

# One ETF トピックス

追加型投信/国内/株式/ETF/インデックス型

- この目論見書により行う「One ETF トピックス」の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第5条の規定により、有価証券届出書を2024年4月8日に関東財務局長に提出しており、2024年4月9日にその効力が生じております。
- 「One ETF トピックス」の基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資家のみなさまに帰属します。したがって、ファンドは、元本が保証されているものではありません。

## アセットマネジメントOne株式会社

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。  
ファンドは、課税上「特定株式投資信託」として取り扱われます。

### ■委託会社への照会先

【コールセンター】 **0120-104-694** (受付時間: 営業日の午前9時~午後5時)

【ホームページアドレス】 <https://www.am-one.co.jp/>

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
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	株式会社東京証券取引所 (東京都中央区日本橋兜町2番1号)

## 目 次

第一部【証券情報】	1
第二部【ファンド情報】	6
第1【ファンドの状況】	6
第2【管理及び運営】	32
第3【ファンドの経理状況】	42
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	120
第三部【委託会社等の情報】	122
第1【委託会社等の概況】	122
約款	168

## 第一部【証券情報】

### (1) 【ファンドの名称】

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

### (2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権 (以下「受益権」といいます。)

当初元本は1口当たり1,475円とします。

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

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

### (3) 【発行(売出)価額の総額】

10兆円を上限とします。

### (4) 【発行(売出)価格】

取得申込受付日の基準価額<sup>※</sup>とします。

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

<基準価額の照会方法等>

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

### (5) 【申込手数料】

販売会社が定める額とします。

※消費税および地方消費税に相当する金額(「消費税等相当額」といいます。)がかかります。

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

**(6) 【申込単位】**

1ユニット以上1ユニット単位とします。

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

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

**(7) 【申込期間】**

継続申込期間：2024年4月9日から2024年10月8日まで

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

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

**(8) 【申込取扱場所】**

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

※販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

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

**(9) 【払込期日】**

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

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

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

**(10) 【払込取扱場所】**

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

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

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

**(11) 【振替機関に関する事項】**

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

## (12) 【その他】

### ・お申込の受付

取得申込みの受付は原則として販売会社の毎営業日に行われます。

取得申込みの受付は原則として正午までにお申込みが行われ、かつ、取得申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとして取扱います。

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

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

### ・お申込方法

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

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

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

できるものとし、また、取得申込みを当該取得申込者から受け付けた販売会社は、取得申込みを取り次ぐ際に委託会社にその旨を通知するものとし、この通知が取得申込みの取次ぎの際に行われなかった場合において、そのことによって信託財産その他に損害が生じたときには、取得申込みを取り次いだ販売会社がその責を負うものとし、

・その他

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

※受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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

## ○振替受益権について

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

ファンドの収益分配金、交換有価証券は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払い、交付されます。

(参考)

### ◆投資信託振替制度

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

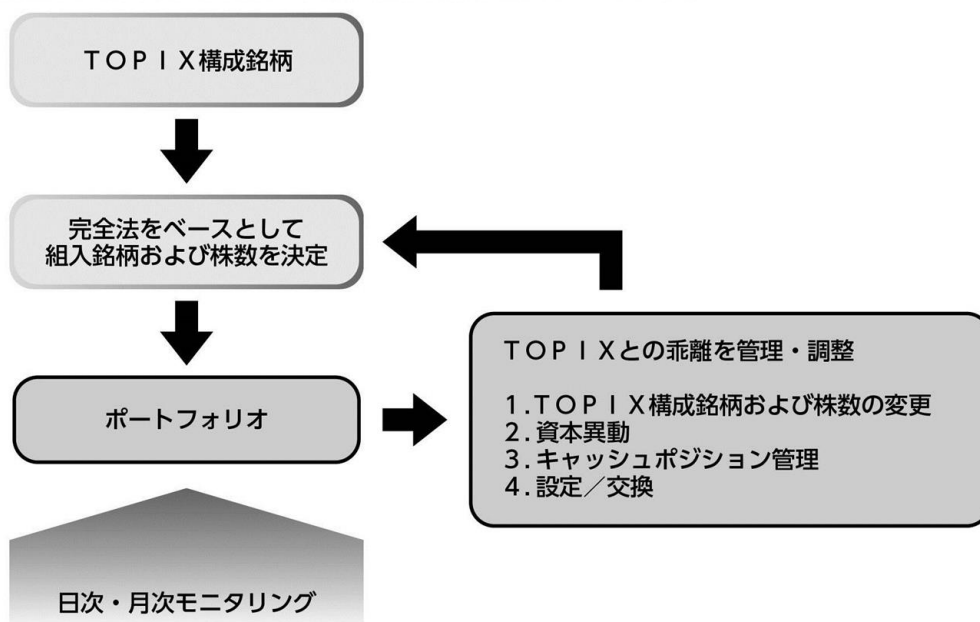
##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

- ①当ファンドは、東証株価指数（TOPIX）（以下、「対象指数」という場合があります。）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ◆信託財産の1口当たりの純資産額の変動率をTOPIXの変動率に一致させることを目的として、TOPIXに採用されている銘柄（採用予定の銘柄を含む。）の株式に対する投資として運用を行います。
  - ◆信託財産中に占める個別銘柄の株数の比率は、TOPIXにおける個別銘柄の時価総額構成比率から算出される株数の比率程度を維持することを原則とします。
- ②当ファンドの信託の限度額は、10兆円相当額とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

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

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



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



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

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

### 東証株価指数(TOPIX)について

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

## ■ 分配方針

年2回の決算時(毎年1月、7月の8日)に収益分配を行います。

分配金額は、経費控除後の配当等収益の全額を原則とします。

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

○商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

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

○属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

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

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

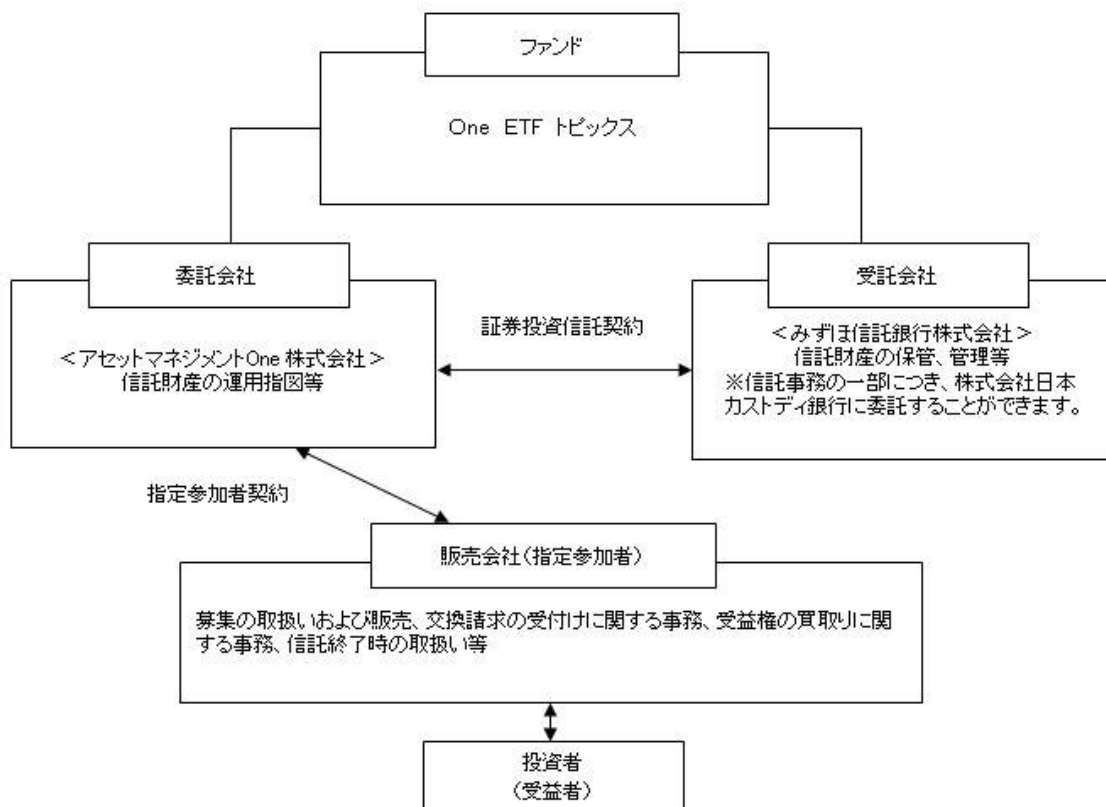
## (2) 【ファンドの沿革】

2015年9月4日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

2015年9月7日 ファンドの受益権を東京証券取引所へ上場

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

## (3) 【ファンドの仕組み】



### ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドにかかる証券投資信託契約を締結します。

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

### ・「指定参加者契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、指定参加者契約を締結します。

募集の取扱いおよび販売、交換請求の受付、受益権の買取りに関する事務、信託終了時の取扱いにかかる事務の内容等が定められています。

## ○委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

### 資本金の額

20億円（2024年1月31日現在）

### 委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「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1月31日現在)

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

※1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

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

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

2. 信託財産中に占める個別銘柄の株数の比率は、対象指数における個別銘柄の時価総額構成比率から算出される株数の比率程度を維持することを原則とします。なお、対象指数から除外された銘柄は、市場動向等を勘案し速やかに売却することを基本としますが、当該銘柄の流動性等によっては、速やかに売却できない場合があります。
3. 1.の方針に沿うよう、信託財産の構成を調整するための指図を行うこと、および補完的に有価証券指数等先物取引等を行うことができます。デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
4. 市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
5. 株式への投資割合には、制限を設けません。
6. 外貨建資産への投資は、行いません。
7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

## (2) 【投資対象】

### ①投資の対象とする資産の種類（約款第18条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項に定めるものをいいます。以下同じ。）とします。

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第24条に定めるものに限り。）

ハ. 金銭債権

### ②運用の指図範囲等（約款第19条第1項）

委託会社は信託財産を主として株式に投資することを指図します。

### ③運用の指図範囲等（約款第19条第2項）

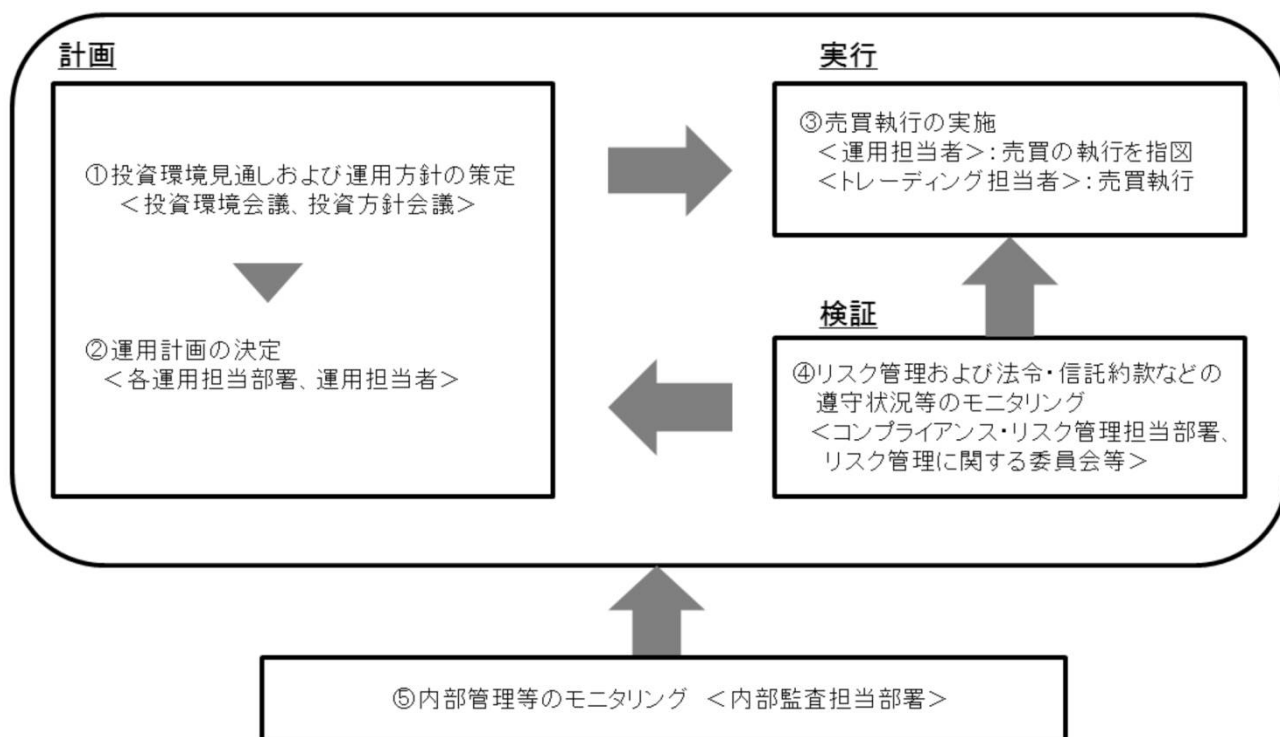
上記②の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託財産を、上記②に掲げる株式のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することの指図ができます。

1. 預金

2. コール・ローン

### (3) 【運用体制】

#### a. ファンドの運用体制



#### 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。

#### ③ 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。

#### ④ 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。

⑤ 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1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### (4) 【分配方針】

##### 1 収益分配方針

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

経費控除後の配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）の全額を分配することを原則とします。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

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

##### 2 収益分配方式

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

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



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

### 3 収益分配金の支払い

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

## (5) 【投資制限】

- ①株式への投資割合には、制限を設けません。（約款第21条）
- ②外貨建資産への投資は、行いません。（約款第21条）
- ③デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。（約款第21条）
- 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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（約款第21条）
- ⑤投資する株式等の範囲（約款第23条）
  - 1) 委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。
  - 2) 上記1)の規定にかかわらず、上場予定の株式で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができます。
- ⑥先物取引等の運用指図（約款第24条）

委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。） 、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。） 、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。） ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。

⑦デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第25条）

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

⑧有価証券の貸付の指図および範囲（約款第26条）

1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式を貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えない範囲内で貸付の指図をすることができます。

2) 上記1)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

3) 委託会社は、株式の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

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

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

### 3【投資リスク】

#### <基準価額の主な変動要因>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### ○株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

#### ○信用リスク

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

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

## ○流動性リスク

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

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

## <その他の留意点>

- 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要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。損失を被る可能性を排除できるものではありません。
- 当ファンドは、基準価額が対象指数と連動する投資成果を目指しますが、主として次のような要因があるため、対象指数と一致した推移をすることを運用上お約束できるものではありません。
  - ・対象指数の構成銘柄について、指数の算出方法どおりの評価価格若しくは構成銘柄異動のタイミングで取引できない場合があること
  - ・当ファンドと対象指数の個別銘柄毎の構成比率が完全に一致しないこと
  - ・追加設定の一部が金銭にて行われた場合、または組入銘柄の配当金や権利処理等によって、信託財産に現金が発生すること
  - ・先物を利用した場合、先物価格と同指数との間に価格差があること
  - ・信託報酬等のコスト負担があること
- 当ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。
- 資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。
- 委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込の受付または交換請求の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付または交換請求の受付を取り消すことができます。
- 当ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権の口数が200万口を下回ることとなった場合、または、やむを得ない事情が発生した場合は、信託を終了（繰上償還）する場合があります。
- 委託会社は、信託期間中において下記に該当することとなった場合は、受託会社と合意のうえ、信託を終了（繰上償還）させます。
  1. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合

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

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

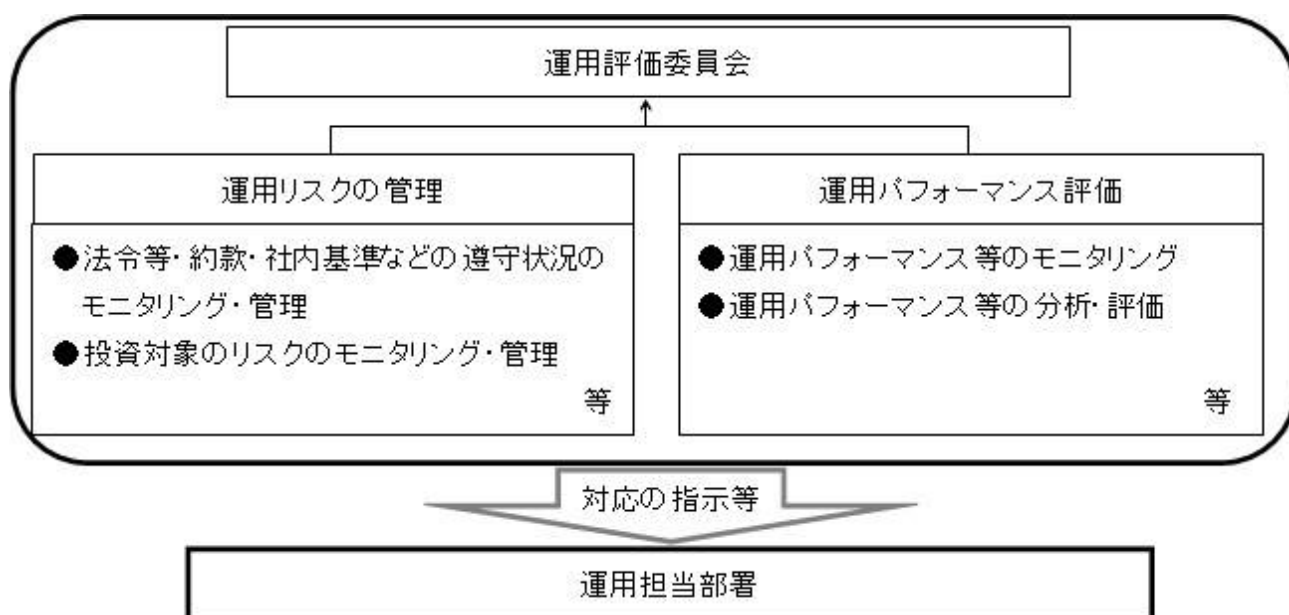
・注意事項

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

<リスク管理体制>

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

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



- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運

用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督  
します。

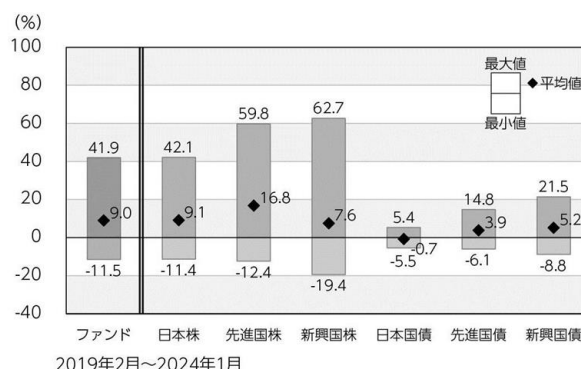
※リスク管理体制は2024年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <参考情報>

### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

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

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 各資産クラスの指数

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

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

## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

販売会社が定める額とします。

※消費税等相当額がかかります。

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

・委託会社への照会

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

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

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

### (2) 【換金(解約)手数料】

販売会社が定める額とします。

※消費税等相当額がかかります。

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

・委託会社への照会

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

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

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

### (3) 【信託報酬等】

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、以下により計算される①と②の合計額とします。

ただし、①により計算される額(税抜)と②により計算される額(税抜)の合計額は、各計算期間においてファンドの純資産総額に対して年率0.25%(税抜)を乗じて得た額を超えないものとします。

①ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.0858%(税抜0.078%)以内の率を乗じて得た額

※2024年4月8日現在は、年率0.0858%(税抜0.078%)になります。配分は以下の通りです。

支払先	内訳(税抜)	主な役務
委託会社	年率0.050%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
受託会社	年率0.028%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行、名義登録事務・分配金支払関係事務等の対価

※信託報酬=運用期間中の基準価額×信託報酬率

②株式の貸付の指図を行った場合は、その品賃料に55%(税抜50%)以内の率を乗じた額につき、委託会社と受託会社で折半します。

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (4) 【その他の手数料等】

##### ○信託財産留保額

ありません。

##### ○その他の費用

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

- ①信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。
- ②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。
- ③有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。
- ④受益権の上場にかかる費用（年間上場料（毎年末の純資産総額に対して最大0.00825%（税抜0.0075%））、追加上場料（追加上場時の増加額（毎年末の純資産総額について、新規上場および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額）に対して0.00825%（税抜0.0075%）））は、信託財産から支払うことができるものとします。
- ⑤対象指数についての商標（これに類する商標を含みます。）の使用料（信託財産の純資産総額に対して最大年率0.033%（税抜0.030%）、ただし165万円（税抜150万円）を下回る場合は165万円（税抜150万円））は、信託財産から支払うことができるものとします。

##### ○お申込時に要するその他の費用

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

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

※2024年4月8日現在。

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。



## (5) 【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「特定株式投資信託」として取扱われます。

### ○個人の受益者に対する課税

#### ①受益権の売却時

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

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

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

#### ②収益分配時

収益分配金は配当所得として課税されます。

原則として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用あり）のいずれかを選択することもできます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### ③受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記①と同様の取扱いとなります。

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

### ※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入したETFなどから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

当ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### ○法人の受益者に対する課税

#### ①受益権の売却時

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

#### ②収益分配金の受取り時

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

③受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記①と同様の取扱いとなります。

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

※上記は、2024年1月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

2024年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	567,059,256,970	98.61
内 日本	567,059,256,970	98.61
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,019,013,494	1.39
純資産総額	575,078,270,464	100.00

その他資産の投資状況

2024年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	8,017,990,000	1.39
内 日本	8,017,990,000	1.39

(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】

#### ①【投資有価証券の主要銘柄】

2024年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	8,603,300	2,706.28 23,283,023,649	3,000.00 25,809,900,000	— —	4.49
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	1,108,300	13,197.91 14,627,250,915	14,695.00 16,286,468,500	— —	2.83
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	9,397,600	1,259.58 11,837,044,807	1,395.00 13,109,652,000	— —	2.28
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	156,800	60,269.47 9,450,253,174	66,580.00 10,439,744,000	— —	1.82
5	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	331,600	24,190.31 8,021,508,150	27,865.00 9,240,034,000	— —	1.61
6	日立製作所 日本	株式 電気機器	760,500	10,267.27 7,808,261,982	11,675.00 8,878,837,500	— —	1.54
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	46,742,800	174.18 8,141,695,469	186.30 8,708,183,640	— —	1.51
8	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,097,200	7,166.72 7,863,327,705	7,700.00 8,448,440,000	— —	1.47
9	三菱商事 日本	株式 卸売業	3,284,800	2,356.25 7,739,818,698	2,565.00 8,425,512,000	— —	1.47
10	信越化学工業 日本	株式 化学	1,423,200	5,640.77 8,027,956,432	5,875.00 8,361,300,000	— —	1.45
11	任天堂 日本	株式	989,200	7,241.25	8,310.00	—	1.43

		日本	その他製 品		7,163,051,455	8,220,252,000	—	
12	三井物産	日本	株式 卸売業	1,249,000	5,452.93 6,810,715,370	6,031.00 7,532,719,000	— —	1.31
13	伊藤忠商事	日本	株式 卸売業	1,114,300	5,893.97 6,567,653,495	6,752.00 7,523,753,600	— —	1.31
14	リクルートホールディング ス	日本	株式 サービ ス業	1,192,400	5,823.64 6,944,116,408	5,927.00 7,067,354,800	— —	1.23
15	本田技研工業	日本	株式 輸送用機 器	3,820,900	1,531.14 5,850,345,411	1,675.50 6,401,917,950	— —	1.11
16	武田薬品工業	日本	株式 医薬品	1,390,700	4,289.81 5,965,849,999	4,362.00 6,066,233,400	— —	1.05
17	第一三共	日本	株式 医薬品	1,369,000	4,039.14 5,529,591,537	4,423.00 6,055,087,000	— —	1.05
18	東京海上ホールディングス	日本	株式 保険業	1,525,300	3,559.99 5,430,063,893	3,930.00 5,994,429,000	— —	1.04
19	KDDI	日本	株式 情報・通 信業	1,214,300	4,601.58 5,587,702,129	4,897.00 5,946,427,100	— —	1.03
20	HOYA	日本	株式 精密機器	308,500	16,894.69 5,212,014,120	18,945.00 5,844,532,500	— —	1.02
21	みずほフィナンシャルグ ループ	日本	株式 銀行業	2,082,900	2,549.10 5,309,539,797	2,702.00 5,627,995,800	— —	0.98
22	ソフトバンクグループ	日本	株式 情報・通 信業	775,200	6,090.59 4,721,431,402	6,460.00 5,007,792,000	— —	0.87
23	ソフトバンク	日本	株式 情報・通 信業	2,528,900	1,813.85 4,587,051,769	1,963.50 4,965,495,150	— —	0.86
24	オリエンタルランド	日本	株式 サービ ス業	852,400	5,280.65 4,501,234,570	5,502.00 4,689,904,800	— —	0.82
25	ダイキン工業	日本	株式 機械	188,900	22,778.87 4,302,929,062	23,885.00 4,511,876,500	— —	0.78
26	村田製作所	日本	株式 電気機器	1,425,500	2,909.72 4,147,813,408	3,015.00 4,297,882,500	— —	0.75
27	SMC	日本	株式 機械	47,400	75,185.95 3,563,814,054	82,910.00 3,929,934,000	— —	0.68
28	三菱電機	日本	株式 電気機器	1,761,300	2,032.05 3,579,059,766	2,203.00 3,880,143,900	— —	0.67
29	日本たばこ産業	日本	株式 食料品	937,500	3,758.41 3,523,510,072	3,895.00 3,651,562,500	— —	0.63
30	丸紅	日本	株式 卸売業	1,382,100	2,294.86 3,171,730,255	2,541.50 3,512,607,150	— —	0.61

(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1月31日現在

種類	投資比率 (%)
株式	98.61
合計	98.61

(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1月31日現在

業種	国内／外国	投資比率 (%)
電気機器	国内	17.22
輸送用機器		8.49
情報・通信業		7.52
卸売業		7.17
銀行業		7.04
化学		5.81
機械		5.31
サービス業		4.65
医薬品		4.50
小売業		4.13
食料品		3.26
陸運業		2.67
保険業		2.41
その他製品		2.39
精密機器		2.33
建設業		2.08
不動産業		1.91
電気・ガス業		1.36
その他金融業		1.14
鉄鋼		0.96
海運業		0.89
証券、商品先物取引業		0.85
ゴム製品		0.70
ガラス・土石製品		0.66
非鉄金属		0.66
金属製品		0.51
石油・石炭製品		0.45
空運業		0.43
繊維製品		0.38
鉱業		0.34
パルプ・紙		0.16
倉庫・運輸関連業	0.14	
水産・農林業	0.08	
合計	98.61	

(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。

## ②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## ③【その他投資資産の主要なもの】

2024年1月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0603月	買建	314	7,512,010,660	8,017,990,000	1.39

(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】

#### ① 【純資産の推移】

直近日（2024年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)	東京証券取引所 市場相場
第1計算期間末 (2016年1月8日)	40,584	40,937	1,447.21	1,459.81	1,450
第2計算期間末 (2016年7月8日)	44,899	45,464	1,208.07	1,223.27	—
第3計算期間末 (2017年1月8日)	56,557	57,023	1,552.83	1,565.63	1,549
第4計算期間末 (2017年7月8日)	91,052	91,952	1,608.21	1,624.11	1,606
第5計算期間末 (2018年1月8日)	120,051	120,757	1,887.27	1,898.37	1,882
第6計算期間末 (2018年7月8日)	140,726	142,050	1,700.57	1,716.57	1,706
第7計算期間末 (2019年1月8日)	142,613	144,146	1,525.21	1,541.61	1,533
第8計算期間末 (2019年7月8日)	171,217	173,344	1,586.07	1,605.77	1,586
第9計算期間末 (2020年1月8日)	201,916	203,981	1,711.25	1,728.75	1,710
第10計算期間末 (2020年7月8日)	234,565	237,149	1,570.66	1,587.96	1,573
第11計算期間末 (2021年1月8日)	308,912	311,185	1,874.98	1,888.78	1,870
第12計算期間末 (2021年7月8日)	412,040	415,621	1,944.36	1,961.26	1,947
第13計算期間末 (2022年1月8日)	410,434	414,457	2,020.03	2,039.83	2,018
第14計算期間末 (2022年7月8日)	371,064	376,214	1,909.68	1,936.18	1,915
第15計算期間末 (2023年1月8日)	424,851	430,043	1,898.20	1,921.40	1,920
第16計算期間末 (2023年7月8日)	500,317	506,315	2,285.48	2,312.88	2,286
第17計算期間末 (2024年1月8日)	527,711	533,060	2,426.75	2,451.35	2,431

2023年1月末日	446,406	—	1,998.94	—	1,997
2月末日	448,590	—	2,017.70	—	2,017
3月末日	452,160	—	2,051.86	—	2,051
4月末日	460,198	—	2,107.01	—	2,106
5月末日	474,618	—	2,182.86	—	2,178
6月末日	513,664	—	2,347.51	—	2,345
7月末日	510,924	—	2,354.18	—	2,352
8月末日	513,995	—	2,364.02	—	2,360
9月末日	517,094	—	2,376.11	—	2,377
10月末日	503,849	—	2,304.80	—	2,304
11月末日	529,676	—	2,429.26	—	2,427
12月末日	527,034	—	2,423.63	—	2,421
2024年1月末日	575,078	—	2,586.50	—	2,587

(注) 計算期間末日が休業日の場合は、前営業日の市場相場を記載しています。

## ②【分配の推移】

	1口当たりの分配金 (円)
第1計算期間	12.60
第2計算期間	15.20
第3計算期間	12.80
第4計算期間	15.90
第5計算期間	11.10
第6計算期間	16.00
第7計算期間	16.40
第8計算期間	19.70
第9計算期間	17.50
第10計算期間	17.30
第11計算期間	13.80
第12計算期間	16.90
第13計算期間	19.80
第14計算期間	26.50
第15計算期間	23.20
第16計算期間	27.40
第17計算期間	24.60

## ③【収益率の推移】

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

第13計算期間	4.9
第14計算期間	△4.2
第15計算期間	0.6
第16計算期間	21.8
第17計算期間	7.3

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	35,858,160	7,815,108
第2計算期間	24,924,100	15,800,837
第3計算期間	24,942,000	25,686,378
第4計算期間	51,843,900	31,648,350
第5計算期間	42,764,100	35,770,629
第6計算期間	54,811,700	35,670,362
第7計算期間	24,523,700	13,771,799
第8計算期間	20,383,600	5,937,088
第9計算期間	14,005,300	3,962,287
第10計算期間	81,712,800	50,364,192
第11計算期間	57,846,700	42,434,261
第12計算期間	101,344,000	54,183,516
第13計算期間	76,116,600	84,849,298
第14計算期間	41,382,200	50,257,264
第15計算期間	39,357,900	9,847,648
第16計算期間	1,980,600	6,887,040
第17計算期間	4,441,600	5,896,515

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

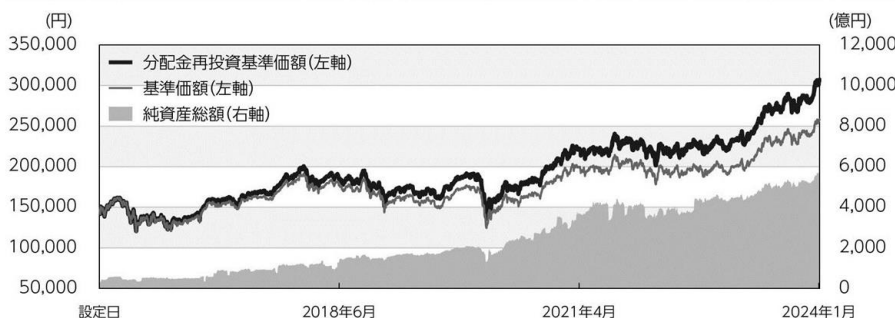
(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(注3) 解約口数は交換口数を表示しています。



データの基準日:2024年1月31日

### 基準価額・純資産の推移 (2015年9月4日~2024年1月31日)



### 分配の推移 (税引前)

2022年 1月	1,980円
2022年 7月	2,650円
2023年 1月	2,320円
2023年 7月	2,740円
2024年 1月	2,460円
設定来累計	30,670円

※分配金は100口当たりです。

※基準価額は100口当たり・信託報酬控除後の価額です。設定当初の投資元本は147,500円(100口当たり)です。  
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
 (設定日:2015年9月4日)

### 主要な資産の状況

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

#### 資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	98.61
内 日本	98.61
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.39
合計(純資産総額)	100.00

#### その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1.39

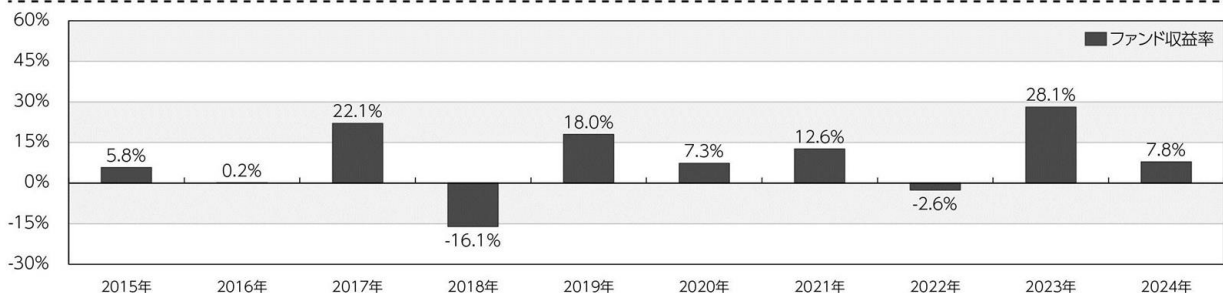
#### 株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	17.22
2	輸送用機器	8.49
3	情報・通信業	7.52
4	卸売業	7.17
5	銀行業	7.04

#### 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.49
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.83
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.28
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.82
5	東京エレクトロン	株式	日本	電気機器	1.61
6	日立製作所	株式	日本	電気機器	1.54
7	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.51
8	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.47
9	三菱商事	株式	日本	卸売業	1.47
10	信越化学工業	株式	日本	化学	1.45

### 年間収益率の推移 (暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。  
 ※2015年は設定日から年末までの収益率、および2024年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

- 掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
- 委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### ・お申込の受付

取得申込みの受付は原則として販売会社の毎営業日に行われます。

取得申込みの受付は原則として正午までにお申込みが行われ、かつ、取得申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとして取扱います。

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

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

#### ・お申込単位

1ユニット以上1ユニット単位とします。

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

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

#### ・お申込価額

取得申込受付日の基準価額※とします。

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

#### <基準価額の照会方法等>

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

#### ・お申込方法

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

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

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

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

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

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

#### ・ 申込手数料

販売会社が定める額とします。

※消費税等相当額がかかります。

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

##### ・ 委託会社への照会

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

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

#### ・ その他

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

※受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

なお、販売会社は、当該取得申込みにかかる現物株式ポートフォリオ等の受渡しまたは支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

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

## 2【換金（解約）手続等】

### ・解約の受付

解約の請求はできません。

### ・交換の受付

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

交換請求の受付は、原則として正午までに交換請求が行われ、かつ、交換請求の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当該交換請求受付日の請求として取扱います。

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

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

### ・交換単位

委託会社が定める口数（最小交換口数）の整数倍とします。

※「最小交換口数」は、委託会社が交換請求受付日の2営業日前までに提示します。

### ・交換価額

交換にかかる受益権の評価額は交換請求受付日の基準価額<sup>※</sup>とします。

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

<基準価額の照会方法等>

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

・交換の方法

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

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

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

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

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

・交換手数料

販売会社が定める額とします。

※消費税等相当額がかかります。

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

- ・委託会社への照会

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

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

・その他

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、交換請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた交換請求の受付を取り消すことがあります。交

換請求の受付を中止された場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の交換請求を撤回できます。ただし、受益者がその交換請求を撤回しない場合には、当該受益権の交換価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に交換請求を受け付けたものとして計算した価額とします。

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

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

#### ・買取り

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

買取請求の受付は、原則として販売会社の定める時刻までに買取請求が行われ、かつ、買取請求の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の買取請求受付分とします。

ただし、2. の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。

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

受益権の買取価額は、買取請求の受付日の基準価額とします。

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

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

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

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場

なお、当ファンドの基準価額は100口当たりで表示されます。

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

#### (2) 【保管】

該当事項はありません。

#### (3) 【信託期間】

信託期間は、2015年9月4日から無期限です。

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

#### (4) 【計算期間】

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

#### (5) 【その他】

##### イ. 償還規定

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

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



## ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、約款はa. からg. に定める以外の方法によって変更することができないものとしします。
- b. 委託会社は、上記a. の事項（上記a. の変更事項にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a. の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b. の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本c. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b. からe. までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a. からf. の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a. からg. の規定にしたがい約款を変更します。
- i. 重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、上記b. に規定する書面に付記します。

## ハ. 関係法人との契約の更改

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

## ニ. 公告

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

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

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

#### ホ. 運用報告書

運用報告書は作成しません。

### 4 【受益者の権利等】

#### (1) 収益分配金に対する請求権および名義登録

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

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

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

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

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

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

## (2) 信託終了時の交換請求権

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

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

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

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

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

## (3) 交換請求権および買取請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期計算期間（2023年7月9日から2024年1月8日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

# 独立監査人の監査報告書

2024年3月8日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 伊加井 真弓  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているOne ETF トピックスの2023年7月9日から2024年1月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、One ETF トピックスの2024年1月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

# 1【財務諸表】

## 【One ETF トピックス】

### (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 2023年7月8日現在	第17期 2024年1月8日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	155,586,209,585	163,689,795,495
株式	494,066,725,840	520,244,712,160
派生商品評価勘定	85,771,840	108,472,040
未収入金	89,739,600	80,581,760
未収配当金	551,754,423	691,366,935
未収利息	15,308,271	2,662,126
その他未収収益	141,003,252	63,869,229
差入委託証拠金	488,700,000	587,921,790
流動資産合計	651,025,212,811	685,469,381,535
資産合計		
	651,025,212,811	685,469,381,535
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	14,148,580	—
前受金	264,985,000	98,087,000
未払収益分配金	5,998,169,702	5,349,427,144
未払受託者報酬	83,025,098	91,318,840
未払委託者報酬	138,545,752	153,984,654
未払利息	485,804	259,372
受入担保金	144,083,684,103	151,998,024,347
その他未払費用	125,076,561	66,928,546
流動負債合計	150,708,120,600	157,758,029,903
負債合計		
	150,708,120,600	157,758,029,903
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	322,894,171,925	320,748,172,300
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	177,422,920,286	206,963,179,332
(分配準備積立金)	3,558,302	19,202,731
元本等合計	500,317,092,211	527,711,351,632
純資産合計		
	500,317,092,211	527,711,351,632
負債純資産合計		
	651,025,212,811	685,469,381,535

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第16期 自 2023年1月9日 至 2023年7月8日	第17期 自 2023年7月9日 至 2024年1月8日
営業収益		
受取配当金	5,556,559,155	5,184,461,107
受取利息	31,914,272	23,688,915
有価証券売買等損益	83,488,207,292	30,206,033,785
派生商品取引等損益	1,727,189,190	560,176,460
その他収益	749,783,819	521,640,327
営業収益合計	91,553,653,728	36,496,000,594
営業費用		
支払利息	33,220,105	25,361,081
受託者報酬	83,025,098	91,318,840
委託者報酬	138,545,752	153,984,654
その他費用	87,077,105	94,054,201
営業費用合計	341,868,060	364,718,776
営業利益又は営業損失(△)	91,211,785,668	36,131,281,818
経常利益又は経常損失(△)	91,211,785,668	36,131,281,818
当期純利益又は当期純損失(△)	91,211,785,668	36,131,281,818
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額(△)	—	—
期首剰余金又は期首欠損金(△)	94,720,044,373	177,422,920,286
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,492,777,417	3,876,581,287
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,492,777,417	3,876,581,287
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,003,517,470	5,118,176,915
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,003,517,470	5,118,176,915
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	5,998,169,702	5,349,427,144
期末剰余金又は期末欠損金(△)	177,422,920,286	206,963,179,332



(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第17期	
	自 2023年7月9日	至 2024年1月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第16期	第17期
	2023年7月8日現在	2024年1月8日現在
1. 期首元本額	330,131,170,925円	322,894,171,925円
期中追加設定元本額	2,921,385,000円	6,551,360,000円
期中一部交換元本額	10,158,384,000円	8,697,359,625円
2. 受益権の総数	218,911,303口	217,456,388口
3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	133,834,708,390円	145,201,293,200円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第16期	第17期
	自 2023年1月9日 至 2023年7月8日	自 2023年7月9日 至 2024年1月8日
1. その他費用	その他費用の内訳は、監査費用(538,837円)、ライセンス料(67,344,021円)、その他(19,194,247円)となっております。	その他費用の内訳は、監査費用(546,296円)、ライセンス料(72,106,678円)、その他(21,401,227円)となっております。
2. 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当金等収益額(6,305,037,141円)及び分配準備積立金(5,338,818円)の合計額から、経費(308,647,955円)を控除して計算される分配対象額は6,001,728,004円(100口当たり2,741円)であり、うち	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当金等収益額(5,704,429,268円)及び分配準備積立金(3,558,302円)の合計額から、経費(339,357,695円)を控除して計算される分配対象額は5,368,629,875円(100口当たり2,468円)であり、うち

	5,998,169,702円（100口当たり2,740円）を分配金額としております。	5,349,427,144円（100口当たり2,460円）を分配金額としております。
--	--	--

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第16期 自 2023年1月9日 至 2023年7月8日	第17期 自 2023年7月9日 至 2024年1月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第16期 2023年7月8日現在	第17期 2024年1月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券	同左

<p>3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>「(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> <p>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。</p>	<p>同左</p>
-----------------------------------	---	-----------

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第16期 2023年7月8日現在	第17期 2024年1月8日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	82,178,439,274	29,933,574,497
合計	82,178,439,274	29,933,574,497

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

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

種類	第17期 2024年1月8日現在			
	契約額等(円)	うち	時価(円)	評価損益(円)

		1年超		
市場取引				
先物取引				
買建	7,352,905,000	—	7,461,480,000	108,575,000
合計	7,352,905,000	—	7,461,480,000	108,575,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第16期 2023年7月8日現在	第17期 2024年1月8日現在
1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	2,285.48円 (228,548円)	2,426.75円 (242,675円)

#### (4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年1月8日現在

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
極洋	8,100	3,850.00	31,185,000	
ニッセイ	214,700	768.70	165,039,890	貸付株式数 700株
マルハニチロ	31,900	2,822.50	90,037,750	貸付株式数 10,300株 (10,300株)
雪国まいたけ	18,300	935.00	17,110,500	
カネコ種苗	6,600	1,411.00	9,312,600	
サカタのタネ	24,400	3,910.00	95,404,000	貸付株式数 10,200株
ホクト	17,200	1,755.00	30,186,000	
ホクリヨウ	1,900	1,043.00	1,981,700	
ショーボンドホールディングス	29,200	6,444.00	188,164,800	貸付株式数 1,500株
ミライト・ワン	71,000	1,898.00	134,758,000	
タマホーム	13,500	4,060.00	54,810,000	貸付株式数 8,800株
サンヨーホームズ	1,400	755.00	1,057,000	
日本アクア	5,000	922.00	4,610,000	貸付株式数 3,300株
ファーストコーポレーション	3,100	741.00	2,297,100	貸付株式数 2,100株
ベステラ	2,800	1,086.00	3,040,800	貸付株式数

				1,700株
R o b o t H o m e	41,800	175.00	7,315,000	貸付株式数 900株
キャンディール	2,200	588.00	1,293,600	貸付株式数 1,400株
住石ホールディングス	21,200	1,143.00	24,231,600	貸付株式数 13,800株
日鉄鉱業	8,600	5,180.00	44,548,000	貸付株式数 1,400株
三井松島ホールディングス	12,700	2,775.00	35,242,500	貸付株式数 7,700株 (200株)
I N P E X	794,200	1,981.50	1,573,707,300	
石油資源開発	24,900	5,550.00	138,195,000	
K&Oエナジーグループ	9,700	2,252.00	21,844,400	
ダイセキ環境ソリューション	2,400	1,113.00	2,671,200	
第一カッター興業	5,500	1,350.00	7,425,000	
明豊ファシリティワークス	4,400	818.00	3,599,200	
安藤・間	124,400	1,164.00	144,801,600	貸付株式数 100株
東急建設	67,300	825.00	55,522,500	
コムシスホールディングス	68,600	3,153.00	216,295,800	貸付株式数 1,700株
ビーアールホールディングス	31,500	365.00	11,497,500	
高松コンストラクショングループ	16,000	2,778.00	44,448,000	貸付株式数 7,600株
東建コーポレーション	6,200	9,090.00	56,358,000	貸付株式数 3,400株
ソネック	1,300	956.00	1,242,800	
ヤマウラ	10,900	1,527.00	16,644,300	貸付株式数 5,900株
オリエンタル白石	79,500	350.00	27,825,000	
大成建設	140,500	5,016.00	704,748,000	
大林組	537,200	1,268.00	681,169,600	貸付株式数 53,600株
清水建設	425,900	962.10	409,758,390	
飛島建設	15,500	1,409.00	21,839,500	
長谷工コーポレーション	137,800	1,913.50	263,680,300	貸付株式数 84,200株
松井建設	14,000	863.00	12,082,000	貸付株式数 100株
銭高組	1,300	4,045.00	5,258,500	
鹿島建設	333,000	2,450.00	815,850,000	
不動テトラ	10,400	2,378.00	24,731,200	
大末建設	3,300	1,398.00	4,613,400	
鉄建建設	10,800	2,052.00	22,161,600	
西松建設	28,700	3,994.00	114,627,800	貸付株式数 15,800株 (15,800株)
三井住友建設	111,800	407.00	45,502,600	貸付株式数 1,000株

大豊建設	5,200	3,705.00	19,266,000	
佐田建設	5,300	660.00	3,498,000	
ナカノフドー建設	5,900	488.00	2,879,200	
奥村組	24,400	4,770.00	116,388,000	
東鉄工業	18,600	3,090.00	57,474,000	
イチケン	2,100	2,319.00	4,869,900	
富士ピー・エス	3,700	465.00	1,720,500	貸付株式数 2,000株
浅沼組	11,100	4,070.00	45,177,000	貸付株式数 5,000株
戸田建設	203,300	933.40	189,760,220	
熊谷組	24,800	3,660.00	90,768,000	
北野建設	1,600	3,240.00	5,184,000	
植木組	2,400	1,623.00	3,895,200	
矢作建設工業	20,400	1,393.00	28,417,200	
ピーエス三菱	19,000	893.00	16,967,000	貸付株式数 12,000株 (2,000株)
日本ハウスホールディングス	32,100	301.00	9,662,100	貸付株式数 17,600株 (10,400株)
大東建託	55,300	16,430.00	908,579,000	
新日本建設	21,100	1,150.00	24,265,000	
東亜道路工業	6,000	7,020.00	42,120,000	
日本道路	17,600	2,082.00	36,643,200	
東亜建設工業	11,600	3,745.00	43,442,000	
日本国土開発	42,700	611.00	26,089,700	
若築建設	5,200	3,100.00	16,120,000	
東洋建設	37,800	1,243.00	46,985,400	貸付株式数 24,800株
五洋建設	212,900	814.30	173,364,470	
世紀東急工業	19,300	1,745.00	33,678,500	貸付株式数 9,000株
福田組	5,700	5,550.00	31,635,000	貸付株式数 3,100株
日本ドライケミカル	2,100	2,674.00	5,615,400	貸付株式数 1,400株
住友林業	129,800	4,164.00	540,487,200	
日本基礎技術	5,000	462.00	2,310,000	貸付株式数 1,600株
巴コーポレーション	10,500	585.00	6,142,500	
大和ハウス工業	415,400	4,461.00	1,853,099,400	貸付株式数 219,900株
ライト工業	30,900	1,992.00	61,552,800	
積水ハウス	455,600	3,227.00	1,470,221,200	
日特建設	14,300	1,126.00	16,101,800	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
北陸電気工事	10,300	1,262.00	12,998,600	
ユアテック	33,100	1,156.00	38,263,600	

日本リーテック	11,700	1,223.00	14,309,100	
四電工	6,300	3,255.00	20,506,500	
中電工	23,300	2,654.00	61,838,200	
関電工	94,100	1,370.00	128,917,000	貸付株式数 200株 (200株)
きんでん	105,700	2,392.50	252,887,250	
東京エネシス	14,900	1,033.00	15,391,700	
トーエネック	5,000	4,710.00	23,550,000	
住友電設	14,300	2,778.00	39,725,400	
日本電設工業	28,200	1,984.00	55,948,800	
エクシオグループ	73,400	3,117.00	228,787,800	
新日本空調	9,700	2,387.00	23,153,900	貸付株式数 3,500株 (3,500株)
九電工	32,500	5,120.00	166,400,000	貸付株式数 2,500株
三機工業	32,500	1,780.00	57,850,000	
日揮ホールディングス	148,600	1,686.50	250,613,900	貸付株式数 31,800株
中外炉工業	4,900	2,403.00	11,774,700	
ヤマト	6,900	956.00	6,596,400	
太平電業	9,300	4,380.00	40,734,000	
高砂熱学工業	40,200	3,215.00	129,243,000	
三晃金属工業	1,100	4,715.00	5,186,500	
NEC ネットエスアイ	59,900	2,288.00	137,051,200	貸付株式数 200株
朝日工業社	7,000	3,060.00	21,420,000	
明星工業	29,100	1,088.00	31,660,800	
大気社	17,300	4,145.00	71,708,500	
ダイダン	19,700	1,455.00	28,663,500	
日比谷総合設備	10,900	2,516.00	27,424,400	
ニッポン	45,100	2,223.00	100,257,300	
日清製粉グループ本社	139,400	1,945.00	271,133,000	貸付株式数 2,300株
日東富士製粉	2,700	4,955.00	13,378,500	貸付株式数 600株
昭和産業	14,600	3,225.00	47,085,000	
鳥越製粉	7,500	650.00	4,875,000	貸付株式数 4,900株
中部飼料	20,900	1,091.00	22,801,900	
フィード・ワン	22,000	827.00	18,194,000	
東洋精糖	1,600	2,069.00	3,310,400	貸付株式数 500株
日本甜菜製糖	8,800	1,997.00	17,573,600	
DM三井製糖ホールディングス	15,000	3,125.00	46,875,000	貸付株式数 6,700株
塩水港精糖	11,000	240.00	2,640,000	
ウェルネオシュガー	7,500	2,166.00	16,245,000	貸付株式数 4,200株

L I F U L L	53,800	185.00	9,953,000	
M I X I	33,800	2,426.00	81,998,800	
ジェイエイシーリクルートメント	56,900	645.00	36,700,500	
日本M&Aセンターホールディングス	250,900	777.20	194,999,480	貸付株式数 147,800株
メンバーズ	5,400	968.00	5,227,200	貸付株式数 3,500株
中広	1,400	422.00	590,800	
UTグループ	20,300	2,310.00	46,893,000	貸付株式数 1,300株
アイティメディア	6,000	992.00	5,952,000	貸付株式数 3,300株
ケアネット	24,200	934.00	22,602,800	貸付株式数 16,000株
E・Jホールディングス	9,200	1,639.00	15,078,800	貸付株式数 5,000株
オープンアップグループ	47,200	2,252.00	106,294,400	
コシダカホールディングス	47,100	1,085.00	51,103,500	貸付株式数 18,800株
アルトナー	3,700	2,263.00	8,373,100	
パソナグループ	19,100	2,582.00	49,316,200	貸付株式数 100株
CDS	2,200	1,704.00	3,748,800	
リンクアンドモチベーション	45,300	558.00	25,277,400	貸付株式数 11,100株
エス・エム・エス	55,200	2,785.50	153,759,600	
サニーサイドアップグループ	2,600	564.00	1,466,400	
パーソルホールディングス	1,602,700	249.70	400,194,190	貸付株式数 3,700株
リニカル	5,700	537.00	3,060,900	
クックパッド	43,100	116.00	4,999,600	貸付株式数 23,800株
エスクリ	3,600	293.00	1,054,800	貸付株式数 2,400株
アイ・ケイ・ケイホールディングス	4,300	685.00	2,945,500	貸付株式数 2,900株
森永製菓	64,500	2,613.50	168,570,750	貸付株式数 200株
中村屋	3,800	3,070.00	11,666,000	貸付株式数 2,000株
江崎グリコ	43,100	4,251.00	183,218,100	貸付株式数 700株
名糖産業	5,900	1,701.00	10,035,900	貸付株式数 3,200株 (100株)
井村屋グループ	9,000	2,368.00	21,312,000	貸付株式数 400株
不二家	10,300	2,449.00	25,224,700	貸付株式数 5,600株
山崎製パン	100,900	3,226.00	325,503,400	貸付株式数 55,600株



第一屋製パン	1,600	648.00	1,036,800	
モロゾフ	4,900	3,850.00	18,865,000	貸付株式数 2,600株
亀田製菓	8,600	4,065.00	34,959,000	貸付株式数 5,100株
寿スピリッツ	71,300	2,091.50	149,123,950	
カルビー	69,000	2,817.50	194,407,500	貸付株式数 4,900株
森永乳業	52,700	2,816.00	148,403,200	貸付株式数 200株
六甲バター	11,100	1,348.00	14,962,800	貸付株式数 6,100株
ヤクルト本社	215,500	3,199.00	689,384,500	貸付株式数 400株
明治ホールディングス	184,900	3,431.00	634,391,900	
雪印メグミルク	36,500	2,148.00	78,402,000	貸付株式数 8,100株
プリマハム	20,300	2,306.00	46,811,800	貸付株式数 8,300株
日本ハム	64,900	4,812.00	312,298,800	
林兼産業	2,800	566.00	1,584,800	
丸大食品	15,200	1,625.00	24,700,000	
S F o o d s	16,600	3,335.00	55,361,000	
柿安本店	5,900	2,510.00	14,809,000	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
伊藤ハム米久ホールディングス	23,000	3,925.00	90,275,000	
学情	8,000	1,765.00	14,120,000	貸付株式数 4,400株
スタジオアリス	7,900	2,106.00	16,637,400	貸付株式数 4,300株
クロスキャット	9,700	1,095.00	10,621,500	貸付株式数 5,300株
シミックホールディングス	7,600	2,645.00	20,102,000	貸付株式数 100株
エプロ	2,400	916.00	2,198,400	
システナ	232,400	309.00	71,811,600	
N J S	3,500	2,751.00	9,628,500	貸付株式数 1,800株
デジタルアーツ	9,700	4,990.00	48,403,000	貸付株式数 5,300株
日鉄ソリューションズ	26,200	4,650.00	121,830,000	
総合警備保障	263,000	819.00	215,397,000	
キューブシステム	8,100	1,112.00	9,007,200	貸付株式数 5,000株
いちご	173,700	343.00	59,579,100	
日本駐車場開発	159,600	196.00	31,281,600	貸付株式数 100,000株
コア	6,800	1,790.00	12,172,000	
カカコム	104,000	1,721.50	179,036,000	
アイロムグループ	6,400	2,040.00	13,056,000	

セントケア・ホールディング	11,500	1,007.00	11,580,500	貸付株式数 5,500株
サイネックス	1,500	824.00	1,236,000	
ルネサンス	12,200	891.00	10,870,200	貸付株式数 7,200株
ディップ	24,100	3,175.00	76,517,500	貸付株式数 10,900株
SBSホールディングス	13,600	2,503.00	34,040,800	貸付株式数 7,300株
デジタルホールディングス	8,200	1,263.00	10,356,600	貸付株式数 1,400株
新日本科学	14,300	1,789.00	25,582,700	貸付株式数 5,800株
キャリアデザインセンター	1,800	2,105.00	3,789,000	
ベネフィット・ワン	54,700	2,110.00	115,417,000	貸付株式数 29,700株
エムスリー	311,100	2,278.00	708,685,800	貸付株式数 5,400株
ツカダ・グローバルホールディング	5,600	379.00	2,122,400	貸付株式数 3,000株
プラス	1,000	691.00	691,000	貸付株式数 600株
アウトソーシング	100,800	1,731.00	174,484,800	貸付株式数 55,800株
ウェルネット	6,700	569.00	3,812,300	貸付株式数 4,600株
ワールドホールディングス	7,100	2,741.00	19,461,100	
ディー・エヌ・エー	56,000	1,385.00	77,560,000	
博報堂DYホールディングス	200,800	1,098.50	220,578,800	貸付株式数 21,800株 (18,100株)
ぐるなび	29,300	271.00	7,940,300	
タカミヤ	21,300	496.00	10,564,800	
ジャパンベストレスキューシステム	7,800	997.00	7,776,600	
ファンコミュニケーションズ	22,000	400.00	8,800,000	貸付株式数 12,100株 (3,600株)
ライク	5,900	1,463.00	8,631,700	貸付株式数 3,700株
Aoba - BBT	3,300	410.00	1,353,000	
エスプール	45,200	432.00	19,526,400	
WDBホールディングス	8,000	2,255.00	18,040,000	
手間いらず	2,600	2,971.00	7,724,600	
ティア	5,200	470.00	2,444,000	
CDG	900	1,201.00	1,080,900	
アドウェイズ	21,700	491.00	10,654,700	貸付株式数 11,800株
バリューコマース	13,800	1,422.00	19,623,600	
インフォマート	163,400	474.00	77,451,600	貸付株式数 900株 (900株)

サッポロホールディングス	49,600	6,419.00	318,382,400	貸付株式数 22,200株
アサヒグループホールディングス	348,400	5,366.00	1,869,514,400	
キリンホールディングス	628,200	2,088.50	1,311,995,700	
宝ホールディングス	102,900	1,226.50	126,206,850	貸付株式数 1,200株
オエノンホールディングス	45,100	348.00	15,694,800	貸付株式数 25,100株
養命酒製造	5,000	1,887.00	9,435,000	貸付株式数 3,000株
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	118,100	2,016.50	238,148,650	貸付株式数 300株
ライフドリンク カンパニー	2,200	4,755.00	10,461,000	貸付株式数 1,500株
サントリー食品インターナショナル	106,200	4,717.00	500,945,400	貸付株式数 300株
ダイドーグループホールディングス	8,500	5,890.00	50,065,000	貸付株式数 4,600株
伊藤園	51,100	4,417.00	225,708,700	貸付株式数 7,500株
キーコーヒー	16,900	2,085.00	35,236,500	貸付株式数 8,600株
ユニカフェ	2,800	923.00	2,584,400	貸付株式数 1,800株
ジャパンフーズ	1,300	1,364.00	1,773,200	貸付株式数 900株
日清オイリオグループ	21,200	4,445.00	94,234,000	
不二製油グループ本社	35,100	2,480.50	87,065,550	
かどや製油	1,000	3,675.00	3,675,000	
J-オイルミルズ	17,300	1,955.00	33,821,500	貸付株式数 5,600株
ローソン	34,500	7,237.00	249,676,500	
サンエー	12,400	4,615.00	57,226,000	貸付株式数 6,800株
カワチ薬品	12,700	2,691.00	34,175,700	貸付株式数 6,900株
エービーシー・マート	70,900	2,410.00	170,869,000	貸付株式数 700株
ハードオフコーポレーション	5,000	1,647.00	8,235,000	
高千穂交易	4,500	3,765.00	16,942,500	貸付株式数 2,500株
アスクル	33,500	2,167.00	72,594,500	貸付株式数 22,200株
ゲオホールディングス	18,200	2,153.00	39,184,600	貸付株式数 7,100株
アダストリア	19,600	3,200.00	62,720,000	貸付株式数 11,900株
ジーフット	7,300	292.00	2,131,600	貸付株式数 4,000株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,200	699.00	838,800	
オルパヘルスケアホールディングス	1,300	1,811.00	2,354,300	

伊藤忠食品	3,600	7,760.00	27,936,000	貸付株式数 1,400株
くら寿司	19,000	3,410.00	64,790,000	貸付株式数 10,700株
キャンドウ	5,800	2,725.00	15,805,000	貸付株式数 2,600株
エレマテック	14,500	1,778.00	25,781,000	
I Kホールディングス	2,900	328.00	951,200	貸付株式数 1,600株
パルグループホールディングス	31,800	2,247.00	71,454,600	貸付株式数 1,000株
エディオン	64,100	1,569.00	100,572,900	貸付株式数 43,000株
あらた	24,800	3,195.00	79,236,000	
サーラコーポレーション	34,000	734.00	24,956,000	貸付株式数 19,000株
ワッツ	4,400	595.00	2,618,000	貸付株式数 3,000株
トーメンデバイス	2,300	5,290.00	12,167,000	貸付株式数 300株
ハローズ	7,400	4,340.00	32,116,000	貸付株式数 4,000株
J Pホールディングス	40,300	457.00	18,417,100	貸付株式数 2,100株
フジオフードグループ本社	18,200	1,414.00	25,734,800	貸付株式数 12,000株
あみやき亭	3,900	4,410.00	17,199,000	貸付株式数 1,900株
東京エレクトロン デバイス	16,200	5,040.00	81,648,000	貸付株式数 8,800株
ひらまつ	21,400	268.00	5,735,200	
円谷フィールズホールディングス	27,800	1,395.00	38,781,000	貸付株式数 14,800株
双日	180,400	3,309.00	596,943,600	
アルフレッサ ホールディングス	162,600	2,408.50	391,622,100	貸付株式数 400株
大黒天物産	5,000	7,170.00	35,850,000	
ハニーズホールディングス	12,800	1,637.00	20,953,600	貸付株式数 7,000株
ファーマライズホールディングス	2,400	651.00	1,562,400	貸付株式数 1,300株
キッコーマン	99,900	8,698.00	868,930,200	貸付株式数 2,000株
味の素	358,400	5,516.00	1,976,934,400	貸付株式数 198,000株
ブルドックソース	8,000	2,183.00	17,464,000	貸付株式数 4,400株
キューピー	81,000	2,560.50	207,400,500	貸付株式数 44,400株 (21,100株)
ハウス食品グループ本社	51,900	3,159.00	163,952,100	

カゴメ	64,900	3,127.00	202,942,300	
焼津水産化学工業	3,600	1,217.00	4,381,200	
アリアケジャパン	15,000	4,505.00	67,575,000	
ピエトロ	1,200	1,818.00	2,181,600	
エバラ食品工業	3,600	2,869.00	10,328,400	
やまみ	800	3,350.00	2,680,000	
ニチレイ	69,100	3,503.00	242,057,300	
横浜冷凍	44,100	1,056.00	46,569,600	貸付株式数 300株
東洋水産	76,200	7,600.00	579,120,000	
イトアンドホールディングス	7,100	2,112.00	14,995,200	貸付株式数 4,500株
大冷	1,200	1,939.00	2,326,800	貸付株式数 500株
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,800	1,066.00	7,248,800	貸付株式数 4,500株
日清食品ホールディングス	159,100	4,938.00	785,635,800	貸付株式数 600株
永谷園ホールディングス	7,400	2,175.00	16,095,000	貸付株式数 2,800株
一正蒲鉾	3,600	750.00	2,700,000	
フジッコ	15,500	1,975.00	30,612,500	
ロック・フィールド	16,900	1,623.00	27,428,700	貸付株式数 10,200株
日本たばこ産業	916,300	3,757.00	3,442,539,100	
ケンコーマヨネーズ	10,400	1,724.00	17,929,600	
わらべや日洋ホールディングス	10,100	3,420.00	34,542,000	貸付株式数 6,000株
なとり	9,500	2,105.00	19,997,500	貸付株式数 4,800株
イフジ産業	1,600	1,350.00	2,160,000	貸付株式数 100株 (100株)
ファーマフーズ	21,700	1,009.00	21,895,300	貸付株式数 13,300株
北の達人コーポレーション	64,600	211.00	13,630,600	貸付株式数 38,200株 (9,800株)
ユーグレナ	93,900	690.00	64,791,000	貸付株式数 54,500株
紀文食品	13,100	1,225.00	16,047,500	貸付株式数 7,200株
ピックルスホールディングス	8,800	1,215.00	10,692,000	貸付株式数 4,800株
スター・マイカ・ホールディングス	17,500	635.00	11,112,500	貸付株式数 4,100株
SREホールディングス	6,500	2,686.00	17,459,000	貸付株式数 400株
ADワークスグループ	21,200	238.00	5,045,600	貸付株式数 3,700株
片倉工業	14,100	1,685.00	23,758,500	貸付株式数

				7,700株
グンゼ	10,900	5,080.00	55,372,000	貸付株式数 5,900株
ヒューリック	351,800	1,499.50	527,524,100	
神栄	1,300	1,870.00	2,431,000	
ラサ商事	5,800	1,554.00	9,013,200	
アルペン	13,400	1,950.00	26,130,000	貸付株式数 7,400株
ハブ	2,900	756.00	2,192,400	
ラクーンホールディングス	12,700	651.00	8,267,700	貸付株式数 8,500株
クオールホールディングス	22,300	1,726.00	38,489,800	
アルコニックス	21,300	1,361.00	28,989,300	貸付株式数 11,700株
神戸物産	125,400	3,941.00	494,201,400	
ソリトンシステムズ	7,900	1,344.00	10,617,600	貸付株式数 400株
ジンズホールディングス	9,600	4,620.00	44,352,000	貸付株式数 5,200株
ビックカメラ	86,200	1,374.00	118,438,800	貸付株式数 47,600株
DCMホールディングス	85,600	1,317.00	112,735,200	
ペッパーフードサービス	37,600	99.00	3,722,400	貸付株式数 20,800株
ハイパー	2,000	308.00	616,000	
M o n o t a R O	229,700	1,557.50	357,757,750	
東京一番フーズ	2,100	517.00	1,085,700	貸付株式数 600株
DDグループ	5,800	1,288.00	7,470,400	貸付株式数 3,800株
あい ホールディングス	25,900	2,328.00	60,295,200	貸付株式数 17,000株
ディーブイエックス	2,500	1,086.00	2,715,000	
きちりホールディングス	2,100	1,017.00	2,135,700	貸付株式数 1,300株
J. フロント リテイリング	185,900	1,305.00	242,599,500	
ドトール・日レスホールディングス	28,700	2,220.00	63,714,000	貸付株式数 15,600株
マツキヨココカラ&カンパニー	294,800	2,562.50	755,425,000	貸付株式数 86,500株
ブロンコビリー	9,500	3,175.00	30,162,500	貸付株式数 5,200株
Z O Z O	103,300	3,242.00	334,898,600	貸付株式数 58,100株
トレジャー・ファクトリー	7,800	1,239.00	9,664,200	貸付株式数 4,800株
物語コーポレーション	27,100	4,450.00	120,595,000	貸付株式数 14,900株
三越伊勢丹ホールディングス	272,900	1,599.50	436,503,550	
東洋紡	66,300	1,079.00	71,537,700	
ユニチカ	49,600	171.00	8,481,600	貸付株式数

				8,200株
富士紡ホールディングス	6,700	3,885.00	26,029,500	
日清紡ホールディングス	116,300	1,159.00	134,791,700	貸付株式数 63,800株
倉敷紡績	11,500	2,950.00	33,925,000	
ダイワボウホールディングス	71,700	3,050.00	218,685,000	貸付株式数 200株
シキボウ	7,100	1,160.00	8,236,000	貸付株式数 3,900株 (3,900株)
日東紡績	19,400	4,775.00	92,635,000	
トヨタ紡織	64,500	2,362.50	152,381,250	
マクニカホールディングス	38,300	7,122.00	272,772,600	貸付株式数 22,400株
H a m e e	5,600	990.00	5,544,000	貸付株式数 2,300株
マーケットエンタープライズ	900	1,047.00	942,300	貸付株式数 600株
ラクト・ジャパン	6,300	1,918.00	12,083,400	貸付株式数 3,400株
ウエルシアホールディングス	84,100	2,514.50	211,469,450	貸付株式数 55,400株
クリエイトSDホールディングス	26,800	3,085.00	82,678,000	貸付株式数 15,900株
グリムス	6,800	2,080.00	14,144,000	貸付株式数 3,700株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,500	1,048.00	25,676,000	
八洲電機	13,100	1,348.00	17,658,800	貸付株式数 7,200株
メディアスホールディングス	10,400	777.00	8,080,800	貸付株式数 1,300株
レスターホールディングス	13,800	2,838.00	39,164,400	
ジオリーヴグループ	2,100	1,336.00	2,805,600	
丸善CHIホールディングス	10,600	333.00	3,529,800	
大光	3,800	622.00	2,363,600	貸付株式数 2,500株
OCHIホールディングス	2,000	1,506.00	3,012,000	貸付株式数 1,400株
TOKAIホールディングス	88,000	983.00	86,504,000	
黒谷	2,500	599.00	1,497,500	貸付株式数 1,700株
ミサワ	1,800	680.00	1,224,000	
ティーライフ	1,200	1,425.00	1,710,000	貸付株式数 600株
C o m i n i x	1,800	815.00	1,467,000	
エー・ピーホールディングス	2,200	934.00	2,054,800	貸付株式数 500株 (500株)
三洋貿易	18,300	1,230.00	22,509,000	
チムニー	2,800	1,442.00	4,037,600	

シュッピン	14,600	1,154.00	16,848,400	貸付株式数 7,900株
ビューティガレージ	5,100	2,124.00	10,832,400	
オイシックス・ラ・大地	21,800	1,370.00	29,866,000	貸付株式数 13,300株
ウイン・パートナーズ	10,500	1,212.00	12,726,000	貸付株式数 6,400株
ネクステージ	37,000	2,568.00	95,016,000	貸付株式数 23,800株 (6,900株)
ジョイフル本田	47,100	1,870.00	88,077,000	
鳥貴族ホールディングス	6,000	3,350.00	20,100,000	貸付株式数 3,400株
ホットランド	12,400	1,852.00	22,964,800	貸付株式数 7,400株
すかいらーくホールディングス	221,500	2,163.50	479,215,250	貸付株式数 142,900株 (1,200株)
SFPホールディングス	8,900	2,130.00	18,957,000	貸付株式数 4,800株
綿半ホールディングス	12,600	1,432.00	18,043,200	貸付株式数 6,200株
日本毛織	40,500	1,359.00	55,039,500	貸付株式数 2,400株
ダイトウボウ	13,900	91.00	1,264,900	
トーア紡コーポレーション	3,300	430.00	1,419,000	貸付株式数 1,500株
ダイドーリミテッド	12,300	443.00	5,448,900	貸付株式数 6,400株
ヨシックスホールディングス	2,900	2,749.00	7,972,100	貸付株式数 900株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	45,200	1,022.00	46,194,400	貸付株式数 29,500株
野村不動産ホールディングス	83,900	3,823.00	320,749,700	貸付株式数 200株
三重交通グループホールディングス	32,300	606.00	19,573,800	貸付株式数 17,800株
サムティ	24,000	2,477.00	59,448,000	貸付株式数 13,300株
ディア・ライフ	25,700	953.00	24,492,100	貸付株式数 13,800株
コーセーアールイー	2,700	1,096.00	2,959,200	
地主	11,500	2,232.00	25,668,000	貸付株式数 6,500株
プレサンスコーポレーション	23,900	1,640.00	39,196,000	貸付株式数 15,300株
フィル・カンパニー	2,300	615.00	1,414,500	
THEグローバル社	4,900	404.00	1,979,600	
ハウスコム	1,300	920.00	1,196,000	
JPMC	8,700	1,117.00	9,717,900	
サンセイランディック	2,500	1,010.00	2,525,000	



エストラスト	900	661.00	594,900	貸付株式数 300株
フージャースホールディングス	23,300	1,089.00	25,373,700	
オープンハウスグループ	55,300	4,287.00	237,071,100	貸付株式数 1,700株 (1,600株)
東急不動産ホールディングス	453,500	953.30	432,321,550	貸付株式数 208,500株
飯田グループホールディングス	144,500	2,201.50	318,116,750	貸付株式数 89,900株 (200株)
イーグランド	1,300	1,542.00	2,004,600	
ムゲンエステート	5,600	1,117.00	6,255,200	
帝国繊維	17,300	2,089.00	36,139,700	貸付株式数 9,600株
日本コークス工業	155,800	125.00	19,475,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,300	667.00	4,869,100	貸付株式数 4,700株
ミタチ産業	2,300	1,128.00	2,594,400	貸付株式数 1,500株
BEENOS	6,600	1,396.00	9,213,600	貸付株式数 4,400株
あさひ	15,000	1,272.00	19,080,000	貸付株式数 8,200株
日本調剤	11,000	1,428.00	15,708,000	貸付株式数 4,000株
コスモス薬品	16,000	15,965.00	255,440,000	貸付株式数 2,500株
シップヘルスケアホールディングス	58,200	2,302.50	134,005,500	
トーエル	4,000	753.00	3,012,000	貸付株式数 2,600株
ソフトクリエイトホールディングス	12,600	1,728.00	21,772,800	貸付株式数 6,600株
セブン&アイ・ホールディングス	558,400	5,645.00	3,152,168,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	109,700	1,134.00	124,399,800	貸付株式数 60,500株
明治電機工業	6,000	1,426.00	8,556,000	
ツルハホールディングス	34,000	12,980.00	441,320,000	貸付株式数 400株
デリカフーズホールディングス	3,900	586.00	2,285,400	貸付株式数 400株
スターティアホールディングス	2,300	1,324.00	3,045,200	貸付株式数 1,300株
サンマルクホールディングス	13,000	2,148.00	27,924,000	貸付株式数 7,100株
フェリシモ	2,000	952.00	1,904,000	貸付株式数 1,300株
トリドールホールディングス	45,400	4,213.00	191,270,200	貸付株式数 25,000株
帝人	147,400	1,365.50	201,274,700	
東レ	1,027,800	746.80	767,561,040	貸付株式数

				6,200株
クラレ	223,600	1,447.00	323,549,200	
旭化成	1,037,800	1,076.50	1,117,191,700	貸付株式数 553,000株 (512,700株)
TOKYO BASE	19,400	303.00	5,878,200	貸付株式数 11,200株
稲葉製作所	7,800	1,510.00	11,778,000	貸付株式数 5,100株
宮地エンジニアリンググループ	7,900	3,300.00	26,070,000	
トーカロ	45,600	1,482.00	67,579,200	
アルファ	3,200	1,404.00	4,492,800	貸付株式数 2,100株
SUMCO	280,800	2,058.50	578,026,800	
川田テクノロジーズ	3,700	6,770.00	25,049,000	
RS Technologies	10,600	2,952.00	31,291,200	
ジェイテックコーポレーション	1,200	2,068.00	2,481,600	貸付株式数 600株
信和	5,700	762.00	4,343,400	
ビーロット	5,700	970.00	5,529,000	
ファーストブラザーズ	1,700	1,023.00	1,739,100	貸付株式数 1,100株
And Doホールディングス	9,100	1,058.00	9,627,800	貸付株式数 5,000株
シーアールイー	8,400	1,464.00	12,297,600	貸付株式数 4,200株
ケイアイスター不動産	7,300	3,235.00	23,615,500	貸付株式数 4,600株
アグレ都市デザイン	1,500	1,563.00	2,344,500	貸付株式数 400株
グッドコムアセット	14,000	742.00	10,388,000	貸付株式数 1,600株
ジェイ・エス・ビー	7,500	2,521.00	18,907,500	
ロードスターキャピタル	9,800	2,000.00	19,600,000	
テンポイノベーション	2,500	1,034.00	2,585,000	貸付株式数 1,500株
グローバル・リンク・マネジメント	1,600	2,260.00	3,616,000	
フェイスネットワーク	2,300	1,484.00	3,413,200	
霞ヶ関キャピタル	4,100	8,510.00	34,891,000	貸付株式数 2,500株
住江織物	1,800	2,266.00	4,078,800	貸付株式数 1,100株
日本フェルト	4,700	430.00	2,021,000	貸付株式数 3,000株
イチカワ	1,100	1,620.00	1,782,000	
エコナックホールディングス	7,600	132.00	1,003,200	
日東製網	900	1,560.00	1,404,000	
芦森工業	1,700	2,092.00	3,556,400	
アツギ	6,000	502.00	3,012,000	貸付株式数 500株 (500株)

ウイルプラスホールディングス	1,400	1,007.00	1,409,800	
JMホールディングス	12,200	2,175.00	26,535,000	貸付株式数 6,600株
コメダホールディングス	39,700	2,778.00	110,286,600	貸付株式数 2,300株
サツドラホールディングス	4,100	794.00	3,255,400	貸付株式数 2,800株
アレンザホールディングス	12,100	1,057.00	12,789,700	貸付株式数 6,600株
串カツ田中ホールディングス	4,300	1,583.00	6,806,900	
バロックジャパンリミテッド	12,600	828.00	10,432,800	貸付株式数 8,400株
クスリのアオキホールディングス	43,300	3,341.00	144,665,300	貸付株式数 14,100株
ダイニック	2,700	725.00	1,957,500	
共和レザー	4,900	746.00	3,655,400	貸付株式数 1,300株 (1,300株)
ピーバンドットコム	1,100	369.00	405,900	
力の源ホールディングス	7,300	1,394.00	10,176,200	貸付株式数 3,900株
FOOD & LIFE COMPANIES	86,400	2,835.50	244,987,200	
アセンテック	6,200	504.00	3,124,800	
セーレン	29,600	2,469.00	73,082,400	貸付株式数 17,000株
ソトー	2,700	701.00	1,892,700	
東海染工	800	870.00	696,000	
小松マテーレ	22,200	779.00	17,293,800	
ワコールホールディングス	31,400	3,441.00	108,047,400	
ホギメディカル	20,300	3,490.00	70,847,000	
クラウドディアホールディングス	1,900	371.00	704,900	貸付株式数 800株
T S I ホールディングス	49,900	755.00	37,674,500	貸付株式数 18,700株
マツオカコーポレーション	2,600	1,445.00	3,757,000	
ワールド	21,700	1,695.00	36,781,500	
T I S	168,000	3,092.00	519,456,000	貸付株式数 400株
テクミラホールディングス	3,900	473.00	1,844,700	貸付株式数 300株 (300株)
グリー	41,200	590.00	24,308,000	
GMOペパボ	1,900	1,183.00	2,247,700	
コーエーテクモホールディングス	96,200	1,623.50	156,180,700	貸付株式数 52,400株
三菱総合研究所	7,500	4,645.00	34,837,500	
ボルテージ	2,400	245.00	588,000	貸付株式数 1,600株
電算	1,000	1,516.00	1,516,000	
AGS	3,500	840.00	2,940,000	

ファインデックス	12,200	1,000.00	12,200,000	
ブレインパッド	11,500	1,078.00	12,397,000	貸付株式数 400株
K L a b	28,200	288.00	8,121,600	貸付株式数 16,800株 (16,200株)
ポールトゥウィンホールディングス	26,200	471.00	12,340,200	
ネクソン	343,700	2,694.50	926,099,650	
アイスタイル	45,600	412.00	18,787,200	貸付株式数 25,100株
エムアップホールディングス	18,800	1,044.00	19,627,200	貸付株式数 6,400株
エイチーム	9,100	565.00	5,141,500	貸付株式数 6,200株
エニグモ	19,500	348.00	6,786,000	貸付株式数 11,000株
テクノスジャパン	7,600	625.00	4,750,000	
e n i s h	8,500	167.00	1,419,500	貸付株式数 4,700株
コロプラ	59,600	607.00	36,177,200	貸付株式数 23,200株 (19,100株)
オルトプラス	7,300	142.00	1,036,600	貸付株式数 4,900株
ブロードリーフ	72,900	574.00	41,844,600	
クロス・マーケティンググループ	5,100	555.00	2,830,500	貸付株式数 2,800株
デジタルハーツホールディングス	9,600	986.00	9,465,600	貸付株式数 1,900株
システム情報	4,100	927.00	3,800,700	
メディアドゥ	6,900	1,395.00	9,625,500	貸付株式数 100株
じげん	44,800	529.00	23,699,200	
ブイキューブ	18,400	310.00	5,704,000	貸付株式数 11,100株
エンカレッジ・テクノロジー	2,000	574.00	1,148,000	
サイバーリンクス	3,300	761.00	2,511,300	
ディー・エル・イー	6,100	199.00	1,213,900	貸付株式数 4,100株
フィックスターズ	17,300	1,252.00	21,659,600	貸付株式数 9,500株
CARTA HOLDINGS	7,200	1,363.00	9,813,600	貸付株式数 3,900株
オブティム	15,800	834.00	13,177,200	貸付株式数 8,600株 (3,600株)
セレス	6,200	1,146.00	7,105,200	貸付株式数 1,300株
S H I F T	10,200	33,760.00	344,352,000	貸付株式数 4,100株
特種東海製紙	8,400	3,995.00	33,558,000	貸付株式数

				3,700株
ティーガイア	16,100	1,945.00	31,314,500	貸付株式数 100株
セック	1,600	5,100.00	8,160,000	
テクマトリックス	28,000	1,689.00	47,292,000	貸付株式数 10,000株
プロシップ	7,400	1,390.00	10,286,000	貸付株式数 3,600株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	40,000	2,328.50	93,140,000	貸付株式数 100株
GMOペイメントゲートウェイ	30,700	9,224.00	283,176,800	貸付株式数 15,000株
ザッパラス	2,300	472.00	1,085,600	
システムリサーチ	5,300	3,095.00	16,403,500	貸付株式数 2,600株
インターネットイニシアティブ	73,400	2,843.00	208,676,200	貸付株式数 43,700株
さくらインターネット	17,200	2,121.00	36,481,200	貸付株式数 11,500株
ヴィンクス	2,000	2,018.00	4,036,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,700	2,657.00	12,487,900	貸付株式数 2,400株
SRAホールディングス	7,900	3,710.00	29,309,000	
システムインテグレータ	2,500	410.00	1,025,000	
朝日ネット	16,500	623.00	10,279,500	
eBASE	21,600	754.00	16,286,400	
アバントグループ	19,400	1,423.00	27,606,200	
アドソル日進	6,500	1,577.00	10,250,500	
ODKソリューションズ	1,600	611.00	977,600	貸付株式数 1,100株
フリービット	8,000	1,411.00	11,288,000	貸付株式数 4,800株
コムチュア	22,200	1,845.00	40,959,000	
サイバーコム	1,400	1,905.00	2,667,000	
アステリア	12,000	642.00	7,704,000	貸付株式数 1,600株
アイル	7,200	3,070.00	22,104,000	
王子ホールディングス	639,100	561.50	358,854,650	貸付株式数 418,100株
日本製紙	86,600	1,300.00	112,580,000	貸付株式数 37,600株
三菱製紙	11,500	570.00	6,555,000	貸付株式数 6,300株
北越コーポレーション	75,400	1,391.00	104,881,400	貸付株式数 49,200株
中越パルプ工業	3,400	1,909.00	6,490,600	貸付株式数 1,800株
巴川コーポレーション	2,400	1,089.00	2,613,600	
大王製紙	67,800	1,126.00	76,342,800	
阿波製紙	2,300	382.00	878,600	貸付株式数 1,600株

マークラインズ	8,300	2,956.00	24,534,800	
メディカル・データ・ビジョン	18,300	667.00	12,206,100	貸付株式数 10,100株
g u m i	22,700	431.00	9,783,700	貸付株式数 14,500株
ショーケース	2,000	305.00	610,000	
モバイルファクトリー	1,800	645.00	1,161,000	貸付株式数 1,200株
テラスカイ	6,600	1,801.00	11,886,600	貸付株式数 4,000株
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,900	1,639.00	14,587,100	
P C I ホールディングス	3,300	1,008.00	3,326,400	貸付株式数 600株
アイビーシー	1,300	460.00	598,000	
ネオジャパン	5,100	1,011.00	5,156,100	貸付株式数 2,800株
P R T I M E S	3,100	1,818.00	5,635,800	貸付株式数 300株
ラクス	72,600	2,435.00	176,781,000	貸付株式数 43,000株
ランドコンピュータ	4,100	892.00	3,657,200	
ダブルスタンダード	4,700	1,577.00	7,411,900	貸付株式数 3,100株
オープンドア	9,000	781.00	7,029,000	貸付株式数 6,100株
マイネット	2,700	289.00	780,300	
アカツキ	7,300	2,479.00	18,096,700	
ベネフィットジャパン	500	1,259.00	629,500	貸付株式数 300株
U b i c o mホールディングス	4,800	1,662.00	7,977,600	貸付株式数 2,500株
カナミックネットワーク	16,500	417.00	6,880,500	貸付株式数 9,600株
ノムラシステムコーポレーション	9,300	115.00	1,069,500	貸付株式数 6,100株
レンゴー	139,700	962.30	134,433,310	
トーモク	8,900	2,218.00	19,740,200	
ザ・パック	11,400	3,290.00	37,506,000	貸付株式数 6,300株
チェンジホールディングス	33,400	1,419.00	47,394,600	貸付株式数 20,700株
シンクロ・フード	5,400	642.00	3,466,800	貸付株式数 3,600株
オークネット	5,700	1,885.00	10,744,500	貸付株式数 3,900株
キャピタル・アセット・プランニング	1,600	736.00	1,177,600	貸付株式数 1,000株
セグエグループ	2,700	925.00	2,497,500	貸付株式数 1,400株
エイトレッド	1,300	1,421.00	1,847,300	

マクロミル	30,100	796.00	23,959,600	貸付株式数 100株 (100株)
ビーグリー	1,800	1,203.00	2,165,400	
オロ	5,600	2,637.00	14,767,200	貸付株式数 3,000株
ユーザーローカル	5,600	1,807.00	10,119,200	貸付株式数 3,000株
テモナ	2,000	216.00	432,000	貸付株式数 1,300株
ニーズウェル	4,700	764.00	3,590,800	貸付株式数 3,200株
マネーフォワード	34,200	4,000.00	136,800,000	貸付株式数 20,400株
サインポスト	3,300	378.00	1,247,400	貸付株式数 2,200株
レゾナック・ホールディングス	148,300	2,978.00	441,637,400	貸付株式数 92,500株
住友化学	1,138,400	358.10	407,661,040	
住友精化	7,200	5,150.00	37,080,000	貸付株式数 3,500株
日産化学	72,100	5,577.00	402,101,700	貸付株式数 1,500株
ラサ工業	5,900	2,141.00	12,631,900	
クレハ	33,500	2,928.00	98,088,000	
多木化学	6,000	3,150.00	18,900,000	貸付株式数 3,300株
テイカ	13,300	1,386.00	18,433,800	
石原産業	25,400	1,412.00	35,864,800	
片倉コープアグリ	2,000	1,101.00	2,202,000	貸付株式数 1,000株
日本曹達	18,100	5,580.00	100,998,000	
東ソー	204,800	1,900.00	389,120,000	
トクヤマ	49,500	2,468.00	122,166,000	貸付株式数 700株
セントラル硝子	16,400	2,706.00	44,378,400	
東亜合成	76,900	1,342.50	103,238,250	
大阪ソーダ	10,700	8,880.00	95,016,000	貸付株式数 5,900株
関東電化工業	29,700	863.00	25,631,100	
SUN ASTERISK	10,900	961.00	10,474,900	貸付株式数 5,900株
デンカ	55,800	2,583.50	144,159,300	貸付株式数 35,200株
イビデン	80,700	7,501.00	605,330,700	貸付株式数 50,700株
信越化学工業	1,391,100	5,637.00	7,841,630,700	貸付株式数 857,800株
日本カーバイド工業	5,700	1,470.00	8,379,000	貸付株式数 200株
プラスアルファ・コンサルティング	9,100	2,633.00	23,960,300	

電算システムホールディングス	6,800	2,814.00	19,135,200	貸付株式数 4,100株
堺化学工業	11,700	1,926.00	22,534,200	貸付株式数 6,300株
第一稀元素化学工業	16,800	993.00	16,682,400	
エア・ウォーター	144,700	1,928.00	278,981,600	
日本酸素ホールディングス	148,800	3,792.00	564,249,600	
日本化学工業	5,600	1,908.00	10,684,800	
東邦アセチレン	9,000	380.00	3,420,000	
日本パーカラライジング	68,400	1,146.00	78,386,400	貸付株式数 20,900株
高压ガス工業	22,300	885.00	19,735,500	
チタン工業	1,100	1,143.00	1,257,300	
四国化成ホールディングス	19,600	1,819.00	35,652,400	貸付株式数 10,800株
戸田工業	3,500	1,556.00	5,446,000	貸付株式数 1,700株
ステラ ケミファ	8,300	3,285.00	27,265,500	貸付株式数 3,600株
保土谷化学工業	4,800	3,630.00	17,424,000	
日本触媒	22,300	5,539.00	123,519,700	貸付株式数 13,000株
大日精化工業	10,700	2,618.00	28,012,600	
カネカ	38,900	3,602.00	140,117,800	
協和キリン	185,600	2,414.50	448,131,200	
APPIER GROUP	52,500	1,798.00	94,395,000	
三菱瓦斯化学	114,600	2,320.00	265,872,000	
三井化学	126,500	4,358.00	551,287,000	
JSR	166,700	4,025.00	670,967,500	
東京応化工業	73,200	2,996.50	219,343,800	
大阪有機化学工業	12,800	2,592.00	33,177,600	貸付株式数 5,800株
三菱ケミカルグループ	1,121,500	895.50	1,004,303,250	
KHネオケム	23,400	2,308.00	54,007,200	
ダイセル	197,200	1,423.00	280,615,600	貸付株式数 300株
住友ベークライト	21,500	7,393.00	158,949,500	
積水化学工業	308,200	2,091.00	644,446,200	貸付株式数 58,000株
日本ゼオン	105,200	1,308.50	137,654,200	貸付株式数 200株
アイカ工業	38,700	3,420.00	132,354,000	貸付株式数 19,200株
UBE	73,000	2,369.00	172,937,000	貸付株式数 10,200株
積水樹脂	22,900	2,523.00	57,776,700	
タキロンシーアイ	39,100	650.00	25,415,000	
旭有機材	10,200	3,780.00	38,556,000	
ニチバン	8,300	1,755.00	14,566,500	貸付株式数 4,800株



リケンテクノス	33,000	864.00	28,512,000	
大倉工業	7,100	2,542.00	18,048,200	貸付株式数 3,900株
積水化成品工業	21,500	500.00	10,750,000	
群栄化学工業	3,600	3,185.00	11,466,000	
タイガースポリマー	3,900	896.00	3,494,400	
ミライアル	2,900	1,449.00	4,202,100	
ダイキアクシス	3,500	722.00	2,527,000	貸付株式数 2,300株
ダイキョーニシカワ	33,900	707.00	23,967,300	
竹本容器	3,200	772.00	2,470,400	
森六ホールディングス	8,000	2,860.00	22,880,000	
恵和	11,000	1,250.00	13,750,000	貸付株式数 6,000株
日本化薬	117,200	1,347.50	157,927,000	
カーリットホールディングス	16,500	923.00	15,229,500	
ソルクシーズ	6,900	401.00	2,766,900	
CLホールディングス	3,700	855.00	3,163,500	貸付株式数 2,200株
プレステージ・インターナショナル	73,700	601.00	44,293,700	貸付株式数 37,500株
フェイス	2,400	478.00	1,147,200	
プロトコーポレーション	16,800	1,296.00	21,772,800	
ハイマックス	4,800	1,448.00	6,950,400	貸付株式数 2,600株
アミューズ	9,600	1,503.00	14,428,800	貸付株式数 1,700株
野村総合研究所	340,300	4,172.00	1,419,731,600	貸付株式数 221,300株
ドリームインキュベータ	5,400	3,115.00	16,821,000	貸付株式数 2,400株
サイバネットシステム	11,000	1,093.00	12,023,000	
クイック	10,900	2,522.00	27,489,800	
TAC	4,200	200.00	840,000	
CEホールディングス	4,400	633.00	2,785,200	貸付株式数 1,000株
日本システム技術	5,000	2,903.00	14,515,000	
電通グループ	154,700	3,720.00	575,484,000	
インテージホールディングス	17,400	1,644.00	28,605,600	貸付株式数 9,500株
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,300	1,220.00	6,466,000	貸付株式数 2,000株
東邦システムサイエンス	5,000	1,264.00	6,320,000	
ぴあ	5,400	3,400.00	18,360,000	貸付株式数 2,900株
イオンファンタジー	5,700	2,546.00	14,512,200	貸付株式数 3,700株
ソースネクスト	70,300	159.00	11,177,700	貸付株式数 48,200株
シーティーエス	19,900	680.00	13,532,000	貸付株式数

				5,500株 (5,500株)
NEXYZ. Group	2,700	704.00	1,900,800	
インフォコム	19,800	2,428.00	48,074,400	
メディカルシステムネットワーク	17,500	664.00	11,620,000	
日本精化	10,200	3,110.00	31,722,000	貸付株式数 5,500株
扶桑化学工業	16,300	4,110.00	66,993,000	貸付株式数 6,100株
トリケミカル研究所	18,600	3,675.00	68,355,000	貸付株式数 7,700株
シンプレクス・ホールディングス	23,100	2,656.00	61,353,600	
HEROZ	5,200	1,610.00	8,372,000	貸付株式数 3,300株
ラクスル	37,000	1,171.00	43,327,000	貸付株式数 14,900株
メルカリ	93,200	2,456.00	228,899,200	貸付株式数 51,000株
I P S	4,400	2,077.00	9,138,800	貸付株式数 2,700株
F I G	9,900	311.00	3,078,900	貸付株式数 6,700株
システムサポート	5,900	1,899.00	11,204,100	
ADEKA	53,500	2,867.00	153,384,500	貸付株式数 100株
日油	46,300	6,853.00	317,293,900	
ミヨシ油脂	3,200	1,271.00	4,067,200	
新日本理化	11,700	197.00	2,304,900	
ハリマ化成グループ	8,400	823.00	6,913,200	貸付株式数 4,700株
イーソル	11,100	581.00	6,449,100	貸付株式数 6,000株
東海ソフト	1,300	1,183.00	1,537,900	
ウイングアーク1st	15,900	2,900.00	46,110,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,100	1,270.00	5,207,000	貸付株式数 2,200株
サーバーワークス	3,100	3,145.00	9,749,500	
東名	600	1,807.00	1,084,200	貸付株式数 400株
ヴィッツ	800	880.00	704,000	
トビラシステムズ	2,400	896.00	2,150,400	
S a n s a n	50,400	1,470.00	74,088,000	貸付株式数 32,800株
L i n k - U	2,000	730.00	1,460,000	貸付株式数 1,100株
ギフトィ	13,400	1,652.00	22,136,800	貸付株式数 9,100株
花王	346,900	5,845.00	2,027,630,500	
第一工業製薬	6,100	1,935.00	11,803,500	
石原ケミカル	6,900	1,906.00	13,151,400	貸付株式数 1,200株

日華化学	3,400	943.00	3,206,200	貸付株式数 2,300株
ニイタカ	1,500	1,867.00	2,800,500	
三洋化成工業	9,400	4,360.00	40,984,000	貸付株式数 900株
メドレー	20,600	4,130.00	85,078,000	貸付株式数 4,200株 (4,200株)
ベース	5,300	3,485.00	18,470,500	貸付株式数 2,900株
JMDC	26,200	4,042.00	105,900,400	貸付株式数 14,400株
武田薬品工業	1,359,400	4,288.00	5,829,107,200	貸付株式数 734,100株
アステラス製薬	1,347,400	1,766.00	2,379,508,400	貸付株式数 605,400株
住友ファーマ	113,900	486.00	55,355,400	
塩野義製薬	193,700	6,883.00	1,333,237,100	貸付株式数 1,600株
わかもと製薬	9,000	213.00	1,917,000	貸付株式数 5,000株
日本新薬	40,200	5,192.00	208,718,400	
中外製薬	480,800	5,388.00	2,590,550,400	
科研製薬	26,300	3,394.00	89,262,200	貸付株式数 2,700株
エーザイ	186,800	7,260.00	1,356,168,000	貸付株式数 25,200株
理研ビタミン	13,000	2,278.00	29,614,000	貸付株式数 7,100株
ロート製薬	148,800	2,920.50	434,570,400	
小野薬品工業	326,000	2,639.50	860,477,000	貸付株式数 141,500株
久光製薬	34,100	4,353.00	148,437,300	貸付株式数 21,700株
有機合成薬品工業	6,900	286.00	1,973,400	
持田製薬	17,600	3,310.00	58,256,000	
参天製薬	279,900	1,421.50	397,877,850	
扶桑薬品工業	5,400	1,920.00	10,368,000	
日本ケミファ	1,000	1,600.00	1,600,000	
ツムラ	48,400	2,670.50	129,252,200	
テルモ	428,200	4,672.00	2,000,550,400	貸付株式数 192,500株
H. U. グループホールディングス	46,100	2,669.00	123,040,900	貸付株式数 100株
キッセイ薬品工業	25,400	3,165.00	80,391,000	
生化学工業	26,000	771.00	20,046,000	
栄研化学	28,200	1,710.00	48,222,000	
鳥居薬品	8,200	3,650.00	29,930,000	貸付株式数 100株
JCRファーマ	52,000	1,142.00	59,384,000	貸付株式数 30,700株

東和薬品	23,600	2,410.00	56,876,000	
富士製薬工業	11,300	1,843.00	20,825,900	
ゼリア新薬工業	21,300	2,033.00	43,302,900	
そーせいグループ	50,400	1,510.00	76,104,000	貸付株式数 32,600株
第一三共	1,338,100	4,031.00	5,393,881,100	貸付株式数 731,700株
杏林製薬	33,300	1,793.00	59,706,900	貸付株式数 100株
大幸薬品	31,700	293.00	9,288,100	貸付株式数 18,500株
ダイト	11,800	1,921.00	22,667,800	
大塚ホールディングス	319,500	5,587.00	1,785,046,500	
大正製薬ホールディングス	34,100	8,671.00	295,681,100	
ペプチドリーム	74,500	1,406.00	104,747,000	貸付株式数 46,100株
大日本塗料	17,000	1,080.00	18,360,000	貸付株式数 10,200株
日本ペイントホールディングス	814,600	1,143.50	931,495,100	
関西ペイント	150,300	2,400.00	360,720,000	貸付株式数 100株
神東塗料	7,100	131.00	930,100	
中国塗料	31,500	1,691.00	53,266,500	
日本特殊塗料	6,100	1,220.00	7,442,000	
藤倉化成	17,700	439.00	7,770,300	
太陽ホールディングス	26,700	3,040.00	81,168,000	貸付株式数 3,900株
D I C	59,900	2,724.50	163,197,550	
サカタインクス	34,100	1,355.00	46,205,500	貸付株式数 18,700株
a r t i e n c e	33,400	2,621.00	87,541,400	
T&K TOKA	13,700	1,455.00	19,933,500	貸付株式数 7,500株 (6,800株)
アルプス技研	14,900	2,652.00	39,514,800	貸付株式数 3,000株
サニックス	25,200	315.00	7,938,000	
日本空調サービス	16,900	820.00	13,858,000	
オリエンタルランド	833,200	5,274.00	4,394,296,800	貸付株式数 553,000株
フォーカスシステムズ	10,300	1,009.00	10,392,700	貸付株式数 3,200株
ダスキン	35,000	3,369.00	117,915,000	
パーク24	98,000	1,873.50	183,603,000	貸付株式数 33,300株 (33,300株)
明光ネットワークジャパン	19,100	778.00	14,859,800	貸付株式数 7,600株
ファルコホールディングス	7,100	2,123.00	15,073,300	貸付株式数 300株
クレスコ	12,600	1,947.00	24,532,200	

フジ・メディア・ホールディングス	147,500	1,610.50	237,548,750	
秀英予備校	1,900	310.00	589,000	
田谷	1,500	406.00	609,000	貸付株式数 700株
ラウンドワン	148,200	565.00	83,733,000	貸付株式数 81,300株
リゾートトラスト	68,400	2,470.00	168,948,000	貸付株式数 40,000株
オービック	51,300	23,815.00	1,221,709,500	貸付株式数 200株
ジャストシステム	22,100	3,120.00	68,952,000	
TDCソフト	14,400	2,117.00	30,484,800	
LINEヤフー	2,186,600	483.30	1,056,783,780	貸付株式数 1,473,200株
ビー・エム・エル	19,400	2,920.00	56,648,000	貸付株式数 100株
トレンドマイクロ	72,600	7,469.00	542,249,400	
IDホールディングス	10,300	1,730.00	17,819,000	
リソー教育	80,500	230.00	18,515,000	
日本オラクル	29,400	10,935.00	321,489,000	貸付株式数 1,600株
早稲田アカデミー	8,700	1,815.00	15,790,500	貸付株式数 4,800株
アルファシステムズ	4,000	2,995.00	11,980,000	
フューチャー	32,800	1,767.00	57,957,600	
CAC Holdings	8,200	1,753.00	14,374,600	
SBテクノロジー	6,500	2,400.00	15,600,000	
トーセ	2,400	713.00	1,711,200	貸付株式数 1,300株 (800株)
ユー・エス・エス	176,600	2,830.00	499,778,000	貸付株式数 6,800株
オービックビジネスコンサルタント	21,600	6,342.00	136,987,200	
アイティフォー	19,700	1,177.00	23,186,900	
東京個別指導学院	18,700	449.00	8,396,300	
東計電算	4,300	3,430.00	14,749,000	貸付株式数 2,000株
サイバーエージェント	347,900	888.60	309,143,940	貸付株式数 5,300株 (1,400株)
楽天グループ	1,349,200	648.20	874,551,440	貸付株式数 883,900株
エクスネット	1,200	1,109.00	1,330,800	
クリーク・アンド・リバー社	7,900	2,210.00	17,459,000	
SBIグローバルアセットマネジメン ト	30,800	642.00	19,773,600	貸付株式数 13,900株
テー・オー・ダブリュー	30,900	324.00	10,011,600	
大塚商会	76,200	5,677.00	432,587,400	貸付株式数 2,400株
サイボウズ	21,200	2,143.00	45,431,600	貸付株式数 400株

山田コンサルティンググループ	6,800	1,756.00	11,940,800	貸付株式数 600株
セントラルスポーツ	5,900	2,480.00	14,632,000	貸付株式数 3,400株
パラカ	5,300	1,947.00	10,319,100	貸付株式数 400株 (100株)
電通総研	18,700	5,720.00	106,964,000	
ACCESS	16,000	809.00	12,944,000	貸付株式数 9,900株
デジタルガレージ	24,500	3,555.00	87,097,500	
イーエムシステムズ	25,600	715.00	18,304,000	貸付株式数 13,200株
ウェザーニューズ	4,700	5,470.00	25,709,000	
C I J	25,500	663.00	16,906,500	貸付株式数 14,000株 (10,800株)
ビジネスエンジニアリング	2,500	4,020.00	10,050,000	貸付株式数 1,300株
日本エンタープライズ	8,800	124.00	1,091,200	
WOWOW	11,600	1,084.00	12,574,400	貸付株式数 5,100株
スカラ	14,200	747.00	10,607,400	
インテリジェント ウェイブ	4,500	1,050.00	4,725,000	貸付株式数 2,000株
フルキャストホールディングス	15,000	1,815.00	27,225,000	貸付株式数 100株
エン・ジャパン	25,600	2,670.00	68,352,000	
セルソース	4,300	1,275.00	5,482,500	貸付株式数 2,600株 (2,500株)
あすか製薬ホールディングス	15,800	1,825.00	28,835,000	
サワイグループホールディングス	35,100	5,238.00	183,853,800	
富士フイルムホールディングス	285,000	8,509.00	2,425,065,000	貸付株式数 131,400株
コニカミノルタ	345,500	419.30	144,868,150	貸付株式数 4,900株
資生堂	320,700	4,212.00	1,350,788,400	
ライオン	201,000	1,308.50	263,008,500	貸付株式数 132,100株
高砂香料工業	11,500	3,530.00	40,595,000	貸付株式数 5,000株
マンダム	33,200	1,280.00	42,496,000	貸付株式数 18,400株
ミルボン	20,900	3,625.00	75,762,500	貸付株式数 12,800株
ファンケル	67,200	2,318.00	155,769,600	貸付株式数 3,600株
コーセー	31,200	10,260.00	320,112,000	貸付株式数 18,500株
コタ	14,100	1,584.00	22,334,400	

シーボン	1,200	1,492.00	1,790,400	貸付株式数 500株
ポーラ・オルビスホールディングス	78,700	1,551.00	122,063,700	貸付株式数 41,900株
ノエビアホールディングス	13,700	5,180.00	70,966,000	
アジュバンホールディングス	2,100	936.00	1,965,600	貸付株式数 300株
新日本製薬	8,800	1,753.00	15,426,400	貸付株式数 4,600株
I - n e	3,100	2,402.00	7,446,200	貸付株式数 1,600株
アクシージア	7,800	880.00	6,864,000	貸付株式数 4,100株
エステー	11,900	1,536.00	18,278,400	
アグロ カネショウ	6,100	1,513.00	9,229,300	貸付株式数 2,500株
コニシ	44,400	1,395.00	61,938,000	
長谷川香料	29,400	3,060.00	89,964,000	
小林製薬	44,700	6,564.00	293,410,800	貸付株式数 24,600株
荒川化学工業	13,000	1,045.00	13,585,000	
メック	12,600	4,215.00	53,109,000	貸付株式数 6,900株
日本高純度化学	3,500	2,497.00	8,739,500	
タカラバイオ	41,400	1,236.00	51,170,400	貸付株式数 22,800株
J C U	17,200	3,760.00	64,672,000	貸付株式数 6,800株
新田ゼラチン	5,800	769.00	4,460,200	
O A Tアグリオ	4,400	1,757.00	7,730,800	貸付株式数 2,100株
デクセリアルズ	38,500	4,223.00	162,585,500	貸付株式数 12,300株
アース製薬	13,900	4,530.00	62,967,000	貸付株式数 7,700株
北興化学工業	15,500	1,071.00	16,600,500	
大成ラミック	4,400	2,928.00	12,883,200	
クミアイ化学工業	61,000	845.00	51,545,000	貸付株式数 33,400株
日本農薬	28,200	650.00	18,330,000	貸付株式数 15,500株
富士興産	2,500	1,944.00	4,860,000	
ニチレキ	20,000	2,459.00	49,180,000	
ユシロ化学工業	8,000	1,716.00	13,728,000	
ビーピー・カストロール	3,300	872.00	2,877,600	貸付株式数 100株 (100株)
富士石油	44,800	377.00	16,889,600	貸付株式数 17,200株
M O R E S C O	3,100	1,325.00	4,107,500	貸付株式数 1,100株

出光興産	853,000	807.50	688,797,500	
E N E O Sホールディングス	2,431,800	597.30	1,452,514,140	
コスモエネルギーホールディングス	45,500	5,924.00	269,542,000	貸付株式数 200株
ANYCOLOR	5,400	3,130.00	16,902,000	貸付株式数 600株
テスホールディングス	32,300	433.00	13,985,900	貸付株式数 21,000株
インフロニア・ホールディングス	173,100	1,446.00	250,302,600	貸付株式数 2,700株
横浜ゴム	77,700	3,294.00	255,943,800	
TOYO TIRE	88,300	2,356.50	208,078,950	
ブリヂストン	449,600	5,913.00	2,658,484,800	
住友ゴム工業	150,600	1,584.00	238,550,400	貸付株式数 300株
藤倉コンポジット	10,300	1,404.00	14,461,200	
オカモト	7,300	4,940.00	36,062,000	
アキレス	9,700	1,592.00	15,442,400	貸付株式数 1,200株
フコク	8,100	1,379.00	11,169,900	
ニッタ	15,600	3,730.00	58,188,000	
クリエートメディック	2,800	896.00	2,508,800	貸付株式数 800株 (800株)
住友理工	23,800	1,098.00	26,132,400	
三ツ星ベルト	18,700	4,520.00	84,524,000	貸付株式数 10,300株
バンドー化学	22,800	1,656.00	37,756,800	
A G C	137,000	5,334.00	730,758,000	
日本板硝子	73,300	603.00	44,199,900	貸付株式数 41,100株
石塚硝子	1,400	3,355.00	4,697,000	
有沢製作所	26,900	1,061.00	28,540,900	貸付株式数 7,800株
日本山村硝子	3,200	1,406.00	4,499,200	
日本電気硝子	62,700	3,108.00	194,871,600	貸付株式数 39,100株
オハラ	7,300	1,171.00	8,548,300	貸付株式数 3,800株
住友大阪セメント	25,600	3,819.00	97,766,400	
太平洋セメント	90,800	2,995.50	271,991,400	貸付株式数 800株
リソルホールディングス	800	5,940.00	4,752,000	貸付株式数 200株 (200株)
日本ヒューム	13,400	910.00	12,194,000	貸付株式数 7,300株
日本コンクリート工業	29,800	347.00	10,340,600	貸付株式数 16,600株 (16,600株)
三谷セキサン	6,400	5,140.00	32,896,000	貸付株式数



				2,900株
アジアパイルホールディングス	21,800	717.00	15,630,600	
東海カーボン	141,700	1,041.00	147,509,700	
日本カーボン	8,100	4,410.00	35,721,000	貸付株式数 4,400株
東洋炭素	10,800	4,915.00	53,082,000	貸付株式数 2,300株
ノリタケカンパニーリミテド	8,500	7,040.00	59,840,000	貸付株式数 2,400株
TOTO	101,400	3,824.00	387,753,600	貸付株式数 47,600株 (46,000株)
日本碍子	178,700	1,737.00	310,401,900	
日本特殊陶業	128,600	3,515.00	452,029,000	
ダントーホールディングス	5,700	1,076.00	6,133,200	貸付株式数 3,900株
MARUWA	5,700	27,660.00	157,662,000	貸付株式数 900株
品川リフラクトリーズ	18,900	1,854.00	35,040,600	
黒崎播磨	3,100	11,470.00	35,557,000	
ヨータイ	9,500	1,503.00	14,278,500	貸付株式数 100株
東京窯業	9,100	449.00	4,085,900	
ニッカトー	3,800	571.00	2,169,800	
フジミインコーポレーテッド	41,300	2,934.00	121,174,200	貸付株式数 100株
クミネ工業	2,500	1,022.00	2,555,000	
エーアンドエーマテリアル	1,800	1,338.00	2,408,400	
ニチアス	38,800	3,390.00	131,532,000	
日本製鉄	707,500	3,384.00	2,394,180,000	貸付株式数 87,600株
神戸製鋼所	317,800	1,948.00	619,074,400	貸付株式数 207,400株
中山製鋼所	36,100	845.00	30,504,500	
合同製鐵	8,800	4,860.00	42,768,000	
JFEホールディングス	439,500	2,310.00	1,015,245,000	
東京製鐵	44,400	1,802.00	80,008,800	貸付株式数 26,100株 (19,800株)
共英製鋼	18,000	2,090.00	37,620,000	貸付株式数 4,800株
大和工業	29,800	7,752.00	231,009,600	貸付株式数 100株 (100株)
東京鐵鋼	7,000	4,505.00	31,535,000	貸付株式数 4,100株
大阪製鐵	7,300	2,579.00	18,826,700	貸付株式数 4,000株
淀川製鋼所	18,000	3,915.00	70,470,000	貸付株式数 3,800株
中部鋼鈹	10,400	2,369.00	24,637,600	貸付株式数

				7,000株
丸一鋼管	48,100	3,706.00	178,258,600	
モリ工業	2,800	4,380.00	12,264,000	
大同特殊鋼	99,500	1,504.50	149,697,750	貸付株式数 10,000株
日本高周波鋼業	3,400	575.00	1,955,000	貸付株式数 1,800株
日本冶金工業	11,500	4,355.00	50,082,500	貸付株式数 6,800株
山陽特殊製鋼	15,600	2,668.00	41,620,800	
愛知製鋼	9,100	3,260.00	29,666,000	
日本金属	2,300	875.00	2,012,500	
ミガロホールディングス	1,300	1,420.00	1,846,000	
大太平洋金属	13,500	1,209.00	16,321,500	貸付株式数 7,300株
新日本電工	78,600	280.00	22,008,000	
栗本鐵工所	7,300	3,270.00	23,871,000	
虹 技	1,200	1,143.00	1,371,600	
日本鑄鉄管	900	1,081.00	972,900	
日本製鋼所	42,600	2,459.00	104,753,400	
三菱製鋼	11,700	1,509.00	17,655,300	
日亜鋼業	8,900	325.00	2,892,500	
日本精線	2,500	4,985.00	12,462,500	
エンビプロ・ホールディングス	8,500	593.00	5,040,500	貸付株式数 4,900株
大紀アルミニウム工業所	20,000	1,221.00	24,420,000	貸付株式数 12,000株
日本軽金属ホールディングス	46,200	1,770.00	81,774,000	
三井金属鉱業	46,000	4,420.00	203,320,000	貸付株式数 1,500株
東邦亜鉛	10,100	1,153.00	11,645,300	貸付株式数 6,500株 (3,100株)
三菱マテリアル	113,000	2,529.50	285,833,500	
住友金属鉱山	183,200	4,262.00	780,798,400	
DOWAホールディングス	39,100	5,112.00	199,879,200	
古河機械金属	20,800	1,977.00	41,121,600	
エス・サイエンス	52,700	20.00	1,054,000	貸付株式数 34,900株
大阪チタニウムテクノロジーズ	27,400	2,759.00	75,596,600	貸付株式数 17,800株
東邦チタニウム	32,700	1,842.00	60,233,400	貸付株式数 18,800株
UACJ	22,100	3,855.00	85,195,500	貸付株式数 4,100株
CKサンエツ	3,800	3,865.00	14,687,000	貸付株式数 2,000株
古河電気工業	52,600	2,238.00	117,718,800	貸付株式数 28,300株
住友電気工業	591,100	1,838.50	1,086,737,350	貸付株式数

				350,000株
フジクラ	186,400	1,112.00	207,276,800	貸付株式数 2,900株
SWCC	17,700	2,929.00	51,843,300	
タツタ電線	28,100	694.00	19,501,400	
カナレ電気	1,500	1,539.00	2,308,500	貸付株式数 100株
平河ヒューテック	10,100	1,351.00	13,645,100	貸付株式数 5,000株
いよぎんホールディングス	179,500	971.90	174,456,050	
しずおかフィナンシャルグループ	335,100	1,246.50	417,702,150	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	127,000	1,018.00	129,286,000	貸付株式数 5,100株
楽天銀行	52,500	2,257.00	118,492,500	貸付株式数 33,600株
京都フィナンシャルグループ	191,100	2,225.00	425,197,500	
リョービ	16,800	2,718.00	45,662,400	
アーレスティ	9,700	731.00	7,090,700	貸付株式数 5,200株
AREホールディングス	59,300	1,966.00	116,583,800	
東洋製罐グループホールディングス	94,300	2,364.00	222,925,200	貸付株式数 500株
ホッカンホールディングス	7,700	1,709.00	13,159,300	貸付株式数 4,500株
コロナ	8,800	964.00	8,483,200	
横河ブリッジホールディングス	24,700	2,665.00	65,825,500	
駒井ハルテック	1,600	2,055.00	3,288,000	
高田機工	600	3,400.00	2,040,000	
三和ホールディングス	158,800	2,154.50	342,134,600	貸付株式数 400株
文化シャッター	41,300	1,427.00	58,935,100	
三協立山	18,100	801.00	14,498,100	
アルインコ	12,000	1,023.00	12,276,000	貸付株式数 2,600株
東洋シャッター	2,000	685.00	1,370,000	
LIXIL	246,700	1,844.50	455,038,150	
日本ファイルコン	5,700	476.00	2,713,200	貸付株式数 3,800株
ノーリツ	26,200	1,526.00	39,981,200	貸付株式数 2,000株
長府製作所	15,700	2,050.00	32,185,000	貸付株式数 8,600株
リンナイ	77,300	3,280.00	253,544,000	貸付株式数 5,300株
ユニプレス	27,500	981.00	26,977,500	貸付株式数 10,400株
ダイニチ工業	4,400	718.00	3,159,200	
日東精工	22,900	536.00	12,274,400	
三洋工業	1,000	2,734.00	2,734,000	
岡部	28,200	756.00	21,319,200	貸付株式数

				14,100株
ジーテクト	20,100	1,753.00	35,235,300	
東プレ	27,800	1,918.00	53,320,400	貸付株式数 800株
高周波熱錬	24,400	988.00	24,107,200	
東京製綱	10,200	1,385.00	14,127,000	
サンコール	12,300	451.00	5,547,300	
モリテックスチール	7,800	290.00	2,262,000	
パイオラックス	19,600	2,403.00	47,098,800	
エイチワン	16,300	809.00	13,186,700	
日本発条	139,800	1,201.50	167,969,700	貸付株式数 34,800株
中央発条	11,700	698.00	8,166,600	貸付株式数 6,300株 (6,200株)
アドバネクス	1,100	932.00	1,025,200	
三浦工業	64,600	2,755.50	178,005,300	貸付株式数 100株
タクマ	52,300	1,754.00	91,734,200	
テクノプロ・ホールディングス	92,200	3,668.00	338,189,600	
アトラグループ	2,600	190.00	494,000	貸付株式数 1,800株
アイ・アールジャパンホールディングス	8,200	1,515.00	12,423,000	貸付株式数 4,500株
Keepers 技研	9,700	6,720.00	65,184,000	貸付株式数 5,200株
ファーストロジック	2,000	556.00	1,112,000	
三機サービス	1,300	1,218.00	1,583,400	
Gunosy	12,500	744.00	9,300,000	貸付株式数 6,800株 (2,100株)
デザインワン・ジャパン	2,200	130.00	286,000	貸付株式数 1,200株
イー・ガーディアン	6,000	1,603.00	9,618,000	貸付株式数 3,300株
リブセンス	4,000	256.00	1,024,000	
ジャパンマテリアル	48,200	2,362.00	113,848,400	
ベクトル	19,300	1,095.00	21,133,500	
ウチヤマホールディングス	3,700	396.00	1,465,200	
チャーム・ケア・コーポレーション	13,100	1,255.00	16,440,500	貸付株式数 7,200株
キャリアリンク	5,800	2,416.00	14,012,800	貸付株式数 3,600株
I B J	12,000	685.00	8,220,000	貸付株式数 7,000株
アサンテ	7,800	1,668.00	13,010,400	貸付株式数 4,200株
バリューHR	13,800	1,491.00	20,575,800	貸付株式数 9,000株
M&Aキャピタルパートナーズ	12,700	2,377.00	30,187,900	貸付株式数 700株

ライドオンエクスプレスホールディングス	6,200	1,021.00	6,330,200	貸付株式数 3,400株
E R Iホールディングス	2,200	1,958.00	4,307,600	貸付株式数 1,500株
アビスト	1,400	3,125.00	4,375,000	貸付株式数 800株
シグマクシス・ホールディングス	21,200	1,365.00	28,938,000	
ウィルグループ	13,100	1,192.00	15,615,200	貸付株式数 7,200株
エスクロー・エージェント・ジャパン	10,500	143.00	1,501,500	
メドピア	13,800	707.00	9,756,600	貸付株式数 7,300株
レアジョブ	1,700	870.00	1,479,000	
リクルートホールディングス	1,165,600	5,818.00	6,781,460,800	貸付株式数 661,600株
エラン	20,800	1,064.00	22,131,200	貸付株式数 6,200株
ツガミ	34,400	1,206.00	41,486,400	
オークマ	13,500	6,096.00	82,296,000	貸付株式数 300株
芝浦機械	15,500	3,475.00	53,862,500	
アマダ	246,800	1,497.00	369,459,600	
アイダエンジニアリング	35,800	844.00	30,215,200	貸付株式数 8,100株 (8,100株)
TAKI SAWA	600	2,596.00	1,557,600	
F U J I	72,800	2,398.00	174,574,400	貸付株式数 200株
牧野フライス製作所	17,100	5,870.00	100,377,000	貸付株式数 6,700株
オーエスジー	68,200	1,965.00	134,013,000	貸付株式数 41,700株
ダイジェット工業	900	839.00	755,100	
旭ダイヤモンド工業	35,700	850.00	30,345,000	
DMG森精機	93,800	2,652.50	248,804,500	貸付株式数 49,700株 (11,700株)
ソディック	37,700	727.00	27,407,900	
ディスコ	74,500	32,920.00	2,452,540,000	貸付株式数 300株
日東工器	7,500	1,880.00	14,100,000	
日進工具	14,300	1,015.00	14,514,500	貸付株式数 5,300株
パンチ工業	8,500	410.00	3,485,000	
富士ダイス	8,000	673.00	5,384,000	貸付株式数 3,200株
土木管理総合試験所	4,100	336.00	1,377,600	
日本郵政	1,850,100	1,317.50	2,437,506,750	
ベルシステム24ホールディングス	16,900	1,716.00	29,000,400	貸付株式数 1,500株
鎌倉新書	13,400	520.00	6,968,000	貸付株式数

				8,900株
SMN	1,700	290.00	493,000	
一蔵	1,100	588.00	646,800	
グローバルキッズCOMPANY	1,600	653.00	1,044,800	
エアトリ	11,500	1,725.00	19,837,500	貸付株式数 6,400株
アトラエ	9,300	700.00	6,510,000	貸付株式数 5,400株
ストライク	6,700	4,465.00	29,915,500	貸付株式数 200株
ソラスト	43,400	618.00	26,821,200	
セラク	4,800	1,262.00	6,057,600	貸付株式数 2,600株
インソース	34,200	850.00	29,070,000	貸付株式数 18,800株
豊田自動織機	130,600	11,660.00	1,522,796,000	貸付株式数 300株
豊和工業	4,700	769.00	3,614,300	貸付株式数 2,500株 (2,500株)
石川製作所	2,200	1,166.00	2,565,200	貸付株式数 600株
リケンNPR	16,800	2,358.00	39,614,400	
東洋機械金属	7,100	709.00	5,033,900	
津田駒工業	1,600	360.00	576,000	
エンシュウ	2,000	688.00	1,376,000	貸付株式数 1,300株
島精機製作所	24,600	1,522.00	37,441,200	貸付株式数 9,500株
オプトラン	25,400	1,614.00	40,995,600	貸付株式数 13,900株 (13,900株)
NCホールディングス	2,000	1,965.00	3,930,000	
イワキ	10,300	2,069.00	21,310,700	
フリーー	14,600	1,328.00	19,388,800	貸付株式数 300株 (300株)
ヤマシンフィルタ	37,100	326.00	12,094,600	貸付株式数 20,500株
日阪製作所	16,900	932.00	15,750,800	
やまびこ	25,300	1,535.00	38,835,500	
野村マイクロ・サイエンス	5,200	14,780.00	76,856,000	貸付株式数 2,900株
平田機工	7,400	6,110.00	45,214,000	貸付株式数 4,000株
PEGASUS	17,100	448.00	7,660,800	貸付株式数 3,500株
マルマエ	6,700	1,893.00	12,683,100	貸付株式数 3,900株
タツモ	9,300	2,759.00	25,658,700	貸付株式数 5,000株

ナブテスコ	97,100	2,812.50	273,093,750	貸付株式数 700株
三井海洋開発	19,600	2,330.00	45,668,000	
レオン自動機	17,900	1,512.00	27,064,800	
SMC	46,300	75,000.00	3,472,500,000	貸付株式数 28,800株
ホソカワミクロン	9,900	4,045.00	40,045,500	
ユニオンツール	6,800	3,370.00	22,916,000	
瑞光	11,100	1,877.00	20,834,700	貸付株式数 6,100株
オイレス工業	21,000	2,043.00	42,903,000	貸付株式数 12,000株
日精エー・エス・ビー機械	6,200	4,350.00	26,970,000	
サトーホールディングス	22,000	2,122.00	46,684,000	
技研製作所	14,500	1,886.00	27,347,000	貸付株式数 200株
日本エアーテック	7,200	1,220.00	8,784,000	
カワタ	2,700	1,085.00	2,929,500	
日精樹脂工業	11,500	1,154.00	13,271,000	貸付株式数 5,300株
オカダアイヨン	2,900	2,615.00	7,583,500	貸付株式数 2,000株
ワイエイシイホールディングス	5,100	2,312.00	11,791,200	貸付株式数 2,900株
小松製作所	725,000	3,804.00	2,757,900,000	貸付株式数 430,000株
住友重機械工業	91,500	3,586.00	328,119,000	
日立建機	61,600	3,880.00	239,008,000	貸付株式数 37,000株
日工	22,900	712.00	16,304,800	貸付株式数 10,400株
巴工業	6,000	3,700.00	22,200,000	貸付株式数 3,300株
井関農機	14,500	1,091.00	15,819,500	
TOWA	17,200	6,480.00	111,456,000	貸付株式数 7,000株
丸山製作所	1,400	2,640.00	3,696,000	
北川鉄工所	6,100	1,372.00	8,369,200	
シンニッタン	11,000	265.00	2,915,000	
ローツェ	8,100	14,350.00	116,235,000	
タカキタ	2,800	512.00	1,433,600	
クボタ	811,700	2,141.00	1,737,849,700	
荏原実業	8,100	2,925.00	23,692,500	
東洋エンジニアリング	22,100	817.00	18,055,700	
三菱化工機	5,400	3,205.00	17,307,000	
月島ホールディングス	20,900	1,375.00	28,737,500	
帝国電機製作所	10,900	3,030.00	33,027,000	
東京機械製作所	2,200	488.00	1,073,600	貸付株式数 1,500株
新東工業	31,300	1,094.00	34,242,200	

澁谷工業	14,500	2,433.00	35,278,500	
アイチコーポレーション	21,500	1,051.00	22,596,500	
小森コーポレーション	38,100	1,239.00	47,205,900	
鶴見製作所	11,800	3,775.00	44,545,000	貸付株式数 7,600株
日本ギア工業	3,300	520.00	1,716,000	
酒井重工業	2,100	6,460.00	13,566,000	
荏原製作所	63,500	8,176.00	519,176,000	
石井鐵工所	1,000	2,719.00	2,719,000	貸付株式数 500株
西島製作所	13,300	2,280.00	30,324,000	
北越工業	15,500	2,618.00	40,579,000	
ダイキン工業	184,700	22,750.00	4,201,925,000	貸付株式数 85,000株
オルガノ	18,600	5,540.00	103,044,000	貸付株式数 2,200株
トーヨーカネツ	5,200	3,990.00	20,748,000	
栗田工業	86,500	5,383.00	465,629,500	
椿本チェーン	21,900	4,055.00	88,804,500	
大同工業	3,800	734.00	2,789,200	
日機装	35,700	1,038.00	37,056,600	
木村化工機	11,800	742.00	8,755,600	
レイズネクスト	21,700	1,543.00	33,483,100	
アネスト岩田	23,900	1,136.00	27,150,400	貸付株式数 13,100株 (3,600株)
ダイフク	261,000	2,754.50	718,924,500	貸付株式数 153,600株 (53,600株)
サムコ	4,100	4,075.00	16,707,500	貸付株式数 2,100株
加藤製作所	4,400	1,340.00	5,896,000	
油研工業	1,400	2,227.00	3,117,800	
タダノ	89,000	1,185.00	105,465,000	
フジテック	36,100	3,540.00	127,794,000	貸付株式数 22,400株
CKD	42,800	2,340.00	100,152,000	貸付株式数 9,400株
平和	45,700	2,129.00	97,295,300	
理想科学工業	12,400	2,810.00	34,844,000	貸付株式数 400株
SANKYO	35,600	8,355.00	297,438,000	
日本金銭機械	18,700	1,381.00	25,824,700	貸付株式数 200株
マースグループホールディングス	7,800	2,590.00	20,202,000	貸付株式数 5,100株
フクシマガリレイ	10,100	4,930.00	49,793,000	貸付株式数 100株
オーイズミ	3,200	429.00	1,372,800	
ダイコク電機	7,600	3,575.00	27,170,000	貸付株式数



				5,100株
竹内製作所	28,100	4,465.00	125,466,500	
アマノ	43,900	3,336.00	146,450,400	
J U K I	24,000	460.00	11,040,000	
サンデン	12,800	207.00	2,649,600	貸付株式数 8,000株
ジャノメ	15,700	684.00	10,738,800	
ブラザー工業	206,700	2,262.00	467,555,400	
マックス	21,800	3,190.00	69,542,000	
モリタホールディングス	26,900	1,559.00	41,937,100	
グローリー	37,100	2,800.50	103,898,550	
新晃工業	15,600	2,755.00	42,978,000	
大和冷機工業	23,700	1,523.00	36,095,100	
セガサミーホールディングス	138,200	2,039.50	281,858,900	貸付株式数 300株
T P R	19,600	1,770.00	34,692,000	貸付株式数 9,800株
ツバキ・ナカシマ	31,000	734.00	22,754,000	貸付株式数 4,300株
ホシザキ	91,300	5,085.00	464,260,500	
大豊工業	13,400	821.00	11,001,400	
日本精工	286,400	780.40	223,506,560	貸付株式数 4,200株
N T N	335,400	264.80	88,813,920	貸付株式数 191,500株
ジェイテクト	137,600	1,237.50	170,280,000	貸付株式数 400株
不二越	11,400	3,715.00	42,351,000	
ミネベアミツミ	269,100	2,859.50	769,491,450	貸付株式数 156,200株
日本トムソン	42,100	576.00	24,249,600	
T H K	89,200	2,734.50	243,917,400	
ユーシン精機	12,200	665.00	8,113,000	
前澤給装工業	11,900	1,331.00	15,838,900	貸付株式数 6,000株
イーグル工業	17,100	1,659.00	28,368,900	
前澤工業	4,900	1,009.00	4,944,100	
日本ピラー工業	14,300	4,285.00	61,275,500	貸付株式数 7,900株
キッツ	51,800	1,220.00	63,196,000	貸付株式数 28,400株 (800株)
日立製作所	743,400	10,245.00	7,616,133,000	貸付株式数 436,000株
三菱電機	1,721,600	2,029.50	3,493,987,200	
富士電機	94,100	6,086.00	572,692,600	貸付株式数 1,400株
東洋電機製造	2,800	996.00	2,788,800	
安川電機	168,000	5,650.00	949,200,000	貸付株式数 109,300株

シンフォニア テクノロジー	17,100	2,137.00	36,542,700	
明電舎	28,700	2,418.00	69,396,600	
オリジン	1,900	1,241.00	2,357,900	
山洋電気	6,700	6,170.00	41,339,000	
デンヨー	11,800	2,327.00	27,458,600	
PHCホールディングス	28,900	1,479.00	42,743,100	貸付株式数 200株
KOKUSAI ELECTRIC	59,700	2,956.00	176,473,200	貸付株式数 37,700株
ソシオネクスト	112,200	2,659.50	298,395,900	貸付株式数 20,500株
ベイカレント・コンサルティング	115,700	4,742.00	548,649,400	
Orchestra Holdings	3,400	1,050.00	3,570,000	
アイモバイル	21,000	454.00	9,534,000	
キャリアインデックス	3,000	209.00	627,000	
MS-Japan	5,000	1,127.00	5,635,000	貸付株式数 3,200株
船場	1,800	890.00	1,602,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	51,000	2,328.00	118,728,000	
フルテック	1,200	1,172.00	1,406,400	貸付株式数 600株
グリーンズ	3,200	1,795.00	5,744,000	
ツナググループ・ホールディングス	2,500	889.00	2,222,500	
GAMEWITH	2,600	304.00	790,400	貸付株式数 1,400株
MS&Consulting	1,200	702.00	842,400	貸付株式数 300株 (300株)
ウェルビー	7,900	837.00	6,612,300	
エル・ティー・エス	1,800	2,855.00	5,139,000	貸付株式数 900株
ミダックホールディングス	9,500	2,071.00	19,674,500	貸付株式数 5,300株
キュービーネットホールディングス	7,500	1,483.00	11,122,500	
RPAホールディングス	21,300	268.00	5,708,400	
三櫻工業	23,400	826.00	19,328,400	
マキタ	176,400	3,825.00	674,730,000	
東芝テック	19,800	2,830.00	56,034,000	
芝浦メカトロニクス	8,800	6,060.00	53,328,000	貸付株式数 4,700株
マブチモーター	76,100	2,379.00	181,041,900	
ニデック	341,500	5,696.00	1,945,184,000	貸付株式数 209,700株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,700	364.00	3,530,800	貸付株式数 5,300株
トレックス・セミコンダクター	7,900	1,740.00	13,746,000	貸付株式数 4,400株
東光高岳	9,300	2,157.00	20,060,100	

ダブル・スコープ	44,300	893.00	39,559,900	貸付株式数 30,300株
宮越ホールディングス	6,900	1,107.00	7,638,300	貸付株式数 3,700株
ダイヘン	15,500	6,200.00	96,100,000	
ヤーマン	26,700	1,012.00	27,020,400	貸付株式数 17,900株
JVCケンウッド	122,100	753.00	91,941,300	貸付株式数 81,400株
ミマキエンジニアリング	14,700	890.00	13,083,000	貸付株式数 4,000株
I-PEX	10,700	1,547.00	16,552,900	
大崎電気工業	33,900	649.00	22,001,100	
オムロン	118,100	6,286.00	742,376,600	貸付株式数 2,100株
日東工業	20,900	3,745.00	78,270,500	
I D E C	22,800	2,885.00	65,778,000	貸付株式数 7,000株
正興電機製作所	2,900	1,091.00	3,163,900	貸付株式数 1,900株
不二電機工業	1,700	1,197.00	2,034,900	貸付株式数 400株
ジーエス・ユアサ コーポレーション	60,400	2,000.00	120,800,000	貸付株式数 31,800株
サクサホールディングス	2,000	2,604.00	5,208,000	
メルコホールディングス	4,900	3,420.00	16,758,000	
テクノメディカ	3,800	2,149.00	8,166,200	貸付株式数 2,000株
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	5,800	679.00	3,938,200	貸付株式数 3,800株
日本電気	203,100	8,348.00	1,695,478,800	
富士通	142,300	21,235.00	3,021,740,500	貸付株式数 87,100株
沖電気工業	69,900	943.00	65,915,700	
岩崎通信機	4,000	761.00	3,044,000	
電気興業	6,900	2,286.00	15,773,400	貸付株式数 500株
サンケン電気	14,400	6,921.00	99,662,400	
ナカヨ	1,400	1,197.00	1,675,800	
アイホン	8,300	2,703.00	22,434,900	
ルネサスエレクトロニクス	1,009,500	2,388.50	2,411,190,750	貸付株式数 22,600株
セイコーエプソン	198,500	2,151.00	426,973,500	貸付株式数 132,000株 (34,600株)
ワコム	117,600	651.00	76,557,600	貸付株式数 15,900株
アルバック	36,700	6,443.00	236,458,100	貸付株式数 600株
アクセル	5,400	2,179.00	11,766,600	
E I Z O	11,300	4,950.00	55,935,000	

ジャパンディスプレイ	666,700	20.00	13,334,000	貸付株式数 438,600株
日本信号	35,200	977.00	34,390,400	
京三製作所	32,400	463.00	15,001,200	
能美防災	20,900	2,206.00	46,105,400	
ホーチキ	11,600	1,794.00	20,810,400	
星和電機	3,800	484.00	1,839,200	貸付株式数 1,800株
エレコム	37,000	1,699.00	62,863,000	貸付株式数 100株
パナソニック ホールディングス	1,827,300	1,424.50	2,602,988,850	貸付株式数 1,080,700株
シャープ	260,700	1,026.50	267,608,550	貸付株式数 120,700株
アンリツ	108,900	1,328.50	144,673,650	貸付株式数 30,500株
富士通ゼネラル	43,800	2,279.50	99,842,100	貸付株式数 6,600株
ソニーグループ	1,083,400	13,170.00	14,268,378,000	貸付株式数 634,300株
TDK	244,900	6,488.00	1,588,911,200	貸付株式数 86,100株
帝国通信工業	6,800	1,970.00	13,396,000	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
タムラ製作所	61,600	543.00	33,448,800	貸付株式数 25,800株
アルプスアルパイン	138,100	1,246.00	172,072,600	貸付株式数 2,800株
池上通信機	2,700	890.00	2,403,000	
日本電波工業	18,500	1,225.00	22,662,500	
鈴木	8,200	1,102.00	9,036,400	貸付株式数 100株
メイコー	15,400	3,995.00	61,523,000	
日本トリム	3,500	3,005.00	10,517,500	
ローランド ディー. ジー.	8,500	3,620.00	30,770,000	貸付株式数 4,600株
フォスター電機	11,500	1,047.00	12,040,500	
SMK	4,100	2,577.00	10,565,700	
ヨコオ	13,700	1,404.00	19,234,800	貸付株式数 600株 (100株)
ティアック	14,100	97.00	1,367,700	
ホシデン	35,200	1,721.00	60,579,200	貸付株式数 19,700株
ヒロセ電機	22,800	16,035.00	365,598,000	貸付株式数 4,600株 (500株)
日本航空電子工業	37,000	3,125.00	115,625,000	貸付株式数 1,400株
TOA	17,600	1,075.00	18,920,000	

マクセル	34,200	1,586.00	54,241,200	
古野電気	20,100	1,900.00	38,190,000	
スミダコーポレーション	20,700	1,167.00	24,156,900	
アイコム	6,000	3,540.00	21,240,000	
リオン	6,400	2,326.00	14,886,400	
横河電機	169,200	2,735.00	462,762,000	
新電元工業	5,900	3,075.00	18,142,500	
アズビル	105,400	4,730.00	498,542,000	貸付株式数 61,100株
東亜ディーケーケー	4,000	915.00	3,660,000	
日本光電工業	65,700	4,486.00	294,730,200	
チノー	6,400	2,141.00	13,702,400	貸付株式数 3,500株
共和電業	8,000	396.00	3,168,000	
日本電子材料	9,400	1,736.00	16,318,400	
堀場製作所	29,200	10,435.00	304,702,000	
アドバンテスト	438,800	4,663.00	2,046,124,400	貸付株式数 294,300株
小野測器	3,500	443.00	1,550,500	
エスペック	12,300	2,363.00	29,064,900	
キーエンス	153,200	60,130.00	9,211,916,000	貸付株式数 101,000株
日置電機	7,200	6,250.00	45,000,000	
シスメックス	132,100	7,793.00	1,029,455,300	貸付株式数 85,000株
日本マイクロニクス	27,500	3,475.00	95,562,500	
メガチップス	12,100	4,570.00	55,297,000	貸付株式数 3,300株 (1,300株)
OBARA GROUP	8,400	3,790.00	31,836,000	貸付株式数 3,300株
IMAGICA GROUP	15,400	623.00	9,594,200	
澤藤電機	1,000	1,248.00	1,248,000	貸付株式数 600株
デンソー	1,263,600	2,165.00	2,735,694,000	貸付株式数 769,000株
原田工業	3,700	756.00	2,797,200	
コーセル	18,400	1,303.00	23,975,200	
イリソ電子工業	14,100	3,595.00	50,689,500	貸付株式数 1,500株
オブテックスグループ	28,100	1,701.00	47,798,100	
千代田インテグレ	6,000	2,795.00	16,770,000	
レーザーテック	70,200	34,010.00	2,387,502,000	
スタンレー電気	98,000	2,688.00	263,424,000	
ウシオ電機	77,800	2,042.00	158,867,600	貸付株式数 42,500株
岡谷電機産業	6,600	285.00	1,881,000	貸付株式数 4,500株
ヘリオス テクノ ホールディング	8,500	517.00	4,394,500	貸付株式数 5,800株

エノモト	2,400	1,583.00	3,799,200	
日本セラミック	12,500	2,711.00	33,887,500	
遠藤照明	3,800	1,324.00	5,031,200	
古河電池	11,300	871.00	9,842,300	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
双信電機	3,400	303.00	1,030,200	貸付株式数 2,300株
山一電機	13,800	1,834.00	25,309,200	貸付株式数 4,900株
図研	13,300	3,990.00	53,067,000	貸付株式数 6,800株
日本電子	38,400	5,961.00	228,902,400	貸付株式数 1,100株
カシオ計算機	110,700	1,226.00	135,718,200	貸付株式数 71,900株
ファナック	746,800	4,090.00	3,054,412,000	貸付株式数 447,700株
日本シイエムケイ	32,500	777.00	25,252,500	
エンプラス	4,500	11,350.00	51,075,000	貸付株式数 2,400株
大真空	22,800	856.00	19,516,800	貸付株式数 10,200株
ローム	283,200	2,606.50	738,160,800	貸付株式数 175,300株
浜松ホトニクス	122,900	5,694.00	699,792,600	貸付株式数 100株
三井ハイテック	13,600	7,039.00	95,730,400	貸付株式数 8,800株
新光電気工業	54,100	5,495.00	297,279,500	貸付株式数 10,000株
京セラ	951,600	2,055.00	1,955,538,000	貸付株式数 486,800株
協栄産業	900	2,447.00	2,202,300	
太陽誘電	74,600	3,683.00	274,751,800	貸付株式数 13,800株
村田製作所	1,393,400	2,907.50	4,051,310,500	貸付株式数 813,700株
双葉電子工業	29,200	530.00	15,476,000	
日東電工	98,700	10,700.00	1,056,090,000	貸付株式数 20,500株
北陸電気工業	3,200	1,380.00	4,416,000	
東海理化電機製作所	43,200	2,246.00	97,027,200	貸付株式数 9,000株
ニチコン	40,200	1,309.00	52,621,800	貸付株式数 19,200株 (19,200株)
日本ケミコン	16,300	1,307.00	21,304,100	
KOA	23,200	1,522.00	35,310,400	貸付株式数 2,000株 (2,000株)

三井E&S	76,800	768.00	58,982,400	
日立造船	136,500	956.00	130,494,000	貸付株式数 84,100株
三菱重工業	270,500	8,641.00	2,337,390,500	貸付株式数 1,000株
川崎重工業	125,000	3,255.00	406,875,000	貸付株式数 800株
I H I	115,200	2,827.00	325,670,400	貸付株式数 24,600株
名村造船所	33,400	1,375.00	45,925,000	貸付株式数 21,900株
サノヤスホールディングス	12,600	141.00	1,776,600	
スプリックス	2,500	839.00	2,097,500	貸付株式数 700株 (700株)
マネジメントソリューションズ	6,700	3,140.00	21,038,000	
プロレド・パートナーズ	3,800	345.00	1,311,000	貸付株式数 2,000株
a n d f a c t o r y	2,600	332.00	863,200	貸付株式数 1,700株
テノ.ホールディングス	1,100	504.00	554,400	貸付株式数 600株
フロンティア・マネジメント	4,000	1,472.00	5,888,000	貸付株式数 2,200株
ピアラ	1,600	296.00	473,600	貸付株式数 1,100株
コプロ・ホールディングス	2,900	1,600.00	4,640,000	
ギークス	1,200	493.00	591,600	貸付株式数 800株
アンビスホールディングス	16,800	2,915.00	48,972,000	
カーブスホールディングス	43,000	651.00	27,993,000	貸付株式数 19,800株
フォーラムエンジニアリング	21,400	849.00	18,168,600	
FAST FITNESS JAPAN	5,400	1,073.00	5,794,200	貸付株式数 2,900株
日本車輛製造	5,000	2,119.00	10,595,000	貸付株式数 3,300株
三菱ロジスネクスト	24,400	1,360.00	33,184,000	
近畿車輛	1,200	1,809.00	2,170,800	
一家ホールディングス	2,200	671.00	1,476,200	貸付株式数 1,300株
フルサト・マルカホールディングス	14,400	2,602.00	37,468,800	貸付株式数 8,000株
ヤマエグループホールディングス	9,200	4,000.00	36,800,000	貸付株式数 3,300株
ジャパングラフトホールディングス	5,200	165.00	858,000	貸付株式数 1,300株
F P G	51,000	1,725.00	87,975,000	
島根銀行	2,400	518.00	1,243,200	貸付株式数 100株
じもとホールディングス	7,400	550.00	4,070,000	

全国保証	39,400	5,347.00	210,671,800	貸付株式数 22,600株 (20,900株)
めぶきフィナンシャルグループ	748,500	438.00	327,843,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	12,300	1,489.00	18,314,700	貸付株式数 6,700株
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,300	4,050.00	78,165,000	
九州フィナンシャルグループ	291,900	831.20	242,627,280	
かんぽ生命保険	153,600	2,662.00	408,883,200	貸付株式数 82,300株
ゆうちょ銀行	1,657,500	1,455.00	2,411,662,500	
あんしん保証	3,600	247.00	889,200	
富山第一銀行	47,900	780.00	37,362,000	貸付株式数 20,800株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	809,300	671.00	543,040,300	
ジェイリース	3,900	2,127.00	8,295,300	貸付株式数 900株
西日本フィナンシャルホールディングス	85,100	1,656.00	140,925,600	
イントラスト	3,200	799.00	2,556,800	
日本モーゲージサービス	4,600	526.00	2,419,600	貸付株式数 2,500株
CASA	3,300	900.00	2,970,000	
SBIアルヒ	14,500	858.00	12,441,000	貸付株式数 9,800株
プレミアグループ	25,400	1,823.00	46,304,200	貸付株式数 3,300株 (3,300株)
日産自動車	2,175,600	567.30	1,234,217,880	貸付株式数 1,429,000株
いすゞ自動車	445,300	1,917.00	853,640,100	
トヨタ自動車	8,409,500	2,701.50	22,718,264,250	貸付株式数 41,700株
日野自動車	230,400	487.20	112,250,880	貸付株式数 60,300株
三菱自動車工業	597,500	454.80	271,743,000	貸付株式数 1,000株
エフテック	5,900	646.00	3,811,400	
レシップホールディングス	3,700	629.00	2,327,300	貸付株式数 2,500株
GMB	1,700	1,208.00	2,053,600	
ファルテック	1,600	546.00	873,600	貸付株式数 500株
武蔵精密工業	37,400	1,540.00	57,596,000	
日産車体	18,000	980.00	17,640,000	貸付株式数 11,900株 (9,400株)
新明和工業	44,100	1,196.00	52,743,600	
極東開発工業	25,300	1,937.00	49,006,100	貸付株式数 8,800株



トピー工業	12,400	2,658.00	32,959,200	
ティラド	3,400	3,150.00	10,710,000	
曙ブレーキ工業	93,500	116.00	10,846,000	貸付株式数 51,700株
タチエス	28,300	1,842.00	52,128,600	
NOK	59,500	1,966.00	116,977,000	
フタバ産業	41,000	843.00	34,563,000	
カヤバ	14,700	5,040.00	74,088,000	貸付株式数 100株
市光工業	27,600	544.00	15,014,400	貸付株式数 10,900株
大同メタル工業	29,900	550.00	16,445,000	
プレス工業	61,200	584.00	35,740,800	
ミクニ	10,700	460.00	4,922,000	
太平洋工業	35,100	1,348.00	47,314,800	
河西工業	13,600	194.00	2,638,400	貸付株式数 2,900株
アイシン	118,100	5,154.00	608,687,400	
マツダ	506,600	1,611.00	816,132,600	貸付株式数 2,100株
今仙電機製作所	5,400	652.00	3,520,800	
本田技研工業	3,734,800	1,530.00	5,714,244,000	貸付株式数 2,217,100株
スズキ	281,300	6,055.00	1,703,271,500	貸付株式数 167,800株
SUBARU	475,000	2,765.50	1,313,612,500	
安永	3,700	650.00	2,405,000	貸付株式数 2,500株
ヤマハ発動機	661,900	1,309.50	866,758,050	
小糸製作所	158,700	2,225.50	353,186,850	貸付株式数 59,000株 (600株)
TBK	9,300	384.00	3,571,200	
エクセディ	25,000	2,677.00	66,925,000	
ミツバ	28,700	952.00	27,322,400	
豊田合成	44,700	2,729.00	121,986,300	
愛三工業	25,400	1,242.00	31,546,800	
盟和産業	1,200	999.00	1,198,800	
日本プラスト	7,200	542.00	3,902,400	
ヨロズ	14,300	853.00	12,197,900	貸付株式数 7,900株
エフ・シー・シー	27,100	1,806.00	48,942,600	
新家工業	1,900	2,905.00	5,519,500	
シマノ	62,200	21,840.00	1,358,448,000	貸付株式数 13,300株
テイ・エス テック	54,500	1,750.50	95,402,250	貸付株式数 100株
三十三フィナンシャルグループ	13,500	1,859.00	25,096,500	貸付株式数 2,900株
第四北越フィナンシャルグループ	23,700	3,920.00	92,904,000	

ひろぎんホールディングス	214,700	938.00	201,388,600	
マーキュリアホールディングス	4,300	710.00	3,053,000	
おきなわフィナンシャルグループ	12,900	2,367.00	30,534,300	
ダイレクトマーケティングミックス	16,200	442.00	7,160,400	
ポピンズ	2,300	1,149.00	2,642,700	
LITALICO	12,300	1,950.00	23,985,000	
コンフィデンス・インターワークス	800	1,550.00	1,240,000	貸付株式数 200株
十六フィナンシャルグループ	19,500	3,800.00	74,100,000	
北國フィナンシャルホールディングス	15,900	4,755.00	75,604,500	
ネットプロテクションズホールディングス	50,000	207.00	10,350,000	
プロクレアホールディングス	17,200	1,882.00	32,370,400	貸付株式数 900株
FPパートナー	3,000	5,220.00	15,660,000	
あいちフィナンシャルグループ	23,200	2,446.00	56,747,200	貸付株式数 12,800株
ジャムコ	6,500	1,574.00	10,231,000	貸付株式数 3,500株
小野建	15,900	1,793.00	28,508,700	
はるやまホールディングス	4,200	625.00	2,625,000	貸付株式数 2,900株
南陽	1,800	2,197.00	3,954,600	
ノジマ	47,000	1,758.00	82,626,000	
佐鳥電機	7,900	2,027.00	16,013,300	
カップ・クリエイト	25,500	1,718.00	43,809,000	貸付株式数 13,900株
エコートレーディング	1,700	1,465.00	2,490,500	
伯東	9,300	5,600.00	52,080,000	貸付株式数 4,600株
コンドーテック	12,400	1,169.00	14,495,600	貸付株式数 6,900株
中山福	4,800	373.00	1,790,400	
ライトオン	6,800	448.00	3,046,400	貸付株式数 4,400株
ナガイレーベン	20,500	2,432.00	49,856,000	貸付株式数 700株
三菱食品	15,000	4,865.00	72,975,000	
良品計画	176,900	2,260.50	399,882,450	貸付株式数 400株
パリミキホールディングス	11,200	538.00	6,025,600	
松田産業	12,300	2,438.00	29,987,400	貸付株式数 6,400株
第一興商	62,700	2,089.00	130,980,300	貸付株式数 34,400株
メディパルホールディングス	167,900	2,320.00	389,528,000	貸付株式数 19,300株 (19,000株)
アドヴァングループ	15,400	1,075.00	16,555,000	
SPK	7,200	1,889.00	13,600,800	貸付株式数 800株

萩原電気ホールディングス	7,000	4,815.00	33,705,000	
アルビス	5,300	2,648.00	14,034,400	貸付株式数 2,900株
アズワン	25,400	5,421.00	137,693,400	貸付株式数 12,200株
スズデン	5,700	2,368.00	13,497,600	貸付株式数 2,500株
尾家産業	2,100	1,763.00	3,702,300	
シモジマ	10,800	1,302.00	14,061,600	貸付株式数 6,100株
ドウシシャ	15,000	2,100.00	31,500,000	貸付株式数 4,800株
小津産業	2,000	1,612.00	3,224,000	貸付株式数 1,300株
コナカ	9,800	405.00	3,969,000	
高速	9,600	2,114.00	20,294,400	貸付株式数 200株
ハウス オブ ローゼ	1,100	1,617.00	1,778,700	
G-7ホールディングス	17,700	1,207.00	21,363,900	
たけびし	6,200	1,945.00	12,059,000	
イオン北海道	47,900	934.00	44,738,600	貸付株式数 26,200株
コジマ	26,800	782.00	20,957,600	貸付株式数 17,100株
ヒマラヤ	2,800	936.00	2,620,800	貸付株式数 1,900株
コーナン商事	19,900	3,930.00	78,207,000	貸付株式数 11,900株
ネットワンシステムズ	62,000	2,344.00	145,328,000	貸付株式数 5,500株
エコス	6,000	2,469.00	14,814,000	貸付株式数 3,300株
ワタミ	17,100	1,047.00	17,903,700	貸付株式数 5,000株
マルシェ	3,200	238.00	761,600	貸付株式数 400株
リックス	2,900	3,455.00	10,019,500	
システムソフト	53,400	62.00	3,310,800	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	327,200	3,292.00	1,077,142,400	貸付株式数 199,300株
丸文	14,500	1,613.00	23,388,500	
西松屋チェーン	31,900	2,040.00	65,076,000	貸付株式数 18,200株
ゼンショーホールディングス	82,500	7,328.00	604,560,000	貸付株式数 49,500株
ハピネット	13,800	2,779.00	38,350,200	
幸楽苑ホールディングス	12,000	1,238.00	14,856,000	貸付株式数 7,200株
ハークスレイ	3,200	864.00	2,764,800	
橋本総業ホールディングス	6,400	1,315.00	8,416,000	貸付株式数 3,500株

日本ライフライン	47,500	1,237.00	58,757,500	
サイゼリヤ	23,900	5,150.00	123,085,000	貸付株式数 15,200株
タカショー	14,100	555.00	7,825,500	貸付株式数 7,700株
VTホールディングス	61,500	519.00	31,918,500	
アルゴグラフィックス	14,100	3,770.00	53,157,000	
魚力	5,700	2,348.00	13,383,600	貸付株式数 2,600株
I DOM	42,900	965.00	41,398,500	貸付株式数 25,100株
日本エム・ディ・エム	12,100	759.00	9,183,900	
ポプラ	2,400	198.00	475,200	貸付株式数 300株
フジ・コーポレーション	7,700	1,680.00	12,936,000	貸付株式数 4,300株
ユナイテッドアローズ	19,000	1,845.00	35,055,000	貸付株式数 8,600株
進和	9,900	2,426.00	24,017,400	貸付株式数 5,500株
エスケイジャパン	2,200	816.00	1,795,200	
ダイトロン	6,400	2,767.00	17,708,800	
ハイデイ日高	24,000	2,912.00	69,888,000	貸付株式数 13,200株
シークス	23,100	1,456.00	33,633,600	貸付株式数 12,700株
YU-WA CREATION HOLDINGS	5,000	155.00	775,000	貸付株式数 2,700株
コロワイド	69,700	2,279.50	158,881,150	貸付株式数 41,200株
田中商事	2,500	792.00	1,980,000	
オーハシテクニカ	8,500	1,866.00	15,861,000	貸付株式数 3,200株
壺番屋	12,800	5,210.00	66,688,000	貸付株式数 7,000株
白銅	4,500	2,368.00	10,656,000	貸付株式数 3,100株
トップカルチャー	2,900	157.00	455,300	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
PLANT	2,000	1,526.00	3,052,000	貸付株式数 1,300株
スギホールディングス	32,600	6,500.00	211,900,000	貸付株式数 100株
ダイコー通産	900	1,205.00	1,084,500	
薬王堂ホールディングス	7,900	2,714.00	21,440,600	貸付株式数 4,500株
島津製作所	203,500	3,957.00	805,249,500	貸付株式数 400株
JMS	14,200	510.00	7,242,000	
クボテック	2,400	259.00	621,600	貸付株式数

				1,600株
長野計器	11,100	2,031.00	22,544,100	貸付株式数 2,500株
ブイ・テクノロジー	8,100	2,738.00	22,177,800	貸付株式数 3,200株 (3,200株)
スター精密	28,800	1,718.00	49,478,400	貸付株式数 3,900株
東京計器	11,700	1,774.00	20,755,800	貸付株式数 6,400株
愛知時計電機	6,600	2,328.00	15,364,800	貸付株式数 3,300株
インターアクション	7,300	1,061.00	7,745,300	
オーバル	7,500	498.00	3,735,000	
東京精密	31,300	8,159.00	255,376,700	貸付株式数 4,000株
マニー	61,300	2,133.50	130,783,550	
ニコン	221,400	1,430.50	316,712,700	貸付株式数 7,500株
トプコン	74,400	1,555.50	115,729,200	
オリンパス	942,700	2,030.50	1,914,152,350	貸付株式数 614,600株
理研計器	10,800	6,620.00	71,496,000	貸付株式数 5,100株
SCREENホールディングス	52,400	11,860.00	621,464,000	貸付株式数 8,900株 (8,900株)
キヤノン電子	16,900	2,049.00	34,628,100	貸付株式数 1,800株
タムロン	9,400	5,590.00	52,546,000	
HOYA	301,500	16,865.00	5,084,797,500	貸付株式数 164,000株
シード	4,300	843.00	3,624,900	
ノーリツ鋼機	14,500	3,080.00	44,660,000	
A&Dホロンホールディングス	22,300	1,813.00	40,429,900	
朝日インテック	171,100	2,853.00	488,148,300	貸付株式数 53,000株
キヤノン	763,900	3,695.00	2,822,610,500	
リコー	384,000	1,120.00	430,080,000	貸付株式数 244,800株
シチズン時計	140,900	881.00	124,132,900	貸付株式数 62,100株
リズム	1,900	3,005.00	5,709,500	
大研医器	7,300	508.00	3,708,400	
メニコン	52,700	2,276.00	119,945,200	貸付株式数 10,400株
シンシア	1,000	532.00	532,000	
KYORITSU	12,700	185.00	2,349,500	
中本パックス	2,800	1,682.00	4,709,600	貸付株式数 1,500株 (1,500株)

スノーピーク	21,800	909.00	19,816,200	貸付株式数 14,600株 (700株)
パラマウントベッドホールディングス	31,800	2,706.00	86,050,800	
トランザクション	10,100	2,127.00	21,482,700	貸付株式数 5,500株
粧美堂	2,300	685.00	1,575,500	
ニホンフラッシュ	14,400	919.00	13,233,600	貸付株式数 7,000株
前田工織	12,900	3,245.00	41,860,500	貸付株式数 5,900株 (5,900株)
永大産業	10,000	228.00	2,280,000	
アートネイチャー	13,800	807.00	11,136,600	貸付株式数 1,200株
バンダイナムコホールディングス	419,600	2,839.00	1,191,244,400	貸付株式数 3,300株
アイフィスジャパン	2,300	615.00	1,414,500	
SHOEI	34,600	1,891.00	65,428,600	
フランスベッドホールディングス	19,800	1,385.00	27,423,000	貸付株式数 10,500株
マーベラス	24,900	719.00	17,903,100	
パイロットコーポレーション	21,600	4,186.00	90,417,600	貸付株式数 12,700株
萩原工業	10,200	1,502.00	15,320,400	貸付株式数 5,600株
エイベックス	26,200	1,382.00	36,208,400	貸付株式数 9,300株
フジシールインターナショナル	31,000	1,734.00	53,754,000	貸付株式数 17,200株
タカラトミー	69,700	2,260.50	157,556,850	
広済堂ホールディングス	34,500	772.00	26,634,000	貸付株式数 22,500株
エステールホールディングス	2,000	637.00	1,274,000	
レック	19,700	1,034.00	20,369,800	
タカノ	3,200	983.00	3,145,600	貸付株式数 2,100株
三光合成	19,300	502.00	9,688,600	
プロネクス	15,900	1,297.00	20,622,300	
ホクシン	6,500	117.00	760,500	貸付株式数 3,500株
ウッドワン	3,100	1,024.00	3,174,400	貸付株式数 1,300株 (100株)
きもと	14,100	207.00	2,918,700	
TOPPANホールディングス	188,300	3,921.00	738,324,300	
大日本印刷	167,400	4,176.00	699,062,400	貸付株式数 52,200株
共同印刷	4,300	3,305.00	14,211,500	貸付株式数 2,300株
NISSHA	26,200	1,503.00	39,378,600	

光村印刷	700	1,484.00	1,038,800	貸付株式数 300株
藤森工業	12,100	3,835.00	46,403,500	
ヴィア・ホールディングス	13,400	176.00	2,358,400	貸付株式数 7,300株
TAKARA & COMPANY	9,800	2,672.00	26,185,600	貸付株式数 5,300株
前澤化成工業	9,900	1,523.00	15,077,700	貸付株式数 5,400株
未来工業	5,500	3,575.00	19,662,500	
アシックス	130,500	4,210.00	549,405,000	貸付株式数 73,000株
ツツミ	3,600	2,315.00	8,334,000	貸付株式数 1,300株
ウェーブロックホールディングス	3,200	637.00	2,038,400	
J S P	10,800	1,865.00	20,142,000	貸付株式数 5,900株
ニチハ	19,200	2,918.00	56,025,600	
ローランド	11,300	4,425.00	50,002,500	貸付株式数 100株
エフピコ	29,100	2,888.00	84,040,800	
小松ウオール工業	6,200	3,005.00	18,631,000	
ヤマハ	96,500	3,255.00	314,107,500	貸付株式数 1,900株
河合楽器製作所	4,600	3,625.00	16,675,000	貸付株式数 2,200株
クリナップ	15,000	702.00	10,530,000	
ピジョン	97,500	1,619.00	157,852,500	貸付株式数 57,500株
天馬	11,100	2,269.00	25,185,900	
キングジム	13,500	874.00	11,799,000	貸付株式数 7,400株
象印マホービン	41,600	1,494.00	62,150,400	
リンテック	30,700	2,700.00	82,890,000	
信越ポリマー	33,100	1,644.00	54,416,400	
東リ	18,900	326.00	6,161,400	
イトーキ	31,400	1,428.00	44,839,200	貸付株式数 19,600株
任天堂	966,900	7,223.00	6,983,918,700	貸付株式数 577,000株
三菱鉛筆	21,700	2,033.00	44,116,100	
松風	6,900	2,733.00	18,857,700	貸付株式数 3,700株 (3,700株)
タカラスタANDARD	32,200	1,692.00	54,482,400	
コクヨ	62,600	2,342.00	146,609,200	
ナカバヤシ	16,500	556.00	9,174,000	貸付株式数 7,300株
ニフコ	45,900	3,839.00	176,210,100	
立川ブラインド工業	7,100	1,427.00	10,131,700	貸付株式数 3,900株

グロープライド	13,700	1,992.00	27,290,400	貸付株式数 2,800株
オカムラ	46,100	2,211.00	101,927,100	
バルカー	12,800	4,170.00	53,376,000	
MUTOHホールディングス	1,200	2,008.00	2,409,600	貸付株式数 500株
伊藤忠商事	1,089,200	5,878.00	6,402,317,600	
丸紅	1,351,000	2,291.00	3,095,141,000	
スクロール	24,100	977.00	23,545,700	貸付株式数 2,500株
高島	6,100	1,211.00	7,387,100	貸付株式数 400株
ヨンドシーホールディングス	15,300	2,044.00	31,273,200	貸付株式数 2,000株
三陽商会	5,100	2,366.00	12,066,600	貸付株式数 2,600株
長瀬産業	74,300	2,319.50	172,338,850	
ナイガイ	2,800	269.00	753,200	
蝶理	10,100	2,875.00	29,037,500	貸付株式数 4,600株
豊田通商	141,900	8,798.00	1,248,436,200	貸付株式数 87,500株
オンワードホールディングス	90,400	490.00	44,296,000	貸付株式数 49,600株
三共生興	22,500	718.00	16,155,000	
兼松	67,800	2,147.00	145,566,600	
美津濃	15,200	4,000.00	60,800,000	
ツカモトコーポレーション	1,300	1,205.00	1,566,500	貸付株式数 800株
ルックホールディングス	3,700	2,348.00	8,687,600	貸付株式数 2,200株
三井物産	1,220,900	5,443.00	6,645,358,700	貸付株式数 720,700株
日本紙パルプ商事	7,700	5,020.00	38,654,000	貸付株式数 4,700株
東京エレクトロン	324,100	24,120.00	7,817,292,000	貸付株式数 114,300株
カメイ	17,200	1,774.00	30,512,800	
東都水産	500	7,130.00	3,565,000	貸付株式数 300株
OUGホールディングス	1,300	2,445.00	3,178,500	
スターゼン	11,200	2,700.00	30,240,000	
セイコーグループ	21,300	2,699.00	57,488,700	
山善	49,100	1,211.00	59,460,100	
椿本興業	3,300	6,150.00	20,295,000	貸付株式数 1,600株
住友商事	980,700	3,147.00	3,086,262,900	
BIPROGY	50,200	4,340.00	217,868,000	
内田洋行	6,600	6,870.00	45,342,000	
三菱商事	3,210,800	2,353.00	7,555,012,400	



第一実業	15,200	2,060.00	31,312,000	
キャノンマーケティングジャパン	37,500	4,195.00	157,312,500	貸付株式数 7,700株
西華産業	6,400	2,995.00	19,168,000	
佐藤商事	11,200	1,519.00	17,012,800	
菱洋エレクトロ	15,300	3,640.00	55,692,000	
東京産業	14,800	849.00	12,565,200	
ユアサ商事	12,700	4,730.00	60,071,000	
神鋼商事	4,100	5,840.00	23,944,000	
トルク	4,800	276.00	1,324,800	貸付株式数 2,600株
阪和興業	29,100	5,050.00	146,955,000	
正栄食品工業	10,800	4,785.00	51,678,000	貸付株式数 6,000株
カナデン	12,200	1,589.00	19,385,800	貸付株式数 5,900株
RYODEN	13,100	2,715.00	35,566,500	貸付株式数 7,200株
ニプロ	127,700	1,111.50	141,938,550	貸付株式数 70,500株
岩谷産業	36,900	6,593.00	243,281,700	貸付株式数 2,900株
ナイス	2,800	1,708.00	4,782,400	
ニチモウ	2,800	2,079.00	5,821,200	
極東貿易	9,700	2,037.00	19,758,900	貸付株式数 5,100株 (5,100株)
アステナホールディングス	30,400	482.00	14,652,800	
三愛オブリ	38,900	1,657.00	64,457,300	
稲畑産業	32,000	3,255.00	104,160,000	
G S I クレオス	8,700	2,244.00	19,522,800	
明和産業	19,100	672.00	12,835,200	貸付株式数 13,100株
クワザワホールディングス	3,200	700.00	2,240,000	貸付株式数 1,700株
キムラタン	54,300	19.00	1,031,700	貸付株式数 28,800株
ゴールドウイン	27,200	9,485.00	257,992,000	
ユニ・チャーム	320,000	5,125.00	1,640,000,000	貸付株式数 16,100株
デサント	26,400	3,645.00	96,228,000	
キング	3,200	698.00	2,233,600	
ワキタ	26,800	1,608.00	43,094,400	貸付株式数 14,700株
ヤマトインターナショナル	6,700	314.00	2,103,800	
東邦ホールディングス	44,800	3,198.00	143,270,400	貸付株式数 22,200株
サンゲツ	37,300	3,125.00	116,562,500	貸付株式数 900株
ミツウロコグループホールディングス	20,700	1,602.00	33,161,400	

シナネンホールディングス	4,500	4,235.00	19,057,500	貸付株式数 2,800株 (2,800株)
伊藤忠エネクス	40,200	1,653.00	66,450,600	貸付株式数 6,200株
サンリオ	45,900	6,001.00	275,445,900	貸付株式数 5,300株
サンワテクノス	8,300	2,246.00	18,641,800	
リョーサン	11,500	4,790.00	55,085,000	
新光商事	21,800	1,192.00	25,985,600	貸付株式数 100株
トーヨー	6,300	2,782.00	17,526,600	貸付株式数 3,800株
三信電気	6,500	2,236.00	14,534,000	貸付株式数 1,000株
東陽テクニカ	16,400	1,443.00	23,665,200	
モスフードサービス	23,800	3,325.00	79,135,000	貸付株式数 13,000株
加賀電子	14,800	6,240.00	92,352,000	
三益半導体工業	12,200	3,095.00	37,759,000	貸付株式数 3,800株
都築電気	8,100	2,280.00	18,468,000	貸付株式数 4,400株
ソーダニッカ	12,000	1,122.00	13,464,000	
立花エレテック	10,700	2,800.00	29,960,000	貸付株式数 900株
木曾路	24,500	2,603.00	63,773,500	貸付株式数 13,500株
SRSホールディングス	26,700	1,113.00	29,717,100	貸付株式数 14,500株
千趣会	29,800	351.00	10,459,800	貸付株式数 12,900株
タカキュー	6,300	83.00	522,900	貸付株式数 3,400株
リテールパートナーズ	24,000	1,701.00	40,824,000	貸付株式数 9,400株
上新電機	16,000	2,455.00	39,280,000	
日本瓦斯	85,900	2,383.50	204,742,650	
ロイヤルホールディングス	28,600	2,567.00	73,416,200	貸付株式数 18,900株
東天紅	700	824.00	576,800	
いなげや	15,700	1,315.00	20,645,500	貸付株式数 8,200株
チヨダ	15,500	861.00	13,345,500	
ライフコーポレーション	17,000	3,330.00	56,610,000	貸付株式数 100株 (100株)
リンガーハット	20,900	2,358.00	49,282,200	貸付株式数 11,400株
MrMaxHD	20,400	635.00	12,954,000	
テンアライド	11,800	311.00	3,669,800	貸付株式数

				7,000株
AOKIホールディングス	34,700	1,137.00	39,453,900	
オークワ	23,300	843.00	19,641,900	貸付株式数 14,200株
コメリ	24,900	3,200.00	79,680,000	貸付株式数 4,000株
青山商事	34,600	1,487.00	51,450,200	貸付株式数 19,000株
しまむら	19,000	15,605.00	296,495,000	貸付株式数 100株
はせがわ	4,300	372.00	1,599,600	
高島屋	112,000	1,959.50	219,464,000	貸付株式数 71,200株
松屋	27,500	948.00	26,070,000	貸付株式数 15,100株
エイチ・ツー・オー リテイリング	71,700	1,555.00	111,493,500	貸付株式数 17,200株
近鉄百貨店	6,900	2,657.00	18,333,300	貸付株式数 2,800株
丸井グループ	107,600	2,437.00	262,221,200	貸付株式数 3,200株
クレディセゾン	95,600	2,628.00	251,236,800	貸付株式数 1,700株
アクシアル リテイリング	11,100	4,120.00	45,732,000	
井筒屋	4,300	385.00	1,655,500	
イオン	549,300	3,252.00	1,786,323,600	貸付株式数 314,500株
イズミ	28,700	3,657.00	104,955,900	貸付株式数 100株
フォーバル	6,400	1,447.00	9,260,800	貸付株式数 3,400株
平和堂	27,100	2,141.00	58,021,100	貸付株式数 15,100株
フジ	24,900	1,966.00	48,953,400	貸付株式数 16,000株
ヤオコー	18,300	8,072.00	147,717,600	貸付株式数 11,100株 (1,200株)
ゼビオホールディングス	22,000	972.00	21,384,000	
ケーズホールディングス	114,500	1,334.50	152,800,250	貸付株式数 59,000株
PALTAC	21,800	4,589.00	100,040,200	貸付株式数 800株
三谷産業	28,300	355.00	10,046,500	貸付株式数 17,000株
Olympicグループ	4,000	549.00	2,196,000	
日産東京販売ホールディングス	13,400	462.00	6,190,800	
あおぞら銀行	108,400	3,160.00	342,544,000	貸付株式数 72,300株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,185,800	1,258.00	11,555,736,400	貸付株式数 6,147,500株

りそなホールディングス	1,758,800	746.70	1,313,295,960	
三井住友トラスト・ホールディングス	542,100	2,848.00	1,543,900,800	
三井住友フィナンシャルグループ	1,072,400	7,161.00	7,679,456,400	
千葉銀行	420,400	1,044.50	439,107,800	
群馬銀行	292,700	704.80	206,294,960	
武蔵野銀行	21,000	2,696.00	56,616,000	
千葉興業銀行	24,900	777.00	19,347,300	
筑波銀行	66,200	247.00	16,351,400	貸付株式数 9,100株
七十七銀行	43,900	3,515.00	154,308,500	貸付株式数 1,000株
秋田銀行	10,100	1,932.00	19,513,200	
山形銀行	16,800	1,077.00	18,093,600	
岩手銀行	9,500	2,526.00	23,997,000	
東邦銀行	119,300	289.00	34,477,700	
東北銀行	4,100	1,197.00	4,907,700	
ふくおかフィナンシャルグループ	131,400	3,447.00	452,935,800	貸付株式数 900株
スルガ銀行	133,000	806.00	107,198,000	貸付株式数 4,200株
八十二銀行	323,700	774.40	250,673,280	
山梨中央銀行	16,900	1,696.00	28,662,400	
大垣共立銀行	28,700	1,887.00	54,156,900	
福井銀行	13,500	1,664.00	22,464,000	
清水銀行	6,000	1,553.00	9,318,000	
富山銀行	1,400	1,717.00	2,403,800	貸付株式数 900株
滋賀銀行	25,100	3,500.00	87,850,000	
南都銀行	22,700	2,491.00	56,545,700	
百五銀行	141,900	545.00	77,335,500	
紀陽銀行	54,000	1,589.00	85,806,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	93,300	1,534.50	143,168,850	貸付株式数 6,600株
山陰合同銀行	94,400	1,012.00	95,532,800	貸付株式数 2,800株
鳥取銀行	2,900	1,380.00	4,002,000	貸付株式数 2,000株
百十四銀行	14,800	2,424.00	35,875,200	
四国銀行	22,100	980.00	21,658,000	
阿波銀行	21,200	2,407.00	51,028,400	貸付株式数 6,200株
大分銀行	9,100	2,564.00	23,332,400	
宮崎銀行	9,100	2,667.00	24,269,700	
佐賀銀行	8,800	1,879.00	16,535,200	
琉球銀行	32,100	1,123.00	36,048,300	
セブン銀行	472,800	300.30	141,981,840	貸付株式数 153,800株 (153,300株)
みずほフィナンシャルグループ	2,036,000	2,548.00	5,187,728,000	
高知銀行	2,900	928.00	2,691,200	貸付株式数

				1,900株
山口フィナンシャルグループ	147,900	1,317.50	194,858,250	
芙蓉総合リース	13,900	12,735.00	177,016,500	貸付株式数 7,700株
みずほリース	25,300	4,965.00	125,614,500	
東京センチュリー	112,700	1,584.00	178,516,800	貸付株式数 400株
SBIホールディングス	220,900	3,360.00	742,224,000	貸付株式数 145,400株 (98,300株)
日本証券金融	55,400	1,536.00	85,094,400	
アイフル	222,000	388.00	86,136,000	
日本アジア投資	6,100	242.00	1,476,200	
名古屋銀行	9,800	5,420.00	53,116,000	貸付株式数 3,000株
北洋銀行	228,500	354.00	80,889,000	
大光銀行	2,700	1,296.00	3,499,200	
愛媛銀行	20,300	1,027.00	20,848,100	
トマト銀行	3,000	1,180.00	3,540,000	
京葉銀行	63,300	684.00	43,297,200	
栃木銀行	75,300	307.00	23,117,100	貸付株式数 7,100株
北日本銀行	4,900	2,144.00	10,505,600	
東和銀行	27,700	614.00	17,007,800	
福島銀行	8,800	237.00	2,085,600	貸付株式数 200株 (200株)
大東銀行	3,600	762.00	2,743,200	
リコーリース	14,300	4,890.00	69,927,000	貸付株式数 4,500株
イオンフィナンシャルサービス	86,600	1,308.50	113,316,100	
アコム	269,200	355.50	95,700,600	貸付株式数 600株
ジャックス	16,100	5,300.00	85,330,000	
オリエントコーポレーション	49,200	1,094.00	53,824,800	貸付株式数 100株
オリックス	919,400	2,759.00	2,536,624,600	貸付株式数 6,400株
三菱HCキャピタル	672,100	984.90	661,951,290	
ジャフコグループ	44,900	1,669.50	74,960,550	貸付株式数 14,600株
九州リースサービス	3,300	1,123.00	3,705,900	貸付株式数 2,200株
トモニホールディングス	142,700	390.00	55,653,000	貸付株式数 5,000株
大和証券グループ本社	1,168,500	1,005.00	1,174,342,500	
野村ホールディングス	2,536,600	669.20	1,697,492,720	貸付株式数 275,700株
岡三証券グループ	132,400	708.00	93,739,200	貸付株式数 62,100株
丸三証券	50,200	860.00	43,172,000	貸付株式数

				27,400株 (26,100株)
東洋証券	40,000	296.00	11,840,000	貸付株式数 400株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	179,100	556.00	99,579,600	
光世証券	1,900	497.00	944,300	貸付株式数 1,000株 (1,000株)
水戸証券	44,500	443.00	19,713,500	
いちよし証券	28,200	724.00	20,416,800	
松井証券	74,200	756.00	56,095,200	貸付株式数 1,000株
SOMPOホールディングス	226,900	7,080.00	1,606,452,000	
日本取引所グループ	393,500	3,005.00	1,182,467,500	貸付株式数 2,600株
マネックスグループ	147,700	697.00	102,946,900	
極東証券	20,700	1,000.00	20,700,000	
岩井コスモホールディングス	17,200	1,872.00	32,198,400	
アイザワ証券グループ	21,800	1,264.00	27,555,200	
フィデアホールディングス	15,600	1,531.00	23,883,600	
池田泉州ホールディングス	209,200	331.00	69,245,200	
アニコムホールディングス	51,200	540.00	27,648,000	
MS&ADインシュアランスグループ ホールディングス	337,700	5,700.00	1,924,890,000	
マネーパートナーズグループ	8,700	296.00	2,575,200	
スパークス・グループ	16,800	1,643.00	27,602,400	
小林洋行	3,600	244.00	878,400	
第一生命ホールディングス	737,000	3,107.00	2,289,859,000	貸付株式数 1,800株
東京海上ホールディングス	1,490,900	3,555.00	5,300,149,500	貸付株式数 8,400株
アドバンテッジリスクマネジメント	4,500	489.00	2,200,500	
イー・ギャランティ	24,500	2,018.00	49,441,000	貸付株式数 400株
アサックス	3,800	725.00	2,755,000	貸付株式数 2,500株
NECキャピタルソリューション	7,400	3,495.00	25,863,000	貸付株式数 4,000株
T&Dホールディングス	405,000	2,324.00	941,220,000	貸付株式数 51,700株
アドバンスクリエイト	8,700	1,015.00	8,830,500	貸付株式数 4,800株
三井不動産	697,500	3,551.00	2,476,822,500	貸付株式数 49,900株
三菱地所	986,000	1,996.50	1,968,549,000	貸付株式数 24,900株
平和不動産	24,500	3,825.00	93,712,500	
東京建物	131,800	2,138.00	281,788,400	貸付株式数 82,400株
京阪神ビルディング	28,200	1,405.00	39,621,000	貸付株式数

				15,400株 (14,800株)
住友不動産	218,100	4,289.00	935,430,900	貸付株式数 2,800株
太平洋興発	3,300	832.00	2,745,600	
テーオーシー	26,900	728.00	19,583,200	貸付株式数 8,900株
東京楽天地	2,500	6,740.00	16,850,000	
レオパレス21	150,900	423.00	63,830,700	貸付株式数 20,800株
スターツコーポレーション	21,600	2,954.00	63,806,400	貸付株式数 1,900株
フジ住宅	19,000	719.00	13,661,000	
空港施設	21,200	596.00	12,635,200	貸付株式数 300株
明和地所	7,500	1,262.00	9,465,000	貸付株式数 3,000株
ゴールドクレスト	12,300	2,284.00	28,093,200	貸付株式数 100株
リログループ	78,900	1,646.00	129,869,400	貸付株式数 200株
エスリード	7,100	3,600.00	25,560,000	貸付株式数 500株
日神グループホールディングス	24,200	516.00	12,487,200	貸付株式数 13,300株
日本エスコン	28,200	959.00	27,043,800	貸付株式数 7,800株
MIRARTHホールディングス	69,300	481.00	33,333,300	
AVANTIA	4,700	894.00	4,201,800	貸付株式数 2,900株
イオンモール	78,200	1,808.00	141,385,600	貸付株式数 50,900株
毎日コムネット	3,100	747.00	2,315,700	
ファースト住建	3,400	1,071.00	3,641,400	貸付株式数 2,300株
ランド	825,300	8.00	6,602,400	
カチタス	40,500	2,144.00	86,832,000	貸付株式数 19,400株
東祥	11,000	844.00	9,284,000	貸付株式数 5,900株
トーセイ	25,100	2,003.00	50,275,300	貸付株式数 14,000株
穴吹興産	1,700	2,032.00	3,454,400	
サンフロンティア不動産	22,300	1,706.00	38,043,800	貸付株式数 6,500株
FJネクストホールディングス	15,900	1,157.00	18,396,300	貸付株式数 8,700株
インテリックス	2,000	499.00	998,000	
ランドビジネス	3,100	268.00	830,800	貸付株式数 600株
サンネクスタグループ	2,500	968.00	2,420,000	

グランディハウス	9,900	626.00	6,197,400	
東武鉄道	168,200	3,873.00	651,438,600	貸付株式数 65,900株
相鉄ホールディングス	54,800	2,751.00	150,754,800	
東急	429,400	1,768.50	759,393,900	貸付株式数 269,400株
京浜急行電鉄	189,500	1,311.00	248,434,500	
小田急電鉄	253,300	2,217.50	561,692,750	貸付株式数 79,900株
京王電鉄	73,600	4,492.00	330,611,200	貸付株式数 5,800株
京成電鉄	98,700	6,741.00	665,336,700	貸付株式数 37,800株
富士急行	18,900	4,290.00	81,081,000	貸付株式数 11,500株
東日本旅客鉄道	281,400	8,316.00	2,340,122,400	貸付株式数 156,300株 (156,300株)
西日本旅客鉄道	181,700	6,048.00	1,098,921,600	貸付株式数 3,200株 (3,200株)
東海旅客鉄道	589,900	3,679.00	2,170,242,100	
西武ホールディングス	185,300	1,992.00	369,117,600	
鴻池運輸	26,100	1,930.00	50,373,000	
西日本鉄道	40,900	2,424.00	99,141,600	
ハマキョウレックス	13,100	4,160.00	54,496,000	
サカイ引越センター	17,000	2,726.00	46,342,000	貸付株式数 8,000株
近鉄グループホールディングス	152,900	4,568.00	698,447,200	貸付株式数 99,300株
阪急阪神ホールディングス	203,900	4,543.00	926,317,700	貸付株式数 26,100株
南海電気鉄道	68,200	2,905.00	198,121,000	
京阪ホールディングス	84,300	3,695.00	311,488,500	
神戸電鉄	4,200	2,942.00	12,356,400	貸付株式数 2,300株
名古屋鉄道	157,700	2,319.00	365,706,300	
山陽電気鉄道	11,500	2,172.00	24,978,000	貸付株式数 6,300株
アルプス物流	12,200	1,764.00	21,520,800	貸付株式数 6,700株
トランコム	4,400	7,260.00	31,944,000	貸付株式数 1,200株
ヤマトホールディングス	195,800	2,632.50	515,443,500	貸付株式数 81,900株
山九	38,900	5,233.00	203,563,700	貸付株式数 100株
日新	11,600	2,547.00	29,545,200	
丸運	5,000	274.00	1,370,000	
丸全昭和運輸	9,400	4,050.00	38,070,000	
センコーグループホールディングス	81,000	1,176.00	95,256,000	貸付株式数



				54,000株 (15,500株)
トナミホールディングス	3,400	4,655.00	15,827,000	
ニッコンホールディングス	48,900	3,114.00	152,274,600	
日本石油輸送	900	2,914.00	2,622,600	
福山通運	17,400	4,155.00	72,297,000	
セイノーホールディングス	86,000	2,162.50	185,975,000	貸付株式数 59,100株 (600株)
エスライングループ本社	2,400	905.00	2,172,000	貸付株式数 900株
神奈川中央交通	4,300	3,025.00	13,007,500	貸付株式数 1,500株
AZ-COM丸和ホールディングス	39,100	1,593.00	62,286,300	貸付株式数 24,500株
C&Fロジホールディングス	14,700	1,493.00	21,947,100	貸付株式数 6,100株
日本郵船	438,300	4,758.00	2,085,431,400	貸付株式数 16,200株
商船三井	331,800	4,908.00	1,628,474,400	貸付株式数 25,200株
川崎汽船	129,200	6,607.00	853,624,400	貸付株式数 81,800株
NSユニテッド海運	8,200	5,030.00	41,246,000	貸付株式数 100株
明海グループ	9,300	823.00	7,653,900	貸付株式数 5,800株
飯野海運	56,100	1,230.00	69,003,000	
共栄タンカー	1,500	870.00	1,305,000	
九州旅客鉄道	108,100	3,171.00	342,785,100	
SGホールディングス	256,700	2,067.00	530,598,900	貸付株式数 167,700株
NIPPON EXPRESSホールディングス	51,900	8,252.00	428,278,800	
ID&Eホールディングス	9,500	3,445.00	32,727,500	貸付株式数 500株
日本航空	375,500	2,786.50	1,046,330,750	貸付株式数 235,000株
ANAホールディングス	416,000	3,137.00	1,304,992,000	貸付株式数 261,800株 (43,600株)
ビーウィズ	4,000	2,115.00	8,460,000	貸付株式数 2,200株
パスコ	1,700	1,828.00	3,107,600	
TREホールディングス	30,100	1,184.00	35,638,400	
人・夢・技術グループ	5,900	1,810.00	10,679,000	
西本Wismettacホールディングス	4,100	5,800.00	23,780,000	貸付株式数 2,200株
シルバーライフ	3,100	857.00	2,656,700	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	700	2,203.00	1,542,100	貸付株式数 300株

Genky Drug Stores	7,100	5,400.00	38,340,000	貸付株式数 3,900株
コア商事ホールディングス	9,100	728.00	6,624,800	
KPPグループホールディングス	41,900	698.00	29,246,200	
ナルミヤ・インターナショナル	1,400	1,215.00	1,701,000	
ブックオフグループホールディングス	8,200	1,163.00	9,536,600	貸付株式数 4,700株
ギフトホールディングス	6,900	2,402.00	16,573,800	貸付株式数 800株
三菱倉庫	37,600	4,367.00	164,199,200	貸付株式数 700株
三井倉庫ホールディングス	14,300	4,880.00	69,784,000	
住友倉庫	41,200	2,534.00	104,400,800	
澁澤倉庫	7,000	3,020.00	21,140,000	
ヤマタネ	7,100	2,543.00	18,055,300	貸付株式数 3,900株
東陽倉庫	2,300	1,574.00	3,620,200	
乾汽船	17,900	1,129.00	20,209,100	貸付株式数 12,300株
日本トランスシティ	30,800	635.00	19,558,000	貸付株式数 16,600株
ケイヒン	1,500	1,777.00	2,665,500	
中央倉庫	8,200	1,174.00	9,626,800	貸付株式数 4,000株
川西倉庫	1,600	1,224.00	1,958,400	貸付株式数 1,000株
安田倉庫	10,400	1,248.00	12,979,200	貸付株式数 5,800株
ファイズホールディングス	1,200	1,221.00	1,465,200	
NISSOホールディングス	13,600	803.00	10,920,800	貸付株式数 8,000株 (8,000株)
大栄環境	28,600	2,483.00	71,013,800	
日本管財ホールディングス	16,500	2,584.00	42,636,000	
東洋埠頭	2,400	1,404.00	3,369,600	
上組	70,600	3,474.00	245,264,400	
サンリツ	2,100	779.00	1,635,900	
キムラユニティー	4,000	1,400.00	5,600,000	貸付株式数 500株
キューソー流通システム	6,100	937.00	5,715,700	貸付株式数 3,500株
東海運	5,000	292.00	1,460,000	
エーアイテイー	9,600	1,816.00	17,433,600	貸付株式数 1,400株
内外トランスライン	6,100	2,390.00	14,579,000	貸付株式数 3,700株
ショーエイコーポレーション	2,700	599.00	1,617,300	
日本コンセプト	5,600	1,763.00	9,872,800	貸付株式数 2,600株
TBSホールディングス	77,200	2,964.00	228,820,800	貸付株式数 51,700株

日本テレビホールディングス	136,000	1,555.50	211,548,000	
朝日放送グループホールディングス	14,400	669.00	9,633,600	貸付株式数 8,100株
テレビ朝日ホールディングス	37,300	1,633.00	60,910,900	貸付株式数 2,400株 (2,400株)
スカパーJ S A Tホールディングス	119,300	708.00	84,464,400	
テレビ東京ホールディングス	11,100	3,090.00	34,299,000	貸付株式数 6,100株
日本BS放送	3,100	917.00	2,842,700	貸付株式数 1,500株
ビジョン	23,100	1,188.00	27,442,800	貸付株式数 13,300株
スマートバリュー	2,100	409.00	858,900	貸付株式数 500株 (500株)
USEN-NEXT HOLDING S	17,200	3,995.00	68,714,000	貸付株式数 10,300株
ワイヤレスゲート	3,700	230.00	851,000	貸付株式数 2,500株
日本通信	151,200	228.00	34,473,600	
クロップス	1,100	1,189.00	1,307,900	
日本電信電話	45,689,700	173.90	7,945,438,830	貸付株式数 30,211,600株
KDDI	1,186,900	4,594.00	5,452,618,600	貸付株式数 632,600株
ソフトバンク	2,471,700	1,811.00	4,476,248,700	貸付株式数 1,479,700株
光通信	15,500	24,080.00	373,240,000	貸付株式数 100株
エムティーアイ	10,500	655.00	6,877,500	貸付株式数 5,800株 (2,400株)
GMOインターネットグループ	56,800	2,497.50	141,858,000	貸付株式数 33,100株
ファイバーゲート	8,300	908.00	7,536,400	貸付株式数 5,300株 (800株)
アイドママーケティングコミュニケーション	2,300	235.00	540,500	
KADOKAWA	81,200	2,891.00	234,749,200	貸付株式数 200株
学研ホールディングス	25,600	998.00	25,548,800	貸付株式数 14,000株
ゼンリン	26,300	887.00	23,328,100	
昭文社ホールディングス	3,600	365.00	1,314,000	貸付株式数 1,800株
インプレスホールディングス	8,600	180.00	1,548,000	貸付株式数 5,000株
東京電力ホールディングス	1,380,600	758.00	1,046,494,800	貸付株式数 800,200株

中部電力	564,400	1,903.00	1,074,053,200	
関西電力	591,400	1,956.50	1,157,074,100	
中国電力	266,100	1,048.00	278,872,800	
北陸電力	156,600	757.10	118,561,860	
東北電力	403,200	1,008.00	406,425,600	
四国電力	142,600	1,059.50	151,084,700	
九州電力	353,000	1,068.00	377,004,000	
北海道電力	148,000	657.60	97,324,800	
沖縄電力	39,100	1,178.00	46,059,800	貸付株式数 19,600株
電源開発	125,800	2,393.00	301,039,400	
エフオン	9,900	457.00	4,524,300	貸付株式数 2,600株
イーレックス	27,200	819.00	22,276,800	貸付株式数 18,300株
レノバ	40,800	1,200.00	48,960,000	貸付株式数 26,300株
東京瓦斯	323,800	3,339.00	1,081,168,200	貸付株式数 212,700株
大阪瓦斯	310,200	3,089.00	958,207,800	
東邦瓦斯	66,300	3,071.00	203,607,300	
北海道瓦斯	9,100	2,278.00	20,729,800	貸付株式数 1,000株
広島ガス	32,400	391.00	12,668,400	貸付株式数 700株
西部ガスホールディングス	16,000	1,984.00	31,744,000	
静岡ガス	30,500	1,088.00	33,184,000	貸付株式数 16,800株
メタウォーター	18,300	2,071.00	37,899,300	貸付株式数 10,000株
M&A総研ホールディングス	7,500	4,270.00	32,025,000	貸付株式数 5,000株
アイネット	9,300	1,867.00	17,363,100	
松竹	8,000	9,645.00	77,160,000	貸付株式数 4,400株
東宝	85,400	4,854.00	414,531,600	
エイチ・アイ・エス	45,700	1,843.00	84,225,100	貸付株式数 25,300株
東映	5,100	20,370.00	103,887,000	貸付株式数 1,800株
ラックランド	7,100	2,403.00	17,061,300	貸付株式数 3,900株
NTTデータグループ	401,600	1,980.00	795,168,000	貸付株式数 256,100株
共立メンテナンス	24,700	5,879.00	145,211,300	貸付株式数 15,900株
イチネンホールディングス	16,700	1,593.00	26,603,100	
建設技術研究所	8,100	5,200.00	42,120,000	
スペース	10,300	945.00	9,733,500	
アインホールディングス	22,300	4,519.00	100,773,700	貸付株式数 12,500株

燦ホールディングス	14,700	1,116.00	16,405,200	
ピー・シー・エー	8,800	1,135.00	9,988,000	貸付株式数 4,700株
スバル興業	900	15,000.00	13,500,000	貸付株式数 300株
東京テアトル	3,200	1,116.00	3,571,200	
タナベコンサルティンググループ	4,700	1,012.00	4,756,400	
ビジネスブレイン太田昭和	6,000	2,163.00	12,978,000	
ナガワ	4,900	7,930.00	38,857,000	貸付株式数 3,200株
東京都競馬	13,200	4,425.00	58,410,000	貸付株式数 7,300株
常磐興産	3,300	1,239.00	4,088,700	
カナモト	24,400	2,930.00	71,492,000	
D T S	32,400	3,570.00	115,668,000	貸付株式数 100株
スクウェア・エニックス・ホールディングス	70,200	5,203.00	365,250,600	貸付株式数 200株
シーイーシー	19,400	1,571.00	30,477,400	
カプコン	137,400	4,803.00	659,932,200	
ニシオホールディングス	14,600	4,080.00	59,568,000	貸付株式数 600株 (600株)
アイ・エス・ビー	7,800	1,457.00	11,364,600	
アゴーラ ホスピタリティーループ	56,500	23.00	1,299,500	貸付株式数 38,600株
日本空港ビルデング	53,300	6,167.00	328,701,100	貸付株式数 7,200株
トランス・コスモス	19,600	3,080.00	60,368,000	貸付株式数 4,300株
乃村工藝社	68,700	873.00	59,975,100	貸付株式数 10,500株
ジャステック	9,400	1,440.00	13,536,000	貸付株式数 3,000株
S C S K	107,500	2,867.50	308,256,250	
藤田観光	6,300	5,910.00	37,233,000	貸付株式数 3,800株
K N T - C Tホールディングス	9,400	1,321.00	12,417,400	貸付株式数 4,200株
トーカイ	13,900	2,098.00	29,162,200	
白洋舎	1,300	2,345.00	3,048,500	貸付株式数 800株
セコム	160,300	10,375.00	1,663,112,500	
N S W	6,800	2,895.00	19,686,000	
セントラル警備保障	8,500	2,504.00	21,284,000	
アイネス	12,000	1,616.00	19,392,000	
丹青社	30,500	885.00	26,992,500	貸付株式数 9,300株
メイテックグループホールディングス	56,700	2,849.00	161,538,300	貸付株式数 4,700株
T K C	24,400	3,690.00	90,036,000	貸付株式数

				300株
富士ソフト	30,900	6,020.00	186,018,000	貸付株式数 19,100株
応用地質	14,700	2,085.00	30,649,500	貸付株式数 200株
船井総研ホールディングス	32,800	2,538.00	83,246,400	貸付株式数 4,600株
NSD	54,800	2,720.00	149,056,000	
進学会ホールディングス	2,300	246.00	565,800	貸付株式数 200株
丸紅建材リース	700	2,751.00	1,925,700	
オオバ	5,400	950.00	5,130,000	貸付株式数 3,700株
コナミグループ	57,500	7,874.00	452,755,000	貸付株式数 1,400株
いであ	2,400	1,762.00	4,228,800	貸付株式数 1,400株
学究社	6,300	2,051.00	12,921,300	貸付株式数 100株
ベネッセホールディングス	52,800	2,635.00	139,128,000	
イオンディライト	16,900	3,580.00	60,502,000	貸付株式数 9,900株
ナック	6,700	990.00	6,633,000	貸付株式数 3,600株
福井コンピュータホールディングス	9,500	2,545.00	24,177,500	
ダイセキ	32,100	3,935.00	126,313,500	貸付株式数 3,500株
ステップ	5,700	1,956.00	11,149,200	貸付株式数 200株 (200株)
泉州電業	8,100	3,235.00	26,203,500	貸付株式数 4,500株
元気寿司	9,200	3,390.00	31,188,000	貸付株式数 1,800株
トラスコ中山	34,000	2,468.00	83,912,000	
ヤマダホールディングス	498,400	446.30	222,435,920	
オートバックスセブン	56,400	1,579.50	89,083,800	
モリト	11,600	1,311.00	15,207,600	
アークランズ	48,200	1,711.00	82,470,200	貸付株式数 26,500株
ニトリホールディングス	59,000	17,500.00	1,032,500,000	貸付株式数 2,700株
グルメ杵屋	13,100	1,069.00	14,003,900	貸付株式数 8,100株
愛眼	6,600	188.00	1,240,800	
ケーユーホールディングス	7,600	1,125.00	8,550,000	
吉野家ホールディングス	59,700	3,262.00	194,741,400	貸付株式数 36,900株
加藤産業	20,000	4,625.00	92,500,000	
北恵	2,300	900.00	2,070,000	貸付株式数 1,400株

イノテック	10,200	1,792.00	18,278,400	
イエローハット	25,700	1,782.00	45,797,400	貸付株式数 15,400株
松屋フーズホールディングス	7,600	5,780.00	43,928,000	貸付株式数 4,200株
J B C Cホールディングス	10,200	3,930.00	40,086,000	貸付株式数 100株
J Kホールディングス	12,400	1,074.00	13,317,600	貸付株式数 6,800株
サガミホールディングス	24,300	1,453.00	35,307,900	貸付株式数 1,400株
日伝	11,000	2,898.00	31,878,000	貸付株式数 600株
関西フードマーケット	11,000	1,460.00	16,060,000	貸付株式数 4,200株
ミロク情報サービス	14,000	1,742.00	24,388,000	貸付株式数 1,700株
北沢産業	5,500	278.00	1,529,000	貸付株式数 3,600株
杉本商事	7,800	2,269.00	17,698,200	貸付株式数 3,900株
因幡電機産業	42,000	3,405.00	143,010,000	
王将フードサービス	12,000	8,090.00	97,080,000	貸付株式数 4,100株
ミニストップ	11,800	1,533.00	18,089,400	貸付株式数 6,400株
アークス	29,700	2,812.00	83,516,400	貸付株式数 6,600株
バローホールディングス	30,900	2,463.00	76,106,700	
東テック	5,400	4,910.00	26,514,000	
ミスミグループ本社	244,600	2,413.50	590,342,100	
アルテック	4,800	240.00	1,152,000	
ベルク	8,100	6,250.00	50,625,000	貸付株式数 2,500株
大 庄	6,800	1,244.00	8,459,200	貸付株式数 3,900株
タキヒヨー	2,100	1,008.00	2,116,800	貸付株式数 300株
ファーストリテイリング	72,900	34,500.00	2,515,050,000	貸付株式数 48,900株
ソフトバンクグループ	757,700	6,080.00	4,606,816,000	貸付株式数 401,700株
蔵王産業	1,600	2,490.00	3,984,000	
スズケン	61,700	4,677.00	288,570,900	
サンドラッグ	54,700	4,517.00	247,079,900	
サックスパー ホールディングス	13,700	812.00	11,124,400	貸付株式数 300株
ジェコス	9,700	1,098.00	10,650,600	
ヤマザワ	1,900	1,263.00	2,399,700	
やまや	1,900	3,085.00	5,861,500	貸付株式数 700株

グローセル	16,500	687.00	11,335,500	
ベルーナ	39,000	628.00	24,492,000	貸付株式数 21,400株
合計	237,173,100		520,244,712,160	

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。



## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

2024年1月31日現在

I 資産総額	777,184,820,756円
II 負債総額	202,106,550,292円
III 純資産総額 (I - II)	575,078,270,464円
IV 発行済数量	222,338,688口
V 1口当たり純資産額 (III / IV)	2,586.50円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (3) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

① 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。

② 上記①の申請のある場合には、上記①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①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。

③ 上記①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。

### (4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (5) 受益権の再分割

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

### (6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、交換請求の受付、交換有価証券の交付および信託終了にかかる金銭の支払い等については、約

款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額（2024年1月31日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構（2024年1月31日現在）

###### ① 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。

###### ② 投資運用の意思決定機構

###### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

###### 2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年1月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,572,383,675,634
追加型株式投資信託	780	15,835,315,739,439
単位型公社債投資信託	21	36,022,651,893
単位型株式投資信託	202	1,082,536,147,383
合計	1,029	18,526,258,214,349

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。  
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表及び中間財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、第38期事業年度（自2022年4月1日至2023年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受け、第39期中間会計期間（自2023年4月1日至2023年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

# 独立監査人の監査報告書

2023年5月25日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人 東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 丘本 正彦

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 稲葉 宏和

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### その他の記載内容

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

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

### 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

(注2) X B R Lデータは監査の対象には含まれておりません。



## (1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,445	1,481
リース債務	-	1
未払金	7,616	7,246
未払収益分配金	0	0
未払償還金	9	-
未払手数料	7,430	7,005
その他未払金	175	240
未払費用	8,501	7,716
未払法人税等	2,683	1,958
未払消費税等	1,330	277
賞与引当金	1,933	1,730
役員賞与引当金	69	48
流動負債計	23,581	20,460
固定負債		
リース債務	-	6
退職給付引当金	2,507	2,654
時効後支払損引当金	147	108
固定負債計	2,655	2,769
負債合計	26,236	23,230
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金	19,552	19,552
資本準備金	2,428	2,428
その他資本剰余金	17,124	17,124
利益剰余金	56,020	57,481
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	55,896	57,358
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	24,216	25,678
株主資本計	77,573	79,034
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△0	△0
評価・換算差額等計	△0	△0
純資産合計	77,573	79,034
負債・純資産合計	103,810	102,265

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

(単位：百万円)

	株主資本								
	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	19,996	51,800	73,353
当期変動額									
剰余金の配当							△11,280	△11,280	△11,280
当期純利益							15,499	15,499	15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	4,219	4,219	4,219
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	△0	△0	73,353
当期変動額			
剰余金の配当			△11,280
当期純利益			15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	△0	△0	△0
当期変動額合計	△0	△0	4,219
当期末残高	△0	△0	77,573

	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

## 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。</p> <p>①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。</p> <p>②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

	<p>資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。</p> <p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(2) 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(3) 投資助言報酬 投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年2回又は4回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
7. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。



(会計方針の変更)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過の取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することとしております。なお、当該適用指針の適用に伴う、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

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

## 注記事項

(貸借対照表関係)

### ※1. 有形固定資産の減価償却累計額

(百万円)

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

(損益計算書関係)

### ※1. 各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

(百万円)

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

### ※2. オフィス再編費用

オフィス再編費用は、主に本社オフィスレイアウトの見直しによるものです。

(株主資本等変動計算書関係)

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

#### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	24,490	—	—	24,490
A種種類株式	15,510	—	—	15,510
合計	40,000	—	—	40,000

#### 2. 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月16日 定時株主総会	普通株式	11,280	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種類 株式				

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
2022年6月16日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	12,360	309,000	2022年3月31日	2022年6月17日
	A種種類株式					

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度 増加株式数（株）	当事業年度 減少株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
普通株式	24,490	—	—	24,490
A種種類株式	15,510	—	—	15,510
合計	40,000	—	—	40,000

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
2022年6月16日 定時株主総会	普通株式	12,360	309,000	2022年3月31日	2022年6月17日
	A種種類株式				

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2023年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①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。

②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。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第37期（2022年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	30,332	30,332	—
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	—
資産計	30,334	30,334	—

第38期（2023年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	29,184	29,184	—
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	—
資産計	29,186	29,186	—

(注1) 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び未払手数料は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しております。

(注2) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第37期（2022年3月31日現在）

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	31,421	—	—	—
(2) 金銭の信託	30,332	—	—	—
(3) 未収委託者報酬	17,567	—	—	—
(4) 未収運用受託報酬	4,348	—	—	—
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	—	1	—	—
合計	83,670	1	—	—

第38期（2023年3月31日現在）

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	33,770	—	—	—
(2) 金銭の信託	29,184	—	—	—
(3) 未収委託者報酬	16,279	—	—	—
(4) 未収運用受託報酬	3,307	—	—	—
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	—	1	—	—
合計	82,540	1	—	—

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

第37期（2022年3月31日現在）

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 金銭の信託	—	6,932	—	6,932
(2) 投資有価証券 その他有価証券	—	—	—	—
資産計	—	6,932	—	6,932

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日）第26項に従い、経過措置を適用した投資信託は上表には含めておりません。貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託23,399百万円、投資有価証券1百万円となります。

第38期（2023年3月31日現在）

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 金銭の信託	—	29,184	—	29,184
(2) 投資有価証券 その他有価証券	—	— 1	—	— 1
資産計	—	29,186	—	29,186

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

投資有価証券

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日）第5項に従い、2. 金融商品の時価等に関する事項及び3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

(百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
投資有価証券（その他有価証券）		
非上場株式	239	180
関係会社株式 非上場株式	5,349	5,810

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（第37期の貸借対照表計上額5,349百万円、第38期の貸借対照表計上額5,810百万円）については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

第37期（2022年3月31日現在）

(百万円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	—	—	—
小計	—	—	—
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	△0
小計	1	2	△0
合計	1	2	△0

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額239百万円）については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

第38期（2023年3月31日現在）

(百万円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	—	—	—
小計	—	—	—
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	△0
小計	1	2	△0
合計	1	2	△0

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額180百万円）については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
株式	13	—	6

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
株式	54	4	9

4. 減損処理を行った有価証券

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)	
	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,479	2,576
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	△14	31
退職給付の支払額	△185	△191
退職給付債務の期末残高	2,576	2,698

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(百万円)	
	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,576	2,698
未積立退職給付債務	2,576	2,698
未認識数理計算上の差異	△35	△44
未認識過去勤務費用	△33	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654
退職給付引当金	2,507	2,654
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

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

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、前事業年度において20百万円、当事業年度において24百万円を営業外費用に計上しております。

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

## 主要な数理計算上の計算基礎

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00%~3.76%	1.00%~3.56%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度97百万円、当事業年度103百万円であります。



(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

(注) 前事業年度は、法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

①MHAM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、②TB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、③DIAM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」③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」③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A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」③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」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212百万円
取得原価		144,212百万円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん	金額	76,224百万円
b. 発生原因		被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。
c. のれんの償却方法及び償却期間		20年間の均等償却

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額	資産合計	40,451百万円
	うち現金・預金	11,605百万円
	うち金銭の信託	11,792百万円
b. 負債の額	負債合計	9,256百万円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額	53,030百万円
b. 主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030百万円
c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間	
顧客関連資産	16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。

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

## (2) 損益計算書項目

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

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

のれんの償却額	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	4,618百万円	4,228百万円

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

収益の構成は次の通りです。

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
委託者報酬	108,259百万円	95,739百万円
運用受託報酬	14,425百万円	14,651百万円
投資助言報酬	1,587百万円	2,048百万円
成功報酬(注)	2,594百万円	1,499百万円
その他営業収益	12百万円	23百万円
合計	126,879百万円	113,962百万円

(注) 成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の委託者報酬及び運用受託報酬、当事業年度においては損益計算書の運用受託報酬に含めて表示しております。

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 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。

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(持分法損益等)

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の 兼任等	事業上 の 関係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託 の販売代 行手数料	7,789	未払 手数料	1,592
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託 の販売代 行手数料	16,373	未払 手数料	2,651

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の 兼任等	事業上 の 関係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託 の販売代 行手数料	7,474	未払 手数料	1,579
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託 の販売代 行手数料	13,932	未払 手数料	2,404

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	1,939,327円79銭	1,975,862円96銭
1株当たり当期純利益金額	387,499円36銭	345,535円19銭

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益金額	15,499百万円	13,821百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	—	—
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,499百万円	13,821百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

# 独立監査人の中間監査報告書

2023年11月22日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人 東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 森重 俊寛

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 稲葉 宏和

### 中間監査意見

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

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

### 中間監査意見の根拠

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

### 中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

### 中間財務諸表監査における監査人の責任

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



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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

(注2) X B R Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## (1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

## (2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

(単位：百万円)

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

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

重要な会計方針

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)</p> <p>市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
<p>2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法</p>	<p>時価法</p>
<p>3. 固定資産の減価償却の方法</p>	<p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <p>建物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする定額法を採用しております。</p>
<p>4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準</p>	<p>外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
<p>5. 引当金の計上基準</p>	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>②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、それぞれ発生の日翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
	<p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投</p>

## 6. 収益及び費用の計上基準

資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。

### (1) 委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

### (2) 運用受託報酬

運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

### (3) 投資助言報酬

投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年2回又は4回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

### (4) 成功報酬

成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。



注記事項

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

(金融商品関係)

第39期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)

### 1. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

### 2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

#### 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

#### 投資有価証券

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。  
これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号2020年3月31日)第5項に従い、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

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

(有価証券関係)

第39期中間会計期間末  
(2023年9月30日現在)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額4,888百万円)については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	△0
小計	1	2	△0
合計	1	2	△0

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額182百万円)については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

(持分法損益等)

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

## (企業結合等関係)

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

### 1. 結合当事企業

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

### 2. 企業結合日

2016年10月1日

### 3. 企業結合の方法

①MHAM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、②TB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、③DIAM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」③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」③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A種種類株式15,510株を交付しました。

### 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

### 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

「3. 企業結合の方法」③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」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2023年4月1日から2023年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212百万円
取得原価		144,212百万円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん	金額	76,224百万円
b. 発生原因	被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。	
c. のれんの償却方法及び償却期間	20年間の均等償却	

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額	資産合計	40,451百万円
	うち現金・預金	11,605百万円
	うち金銭の信託	11,792百万円
b. 負債の額	負債合計	9,256百万円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額	53,030百万円
b. 主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030百万円
c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間	
顧客関連資産	16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

(2) 損益計算書項目

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

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

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

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 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。

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

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

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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



#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

# 約 款

追加型証券投資信託  
One E T F トピックス  
約款

<信託の種類、委託者および受託者>

第1条 この信託は、証券投資信託であり、アセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者とします。

②この信託は、信託法(平成18年法律第108号)(以下「信託法」といいます。)の適用を受けます。

<信託事務の委託>

第2条 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関(受託者の利害関係人(金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。)を含みます。)と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

<信託の目的および金額>

第3条 委託者は、20,565,128,500円に相当する、委託者の指定する有価証券(以下「信託適格有価証券」といいます。)および金銭を、受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

②前項に規定する信託適格有価証券とは、次の各号の要件のすべてを満たす有価証券をいいます。

1. 原則として東証株価指数(TOPIX)(以下「対象指数」といいます。)に採用されているまたは採用が決定された銘柄の株式であること
2. 原則として有価証券の株数の比率が、第21条に定める運用の基本方針に沿ったものであること
3. 投資信託及び投資法人に関する法律施行令ならびに同法律施行規則に定めるものであること

<追加信託の限度額>

第4条 委託者は、受託者と合意のうえ、10兆円相当額を限度として、信託適格有価証券および金銭を追加することができます。

②委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

<信託期間>

第5条 この信託は、期間の定めを設けません。ただし、第47条第1項および第2項、第48条第1項、第49条第1項および第51条第2項の規定により信託を終了させることがあります。

<受益権の取得申込の勧誘の種類>

第6条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

<当初の受益者>

第7条 信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第8条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。ただし、別に定める金融商品取引清算機関(金融商品取引法第2条第29項に規定する金融商品取引清算機関とし、以下、「清算機関」といいます。)の業務方法書に定めるところにより、第13条に定める取得申込みを受付けた販売会社が、当該取得申込みの受付によって生じる信託適格有価証券および金銭の委託者への受渡または支払いの債務の負担を当該清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合の追加信託当初の受益者は当該清算機関とします。

<受益権の分割および再分割>

第8条 委託者は、第3条の規定による受益権については、13,942,460口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)に定めるところにしたがい、受託者と協議のうえ、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。

<追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法>

第9条 追加信託に相当する金額は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じて得た額(第13条第6項または同条第7項に該当する場合の取得申込みにおいては同各項に定める経費に相当する金額を加えた額)とします。

②委託者は、原則として、信託適格有価証券をもって追加信託を行うものとします。ただし、追加信託における信託適格有価証券の評価額(追加信託を行う日の前営業日において公表されている最終価格に基づき算出した価額またはこれに準ずるものとして合理的な方法により算出した価額をいいます。以下同じ。)の合計が、前項の追加信託に相当する金額に満たない場合は、その差額については金銭による追加信託を行うものとします。

③この約款において基準価額とは、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したがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除して得た金額(以下「純資産総額」といいます。)を計算日における受益権口数で除して得た金額をいいます。

<信託日時の異なる受益権の内容>

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

<受益権の帰属と受益証券の不発行>

第11条 この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受けるとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関(社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。)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。)

②委託者は、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、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、委託者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。

③委託者は、第8条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

<受益権の設定にかかる受託者の通知>

第12条 受託者は、第3条に規定する信託適格有価証券および金銭について受入れまたは振替済の通知を受けた場合には、振替機関に対し当初設定が行われた旨を通知するものとします。

②受託者は、追加信託にかかる信託適格有価証券(第13条第6項または同条第7項に規定する株式の個別銘柄時価総額に相当する金額および必要な経費に相当する金額の金銭を含みます。)について受入れまたは振替済の通知を受けた場合には、振替機関に対し追加信託が行われた旨を通知するものとします。ただし、第7条ただし書きに掲げる業務方法書に定めるところにより、当該信託適格

有価証券の委託者への受渡または支払いの債務を清算機関が負担する場合には、受託者は、委託者の指図に基づき、当該信託適格有価証券についての受入れまたは振替済の通知にかかわらず、振替機関に対し追加信託が行われた旨を通知するものとします。

#### <受益権の申込単位および価額>

第13条 販売会社（委託者の指定する第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。）をいいます。以下同じ。）は、第8条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、取得の申込みに応じることができます。この場合、取得申込みは、対象指数を構成する各銘柄の有価証券の数の構成比率に相当する比率により構成される各銘柄の有価証券をもって行うものとします。ただし、当該有価証券の評価額が取得する受益権の評価額（第2項の取得にかかる一定口数に第3項の受益権の価額を乗じて得た額をいいます。）に満たない場合は、その差額に相当する金額について金銭を充当することができるものとします。

②販売会社は、受益権の取得申込者に対し、その申込みの当日（委託者が別に定める時限を過ぎて受け付けた場合は翌営業日とし、第3条第1項の規定にかかる取得については信託契約締結日とします。）を受付日として、委託者が定める取得にかかる一定口数をもって取得申込みに応じることができます。

③前項の場合の受益権の価額は、取得申込受付日の基準価額とします。ただし、取得日が信託契約締結日である場合の受益権の価額は、1口につき信託契約締結日の前営業日における対象指数の終値に相当する値を円表示した価額（円未満切り上げ）とします。

④販売会社は、取得申込時において、当該販売会社が定める手数料および当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を当該取得申込者から徴することができるものとします。

⑤委託者は、原則として、次の各号に該当する場合は、受益権の取得申込みの受付を停止します。ただし、第1号から第4号に該当する場合であっても、委託者の判断により、受益権の取得申込みを受け付けることがあります。

1. 対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内
2. 対象指数の銘柄変更実施日および銘柄株数変更実施日の各々3営業日前から起算して4営業日以内
3. 第33条に定める計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内）
4. この信託が終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
5. 前各号のほか、委託者が、第21条各号に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めるとき

⑥前項第1号に該当する場合において委託者の判断により取得申込みを受け付けるときには、第1項の規定にかかわらず、当該取得申込みにかかる有価証券のうち、配当落または権利落対象銘柄（以下、本項において、「対象銘柄」といいます。）の個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを受け付けることができるものとします。この場合の個別銘柄時価総額は、第3項の基準価額の計算日における当該対象銘柄の金融商品取引所（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および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）の終値（終値のないものについてはそれに準ずる価額とします。）に第1項の取得申込みにかかる有価証券に含まれる当該対象銘柄の株数を乗じて得た金額とし、この場合において、委託者は、当該対象銘柄を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額として委託者が別に定める金額を徴することができるものとします。

⑦取得申込者が対象指数に採用されている銘柄の株式の発行会社またはその子会社（会社法第2条第3号に規定する子会社をいい、当該発行会社を含めて以下「発行会社等」といいます。）である場合には、第1項の規定にかかわらず、取得申込みにかかる有価証券のうち当該発行会社等の株式の個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを行うものとします。この場合の個別銘柄時価総額は、第3項の基準価額の計算日における当該発行会社の株式の金融商品取引所の終値（終値のないものについてはそれに準ずる価額とします。）に第1項の取得申込みにかかる

有価証券に含まれる当該発行会社の株数を乗じて得た金額とし、この場合において、委託者は、当該発行会社の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額として委託者が別に定める金額を徴することができるものとします。

- ⑧取得申込者が対象指数に採用されている銘柄の株式の発行会社等である場合、取得申込みを当該取得申込者から受け付けた販売会社（販売会社が対象指数に採用されている銘柄の株式の発行会社等に該当する場合には、当該販売会社が自己勘定で取得申込みを行うときを含むものとします。次項において同じ。）は、取得申込みを取り次ぐ際に委託者にその旨を通知するものとします。
- ⑨前項の通知が取得申込みの取次ぎの際に行われなかった場合において、そのことによって信託財産その他に損害が生じたときには、取得申込みを取り次いだ販売会社がその責を負うものとします。
- ⑩第1項の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みにかかる信託適格有価証券および金銭の受渡または支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。また、第7条ただし書きに掲げる業務方法書に定めるところにより、取得申込みを受付けた販売会社が、当該取得申込みの受付によって生じる信託適格有価証券および金銭の委託者への受渡または支払いの債務の負担を清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、振替機関等における当該清算機関の名義の口座に口数の増加の記載または記録が行われ、取得申込者が自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行うための振替機関等の口座における口数の増加の記載または記録は、当該清算機関と販売会社（販売会社による清算機関への債務の負担の申込みにおいて、当該販売会社の委託を受けて金融商品取引法第2条第27項に定める有価証券等清算取次ぎが行われる場合には、当該有価証券等清算取次ぎを行う金融商品取引業者または登録金融機関を含みます。）との間で振替機関等を介して行われます。
- ⑪前各項の規定に関わらず、委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受け付けを中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受け付けを取り消すことができます。

#### <金融商品取引所への上場>

第14条 委託者は、この信託の受益権について、金融商品取引所に上場申請を行うものとし、当該受益権は、当該金融商品取引所の定める諸規則等に基づき当該金融商品取引所の承認を得たうえで、当該金融商品取引所が開設する市場に上場されるものとします。

- ②委託者は、この信託の受益権が上場された場合には、前項の金融商品取引所の定める諸規則等を遵守し、当該金融商品取引所が諸規則等に基づいて行う受益権に対する上場廃止または売買取引の停止その他の措置に従うものとします。

#### <受益権の譲渡にかかる記載または記録>

第15条 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。

- ②前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項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。
- ③委託者は、第1項に規定する振替について、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、委託者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。

<受益権の譲渡の対抗要件>

第16条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

<受益者名簿の作成と名義登録>

第17条 受託者は、この信託にかかる受益者名簿を作成し、第7条の受益者について、その氏名または名称、住所および個人番号（行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律（平成二十五年法律第二十七号）第二条第五項に規定する個人番号をいう。以下同じ。）または法人番号（同条第十五項に規定する法人番号をいう。以下同じ。）（個人番号または法人番号を有しない者にあつては、氏名または名称および住所。）、その他受託者が定める事項を、受益者名簿に名義登録するものとします。

②受託者は、計算期間終了日において、社振法等関係法令、諸規則等に基づき、振替機関より通知を受けた受益権の帰属者を振替機関等の振替口座簿に記載または記録された受益権にかかる受益者として、その氏名または名称、住所および個人番号または法人番号（個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所。）、その他受託者の定める事項を受益者名簿に登録するものとします。なお、受託者は他の証券代行会社等、受託者が適当と認める者と委託契約を締結し、受益者名簿の作成および受益者名簿への名義登録を委託することができます。

③受益者は、この信託の受益権が上場されている金融商品取引所の会員（口座管理機関であるものに限ります。以下同じ。）を経由して第1項の受益者名簿の名義登録を請求することができます。この場合、当該会員は、当該会員が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。ただし、証券金融会社等は前項に規定する登録を受託者（受託者が第1項において受益者名簿の作成を委託した場合は、その委託をした者）に対して直接に行うことができます。

④前項に規定する名義登録は、第33条に規定する毎計算期間の末日の翌日から15日間停止するものとします。また、この信託が終了することとなる場合は、信託終了日の直前5営業日間において名義登録を停止するものとします。

<投資の対象とする資産の種類>

第18条 この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。）とします。

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第24条に定めるものに限ります。）

ハ. 金銭債権

<運用の指図範囲等>

第19条 委託者は信託財産を主として株式に投資することを指図します。

②前項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、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託財産を、前項に掲げる株式のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することの指図ができます。

1. 預金

2. コール・ローン

<利害関係人等との取引等>

第20条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資

法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本項、次項および第27条において同じ。）、第27条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等ならびに第24条、第26条、第29条および第30条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

- ②受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ③委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前2条に掲げる資産への投資等ならびに第24条、第26条、第29条および第30条に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。
- ④前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

#### <運用の基本方針>

第21条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、次の各号に掲げる運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

1. この信託は、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象指数の変動率に一致させることを目的として、対象指数に採用されている銘柄（採用予定の銘柄を含みます。）の株式に対する投資として運用を行います。
2. 信託財産中に占める個別銘柄の株数の比率は、対象指数における個別銘柄の時価総額構成比率から算出される株数の比率程度を維持することを原則とします。なお、対象指数から除外された銘柄は、市場動向等を勘案し速やかに売却することを基本としますが、当該銘柄の流動性等によっては、速やかに売却できない場合があります。
3. 第1号の方針に沿うよう、信託財産の構成を調整するための指図を行うこと、および補完的に有価証券指数等先物取引等を行うことができます。デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
4. 市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
5. 株式への投資割合には、制限を設けません。
6. 外貨建資産への投資は、行いません。
7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。

#### <収益分配方針>

第22条 毎決算時に、経費控除後の配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）の全額を分配することを原則とします。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

- ②留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。



<投資する株式等の範囲>

第23条 委託者が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式についてはこの限りではありません。

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

<先物取引等の運用指図>

第24条 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国のこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。

<デリバティブ取引等にかかる投資制限>

第25条 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

<有価証券の貸付の指図および範囲>

第26条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式を貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えない範囲内で貸付の指図をすることができます。

②前項に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

③委託者は、株式の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

<信託業務の委託等>

第27条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みません。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

②受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

1. 信託財産の保存にかかる業務
2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
4. 受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

<信託財産の登記等および記載等の留保等>

第28条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をするこ

- とします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。
- ②前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
  - ③信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
  - ④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

#### <有価証券売却等の指図>

第29条 委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

#### <再投資の指図>

第30条 委託者は、前条の規定による売却代金、株式の清算分配金、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

#### <受託者による資金の立替え>

- 第31条 信託財産に属する有価証券について、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。
- ②信託財産に属する株式の清算分配金、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
  - ③前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

#### <損益の帰属>

第32条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

#### <信託の計算期間>

第33条 この信託の計算期間は、毎年1月9日から7月8日まで、および7月9日から翌年1月8日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は信託契約締結日から平成28年1月8日までとし、最終計算期間の終了日は第5条に規定するこの信託の信託期間の終了日とします。

#### <信託財産に関する報告等>

- 第34条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。
- ②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。
  - ③受託者は、前2項の報告を行うことにより、受益者に対する信託法第37条第3項に定める報告は行わないこととします。
  - ④受益者は、受託者に対し、信託法第37条第2項に定める書類または電磁的記録の作成に欠くことのできない情報その他の信託に関する重要な情報および当該受益者以外の者の利益を害するおそれのない情報を除き、信託法第38条第1項に定める閲覧または謄写の請求をすることはできないものとします。

#### <信託事務の諸費用および監査費用>

第35条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息は、

受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

②信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

③受益権の上場にかかる費用および対象指数の商標（これに類する商標を含みます。）の使用料等（以下「商標使用料等」といいます。）ならびに当該上場にかかる費用および当該商標使用料等にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができるものとします。

#### <信託報酬等の額および支弁の方法>

第36条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、次の各号により計算された額の合計額とします。

ただし、当該合計額は、第33条に規定する各計算期間において、信託財産の純資産総額に年10,000分の25の率を乗じて得た額を超えないものとします。

1. 第33条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の7.8以内の率を乗じて得た額

2. 第26条に規定する有価証券の貸付の指図を行った場合は、その品貸料に100分の50以内の率を乗じて得た額

②前項の信託報酬は、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、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

③第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

#### <収益の分配>

第37条 信託財産から生じる配当等収益と前期から繰り越した分配準備積立金は、第35条に規定する諸費用および監査費用等ならびに当該諸費用および監査費用等にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、前期から繰り越した負数の分配準備積立金があるときはその全額を補てんした後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。また、収益分配金額の調整のためその一部または全部を信託財産内に留保したときは分配準備積立金として積み立て、次期以降の分配にあてることができます。なお、第35条に規定する諸費用および監査費用等ならびに当該諸費用および監査費用等にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除しきれないときは、その差額を負数の分配準備積立金として次期に繰り越します。

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

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

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

#### <収益分配金の払い込みと支払いに関する受託者の免責>

第38条 受託者は、支払開始日から5年経過した後に、収益分配金の未払残高があるときは、当該金額を委託者に交付するものとします。

②受託者は、前項の規定により委託者に収益分配金を交付した後は、当該交付にかかる金額に関する受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

#### <収益分配金の支払い>

第39条 受託者は、計算期間終了日において第17条の受益者名簿に名義登録されている者を計算期間終了日における受益者（以下「名義登録受益者」といいます。）として、当該名義登録受益者に収益分配金を支払います。

- ②受託者は、収益分配金の支払いについて、受益者名簿の作成を委託した者にこれを委託することができます。
- ③第1項に規定する収益分配金の支払いは、原則として、毎計算期間終了日から起算して40日以内の委託者の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定する預金口座等に当該収益分配金を振り込む方式または同日から分配金領収証等により行うものとします。なお、名義登録受益者が第17条第3項に規定する金融商品取引所の会員と別途収益分配金の取扱いにかかる契約を締結している場合は、当該契約にしたがい支払われるものとします。

<収益分配金、信託終了時の交換有価証券等および買取代金の時効>

- 第40条 受益者が、収益分配金については前条第3項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。
- ②受益者が、信託終了時における交換による有価証券、信託終了にかかる金銭および買取りにかかる金銭については信託終了日から10年間その受渡しを請求しないときは、その権利を失い、受託者により振替機関等の口座への増加の記載または記録が行われた有価証券および受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

<追加信託金および受益権と有価証券の交換の計理処理>

- 第41条 追加信託の金額（追加信託にかかる信託適格有価証券の価額を含みます。）は、当該金額と元本に相当する金額との差額を、追加信託差金として処理します。
- ②第43条に定める受益権と有価証券との交換にあつては、交換にかかる受益権口数に交換請求の受付日の基準価額を乗じて得た金額と元本に相当する金額との差額を、交換（解約）差金として処理します。

<交換請求>

- 第42条 受益者は、平成27年11月6日以降において、自己に帰属する受益権につき、その請求の当日（委託者が別に定める時限を過ぎて受け付けた場合は翌営業日）を受付日として、交換請求にかかる一定口数（以下「最小交換口数」といいます。）の整数倍の受益権をもって、委託者に当該受益権と信託財産に属する有価証券との交換（以下「交換」といいます。）を請求することができます。
- ②委託者は、前項の交換の請求を受け付けた場合には、第43条の規定にしたがって前項の請求にかかる受益権と信託財産に属する有価証券との交換の指図を行います。
- ③委託者は、原則として、次の各号に該当する場合は、受益権の交換請求の受付を停止します。ただし、第1号から第4号に該当する場合であっても、委託者の判断により、受益権の交換請求を受け付けることがあります。
1. 対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日
  2. 対象指数の銘柄変更実施日および銘柄株数変更実施日の各々3営業日前から起算して6営業日以内
  3. 第33条に定める計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内）
  4. この信託が終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
  5. 前各号のほか、委託者が、第21条各号に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めるとき
- ④受益者が第1項の交換の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ⑤前項の販売会社は、振替機関の定める方法により、振替受益権の抹消にかかる手続きを行うものとします。なお、第7条ただし書きに掲げる業務方法書に定めるところにより、当該販売会社が、振替受益権の委託者への受渡しの債務の負担を清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、当該清算機関が振替受益権の抹消にかかる手続きを行います。当該抹消にかかる手続きおよび第43条第5項に掲げる交換有価証券にかかる振替の請求が行われた後に、振替機関は、第43条第2項から第4項の規定にしたがって計算された当該交換にかかる受益権の口数と同口数の振替

受益権を抹消するものとし、社振法の規定にしたがい振替機関等の口座に第1項の交換の請求を行った受益者にかかる当該口数の減少の記載または記録が行われます。

- ⑥受託者は、第43条第2項から第4項の委託者の交換の指図に基づいて、交換にかかる振替受益権については、振替口座簿における抹消の手続きおよび第43条第6項に定める抹消の確認をもって、当該振替受益権を受入れ抹消したのものとして取り扱います。
- ⑦交換にかかる受益権の評価額は交換請求の受付日の基準価額とします。この場合において、受益者が交換によって取得する個別銘柄の有価証券の数は、交換請求の受付日における当該有価証券の評価額に基づいて計算された数とし、取引所売買単位（金融商品取引所が定める一売買単位をいいます。以下同じ。）の整数倍とします。
- ⑧販売会社は、交換時において、当該販売会社が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を当該交換請求を行った受益者から徴することができるものとし、
- ⑨第1項の交換の請求を行った受益者が対象指数に採用されている銘柄の株式の発行会社等である場合、当該交換の請求を受益者から受け付けた販売会社（販売会社が対象指数に採用されている銘柄の株式の発行会社等に該当する場合には、当該販売会社が自己勘定で交換を請求するときを含むもの）とし、次項において同じ。）は、交換の請求を取り次ぐ際に委託者にその旨を通知するものとし、
- ⑩前項の通知が交換の請求の取次ぎの際に行われなかった場合において、そのことによって信託財産その他に損害が生じたときには、交換の請求を取り次いだ販売会社がその責を負うものとし、
- ⑪委託者は、金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、交換請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた交換請求の受け付けを取り消すことができます。
- ⑫前項により交換請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の交換請求を撤回できます。ただし、受益者がその交換請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に当該交換請求を受け付けたものとして前各項の規定を準用します。

#### < 交換の指図等 >

- 第43条 委託者は、受益者が最小交換口数の整数倍の振替受益権をもって前条第1項の請求を行い、その請求を受け付けた場合には、受益者から提示された口数の振替受益権から受益者が取得できる個別銘柄の有価証券の数と、交換に要する受益権の口数を計算します。
- ②委託者は、受託者に対し、前項の規定により計算された口数の受益権と信託財産に属する有価証券のうち取引所売買単位の整数倍となる有価証券を交換するよう指図します。
  - ③前項の規定にかかわらず、交換の請求を行った受益者が、対象指数に採用されている銘柄の株式の発行会社等である場合には、第1項の交換に要する受益権の口数から当該発行会社の株式の個別銘柄時価総額に相当する口数を除いた口数の受益権と、信託財産に属する有価証券のうち取引所売買単位の整数倍となる有価証券（当該発行会社の株式を除きます。）を交換するよう指図します。この場合の個別銘柄時価総額は、前条第7項の基準価額の計算日における当該発行会社の株式の金融商品取引所の終値（終値のないものについてはそれに準ずる価額とします。）に前条第7項の規定に基づき計算された数を乗じて得た金額とします。
  - ④第2項の規定にかかわらず、前条第3項第1号に該当する場合において委託者の判断により交換請求を受け付ける場合には、第1項の交換に要する受益権の口数と信託財産に属する有価証券のうち取引所売買単位の整数倍となる有価証券（配当落または権利落対象銘柄（以下、本項において、「対象銘柄」といいます。）を除きます。）および当該対象銘柄の個別銘柄時価総額に相当する金銭を交換するよう指図します。この場合の個別銘柄時価総額は、前条第7項の基準価額の計算日における当該対象銘柄の金融商品取引所の終値（終値のないものについてはそれに準ずる価額とします。）に前条第7項の規定に基づき計算された数を乗じて得た金額とします。
  - ⑤受託者は、交換のための振替受益権の抹消にかかる手続きが行われたことを確認した場合に、委託者の指図にしたがい、振替機関の定める方法により信託財産に属する交換有価証券にかかる振替の請求等を行うものとし、

り、前条第5項に掲げる交換の請求を受付けた販売会社が、振替受益権の委託者への受渡しの債務の負担を当該清算機関に申込み、これを当該清算機関が負担する場合には、受託者は、同条同項に掲げる手続きにかかわらず、委託者の指図にしたがい、振替機関の定める方法により信託財産に属する交換有価証券にかかる振替請求を行うものとします。受益者への交換有価証券の交付に際しては、原則として交換請求の受付日から起算して3営業日目から、振替機関等の口座に前条第1項の交換の請求を行った受益者にかかる有価証券の増加の記載または記録が行われます。

- ⑥委託者は、交換請求の受付日の翌営業日以降、交換によって抹消されることとなる振替受益権と同口数の受益権を失効したものとして取り扱うこととし、受託者は、当該受益権にかかる振替受益権が交換有価証券の振替日に抹消済みであることを確認するものとします。

#### <受益権の買取り>

第44条 販売会社は、次の各号に該当する場合で受益者の請求があるときは、その当日（別に定める時限を過ぎて受け付けた場合は翌営業日）を受付日としてその受益権を買取ります。ただし、第2号の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。

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

②受益権の買取価額は、買取請求の受付日の基準価額とします。

③販売会社は、前2項の規定により受益権の買取りを行うときは、当該販売会社が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。

④販売会社は、金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託者との協議に基づいて第1項による受益権の買取りを停止することおよびすでに受け付けた受益権の買取りの受付を取り消すことができます。

⑤前項により受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取り停止以前に行った当日の買取り請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取り請求を撤回しない場合には、買取り停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取り請求を受け付けたものとして、第1項から第3項の規定を準用します。

#### <信託終了時の交換等>

第45条 委託者は、この信託が終了するときは、委託者が別に定める一定口数以上の受益権を有する受益者に対しては、信託財産に属する有価証券を当該受益権として振替口座簿に記載または記録されている振替受益権と引換えに交換するものとします。この場合、受益者が取得する個別銘柄の株数は、信託終了日の5営業日前の日の基準価額に基づいて計算された株数とし、取引所売買単位の整数倍とします。その他の事項については、第42条および第43条の規定に準じるものとします。

②販売会社は、委託者が別に定める一定口数未満の受益権について買取るものとします。この場合には、当該販売会社が別に定める手数料および当該手数料に対する消費税等に相当する金額を徴することができるものとします。

③この信託が終了するときは、販売会社は、その所有にかかるすべての受益権を交換請求するものとします。交換により引渡される株式に当該販売会社が発行する株式または当該販売会社が子会社となる株式が含まれる場合には、委託者は、受託者に対しこれを売却する指図をするとともに、当該株式等の評価額に相当する口数の受益権を、受託者は信託財産をもって買取るものとします。

#### <信託契約の一部解約>

第46条 受益者は、自己に帰属する受益権について、信託期間中においてこの信託の一部解約の実行を請求することはできません。

#### <信託契約の解約>

第47条 委託者は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、信託財産の一部を受益権と交換することにより受益権の口数が200万口を下回ることとなった場合、または、やむを得ない事情が発生した場合は、受託者と合意のうえ、信託契約を解約し、信

託を終了させることができます。この場合において、委託者は、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。

- ②委託者は、信託期間中において次の各号に該当することとなった場合は、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出るものとします。
1. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合
  2. 対象指数が廃止された場合
  3. 対象指数の計算方法の変更等に伴って委託者または受託者が必要と認めたこの約款の変更が第52条第2項に規定する書面決議により否決された場合
- なお、第1号に掲げる事由によりこの信託契約を解約する場合には、その廃止された日に信託を終了するための手続きを開始するものとします。
- ③委託者は、第1項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- ④前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ⑤第3項の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- ⑥第3項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項から前項までの手続を行うことが困難な場合も適用しません。

#### <信託契約に関する監督官庁の命令>

第48条 委託者は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの約款を変更しようとするときは、第52条の規定にしたがいます。

#### <委託者の登録取消等に伴う取扱い>

第49条 委託者が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ②前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第52条第2項に規定する書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

#### <委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い>

第50条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ②委託者は、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、これに伴い信託契約に関する事業を承継させることがあります。

#### <受託者の辞任および解任に伴う取扱い>

第51条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を

解任した場合、委託者は、第52条の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者は信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### <約款の変更等>

第52条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

②委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前項の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

③前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

④第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

⑤書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

⑥第2項から前項までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

⑦前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### <反対者の買取請求権>

第53条 第47条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、第47条第3項または前条第2項に規定する書面に付記します。

#### <他の受益者の氏名等の開示の請求の制限>

第54条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

#### <公告>

第55条 委託者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/>

②前項の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。



<質権口記載または記録の受益権の取扱い>

第56条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、交換請求の受付け、交換有価証券の交付および信託終了にかかる金銭の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

<約款に関する疑義の取扱い>

第57条 この約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成27年9月4日 (信託契約締結日)

委託者 D I A Mアセットマネジメント株式会社

受託者 みずほ信託銀行株式会社

#### 約 款 付 表

1. 約款第7条の「別に定める金融商品取引清算機関」は、株式会社日本証券クリアリング機構とします。