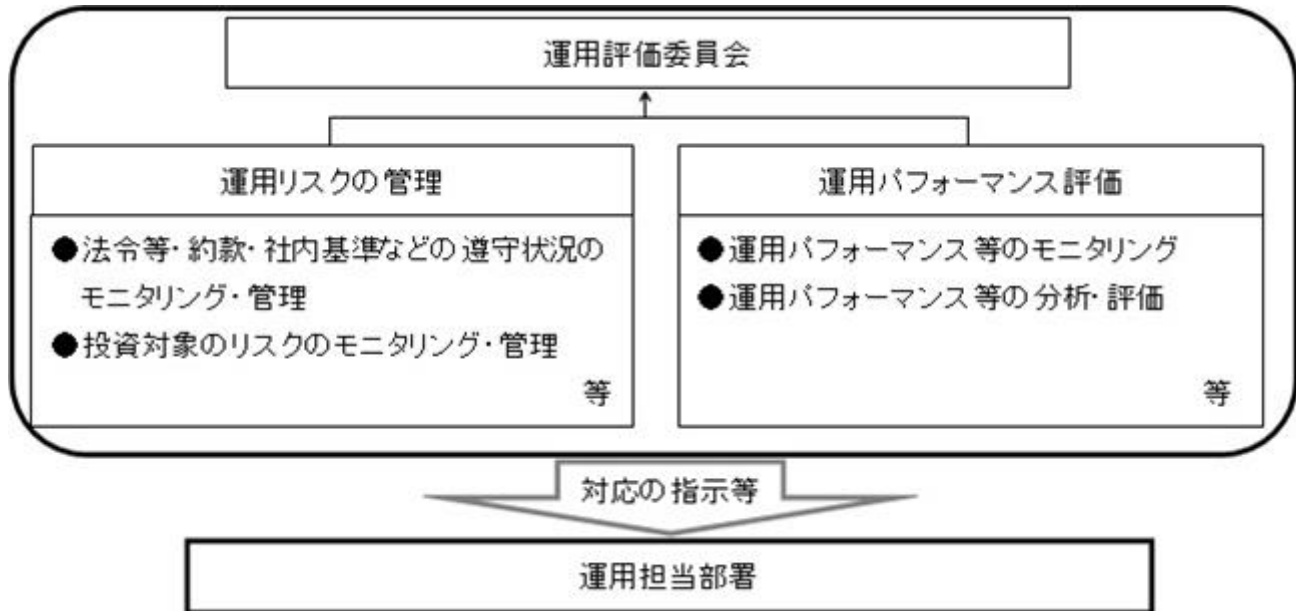
<収益分配金に関する留意点>

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

(2) リスク管理体制

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

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

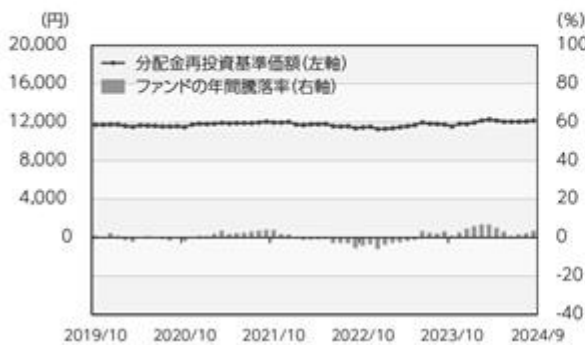


- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

リスク管理体制は2024年9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。

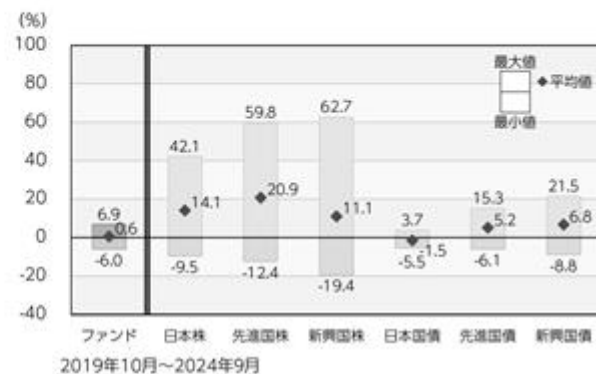
<参考情報>

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。なお、分配金再投資基準価額は、1999年1月4日の当ファンドの基準価額(9,967円)に合わせて指数化しています。
- ※ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

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

通常のお申込みの場合

申込手数料は、取得申込金額(取得申込口数に発行価格を乗じた額)に、1.1%(税抜1.0%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。なお、申込手数料には消費税等相当額が課せられます。

確定拠出年金制度に基づくお申込みの場合

無手数料とします。

申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。

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

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

< 申込手数料を対価とする役務の内容 >

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

(2)【換金(解約)手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.935%(税抜0.85%)の率を乗じて得た額とします。

その配分(税抜)については、以下の通りとなります。

委託会社	販売会社	受託会社
0.40%	0.35%	0.10%

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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

< 信託報酬等を対価とする役務の内容 >

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

当ファンドは、少額投資非課税制度(NISA)の対象ではありません。公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISAの適用対象となります。

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

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

--- (参考情報) ファンドの総経費率 ---

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.94%	0.94%	0.00%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2024年3月12日~2024年9月10日

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

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

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

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2024年9月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券		3,561,589,900	53.75
	内 日本	3,561,589,900	53.75
親投資信託受益証券		1,108,167,882	16.72
	内 日本	1,108,167,882	16.72
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,956,214,831	29.52
純資産総額		6,625,972,613	100.00

その他資産の投資状況

2024年9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（売建）		1,085,475,000	16.38
	内 日本	1,085,475,000	16.38
債券先物取引（買建）		1,880,450,000	28.38
	内 日本	1,880,450,000	28.38

（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。

（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9月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		558,278,966,080	97.36
	内 日本	558,278,966,080	97.36
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		15,153,864,926	2.64
純資産総額		573,432,831,006	100.00

その他資産の投資状況

2024年9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）		15,408,450,000	2.69
	内 日本	15,408,450,000	2.69

（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9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	234,935,632	4.5499 1,068,957,125	4.7169 1,108,167,882	- -	16.72
2	156回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証 券	600,000,000	99.30 595,830,000	99.38 596,280,000	0.2 2027/12/20	9.00
3	189回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	200,000,000	102.95 205,918,000	103.48 206,976,000	1.9 2044/6/20	3.12
4	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	200,000,000	99.62 199,242,000	99.67 199,342,000	0.1 2026/3/20	3.01
5	141回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	150,000,000	107.86 161,794,500	108.10 162,162,000	1.7 2032/12/20	2.45
6	83回 利付国庫債券(3 0年) 日本	国債証 券	150,000,000	102.48 153,733,500	102.48 153,729,000	2.2 2054/6/20	2.32
7	100回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	140,000,000	106.21 148,696,800	106.17 148,639,400	2.2 2028/3/20	2.24
8	370回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	150,000,000	97.99 146,995,500	98.28 147,424,500	0.5 2033/3/20	2.22
9	180回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	150,000,000	88.02 132,042,000	88.47 132,712,500	0.8 2042/3/20	2.00
10	15回 利付国庫債券(3 0年) 日本	国債証 券	100,000,000	114.93 114,939,000	115.27 115,276,000	2.5 2034/6/20	1.74
11	142回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	100,000,000	108.64 108,645,000	108.93 108,930,000	1.8 2032/12/20	1.64
12	145回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	100,000,000	107.86 107,863,000	108.12 108,127,000	1.7 2033/6/20	1.63
13	102回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	100,000,000	107.33 107,333,000	107.30 107,307,000	2.4 2028/6/20	1.62
14	105回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	100,000,000	106.54 106,543,000	106.55 106,559,000	2.1 2028/9/20	1.61
15	97回 利付国庫債券(2 0年) 日本	国債証 券	100,000,000	105.37 105,379,000	105.36 105,360,000	2.2 2027/9/20	1.59
16	10回 利付国庫債券(3 0年) 日本	国債証 券	100,000,000	102.92 102,926,000	103.19 103,196,000	1.1 2033/3/20	1.56
17	171回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	120,000,000	84.61 101,536,800	85.07 102,093,600	0.3 2039/12/20	1.54

18	364回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	100,000,000	96.53 96,532,000	96.75 96,752,000	0.1 2031/9/20	1.46
19	156回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	100,000,000	92.60 92,605,000	93.06 93,062,000	0.4 2036/3/20	1.40
20	77回 利付国庫債券(3 0年) 日本	国債証券	100,000,000	90.09 90,090,000	90.18 90,181,000	1.6 2052/12/20	1.36
21	181回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	100,000,000	89.20 89,202,000	89.65 89,656,000	0.9 2042/6/20	1.35
22	167回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	100,000,000	89.13 89,133,000	89.59 89,592,000	0.5 2038/12/20	1.35
23	170回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	100,000,000	85.07 85,077,000	85.53 85,539,000	0.3 2039/9/20	1.29
24	148回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	60,000,000	105.81 63,490,800	106.15 63,695,400	1.5 2034/3/20	0.96
25	57回 利付国庫債券(3 0年) 日本	国債証券	70,000,000	79.67 55,773,200	79.83 55,883,100	0.8 2047/12/20	0.84
26	151回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	50,000,000	99.01 49,507,000	99.09 49,548,000	0.005 2027/3/20	0.75
27	361回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	50,000,000	97.21 48,605,500	97.38 48,690,500	0.1 2030/12/20	0.73
28	183回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	50,000,000	96.35 48,177,000	96.83 48,418,500	1.4 2042/12/20	0.73
29	187回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	50,000,000	93.64 46,824,500	94.13 47,068,500	1.3 2043/12/20	0.71
30	80回 利付国庫債券(3 0年) 日本	国債証券	50,000,000	93.99 46,998,000	94.08 47,043,500	1.8 2053/9/20	0.71

(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9月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	53.75
親投資信託受益証券	16.72
合計	70.48

(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9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	2,542.50 20,268,047,250	- -	3.53
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	5,251,000	2,831.01 14,865,684,032	2,777.50 14,584,652,500	- -	2.54
3	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,639,500	2,419.85 8,807,052,562	3,781.00 13,760,949,500	- -	2.40
4	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	1,453.50 13,074,087,150	- -	2.28
5	キーエンス 日本	株式 電気機器	150,100	64,310.37 9,652,987,618	68,360.00 10,260,836,000	- -	1.79
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	8,705.00 9,665,161,500	- -	1.69
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	3,080,500	2,616.05 8,058,749,716	3,045.00 9,380,122,500	- -	1.64
8	三菱商事 日本	株式 卸売業	3,046,700	2,823.87 8,603,509,587	2,952.50 8,995,381,750	- -	1.57
9	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,066,700	6,757.19 7,207,902,143	7,678.00 8,190,122,600	- -	1.43
10	信越化学工業 日本	株式 化学	1,347,000	5,852.78 7,883,697,696	5,977.00 8,051,019,000	- -	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	25,290.00 8,029,575,000	- -	1.40
12	三井物産 日本	株式 卸売業	2,376,700	2,959.63 7,034,166,158	3,178.00 7,553,152,600	- -	1.32
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	5,231.00 7,543,625,100	- -	1.32
14	任天堂 日本	株式 その他製品	946,900	8,317.19 7,875,556,230	7,636.00 7,230,528,400	- -	1.26
15	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	44,739,500	181.05 8,100,392,860	146.80 6,567,758,600	- -	1.15
16	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	8,427.00 6,251,991,300	- -	1.09
17	第一三共 日本	株式 医薬品	1,310,300	4,592.51 6,017,574,938	4,709.00 6,170,202,700	- -	1.08
18	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	2,936.00 5,853,503,200	- -	1.02

19	HOYA 日本	株式 精密機器	295,200	18,437.71 5,442,813,054	19,785.00 5,840,532,000	- -	1.02
20	三菱重工業 日本	株式 機械	2,648,800	1,098.05 2,908,516,431	2,117.50 5,608,834,000	- -	0.98
21	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,331,300	4,219.12 5,616,917,124	4,103.00 5,462,323,900	- -	0.95
22	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	1,507.50 5,356,599,750	- -	0.93
23	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,106,200	4,588.91 5,076,252,298	4,594.00 5,081,882,800	- -	0.89
24	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	24,031,000	194.05 4,663,330,366	187.20 4,498,603,200	- -	0.78
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	47,420.00 4,229,864,000	- -	0.74
26	富士通 日本	株式 電気機器	1,393,800	2,314.72 3,226,263,512	2,935.50 4,091,499,900	- -	0.71
27	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,659,100	2,048.69 3,398,987,768	2,303.50 3,821,736,850	- -	0.67
28	村田製作所 日本	株式 電気機器	1,339,500	2,975.12 3,985,184,728	2,806.50 3,759,306,750	- -	0.66
29	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	897,300	3,958.43 3,551,899,614	4,179.00 3,749,816,700	- -	0.65
30	ダイキン工業 日本	株式 機械	180,700	20,947.53 3,785,219,219	20,075.00 3,627,552,500	- -	0.63

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	97.36
合計	97.36

(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9月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	17.21
情報・通信業		7.36
銀行業		7.22
卸売業		7.18
輸送用機器		7.03
化学		5.66
機械		5.39
サービス業		4.62
医薬品		4.53
小売業		4.39
食料品		3.19
保険業		2.96

その他製品	2.45
精密機器	2.37
陸運業	2.32
建設業	2.17
不動産業	1.90
電気・ガス業	1.34
その他金融業	1.17
鉄鋼	0.84
証券、商品先物取引業	0.79
海運業	0.79
非鉄金属	0.78
ガラス・土石製品	0.67
ゴム製品	0.58
石油・石炭製品	0.54
金属製品	0.50
繊維製品	0.39
空運業	0.38
鉱業	0.26
パルプ・紙	0.15
倉庫・運輸関連業	0.15
水産・農林業	0.08
合計	97.36

（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】

2024年9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 0612月	売建	41	1,099,681,470	1,085,475,000	16.38
債券先物取引	大阪取引所	長国先 0612 月	買建	13	1,878,112,310	1,880,450,000	28.38

（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。

（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9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 0612月	買建	582	15,172,912,060	15,408,450,000	2.69

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

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第38計算期間末 (2015年 3月10日)	10,480	10,490	1.0087	1.0097
第39計算期間末 (2015年 9月10日)	9,762	9,820	1.0024	1.0084
第40計算期間末 (2016年 3月10日)	9,700	9,758	1.0090	1.0150
第41計算期間末 (2016年 9月12日)	9,838	9,896	1.0257	1.0317
第42計算期間末 (2017年 3月10日)	9,526	9,526	1.0258	1.0258
第43計算期間末 (2017年 9月11日)	9,279	9,288	1.0305	1.0315
第44計算期間末 (2018年 3月12日)	8,952	9,038	1.0417	1.0517
第45計算期間末 (2018年 9月10日)	8,713	8,713	1.0288	1.0288
第46計算期間末 (2019年 3月11日)	8,515	8,515	1.0330	1.0330
第47計算期間末 (2019年9月10日)	8,354	8,354	1.0270	1.0270
第48計算期間末 (2020年3月10日)	8,120	8,120	1.0083	1.0083
第49計算期間末 (2020年9月10日)	7,877	7,892	1.0158	1.0178
第50計算期間末 (2021年3月10日)	7,908	7,984	1.0387	1.0487
第51計算期間末 (2021年9月10日)	7,839	7,846	1.0557	1.0567
第52計算期間末 (2022年3月10日)	7,436	7,436	1.0130	1.0130
第53計算期間末 (2022年9月12日)	7,259	7,267	1.0023	1.0033
第54計算期間末 (2023年3月10日)	7,060	7,060	0.9950	0.9950
第55計算期間末 (2023年9月11日)	6,739	6,805	1.0147	1.0247
第56計算期間末 (2024年3月11日)	6,693	6,758	1.0320	1.0420

第57計算期間末 (2024年9月10日)	6,544	6,544	1.0226	1.0226
2023年9月末日	6,735	-	1.0102	-
10月末日	6,629	-	0.9941	-
11月末日	6,745	-	1.0180	-
12月末日	6,692	-	1.0164	-
2024年1月末日	6,750	-	1.0300	-
2月末日	6,814	-	1.0460	-
3月末日	6,839	-	1.0470	-
4月末日	6,732	-	1.0374	-
5月末日	6,616	-	1.0261	-
6月末日	6,625	-	1.0279	-
7月末日	6,577	-	1.0260	-
8月末日	6,604	-	1.0295	-
9月末日	6,625	-	1.0359	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金（円）
第38計算期間	0.0010
第39計算期間	0.0060
第40計算期間	0.0060
第41計算期間	0.0060
第42計算期間	0.0000
第43計算期間	0.0010
第44計算期間	0.0100
第45計算期間	0.0000
第46計算期間	0.0000
第47計算期間	0.0000
第48計算期間	0.0000
第49計算期間	0.0020
第50計算期間	0.0100
第51計算期間	0.0010
第52計算期間	0.0000
第53計算期間	0.0010
第54計算期間	0.0000
第55計算期間	0.0100
第56計算期間	0.0100
第57計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率（％）
第38計算期間	1.51
第39計算期間	0.03
第40計算期間	1.26
第41計算期間	2.25
第42計算期間	0.01
第43計算期間	0.56
第44計算期間	2.06
第45計算期間	1.24

第46計算期間	0.41
第47計算期間	0.6
第48計算期間	1.8
第49計算期間	0.9
第50計算期間	3.2
第51計算期間	1.7
第52計算期間	4.0
第53計算期間	1.0
第54計算期間	0.7
第55計算期間	3.0
第56計算期間	2.7
第57計算期間	0.9

(注1) 収益率は期間騰落率です。

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

(4) 【設定及び解約の実績】

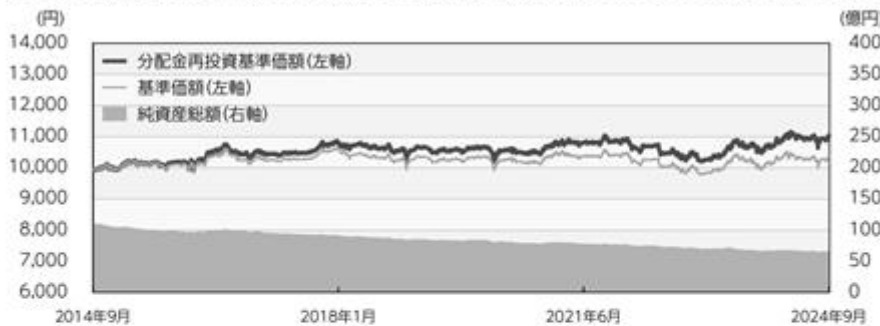
	設定口数	解約口数
第38計算期間	294,952,276	1,024,842,529
第39計算期間	317,180,609	968,640,410
第40計算期間	442,473,798	566,960,043
第41計算期間	440,391,845	462,278,145
第42計算期間	497,804,047	804,194,658
第43計算期間	290,194,467	571,802,304
第44計算期間	275,168,842	685,083,990
第45計算期間	376,901,704	502,346,126
第46計算期間	221,128,589	446,507,337
第47計算期間	255,610,157	364,455,489
第48計算期間	328,416,839	409,867,557
第49計算期間	337,863,174	636,916,350
第50計算期間	356,094,482	496,405,488
第51計算期間	304,220,136	492,728,215
第52計算期間	230,074,406	314,104,055
第53計算期間	234,209,843	332,469,655
第54計算期間	223,150,533	370,240,827
第55計算期間	225,206,261	679,353,149
第56計算期間	318,215,180	474,436,170
第57計算期間	293,216,801	378,747,928

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

参考情報

データの基準日:2024年9月30日

基準価額・純資産の推移 (2014年9月30日～2024年9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:1993年11月26日)

分配の推移(税引前)

2022年 9月	10円
2023年 3月	0円
2023年 9月	100円
2024年 3月	100円
2024年 9月	0円
設定来累計	2,300円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

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

資産の状況

資産の種類	比率(%)
国債証券	53.75
内 日本	53.75
親投資信託受益証券	16.72
内 日本	16.72
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	29.52
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(売建)	△16.38
債券先物取引(買建)	28.38

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	利率(%)	償還日	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	親投資信託受益証券	-	-	16.72
2	156回 利付国庫債券(5年)	国債証券	0.2	2027/12/20	9.00
3	189回 利付国庫債券(20年)	国債証券	1.9	2044/6/20	3.12
4	342回 利付国庫債券(10年)	国債証券	0.1	2026/3/20	3.01
5	141回 利付国庫債券(20年)	国債証券	1.7	2032/12/20	2.45
6	83回 利付国庫債券(30年)	国債証券	2.2	2054/6/20	2.32
7	100回 利付国庫債券(20年)	国債証券	2.2	2028/3/20	2.24
8	370回 利付国庫債券(10年)	国債証券	0.5	2033/3/20	2.22
9	180回 利付国庫債券(20年)	国債証券	0.8	2042/3/20	2.00
10	15回 利付国庫債券(30年)	国債証券	2.5	2034/6/20	1.74

■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	97.36
内 日本	97.36
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.64
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)	2.69

株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	17.21
2	情報・通信業	7.36
3	銀行業	7.22
4	卸売業	7.18
5	輸送用機器	7.03

組入上位10銘柄

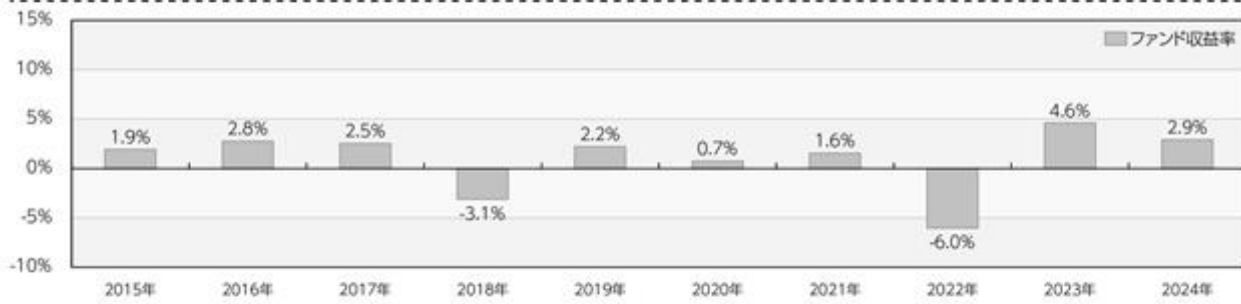
順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.53
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.54
3	日立製作所	株式	日本	電気機器	2.40
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.28
5	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.79
6	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.69
7	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.64
8	三菱商事	株式	日本	卸売業	1.57
9	伊藤忠商事	株式	日本	卸売業	1.43
10	信越化学工業	株式	日本	化学	1.40

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2024年9月30日

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。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

○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】

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

2【換金（解約）手続等】

<一部解約（解約請求）>

- (1) 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に各販売会社が定める単位をもって解約を請求することができます。
解約単位は、販売会社にお問い合わせください。
- (2) 解約の請求を行う受益者は、振替制度にかかる口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約にか

かる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。なお、解約の請求を受益者が行う際は、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

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

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

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

(以下同じ。)

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

< 受益権の買取り（買取請求） >

- (1) 販売会社は、受益者から受益権の買取りの請求があるときは、1口を最低単位として販売会社が個別に定める単位をもってその受益権を買取ります。なお、受益者が受益権の買取りを請求するときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。
- (2) 受益権の買取価額は、買取約定日の基準価額とします。
一定の要件を満たしている買取請求による換金の場合に限るものとします。なお、一定の要件を満たしていない場合には、買取約定日の基準価額から当該買取りを行う販売会社にかかる源泉徴収税額に相当する額を差し引いた金額となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (3) 販売会社は、証券取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて受益権の買取りを中止することができます。この場合、受益者は買取中止以前に行った当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合に

は、当該受益権の買取価額は、買取中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取りの請求を受付けたものとして、前記(2)の規定に準じて計算された価額とします。

(注) 税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
株式	計算日における取引所の最終相場
公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額(売り気配相場を除きます。) ・価格情報会社の提供する価額
マザーファンド受益証券	計算日の基準価額

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

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

1993年11月26日から無期限とします。

(4)【計算期間】

毎年3月11日から9月10日までおよび9月11日から翌年3月10日までとすることを原則とします。ただし、第1期計算期間は1993年11月26日から1994年9月10日までとし、第2期計算期間から第5期計算期間は、それぞれ9月11日から翌年9月10日までとします。

上記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「当該日」といいます。)が休業日のとき、計算期間終了日は、当該日の翌日以降の最初の営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

信託契約の解約

以下の場合には信託契約を解約し信託を終了することがあります。

1. 委託会社は、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき、もしくは信託契約の一部解約により、受益権の口数が当初設定口数の10分の1を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。
 - a. この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかる全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
 - b. 前記 a. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
 - c. 前記 b. の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記 1. の信託契約の解約をしません。
 - d. 委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
 - e. 前記 b. から d. までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記 b. の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
 - f. 前記 1. に定める信託契約の解約を行う場合において、前記 b. の期間内に異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。なお、買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社の協議により決定するものとします。
2. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
3. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、この信託は、「信託約款の変更 4.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
4. 受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

1. 委託会社は、信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更できるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
2. 委託会社は、前記 1. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られた

る受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

3. 前記2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一カ月を下らないものとします。
4. 前記3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、この信託約款を変更しないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前記2.に定める変更を行う場合において、前記3.の期間内に異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。なお、買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社の協議により決定するものとします。
7. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記の規定にしたがいます。

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

関係法人との契約の変更および受託会社の辞任または解任に伴う取扱い

1. 委託会社と販売会社との間の募集・販売等契約は、締結日から原則1年間とし、期間終了の3カ月前までに別段の意思表示のない時は、同一条件にて継続されます。
2. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社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「信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託事務処理の再信託

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

公告

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

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

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

運用報告書

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

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の主な権利の内容は次のとおりです。

なお、委託会社は2007年1月4日付約款変更以前の約款第7条第2項の規定に基づき、1998年12月1日付で1口当たり元本額を1万円から1円に変更するための受益権分割を実施しました。ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることによる差異を生じることはありません。

(1) 収益分配金請求権

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

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

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

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

(2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3) 一部解約請求権

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

(4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第57期計算期間(2024年3月12日から2024年9月10日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【MHAMスリーウェイオープン】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第56期 2024年3月11日現在	第57期 2024年9月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,044,555,635	1,862,771,562
国債証券	3,611,130,500	3,553,736,600
親投資信託受益証券	1,093,625,366	1,068,957,125
派生商品評価勘定	331,975	4,993,400
未収入金	-	4,868,780
未収利息	10,524,882	10,539,572
前払金	8,040,000	-
前払費用	1,193,424	1,458,903
差入委託証拠金	53,988,691	90,688,420
流動資産合計	6,823,390,473	6,598,014,362
資産合計	6,823,390,473	6,598,014,362
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	21,771,220	83,080
前受金	-	10,115,000
未払金	9,095,390	823,300
未払収益分配金	64,857,969	-
未払解約金	2,745,474	11,019,861
未払受託者報酬	3,681,751	3,668,378
未払委託者報酬	27,613,443	27,513,226
その他未払費用	55,870	55,663
流動負債合計	129,821,117	53,278,508
負債合計	129,821,117	53,278,508
純資産の部		
元本等		
元本	6,485,796,911	6,400,265,784
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	207,772,445	144,470,070
(分配準備積立金)	271,456,235	256,415,008
元本等合計	6,693,569,356	6,544,735,854
純資産合計	6,693,569,356	6,544,735,854
負債純資産合計	6,823,390,473	6,598,014,362

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第56期 自 2023年9月12日 至 2024年3月11日	第57期 自 2024年3月12日 至 2024年9月10日
営業収益		
受取利息	16,680,447	18,806,868
有価証券売買等損益	110,430,947	88,754,741
派生商品取引等損益	73,666,165	40,680,195
その他収益	10,768,777	-
営業収益合計	211,546,336	29,267,678
営業費用		
支払利息	213,100	3,276
受託者報酬	3,681,751	3,668,378
委託者報酬	27,613,443	27,513,226
その他費用	387,163	55,663
営業費用合計	31,895,457	31,240,543
営業利益又は営業損失（ ）	179,650,879	60,508,221
経常利益又は経常損失（ ）	179,650,879	60,508,221
当期純利益又は当期純損失（ ）	179,650,879	60,508,221
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（ ）	3,342,019	271,097
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	97,355,222	207,772,445
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,900,930	9,080,847
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	5,900,930	9,080,847
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,934,598	12,146,098
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,934,598	12,146,098
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	64,857,969	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	207,772,445	144,470,070

(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57期	
	自 2024年3月12日	至 2024年9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 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、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>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。</p>	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>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。</p>	
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年3月10日及び9月10日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2024年3月11日としております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第56期	第57期
	2024年3月11日現在	2024年9月10日現在
1. 期首元本額	6,642,017,901円	6,485,796,911円
期中追加設定元本額	318,215,180円	293,216,801円
期中一部解約元本額	474,436,170円	378,747,928円
2. 受益権の総数	6,485,796,911口	6,400,265,784口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第56期	第57期
	自 2023年9月12日 至 2024年3月11日	自 2024年3月12日 至 2024年9月10日
1. 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（31,864,388円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（374,821,563円）及び分配準備積立金（304,449,816円）より分配対象収益は711,135,767円（1万口当たり1,096.45円）であり、うち64,857,969円（1万口当たり100円）を分配金額としております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（413,662円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（381,980,821円）及び分配準備積立金（256,001,346円）より分配対象収益は638,395,829円（1万口当たり997.45円）ですが、分配を行っておりません。</p>

(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56期	第57期
	自 2023年9月12日 至 2024年3月11日	自 2024年3月12日 至 2024年9月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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、株価指数先物取引及び債券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、株価及び市場金利の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第56期	第57期
	2024年3月11日現在	2024年9月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

2. 時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第56期 2024年3月11日現在	第57期 2024年9月10日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	22,974,200	46,131,500
親投資信託受益証券	136,333,147	24,668,241
合計	113,358,947	70,799,741

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	第56期 2024年3月11日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	946,440,000	-	924,875,000	21,565,000
合計	946,440,000	-	924,875,000	21,565,000

種類	第57期 2024年9月10日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	509,900,000	-	514,900,000	5,000,000
合計	509,900,000	-	514,900,000	5,000,000

（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。

債券関連

種類	第56期 2024年3月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	1,018,640,000	-	1,018,780,000	140,000
合計	1,018,640,000	-	1,018,780,000	140,000

種類	第57期 2024年9月10日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	1,154,080,000	-	1,154,000,000	80,000
合計	1,154,080,000	-	1,154,000,000	80,000

（注）時価の算定方法

債券先物取引

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）

	第56期 2024年3月11日現在	第57期 2024年9月10日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0320円 (10,320円)	1.0226円 (10,226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9月10日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	151回 利付国庫債券(5年)	50,000,000	49,507,000	
	156回 利付国庫債券(5年)	600,000,000	595,830,000	
	342回 利付国庫債券(10年)	200,000,000	199,242,000	
	361回 利付国庫債券(10年)	50,000,000	48,605,500	
	364回 利付国庫債券(10年)	100,000,000	96,532,000	
	370回 利付国庫債券(10年)	150,000,000	146,995,500	
	10回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	102,926,000	
	15回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	114,939,000	
	57回 利付国庫債券(30年)	70,000,000	55,773,200	
	75回 利付国庫債券(30年)	50,000,000	42,061,000	
	77回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	90,090,000	
	80回 利付国庫債券(30年)	50,000,000	46,998,000	
	83回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	153,733,500	
	97回 利付国庫債券(20年)	100,000,000	105,379,000	
	100回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	148,696,800	
	102回 利付国庫債券(20年)	100,000,000	107,333,000	
	105回 利付国庫債券(20年)	100,000,000	106,543,000	
	141回 利付国庫債券(20年)	150,000,000	161,794,500	
	142回 利付国庫債券(20年)	100,000,000	108,645,000	

145回 利付国庫債券(20年)		100,000,000	107,863,000	
148回 利付国庫債券(20年)		60,000,000	63,490,800	
151回 利付国庫債券(20年)		10,000,000	10,243,500	
156回 利付国庫債券(20年)		100,000,000	92,605,000	
167回 利付国庫債券(20年)		100,000,000	89,133,000	
170回 利付国庫債券(20年)		100,000,000	85,077,000	
171回 利付国庫債券(20年)		120,000,000	101,536,800	
180回 利付国庫債券(20年)		150,000,000	132,042,000	
181回 利付国庫債券(20年)		100,000,000	89,202,000	
183回 利付国庫債券(20年)		50,000,000	48,177,000	
187回 利付国庫債券(20年)		50,000,000	46,824,500	
189回 利付国庫債券(20年)		200,000,000	205,918,000	
国債証券 合計		3,600,000,000	3,553,736,600	
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	234,935,632	1,068,957,125	
親投資信託受益証券 合計		234,935,632	1,068,957,125	
合計			4,622,693,725	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(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。

(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9月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,601,764,329
株式	544,009,521,970
未収配当金	267,844,476
前払金	110,255,000
差入委託証拠金	450,162,940
流動資産合計	549,439,548,715
資産合計	549,439,548,715
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	131,503,970
未払解約金	43,859,000
流動負債合計	175,362,970
負債合計	175,362,970
純資産の部	
元本等	
元本	120,716,950,133
剰余金	
剰余金又は欠損金()	428,547,235,612
元本等合計	549,264,185,745
純資産合計	549,264,185,745
負債純資産合計	549,439,548,715

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3月12日 至 2024年9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年9月10日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	119,533,482,625円
同期中追加設定元本額	22,672,216,207円
同期中一部解約元本額	21,488,748,699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	2,375,751,767円
たわらノーロード 国内株式<ラップ専用>	6,123,270,656円
One DC 国内株式インデックスファンド	33,957,083,699円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,489,969,658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)	18,464,444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)	23,787,518円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	11,462,434円
たわらノーロード TOPIX	2,973,393,812円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,917,571,270円
たわらノーロード バランス(堅実型)	50,047,517円
たわらノーロード バランス(標準型)	401,800,643円
たわらノーロード バランス(積極型)	734,429,878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)	2,395,406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)	139,734,622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)	427,766,425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)	390,886,585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)	577,272,314円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	266,212円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,167,733円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	27,345,972円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,680,763円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	15,690,430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)	49,545円
マスターズ・マルチアセット・ファンド(積極型)	439,685円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,423,370,380円
Oneグローバルバランス	86,235,754円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	873,671,001円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,205,466,724円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,886,767,109円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	243,390,431円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	849,875,717円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,012,355,819円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	25,854,132円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	971,013,845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)	258,761,892円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	324,907,981円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	572,574,471円
投資のソムリエ	5,947,063,286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>	684,396,390円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	369,279,350円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,396,106,663円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	300,385,019円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	874,419,543円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	63,103,334円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	32,758,675円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,941,909円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	154,724,734円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	582,484,036円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	98,179,798円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	228,248,027円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	61,151,635円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	35,389,571円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	21,552,121円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	692,339,894円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	5,651,037円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	1,042,539円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	29,305,874円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	41,699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)	1,986,849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)	1,964,461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)	2,656,967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)	1,158,481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)	404,731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)	5,059,678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)	92,609,788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)	1,340,606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)	85,890,626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)	359,385,111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)	4,468,050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)	363,541,380円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	102,134,834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)	2,168,588円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	20,403,479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)	29,381,715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)	3,285,101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)	3,458,466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)	31,370,493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)	58,116,551円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,433,807円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	9,213,781円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,903,301円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	77,275円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	516,872円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,500,268円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	229,636,332円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	355,849,083円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,104,567,307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)	8,612,519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)	12,745,738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)	120,370,078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)	23,810,867円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	50,709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)	110,365,407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)	6,909,262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)	25,445,504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)	53,983,653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)	114,595,179円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	15,662,108円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	6,043,047円
動的パッケージファンド<DC年金>	15,853,719円
コア資産形成ファンド	7,268,402円
MHAMトピックスファンド	779,660,229円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	43,736,527円

MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	1,762,766,017円
MHAM日本株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	2,430,887,909円
計	120,716,950,133円
2. 受益権の総数	120,716,950,133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 2024年3月12日 至 2024年9月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年9月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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9月10日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	3,298,861,679	
合計	3,298,861,679	

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2024年2月8日から2024年9月10日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2024年9月10日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	5,512,140,000	-		5,380,705,000
合計	5,512,140,000	-		5,380,705,000

（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ではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2024年9月10日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	4.5500円 (45,500円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2024年9月10日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	8,700	4,190.00	36,453,000	
ニッスイ	210,200	940.40	197,672,080	
マルハニチロ	31,100	3,094.00	96,223,400	
雪国まいたけ	17,900	998.00	17,864,200	
カネコ種苗	5,800	1,362.00	7,899,600	
サカタのタネ	23,900	3,420.00	81,738,000	
ホクト	16,800	1,809.00	30,391,200	
ホクリヨウ	1,300	982.00	1,276,600	
ショーボンドホールディングス	28,600	5,629.00	160,989,400	
ミライト・ワン	63,500	2,040.50	129,571,750	

タマホーム	13,200	3,930.00	51,876,000
サンヨーホームズ	1,000	702.00	702,000
日本アクア	3,000	846.00	2,538,000
ファーストコーポレーション	2,000	762.00	1,524,000
ベステラ	1,700	926.00	1,574,200
robot home	41,200	144.00	5,932,800
キャンディル	1,400	600.00	840,000
住石ホールディングス	29,700	946.00	28,096,200
日鉄鉱業	8,400	4,120.00	34,608,000
三井松島ホールディングス	12,600	4,565.00	57,519,000
I N P E X	635,600	1,923.00	1,222,258,800
石油資源開発	24,300	5,270.00	128,061,000
K & O エナジーグループ	9,500	3,265.00	31,017,500
リョーサン菱洋ホールディングス	29,800	2,603.00	77,569,400
ダイセキ環境ソリューション	1,500	1,021.00	1,531,500
第一カッター興業	6,000	1,490.00	8,940,000
明豊ファシリティワークス	1,700	840.00	1,428,000
安藤・間	121,800	1,124.00	136,903,200
東急建設	65,800	725.00	47,705,000
コムシスホールディングス	67,100	3,212.00	215,525,200
ビーアールホールディングス	30,800	357.00	10,995,600
高松コンストラクショングループ	15,700	2,933.00	46,048,100
東建コーポレーション	5,200	10,830.00	56,316,000
ソネック	1,000	931.00	931,000
ヤマウラ	10,700	1,122.00	12,005,400
オリエンタル白石	78,000	383.00	29,874,000
大成建設	134,800	6,451.00	869,594,800
大林組	526,000	1,856.50	976,519,000
清水建設	417,000	1,004.50	418,876,500
飛島建設	15,100	1,416.00	21,381,600
長谷工コーポレーション	135,000	1,872.00	252,720,000
松井建設	13,700	757.00	10,370,900
銭高組	500	3,480.00	1,740,000
鹿島建設	326,100	2,610.00	851,121,000
不動テトラ	10,300	2,291.00	23,597,300
大末建設	1,400	1,632.00	2,284,800
鉄建建設	10,500	2,386.00	25,053,000
西松建設	27,900	5,239.00	146,168,100
三井住友建設	109,600	383.00	41,976,800
大豊建設	5,000	3,420.00	17,100,000
佐田建設	2,100	868.00	1,822,800
ナカノフドー建設	3,600	473.00	1,702,800
奥村組	23,800	4,400.00	104,720,000
東鉄工業	18,200	3,420.00	62,244,000
イチケン	800	2,541.00	2,032,800
富士ピー・エス	2,400	441.00	1,058,400
浅沼組	54,500	694.00	37,823,000
戸田建設	198,900	993.50	197,607,150
熊谷組	24,200	3,460.00	83,732,000
北野建設	600	3,800.00	2,280,000

植木組	1,000	1,615.00	1,615,000	
矢作建設工業	20,000	1,614.00	32,280,000	
ピーエス・コンストラクション	18,600	977.00	18,172,200	
日本ハウスホールディングス	31,400	357.00	11,209,800	
大東建託	54,200	17,950.00	972,890,000	
新日本建設	20,700	1,592.00	32,954,400	
サムティホールディングス	28,700	2,618.00	75,136,600	
東亜道路工業	28,100	1,324.00	37,204,400	
日本道路	17,200	1,663.00	28,603,600	
東亜建設工業	44,300	912.00	40,401,600	
日本国土開発	41,800	487.00	20,356,600	
若築建設	5,000	3,305.00	16,525,000	
東洋建設	37,000	1,355.00	50,135,000	
五洋建設	208,500	612.00	127,602,000	
世紀東急工業	18,800	1,595.00	29,986,000	
福田組	5,500	5,270.00	28,985,000	
日本ドライケミカル	800	2,976.00	2,380,800	
住友林業	127,200	6,202.00	788,894,400	
日本基礎技術	3,100	709.00	2,197,900	
巴コーポレーション	4,100	958.00	3,927,800	
大和ハウス工業	406,800	4,561.00	1,855,414,800	
ライト工業	27,200	2,152.00	58,534,400	
積水ハウス	446,000	3,826.00	1,706,396,000	
日特建設	14,000	1,003.00	14,042,000	
北陸電気工事	10,200	1,185.00	12,087,000	
ユアテック	32,400	1,516.00	49,118,400	
日本リーテック	11,500	1,072.00	12,328,000	
四電工	6,100	3,860.00	23,546,000	
中電工	22,800	3,235.00	73,758,000	
関電工	92,200	2,265.00	208,833,000	
きんでん	102,200	3,385.00	345,947,000	
東京エネシス	13,700	1,115.00	15,275,500	
トーエネック	4,800	4,855.00	23,304,000	
住友電設	13,900	3,650.00	50,735,000	
日本電設工業	27,700	1,774.00	49,139,800	
エクシオグループ	143,800	1,597.00	229,648,600	
新日本空調	9,500	3,410.00	32,395,000	
九電工	31,700	6,552.00	207,698,400	
三機工業	31,700	2,209.00	70,025,300	
日揮ホールディングス	145,400	1,196.50	173,971,100	
中外炉工業	4,800	2,635.00	12,648,000	
ヤマト	2,600	966.00	2,511,600	
太平電業	9,100	5,350.00	48,685,000	
高砂熱学工業	39,500	5,110.00	201,845,000	
三晃金属工業	400	4,035.00	1,614,000	
NEC ネットズエスアイ	58,600	2,678.00	156,930,800	
朝日工業社	13,700	1,295.00	17,741,500	
明星工業	28,400	1,177.00	33,426,800	
大気社	16,900	4,760.00	80,444,000	
ダイダン	19,300	2,875.00	55,487,500	

日比谷総合設備	10,600	3,330.00	35,298,000
ニッポン	44,200	2,256.00	99,715,200
日清製粉グループ本社	136,600	1,938.00	264,730,800
日東富士製粉	2,400	7,080.00	16,992,000
昭和産業	14,300	2,912.00	41,641,600
鳥越製粉	2,900	675.00	1,957,500
中部飼料	20,500	1,518.00	31,119,000
フィード・ワン	21,700	826.00	17,924,200
東洋精糖	1,000	1,430.00	1,430,000
日本甜菜製糖	8,600	2,727.00	23,452,200
D M三井製糖ホールディングス	14,600	3,310.00	48,326,000
塩水港精糖	6,600	264.00	1,742,400
ウェルネオシュガー	7,400	2,190.00	16,206,000
L I F U L L	37,800	140.00	5,292,000
M I X I	33,100	2,862.00	94,732,200
ジェイエイシーリクルートメント	55,700	790.00	44,003,000
日本M&Aセンターホールディングス	245,600	638.40	156,791,040
メンバーズ	5,200	896.00	4,659,200
中広	800	518.00	414,400
U Tグループ	20,000	2,697.00	53,940,000
アイティメディア	5,800	1,636.00	9,488,800
ケアネット	31,400	638.00	20,033,200
E・Jホールディングス	9,000	1,715.00	15,435,000
オープンアップグループ	46,400	2,037.00	94,516,800
コシダカホールディングス	46,100	975.00	44,947,500
アルトナー	1,500	1,857.00	2,785,500
パソナグループ	18,700	2,203.00	41,196,100
C D S	1,400	1,834.00	2,567,600
リンクアンドモチベーション	38,100	601.00	22,898,100
エス・エム・エス	54,100	2,132.50	115,368,250
サニーサイドアップグループ	1,800	524.00	943,200
パーソルホールディングス	1,569,400	281.00	441,001,400
リニカル	3,400	398.00	1,353,200
クックパッド	42,200	192.00	8,102,400
エスクリ	2,300	241.00	554,300
アイ・ケイ・ケイホールディングス	2,500	772.00	1,930,000
森永製菓	61,800	2,959.50	182,897,100
中村屋	3,600	3,210.00	11,556,000
江崎グリコ	42,300	4,287.00	181,340,100
名糖産業	5,800	1,881.00	10,909,800
井村屋グループ	8,900	2,492.00	22,178,800
不二家	10,300	2,647.00	27,264,100
山崎製パン	98,800	2,906.50	287,162,200
第一屋製パン	1,000	649.00	649,000
モロゾフ	4,600	4,670.00	21,482,000
亀田製菓	8,400	4,695.00	39,438,000
寿スピリッツ	69,700	1,759.50	122,637,150
カルビー	67,600	3,511.00	237,343,600
森永乳業	51,500	3,555.00	183,082,500
六甲バター	10,900	1,444.00	15,739,600

ヤクルト本社	211,000	3,116.00	657,476,000
明治ホールディングス	181,000	3,717.00	672,777,000
雪印メグミルク	35,800	2,710.00	97,018,000
プリマハム	19,800	2,426.00	48,034,800
日本ハム	63,500	5,565.00	353,377,500
林兼産業	1,700	481.00	817,700
丸大食品	14,900	1,726.00	25,717,400
S Foods	16,300	2,699.00	43,993,700
柿安本店	5,700	2,591.00	14,768,700
伊藤ハム米久ホールディングス	22,500	3,915.00	88,087,500
学情	7,700	1,628.00	12,535,600
スタジオアリス	7,600	2,056.00	15,625,600
クロスキャット	9,500	1,149.00	10,915,500
エプロ	1,500	805.00	1,207,500
システナ	227,400	381.00	86,639,400
N J S	3,400	3,515.00	11,951,000
デジタルアーツ	9,500	4,375.00	41,562,500
日鉄ソリューションズ	51,300	3,655.00	187,501,500
総合警備保障	257,500	1,060.00	272,950,000
キューブシステム	7,900	1,047.00	8,271,300
いちご	150,000	360.00	54,000,000
日本駐車場開発	175,700	219.00	38,478,300
コア	6,700	1,772.00	11,872,400
カカクコム	100,000	2,590.00	259,000,000
アイロムグループ	6,200	2,776.00	17,211,200
セントケア・ホールディング	11,200	736.00	8,243,200
サイネックス	1,000	709.00	709,000
ルネサンス	12,100	1,058.00	12,801,800
ディップ	23,500	2,845.00	66,857,500
S B Sホールディングス	13,200	2,443.00	32,247,600
デジタルホールディングス	7,900	945.00	7,465,500
新日本科学	14,000	1,142.00	15,988,000
キャリアデザインセンター	600	1,916.00	1,149,600
エムスリー	304,600	1,346.50	410,143,900
ツカダ・グローバルホールディング	3,300	397.00	1,310,100
プラス	700	568.00	397,600
ウェルネット	3,000	828.00	2,484,000
ワールドホールディングス	6,100	1,913.00	11,669,300
ディー・エヌ・エー	54,700	1,643.00	89,872,100
博報堂DYホールディングス	196,600	1,228.00	241,424,800
ぐるなび	28,700	367.00	10,532,900
タカミヤ	21,100	456.00	9,621,600
ファンコミュニケーションズ	21,900	400.00	8,760,000
ライク	5,700	1,435.00	8,179,500
A o b a B B T	2,100	318.00	667,800
エスプール	44,300	360.00	15,948,000
W D Bホールディングス	7,800	1,736.00	13,540,800
手間いらず	2,500	3,470.00	8,675,000
ティア	3,700	453.00	1,676,100
C D G	600	1,677.00	1,006,200

アドウェイズ	18,800	354.00	6,655,200
バリューコマース	13,400	1,099.00	14,726,600
インフォマート	145,400	328.00	47,691,200
サッポロホールディングス	48,500	7,716.00	374,226,000
アサヒグループホールディングス	369,500	5,581.00	2,062,179,500
キリンホールディングス	615,000	2,239.00	1,376,985,000
宝ホールディングス	99,700	1,159.50	115,602,150
オエノンホールディングス	44,100	392.00	17,287,200
養命酒製造	4,800	2,283.00	10,958,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	104,200	2,192.50	228,458,500
ライフドリンク カンパニー	3,000	7,350.00	22,050,000
サントリー食品インターナショナル	104,000	5,542.00	576,368,000
ダイドーグループホールディングス	16,700	3,000.00	50,100,000
伊藤園	49,900	3,354.00	167,364,600
キーコーヒー	16,500	2,055.00	33,907,500
ユニカフェ	1,800	915.00	1,647,000
日清オイリオグループ	20,800	5,300.00	110,240,000
不二製油グループ本社	34,300	3,439.00	117,957,700
かどや製油	400	3,630.00	1,452,000
J-オイルミルズ	16,900	1,957.00	33,073,300
サンエー	24,400	2,626.00	64,074,400
カワチ薬品	12,500	2,685.00	33,562,500
エービーシー・マート	69,300	3,085.00	213,790,500
ハードオフコーポレーション	6,300	1,908.00	12,020,400
高千穂交易	6,300	3,860.00	24,318,000
アスクル	38,300	2,068.00	79,204,400
ゲオホールディングス	17,900	1,566.00	28,031,400
アダストリア	19,000	3,505.00	66,595,000
ジーフット	4,300	288.00	1,238,400
シー・ヴィ・エス・バイエリア	700	558.00	390,600
オルバヘルスケアホールディングス	1,000	1,880.00	1,880,000
伊藤忠食品	3,600	7,270.00	26,172,000
くら寿司	18,600	3,475.00	64,635,000
キャンドウ	5,600	3,365.00	18,844,000
エレマテック	14,100	1,718.00	24,223,800
IKホールディングス	1,900	357.00	678,300
パルグループホールディングス	31,100	2,411.00	74,982,100
エディオン	63,000	1,862.00	117,306,000
あらた	24,200	3,685.00	89,177,000
サーラコーポレーション	33,300	823.00	27,405,900
ワッツ	2,300	829.00	1,906,700
トーメンデバイス	2,300	5,570.00	12,811,000
ハローズ	7,300	4,125.00	30,112,500
J Pホールディングス	39,500	720.00	28,440,000
フジオフードグループ本社	17,900	1,340.00	23,986,000
あみやき亭	3,900	5,850.00	22,815,000
東京エレクトロン デバイス	15,900	3,500.00	55,650,000
ひらまつ	8,400	189.00	1,587,600
円谷フィールズホールディングス	25,600	2,005.00	51,328,000

双日	176,600	3,249.00	573,773,400
アルフレッサホールディングス	159,400	2,414.50	384,871,300
大黒天物産	4,800	12,000.00	57,600,000
ハニーズホールディングス	14,000	1,607.00	22,498,000
ファーマライズホールディングス	1,400	609.00	852,600
キッコーマン	489,200	1,633.50	799,108,200
味の素	347,100	5,456.00	1,893,777,600
ブルドックソース	7,700	1,803.00	13,883,100
キュービー	79,400	3,721.00	295,447,400
ハウス食品グループ本社	50,900	2,998.00	152,598,200
カゴメ	63,500	3,178.00	201,803,000
アリアケジャパン	14,700	4,825.00	70,927,500
ピエトロ	800	1,758.00	1,406,400
エバラ食品工業	3,500	2,789.00	9,761,500
やまみ	500	4,975.00	2,487,500
ニチレイ	67,600	4,490.00	303,524,000
横浜冷凍	39,800	1,002.00	39,879,600
東洋水産	74,700	9,273.00	692,693,100
イトアンドホールディングス	7,100	2,047.00	14,533,700
大冷	800	1,977.00	1,581,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,800	1,709.00	11,621,200
日清食品ホールディングス	155,700	3,891.00	605,828,700
一正蒲鉾	1,500	745.00	1,117,500
フジッコ	15,200	1,719.00	26,128,800
ロック・フィールド	18,000	1,464.00	26,352,000
日本たばこ産業	897,300	4,207.00	3,774,941,100
ケンコーマヨネーズ	10,300	2,245.00	23,123,500
わらべや日洋ホールディングス	9,900	2,354.00	23,304,600
なとり	9,300	2,071.00	19,260,300
イフジ産業	1,100	1,437.00	1,580,700
ファーマフーズ	19,600	950.00	18,620,000
北の達人コーポレーション	63,400	167.00	10,587,800
ユーグレナ	92,000	481.00	44,252,000
紀文食品	12,900	1,188.00	15,325,200
ピックルスホールディングス	8,700	1,011.00	8,795,700
スター・マイカ・ホールディングス	15,200	614.00	9,332,800
SREホールディングス	6,300	4,405.00	27,751,500
ADワークスグループ	8,300	201.00	1,668,300
片倉工業	13,800	1,967.00	27,144,600
ゲンゼ	10,700	5,620.00	60,134,000
ヒューリック	344,500	1,469.50	506,242,750
神栄	800	1,663.00	1,330,400
ラサ商事	7,300	1,457.00	10,636,100
アルペン	13,100	2,142.00	28,060,200
ハブ	1,700	757.00	1,286,900
ラクーンホールディングス	11,300	725.00	8,192,500
クオールホールディングス	21,900	1,430.00	31,317,000
アルコニックス	21,000	1,355.00	28,455,000
神戸物産	122,800	4,475.00	549,530,000
ソリトンシステムズ	7,700	1,061.00	8,169,700

ジーンズホールディングス	12,200	5,240.00	63,928,000
ビックカメラ	94,900	1,581.00	150,036,900
DCMホールディングス	82,100	1,475.00	121,097,500
ペッパーフードサービス	39,000	161.00	6,279,000
ハイパー	1,200	318.00	381,600
MonotaRO	224,900	2,535.00	570,121,500
東京一番フーズ	1,500	515.00	772,500
DDグループ	2,300	1,285.00	2,955,500
あいホールディングス	26,260	2,378.00	62,446,280
ディービーエックス	1,500	949.00	1,423,500
きちりホールディングス	1,500	845.00	1,267,500
J.フロントリテイリング	182,000	1,462.00	266,084,000
ドトール・日レスホールディングス	28,000	2,293.00	64,204,000
マツキヨココカラ&カンパニー	288,600	2,204.50	636,218,700
ブロンコビリー	9,300	3,675.00	34,177,500
ZOZO	101,200	4,747.00	480,396,400
トレジャー・ファクトリー	10,900	1,734.00	18,900,600
物語コーポレーション	26,600	3,480.00	92,568,000
三越伊勢丹ホールディングス	262,700	2,176.00	571,635,200
東洋紡	64,900	975.00	63,277,500
ユニチカ	48,500	290.00	14,065,000
富士紡ホールディングス	6,600	4,225.00	27,885,000
日清紡ホールディングス	113,900	913.50	104,047,650
倉敷紡績	10,600	4,640.00	49,184,000
ダイワボウホールディングス	70,200	2,779.00	195,085,800
シキボウ	10,800	1,035.00	11,178,000
日東紡績	19,000	5,220.00	99,180,000
トヨタ紡織	63,200	1,845.00	116,604,000
マクニカホールディングス	37,600	5,707.00	214,583,200
Hamee	6,500	1,149.00	7,468,500
マーケットエンタープライズ	500	843.00	421,500
ラクト・ジャパン	6,800	2,960.00	20,128,000
ウエルシアホールディングス	82,300	2,003.00	164,846,900
クリエイトSDホールディングス	22,400	3,140.00	70,336,000
グリムス	6,700	2,497.00	16,729,900
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,000	1,229.00	29,496,000
八洲電機	12,900	1,517.00	19,569,300
メディアスホールディングス	9,300	775.00	7,207,500
レスター	13,300	2,612.00	34,739,600
ジオリーブグループ	1,400	1,132.00	1,584,800
丸善CHIホールディングス	4,100	325.00	1,332,500
大光	2,800	601.00	1,682,800
OCHIホールディングス	800	1,390.00	1,112,000
TOKAIホールディングス	86,100	995.00	85,669,500
黒谷	1,600	609.00	974,400
ミサワ	1,200	620.00	744,000
ティーライフ	700	1,123.00	786,100
Cominix	1,200	894.00	1,072,800
エー・ピーホールディングス	1,400	991.00	1,387,400

三洋貿易	16,200	1,454.00	23,554,800
チムニー	1,200	1,320.00	1,584,000
シュッピン	14,300	1,169.00	16,716,700
ビューティガレージ	5,000	1,569.00	7,845,000
オイシックス・ラ・大地	21,500	1,422.00	30,573,000
ウイン・パートナーズ	10,300	1,151.00	11,855,300
ネクステージ	36,300	1,743.00	63,270,900
ジョイフル本田	44,000	2,127.00	93,588,000
エターナルホスピタリティグループ	5,800	3,045.00	17,661,000
ホットランド	12,300	2,340.00	28,782,000
すかいらーくホールディングス	216,800	2,364.50	512,623,600
SFPホールディングス	7,600	1,987.00	15,101,200
綿半ホールディングス	12,400	1,728.00	21,427,200
日本毛織	38,500	1,292.00	49,742,000
ダイトウボウ	8,100	101.00	818,100
トーア紡コーポレーション	1,800	399.00	718,200
ダイドーリミテッド	4,100	921.00	3,776,100
ヨシックスホールディングス	3,700	3,285.00	12,154,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	44,300	841.00	37,256,300
野村不動産ホールディングス	82,200	4,069.00	334,471,800
三重交通グループホールディングス	31,600	490.00	15,484,000
ディア・ライフ	25,100	908.00	22,790,800
コーセーアールイー	1,600	636.00	1,017,600
地主	11,300	1,992.00	22,509,600
プレサンスコーポレーション	19,500	1,890.00	36,855,000
フィル・カンパニー	2,300	608.00	1,398,400
THEグローバル社	3,400	612.00	2,080,800
ハウスコム	800	1,024.00	819,200
JPMC	8,500	1,111.00	9,443,500
サンセイランディック	1,500	967.00	1,450,500
エストラスト	600	686.00	411,600
フージャースホールディングス	22,600	1,032.00	23,323,200
オープンハウスグループ	54,200	5,673.00	307,476,600
東急不動産ホールディングス	444,100	997.70	443,078,570
飯田グループホールディングス	141,500	2,282.50	322,973,750
イーグランド	700	1,469.00	1,028,300
ムゲンエステート	2,500	1,485.00	3,712,500
帝国繊維	17,000	2,694.00	45,798,000
日本コークス工業	152,400	96.00	14,630,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,200	402.00	2,894,400
ミタチ産業	1,500	1,099.00	1,648,500
BEENOS	9,400	2,441.00	22,945,400
あさひ	14,600	1,580.00	23,068,000
日本調剤	10,400	1,244.00	12,937,600
コスモス薬品	26,600	7,419.00	197,345,400
シップヘルスケアホールディングス	57,100	2,126.00	121,394,600
トーエル	1,600	829.00	1,326,400
ソフトクリエイイトホールディングス	12,500	1,706.00	21,325,000
セブン&アイ・ホールディングス	1,606,800	2,182.00	3,506,037,600

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	107,400	1,053.00	113,092,200	
明治電機工業	5,900	1,458.00	8,602,200	
ツルハホールディングス	33,300	8,840.00	294,372,000	
デリカフーズホールディングス	2,400	566.00	1,358,400	
スターティアホールディングス	1,000	2,010.00	2,010,000	
サンマルクホールディングス	12,800	2,083.00	26,662,400	
フェリシモ	1,300	906.00	1,177,800	
トリドールホールディングス	44,400	3,532.00	156,820,800	
帝人	144,300	1,352.50	195,165,750	
東レ	1,006,500	746.30	751,150,950	
クラレ	218,800	1,837.50	402,045,000	
旭化成	1,016,300	1,029.00	1,045,772,700	
TOKYO BASE	16,900	233.00	3,937,700	
稲葉製作所	8,600	1,724.00	14,826,400	
宮地エンジニアリンググループ	7,600	4,190.00	31,844,000	
トーカコ	44,700	1,728.00	77,241,600	
アルファ	1,400	1,198.00	1,677,200	
SUMCO	294,600	1,470.00	433,062,000	
川田テクノロジーズ	11,000	2,580.00	28,380,000	
RS Technologies	11,900	3,210.00	38,199,000	
ジェイテックコーポレーション	1,000	1,496.00	1,496,000	
信和	2,200	762.00	1,676,400	
ピーロット	2,000	969.00	1,938,000	
ファーストブラザーズ	1,000	1,112.00	1,112,000	
And Doホールディングス	8,900	1,027.00	9,140,300	
シーアールイー	6,700	1,383.00	9,266,100	
ケイアイスター不動産	7,200	3,885.00	27,972,000	
アグレ都市デザイン	1,000	1,480.00	1,480,000	
グッドコムアセット	12,100	841.00	10,176,100	
ジェイ・エス・ビー	6,100	2,862.00	17,458,200	
ロードスターキャピタル	8,400	2,252.00	18,916,800	
テンポイノベーション	1,600	924.00	1,478,400	
グローバル・リンク・マネジメント	600	2,186.00	1,311,600	
フェイスネットワーク	1,000	1,497.00	1,497,000	
霞ヶ関キャピタル	6,000	13,490.00	80,940,000	
住江織物	700	2,067.00	1,446,900	
日本フェルト	2,800	488.00	1,366,400	
イチカワ	700	1,615.00	1,130,500	
エコナックホールディングス	4,800	113.00	542,400	
日東製網	500	1,452.00	726,000	
芦森工業	700	2,190.00	1,533,000	
アツギ	2,300	749.00	1,722,700	
ウイルプラスホールディングス	1,200	1,153.00	1,383,600	
JMホールディングス	12,100	3,070.00	37,147,000	
コメダホールディングス	38,800	2,717.00	105,419,600	
サツドラホールディングス	2,200	802.00	1,764,400	
アレンザホールディングス	12,100	1,058.00	12,801,800	
串カツ田中ホールディングス	4,300	1,454.00	6,252,200	
パロックジャパンリミテッド	12,400	760.00	9,424,000	

クスリのアオキホールディングス	47,800	3,328.00	159,078,400	
ダイニック	1,600	767.00	1,227,200	
共和レザー	1,900	673.00	1,278,700	
ピーバンドットコム	800	368.00	294,400	
力の源ホールディングス	9,100	1,152.00	10,483,200	
FOOD & LIFE COMPANIES	84,600	2,606.00	220,467,600	
アセンテック	6,100	545.00	3,324,500	
セーレン	29,000	2,503.00	72,587,000	
ソトー	1,600	702.00	1,123,200	
東海染工	500	774.00	387,000	
小松マテーレ	21,900	751.00	16,446,900	
ワコールホールディングス	27,900	4,358.00	121,588,200	
ホギメディカル	17,700	4,370.00	77,349,000	
クラウドシアホールディングス	1,400	355.00	497,000	
T S Iホールディングス	45,100	896.00	40,409,600	
マツオカコーポレーション	1,100	1,720.00	1,892,000	
ワールド	21,300	1,918.00	40,853,400	
T I S	159,100	3,546.00	564,168,600	
テクミラホールディングス	2,300	341.00	784,300	
グリー	50,300	446.00	22,433,800	
GMOペパボ	1,900	1,359.00	2,582,100	
コーエーテックモホールディングス	94,200	1,587.50	149,542,500	
三菱総合研究所	7,300	4,080.00	29,784,000	
ボルテージ	1,500	229.00	343,500	
電算	600	1,401.00	840,600	
A G S	1,500	843.00	1,264,500	
ファインデックス	12,000	869.00	10,428,000	
ブレインパッド	12,600	859.00	10,823,400	
K L a b	36,000	191.00	6,876,000	
ポールトゥウィンホールディングス	25,700	412.00	10,588,400	
ネクソン	330,100	2,716.50	896,716,650	
アイスタイル	50,200	529.00	26,555,800	
エムアップホールディングス	18,400	1,273.00	23,423,200	
エイチーム	10,100	650.00	6,565,000	
エニグモ	19,200	326.00	6,259,200	
テクノスジャパン	3,000	673.00	2,019,000	
e n i s h	5,100	184.00	938,400	
コロプラ	51,100	561.00	28,667,100	
オルトプラス	4,800	103.00	494,400	
ブロードリーフ	60,300	687.00	41,426,100	
クロス・マーケティンググループ	2,400	709.00	1,701,600	
デジタルハーツホールディングス	9,400	812.00	7,632,800	
メディアドゥ	6,900	1,418.00	9,784,200	
じげん	43,800	581.00	25,447,800	
ブイキューブ	18,000	206.00	3,708,000	
エンカレッジ・テクノロジー	1,400	602.00	842,800	
サイバーリンクス	2,000	754.00	1,508,000	
ディー・エル・イー	3,600	117.00	421,200	
フィックスターズ	15,000	1,472.00	22,080,000	

CARTA HOLDINGS	8,500	1,343.00	11,415,500
オブティム	15,600	611.00	9,531,600
セレス	6,000	1,266.00	7,596,000
SHIFT	10,100	11,765.00	118,826,500
特種東海製紙	8,100	3,700.00	29,970,000
ティーガイア	15,800	3,840.00	60,672,000
セック	2,100	4,160.00	8,736,000
テクマトリックス	27,500	2,357.00	64,817,500
プロシップ	7,300	1,428.00	10,424,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	37,400	3,034.00	113,471,600
GMOペイメントゲートウェイ	34,300	8,833.00	302,971,900
ザッパラス	1,300	355.00	461,500
システムリサーチ	10,300	1,445.00	14,883,500
インターネットイニシアティブ	72,000	2,932.00	211,104,000
さくらインターネット	16,800	3,755.00	63,084,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,400	2,754.00	12,117,600
SRAホールディングス	7,600	4,330.00	32,908,000
システムインテグレータ	1,500	320.00	480,000
朝日ネット	16,200	659.00	10,675,800
eBASE	21,300	583.00	12,417,900
アバントグループ	19,000	2,071.00	39,349,000
アドソル日進	6,300	1,734.00	10,924,200
ODKソリューションズ	1,200	583.00	699,600
フリービット	6,600	1,225.00	8,085,000
コムチュア	21,800	1,545.00	33,681,000
アステリア	11,900	529.00	6,295,100
アイル	8,400	2,795.00	23,478,000
王子ホールディングス	625,400	574.90	359,542,460
日本製紙	84,700	906.00	76,738,200
三菱製紙	4,400	541.00	2,380,400
北越コーポレーション	74,000	1,435.00	106,190,000
中越パルプ工業	1,400	1,299.00	1,818,600
巴川コーポレーション	1,500	764.00	1,146,000
大王製紙	66,200	861.90	57,057,780
阿波製紙	1,500	463.00	694,500
マークライnz	8,900	2,995.00	26,655,500
メディカル・データ・ビジョン	17,900	513.00	9,182,700
gumi	24,400	303.00	7,393,200
ショーケース	1,300	272.00	353,600
モバイルファクトリー	1,200	782.00	938,400
テラスカイ	6,600	2,185.00	14,421,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	7,700	2,006.00	15,446,200
PCIホールディングス	1,500	1,112.00	1,668,000
アイビーシー	800	532.00	425,600
ネオジャパン	5,000	1,779.00	8,895,000
PR TIMES	3,100	1,720.00	5,332,000
ラクス	71,100	2,257.50	160,508,250

ランドコンピュータ	2,500	790.00	1,975,000
ダブルスタンダード	4,400	1,514.00	6,661,600
オープンドア	8,800	693.00	6,098,400
マイネット	1,600	352.00	563,200
アカツキ	7,300	2,014.00	14,702,200
ベネフィットジャパン	300	1,110.00	333,000
Ubicomホールディングス	4,700	1,375.00	6,462,500
カナミックネットワーク	18,800	559.00	10,509,200
ノムラシステムコーポレーション	5,400	114.00	615,600
レンゴー	136,600	997.00	136,190,200
トーモク	8,600	2,366.00	20,347,600
ザ・バック	11,200	3,685.00	41,272,000
チェンジホールディングス	32,800	1,252.00	41,065,600
シンクロ・フード	3,200	510.00	1,632,000
オークネット	7,000	2,253.00	15,771,000
キャピタル・アセット・プランニング	1,100	816.00	897,600
セグエグループ	3,100	653.00	2,024,300
エイトレッド	800	1,585.00	1,268,000
マクロミル	29,500	758.00	22,361,000
ピーグリー	1,200	1,359.00	1,630,800
オロ	6,300	2,478.00	15,611,400
ユーザーローカル	6,300	1,933.00	12,177,900
テモナ	1,300	206.00	267,800
ニーズウェル	3,600	312.00	1,123,200
マネーフォワード	36,700	5,546.00	203,538,200
サインポスト	2,000	508.00	1,016,000
レゾナック・ホールディングス	134,800	3,080.00	415,184,000
住友化学	1,114,700	390.60	435,401,820
住友精化	7,100	5,220.00	37,062,000
日産化学	70,100	4,935.00	345,943,500
ラサ工業	5,700	2,490.00	14,193,000
クレハ	31,000	2,676.00	82,956,000
多木化学	5,800	3,845.00	22,301,000
テイカ	12,400	1,637.00	20,298,800
石原産業	24,900	1,463.00	36,428,700
片倉コープアグリ	1,300	996.00	1,294,800
日本曹達	17,800	4,940.00	87,932,000
東ソー	200,500	1,851.50	371,225,750
トクヤマ	48,500	2,587.50	125,493,750
セントラル硝子	16,100	3,395.00	54,659,500
東亜合成	72,200	1,589.50	114,761,900
大阪ソーダ	10,500	8,860.00	93,030,000
関東電化工業	29,000	899.00	26,071,000
SUN ASTERISK	10,700	565.00	6,045,500
デンカ	54,600	2,183.00	119,191,800
イビデン	79,000	4,188.00	330,852,000
信越化学工業	1,347,000	5,573.00	7,506,831,000
日本カーパイド工業	7,200	1,669.00	12,016,800
プラスアルファ・コンサルティング	18,900	2,136.00	40,370,400
電算システムホールディングス	6,700	2,614.00	17,513,800

堺化学工業	11,500	2,562.00	29,463,000
第一稀元素化学工業	16,400	809.00	13,267,600
エア・ウォーター	141,700	2,002.50	283,754,250
日本酸素ホールディングス	145,600	5,083.00	740,084,800
日本化学工業	5,500	2,695.00	14,822,500
東邦アセチレン	3,500	337.00	1,179,500
日本パーカライジング	66,900	1,200.00	80,280,000
高压ガス工業	22,000	884.00	19,448,000
チタン工業	600	854.00	512,400
四国化成ホールディングス	16,900	1,936.00	32,718,400
戸田工業	3,500	1,755.00	6,142,500
ステラ ケミファ	8,000	4,035.00	32,280,000
保土谷化学工業	4,700	4,670.00	21,949,000
日本触媒	87,400	1,669.00	145,870,600
大日精化工業	10,500	2,967.00	31,153,500
カネカ	37,000	3,718.00	137,566,000
協和キリン	181,600	3,198.00	580,756,800
A P P I E R G R O U P	45,700	1,694.00	77,415,800
三菱瓦斯化学	109,600	2,582.50	283,042,000
三井化学	123,900	3,792.00	469,828,800
東京応化工業	71,700	3,153.00	226,070,100
大阪有機化学工業	12,700	2,865.00	36,385,500
三菱ケミカルグループ	1,098,200	900.00	988,380,000
K H ネオケム	27,100	2,017.00	54,660,700
ビジョナル	17,700	9,230.00	163,371,000
ダイセル	186,400	1,269.50	236,634,800
住友ベークライト	42,100	3,694.00	155,517,400
積水化学工業	299,100	2,226.00	665,796,600
日本ゼオン	103,000	1,276.50	131,479,500
アイカ工業	38,000	3,326.00	126,388,000
U B E	71,500	2,541.00	181,681,500
積水樹脂	22,300	2,288.00	51,022,400
タキロンシーアイ	38,300	869.00	33,282,700
旭有機材	10,100	3,860.00	38,986,000
ニチパン	8,100	1,939.00	15,705,900
リケンテクノス	28,000	972.00	27,216,000
大倉工業	7,100	2,543.00	18,055,300
積水化成品工業	21,300	401.00	8,541,300
群栄化学工業	3,600	2,700.00	9,720,000
タイガースポリマー	2,300	769.00	1,768,700
ミライアル	1,200	1,338.00	1,605,600
ダイキアクシス	2,000	712.00	1,424,000
ダイキョーニシカワ	33,100	651.00	21,548,100
竹本容器	1,900	821.00	1,559,900
森六ホールディングス	7,700	2,240.00	17,248,000
恵和	9,700	1,039.00	10,078,300
日本化薬	114,700	1,277.00	146,471,900
カーリット	16,200	1,044.00	16,912,800
ソルクシーズ	4,300	291.00	1,251,300
C L ホールディングス	3,700	933.00	3,452,100

プレステージ・インターナショナル	72,200	746.00	53,861,200	
フェイス	1,300	399.00	518,700	
プロトコーポレーション	16,400	1,404.00	23,025,600	
ハイマックス	4,400	1,304.00	5,737,600	
アミューズ	9,300	1,413.00	13,140,900	
野村総合研究所	325,700	5,206.00	1,695,594,200	
ドリームインキュベータ	5,200	2,257.00	11,736,400	
クイック	10,700	2,060.00	22,042,000	
T A C	2,300	166.00	381,800	
C Eホールディングス	2,400	473.00	1,135,200	
日本システム技術	13,900	1,901.00	26,423,900	
電通グループ	166,600	4,261.00	709,882,600	
インテージホールディングス	17,000	1,550.00	26,350,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,700	865.00	5,795,500	
東邦システムサイエンス	6,300	1,454.00	9,160,200	
ぴあ	5,100	3,020.00	15,402,000	
イオンファンタジー	5,500	2,237.00	12,303,500	
ソースネクスト	68,900	202.00	13,917,800	
シーティーエス	19,600	830.00	16,268,000	
N E X Y Z . G r o u p	1,600	733.00	1,172,800	
メディカルシステムネットワーク	17,200	442.00	7,602,400	
日本精化	10,100	2,245.00	22,674,500	
扶桑化学工業	16,000	3,670.00	58,720,000	
トリケミカル研究所	18,200	3,140.00	57,148,000	
シンプレクス・ホールディングス	22,900	2,451.00	56,127,900	
H E R O Z	5,900	1,050.00	6,195,000	
ラクスル	36,400	1,200.00	43,680,000	
メルカリ	73,400	2,465.00	180,931,000	
I P S	4,400	2,183.00	9,605,200	
F I G	5,800	350.00	2,030,000	
システムサポート	5,800	2,066.00	11,982,800	
A D E K A	52,400	2,898.00	151,855,200	
日油	136,100	2,206.50	300,304,650	
ミヨシ油脂	1,400	1,550.00	2,170,000	
新日本理化	7,000	185.00	1,295,000	
ハリマ化成グループ	10,600	850.00	9,010,000	
イーソル	10,200	725.00	7,395,000	
東海ソフト	800	1,222.00	977,600	
ウイングアーク1 s t	15,700	2,921.00	45,859,700	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	5,000	859.00	4,295,000	
サーバーワークス	3,100	2,842.00	8,810,200	
東名	1,000	1,427.00	1,427,000	
ヴィッツ	500	783.00	391,500	
トビラシステムズ	1,500	778.00	1,167,000	
S a n s a n	49,300	2,346.00	115,657,800	
L i n k - Uグループ	1,100	494.00	543,400	
ギフトィ	13,200	1,141.00	15,061,200	
花王	365,700	7,017.00	2,566,116,900	
第一工業製薬	6,000	2,925.00	17,550,000	

石原ケミカル	6,700	2,196.00	14,713,200	
日華化学	1,400	1,266.00	1,772,400	
ニイタカ	1,100	1,850.00	2,035,000	
三洋化成工業	9,200	4,080.00	37,536,000	
メドレー	16,500	3,340.00	55,110,000	
ベース	7,400	3,200.00	23,680,000	
J M D C	25,600	4,454.00	114,022,400	
武田薬品工業	1,331,300	4,267.00	5,680,657,100	
アステラス製薬	1,319,300	1,791.00	2,362,866,300	
住友ファーマ	111,400	573.00	63,832,200	
塩野義製薬	183,000	6,475.00	1,184,925,000	
わかもと製薬	5,300	244.00	1,293,200	
日本新薬	39,500	3,436.00	135,722,000	
中外製薬	470,900	6,584.00	3,100,405,600	
科研製薬	25,700	4,034.00	103,673,800	
エーザイ	183,000	5,718.00	1,046,394,000	
理研ビタミン	12,800	2,590.00	33,152,000	
ロート製薬	145,600	3,648.00	531,148,800	
小野薬品工業	307,600	1,941.50	597,205,400	
久光製薬	33,400	4,040.00	134,936,000	
有機合成薬品工業	4,200	268.00	1,125,600	
持田製薬	16,800	3,245.00	54,516,000	
参天製薬	265,400	1,812.00	480,904,800	
扶桑薬品工業	5,300	2,214.00	11,734,200	
日本ケミファ	600	1,604.00	962,400	
ツムラ	47,400	3,941.00	186,803,400	
テルモ	836,000	2,597.50	2,171,510,000	
H . U . グループホールディングス	45,100	2,610.50	117,733,550	
キッセイ薬品工業	24,900	3,555.00	88,519,500	
生化学工業	25,400	812.00	20,624,800	
栄研化学	25,900	2,350.00	60,865,000	
鳥居薬品	8,000	3,620.00	28,960,000	
J C R ファーマ	50,900	644.00	32,779,600	
東和薬品	23,000	2,920.00	67,160,000	
富士製薬工業	11,100	1,270.00	14,097,000	
ゼリア新薬工業	21,000	2,264.00	47,544,000	
ネクスラファーマ	70,600	1,283.00	90,579,800	
第一三共	1,310,300	5,275.00	6,911,832,500	
杏林製薬	32,600	1,534.00	50,008,400	
大幸薬品	31,300	411.00	12,864,300	
ダイト	11,500	2,315.00	26,622,500	
大塚ホールディングス	375,400	8,156.00	3,061,762,400	
ペプチドリーム	72,900	2,550.00	185,895,000	
大日本塗料	16,600	1,091.00	18,110,600	
日本ペイントホールディングス	664,800	870.60	578,774,880	
関西ペイント	129,800	2,708.00	351,498,400	
神東塗料	4,600	129.00	593,400	
中国塗料	30,800	1,970.00	60,676,000	
日本特殊塗料	2,400	1,195.00	2,868,000	
藤倉化成	17,400	464.00	8,073,600	

太陽ホールディングス	26,100	3,565.00	93,046,500
D I C	53,400	3,128.00	167,035,200
サカティンクス	33,300	1,557.00	51,848,100
a r t i e n c e	27,000	3,795.00	102,465,000
アルプス技研	13,300	2,735.00	36,375,500
サニックス	24,700	269.00	6,644,300
日本空調サービス	16,500	1,075.00	17,737,500
オリエンタルランド	815,800	3,935.00	3,210,173,000
フォーカスシステムズ	10,100	1,129.00	11,402,900
ダスキン	33,700	3,959.00	133,418,300
パーク24	115,100	1,774.00	204,187,400
明光ネットワークジャパン	18,700	686.00	12,828,200
ファルコホールディングス	6,900	2,359.00	16,277,100
クレスコ	24,700	1,258.00	31,072,600
フジ・メディア・ホールディングス	144,600	1,754.50	253,700,700
秀英予備校	1,300	271.00	352,300
田谷	1,100	357.00	392,700
ラウンドワン	145,300	983.00	142,829,900
リゾートトラスト	66,900	2,890.50	193,374,450
オービック	50,300	25,360.00	1,275,608,000
ジャストシステム	21,700	3,520.00	76,384,000
T D C ソフト	28,100	1,170.00	32,877,000
L I N E ヤフー	2,141,500	398.30	852,959,450
ビー・エム・エル	18,900	2,686.00	50,765,400
トレンドマイクロ	79,000	8,544.00	674,976,000
I D ホールディングス	10,200	1,360.00	13,872,000
リソー教育	78,800	246.00	19,384,800
日本オラクル	28,800	13,435.00	386,928,000
早稲田アカデミー	8,500	1,570.00	13,345,000
アルファシステムズ	4,000	2,828.00	11,312,000
フューチャー	37,500	1,820.00	68,250,000
C A C H o l d i n g s	9,200	1,725.00	15,870,000
トーセ	1,500	628.00	942,000
ユー・エス・エス	345,900	1,386.50	479,590,350
オービックビジネスコンサルタント	21,300	7,363.00	156,831,900
アイティフォー	19,200	1,330.00	25,536,000
東京個別指導学院	18,400	405.00	7,452,000
東計電算	4,200	4,570.00	19,194,000
サイバーエージェント	340,600	1,042.00	354,905,200
楽天グループ	1,084,800	947.70	1,028,064,960
エクスネット	700	1,454.00	1,017,800
クリーク・アンド・リバー社	7,600	1,446.00	10,989,600
S B I グローバルアセットマネジメント	30,300	597.00	18,089,100
テー・オー・ダブリュー	30,400	315.00	9,576,000
大塚商会	170,600	3,559.00	607,165,400
サイボウズ	20,700	1,601.00	33,140,700
山田コンサルティンググループ	6,800	2,332.00	15,857,600
セントラルスポーツ	5,600	2,499.00	13,994,400
パラカ	4,600	1,812.00	8,335,200

電通総研	14,600	5,820.00	84,972,000
A C C E S S	15,700	1,744.00	27,380,800
デジタルガレージ	24,000	2,897.00	69,528,000
イーエムシステムズ	25,000	528.00	13,200,000
ウェザーニューズ	4,600	5,630.00	25,898,000
C I J	37,500	421.00	15,787,500
ビジネスエンジニアリング	3,200	4,125.00	13,200,000
日本エンタープライズ	5,000	117.00	585,000
WOWOW	11,400	1,063.00	12,118,200
スカラ	13,700	465.00	6,370,500
インテリジェント ウェイブ	1,800	905.00	1,629,000
フルキャストホールディングス	12,700	1,560.00	19,812,000
エン・ジャパン	25,000	2,455.00	61,375,000
セルソース	10,100	1,397.00	14,109,700
あすか製薬ホールディングス	15,500	2,206.00	34,193,000
サワイグループホールディングス	34,300	6,296.00	215,952,800
富士フイルムホールディングス	837,200	3,810.00	3,189,732,000
コニカミノルタ	338,300	415.50	140,563,650
資生堂	314,000	3,199.00	1,004,486,000
ライオン	191,300	1,547.50	296,036,750
高砂香料工業	11,300	4,970.00	56,161,000
マンダム	32,500	1,229.00	39,942,500
ミルボン	24,100	3,002.00	72,348,200
ファンケル	65,900	2,800.00	184,520,000
コーセー	30,700	8,084.00	248,178,800
コタ	15,200	1,618.00	24,593,600
シーボン	700	1,302.00	911,400
ポーラ・オルビスホールディングス	77,100	1,424.00	109,790,400
ノエビアホールディングス	13,200	5,420.00	71,544,000
アジュバンホールディングス	1,300	820.00	1,066,000
新日本製薬	8,600	1,811.00	15,574,600
I - n e	5,000	1,825.00	9,125,000
アクシージア	9,900	729.00	7,217,100
エステー	11,600	1,517.00	17,597,200
アグロ カネショウ	5,300	1,298.00	6,879,400
コニシ	43,400	1,249.00	54,206,600
長谷川香料	28,700	2,945.00	84,521,500
小林製薬	39,400	5,545.00	218,473,000
荒川化学工業	12,900	1,211.00	15,621,900
メック	12,500	3,450.00	43,125,000
日本高純度化学	3,400	3,095.00	10,523,000
タカラバイオ	40,400	988.00	39,915,200
J C U	16,600	3,360.00	55,776,000
新田ゼラチン	2,300	899.00	2,067,700
O A T アグリオ	5,500	1,955.00	10,752,500
デクセリアルズ	37,100	5,837.00	216,552,700
アース製薬	13,500	5,310.00	71,685,000
北興化学工業	13,300	1,259.00	16,744,700
大成ラミック	4,300	2,685.00	11,545,500
クマイ化学工業	59,700	795.00	47,461,500

日本農薬	27,600	591.00	16,311,600
富士興産	1,100	1,493.00	1,642,300
ニチレキ	19,600	2,456.00	48,137,600
ユシロ化学工業	7,700	1,556.00	11,981,200
ピーピー・カストロール	2,000	867.00	1,734,000
富士石油	43,800	362.00	15,855,600
MORESCO	1,300	1,218.00	1,583,400
出光興産	780,900	1,005.50	785,194,950
ENEOSホールディングス	2,381,300	747.30	1,779,545,490
コスモエネルギーホールディングス	44,600	7,527.00	335,704,200
ANYCOLOR	21,400	2,311.00	49,455,400
テスホールディングス	31,600	280.00	8,848,000
インフロニア・ホールディングス	169,600	1,190.00	201,824,000
横浜ゴム	76,000	3,117.00	236,892,000
TOYO TIRE	86,500	2,037.00	176,200,500
ブリヂストン	440,300	5,375.00	2,366,612,500
住友ゴム工業	147,500	1,506.50	222,208,750
藤倉コンポジット	14,400	1,198.00	17,251,200
オカモト	7,200	5,200.00	37,440,000
アキレス	9,500	1,527.00	14,506,500
フコク	7,800	1,709.00	13,330,200
ニッタ	15,200	3,675.00	55,860,000
クリエートメディック	1,600	953.00	1,524,800
住友理工	23,300	1,487.00	34,647,100
三ツ星ベルト	17,500	3,980.00	69,650,000
バンドー化学	22,200	1,791.00	39,760,200
AGC	146,200	4,403.00	643,718,600
日本板硝子	71,900	339.00	24,374,100
石塚硝子	600	2,480.00	1,488,000
有沢製作所	26,300	1,456.00	38,292,800
日本山村硝子	1,300	1,493.00	1,940,900
日本電気硝子	55,800	3,227.00	180,066,600
オハラ	7,200	1,354.00	9,748,800
住友大阪セメント	25,000	3,772.00	94,300,000
太平洋セメント	86,100	3,026.00	260,538,600
リソルホールディングス	300	4,580.00	1,374,000
日本ヒューム	13,200	1,292.00	17,054,400
日本コンクリート工業	29,200	351.00	10,249,200
三谷セキサン	6,300	5,630.00	35,469,000
アジアパイルホールディングス	21,500	822.00	17,673,000
東海カーボン	138,700	840.10	116,521,870
日本カーボン	8,600	4,290.00	36,894,000
東洋炭素	10,600	5,070.00	53,742,000
ノリタケ	16,600	3,745.00	62,167,000
TOTO	99,300	4,800.00	476,640,000
日本碍子	174,900	1,849.50	323,477,550
日本特殊陶業	125,900	4,024.00	506,621,600
ダントーホールディングス	1,200	401.00	481,200
MARUWA	5,500	35,200.00	193,600,000
品川リフラクトリーズ	18,500	1,691.00	31,283,500

黒崎播磨	12,400	2,082.00	25,816,800
ヨータイ	9,300	1,724.00	16,033,200
東京窯業	3,600	411.00	1,479,600
ニッカトー	2,400	522.00	1,252,800
フジインコーポレーテッド	40,300	2,181.00	87,894,300
クニミネ工業	1,500	1,057.00	1,585,500
エーアンドエーマテリアル	1,200	1,196.00	1,435,200
ニチアス	38,100	5,150.00	196,215,000
日本製鉄	720,500	3,021.00	2,176,630,500
神戸製鋼所	311,200	1,666.00	518,459,200
中山製鋼所	35,500	787.00	27,938,500
合同製鐵	8,600	4,225.00	36,335,000
JFEホールディングス	430,400	1,886.00	811,734,400
東京製鐵	43,500	1,891.00	82,258,500
共英製鋼	17,700	1,670.00	29,559,000
大和工業	29,200	7,065.00	206,298,000
東京鐵鋼	6,900	5,100.00	35,190,000
大阪製鐵	7,200	3,300.00	23,760,000
淀川製鋼所	16,100	5,460.00	87,906,000
中部鋼鈹	10,300	2,271.00	23,391,300
丸一鋼管	47,200	3,396.00	160,291,200
モリ工業	3,600	5,260.00	18,936,000
大同特殊鋼	97,500	1,349.00	131,527,500
日本高周波鋼業	2,000	391.00	782,000
日本冶金工業	11,300	4,390.00	49,607,000
山陽特殊製鋼	15,300	1,842.00	28,182,600
愛知製鋼	8,900	3,285.00	29,236,500
日本金属	1,500	638.00	957,000
ミガロホールディングス	1,500	2,119.00	3,178,500
大平洋金属	13,200	1,301.00	17,173,200
新日本電工	92,500	284.00	26,270,000
栗本鐵工所	7,200	4,110.00	29,592,000
虹技	700	1,037.00	725,900
日本鑄鉄管	600	1,211.00	726,600
日本製鋼所	41,700	4,160.00	173,472,000
三菱製鋼	11,500	1,305.00	15,007,500
日亜鋼業	5,700	291.00	1,658,700
日本精線	12,600	1,075.00	13,545,000
エンビプロ・ホールディングス	13,700	482.00	6,603,400
大紀アルミニウム工業所	19,700	1,067.00	21,019,900
日本輕金属ホールディングス	45,400	1,543.00	70,052,200
三井金属鋳業	45,100	4,380.00	197,538,000
東邦亜鉛	10,100	863.00	8,716,300
三菱マテリアル	110,500	2,376.50	262,603,250
住友金属鋳山	179,500	3,533.00	634,173,500
DOWAホールディングス	38,200	4,774.00	182,366,800
古河機械金属	20,400	1,577.00	32,170,800
エス・サイエンス	32,700	24.00	784,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	26,900	2,335.00	62,811,500
東邦チタニウム	32,000	1,034.00	33,088,000

U A C J	21,800	5,100.00	111,180,000
C Kサンエツ	2,800	3,330.00	9,324,000
古河電気工業	51,400	3,159.00	162,372,600
住友電気工業	578,700	2,289.00	1,324,644,300
フジクラ	182,400	3,867.00	705,340,800
S W C C	17,400	5,210.00	90,654,000
カナレ電気	1,000	1,394.00	1,394,000
平河ヒューテック	9,900	1,430.00	14,157,000
いよぎんホールディングス	175,800	1,356.50	238,472,700
しずおかフィナンシャルグループ	325,300	1,275.00	414,757,500
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	124,400	1,487.50	185,045,000
楽天銀行	68,600	3,180.00	218,148,000
京都フィナンシャルグループ	186,000	2,186.00	406,596,000
リョービ	16,400	1,920.00	31,488,000
アーレスティ	3,700	583.00	2,157,100
A R E ホールディングス	58,100	1,827.00	106,148,700
東洋製罐グループホールディングス	88,800	2,280.00	202,464,000
ホッカンホールディングス	7,500	1,650.00	12,375,000
コロナ	8,600	924.00	7,946,400
横河ブリッジホールディングス	24,100	2,601.00	62,684,100
駒井ハルテック	1,000	1,639.00	1,639,000
高田機工	400	3,540.00	1,416,000
三和ホールディングス	154,200	3,417.00	526,901,400
文化シャッター	40,400	1,639.00	66,215,600
三協立山	19,500	718.00	14,001,000
アルインコ	11,900	980.00	11,662,000
東洋シャッター	1,300	800.00	1,040,000
L I X I L	241,700	1,713.00	414,032,100
日本フィルコン	3,400	514.00	1,747,600
ノーリツ	21,900	1,893.00	41,456,700
長府製作所	17,400	2,005.00	34,887,000
リンナイ	74,100	3,444.00	255,200,400
ユニプレス	27,000	1,111.00	29,997,000
ダイニチ工業	2,500	619.00	1,547,500
日東精工	22,400	544.00	12,185,600
三洋工業	600	3,310.00	1,986,000
岡部	27,700	746.00	20,664,200
ジーテクト	19,700	1,594.00	31,401,800
東プレ	27,300	1,794.00	48,976,200
高周波熱錬	22,900	1,002.00	22,945,800
東京製綱	10,100	1,054.00	10,645,400
サンコール	15,700	369.00	5,793,300
モリテックスチール	4,700	189.00	888,300
パイオラックス	18,700	2,325.00	43,477,500
エイチワン	16,100	887.00	14,280,700
日本発条	136,800	1,712.50	234,270,000
中央発條	11,500	1,150.00	13,225,000
アドパネクス	600	937.00	562,200
三浦工業	63,300	3,445.00	218,068,500
タクマ	51,200	1,559.00	79,820,800

テクノプロ・ホールディングス	89,500	2,958.00	264,741,000	
アトラグループ	1,600	137.00	219,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	7,900	922.00	7,283,800	
KeepEr 技研	9,500	4,040.00	38,380,000	
ファーストロジック	1,600	609.00	974,400	
三機サービス	1,000	983.00	983,000	
Gunosy	12,300	891.00	10,959,300	
デザインワン・ジャパン	1,600	125.00	200,000	
イー・ガーディアン	7,400	1,856.00	13,734,400	
リブセンス	2,400	172.00	412,800	
ジャパンマテリアル	47,300	1,661.00	78,565,300	
ベクトル	18,400	916.00	16,854,400	
ウチヤマホールディングス	2,300	332.00	763,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	12,900	1,385.00	17,866,500	
キャリアリンク	5,600	2,521.00	14,117,600	
IBJ	12,000	693.00	8,316,000	
アサンテ	7,600	1,664.00	12,646,400	
バリューHR	13,300	1,598.00	21,253,400	
M&Aキャピタルパートナーズ	12,600	2,170.00	27,342,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,100	1,001.00	6,106,100	
E R Iホールディングス	1,100	1,977.00	2,174,700	
アビスト	500	3,430.00	1,715,000	
シグマクシス・ホールディングス	20,200	1,490.00	30,098,000	
ウィルグループ	12,900	928.00	11,971,200	
エスクロー・エージェント・ジャパン	6,500	136.00	884,000	
メドピア	12,400	603.00	7,477,200	
レアジョブ	1,100	390.00	429,000	
リクルートホールディングス	1,110,300	8,522.00	9,461,976,600	
エラン	20,400	840.00	17,136,000	
ツガミ	32,400	1,445.00	46,818,000	
オークマ	13,200	5,593.00	73,827,600	
芝浦機械	14,200	3,635.00	51,617,000	
アマダ	229,500	1,445.50	331,742,250	
アイダエンジニアリング	35,000	780.00	27,300,000	
F U J I	71,300	2,238.50	159,605,050	
牧野フライス製作所	16,700	5,440.00	90,848,000	
オーエスジー	66,700	1,953.50	130,298,450	
ダイジェット工業	500	740.00	370,000	
旭ダイヤモンド工業	34,900	830.00	28,967,000	
D M G 森精機	95,500	3,104.00	296,432,000	
ソディック	39,900	747.00	29,805,300	
ディスコ	73,000	33,630.00	2,454,990,000	
日東工器	7,300	2,381.00	17,381,300	
日進工具	14,000	747.00	10,458,000	
パンチ工業	3,300	420.00	1,386,000	
富士ダイス	10,200	765.00	7,803,000	
土木管理総合試験所	2,500	307.00	767,500	
日本郵政	1,611,500	1,401.50	2,258,517,250	

ベルシステム24ホールディングス	16,500	1,543.00	25,459,500
鎌倉新書	13,200	404.00	5,332,800
S MN	1,100	306.00	336,600
一蔵	700	544.00	380,800
グローバルキッズCOMPANY	1,100	747.00	821,700
エアトリ	11,300	1,190.00	13,447,000
アトラエ	11,700	784.00	9,172,800
ストライク	7,600	4,610.00	35,036,000
ソラスト	42,500	564.00	23,970,000
セラク	4,700	1,383.00	6,500,100
インソース	33,400	1,072.00	35,804,800
豊田自動織機	127,800	10,660.00	1,362,348,000
豊和工業	1,800	783.00	1,409,400
石川製作所	1,000	1,352.00	1,352,000
リケンNPR	16,400	2,319.00	38,031,600
東洋機械金属	2,800	645.00	1,806,000
津田駒工業	1,000	366.00	366,000
エンシュウ	1,300	625.00	812,500
島精機製作所	24,000	1,324.00	31,776,000
オプトラン	24,900	1,649.00	41,060,100
イワキ	10,200	2,709.00	27,631,800
フリー	14,200	1,030.00	14,626,000
ヤマシンフィルタ	36,100	444.00	16,028,400
日阪製作所	16,500	1,090.00	17,985,000
やまびこ	24,800	2,232.00	55,353,600
野村マイクロ・サイエンス	20,500	2,361.00	48,400,500
平田機工	7,300	4,725.00	34,492,500
PEGASUS	16,700	475.00	7,932,500
マルマエ	6,700	1,436.00	9,621,200
タツモ	10,800	2,722.00	29,397,600
ナブテスコ	95,000	2,293.00	217,835,000
三井海洋開発	19,200	2,680.00	51,456,000
レオン自動機	17,600	1,330.00	23,408,000
S MC	45,400	58,760.00	2,667,704,000
ホソカワミクロン	10,600	4,105.00	43,513,000
ユニオンツール	6,700	5,700.00	38,190,000
瑞光	10,900	1,187.00	12,938,300
オイレス工業	20,500	2,059.00	42,209,500
日精エー・エス・ビー機械	5,100	4,680.00	23,868,000
サトーホールディングス	20,700	1,915.00	39,640,500
技研製作所	14,200	1,753.00	24,892,600
日本エアータック	7,100	1,141.00	8,101,100
カワタ	1,600	866.00	1,385,600
日精樹脂工業	11,300	930.00	10,509,000
オカダアイヨン	1,200	2,115.00	2,538,000
ワイエイシイホールディングス	6,500	2,007.00	13,045,500
小松製作所	710,000	3,658.00	2,597,180,000
住友重機械工業	89,500	3,238.00	289,801,000
日立建機	60,200	3,383.00	203,656,600
日工	22,500	683.00	15,367,500

巴工業	5,900	3,965.00	23,393,500
井関農機	14,200	981.00	13,930,200
TOWA	16,800	5,880.00	98,784,000
丸山製作所	600	2,530.00	1,518,000
北川鉄工所	5,900	1,236.00	7,292,400
シンニッタン	6,800	213.00	1,448,400
ローツェ	78,000	1,797.00	140,166,000
タカキタ	1,800	439.00	790,200
クボタ	791,900	2,008.00	1,590,135,200
荏原実業	7,300	3,680.00	26,864,000
東洋エンジニアリング	21,700	675.00	14,647,500
三菱化工機	5,300	3,390.00	17,967,000
月島ホールディングス	20,500	1,282.00	26,281,000
帝国電機製作所	10,400	2,567.00	26,696,800
東京機械製作所	1,500	360.00	540,000
新東工業	30,700	971.00	29,809,700
澁谷工業	14,200	3,405.00	48,351,000
アイチコーポレーション	21,000	1,143.00	24,003,000
小森コーポレーション	37,200	1,113.00	41,403,600
鶴見製作所	11,600	3,640.00	42,224,000
日本ギア工業	1,900	438.00	832,200
酒井重工業	2,600	4,405.00	11,453,000
荏原製作所	310,900	1,751.00	544,385,900
石井鐵工所	600	8,350.00	5,010,000
西島製作所	13,100	2,602.00	34,086,200
北越工業	15,200	1,798.00	27,329,600
ダイキン工業	180,700	16,925.00	3,058,347,500
オルガノ	18,200	6,270.00	114,114,000
トーヨーカネツ	5,100	3,955.00	20,170,500
栗田工業	84,700	5,493.00	465,257,100
椿本チエイン	20,800	5,600.00	116,480,000
大同工業	1,500	751.00	1,126,500
日機装	38,700	988.00	38,235,600
木村化工機	11,600	693.00	8,038,800
レイズネクスト	21,400	1,615.00	34,561,000
アネスト岩田	23,300	1,250.00	29,125,000
ダイフク	255,700	2,557.50	653,952,750
サムコ	3,600	3,470.00	12,492,000
加藤製作所	1,700	1,197.00	2,034,900
油研工業	600	2,184.00	1,310,400
タダノ	87,100	933.50	81,307,850
フジテック	35,300	4,690.00	165,557,000
CKD	41,900	2,596.00	108,772,400
平和	44,800	2,119.00	94,931,200
理想科学工業	12,200	3,455.00	42,151,000
SANKYO	145,700	2,140.50	311,870,850
日本金銭機械	18,300	942.00	17,238,600
マースグループホールディングス	7,600	3,595.00	27,322,000
フクシマガリレイ	9,900	5,220.00	51,678,000
オーイズミ	2,000	382.00	764,000

ダイコク電機	7,400	3,375.00	24,975,000
竹内製作所	27,500	4,150.00	114,125,000
アマノ	43,000	4,242.00	182,406,000
J U K I	23,300	392.00	9,133,600
サンデン	7,600	144.00	1,094,400
ジャノメ	15,200	817.00	12,418,400
ブラザー工業	202,300	2,791.50	564,720,450
マックス	21,400	3,560.00	76,184,000
モリタホールディングス	26,300	1,957.00	51,469,100
グローリー	36,400	2,623.00	95,477,200
新晃工業	15,200	4,725.00	71,820,000
大和冷機工業	23,100	1,474.00	34,049,400
セガサミーホールディングス	135,200	2,884.00	389,916,800
T P R	19,200	2,227.00	42,758,400
ツバキ・ナカシマ	37,400	673.00	25,170,200
ホシザキ	97,600	4,549.00	443,982,400
大豊工業	13,200	602.00	7,946,400
日本精工	280,300	713.70	200,050,110
N T N	328,400	255.00	83,742,000
ジェイテクト	134,900	1,076.00	145,152,400
不二越	11,200	3,010.00	33,712,000
ミネベアミツミ	263,400	2,636.00	694,322,400
日本トムソン	41,200	473.00	19,487,600
T H K	87,400	2,490.00	217,626,000
ユーシン精機	12,200	624.00	7,612,800
前澤給装工業	10,900	1,295.00	14,115,500
イーグル工業	16,700	2,008.00	33,533,600
前澤工業	2,100	1,286.00	2,700,600
P I L L A R	14,000	3,975.00	55,650,000
キッツ	50,700	979.00	49,635,300
日立製作所	3,639,500	3,300.00	12,010,350,000
三菱電機	1,659,100	2,232.00	3,703,111,200
富士電機	92,200	7,486.00	690,209,200
東洋電機製造	1,300	1,056.00	1,372,800
安川電機	164,600	4,352.00	716,339,200
シンフォニア テクノロジー	16,700	4,360.00	72,812,000
明電舎	28,000	3,045.00	85,260,000
オリジン	1,300	1,193.00	1,550,900
山洋電気	6,600	9,430.00	62,238,000
デンヨー	11,600	2,400.00	27,840,000
PHCホールディングス	28,300	1,110.00	31,413,000
KOKUSAI ELECTRIC	79,000	3,155.00	249,245,000
ソシオネクスト	110,200	2,755.00	303,601,000
ベイカレント	113,200	4,830.00	546,756,000
Orchestra Holdings	3,400	856.00	2,910,400
アイモバイル	19,600	461.00	9,035,600
キャリアインデックス	1,700	180.00	306,000
MS - Japan	6,300	1,001.00	6,306,300
船場	1,200	1,171.00	1,405,200

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	49,800	2,808.00	139,838,400	
フルテック	800	1,132.00	905,600	
グリーンズ	1,300	1,725.00	2,242,500	
ツナググループ・ホールディングス	1,500	694.00	1,041,000	
GAMEWITH	2,200	204.00	448,800	
MS&Consulting	700	521.00	364,700	
エル・ティー・エス	1,800	1,639.00	2,950,200	
ミダックホールディングス	9,300	1,668.00	15,512,400	
キュービーネットホールディングス	8,900	1,081.00	9,620,900	
オープングループ	21,200	204.00	4,324,800	
三櫻工業	22,900	744.00	17,037,600	
マキタ	172,700	4,593.00	793,211,100	
東芝テック	19,400	3,355.00	65,087,000	
芝浦メカトロニクス	8,600	7,430.00	63,898,000	
マブチモーター	66,500	2,165.50	144,005,750	
ニデック	334,400	5,694.00	1,904,073,600	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,600	379.00	3,638,400	
トレックス・セミコンダクター	7,700	1,505.00	11,588,500	
東光高岳	9,100	1,766.00	16,070,600	
ダブル・スコープ	43,300	400.00	17,320,000	
宮越ホールディングス	6,800	1,812.00	12,321,600	
ダイヘン	14,300	6,160.00	88,088,000	
ヤーマン	29,400	836.00	24,578,400	
JVCケンウッド	119,500	1,309.00	156,425,500	
ミマキエンジニアリング	14,300	1,492.00	21,335,600	
I-PEX	8,400	1,523.00	12,793,200	
大崎電気工業	33,100	715.00	23,666,500	
オムロン	115,700	5,757.00	666,084,900	
日東工業	20,400	3,065.00	62,526,000	
IDEC	22,300	2,506.00	55,883,800	
正興電機製作所	1,700	1,226.00	2,084,200	
不二電機工業	1,300	1,030.00	1,339,000	
ジーエス・ユアサコーポレーション	59,000	2,886.50	170,303,500	
サクサ	800	2,342.00	1,873,600	
メルコホールディングス	4,700	3,720.00	17,484,000	
テクノメディカ	3,600	1,890.00	6,804,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	5,600	602.00	3,371,200	
日本電気	198,800	12,550.00	2,494,940,000	
富士通	1,393,800	2,788.00	3,885,914,400	
沖電気工業	68,500	956.00	65,486,000	
電気興業	6,100	2,012.00	12,273,200	
サンケン電気	14,000	6,435.00	90,090,000	
ナカヨ	800	1,138.00	910,400	
アイホン	8,000	2,868.00	22,944,000	
ルネサスエレクトロニクス	1,154,100	2,115.50	2,441,498,550	
セイコーエプソン	194,400	2,589.00	503,301,600	
ワコム	106,500	653.00	69,544,500	
アルバック	33,100	7,316.00	242,159,600	

アクセル	6,900	1,281.00	8,838,900
E I Z O	11,100	4,360.00	48,396,000
ジャパンディスプレイ	651,400	22.00	14,330,800
日本信号	34,400	943.00	32,439,200
京三製作所	31,500	498.00	15,687,000
能美防災	20,500	2,596.00	53,218,000
ホーチキ	11,300	1,898.00	21,447,400
星和電機	2,300	518.00	1,191,400
エレコム	36,300	1,436.00	52,126,800
パナソニック ホールディングス	1,789,300	1,213.50	2,171,315,550
シャープ	255,400	899.20	229,655,680
アンリツ	106,700	1,081.50	115,396,050
富士通ゼネラル	42,900	1,958.50	84,019,650
ソニーグループ	1,050,200	13,195.00	13,857,389,000
T D K	239,800	8,938.00	2,143,332,400
帝国通信工業	6,700	2,404.00	16,106,800
タムラ製作所	60,200	593.00	35,698,600
アルプスアルパイン	135,200	1,474.50	199,352,400
池上通信機	1,600	684.00	1,094,400
日本電波工業	18,100	1,055.00	19,095,500
鈴木	8,000	1,583.00	12,664,000
メイコー	15,000	5,640.00	84,600,000
日本トリム	3,400	3,590.00	12,206,000
フォスター電機	11,200	1,576.00	17,651,200
S M K	3,900	2,229.00	8,693,100
ヨコオ	13,200	1,579.00	20,842,800
ティアック	7,900	85.00	671,500
ホシデン	34,400	2,079.00	71,517,600
ヒロセ電機	22,000	18,385.00	404,470,000
日本航空電子工業	36,300	2,450.00	88,935,000
T O A	17,200	929.00	15,978,800
マクセル	33,300	1,801.00	59,973,300
古野電気	19,700	1,638.00	32,268,600
スミダコーポレーション	20,300	897.00	18,209,100
アイコム	5,800	2,686.00	15,578,800
リオン	6,200	1,997.00	12,381,400
横河電機	165,700	3,525.00	584,092,500
新電元工業	5,700	2,361.00	13,457,700
アズビル	103,200	4,690.00	484,008,000
東亜ディーケーケー	1,600	847.00	1,355,200
日本光電工業	124,700	1,978.00	246,656,600
チノー	6,200	2,164.00	13,416,800
共和電業	4,700	425.00	1,997,500
日本電子材料	9,200	2,271.00	20,893,200
堀場製作所	28,400	8,654.00	245,773,600
アドバンテスト	429,700	5,899.00	2,534,800,300
小野測器	2,100	569.00	1,194,900
エスベック	12,100	2,400.00	29,040,000
キーエンス	150,100	63,470.00	9,526,847,000
日置電機	7,800	8,110.00	63,258,000

シスメックス	388,400	2,710.00	1,052,564,000	
日本マイクロニクス	24,800	3,700.00	91,760,000	
メガチップス	11,600	5,150.00	59,740,000	
OBARA GROUP	9,400	3,870.00	36,378,000	
IMAGICA GROUP	14,900	481.00	7,166,900	
澤藤電機	600	1,052.00	631,200	
デンソー	1,237,400	2,028.00	2,509,447,200	
原田工業	2,300	547.00	1,258,100	
コーセル	16,100	1,165.00	18,756,500	
イリソ電子工業	13,700	2,513.00	34,428,100	
オブテックスグループ	27,600	1,657.00	45,733,200	
千代田インテグレ	5,200	3,640.00	18,928,000	
レーザーテック	68,800	22,010.00	1,514,288,000	
スタンレー電気	96,000	2,781.50	267,024,000	
ウシオ電機	66,200	2,040.00	135,048,000	
岡谷電機産業	3,900	236.00	920,400	
ヘリオス テクノ ホールディング	3,300	909.00	2,999,700	
エノモト	1,000	1,393.00	1,393,000	
日本セラミック	13,700	2,463.00	33,743,100	
遠藤照明	1,500	1,286.00	1,929,000	
古河電池	11,100	1,380.00	15,318,000	
山一電機	13,300	2,418.00	32,159,400	
図研	12,600	3,285.00	41,391,000	
日本電子	37,600	5,465.00	205,484,000	
カシオ計算機	108,300	1,160.00	125,628,000	
ファナック	725,700	3,800.00	2,757,660,000	
日本シイエムケイ	35,100	396.00	13,899,600	
エンプラス	4,400	6,010.00	26,444,000	
大真空	22,200	593.00	13,164,600	
ローム	271,800	1,534.00	416,941,200	
浜松ホトニクス	120,300	3,454.00	415,516,200	
三井ハイテック	66,000	933.70	61,624,200	
新光電気工業	53,100	5,465.00	290,191,500	
京セラ	931,900	1,691.50	1,576,308,850	
協栄産業	500	2,291.00	1,145,500	
太陽誘電	73,000	2,984.50	217,868,500	
村田製作所	1,339,500	2,700.50	3,617,319,750	
双葉電子工業	28,900	503.00	14,536,700	
日東電工	95,200	11,155.00	1,061,956,000	
北陸電気工業	1,300	1,340.00	1,742,000	
東海理化電機製作所	42,300	1,923.00	81,342,900	
ニチコン	39,400	951.00	37,469,400	
日本ケミコン	16,000	1,073.00	17,168,000	
KOA	22,600	1,182.00	26,713,200	
三井E&S	75,000	1,168.00	87,600,000	
日立造船	133,700	945.00	126,346,500	
三菱重工業	2,648,800	1,696.50	4,493,689,200	
川崎重工業	122,300	4,507.00	551,206,100	
IHI	112,800	6,250.00	705,000,000	
名村造船所	46,700	1,483.00	69,256,100	

サノヤスホールディングス	7,300	165.00	1,204,500
スプリックス	1,600	792.00	1,267,200
マネジメントソリューションズ	6,700	1,189.00	7,966,300
プロレド・パートナーズ	3,800	530.00	2,014,000
and factory	1,500	273.00	409,500
テノ・ホールディングス	700	415.00	290,500
フロンティア・マネジメント	3,900	1,143.00	4,457,700
ピアラ	1,100	273.00	300,300
コプロ・ホールディングス	1,200	1,530.00	1,836,000
ギークス	700	422.00	295,400
アンビスホールディングス	33,000	1,808.00	59,664,000
カーブスホールディングス	42,100	767.00	32,290,700
フォーラムエンジニアリング	21,100	989.00	20,867,900
FAST FITNESS JAPAN	5,200	1,267.00	6,588,400
Mac bee Planet	4,300	2,921.00	12,560,300
日本車輛製造	4,900	2,106.00	10,319,400
三菱ロジスネクスト	23,900	1,210.00	28,919,000
近畿車輛	700	1,408.00	985,600
一家ホールディングス	1,500	700.00	1,050,000
フルサト・マルカホールディングス	12,800	2,201.00	28,172,800
ヤマエグループホールディングス	13,900	1,988.00	27,633,200
ジャパングラフトホールディングス	4,300	140.00	602,000
F P G	52,700	2,156.00	113,621,200
島根銀行	1,500	509.00	763,500
じもとホールディングス	4,400	290.00	1,276,000
全国保証	38,600	5,670.00	218,862,000
めぶきフィナンシャルグループ	684,300	562.10	384,645,030
ジャパンインベストメントアドバイザー	23,900	1,112.00	26,576,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,900	4,280.00	80,892,000
九州フィナンシャルグループ	285,900	679.70	194,326,230
かんぼ生命保険	150,400	2,641.50	397,281,600
ゆうちょ銀行	1,623,100	1,359.50	2,206,604,450
あんしん保証	2,400	186.00	446,400
富山第一銀行	46,900	1,114.00	52,246,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	785,700	794.50	624,238,650
ジェイリース	9,900	1,354.00	13,404,600
西日本フィナンシャルホールディングス	82,800	1,636.00	135,460,800
イントラスト	1,900	713.00	1,354,700
日本モーゲージサービス	2,600	407.00	1,058,200
C A S A	2,000	808.00	1,616,000
S B I アルヒ	14,100	832.00	11,731,200
プレミアグループ	25,000	2,079.00	51,975,000
日産自動車	1,973,200	402.50	794,213,000
いすゞ自動車	421,100	2,043.00	860,307,300
トヨタ自動車	7,971,700	2,499.50	19,925,264,150
日野自動車	225,600	414.50	93,511,200

三菱自動車工業	585,000	397.00	232,245,000
エフテック	2,300	516.00	1,186,800
レシップホールディングス	2,200	587.00	1,291,400
G M B	1,100	1,150.00	1,265,000
ファルテック	1,100	460.00	506,000
武蔵精密工業	36,700	1,927.00	70,720,900
日産車体	15,200	947.00	14,394,400
新明和工業	43,200	1,274.00	55,036,800
極東開発工業	24,800	2,637.00	65,397,600
トピー工業	12,300	1,961.00	24,120,300
ティラド	3,400	3,550.00	12,070,000
曙ブレーキ工業	91,500	130.00	11,895,000
タチエス	27,700	1,900.00	52,630,000
N O K	58,300	2,329.00	135,780,700
フタバ産業	40,100	677.00	27,147,700
カヤバ	14,100	4,515.00	63,661,500
市光工業	27,100	415.00	11,246,500
大同メタル工業	29,300	481.00	14,093,300
プレス工業	59,800	578.00	34,564,400
ミクニ	4,200	343.00	1,440,600
太平洋工業	34,300	1,373.00	47,093,900
河西工業	7,900	151.00	1,192,900
アイシン	105,900	4,861.00	514,779,900
マツダ	496,100	1,091.00	541,245,100
今仙電機製作所	2,100	565.00	1,186,500
本田技研工業	3,553,300	1,486.50	5,281,980,450
スズキ	1,101,800	1,529.50	1,685,203,100
S U B A R U	465,100	2,511.00	1,167,866,100
安永	2,200	583.00	1,282,600
ヤマハ発動機	648,100	1,213.00	786,145,300
小糸製作所	155,300	1,998.50	310,367,050
T B K	5,500	292.00	1,606,000
エクセディ	24,600	3,015.00	74,169,000
ミツバ	28,000	922.00	25,816,000
豊田合成	43,000	2,422.00	104,146,000
愛三工業	24,900	1,422.00	35,407,800
盟和産業	700	1,120.00	784,000
日本プラスト	4,400	369.00	1,623,600
ヨロズ	14,000	1,060.00	14,840,000
エフ・シー・シー	26,600	2,397.00	63,760,200
新家工業	700	4,830.00	3,381,000
シマノ	65,500	25,765.00	1,687,607,500
テイ・エス テック	53,400	1,804.00	96,333,600
三十三フィナンシャルグループ	13,200	1,697.00	22,400,400
第四北越フィナンシャルグループ	23,100	4,895.00	113,074,500
ひろぎんホールディングス	210,200	1,105.00	232,271,000
マーキュリアホールディングス	1,500	854.00	1,281,000
おきなわフィナンシャルグループ	12,700	2,358.00	29,946,600
ダイレクトマーケティングミックス	16,000	257.00	4,112,000
ポピンズ	2,300	1,474.00	3,390,200

LITALICO	12,100	1,233.00	14,919,300
コンフィデンス・インターワークス	500	1,761.00	880,500
十六フィナンシャルグループ	19,000	4,055.00	77,045,000
北國フィナンシャルホールディングス	14,400	4,635.00	66,744,000
ネットプロテクションズホールディングス	49,100	294.00	14,435,400
プロクレアホールディングス	16,900	1,794.00	30,318,600
FPパートナー	6,600	2,738.00	18,070,800
あいちフィナンシャルグループ	30,400	2,399.00	72,929,600
ジャムコ	8,000	1,271.00	10,168,000
小野建	16,100	1,484.00	23,892,400
はるやまホールディングス	2,500	579.00	1,447,500
南陽	1,500	1,049.00	1,573,500
ノジマ	46,000	1,830.00	84,180,000
佐鳥電機	11,100	1,869.00	20,745,900
カップ・クリエイト	24,900	1,720.00	42,828,000
エコートレーディング	1,100	918.00	1,009,800
伯東	9,100	4,685.00	42,633,500
コンドーテック	12,300	1,203.00	14,796,900
中山福	3,100	375.00	1,162,500
ライトオン	4,000	352.00	1,408,000
ナガイレーベン	20,000	2,506.00	50,120,000
三菱食品	14,600	5,130.00	74,898,000
良品計画	189,000	2,708.00	511,812,000
パリミキホールディングス	4,400	355.00	1,562,000
松田産業	12,200	3,095.00	37,759,000
第一興商	61,400	1,696.50	104,165,100
メディバルホールディングス	161,300	2,673.00	431,154,900
アドヴァングループ	13,400	906.00	12,140,400
SPK	7,100	2,001.00	14,207,100
萩原電気ホールディングス	6,900	3,455.00	23,839,500
アルビス	5,100	2,748.00	14,014,800
アズワン	49,100	2,862.00	140,524,200
スズデン	5,400	1,853.00	10,006,200
尾家産業	800	2,016.00	1,612,800
シモジマ	10,700	1,298.00	13,888,600
ドウシシャ	14,600	2,157.00	31,492,200
小津産業	1,300	1,641.00	2,133,300
コナカ	6,200	240.00	1,488,000
高速	9,500	2,358.00	22,401,000
ハウスオブローゼ	700	1,485.00	1,039,500
G-7ホールディングス	17,400	1,574.00	27,387,600
たけびし	5,900	2,369.00	13,977,100
イオン北海道	47,000	916.00	43,052,000
コジマ	30,800	925.00	28,490,000
ヒマラヤ	2,000	888.00	1,776,000
コーナン商事	19,500	3,775.00	73,612,500
ネットワンシステムズ	58,500	3,644.00	213,174,000
エコス	5,900	2,087.00	12,313,300
ワタミ	16,700	857.00	14,311,900

マルシェ	1,900	205.00	389,500	
リックス	3,600	2,819.00	10,148,400	
システムソフト	53,400	61.00	3,257,400	
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	320,500	3,737.00	1,197,708,500	
丸文	14,100	1,037.00	14,621,700	
西松屋チェーン	31,100	2,527.00	78,589,700	
ゼンショーホールディングス	80,700	7,640.00	616,548,000	
ハビネット	13,300	4,045.00	53,798,500	
幸楽苑ホールディングス	11,900	1,224.00	14,565,600	
ハークスレイ	1,600	742.00	1,187,200	
橋本総業ホールディングス	6,100	1,190.00	7,259,000	
日本ライフライン	42,500	1,178.00	50,065,000	
サイゼリヤ	23,400	5,190.00	121,446,000	
タカショー	13,800	468.00	6,458,400	
V Tホールディングス	61,300	484.00	29,669,200	
アルゴグラフィックス	13,700	5,250.00	71,925,000	
魚力	5,500	2,463.00	13,546,500	
I D O M	42,000	1,060.00	44,520,000	
日本エム・ディ・エム	12,100	725.00	8,772,500	
ポブラ	1,500	208.00	312,000	
フジ・コーポレーション	7,500	2,110.00	15,825,000	
ユナイテッドアローズ	18,600	2,228.00	41,440,800	
進和	9,700	2,555.00	24,783,500	
エスケイジャパン	1,400	740.00	1,036,000	
ダイトロン	7,000	2,589.00	18,123,000	
ハイデイ日高	23,500	2,662.00	62,557,000	
シークス	22,500	1,054.00	23,715,000	
京都きもの友禅ホールディングス	3,100	93.00	288,300	
コロワイド	68,300	1,730.00	118,159,000	
田中商事	1,600	670.00	1,072,000	
オーハシテクニカ	8,300	1,768.00	14,674,400	
壱番屋	62,800	1,027.00	64,495,600	
白銅	4,400	2,445.00	10,758,000	
トップカルチャー	2,100	150.00	315,000	
P L A N T	1,300	1,582.00	2,056,600	
スギホールディングス	95,800	2,545.00	243,811,000	
ダイコー通産	600	1,175.00	705,000	
薬王堂ホールディングス	7,600	2,549.00	19,372,400	
島津製作所	199,200	4,591.00	914,527,200	
J M S	13,800	500.00	6,900,000	
クボテック	1,500	203.00	304,500	
長野計器	10,900	2,452.00	26,726,800	
ブイ・テクノロジー	7,800	2,527.00	19,710,600	
スター精密	25,500	1,868.00	47,634,000	
東京計器	11,500	2,541.00	29,221,500	
愛知時計電機	6,600	2,000.00	13,200,000	
インターアクション	9,000	1,194.00	10,746,000	
オーバル	4,400	373.00	1,641,200	
東京精密	30,800	6,906.00	212,704,800	

マニー	60,000	1,863.50	111,810,000
ニコン	216,700	1,426.50	309,122,550
トプコン	72,900	1,460.50	106,470,450
オリンパス	858,600	2,529.50	2,171,828,700
理研計器	21,300	3,745.00	79,768,500
S C R E E Nホールディングス	51,300	9,886.00	507,151,800
キヤノン電子	14,200	2,196.00	31,183,200
タムロン	20,600	4,475.00	92,185,000
H O Y A	295,200	19,015.00	5,613,228,000
シード	3,100	512.00	1,587,200
ノーリツ鋼機	14,100	4,290.00	60,489,000
A & Dホロンホールディングス	22,000	2,176.00	47,872,000
朝日インテック	182,800	2,740.00	500,872,000
キヤノン	748,000	4,825.00	3,609,100,000
リコー	376,000	1,495.00	562,120,000
シチズン時計	137,900	912.00	125,764,800
リズム	800	3,825.00	3,060,000
大研医器	2,900	525.00	1,522,500
メニコン	51,500	1,307.50	67,336,250
シンシア	600	393.00	235,800
K Y O R I T S U	7,400	161.00	1,191,400
中本パックス	1,200	1,595.00	1,914,000
パラマウントベッドホールディングス	31,100	2,470.00	76,817,000
トランザクション	9,900	2,035.00	20,146,500
粧美堂	1,500	566.00	849,000
ニホンフラッシュ	14,100	904.00	12,746,400
前田工織	26,000	1,676.00	43,576,000
永大産業	6,100	220.00	1,342,000
アートネイチャー	13,400	794.00	10,639,600
フルヤ金属	14,100	3,795.00	53,509,500
バンダイナムコホールディングス	407,100	3,254.00	1,324,703,400
アイフィスジャパン	1,500	565.00	847,500
S H O E I	42,200	2,194.00	92,586,800
フランスベッドホールディングス	19,300	1,210.00	23,353,000
マーベラス	24,300	590.00	14,337,000
パイロットコーポレーション	23,400	4,516.00	105,674,400
萩原工業	10,100	1,464.00	14,786,400
エイベックス	25,500	1,471.00	37,510,500
フジシールインターナショナル	30,500	2,323.00	70,851,500
タカラトミー	68,300	3,680.00	251,344,000
広済堂ホールディングス	48,500	488.00	23,668,000
エステールホールディングス	1,300	633.00	822,900
レック	19,300	1,217.00	23,488,100
タカノ	1,300	849.00	1,103,700
三光合成	18,900	539.00	10,187,100
プロネクサス	15,700	1,236.00	19,405,200
ホクシン	4,000	105.00	420,000
ウッドワン	1,800	788.00	1,418,400
きもと	8,400	242.00	2,032,800
T O P P A Nホールディングス	178,700	4,281.00	765,014,700

大日本印刷	155,500	5,180.00	805,490,000	
共同印刷	4,200	3,330.00	13,986,000	
N I S S H A	25,600	1,916.00	49,049,600	
光村印刷	400	1,515.00	606,000	
藤森工業	12,000	4,360.00	52,320,000	
ヴィア・ホールディングス	8,100	108.00	874,800	
TAKARA & COMPANY	8,800	2,720.00	23,936,000	
前澤化成工業	9,700	1,759.00	17,062,300	
未来工業	5,300	3,365.00	17,834,500	
アシックス	553,700	2,689.00	1,488,899,300	
ツツミ	3,600	2,163.00	7,786,800	
ウェーブロックホールディングス	2,000	610.00	1,220,000	
J S P	10,600	1,922.00	20,373,200	
ニチハ	18,800	3,465.00	65,142,000	
ローランド	11,100	3,705.00	41,125,500	
エフピコ	28,400	2,874.50	81,635,800	
小松ウオール工業	6,100	2,989.00	18,232,900	
ヤマハ	91,300	3,540.00	323,202,000	
河合楽器製作所	4,400	2,730.00	12,012,000	
クリナップ	14,700	714.00	10,495,800	
ビジョン	95,500	1,566.50	149,600,750	
天馬	10,100	2,511.00	25,361,100	
キングジム	13,200	853.00	11,259,600	
象印マホービン	44,800	1,706.00	76,428,800	
リンテック	30,200	3,185.00	96,187,000	
信越ポリマー	32,500	1,503.00	48,847,500	
東リ	7,400	370.00	2,738,000	
イトーキ	29,900	1,441.00	43,085,900	
任天堂	946,900	7,695.00	7,286,395,500	
三菱鉛筆	21,400	2,425.00	51,895,000	
松風	6,800	4,850.00	32,980,000	
タカラスタANDARD	30,800	1,553.00	47,832,400	
コクヨ	74,900	2,535.50	189,908,950	
ナカバヤシ	16,200	524.00	8,488,800	
ニフコ	45,000	3,575.00	160,875,000	
立川ブラインド工業	7,100	1,274.00	9,045,400	
グローブライド	13,300	1,830.00	24,339,000	
オカムラ	45,200	2,011.00	90,897,200	
バルカー	12,700	3,355.00	42,608,500	
MUTOHホールディングス	700	2,405.00	1,683,500	
伊藤忠商事	1,066,700	7,572.00	8,077,052,400	
丸紅	1,316,200	2,263.00	2,978,560,600	
スクロール	23,500	944.00	22,184,000	
高島	2,400	1,302.00	3,124,800	
ヨンドシーホールディングス	15,000	1,856.00	27,840,000	
三陽商会	7,200	2,361.00	16,999,200	
長瀬産業	70,900	3,127.00	221,704,300	
ナイガイ	1,800	233.00	419,400	
蝶理	10,100	3,470.00	35,047,000	
豊田通商	416,900	2,524.00	1,052,255,600	

オンワードホールディングス	88,600	536.00	47,489,600	
三共生興	22,000	578.00	12,716,000	
兼松	66,200	2,450.00	162,190,000	
美津濃	14,900	9,150.00	136,335,000	
ツカモトコーポレーション	800	1,210.00	968,000	
ルックホールディングス	4,600	2,596.00	11,941,600	
三井物産	2,376,700	2,826.00	6,716,554,200	
日本紙パルプ商事	7,600	6,450.00	49,020,000	
東京エレクトロン	317,500	22,260.00	7,067,550,000	
カメイ	16,900	1,967.00	33,242,300	
東都水産	200	6,510.00	1,302,000	
OUGホールディングス	500	2,596.00	1,298,000	
スターゼン	11,000	2,826.00	31,086,000	
セイコーグループ	21,000	3,725.00	78,225,000	
山善	48,300	1,383.00	66,798,900	
椿本興業	9,900	1,740.00	17,226,000	
住友商事	960,300	3,193.00	3,066,237,900	
BIPROGY	49,100	4,952.00	243,143,200	
内田洋行	6,500	6,710.00	43,615,000	
三菱商事	3,046,700	2,861.50	8,718,132,050	
第一実業	14,900	2,378.00	35,432,200	
キヤノンマーケティングジャパン	36,700	4,810.00	176,527,000	
西華産業	6,200	3,860.00	23,932,000	
佐藤商事	11,100	1,365.00	15,151,500	
東京産業	14,500	698.00	10,121,000	
ユアサ商事	12,500	5,070.00	63,375,000	
神鋼商事	4,000	6,870.00	27,480,000	
トルク	3,900	210.00	819,000	
阪和興業	28,500	4,865.00	138,652,500	
正栄食品工業	10,600	4,585.00	48,601,000	
カナデン	12,000	1,389.00	16,668,000	
RYODEN	12,800	2,475.00	31,680,000	
ニプロ	124,900	1,363.00	170,238,700	
岩谷産業	36,200	8,160.00	295,392,000	
ナイス	1,200	1,895.00	2,274,000	
ニチモウ	1,200	1,853.00	2,223,600	
極東貿易	9,500	1,495.00	14,202,500	
アステナホールディングス	29,800	509.00	15,168,200	
三愛オブリ	37,000	2,016.00	74,592,000	
稲畑産業	31,200	3,285.00	102,492,000	
G S Iクレオス	8,500	1,975.00	16,787,500	
明和産業	18,700	643.00	12,024,100	
クワザワホールディングス	1,900	661.00	1,255,900	
キムラタン	33,200	18.00	597,600	
ゴールドウイン	26,700	7,960.00	212,532,000	
ユニ・チャーム	313,300	5,056.00	1,584,044,800	
デザート	25,800	4,340.00	111,972,000	
キング	2,000	723.00	1,446,000	
ワキタ	26,200	1,614.00	42,286,800	
ヤマトインターナショナル	4,000	330.00	1,320,000	

東邦ホールディングス	42,900	5,007.00	214,800,300	
サンゲツ	36,600	2,849.00	104,273,400	
ミツウロコグループホールディングス	20,300	1,634.00	33,170,200	
シナネンホールディングス	4,400	5,770.00	25,388,000	
伊藤忠エネクス	39,400	1,598.00	62,961,200	
サンリオ	128,800	3,866.00	497,940,800	
サンワテクノス	7,900	1,967.00	15,539,300	
新光商事	21,300	878.00	18,701,400	
トーヨー	6,100	2,639.00	16,097,900	
三信電気	6,300	1,972.00	12,423,600	
東陽テクニカ	14,500	1,620.00	23,490,000	
モスフードサービス	23,200	3,465.00	80,388,000	
加賀電子	14,400	5,300.00	76,320,000	
都築電気	7,800	2,280.00	17,784,000	
ソーダニッカ	16,700	1,135.00	18,954,500	
立花エレテック	10,500	2,608.00	27,384,000	
木曽路	23,900	2,417.00	57,766,300	
SRSホールディングス	26,100	1,245.00	32,494,500	
千趣会	29,300	296.00	8,672,800	
リテールパートナーズ	23,500	1,360.00	31,960,000	
上新電機	15,800	2,735.00	43,213,000	
日本瓦斯	84,000	2,333.00	195,972,000	
ロイヤルホールディングス	27,900	2,392.00	66,736,800	
東天紅	400	790.00	316,000	
いなげや	15,500	1,198.00	18,569,000	
チヨダ	15,100	938.00	14,163,800	
ライフコーポレーション	16,600	3,625.00	60,175,000	
リンガーハット	20,400	2,190.00	44,676,000	
MrMaxHD	20,000	690.00	13,800,000	
テンアライド	4,900	299.00	1,465,100	
AOKIホールディングス	34,000	1,211.00	41,174,000	
オークワ	22,900	930.00	21,297,000	
コメリ	24,400	3,780.00	92,232,000	
青山商事	33,800	1,367.00	46,204,600	
しまむら	37,200	7,955.00	295,926,000	
はせがわ	2,500	333.00	832,500	
高島屋	202,200	1,103.00	223,026,600	
松屋	27,000	871.00	23,517,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	81,000	2,141.00	173,421,000	
近鉄百貨店	6,900	2,083.00	14,372,700	
丸井グループ	105,300	2,551.00	268,620,300	
クレディセゾン	93,500	3,434.00	321,079,000	
アクシアル リテイリング	43,300	958.00	41,481,400	
井筒屋	2,500	426.00	1,065,000	
イオン	537,800	3,925.00	2,110,865,000	
イズミ	28,000	3,653.00	102,284,000	
フォーバル	6,200	1,349.00	8,363,800	
平和堂	26,600	2,456.00	65,329,600	
フジ	24,300	2,058.00	50,009,400	
ヤオコー	18,800	10,240.00	192,512,000	

ゼビオホールディングス	21,600	1,241.00	26,805,600
ケースホールディングス	106,600	1,555.50	165,816,300
PALTAC	21,300	4,523.00	96,339,900
三谷産業	27,900	322.00	8,983,800
Olympicグループ	2,500	491.00	1,227,500
日産東京販売ホールディングス	5,200	448.00	2,329,600
あおぞら銀行	106,100	2,537.00	269,175,700
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,994,900	1,445.50	13,002,127,950
りそなホールディングス	1,694,800	1,066.00	1,806,656,800
三井住友トラスト・ホールディングス	525,900	3,481.00	1,830,657,900
三井住友フィナンシャルグループ	1,034,300	9,036.00	9,345,934,800
千葉銀行	411,500	1,154.50	475,076,750
群馬銀行	286,500	960.50	275,183,250
武蔵野銀行	20,600	2,730.00	56,238,000
千葉興業銀行	34,800	960.00	33,408,000
筑波銀行	64,900	241.00	15,640,900
七十七銀行	43,000	4,020.00	172,860,000
秋田銀行	9,900	2,210.00	21,879,000
山形銀行	16,400	1,040.00	17,056,000
岩手銀行	9,300	2,386.00	22,189,800
東邦銀行	116,800	249.00	29,083,200
東北銀行	1,600	1,173.00	1,876,800
ふくおかフィナンシャルグループ	128,600	3,747.00	481,864,200
スルガ銀行	110,500	1,169.00	129,174,500
八十二銀行	316,900	853.00	270,315,700
山梨中央銀行	16,500	1,637.00	27,010,500
大垣共立銀行	28,000	1,866.00	52,248,000
福井銀行	13,200	1,860.00	24,552,000
清水銀行	5,900	1,482.00	8,743,800
富山銀行	1,000	1,644.00	1,644,000
滋賀銀行	24,600	3,285.00	80,811,000
南都銀行	22,100	3,070.00	67,847,000
百五銀行	138,800	555.00	77,034,000
紀陽銀行	52,900	1,799.00	95,167,100
ほくほくフィナンシャルグループ	91,400	1,631.50	149,119,100
山陰合同銀行	92,500	1,250.00	115,625,000
鳥取銀行	1,200	1,260.00	1,512,000
百十四銀行	14,400	2,551.00	36,734,400
四国銀行	21,800	988.00	21,538,400
阿波銀行	20,700	2,496.00	51,667,200
大分銀行	8,800	3,215.00	28,292,000
宮崎銀行	8,900	2,740.00	24,386,000
佐賀銀行	8,700	2,082.00	18,113,400
琉球銀行	31,300	1,021.00	31,957,300
セブン銀行	462,800	283.80	131,342,640
みずほフィナンシャルグループ	1,993,700	2,832.00	5,646,158,400
高知銀行	1,700	814.00	1,383,800
山口フィナンシャルグループ	144,900	1,587.00	229,956,300
芙蓉総合リース	13,400	11,055.00	148,137,000
みずほリース	123,700	1,023.00	126,545,100

東京センチュリー	110,300	1,714.50	189,109,350
SBIホールディングス	237,000	3,234.00	766,458,000
日本証券金融	54,300	1,893.00	102,789,900
アイフル	217,300	320.00	69,536,000
日本アジア投資	3,600	208.00	748,800
名古屋銀行	9,400	6,410.00	60,254,000
北洋銀行	223,800	398.00	89,072,400
大光銀行	1,200	1,429.00	1,714,800
愛媛銀行	19,900	1,180.00	23,482,000
トマト銀行	1,300	1,179.00	1,532,700
京葉銀行	60,600	731.00	44,298,600
栃木銀行	74,000	263.00	19,462,000
北日本銀行	4,800	2,456.00	11,788,800
東和銀行	27,200	587.00	15,966,400
福島銀行	5,100	243.00	1,239,300
大東銀行	2,200	657.00	1,445,400
リコーリース	13,900	5,040.00	70,056,000
イオンフィナンシャルサービス	84,700	1,270.00	107,569,000
アコム	263,600	369.10	97,294,760
ジャックス	15,800	3,875.00	61,225,000
オリエントコーポレーション	48,300	942.00	45,498,600
オリックス	885,700	3,430.00	3,037,951,000
三菱HCキャピタル	658,100	1,041.50	685,411,150
ジャフコグループ	43,900	2,040.00	89,556,000
九州リースサービス	1,400	1,017.00	1,423,800
トモニホールディングス	139,800	388.00	54,242,400
大和証券グループ本社	1,144,200	1,012.50	1,158,502,500
野村ホールディングス	2,483,800	778.40	1,933,389,920
岡三証券グループ	129,600	626.00	81,129,600
丸三証券	49,000	971.00	47,579,000
東洋証券	39,300	403.00	15,837,900
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	175,200	493.00	86,373,600
光世証券	1,300	435.00	565,500
水戸証券	43,500	418.00	18,183,000
いちよし証券	27,700	693.00	19,196,100
松井証券	72,600	806.00	58,515,600
SOMPOホールディングス	666,500	3,251.00	2,166,791,500
日本取引所グループ	380,800	3,337.00	1,270,729,600
マネックスグループ	144,800	614.00	88,907,200
極東証券	20,200	1,461.00	29,512,200
岩井コスモホールディングス	16,800	2,016.00	33,868,800
アイザワ証券グループ	21,400	1,801.00	38,541,400
フィデアホールディングス	15,200	1,469.00	22,328,800
池田泉州ホールディングス	204,700	328.00	67,141,600
アニコムホールディングス	50,200	649.00	32,579,800
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	992,000	3,200.00	3,174,400,000
マネーパートナーズグループ	5,100	218.00	1,111,800
スパークス・グループ	16,400	1,321.00	21,664,400

小林洋行	2,200	271.00	596,200	
第一生命ホールディングス	694,500	3,752.00	2,605,764,000	
東京海上ホールディングス	1,442,100	5,110.00	7,369,131,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	2,500	540.00	1,350,000	
イー・ギャランティ	24,000	1,415.00	33,960,000	
アサックス	2,100	749.00	1,572,900	
NECキャピタルソリューション	7,300	3,810.00	27,813,000	
T&Dホールディングス	396,500	2,287.00	906,795,500	
アドバンスクリエイト	11,300	1,002.00	11,322,600	
三井不動産	2,049,200	1,421.50	2,912,937,800	
三菱地所	926,700	2,325.00	2,154,577,500	
平和不動産	23,900	4,010.00	95,839,000	
東京建物	129,000	2,319.00	299,151,000	
京阪神ビルディング	27,700	1,559.00	43,184,300	
住友不動産	213,600	4,760.00	1,016,736,000	
太平洋興発	2,000	736.00	1,472,000	
テーオーシー	26,300	621.00	16,332,300	
レオパレス21	147,700	596.00	88,029,200	
スターツコーポレーション	21,300	3,345.00	71,248,500	
フジ住宅	18,600	681.00	12,666,600	
空港施設	20,800	577.00	12,001,600	
明和地所	9,500	969.00	9,205,500	
ゴールドクレスト	12,200	3,200.00	39,040,000	
リログループ	77,300	1,831.50	141,574,950	
エスリード	7,000	4,540.00	31,780,000	
日神グループホールディングス	23,700	488.00	11,565,600	
日本エスコン	27,600	1,002.00	27,655,200	
MIRARTHホールディングス	67,900	502.00	34,085,800	
AVANTIA	1,800	766.00	1,378,800	
イオンモール	76,500	2,078.50	159,005,250	
毎日コムネット	2,000	705.00	1,410,000	
ファースト住建	1,400	1,095.00	1,533,000	
ランド	819,200	8.00	6,553,600	
カチタス	39,700	1,750.00	69,475,000	
東祥	10,800	691.00	7,462,800	
トーセイ	24,600	2,272.00	55,891,200	
穴吹興産	800	2,025.00	1,620,000	
サンフロンティア不動産	22,000	1,714.00	37,708,000	
FJネクストホールディングス	15,600	1,276.00	19,905,600	
インテリックス	1,300	664.00	863,200	
ランドビジネス	1,900	203.00	385,700	
サンネクスタグループ	1,700	999.00	1,698,300	
グランディハウス	12,600	556.00	7,005,600	
東武鉄道	164,800	2,595.50	427,738,400	
相鉄ホールディングス	53,700	2,461.00	132,155,700	
東急	420,500	1,885.00	792,642,500	
京浜急行電鉄	185,600	1,190.00	220,864,000	
小田急電鉄	248,000	1,757.00	435,736,000	
京王電鉄	72,100	3,664.00	264,174,400	
京成電鉄	96,700	4,572.00	442,112,400	

富士急行	18,500	2,519.00	46,601,500
東日本旅客鉄道	826,600	2,874.00	2,375,648,400
西日本旅客鉄道	355,800	2,743.00	975,959,400
東海旅客鉄道	577,600	3,377.00	1,950,555,200
西武ホールディングス	181,300	3,614.00	655,218,200
鴻池運輸	25,500	2,401.00	61,225,500
西日本鉄道	39,900	2,304.50	91,949,550
ハマキョウレックス	12,800	4,895.00	62,656,000
サカイ引越センター	16,600	2,446.00	40,603,600
近鉄グループホールディングス	149,700	3,495.00	523,201,500
阪急阪神ホールディングス	199,600	4,537.00	905,585,200
南海電気鉄道	66,700	2,362.00	157,545,400
京阪ホールディングス	82,600	3,029.00	250,195,400
神戸電鉄	4,100	2,608.00	10,692,800
名古屋鉄道	154,400	1,727.50	266,726,000
山陽電気鉄道	11,300	2,012.00	22,735,600
アルプス物流	12,200	5,760.00	70,272,000
トランコム	4,400	7,100.00	31,240,000
ヤマトホールディングス	181,900	1,592.50	289,675,750
山九	36,200	4,790.00	173,398,000
日新	11,400	4,260.00	48,564,000
丸運	3,300	575.00	1,897,500
丸全昭和運輸	9,300	4,870.00	45,291,000
センコーグループホールディングス	79,000	1,226.00	96,854,000
トナミホールディングス	3,300	5,920.00	19,536,000
ニッコンホールディングス	46,100	3,752.00	172,967,200
日本石油輸送	300	2,886.00	865,800
福山通運	13,700	3,790.00	51,923,000
セイノーホールディングス	84,100	2,408.50	202,554,850
神奈川中央交通	4,100	3,340.00	13,694,000
AZ-COM丸和ホールディングス	38,300	1,107.00	42,398,100
日本郵船	387,800	4,630.00	1,795,514,000
商船三井	325,100	4,688.00	1,524,068,800
川崎汽船	360,600	1,919.50	692,171,700
NSユナイテッド海運	7,900	4,290.00	33,891,000
明海グループ	3,600	701.00	2,523,600
飯野海運	54,900	1,173.00	64,397,700
共栄タンカー	1,100	979.00	1,076,900
九州旅客鉄道	105,800	4,123.00	436,213,400
SGホールディングス	251,300	1,578.50	396,677,050
NIPPON EXPRESSホールディングス	55,900	7,186.00	401,697,400
ID&Eホールディングス	9,300	3,970.00	36,921,000
日本航空	367,700	2,430.50	893,694,850
ANAホールディングス	407,400	2,999.00	1,221,792,600
ピーウィズ	3,200	1,813.00	5,801,600
サンウェルズ	5,900	2,010.00	11,859,000
パスコ	1,000	2,135.00	2,135,000
TREホールディングス	29,500	1,582.00	46,669,000
人・夢・技術グループ	6,300	1,751.00	11,031,300

西本Wismettacホールディングス	9,600	1,378.00	13,228,800	
シルバーライフ	4,300	931.00	4,003,300	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	400	2,580.00	1,032,000	
Genky DrugStores	13,800	3,785.00	52,233,000	
コア商事ホールディングス	11,100	619.00	6,870,900	
KPPグループホールディングス	41,100	669.00	27,495,900	
ナルミヤ・インターナショナル	1,000	1,239.00	1,239,000	
ブックオフグループホールディングス	10,400	1,297.00	13,488,800	
ギフトホールディングス	7,700	2,588.00	19,927,600	
三菱倉庫	35,800	5,255.00	188,129,000	
三井倉庫ホールディングス	13,900	5,900.00	82,010,000	
住友倉庫	39,900	2,727.00	108,807,300	
澁澤倉庫	6,900	2,942.00	20,299,800	
ヤマタネ	7,100	3,245.00	23,039,500	
東陽倉庫	1,000	1,338.00	1,338,000	
乾汽船	17,600	1,127.00	19,835,200	
日本トランスシティ	30,300	875.00	26,512,500	
ケイヒン	1,000	2,016.00	2,016,000	
中央倉庫	7,900	1,396.00	11,028,400	
川西倉庫	1,100	1,151.00	1,266,100	
安田倉庫	10,300	1,664.00	17,139,200	
ファイズホールディングス	700	851.00	595,700	
NISSOホールディングス	13,200	754.00	9,952,800	
大栄環境	27,900	3,130.00	87,327,000	
日本管財ホールディングス	16,200	2,632.00	42,638,400	
東洋埠頭	1,100	1,285.00	1,413,500	
上組	69,000	3,355.00	231,495,000	
サンリツ	1,300	805.00	1,046,500	
キムラユニティー	1,600	1,472.00	2,355,200	
キューソー流通システム	9,900	1,938.00	19,186,200	
東海運	2,800	328.00	918,400	
エーアイティー	9,400	1,662.00	15,622,800	
内外トランスライン	6,000	2,686.00	16,116,000	
ショーエイコーポレーション	1,700	573.00	974,100	
日本コンセプト	5,400	1,677.00	9,055,800	
TBSホールディングス	75,600	4,071.00	307,767,600	
日本テレビホールディングス	133,200	2,377.00	316,616,400	
朝日放送グループホールディングス	14,200	637.00	9,045,400	
テレビ朝日ホールディングス	36,600	2,000.00	73,200,000	
スカパーJSATホールディングス	116,800	855.00	99,864,000	
テレビ東京ホールディングス	10,800	3,890.00	42,012,000	
日本BS放送	1,900	889.00	1,689,100	
ビジョン	22,600	1,314.00	29,696,400	
スマートバリュー	1,500	301.00	451,500	
U-NEXT HOLDINGS	16,800	5,620.00	94,416,000	
ワイヤレスゲート	2,200	256.00	563,200	
日本通信	147,900	167.00	24,699,300	
クロップス	700	966.00	676,200	
日本電信電話	44,739,500	150.20	6,719,872,900	

KDDI	1,106,200	4,824.00	5,336,308,800
ソフトバンク	2,403,100	1,995.00	4,794,184,500
光通信	14,900	33,000.00	491,700,000
エムティーアイ	10,300	1,091.00	11,237,300
GMOインターネットグループ	48,900	2,467.50	120,660,750
ファイバーゲート	7,900	1,075.00	8,492,500
アйдママーケティングコミュニケーション	1,700	219.00	372,300
KADOKAWA	79,500	3,025.00	240,487,500
学研ホールディングス	27,600	993.00	27,406,800
ゼンリン	25,600	857.00	21,939,200
昭文社ホールディングス	2,100	375.00	787,500
インプレスホールディングス	4,900	149.00	730,100
東京電力ホールディングス	1,351,900	644.90	871,840,310
中部電力	552,700	1,753.00	968,883,100
関西電力	579,100	2,436.50	1,410,977,150
中国電力	260,400	1,003.50	261,311,400
北陸電力	153,300	971.30	148,900,290
東北電力	394,900	1,378.00	544,172,200
四国電力	139,600	1,312.50	183,225,000
九州電力	345,600	1,583.50	547,257,600
北海道電力	145,000	1,030.00	149,350,000
沖縄電力	38,400	1,072.00	41,164,800
電源開発	123,100	2,366.00	291,254,600
エフオン	11,100	380.00	4,218,000
イーレックス	26,800	692.00	18,545,600
レノバ	39,900	929.00	37,067,100
東京瓦斯	292,100	3,538.00	1,033,449,800
大阪瓦斯	298,800	3,521.00	1,052,074,800
東邦瓦斯	65,000	4,277.00	278,005,000
北海道瓦斯	8,900	3,100.00	27,590,000
広島ガス	31,900	384.00	12,249,600
西部ガスホールディングス	15,700	1,875.00	29,437,500
静岡ガス	34,100	1,095.00	37,339,500
メタウォーター	17,900	1,695.00	30,340,500
M&A総研ホールディングス	16,400	2,935.00	48,134,000
アイネット	9,100	1,516.00	13,795,600
松竹	7,700	10,310.00	79,387,000
東宝	83,700	5,958.00	498,684,600
エイチ・アイ・エス	49,200	1,835.00	90,282,000
東映	24,900	4,530.00	112,797,000
ラックランド	7,100	1,978.00	14,043,800
NTTデータグループ	393,200	2,343.00	921,267,600
共立メンテナンス	48,500	2,278.00	110,483,000
イチネンホールディングス	16,200	1,752.00	28,382,400
建設技術研究所	7,800	4,425.00	34,515,000
スペース	10,100	1,081.00	10,918,100
アインホールディングス	22,000	5,277.00	116,094,000
燦ホールディングス	14,400	1,163.00	16,747,200
ピー・シー・エー	8,600	1,967.00	16,916,200

スバル興業	6,000	2,869.00	17,214,000	
東京テアトル	1,400	1,101.00	1,541,400	
タナベコンサルティンググループ	5,900	1,213.00	7,156,700	
ビジネスブレイン太田昭和	5,900	1,782.00	10,513,800	
ナガワ	4,800	7,220.00	34,656,000	
東京都競馬	11,300	3,930.00	44,409,000	
常磐興産	1,400	1,676.00	2,346,400	
カナモト	23,800	2,944.00	70,067,200	
D T S	29,700	3,970.00	117,909,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	68,800	5,477.00	376,817,600	
シーイーシー	19,000	1,711.00	32,509,000	
カブコン	268,900	3,319.00	892,479,100	
ニシオホールディングス	12,800	4,130.00	52,864,000	
アイ・エス・ビー	7,100	1,410.00	10,011,000	
アゴーラ ホスピタリティグループ	33,100	39.00	1,290,900	
日本空港ビルデング	52,300	5,046.00	263,905,800	
トランス・コスモス	17,200	3,480.00	59,856,000	
乃村工藝社	67,100	819.00	54,954,900	
S C S K	105,200	2,949.00	310,234,800	
藤田観光	6,900	9,430.00	65,067,000	
K N T - C Tホールディングス	9,200	1,281.00	11,785,200	
トーカイ	13,500	2,185.00	29,497,500	
白洋舎	800	2,315.00	1,852,000	
セコム	157,000	10,990.00	1,725,430,000	
N S W	6,700	2,888.00	19,349,600	
セントラル警備保障	8,300	2,681.00	22,252,300	
アイネス	11,700	1,524.00	17,830,800	
丹青社	29,800	869.00	25,896,200	
メイテックグループホールディングス	52,500	3,386.00	177,765,000	
T K C	26,900	3,745.00	100,740,500	
富士ソフト	41,600	9,440.00	392,704,000	
応用地質	14,300	2,463.00	35,220,900	
船井総研ホールディングス	30,800	2,269.00	69,885,200	
N S D	53,100	3,205.00	170,185,500	
進学会ホールディングス	1,700	226.00	384,200	
丸紅建材リース	400	2,857.00	1,142,800	
オオバ	2,300	1,005.00	2,311,500	
コナミグループ	56,400	13,700.00	772,680,000	
いであ	1,000	2,240.00	2,240,000	
学究社	6,100	2,007.00	12,242,700	
イオンディライト	16,500	4,215.00	69,547,500	
ナック	13,200	551.00	7,273,200	
福井コンピュータホールディングス	9,300	2,550.00	23,715,000	
ダイセキ	31,400	3,705.00	116,337,000	
ステップ	5,600	1,973.00	11,048,800	
泉州電業	10,900	4,550.00	49,595,000	
GENKI GLOBAL DINING CONCEPTS	9,000	4,265.00	38,385,000	

トラスコ中山	33,300	2,559.00	85,214,700
ヤマダホールディングス	488,300	450.90	220,174,470
オートバックスセブン	55,200	1,480.00	81,696,000
モリト	12,700	1,342.00	17,043,400
アークランズ	47,300	1,723.00	81,497,900
ニトリホールディングス	57,700	22,340.00	1,289,018,000
グルメ杵屋	12,900	1,091.00	14,073,900
愛眼	4,200	164.00	688,800
ケーユーホールディングス	7,400	1,041.00	7,703,400
吉野家ホールディングス	58,400	3,282.00	191,668,800
加藤産業	19,600	4,230.00	82,908,000
北恵	1,500	902.00	1,353,000
イノテック	10,100	1,455.00	14,695,500
イエローハット	25,200	2,420.00	60,984,000
松屋フーズホールディングス	7,500	5,580.00	41,850,000
JBCホールディングス	10,100	4,375.00	44,187,500
JKホールディングス	12,400	973.00	12,065,200
サガミホールディングス	23,700	1,688.00	40,005,600
日伝	10,400	3,225.00	33,540,000
ミロク情報サービス	13,500	1,860.00	25,110,000
北沢産業	3,300	369.00	1,217,700
杉本商事	7,600	3,015.00	22,914,000
因幡電機産業	41,100	3,850.00	158,235,000
王将フードサービス	11,900	8,410.00	100,079,000
ミニストップ	11,600	1,664.00	19,302,400
アークス	29,100	2,525.00	73,477,500
バローホールディングス	30,400	2,211.00	67,214,400
東テク	15,900	2,293.00	36,458,700
ミスミグループ本社	239,600	2,651.00	635,179,600
アルテック	2,900	227.00	658,300
ベルク	7,800	6,280.00	48,984,000
大 庄	8,500	1,058.00	8,993,000
タキヒヨー	1,400	1,223.00	1,712,200
ファーストリテイリング	89,200	43,640.00	3,892,688,000
ソフトバンクグループ	741,900	7,843.00	5,818,721,700
蔵王産業	600	2,521.00	1,512,600
スズケン	56,700	5,278.00	299,262,600
サンドラッグ	53,500	4,307.00	230,424,500
サックスパー ホールディングス	13,200	805.00	10,626,000
ジェコス	9,600	907.00	8,707,200
ヤマザワ	1,300	1,236.00	1,606,800
やまや	700	3,040.00	2,128,000
ベルーナ	38,200	717.00	27,389,400
合計	246,843,560		544,009,521,970

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2024年9月30日現在

資産総額	6,635,613,414円
負債総額	9,640,801円
純資産総額(-)	6,625,972,613円
発行済数量	6,396,185,852口
1口当たり純資産額(/)	1.0359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9月30日現在

資産総額	573,990,885,057円
負債総額	558,054,051円
純資産総額(-)	573,432,831,006円
発行済数量	121,570,404,385口
1口当たり純資産額(/)	4.7169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9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9月30日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年9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	1,454,341,224,045
追加型株式投資信託	773	16,698,766,641,729
単位型公社債投資信託	22	35,408,258,167
単位型株式投資信託	194	1,059,778,361,537
合計	1,015	19,248,294,485,478

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			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	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おります。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第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
合計	113,962百万円	121,507百万円

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行（ 1）	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北海道銀行	93,524	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北都銀行（ 1）	12,500	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社荘内銀行	8,500	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社常陽銀行	85,113	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社千葉興業銀行（ 1）	62,120	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社きらぼし銀行（ 1）	43,734	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社第四北越銀行（ 1）	32,776	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北陸銀行	140,409	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社大垣共立銀行（ 1）	46,773	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社池田泉州銀行	61,385	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社山口銀行	10,005	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社十八親和銀行	36,878	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社宮崎銀行（ 1）	14,697	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北九州銀行	10,000	日本において銀行業務を営んでおります。
みずほ信託銀行株式会社（ 1）	247,369	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。
株式会社きらやか銀行	34,183	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社もみじ銀行	10,000	日本において銀行業務を営んでおります。
信金中央金庫	（ 2）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。
a uカブコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

株式会社SBI証券	54,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
OKB証券株式会社（ 1）	1,500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
岡三証券株式会社（ 1）	5,000	「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。
みずほ証券株式会社（ 1）	125,167	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
大和証券株式会社	100,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	（ 3）19,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
SMB C日興証券株式会社	135,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
マネックス証券株式会社	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。
フィデリティ証券株式会社	12,658	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
松井証券株式会社	11,945	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
丸國證券株式会社	601	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
丸三証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ワイエム証券株式会社	1,270	「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

（注）確定拠出年金向けの取扱販売会社を含みます。

（ 1）新規の取得のお申込みのお取扱いを行っておりません。

（ 2）出資の総額

（ 3）2023年12月31日現在

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

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

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

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去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) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2024年11月15日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 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MHAMスリーウェイオープンの2024年3月12日から2024年9月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、MHAMスリーウェイオープンの2024年9月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。