

MHAM TOPIXオープン

追加型投信／国内／株式／インデックス型

- この目論見書により行う「MHAM TOPIXオープン」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12月11日に関東財務局長に提出しており、2024年12月12日にその効力が生じております。
- 「MHAM TOPIXオープン」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「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	該当事項はありません。

目 次

第一部【証券情報】	1
第二部【ファンド情報】	4
第1【ファンドの状況】	4
第2【管理及び運営】	35
第3【ファンドの経理状況】	41
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	112
第三部【委託会社等の情報】	114
第1【委託会社等の概況】	114
約款	143

第一部【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

MHAM TOPIXオープン(以下「当ファンド」といいます。)

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

(3) 【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4) 【発行（売出）価格】

取得申込日の基準価額とします。

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

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

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

注：電話番号はコールセンターのものです（以下同じ）。

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

(5) 【申込手数料】

① 通常のお申込みのお取扱い

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

- ② 確定拠出年金制度に基づくお申込みのお取扱い
無手数料とします。
- ③ 申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。
- ④ 「自動けいぞく投資コース」を選択された場合の収益分配金は、毎計算期末の翌営業日に原則
として税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。
- ⑤ 上記①にかかわらず、償還乗換優遇措置等の取扱いを行う販売会社では、一定の条件を満たし
た場合に申込手数料が割引、または無手数料となる場合があります。詳しくは販売会社にお問い
合わせください。

(6) 【申込単位】

- ① 申込単位は、各販売会社が定める単位とします。
- ② 「一般コース」および「自動けいぞく投資コース」による取得申込が可能です。販売会社によ
っては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。なお、「自動けいぞく投
資コース」を選択されたお申込者は、収益分配金の再投資に際し、1口の整数倍をもって取得する
ことができます。
- ③ 申込単位および取扱コースについては、販売会社にお問い合わせください。
※当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

2024年12月12日から2025年6月10日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

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

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

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

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

① 投資信託振替制度における振替受益権について

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

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

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

② 確定拠出年金制度に基づくお申込みのお取扱い

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

- ① 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券への投資を通じてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資を行い、東証株価指数（TOPIX、配当込み）※の動きに連動する投資成果を目指します。

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

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

<ファンドの特色>

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

- ② 2,000億円を上限に信託金を追加することができます。なお、信託金の上限額については、受託会社と合意のうえ、変更することができます。
- ③ 一般社団法人投資信託協会が定める分類方法において、以下のように分類・区分されます。

<商品分類>

・商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉となる資産)	補足分類
単位型 追加型		株 式	
	国 内	債 券	インデックス型
	海 外	不動産投信	
	内 外	その他資産 ()	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	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
国 内	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
株 式	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
インデックス型	目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

< 属性区分 >

・属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

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

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

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

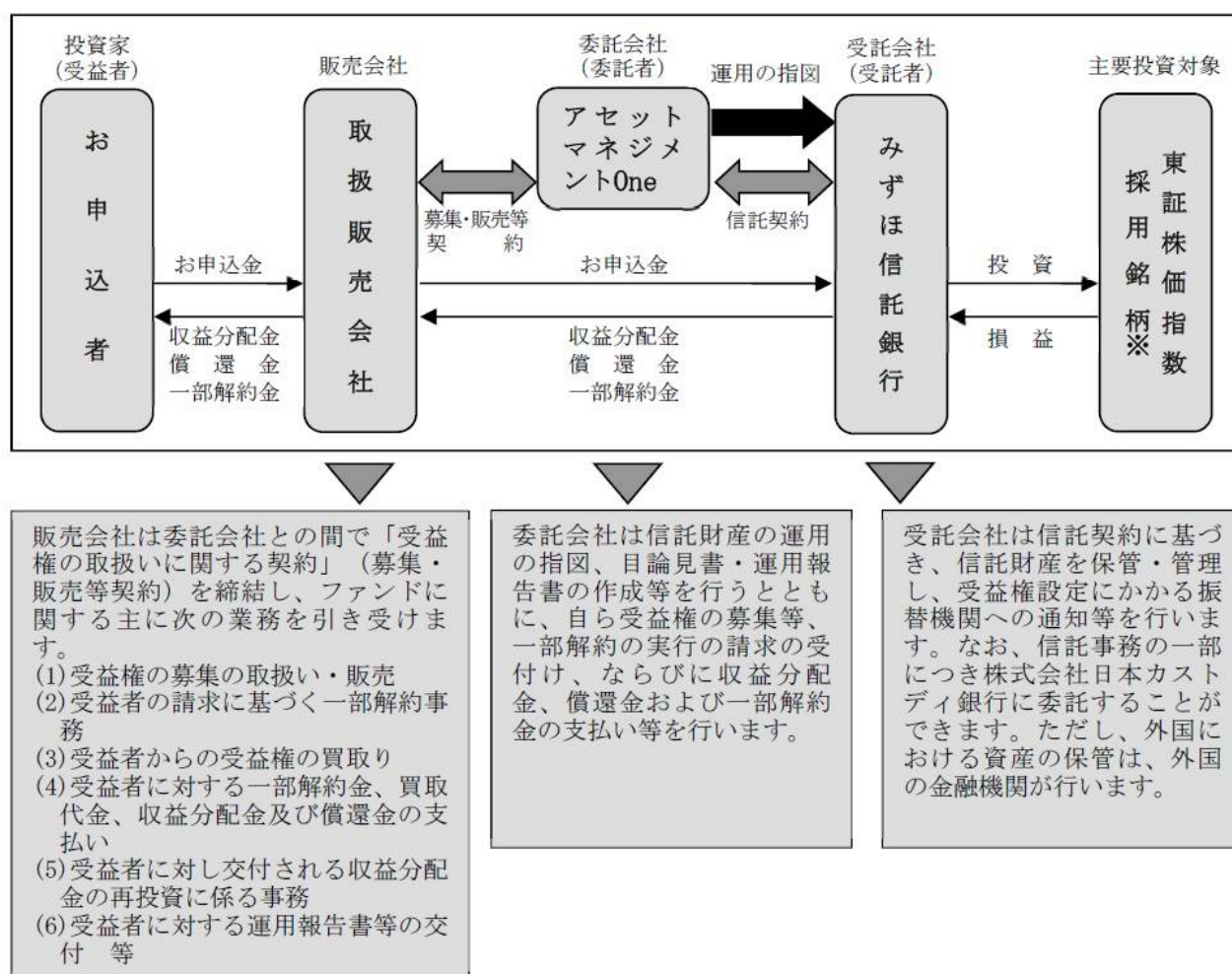
（注3）当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

（2）【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】

① 当ファンドの運営の仕組み

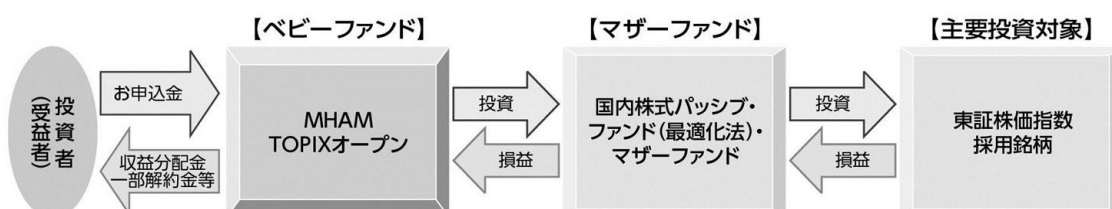


※ 主要投資対象である東証株価指数採用銘柄には、主として、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドを通じて投資を行います。

② ファミリーファンド方式の仕組み

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

《ファミリーファンド方式》



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

※ マザーファンドのほかに、株式等に直接投資する場合があります。

③ 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2024年9月30日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2024年9月30日現在）

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

※1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

① 基本方針

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

② 運用方法

1. 主要投資対象

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

2. 投資態度

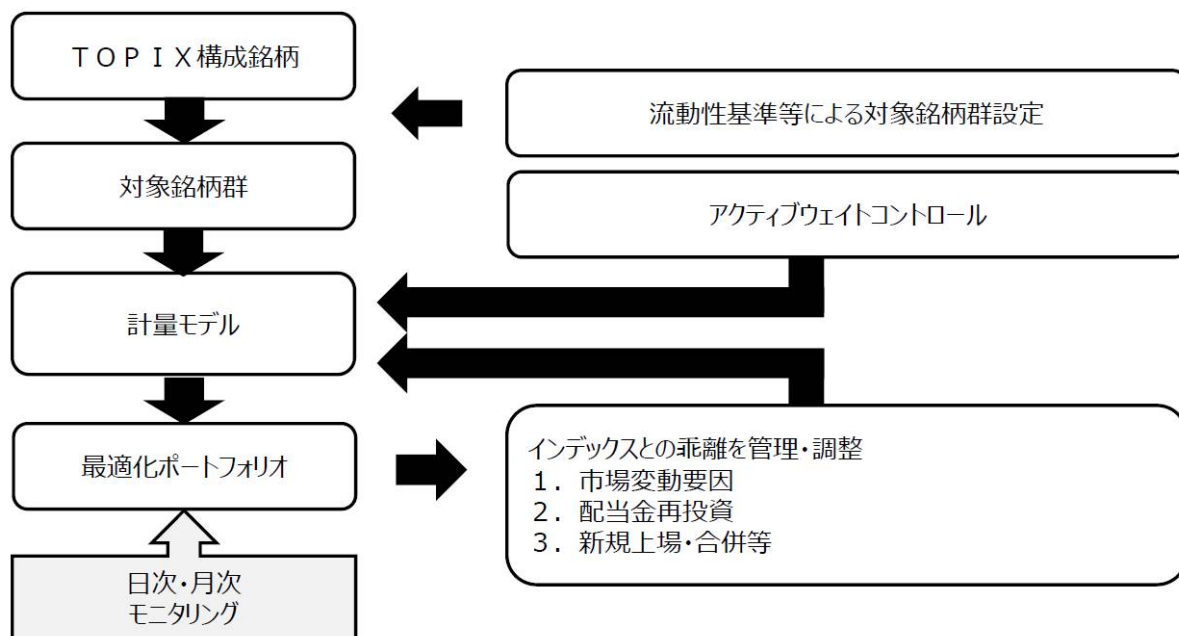
- a. 主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券に投資し、東証株価指数（TOPIX、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ◆ 運用にあたっては、「日本株式マルチファクターモデル」を活用します。
- ・ 「日本株式マルチファクターモデル」とは、複数のリスクファクターによって株式のリターンを分解・説明するモデルです。このモデルを活用し、TOPIXに連動する銘柄群を効率的に選びます。
 - ・ 投資する銘柄群について定期的に見直しを実施することにより、TOPIXに対する連動性を高めます。
- b. 現物株への投資よりTOPIX先物等を活用する方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

引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引(以下「有価証券先物取引等」といいます。)を行うことができます。

③ ファンドの投資プロセス

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

＜国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの投資プロセス＞



1. 流動性基準等による対象銘柄群設定

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

2. 最適化法によるポートフォリオの構築

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

3. インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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

(2) 【投資対象】

① 有価証券の指図範囲

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

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

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

② 金融商品の指図範囲

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

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

③ その他の投資対象

1. 有価証券先物取引等

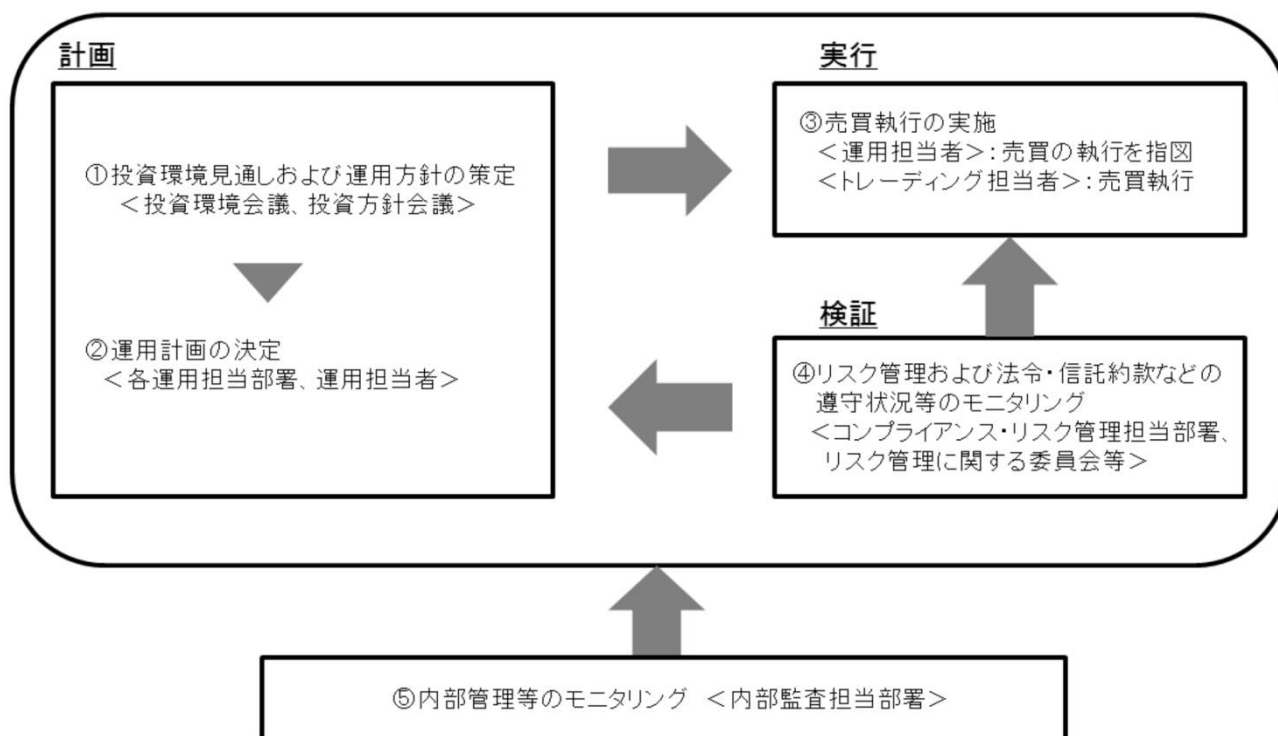
有価証券先物取引等を行うことができます。

2. スワップ取引および金利先渡し取引

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

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



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9月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

① 収益分配方針

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

1. 分配対象収益の範囲

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

2. 分配対象収益についての分配方針

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

3. 留保金の運用方針

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

※ 将来の収益分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

② 収益分配金の支払い

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

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

（５）【投資制限】

a. 約款で定める投資制限

① 株式および新株引受権証券等（約款 運用の基本方針(3)運用制限、約款第18条および第19条）

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

② 非株式[株式以外の資産]（約款 運用の基本方針(2)運用方法②投資態度）

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

③ 外貨建資産への投資（約款 運用の基本方針(3)運用制限）

外貨建資産への投資は行いません。

④ デリバティブ取引（約款 運用の基本方針(3)運用制限）

デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

⑤ 信用取引（約款第21条）

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお当該売り付けの決済については、株券の引き渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
2. 前記1. の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、且つ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - a. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - b. 株式分割により取得する株券
 - c. 有償増資により取得する株券
 - d. 売り出しにより取得する株券
 - e. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしている新株予約権付社債（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
 - f. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前記e. に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑥ 信用リスク集中回避のための投資制限(約款第21条の1の2)

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

⑦ デリバティブ取引等(約款第21条の2)

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

⑧ 有価証券先物取引等(約款第22条)

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

2. 委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

⑨ スワップ取引(約款第23条)

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(「スワップ取引」)を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
4. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑩ 金利先渡取引(約款第24条)

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

⑪ 転換社債等(約款第25条)

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

⑫ 有価証券の貸付(約款第26条)

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

3. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

⑬ 資金の借入れ(約款第33条)

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

b. 法令で定める投資制限

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

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

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

1. 基本方針

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

2. 運用方法

（1）投資対象

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

（2）投資態度

- 1) 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

- 2) 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。
- 3) 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 4) 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
- 5) 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。

(3) 投資制限

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

3【投資リスク】

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

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

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

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

① 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

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

② 流動性リスク

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

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

③ 信用リスク

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

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

<その他>

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

- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用が影響を受ける場合があります。
- ・当ファンドは、証券取引所における取引の停止等があるときには、一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことがあります。
- ・資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

<その他の留意点>

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

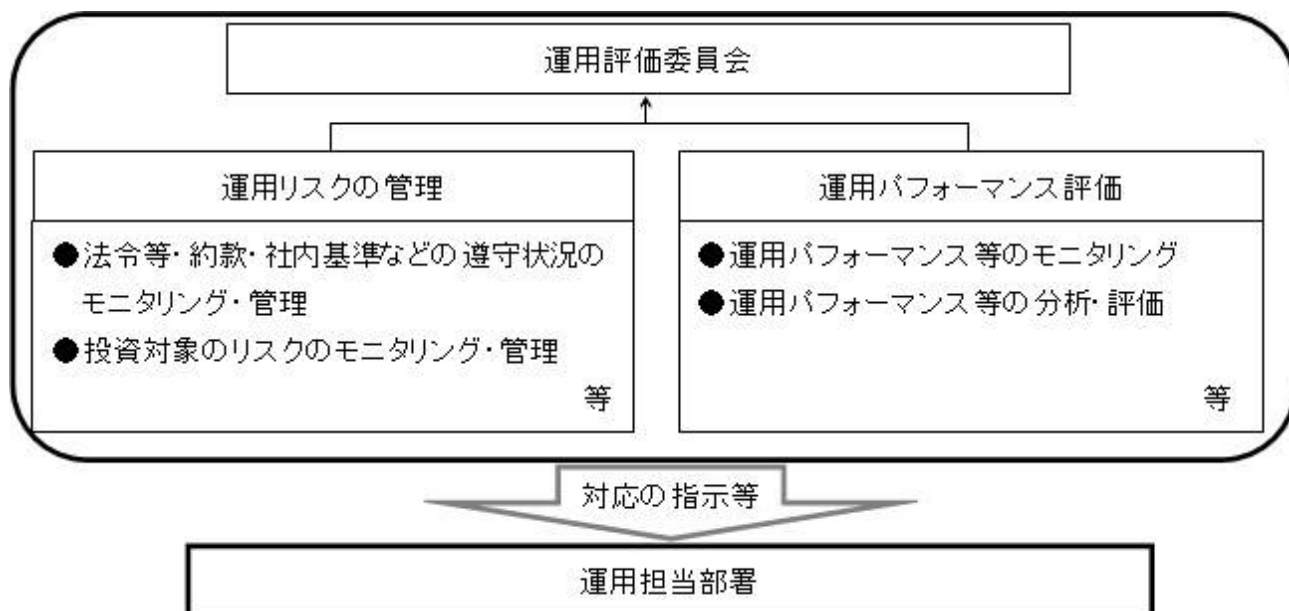
<収益分配金に関する留意点>

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

(2) リスク管理体制

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

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



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

※リスク管理体制は2024年9月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

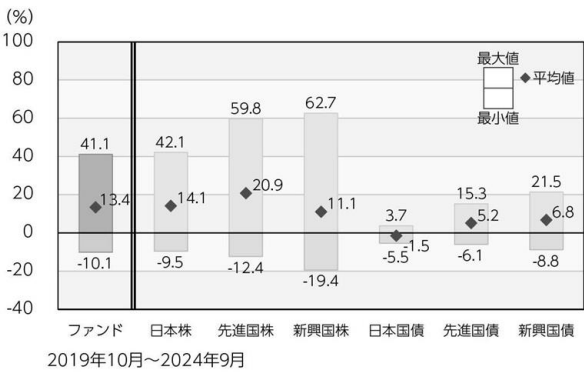
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

① 通常のお申込みの場合

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

② 確定拠出年金制度に基づくお申込みの場合

無手数料とします。

③ 申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。

④ 「自動けいぞく投資コース」における収益分配金は、毎計算期間末の翌営業日に原則として税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

⑤ 上記①にかかわらず、償還乗換優遇措置等の取扱いを行う販売会社では、一定の条件を満たした場合に申込手数料が割引、または無手数料となる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

<申込手数料を対価とする役務の内容>

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

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.66%（税抜0.6%）の率を乗じて得た額とします。

その配分（税抜）については、以下の通りとなります。

委託会社	販売会社	受託会社
0.265%	0.275%	0.060%

② 信託報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の6ヵ月の終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。なお、信託報酬にかかる消費税等相当額を、信託報酬支弁の時に信託財産中から支弁します。

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

< 信託報酬等を対価とする役務の内容 >

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

(4) 【その他の手数料等】

- 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、外国における資産の保管等に要する費用ならびに受託会社の立替えた立替金の利息および資金の借入れを行った際の当該借入金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ② 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、当該費用にかかる消費税等相当額とともに毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁します。
- ③ 当ファンドの組入有価証券の売買時の売買委託手数料、先物・オプション取引等に要する費用およびこれら手数料ならびに費用にかかる消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ④ 上記①～③の手数料等（借入金の利息および財務諸表の監査に要する費用を除きます。）については、当ファンドが投資対象とするマザーファンドにおいて発生する場合、マザーファンドの信託財産中から支弁されます。これらはマザーファンドの基準価額に反映されるため、結果として当ファンドの受益者が間接的に負担することとなります。

(5) 【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

○法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

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

※上記は、2024年9月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

◇個別元本方式について

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

＜個別元本について＞

- ①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- ②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

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

- ③収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の＜収益分配金の課税について＞を参照。）

＜収益分配金の課税について＞

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

収益分配の際、①当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

…（参考情報）ファンドの総経費率…

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

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2023年3月11日～2024年3月11日

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

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

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

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2024年9月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券		11,186,511,178	99.98
	内 日本	11,186,511,178	99.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,885,822	0.02
純資産総額		11,188,397,000	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2024年9月30日現在

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

その他資産の投資状況

2024年9月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）		15,408,450,000	2.69
	内 日本	15,408,450,000	2.69

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

(2)【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2024年9月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,371,581,161	4.6560	4.7169	—	99.98
				11,042,281,262	11,186,511,178	—	

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.98
合計	99.98

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2024年9月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,971,700	3,243.28 25,854,489,189	2,542.50 20,268,047,250	— —	3.53
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	5,251,000	2,831.01 14,865,684,032	2,777.50 14,584,652,500	— —	2.54
3	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,639,500	2,419.85 8,807,052,562	3,781.00 13,760,949,500	— —	2.40
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,994,900	1,415.86 12,735,586,906	1,453.50 13,074,087,150	— —	2.28
5	キーエンス 日本	株式 電気機器	150,100	64,310.37 9,652,987,618	68,360.00 10,260,836,000	— —	1.79
6	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,110,300	5,949.27 6,605,482,998	8,705.00 9,665,161,500	— —	1.69
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	3,080,500	2,616.05 8,058,749,716	3,045.00 9,380,122,500	— —	1.64
8	三菱商事 日本	株式 卸売業	3,046,700	2,823.87 8,603,509,587	2,952.50 8,995,381,750	— —	1.57
9	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,066,700	6,757.19 7,207,902,143	7,678.00 8,190,122,600	— —	1.43
10	信越化学工業 日本	株式 化学	1,347,000	5,852.78 7,883,697,696	5,977.00 8,051,019,000	— —	1.40
11	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	317,500	28,784.84 9,139,189,430	25,290.00 8,029,575,000	— —	1.40
12	三井物産 日本	株式 卸売業	2,376,700	2,959.63 7,034,166,158	3,178.00 7,553,152,600	— —	1.32
13	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,442,100	3,992.45 5,757,516,467	5,231.00 7,543,625,100	— —	1.32
14	任天堂 日本	株式 その他製品	946,900	8,317.19 7,875,556,230	7,636.00 7,230,528,400	— —	1.26
15	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	44,739,500	181.05 8,100,392,860	146.80 6,567,758,600	— —	1.15
16	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	741,900	6,779.22 5,029,503,785	8,427.00 6,251,991,300	— —	1.09
17	第一三共 日本	株式 医薬品	1,310,300	4,592.51 6,017,574,938	4,709.00 6,170,202,700	— —	1.08
18	みずほフィナンシャルグループ	株式	1,993,700	2,749.39	2,936.00	—	1.02

	ループ	日本	銀行業		5,481,460,844	5,853,503,200	—	
19	HOYA	日本	株式 精密機器	295,200	18,437.71 5,442,813,054	19,785.00 5,840,532,000	— —	1.02
20	三菱重工業	日本	株式 機械	2,648,800	1,098.05 2,908,516,431	2,117.50 5,608,834,000	— —	0.98
21	武田薬品工業	日本	株式 医薬品	1,331,300	4,219.12 5,616,917,124	4,103.00 5,462,323,900	— —	0.95
22	本田技研工業	日本	株式 輸送用機器	3,553,300	1,706.46 6,063,598,483	1,507.50 5,356,599,750	— —	0.93
23	KDDI	日本	株式 情報・通信業	1,106,200	4,588.91 5,076,252,298	4,594.00 5,081,882,800	— —	0.89
24	ソフトバンク	日本	株式 情報・通信業	24,031,000	194.05 4,663,330,366	187.20 4,498,603,200	— —	0.78
25	ファーストリテイリング	日本	株式 小売業	89,200	39,554.79 3,528,287,556	47,420.00 4,229,864,000	— —	0.74
26	富士通	日本	株式 電気機器	1,393,800	2,314.72 3,226,263,512	2,935.50 4,091,499,900	— —	0.71
27	三菱電機	日本	株式 電気機器	1,659,100	2,048.69 3,398,987,768	2,303.50 3,821,736,850	— —	0.67
28	村田製作所	日本	株式 電気機器	1,339,500	2,975.12 3,985,184,728	2,806.50 3,759,306,750	— —	0.66
29	日本たばこ産業	日本	株式 食料品	897,300	3,958.43 3,551,899,614	4,179.00 3,749,816,700	— —	0.65
30	ダイキン工業	日本	株式 機械	180,700	20,947.53 3,785,219,219	20,075.00 3,627,552,500	— —	0.63

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率 (%)
株式	97.36
合計	97.36

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2024年9月30日現在

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

食料品	3.19
保険業	2.96
その他製品	2.45
精密機器	2.37
陸運業	2.32
建設業	2.17
不動産業	1.90
電気・ガス業	1.34
その他金融業	1.17
鉄鋼	0.84
証券、商品先物取引業	0.79
海運業	0.79
非鉄金属	0.78
ガラス・土石製品	0.67
ゴム製品	0.58
石油・石炭製品	0.54
金属製品	0.50
繊維製品	0.39
空運業	0.38
鉱業	0.26
パルプ・紙	0.15
倉庫・運輸関連業	0.15
水産・農林業	0.08
合計	97.36

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2024年9月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0612月	買建	582	15,172,912,060	15,408,450,000	2.69

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

(注2) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

(3) 【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2024年9月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
第17計算期間末 (2015年 3月10日)	9,788	9,877	1.0008	1.0098
第18計算期間末 (2016年 3月10日)	8,408	8,502	0.8879	0.8979
第19計算期間末 (2017年 3月10日)	9,275	9,383	1.0364	1.0484
第20計算期間末 (2018年 3月12日)	9,108	9,211	1.1489	1.1619
第21計算期間末 (2019年 3月11日)	8,288	8,359	1.0502	1.0592
第22計算期間末 (2020年3月10日)	6,843	6,975	0.9339	0.9519
第23計算期間末 (2021年3月10日)	8,814	8,917	1.2812	1.2962
第24計算期間末 (2022年3月10日)	8,083	8,209	1.2194	1.2384
第25計算期間末 (2023年3月10日)	8,938	9,103	1.3566	1.3816
第26計算期間末 (2024年3月11日)	11,202	11,359	1.7894	1.8144
2023年9月末日	10,154	—	1.5815	—
10月末日	9,890	—	1.5333	—
11月末日	10,339	—	1.6154	—
12月末日	10,223	—	1.6111	—
2024年1月末日	10,947	—	1.7360	—
2月末日	11,471	—	1.8205	—
3月末日	11,824	—	1.8744	—
4月末日	11,726	—	1.8566	—
5月末日	11,772	—	1.8766	—
6月末日	11,933	—	1.9028	—
7月末日	11,774	—	1.8914	—
8月末日	11,434	—	1.8358	—
9月末日	11,188	—	1.8066	—

②【分配の推移】

	1口当たりの分配金 (円)
第17計算期間	0.0090
第18計算期間	0.0100
第19計算期間	0.0120
第20計算期間	0.0130
第21計算期間	0.0090
第22計算期間	0.0180
第23計算期間	0.0150
第24計算期間	0.0190
第25計算期間	0.0250
第26計算期間	0.0250

③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第17計算期間	25.80
第18計算期間	△10.28
第19計算期間	18.08
第20計算期間	12.11
第21計算期間	△7.81
第22計算期間	△9.4
第23計算期間	38.8
第24計算期間	△3.3
第25計算期間	13.3
第26計算期間	33.7
2024年3月12日～2024年9月11日	△4.3

(注1) 収益率は期間騰落率です。

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

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第17計算期間	1,297,591,952	2,399,371,648
第18計算期間	1,764,811,465	2,076,291,110
第19計算期間	1,243,083,227	1,762,450,093
第20計算期間	1,277,274,100	2,299,730,471
第21計算期間	1,138,643,487	1,174,485,331
第22計算期間	1,083,065,008	1,646,604,346
第23計算期間	1,239,609,441	1,688,249,680
第24計算期間	1,042,960,494	1,294,065,701
第25計算期間	866,476,295	906,274,102
第26計算期間	951,775,933	1,280,435,563
2024年3月12日～ 2024年9月11日	452,815,757	511,449,541

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

データの基準日:2024年9月30日

基準価額・純資産の推移 《2014年9月30日～2024年9月30日》



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:1998年10月22日)

分配の推移(税引前)

2020年 3月	180円
2021年 3月	150円
2022年 3月	190円
2023年 3月	250円
2024年 3月	250円
設定来累計	6,010円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

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

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	97.36
内 日本	97.36
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.64
合計(純資産総額)	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.69

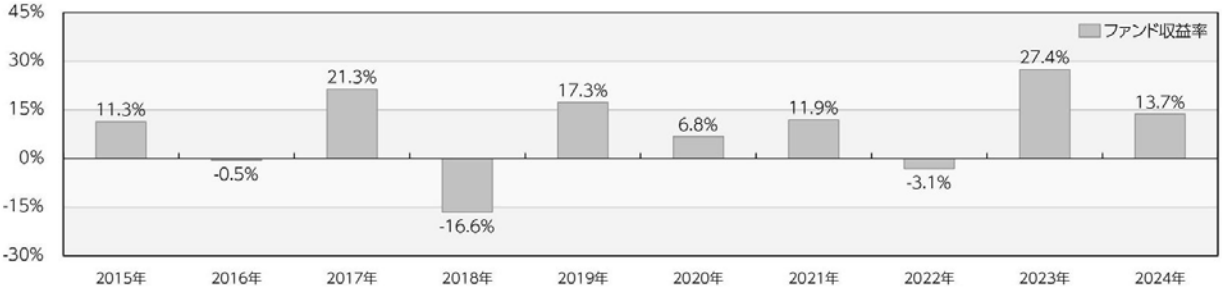
株式組入上位5業種

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

組入上位10銘柄

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

年間収益率の推移(暦年ベース)



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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- (1) 当ファンドのお申込みは、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後2時30分までにお買付けのお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日分のお申込みといたします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については翌営業日のお取扱いとなります。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。
 - (2) 取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとしします。
 - (3) お申込みには、収益の分配がなされた場合に分配金を受領する「一般コース」と、分配金は原則として税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資される「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があります。ただし、販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
 - (4) 申込単位は、各販売会社が定める単位とします。申込単位については、販売会社にお問い合わせください。
 - (5) 取得申込者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
 - (6) 取得申込みにかかる受益権の価額は、取得申込日の基準価額に、販売会社が別に定める申込手数料および申込手数料にかかる消費税等相当額を加算した価額とします。
 - (7) 販売会社において金額買付（申込単位が金額にて表示されている場合）による申込みをされた場合、申込手数料および申込手数料にかかる消費税等相当額はお申込代金の中から差し引かれます。
 - (8) 自動けいぞく投資約款に基づく契約に基づき、収益分配金を再投資する際は、1口単位で購入できるものとします。なお、その際の受益権の価額は、原則として各計算期間終了日の基準価額とします。
 - (9) 当ファンドを確定拠出年金制度に基づき取得する場合については、確定拠出年金に係る法令・制度等の定めに従って取得申込等の手続きが行われます。
 - (10) 信託財産の資金管理を円滑に行うために大口※の取得申込みには制限を設ける場合があります。また、信託財産の運用方針の維持および円滑な資金管理のため、当ファンドの残高や市場の流動性等に応じ、委託会社の判断により一日あたりの取得申込みの総額について制限を設ける場合があります。
- ※当ファンドの場合、1件あたり10億円を目安と致します。
- (11) 信託財産の効率的な運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合、証券取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

2【換金（解約）手続等】

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

※ 解約単位は、販売会社にお問い合わせください。

- (2) 解約の請求を行う受益者は、振替制度にかかる口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。なお、解約の請求を受益者が行う際は、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。
- (3) 解約請求の受付けについては、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後2時30分までに解約のお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付けにかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日分のお申込みとします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については、翌営業日のお取扱いとなります。なお、販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- (4) 解約の価額は、解約請求受付日の基準価額とします。詳しくは、販売会社または委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

- ① 基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

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

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

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

1998年10月22日から無期限とします。

(4)【計算期間】

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

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

(5)【その他】

① 信託契約の解約

以下の場合には信託契約を解約し信託を終了することがあります。

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

- a. この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかる全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
 - b. 前記 a. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一ヵ月を下らないものとします。
 - c. 前記 b. の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記 1. の信託契約の解約をしません。
 - d. 委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
 - e. 前記 b. から d. までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記 b. の一定の期間が一ヵ月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
 - f. 前記 1. に定める信託契約の解約を行う場合において、前記 b. の期間内に異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。なお、買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社の協議により決定するものとします。
- 2. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
 - 3. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、この信託は、「②信託約款の変更4.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
 - 4. 受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- ② 信託約款の変更
- 1. 委託会社は、信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更できるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
 - 2. 委託会社は、前記 1. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
 - 3. 前記 2. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一ヵ月を下らないものとします。
 - 4. 前記 3. の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記 1. の信託約款の変更をしません。

5. 委託会社は、この信託約款を変更しないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前記2.に定める変更を行う場合において、前記3.の期間内に異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。なお、買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社の協議により決定するものとします。
7. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記の規定にしたがいます。

③ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

④ 関係法人との契約の更改および受託会社の辞任または解任に伴う取扱い

1. 委託会社と販売会社との間の募集・販売等契約は、締結日から原則1年間とし、期間終了の3ヵ月前までに別段の意思表示のない時は、同一条件にて継続されます。
2. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は「② 信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

⑤ 信託事務処理の再信託

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

⑥ 公告

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

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

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

⑦ 運用報告書

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金請求権

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

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

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

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

(2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3) 一部解約請求権

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

(4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期計算期間（2023年3月11日から2024年3月11日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年5月17日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 森重 俊寛
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMHAM TOPIXオープンの2023年3月11日から2024年3月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、MHAM TOPIXオープンの2024年3月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R Lデータは監査の対象には含まれておりません。

1【財務諸表】

【MHAM TOPIXオープン】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第25期 2023年3月10日現在	第26期 2024年3月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	41,782,246	87,643,296
親投資信託受益証券	8,937,978,471	11,200,659,647
未収入金	165,530,000	161,883,000
流動資産合計	9,145,290,717	11,450,185,943
資産合計	9,145,290,717	11,450,185,943
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	164,724,708	156,508,217
未払解約金	13,088,657	56,446,156
未払受託者報酬	2,854,028	3,462,473
未払委託者報酬	25,686,483	31,162,659
その他未払費用	67,456	81,864
流動負債合計	206,421,332	247,661,369
負債合計	206,421,332	247,661,369
純資産の部		
元本等		
元本	6,588,988,344	6,260,328,714
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,349,881,041	4,942,195,860
（分配準備積立金）	2,165,683,764	4,325,859,231
元本等合計	8,938,869,385	11,202,524,574
純資産合計	8,938,869,385	11,202,524,574
負債純資産合計	9,145,290,717	11,450,185,943

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第25期 自 2022年3月11日 至 2023年3月10日	第26期 自 2023年3月11日 至 2024年3月11日
営業収益		
受取利息	206	327
有価証券売買等損益	1,139,961,667	3,039,712,176
その他収益	6	57,762
営業収益合計	1,139,961,879	3,039,770,265
営業費用		
支払利息	8,683	13,152
受託者報酬	5,700,680	6,670,431
委託者報酬	51,306,680	60,034,617
その他費用	134,736	159,463
営業費用合計	57,150,779	66,877,663
営業利益又は営業損失（△）	1,082,811,100	2,972,892,602
経常利益又は経常損失（△）	1,082,811,100	2,972,892,602
当期純利益又は当期純損失（△）	1,082,811,100	2,972,892,602
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	74,760,753	267,910,943
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,454,470,814	2,349,881,041
剰余金増加額又は欠損金減少額	254,311,036	511,377,037
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	254,311,036	511,377,037
剰余金減少額又は欠損金増加額	202,226,448	467,535,660
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	202,226,448	467,535,660
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	164,724,708	156,508,217
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,349,881,041	4,942,195,860

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第25期	第26期
	2023年3月10日現在	2024年3月11日現在
1. 期首元本額	6,628,786,151円	6,588,988,344円
期中追加設定元本額	866,476,295円	951,775,933円
期中一部解約元本額	906,274,102円	1,280,435,563円
2. 受益権の総数	6,588,988,344口	6,260,328,714口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第25期	第26期
	自 2022年3月11日 至 2023年3月10日	自 2023年3月11日 至 2024年3月11日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(211,023,556円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(410,566,962円)、信託約款に規定される収益調整金(3,726,120,125円)及び分配準備積立金(1,708,817,954円)より分配対象収益は6,056,528,597円(1万口当たり9,191.89円)であり、うち164,724,708円(1万口当たり250円)を分配金額としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(224,637,109円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(2,480,344,550円)、信託約款に規定される収益調整金(3,822,281,733円)及び分配準備積立金(1,777,385,789円)より分配対象収益は8,304,649,181円(1万口当たり13,265.51円)であり、うち156,508,217円(1万口当たり250円)を分配金額としております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第25期	第26期
	自 2022年3月11日 至 2023年3月10日	自 2023年3月11日 至 2024年3月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商	当ファンドが保有する金融商品の	同左

品に係るリスク	種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第25期 2023年3月10日現在	第26期 2024年3月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第25期	第26期
----	------	------

	2023年3月10日現在	2024年3月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,076,052,336	2,834,084,309
合計	1,076,052,336	2,834,084,309

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第25期 2023年3月10日現在	第26期 2024年3月11日現在
1口当たり純資産額	1.3566円	1.7894円
（1万口当たり純資産額）	（13,566円）	（17,894円）

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2024年3月11日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファン ド	2,406,156,745	11,200,659,647	
親投資信託受益証券	合計	2,406,156,745	11,200,659,647	
合計			11,200,659,647	

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

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年3月11日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,552,508,976
株式	552,430,865,410
未収入金	151,040,000
未収配当金	824,669,226
差入委託証拠金	188,366,470
流動資産合計	557,147,450,082
資産合計	557,147,450,082
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	72,110,210
前受金	17,225,000
未払金	7,079,240
未払解約金	621,208,000
流動負債合計	717,622,450
負債合計	717,622,450
純資産の部	
元本等	
元本	119,533,482,625
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	436,896,345,007
元本等合計	556,429,827,632
純資産合計	556,429,827,632
負債純資産合計	557,147,450,082

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年3月11日 至 2024年3月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年3月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	120,435,149,015円
同期中追加設定元本額	56,395,772,177円
同期中一部解約元本額	57,297,438,567円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOPIXオープン	2,406,156,745円
たわらノーロード 国内株式くらっぷ専用>	3,798,908,883円
One DC 国内株式インデックスファンド	31,416,434,664円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,589,394,170円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	1,572,967円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	8,952,801円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	21,079,024円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	21,229,561円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	28,800,675円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	17,989,649円
たわらノーロード TOPIX	2,301,669,566円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,698,970,509円
たわらノーロード バランス（堅実型）	45,999,549円
たわらノーロード バランス（標準型）	343,637,106円
たわらノーロード バランス（積極型）	596,261,922円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	2,176,132円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	135,993,571円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	393,889,932円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	343,717,190円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	479,222,558円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	351,849円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,314,206円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	26,173,248円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	4,975,024円

たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	12,291,891円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,450,896,083円
O n e グローバルバランス	47,706,820円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	886,333,060円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3,285,944,674円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3,838,341,625円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	285,684,942円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	952,267,543円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	1,083,325,759円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,196,964円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,070,522,519円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	14,869,106円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国10）	275,895,063円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国20）	330,045,853円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国30）	555,148,066円
投資のソムリエ	7,425,491,210円
クルーズコントロール	376,994,748円
投資のソムリエ<DC年金>	740,007,699円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	373,824,441円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,095,993,715円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	695,786,110円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,245,694,106円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	74,627,658円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	38,110,231円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	6,144,353円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	129,212,188円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	503,163,784円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	605,706,951円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	218,461,024円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	74,933,981円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	40,857,597円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	24,829,654円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	501,631,121円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	6,032,184円
O n e グローバル最適化バランス（安定型）<ラップ向け>	1,609,480円
O n e グローバル最適化バランス（成長型）<ラップ向け>	30,225,928円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12（適格機関投資家限定）	348,992円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06（適格機関投資家限定）	282,142円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08（適格機関投資家限定）	1,140,019円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09（適格機関投資家限定）	200,478円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03（適格機関投資家限定）	20,948,989円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ 2021-04（適格機関投資家限定）	715,577円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2021-06（適格機関投資家限定）	143,247,305円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09（適格機関投資家限定）	173,190円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	75,853,270円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）２０２２－１０（適格機関投資家限定）	352,912,231円
予兆モデル活用型戦略ファンド２０２４－０１（適格機関投資家限定）	427,966円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	243,760,134円
AMO n e マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	11,580,471円
D I A Mワールドバランス２５VA（適格機関投資家限定）	21,683,258円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	76,736,840円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	361,860円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（FOF s 用）（適格機関投資家専用）	2,987,134円
D I A Mグローバル・バランスファンド２５VA（適格機関投資家限定）	33,738,800円
D I A Mグローバル・バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	66,106,652円
D I A M国際分散バランスファンド３０VA（適格機関投資家限定）	2,503,989円
D I A M国際分散バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	9,989,221円
D I A M国内重視バランスファンド３０VA（適格機関投資家限定）	2,983,765円
D I A M国内重視バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	78,072円
D I A M世界バランスファンド４０VA（適格機関投資家限定）	527,239円
D I A M世界バランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	16,058,745円
D I A Mバランスファンド２５VA（適格機関投資家限定）	264,896,458円
D I A Mバランスファンド３７．５VA（適格機関投資家限定）	382,110,036円
D I A Mバランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	1,179,828,325円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA（適格機関投資家限定）	10,098,008円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA 2（適格機関投資家限定）	14,307,224円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド３０VA（適格機関投資家限定）	139,619,346円
D I A M世界アセットバランスファンドVA（適格機関投資家向け）	27,196,102円
D I A M世界バランスファンド５５VA（適格機関投資家限定）	51,649円
D I A M世界アセットバランスファンド２VA（適格機関投資家限定）	148,169,717円
D I A M世界アセットバランスファンド４０VA（適格機関投資家限定）	7,621,803円
D I A M世界アセットバランスファンド２５VA（適格機関投資家限定）	36,279,078円
D I A M世界アセットバランスファンド３VA（適格機関投資家限定）	97,349,190円
D I A M世界アセットバランスファンド４VA（適格機関投資家限定）	125,351,341円
D I A M世界バランス２５VA（適格機関投資家限定）	16,684,614円
D I A M国内バランス３０VA（適格機関投資家限定）	6,225,559円
動的パッケージファンド＜DC年金＞	25,746,688円
コア資産形成ファンド	13,022,014円
MHAMトピックスファンド	779,617,727円
MHAM T O P I XファンドVA（適格機関投資家専用）	44,602,590円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	3,030,548,533円
MHAM日本株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	1,852,195,020円
計	119,533,482,625円
2. 受益権の総数	119,533,482,625口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年3月11日 至 2024年3月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年3月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年3月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	24,197,221,220

合計	24,197,221,220
----	----------------

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2024年2月8日から2024年3月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2024年3月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	3,692,290,000	—	3,620,225,000	△72,065,000
合計	3,692,290,000	—	3,620,225,000	△72,065,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

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

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年3月11日現在

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

R o b o t H o m e	39,900	159.00	6,344,100	
キャンディル	1,700	584.00	992,800	
住石ホールディングス	23,200	3,470.00	80,504,000	
日鉄鉱業	8,200	4,940.00	40,508,000	
三井松島ホールディングス	12,100	3,045.00	36,844,500	
I N P E X	688,400	2,059.50	1,417,759,800	
石油資源開発	23,800	6,090.00	144,942,000	
K&Oエナジーグループ	9,300	2,461.00	22,887,300	
ダイセキ環境ソリューション	1,800	960.00	1,728,000	
第一カッター興業	5,900	1,511.00	8,914,900	
明豊ファシリティワークス	3,300	881.00	2,907,300	
安藤・間	118,700	1,205.00	143,033,500	
東急建設	64,200	840.00	53,928,000	
コムシスホールディングス	65,500	3,461.00	226,695,500	
ビーアールホールディングス	30,100	373.00	11,227,300	
高松コンストラクショングループ	15,200	2,854.00	43,380,800	
東建コーポレーション	5,200	9,390.00	48,828,000	
ソネック	1,000	935.00	935,000	
ヤマウラ	10,400	1,537.00	15,984,800	
オリエンタル白石	75,800	390.00	29,562,000	
大成建設	134,200	5,359.00	719,177,800	
大林組	512,800	1,757.00	900,989,600	
清水建設	406,600	945.60	384,480,960	
飛島建設	14,800	1,565.00	23,162,000	
長谷工コーポレーション	131,600	1,818.00	239,248,800	
松井建設	13,400	881.00	11,805,400	
銭高組	1,000	4,285.00	4,285,000	
鹿島建設	318,000	3,013.00	958,134,000	
不動テトラ	9,900	2,169.00	21,473,100	
大末建設	2,500	1,585.00	3,962,500	
鉄建建設	10,300	2,531.00	26,069,300	
西松建設	27,400	4,486.00	122,916,400	
三井住友建設	106,600	434.00	46,264,400	
大豊建設	4,900	3,400.00	16,660,000	
佐田建設	4,100	729.00	2,988,900	
ナカノフドー建設	4,500	655.00	2,947,500	
奥村組	23,200	5,130.00	119,016,000	
東鉄工業	17,800	3,010.00	53,578,000	
イチケン	1,600	2,432.00	3,891,200	
富士ピー・エス	2,900	453.00	1,313,700	
浅沼組	10,600	4,270.00	45,262,000	
戸田建設	194,100	999.20	193,944,720	
熊谷組	23,700	4,050.00	95,985,000	
北野建設	1,200	3,320.00	3,984,000	
植木組	1,800	1,710.00	3,078,000	
矢作建設工業	19,500	1,532.00	29,874,000	
ピーエス三菱	18,200	1,054.00	19,182,800	
日本ハウスホールディングス	30,500	313.00	9,546,500	
大東建託	52,800	17,400.00	918,720,000	
新日本建設	20,100	1,423.00	28,602,300	

東亜道路工業	5,700	6,280.00	35,796,000	
日本道路	16,800	1,991.00	33,448,800	
東亜建設工業	11,100	4,970.00	55,167,000	
日本国土開発	40,800	516.00	21,052,800	
若築建設	5,000	3,250.00	16,250,000	
東洋建設	36,100	1,377.00	49,709,700	
五洋建設	203,300	782.20	159,021,260	
世紀東急工業	18,400	1,881.00	34,610,400	
福田組	5,400	5,440.00	29,376,000	
日本ドライケミカル	1,600	2,619.00	4,190,400	
住友林業	123,900	4,223.00	523,229,700	
日本基礎技術	3,800	513.00	1,949,400	
巴コーポレーション	8,100	652.00	5,281,200	
大和ハウス工業	396,600	4,267.00	1,692,292,200	
ライト工業	29,500	1,917.00	56,551,500	
積水ハウス	434,900	3,321.00	1,444,302,900	
日特建設	13,700	1,158.00	15,864,600	
北陸電気工事	9,800	1,186.00	11,622,800	
ユアテック	31,600	1,353.00	42,754,800	
日本リーテック	11,200	1,296.00	14,515,200	
四電工	6,000	3,950.00	23,700,000	
中電工	22,300	2,971.00	66,253,300	
関電工	89,900	1,737.00	156,156,300	
きんでん	101,000	2,694.50	272,144,500	
東京エネシス	14,300	1,199.00	17,145,700	
トーエネック	4,700	5,260.00	24,722,000	
住友電設	13,700	3,215.00	44,045,500	
日本電設工業	26,900	1,987.00	53,450,300	
エクシオグループ	70,100	3,197.00	224,109,700	
新日本空調	9,300	2,881.00	26,793,300	
九電工	31,000	5,999.00	185,969,000	
三機工業	31,000	2,044.00	63,364,000	
日揮ホールディングス	141,900	1,387.00	196,815,300	
中外炉工業	4,700	2,930.00	13,771,000	
ヤマト	5,300	969.00	5,135,700	
太平電業	8,900	4,335.00	38,581,500	
高砂熱学工業	38,400	4,415.00	169,536,000	
三晃金属工業	900	4,980.00	4,482,000	
NECネットエスアイ	57,200	2,564.00	146,660,800	
朝日工業社	6,700	3,270.00	21,909,000	
明星工業	27,800	1,287.00	35,778,600	
大気社	16,500	4,595.00	75,817,500	
ダイダン	18,900	1,936.00	36,590,400	
日比谷総合設備	10,400	2,697.00	28,048,800	
ニッポン	43,100	2,342.00	100,940,200	
日清製粉グループ本社	133,100	2,045.50	272,256,050	
日東富士製粉	2,300	5,390.00	12,397,000	
昭和産業	14,000	3,435.00	48,090,000	
鳥越製粉	5,600	686.00	3,841,600	
中部飼料	19,900	1,251.00	24,894,900	

フィード・ワン	21,000	1,024.00	21,504,000	
東洋精糖	1,200	2,507.00	3,008,400	
日本甜菜製糖	8,400	2,083.00	17,497,200	
DM三井製糖ホールディングス	14,300	3,310.00	47,333,000	
塩水港精糖	8,400	301.00	2,528,400	
ウェルネオシュガー	7,200	2,287.00	16,466,400	
L I F U L L	51,300	173.00	8,874,900	
M I X I	32,200	2,465.00	79,373,000	
ジェイエシーリクルートメント	54,300	718.00	38,987,400	
日本M&Aセンターホールディングス	239,500	950.10	227,548,950	
メンバーズ	5,100	905.00	4,615,500	
中広	1,000	412.00	412,000	
UTグループ	19,400	3,620.00	70,228,000	
アイティメディア	5,700	1,919.00	10,938,300	
ケアネット	23,100	694.00	16,031,400	
E・Jホールディングス	8,800	1,674.00	14,731,200	
オープンアップグループ	45,100	2,068.00	93,266,800	
コシダカホールディングス	45,000	914.00	41,130,000	
アルトナー	2,800	2,467.00	6,907,600	
パソナグループ	18,200	2,840.00	51,688,000	
CDS	1,700	1,706.00	2,900,200	
リンクアンドモチベーション	43,300	607.00	26,283,100	
エス・エム・エス	52,700	2,490.00	131,223,000	
サニーサイドアップグループ	2,300	688.00	1,582,400	
パーソルホールディングス	1,530,100	202.80	310,304,280	
リニカル	4,300	379.00	1,629,700	
クックパッド	41,100	123.00	5,055,300	
エスクリ	2,700	305.00	823,500	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	3,300	760.00	2,508,000	
森永製菓	61,600	2,593.50	159,759,600	
中村屋	3,500	3,070.00	10,745,000	
江崎グリコ	41,200	4,392.00	180,950,400	
名糖産業	5,700	1,850.00	10,545,000	
井村屋グループ	8,600	2,498.00	21,482,800	
不二家	9,900	2,447.00	24,225,300	
山崎製パン	96,400	3,897.00	375,670,800	
第一屋製パン	1,200	685.00	822,000	
モロゾフ	4,600	4,190.00	19,274,000	
亀田製菓	8,200	4,330.00	35,506,000	
寿スピリッツ	68,100	1,823.00	124,146,300	
カルビー	65,900	3,424.00	225,641,600	
森永乳業	50,300	3,179.00	159,903,700	
六甲バター	10,600	1,353.00	14,341,800	
ヤクルト本社	205,700	3,233.00	665,028,100	
明治ホールディングス	176,500	3,403.00	600,629,500	
雪印メグミルク	34,800	2,220.00	77,256,000	
プリマハム	19,300	2,280.00	44,004,000	
日本ハム	61,900	5,180.00	320,642,000	
林兼産業	2,200	557.00	1,225,400	
丸大食品	14,500	1,632.00	23,664,000	

S F o o d s	15,900	3,195.00	50,800,500	
柿安本店	5,600	2,665.00	14,924,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	22,000	4,150.00	91,300,000	
学情	7,700	1,746.00	13,444,200	
スタジオアリス	7,500	2,043.00	15,322,500	
クロスキャット	9,300	1,739.00	16,172,700	
エプコ	1,800	839.00	1,510,200	
システナ	221,900	287.00	63,685,300	
N J S	3,300	2,920.00	9,636,000	
デジタルアーツ	9,300	4,360.00	40,548,000	
日鉄ソリューションズ	25,000	4,950.00	123,750,000	
総合警備保障	251,100	848.20	212,983,020	
キューブシステム	7,800	1,089.00	8,494,200	
いちご	165,900	405.00	67,189,500	
日本駐車場開発	152,400	191.00	29,108,400	
コア	6,500	1,900.00	12,350,000	
カカコム	99,300	1,748.50	173,626,050	
アイロムグループ	6,100	1,823.00	11,120,300	
セントケア・ホールディング	11,000	871.00	9,581,000	
サイネックス	1,100	808.00	888,800	
ルネサンス	11,700	1,046.00	12,238,200	
ディップ	23,000	2,592.00	59,616,000	
S B Sホールディングス	13,000	2,277.00	29,601,000	
デジタルホールディングス	7,800	1,121.00	8,743,800	
新日本科学	13,700	1,543.00	21,139,100	
キャリアデザインセンター	1,400	1,698.00	2,377,200	
ベネフィット・ワン	52,200	2,163.00	112,908,600	
エムスリー	297,000	2,082.50	618,502,500	
ツカダ・グローバルホールディング	4,300	401.00	1,724,300	
プラス	700	663.00	464,100	
アウトソーシング	96,500	1,747.00	168,585,500	
ウェルネット	5,900	538.00	3,174,200	
ワールドホールディングス	6,800	2,373.00	16,136,400	
ディー・エヌ・エー	53,400	1,397.50	74,626,500	
博報堂D Yホールディングス	191,700	1,359.00	260,520,300	
ぐるなび	28,000	282.00	7,896,000	
タカミヤ	20,400	568.00	11,587,200	
ファンコミュニケーションズ	21,000	404.00	8,484,000	
ライク	5,600	1,567.00	8,775,200	
A o b a - B B T	2,500	391.00	977,500	
エスプール	43,200	317.00	13,694,400	
W D Bホールディングス	7,700	2,266.00	17,448,200	
手間いらず	2,500	2,940.00	7,350,000	
ティア	3,900	454.00	1,770,600	
C D G	800	1,232.00	985,600	
アドウェイズ	20,700	447.00	9,252,900	
パリュエコマース	13,200	1,054.00	13,912,800	
インフォマート	156,000	385.00	60,060,000	
サッポロホールディングス	47,400	6,333.00	300,184,200	
アサヒグループホールディングス	332,700	5,222.00	1,737,359,400	

麒麟ホールディングス	599,700	2,048.50	1,228,485,450	
宝ホールディングス	98,300	1,110.00	109,113,000	
オエノンホールディングス	43,000	340.00	14,620,000	
養命酒製造	4,800	1,876.00	9,004,800	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	112,800	2,244.50	253,179,600	
ライフドリンク カンパニー	2,100	4,315.00	9,061,500	
サントリー食品インターナショナル	101,400	4,833.00	490,066,200	
ダイドーグループホールディングス	16,300	2,768.00	45,118,400	
伊藤園	48,800	3,735.00	182,268,000	
キーコーヒー	16,100	2,036.00	32,779,600	
ユニカフェ	2,200	909.00	1,999,800	
ジャパンフーズ	1,000	1,465.00	1,465,000	
日清オイリオグループ	20,300	5,140.00	104,342,000	
不二製油グループ本社	33,500	2,345.50	78,574,250	
かどや製油	800	3,865.00	3,092,000	
Jーオイルミルズ	16,500	1,988.00	32,802,000	
ローソン	32,900	10,300.00	338,870,000	
サンエー	11,800	4,590.00	54,162,000	
カワチ薬品	12,100	2,708.00	32,766,800	
エービーシー・マート	67,700	2,782.50	188,375,250	
ハードオフコーポレーション	5,500	1,685.00	9,267,500	
高千穂交易	4,900	3,765.00	18,448,500	
アスクル	37,300	1,995.00	74,413,500	
ゲオホールディングス	17,400	1,857.00	32,311,800	
アダストリア	18,700	3,785.00	70,779,500	
ジーフット	5,700	280.00	1,596,000	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	900	675.00	607,500	
オルパヘルスケアホールディングス	1,100	1,878.00	2,065,800	
伊藤忠食品	3,500	7,490.00	26,215,000	
くら寿司	18,100	4,320.00	78,192,000	
キャンドウ	5,500	2,717.00	14,943,500	
エレマテック	13,900	1,870.00	25,993,000	
I Kホールディングス	2,300	375.00	862,500	
パルグループホールディングス	30,400	2,529.00	76,881,600	
エディオン	61,200	1,536.00	94,003,200	
あらた	23,700	3,230.00	76,551,000	
サーラコーポレーション	32,500	790.00	25,675,000	
ワッツ	3,300	648.00	2,138,400	
トーマンデバイス	2,200	5,630.00	12,386,000	
ハローズ	7,000	4,520.00	31,640,000	
J Pホールディングス	38,400	474.00	18,201,600	
フジオフードグループ本社	17,400	1,307.00	22,741,800	
あみやき亭	3,700	4,730.00	17,501,000	
東京エレクトロン デバイス	15,400	7,100.00	109,340,000	
ひらまつ	16,400	247.00	4,050,800	
円谷フィールズホールディングス	26,600	1,496.00	39,793,600	
双日	172,300	3,850.00	663,355,000	
アルフレッサ ホールディングス	155,300	2,186.50	339,563,450	
大黒天物産	4,800	9,510.00	45,648,000	

ハニーズホールディングス	13,700	1,697.00	23,248,900	
ファーマライズホールディングス	1,600	647.00	1,035,200	
キッコーマン	95,400	9,392.00	895,996,800	
味の素	342,100	5,478.00	1,874,023,800	
ブルドックソース	7,600	2,152.00	16,355,200	
キューピー	77,400	2,767.00	214,165,800	
ハウス食品グループ本社	49,600	3,077.00	152,619,200	
カゴメ	61,900	3,347.00	207,179,300	
焼津水産化学工業	2,800	1,343.00	3,760,400	
アリアケジャパン	14,400	5,310.00	76,464,000	
ピエトロ	900	1,826.00	1,643,400	
エバラ食品工業	3,400	2,982.00	10,138,800	
やまみ	900	3,555.00	3,199,500	
ニチレイ	66,000	3,972.00	262,152,000	
横浜冷凍	42,100	1,051.00	44,247,100	
東洋水産	72,800	8,564.00	623,459,200	
イトアンドホールディングス	6,800	2,022.00	13,749,600	
大冷	1,000	1,915.00	1,915,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,500	1,265.00	8,222,500	
日清食品ホールディングス	151,900	4,184.00	635,549,600	
永谷園ホールディングス	7,100	2,209.00	15,683,900	
一正蒲鉾	2,800	737.00	2,063,600	
フジッコ	14,800	1,925.00	28,490,000	
ロック・フィールド	17,600	1,579.00	27,790,400	
日本たばこ産業	874,800	3,824.00	3,345,235,200	
ケンコーマヨネーズ	9,900	2,025.00	20,047,500	
わらべや日洋ホールディングス	9,600	2,664.00	25,574,400	
なとり	9,100	2,117.00	19,264,700	
イフジ産業	1,200	1,485.00	1,782,000	
ファーマフーズ	20,700	958.00	19,830,600	
北の達人コーポレーション	61,700	200.00	12,340,000	
ユーグレナ	89,600	603.00	54,028,800	
紀文食品	12,500	1,239.00	15,487,500	
ピックルスホールディングス	8,400	1,155.00	9,702,000	
スター・マイカ・ホールディングス	16,700	542.00	9,051,400	
S R Eホールディングス	6,200	3,835.00	23,777,000	
ADワークスグループ	16,100	233.00	3,751,300	
片倉工業	13,500	1,771.00	23,908,500	
ゲンゼ	10,400	5,490.00	57,096,000	
ヒューリック	335,900	1,488.50	499,987,150	
神栄	1,000	1,640.00	1,640,000	
ラサ商事	6,300	1,965.00	12,379,500	
アルペン	12,700	1,955.00	24,828,500	
ハブ	2,200	722.00	1,588,400	
ラクーンホールディングス	10,900	588.00	6,409,200	
クオールホールディングス	21,300	1,678.00	35,741,400	
アルコニックス	20,400	1,415.00	28,866,000	
神戸物産	119,700	4,072.00	487,418,400	
ソリトンシステムズ	7,600	1,351.00	10,267,600	
ジンズホールディングス	9,200	4,305.00	39,606,000	

ビックカメラ	82,300	1,262.00	103,862,600	
DCMホールディングス	81,800	1,451.00	118,691,800	
ペッパーフードサービス	35,800	120.00	4,296,000	
ハイパー	1,600	303.00	484,800	
M o n o t a R O	219,300	1,485.50	325,770,150	
東京一番フーズ	1,700	522.00	887,400	
DDグループ	4,400	1,190.00	5,236,000	
あい ホールディングス	24,800	2,261.00	56,072,800	
ディーブイエックス	1,900	1,067.00	2,027,300	
きちりホールディングス	1,800	900.00	1,620,000	
J. フロント リテイリング	177,500	1,463.50	259,771,250	
ドトール・日レスホールディングス	27,400	2,010.00	55,074,000	
マツキヨココカラ&カンパニー	281,400	2,347.50	660,586,500	
ブロンコビリー	9,100	3,395.00	30,894,500	
Z O Z O	98,600	3,676.00	362,453,600	
トレジャー・ファクトリー	8,500	1,389.00	11,806,500	
物語コーポレーション	25,800	4,455.00	114,939,000	
三越伊勢丹ホールディングス	260,500	2,208.50	575,314,250	
東洋紡	63,300	1,112.00	70,389,600	
ユニチカ	47,300	169.00	7,993,700	
富士紡ホールディングス	6,400	4,420.00	28,288,000	
日清紡ホールディングス	111,000	1,183.00	131,313,000	
倉敷紡績	10,400	3,270.00	34,008,000	
ダイワボウホールディングス	68,500	2,503.50	171,489,750	
シキボウ	7,700	1,214.00	9,347,800	
日東紡績	18,600	5,440.00	101,184,000	
トヨタ紡織	61,600	2,294.50	141,341,200	
マクニカホールディングス	36,600	7,591.00	277,830,600	
H a m e e	6,200	1,118.00	6,931,600	
マーケットエンタープライズ	600	820.00	492,000	
ラクト・ジャパン	6,000	2,396.00	14,376,000	
ウエルシアホールディングス	80,200	2,684.00	215,256,800	
クリエイトSDホールディングス	21,900	3,240.00	70,956,000	
グリムス	6,500	2,135.00	13,877,500	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	23,400	1,215.00	28,431,000	
八洲電機	12,500	1,572.00	19,650,000	
メディアスホールディングス	9,000	735.00	6,615,000	
レスターホールディングス	13,200	2,888.00	38,121,600	
ジオリーヴグループ	1,600	1,380.00	2,208,000	
丸善CH I ホールディングス	8,300	329.00	2,730,700	
大光	3,600	634.00	2,282,400	
O C H I ホールディングス	1,600	1,699.00	2,718,400	
T O K A I ホールディングス	84,000	1,000.00	84,000,000	
黒谷	2,200	594.00	1,306,800	
ミサワ	1,500	617.00	925,500	
ティーライフ	900	1,373.00	1,235,700	
C o m i n i x	1,400	890.00	1,246,000	
エー・ピーホールディングス	1,700	973.00	1,654,100	
三洋貿易	17,500	1,216.00	21,280,000	

チムニー	2,100	1,414.00	2,969,400	
シュッピン	14,000	1,162.00	16,268,000	
ビューティガレージ	4,900	2,131.00	10,441,900	
オイシックス・ラ・大地	20,800	1,301.00	27,060,800	
ウイン・パートナーズ	10,100	1,256.00	12,685,600	
ネクステージ	35,300	2,581.00	91,109,300	
ジョイフル本田	45,000	2,135.00	96,075,000	
鳥貴族ホールディングス	5,700	4,565.00	26,020,500	
ホットランド	11,800	1,827.00	21,558,600	
すかいらくホールディングス	211,400	2,209.50	467,088,300	
SFPホールディングス	8,500	1,875.00	15,937,500	
綿半ホールディングス	12,000	1,515.00	18,180,000	
日本毛織	37,500	1,388.00	52,050,000	
ダイトウボウ	10,400	93.00	967,200	
トーア紡コーポレーション	2,500	439.00	1,097,500	
ダイドーリミテッド	9,400	679.00	6,382,600	
ヨシックスホールディングス	3,200	2,929.00	9,372,800	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	43,100	983.00	42,367,300	
野村不動産ホールディングス	80,100	3,711.00	297,251,100	
三重交通グループホールディングス	30,900	625.00	19,312,500	
サムティ	22,900	2,423.00	55,486,700	
ディア・ライフ	24,500	926.00	22,687,000	
コーセーアールイー	2,000	866.00	1,732,000	
地主	11,000	2,148.00	23,628,000	
プレサンスコーポレーション	22,900	1,689.00	38,678,100	
フィル・カンパニー	2,200	808.00	1,777,600	
THEグローバル社	4,300	400.00	1,720,000	
ハウスコム	1,000	978.00	978,000	
JPMC	8,300	1,185.00	9,835,500	
サンセイランディック	1,900	998.00	1,896,200	
エストラスト	700	637.00	445,900	
フージャースホールディングス	22,200	1,068.00	23,709,600	
オープンハウスグループ	52,700	4,384.00	231,036,800	
東急不動産ホールディングス	432,900	984.80	426,319,920	
飯田グループホールディングス	138,000	1,926.00	265,788,000	
イーグランド	1,000	1,577.00	1,577,000	
ムゲンエステート	4,300	1,321.00	5,680,300	
帝国繊維	16,500	2,250.00	37,125,000	
日本コークス工業	148,700	142.00	21,115,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,000	592.00	4,144,000	
ミタチ産業	1,900	1,184.00	2,249,600	
B E E N O S	6,300	1,920.00	12,096,000	
あさひ	14,300	1,306.00	18,675,800	
日本調剤	10,500	1,610.00	16,905,000	
コスモス薬品	13,100	13,650.00	178,815,000	
シップヘルスケアホールディングス	55,600	2,231.00	124,043,600	
トーエル	3,100	788.00	2,442,800	
ソフトクリエイトホールディングス	12,100	1,897.00	22,953,700	
セブン&アイ・ホールディングス	1,599,300	2,103.50	3,364,127,550	

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

オカダアイヨン	2, 200	2, 844. 00	6, 256, 800	
ワイエイシイホールディングス	5, 500	2, 326. 00	12, 793, 000	
小松製作所	692, 200	4, 192. 00	2, 901, 702, 400	
住友重機械工業	87, 400	4, 583. 00	400, 554, 200	
日立建機	58, 800	4, 226. 00	248, 488, 800	
日工	21, 900	780. 00	17, 082, 000	
巴工業	5, 800	3, 840. 00	22, 272, 000	
井関農機	13, 800	1, 012. 00	13, 965, 600	
TOWA	16, 400	9, 270. 00	152, 028, 000	
丸山製作所	1, 100	2, 286. 00	2, 514, 600	
北川鉄工所	5, 800	1, 551. 00	8, 995, 800	
シンニッタン	8, 600	286. 00	2, 459, 600	
ローツェ	7, 700	20, 900. 00	160, 930, 000	
タカキタ	2, 200	482. 00	1, 060, 400	
クボタ	772, 000	2, 194. 50	1, 694, 154, 000	
荏原実業	7, 800	3, 630. 00	28, 314, 000	
東洋エンジニアリング	21, 100	890. 00	18, 779, 000	
三菱化工機	5, 200	3, 785. 00	19, 682, 000	
月島ホールディングス	20, 000	1, 431. 00	28, 620, 000	
帝国電機製作所	10, 400	2, 526. 00	26, 270, 400	
東京機械製作所	1, 700	450. 00	765, 000	
新東工業	29, 900	1, 134. 00	33, 906, 600	
澁谷工業	13, 900	3, 190. 00	44, 341, 000	
アイチコーポレーション	20, 600	1, 105. 00	22, 763, 000	
小森コーポレーション	36, 400	1, 263. 00	45, 973, 200	
鶴見製作所	11, 300	3, 590. 00	40, 567, 000	
日本ギア工業	2, 500	591. 00	1, 477, 500	
酒井重工業	2, 300	6, 540. 00	15, 042, 000	
荏原製作所	60, 600	13, 375. 00	810, 525, 000	
石井鐵工所	800	2, 720. 00	2, 176, 000	
西島製作所	12, 700	2, 621. 00	33, 286, 700	
北越工業	14, 800	1, 952. 00	28, 889, 600	
ダイキン工業	176, 300	20, 180. 00	3, 557, 734, 000	
オルガノ	17, 700	7, 560. 00	133, 812, 000	
トーヨーカネツ	5, 000	4, 440. 00	22, 200, 000	
栗田工業	82, 600	6, 343. 00	523, 931, 800	
椿本チエイン	20, 900	4, 910. 00	102, 619, 000	
大同工業	2, 900	754. 00	2, 186, 600	
日機装	34, 100	1, 248. 00	42, 556, 800	
木村化工機	11, 300	693. 00	7, 830, 900	
レイズネクスト	20, 800	2, 236. 00	46, 508, 800	
アネスト岩田	22, 800	1, 272. 00	29, 001, 600	
ダイフク	249, 200	3, 388. 00	844, 289, 600	
サムコ	4, 000	5, 330. 00	21, 320, 000	
加藤製作所	3, 300	1, 432. 00	4, 725, 600	
油研工業	1, 100	2, 356. 00	2, 591, 600	
タダノ	85, 000	1, 244. 00	105, 740, 000	
フジテック	34, 500	3, 715. 00	128, 167, 500	
C K D	40, 900	3, 225. 00	131, 902, 500	
平和	43, 700	2, 028. 00	88, 623, 600	

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

MUTOHホールディングス	900	2, 275. 00	2, 047, 500	
伊藤忠商事	1, 039, 900	6, 385. 00	6, 639, 761, 500	
丸紅	1, 289, 800	2, 434. 00	3, 139, 373, 200	
スクロール	23, 000	947. 00	21, 781, 000	
高島	4, 700	1, 298. 00	6, 100, 600	
ヨンドシーホールディングス	14, 600	1, 873. 00	27, 345, 800	
三陽商会	5, 500	2, 567. 00	14, 118, 500	
長瀬産業	70, 900	2, 475. 00	175, 477, 500	
ナイガイ	2, 100	261. 00	548, 100	
蝶理	9, 700	3, 205. 00	31, 088, 500	
豊田通商	135, 500	9, 411. 00	1, 275, 190, 500	
オンワードホールディングス	86, 300	522. 00	45, 048, 600	
三共生興	21, 500	766. 00	16, 469, 000	
兼松	64, 700	2, 452. 00	158, 644, 400	
美津濃	14, 500	5, 520. 00	80, 040, 000	
ツカモトコーポレーション	1, 000	1, 291. 00	1, 291, 000	
ルックホールディングス	4, 100	2, 524. 00	10, 348, 400	
三井物産	1, 165, 600	6, 522. 00	7, 602, 043, 200	
日本紙パルプ商事	7, 400	5, 220. 00	38, 628, 000	
東京エレクトロン	309, 500	37, 150. 00	11, 497, 925, 000	
カメイ	16, 400	2, 019. 00	33, 111, 600	
東都水産	400	6, 600. 00	2, 640, 000	
OUGホールディングス	1, 000	2, 522. 00	2, 522, 000	
スターゼン	10, 700	2, 783. 00	29, 778, 100	
セイコーグループ	20, 400	3, 885. 00	79, 254, 000	
山善	46, 900	1, 309. 00	61, 392, 100	
椿本興業	3, 100	6, 730. 00	20, 863, 000	
住友商事	936, 300	3, 462. 00	3, 241, 470, 600	
B I P R O G Y	48, 000	4, 565. 00	219, 120, 000	
内田洋行	6, 300	6, 910. 00	43, 533, 000	
三菱商事	2, 970, 300	3, 235. 00	9, 608, 920, 500	
第一実業	14, 600	2, 112. 00	30, 835, 200	
キヤノンマーケティングジャパン	35, 800	4, 361. 00	156, 123, 800	
西華産業	6, 100	3, 175. 00	19, 367, 500	
佐藤商事	10, 900	1, 740. 00	18, 966, 000	
菱洋エレクトロ	14, 700	3, 850. 00	56, 595, 000	
東京産業	14, 100	715. 00	10, 081, 500	
ユアサ商事	12, 100	4, 850. 00	58, 685, 000	
神鋼商事	3, 900	6, 920. 00	26, 988, 000	
トルク	3, 700	291. 00	1, 076, 700	
阪和興業	27, 800	5, 490. 00	152, 622, 000	
正栄食品工業	10, 300	4, 730. 00	48, 719, 000	
カナデン	11, 600	1, 501. 00	17, 411, 600	
R Y O D E N	12, 500	2, 556. 00	31, 950, 000	
ニプロ	121, 900	1, 187. 50	144, 756, 250	
岩谷産業	35, 200	7, 847. 00	276, 214, 400	
ナイス	2, 100	1, 576. 00	3, 309, 600	
ニチモウ	2, 200	2, 165. 00	4, 763, 000	
極東貿易	9, 200	2, 174. 00	20, 000, 800	
アステナホールディングス	29, 000	471. 00	13, 659, 000	

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

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

鳥取銀行	2, 200	1, 486. 00	3, 269, 200	
百十四銀行	14, 200	2, 869. 00	40, 739, 800	
四国銀行	21, 200	1, 197. 00	25, 376, 400	
阿波銀行	20, 200	2, 782. 00	56, 196, 400	
大分銀行	8, 700	2, 890. 00	25, 143, 000	
宮崎銀行	8, 700	2, 907. 00	25, 290, 900	
佐賀銀行	8, 500	2, 092. 00	17, 782, 000	
琉球銀行	30, 700	1, 195. 00	36, 686, 500	
セブン銀行	451, 400	297. 50	134, 291, 500	
みずほフィナンシャルグループ	1, 943, 700	3, 002. 00	5, 834, 987, 400	
高知銀行	2, 200	1, 017. 00	2, 237, 400	
山口フィナンシャルグループ	141, 200	1, 592. 50	224, 861, 000	
芙蓉総合リース	13, 300	12, 925. 00	171, 902, 500	
みずほリース	24, 100	5, 250. 00	126, 525, 000	
東京センチュリー	107, 600	1, 515. 00	163, 014, 000	
S B I ホールディングス	211, 000	3, 828. 00	807, 708, 000	
日本証券金融	52, 900	1, 634. 00	86, 438, 600	
アイフル	212, 000	401. 00	85, 012, 000	
日本アジア投資	4, 700	229. 00	1, 076, 300	
名古屋銀行	9, 300	6, 760. 00	62, 868, 000	
北洋銀行	218, 200	460. 00	100, 372, 000	
大光銀行	2, 100	1, 542. 00	3, 238, 200	
愛媛銀行	19, 400	1, 122. 00	21, 766, 800	
トマト銀行	2, 300	1, 336. 00	3, 072, 800	
京葉銀行	60, 400	763. 00	46, 085, 200	
栃木銀行	71, 900	369. 00	26, 531, 100	
北日本銀行	4, 700	2, 336. 00	10, 979, 200	
東和銀行	26, 400	700. 00	18, 480, 000	
福島銀行	6, 600	284. 00	1, 874, 400	
大東銀行	2, 700	788. 00	2, 127, 600	
リコーリース	13, 700	5, 210. 00	71, 377, 000	
イオンフィナンシャルサービス	82, 700	1, 305. 00	107, 923, 500	
アコム	257, 100	387. 00	99, 497, 700	
ジャックス	15, 300	5, 300. 00	81, 090, 000	
オリエントコーポレーション	47, 000	1, 070. 00	50, 290, 000	
オリックス	863, 600	3, 150. 00	2, 720, 340, 000	
三菱HCキャピタル	641, 600	1, 019. 00	653, 790, 400	
ジャフコ グループ	42, 900	1, 734. 00	74, 388, 600	
九州リースサービス	2, 600	1, 493. 00	3, 881, 800	
トモニホールディングス	136, 300	421. 00	57, 382, 300	
大和証券グループ本社	1, 115, 500	1, 079. 00	1, 203, 624, 500	
野村ホールディングス	2, 421, 500	885. 80	2, 144, 964, 700	
岡三証券グループ	126, 500	777. 00	98, 290, 500	
丸三証券	47, 900	1, 006. 00	48, 187, 400	
東洋証券	38, 200	391. 00	14, 936, 200	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	171, 000	596. 00	101, 916, 000	
光世証券	1, 400	761. 00	1, 065, 400	
水戸証券	42, 500	486. 00	20, 655, 000	
いちよし証券	27, 000	807. 00	21, 789, 000	

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

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

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

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

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

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

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
- なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第27期中間計算期間(2024年3月12日から2024年9月11日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月15日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMHAM TOPIXオープンの2024年3月12日から2024年9月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、MHAM TOPIXオープンの2024年9月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年3月12日から2024年9月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

【中間財務諸表】

【MHAM TOPIXオープン】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第26期 2024年3月11日現在	第27期中間計算期間末 2024年9月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	87,643,296	52,437,492
親投資信託受益証券	11,200,659,647	10,617,709,797
未収入金	161,883,000	—
流動資産合計	11,450,185,943	10,670,147,289
資産合計	11,450,185,943	10,670,147,289
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	156,508,217	—
未払解約金	56,446,156	12,207,665
未払受託者報酬	3,462,473	3,843,701
未払委託者報酬	31,162,659	34,593,554
その他未払費用	81,864	90,872
流動負債合計	247,661,369	50,735,792
負債合計	247,661,369	50,735,792
純資産の部		
元本等		
元本	6,260,328,714	6,201,694,930
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	4,942,195,860	4,417,716,567
（分配準備積立金）	4,325,859,231	3,986,809,053
元本等合計	11,202,524,574	10,619,411,497
純資産合計	11,202,524,574	10,619,411,497
負債純資産合計	11,450,185,943	10,670,147,289

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第26期中間計算期間 自 2023年3月11日 至 2023年9月10日	第27期中間計算期間 自 2024年3月12日 至 2024年9月11日
営業収益		
受取利息	271	20,256
有価証券売買等損益	1,591,249,383	△423,454,850
営業収益合計	1,591,249,654	△423,434,594
営業費用		
支払利息	9,956	55
受託者報酬	3,207,958	3,843,701
委託者報酬	28,871,958	34,593,554
その他費用	75,822	90,872
営業費用合計	32,165,694	38,528,182
営業利益又は営業損失（△）	1,559,083,960	△461,962,776
経常利益又は経常損失（△）	1,559,083,960	△461,962,776
中間純利益又は中間純損失（△）	1,559,083,960	△461,962,776
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	73,747,128	27,976,167
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,349,881,041	4,942,195,860
剰余金増加額又は欠損金減少額	237,662,658	369,970,146
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	237,662,658	369,970,146
剰余金減少額又は欠損金増加額	222,267,299	404,510,496
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	222,267,299	404,510,496
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	—	—
中間剰余金又は中間欠損金（△）	3,850,613,232	4,417,716,567

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第27期中間計算期間 自 2024年3月12日 至 2024年9月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年3月10日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2024年3月11日、当中間計算期間末日を2024年9月11日としております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第26期 2024年3月11日現在	第27期中間計算期間末 2024年9月11日現在
1. 期首元本額	6,588,988,344円	6,260,328,714円
期中追加設定元本額	951,775,933円	452,815,757円
期中一部解約元本額	1,280,435,563円	511,449,541円
2. 受益権の総数	6,260,328,714口	6,201,694,930口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第26期 2024年3月11日現在	第27期中間計算期間末 2024年9月11日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額ははありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額ははありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった	同左

	場合、当該価額が異なることもあります。	
--	---------------------	--

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第26期 2024年3月11日現在	第27期中間計算期間末 2024年9月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7894円 (17,894円)	1.7123円 (17,123円)

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年9月11日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,756,370,500
株式	534,322,514,460
派生商品評価勘定	43,276,410
未収入金	143,728
未収配当金	263,597,176
前払金	131,435,000
差入委託証拠金	460,267,413
流動資産合計	539,977,604,687
資産合計	539,977,604,687
負債の部	
流動負債	
未払金	242,342,940
未払解約金	34,332,000
流動負債合計	276,674,940
負債合計	276,674,940
純資産の部	
元本等	
元本	120,758,959,585
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	418,941,970,162
元本等合計	539,700,929,747
純資産合計	539,700,929,747
負債純資産合計	539,977,604,687

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目		自 2024年3月12日 至 2024年9月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年9月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	119,533,482,625円
同期中追加設定元本額	22,718,468,522円
同期中一部解約元本額	21,492,991,562円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOPIXオープン	2,375,751,767円
たわらノーロード 国内株式くらっぷ専用>	6,122,955,051円
One DC 国内株式インデックスファンド	33,985,021,062円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,489,465,921円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	1,958,569円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	7,816,793円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	18,464,444円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	25,971,845円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	23,787,518円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	11,462,434円
たわらノーロード TOPIX	2,979,542,164円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,917,571,270円
たわらノーロード バランス（堅実型）	50,047,517円
たわらノーロード バランス（標準型）	401,800,643円
たわらノーロード バランス（積極型）	734,429,878円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	2,382,219円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	139,950,447円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	428,560,272円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	392,226,585円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	578,261,545円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	279,619円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,173,448円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	27,441,137円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	6,728,236円

たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	15,772,628円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	10,674円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	49,545円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	439,685円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,426,362,688円
O n e グローバルバランス	86,235,754円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	874,675,397円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3,205,466,724円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3,886,767,109円
D I A M DC バランス 3 0 インデックスファンド	243,390,431円
D I A M DC バランス 5 0 インデックスファンド	850,384,728円
D I A M DC バランス 7 0 インデックスファンド	1,012,355,819円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	25,854,132円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	971,013,845円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	12,880,508円
D I A M DC 8 資産バランスファンド（新興国 1 0）	258,761,892円
D I A M DC 8 資産バランスファンド（新興国 2 0）	324,907,981円
D I A M DC 8 資産バランスファンド（新興国 3 0）	572,574,471円
投資のソムリエ	5,947,063,286円
クルーズコントロール	35,585,879円
投資のソムリエ<DC年金>	684,396,390円
D I A M 8 資産バランスファンドN<DC年金>	369,279,350円
4 資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,396,906,663円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	300,385,019円
リスク抑制世界 8 資産バランスファンド	874,419,543円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー 2 0 4 5）	63,103,334円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー 2 0 5 5）	32,758,675円
リスク抑制世界 8 資産バランスファンド（DC）	2,941,909円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー 2 0 3 5）	154,724,734円
4 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	583,150,410円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	98,179,798円
9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	228,248,027円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー 2 0 4 0）	61,151,635円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー 2 0 5 0）	35,389,571円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー 2 0 6 0）	21,552,121円
4 資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	693,542,971円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー 2 0 6 5）	5,651,037円
O n e グローバル最適化バランス（安定型）<ラップ向け>	1,042,539円
O n e グローバル最適化バランス（成長型）<ラップ向け>	29,726,754円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー 2 0 7 0）	41,699円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2 0 1 9 - 1 2 （適格機関投資家限定）	1,986,849円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2 0 2 0 - 0 6 （適格機関投資家限定）	1,964,461円
マルチアセット・インカム戦略ファンド 2 0 - 0 8 （適格機関投資家限定）	2,656,967円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2 0 2 0 - 0 9 （適格機関投資家限定）	1,158,481円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2 0 2 1 - 0 3 （適格機関投資家限定）	404,731円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ 2 0 2 1 - 0 4 （適格機関投資家限定）	5,059,678円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２１－０６（適格機関投資家限定）	92,609,788円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	1,340,606円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	85,890,626円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）２０２２－１０（適格機関投資家限定）	359,385,111円
予兆モデル活用型戦略ファンド２０２４－０１（適格機関投資家限定）	4,468,050円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）２０２４－０５（適格機関投資家限定）	363,541,380円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	102,134,834円
AMO n e マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	2,168,588円
D I A Mワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,381,940円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	29,381,715円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	3,285,101円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（F O F s 用）（適格機関投資家専用）	3,458,466円
D I A Mグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	31,370,493円
D I A Mグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	58,116,551円
D I A M国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,433,807円
D I A M国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,213,781円
D I A M国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,903,301円
D I A M国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	77,275円
D I A M世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	516,872円
D I A M世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,500,268円
D I A Mバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	229,026,002円
D I A Mバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	355,587,544円
D I A Mバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,104,297,636円
D I A Mグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	8,612,519円
D I A Mグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	12,745,738円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	120,112,935円
D I A M世界アセットバランスファンドＶＡ（適格機関投資家向け）	23,782,075円
D I A M世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	50,709円
D I A M世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	108,857,714円
D I A M世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,909,262円
D I A M世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	25,445,504円
D I A M世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	53,569,367円
D I A M世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	114,595,179円
D I A M世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,622,767円
D I A M国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,043,047円
動的パッケージファンド＜D C 年金＞	15,853,719円
コア資産形成ファンド	7,268,402円
MHAMトピックスファンド	780,647,922円

MHAM TOPIXファンドVA (適格機関投資家専用)	43,736,527円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	1,762,766,017円
MHAM日本株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	2,430,887,909円
計	120,758,959,585円
2. 受益権の総数	120,758,959,585口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2024年9月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2024年9月11日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
先物取引				
買建	5,572,905,000	—	5,616,255,000	43,350,000
合計	5,572,905,000	—	5,616,255,000	43,350,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

(1口当たり情報に関する注記)

	2024年9月11日現在
1口当たり純資産額	4.4692円
(1万口当たり純資産額)	(44,692円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2024年9月30日現在

I 資産総額	11,210,629,770円
II 負債総額	22,232,770円
III 純資産総額（I－II）	11,188,397,000円
IV 発行済数量	6,193,063,465口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.8066円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2024年9月30日現在

I 資産総額	573,990,885,057円
II 負債総額	558,054,051円
III 純資産総額（I－II）	573,432,831,006円
IV 発行済数量	121,570,404,385口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	4.7169円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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はない場合には、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たときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2024年9月30日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2024年9月30日現在）

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9月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,454,341,224,045
追加型株式投資信託	773	16,698,766,641,729
単位型公社債投資信託	22	35,408,258,167
単位型株式投資信託	194	1,059,778,361,537
合計	1,015	19,248,294,485,478

3【委託会社等の経理状況】

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

独立監査人の監査報告書

2024年5月23日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 森 重 俊 寛
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 長 谷 川 敬
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 稲 葉 宏 和
業務執行社員

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　　上

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

(注2) 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38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	33,770	41,183
金銭の信託	29,184	28,143
未収委託者報酬	16,279	19,018
未収運用受託報酬	3,307	3,577
未収投資助言報酬	283	315
未収収益	15	6
前払費用	1,129	1,510
その他	2,377	2,088
流動資産計	86,346	95,843
固定資産		
有形固定資産	1,127	1,093
建物	※1 1,001	※1 918
器具備品	※1 118	※1 130
リース資産	※1 7	※1 5
建設仮勘定	－	39
無形固定資産	5,021	4,495
ソフトウェア	3,367	2,951
ソフトウェア仮勘定	1,651	1,543
電話加入権	2	0
投資その他の資産	9,768	8,935
投資有価証券	182	184
関係会社株式	5,810	4,447
長期差入保証金	775	768
繰延税金資産	2,895	3,406
その他	104	128
固定資産計	15,918	14,524
資産合計	102,265	110,368

(単位：百万円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,481	1,982
リース債務	1	1
未払金	7,246	8,970
未払収益分配金	0	1
未払償還金	-	0
未払手数料	7,005	8,246
その他未払金	240	721
未払費用	7,716	8,616
未払法人税等	1,958	3,676
未払消費税等	277	1,497
賞与引当金	1,730	1,927
役員賞与引当金	48	52
流動負債計	20,460	26,725
固定負債		
リース債務	6	4
退職給付引当金	2,654	2,719
時効後支払損引当金	108	73
固定負債計	2,769	2,796
負債合計	23,230	29,521
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金	19,552	19,552
資本準備金	2,428	2,428
その他資本剰余金	17,124	17,124
利益剰余金	57,481	59,294
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	57,358	59,170
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	25,678	27,490
株主資本計	79,034	80,846
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△0	△0
評価・換算差額等計	△0	△0
純資産合計	79,034	80,846
負債・純資産合計	102,265	110,368

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

(単位：百万円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本 合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573
当期変動額									
剰余金の配当							△12,360	△12,360	△12,360
当期純利益							13,821	13,821	13,821
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	－	－	－	－	－	－	1,461	1,461	1,461
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	△0	△0	77,573
当期変動額			
剰余金の配当			△12,360
当期純利益			13,821
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	△0	△0	△0
当期変動額合計	△0	△0	1,461
当期末残高	△0	△0	79,034

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本 合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034
当期変動額									
剰余金の配当							△11,040	△11,040	△11,040
当期純利益							12,852	12,852	12,852
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	－	－	－	－	－	－	1,812	1,812	1,812
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	27,490	59,294	80,846

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	△0	△0	79,034
当期変動額			
剰余金の配当			△11,040
当期純利益			12,852
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	△0	△0	△0
当期変動額合計	△0	△0	1,812
当期末残高	△0	△0	80,846

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(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 (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
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	(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 (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。 (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。
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	(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。 (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。 (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。 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。 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。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。
6. 収益及び費用の計上基準	当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。

(1) 委託者報酬

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

(2) 運用受託報酬

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

(3) 投資助言報酬

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

(4) 成功報酬

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

注記事項

(貸借対照表関係)

※1. 有形固定資産の減価償却累計額

(百万円)

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

(損益計算書関係)

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

(百万円)

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

※2. 減損損失

当事業年度において、以下の資産について減損損失を計上しました。

(百万円)

場所	用途	種類	減損損失
本社	事業用資産	ソフトウェア仮勘定	231

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

(株主資本等変動計算書関係)

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

2024年6月17日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生（予定）日
2024年6月17日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	10,280	257,000	2024年3月31日	2024年6月18日
	A種種類株式					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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います。

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38期（2023年3月31日現在）

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

第39期（2024年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	28,143	28,143	—
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	—
資産計	28,145	28,145	—

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

（注2）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第38期（2023年3月31日現在）

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

第39期（2024年3月31日現在）

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	41,183	—	—	—
(2) 金銭の信託	28,143	—	—	—
(3) 未収委託者報酬	19,018	—	—	—
(4) 未収運用受託報酬	3,577	—	—	—
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	—	1	—	—
合計	91,923	1	—	—

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

第38期（2023年3月31日現在）

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

第39期（2024年3月31日現在）

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 金銭の信託	—	28,143	—	28,143
(2) 投資有価証券 其他有価証券	—	1	—	1
資産計	—	28,145	—	28,145

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

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

投資有価証券

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

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

（百万円）

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（第38期の貸借対照表計上額5,810百万円、第39期の貸借対照表計上額4,447百万円）については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

第38期（2023年3月31日現在）

(百万円)

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

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

第39期（2024年3月31日現在）

(百万円)

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

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

該当はありません。

4. 減損処理を行った有価証券

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

当事業年度において、有価証券について1,362百万円（関係会社株式1,362百万円）減損処理を行っております。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)	
	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,576	2,698
勤務費用	279	296
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	31	9
退職給付の支払額	△191	△246
退職給付債務の期末残高	2,698	2,760

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(百万円)	
	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,698	2,760
未積立退職給付債務	2,698	2,760
未認識数理計算上の差異	△44	△40
未認識過去勤務費用	0	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,654	2,719
退職給付引当金	2,654	2,719
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,654	2,719

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

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

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、前事業年度において24百万円、当事業年度において6百万円を営業外費用に計上しております。

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00%～3.56%	1.00%～3.56%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度103百万円、当事業年度104百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
法定実効税率	30.62 %	30.62 %
（調整）		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△3.69 %	△1.44 %
その他	△0.06 %	△0.14 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.87 %	29.04 %

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

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

(2) 損益計算書項目

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
営業収益	一百万円	一百万円
営業利益	△8,039百万円	△7,649百万円
経常利益	△8,039百万円	△7,649百万円
税引前当期純利益	△8,039百万円	△7,649百万円
当期純利益	△6,744百万円	△6,474百万円
1株当たり当期純利益	△168,617円97銭	△161,850円28銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	4,228百万円	3,837百万円

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

収益の構成は次の通りです。

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

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

属性	会社等の 名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託 の販売代 行手数料	8,140	未払 手数料	1,870
	みずほ証券株式 会社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	—	—	当社設定 投資信託 の販売	投資信託 の販売代 行手数料	16,655	未払 手数料	3,137

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	1,975,862円96銭	2,021,173円74銭
1株当たり当期純利益金額	345,535円19銭	321,310円79銭

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

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

	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第39期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益金額	13,821百万円	12,852百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	—	—
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	13,821百万円	12,852百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

約 款

追加型証券投資信託 MHAM TOPIXオープン
運用の基本方針

約款第17条の規定に基づき、委託者の定める運用の基本方針は次のものとします。

(1) 基本方針

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

(2) 運用方法

①投資対象

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

②投資態度

1. 主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券に投資し、東証株価指数（TOPIX、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
2. 現物株への投資よりTOPIX先物等を活用する方が有利と認められるときは、TOPIX先物等を活用することがあります。
3. 株価指数等の先物取引を含む株式の実質投資割合は、原則信託財産の純資産総額の範囲内となるよう運用を行いますが、一時的に株式の実質投資総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質投資総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。
4. 組入対象銘柄は、わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄とします。ただし、流動性に著しく欠ける銘柄や信用リスクが高いと判断される銘柄等は組入れません。
5. 現物株式の実質組入比率（信託財産に属する他の投資信託受益証券の時価総額に、当該他の投資信託の信託財産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額と、信託財産に属する株式の時価総額との合計額が信託財産総額に占める割合）は、通常の状態では50%以上とすることを基本とします。
6. 非株式（株式以外の資産）への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
7. 上記1から6について、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。
8. 国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
9. 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引および金利先渡取引を行うことができます。

(3) 運用制限

- ①株式の実質投資割合には、制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資は、行いません。
- ③新株引受権証券等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- ④同一銘柄の転換社債等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ⑤同一銘柄の新株引受権証券等への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ⑥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。
- 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10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人

人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(4) 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行います。

① 分配対象収益の範囲

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

② 分配対象収益についての分配方針

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

③ 留保金の運用方針

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

追加型証券投資信託
MHAM TOPIXオープン 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、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

<信託事務の委託>

第1条の2 受託者は、信託法第26条第1項に基づく信託事務の委任として、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2条 委託者は、金5百万～15百万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

<追加信託金限度額>

第3条 委託者は、金2,000億円を限度として信託金を追加することができるものとし、追加信託が行われたときは、受託者は、その引受けを証する書面を委託者に交付します。

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4条の1 この信託の期間は、信託契約締結日から第46条第7項、第47条、第48条第1項、第49条第1項および第51条第2項の規定による信託終了の日までとします。

②（削除）

<受益権の取得申込みの勧誘の種類>

第4条の2 この信託に係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5条 この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6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。

<受益権の分割および再分割>

第6条 委託者は、第2条に規定する信託によって生じた受益権については、これを5百万～15百万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託の都度、第7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、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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。

<追加信託金の価額および口数、基準価額の計算方法>

第7条 追加信託金は、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た額とします。

②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く。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

③（削除）

＜信託日時の異なる受益権の内容＞

第8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9条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資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。）及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6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。

④委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行われたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預りではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行うものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日にかかる収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、委託者の指定する証券会社（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。以下同じ。）および登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）（以下、両者を総称して「指定販売会社」といいます。）ならびに保護預り会社または第44条に規定する委託者の指定する口座管理機関に当該申請の手続きを委任することができます。

＜受益権の設定に係る受託者の通知＞

第9条の2 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

<受益権の申込単位および価額>

第10条 指定販売会社は、第6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、1口を最低単位として個別に申込単位を設定し、取得の申込みに応じることができるものとします。

②委託者は、第6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、1万口以上1万口単位をもって取得の申込みに応じることができるものとします。

③前2項の取得申込者は委託者または指定販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設された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係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、委託者（第44条の委託者の指定する口座管理機関を含みます。）または指定販売会社は、当該取得申込みの代金（第4項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。

④第1項および第2項の場合の受益権の価額は、取得申込日の基準価額に、手数料および当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込みに係る取得価額は、1口につき1円とします。

⑤前項の手数料の額は、委託者または指定販売会社がそれぞれ別に定めるものとします。

⑥第4項の規定にかかわらず、受益者が第43条第2項の規定に基づいて収益分配金の再投資を行う場合の受益権の価額は、原則として、第36条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。

<受益証券の券種>

第11条 （削除）

<受益権の譲渡に係る記載または記録>

第12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係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、当該譲渡に係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はない場合には、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係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え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13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。

<受益証券の再交付>

第14条 （削除）

<毀損した場合等の再交付>

第15条 （削除）

<受益証券の再交付の費用>

第16条 （削除）

<運用の基本方針>

第17条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがってその指図を行います。

<運用の指図範囲>

第18条 委託者は、信託金を、主として、アセットマネジメントOne 株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券および次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

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

②委託者は、信託金を前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

③第1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には、委託者は信託金を、前項に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

④委託者は取得時において信託財産に属する新株引受権証券等の時価総額とマザーファンドに属する新株引受権証券等の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

⑤前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの純資産総額に占める新株引受権証券等の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

<受託者の自己または利害関係人等との取引>

第18条の2 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、第18条第1項および第2項に定める資産への投資等を行うことができます。

②前項の取扱い、第21条、第22条ないし第24条、第26条、第32条、第33条における委託者の指図による取引についても同様とします。

<投資する株式等の範囲>

第19条 委託者が投資することを指図する株式および新株引受権証券等は、証券取引所（「証券取引所」とは、金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場（以下「取引所」といいます。）のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場（上場予定を含みます。）されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式および新株引受権証券等についてはこの限りではありません。

<同一銘柄の株式等への投資制限>

第20条 （削除）

<信用取引の指図範囲>

第21条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお当該売り付けの決済については、株券の引き渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

②前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、且つ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

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

<信用リスク集中回避のための投資制限>

第21条の1の2 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

<デリバティブ取引等に係る投資制限>

第21条の2 委託者は、デリバティブ取引等（デリバティブ取引とは、金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買および商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。）を含みます。以下「デリバティブ取引等」といいます（ただし、この信託において取引可能なものに限り、以下同じ。）。）について、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

<先物取引等の運用指図>

第22条 委託者は、わが国の証券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。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

②委託者は、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

<スワップ取引の運用指図・目的・範囲>

第23条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

②スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第4条の1に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

④委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<金利先渡取引の運用指図・目的・範囲>

第24条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。

②金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として第4条の1に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約可能なものについてはこの限りではありません。

③金利先渡取引の評価は、当該取引の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

④委託者は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<同一銘柄の転換社債等への投資制限>

第25条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債（両者を総称して「転換社債等」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債等の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

②前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの純資産総額に占める当該転換社債等の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

<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および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価評価額を超えないものとします。
2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額を超えないものとします。
- 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、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受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す。）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係る実績等に照らし、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（裁量性のないものに限ります。）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. 信託財産の保存に係る業務
 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係る業務
 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

<有価証券の保管>

第28条 （削除）

<混蔵寄託>

第29条 金融機関または証券会社等（証券会社および外国の法令に準拠して設立された法人で証券会社に類する者をいいます。以下同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または証券会社等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または証券会社等の名義で混蔵寄託できるものとします。

<一括登録>

第30条 （削除）

<信託財産の登記等および記載等の留保等>

第31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。

<有価証券の売却および再投資の指図>

- 第32条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券にかかる信託契約の一部解約および有価証券の売却等の指図ができます。
- ②委託者は、前項の規定による一部解約金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、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。

<資金の借入れ>

- 第33条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- ②一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
 - ③収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
 - ④借入金の利息は信託財産中より支弁します。

<損益の帰属>

- 第34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。

<受託者による資金の立替え>

- 第35条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、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信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、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、その都度別にこれを定めます。

<計算期間>

- 第36条 この信託の計算期間は、毎年3月11日から翌年3月10日までとすることを原則とします。ただし、

第1期計算期間は平成10年10月22日から平成11年3月10日までとします。

- ②前項の規定にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日で該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

<信託財産に関する報告>

第37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。

<信託事務の諸費用および監査費用>

第38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(以下「諸経費」といいます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ②信託財産に係る監査費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

<信託報酬等>

第39条 委託者および受託者の受ける報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

- ②前項の報酬額は、当該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60の率を乗じて得た金額とし、委託者と受託者との配分については、別に定めます。
- ③前項の報酬額に係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。

<利益の処理方法>

第40条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理するものとします。

1. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額(以下「配当等収益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配に充てるため、その一部を分配準備積立金として積立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。ただし、分配後に残額があるときは、これを次期以降の分配に充てるため、分配準備積立金として積立てることができます。

- ②毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

<追加信託金または一部解約金の計理処理>

第41条 (削除)

<収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責>

第42条 受託者は、収益分配金については第43条第1項に規定する支払開始日および第43条第2項に規定する交付開始前までに、償還金(信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。)については第43条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金(第46条第3項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。)については第43条第4項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ②受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金

を払い込んだ後は、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、償還金および一部解約金の支払い＞

第43条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者または指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。なお、平成19年1月4日以降においても、第45条に規定する時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引き換えに受益者に支払います。

②前項の規定にかかわらず、別に定める自動けいぞく投資約款に基づく契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌日に収益分配金が指定販売会社に交付されます。この場合、指定販売会社は受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第9条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者または指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

④一部解約金は、第46条第1項の受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として5営業日目から当該受益者に支払います。

⑤前各項（第2項を除く。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとします。ただし、委託者が自ら募集したものについての支払いは、委託者の営業所において行うものとします。

⑥収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

＜委託者の自らの募集に係る受益権の口座管理機関＞

第44条 委託者は、委託者の自らの募集に係る受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または登録等に関する業務を委任することができます。

＜収益分配金および償還金の時効＞

第45条 受益者が、収益分配金については第43条第1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、ならびに信託終了による償還金については第43条第3項に規定する支払開始日から10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。

＜信託の一部解約＞

第46条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に、1口を最低単位として委託者または指定販売会社が個別に定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

②委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

なお、前項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

- ③前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の基準価額とします。
- ④平成19年1月4日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者または指定販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日前に行われる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行うものとします。
- ⑤委託者は、証券取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。
- ⑥前項により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして第3項の規定に準じて算定した価額とします。
- ⑦委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が5億口を下ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。
- ⑧委託者は、前項の事項を行おうとする時は、その手続きについて第47条の規定を準用します。

<質権口記載又は記録の受益権の取り扱い>

第46条の2 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金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。

<信託契約の解約>

- 第47条 委託者は、信託期間中にこの信託契約を解約することが受益者のため有利にあると認めたとき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、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
 - ③前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
 - ④前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。
 - ⑤委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
 - ⑥第3項から前項までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項の一定の期間が一月を下らずにこの公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

<信託契約に関する監督官庁の命令>

- 第48条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- ②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第52条の1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、この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条の1第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者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、事業の全部又は一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

②委託者は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

③（削除）

<受託者の辞任および解任に伴う取扱い>

第51条 受託者は、委託者の承認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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。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1の規定にしたがい、新受託者を選任します。

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

<信託約款の変更>

第52条の1 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、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

②委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。

⑤委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

<反対者の買取請求権>

第52条の2 第47条に規定する信託契約の解約（第46条第8項において準用する場合を含みます。）または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第47条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、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取るべき旨を請求することができます。

②前項の買取請求の取扱いについては、委託者、受託者の協議により決定するものとします。

<運用報告書に記載すべき事項の提供>

第52条の3 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供します。

- ②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

<公告>

第53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。

<信託約款に関する疑義の取扱い>

第54条 この信託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。

(付則)

第1条 この信託約款において、「自動けいぞく投資契約」とは、この信託について受益権取得申込者と指定販売会社が締結する「自動けいぞく投資契約」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合、「自動けいぞく投資契約」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第43第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。なお、平成12年3月31日以前の取得申込みにかかる受益権の信託時の受益権の価額は、委託者が計算する平成12年3月31日の平均信託金（信託金総額を総口数で除して得た額）とみなすものとします。

第3条 平成18年12月29日現在の信託約款第9条（受益証券の発行）、第11条（受益証券の種類）から第16条（受益証券の再交付の費用）の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、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には、なおその効力を有するものとします。

第4条 第24条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 平成10年10月22日

親投資信託
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
約款

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

（１）投資対象

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

（２）投資態度

- １）主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ２）最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。
- ３）株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- ４）株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
- ５）非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。
- ６）国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- ７）信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

（３）投資制限

- １）株式への投資割合には、制限を設けません。
- ２）有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行います。
- ３）金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第18条の範囲で行います。
- ４）デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- ５）外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
- ６）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、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。