



One DC 国内株式インデックス ファンド

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「One DC 国内株式インデックスファンド」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11月7日に関東財務局長に提出しており、2024年11月8日にその効力が生じております。

■「One DC 国内株式インデックスファンド」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】	42
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	113
第三部【委託会社等の情報】	115
第1【委託会社等の概況】	115
約款	144

第一部【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

One DC 国内株式インデックスファンド

(以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。)

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

(3) 【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4) 【発行（売出）価格】

お申込日の基準価額※とします。

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

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

<基準価額の照会方法等>

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

ただし、収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2024年11月8日から2025年5月7日まで

ただし、お申込みの取扱いは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

※販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

(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】

お申込みの方法

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

します。

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

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

○振替受益権について

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

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

(参考)

◆投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

- ①当ファンドは、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ②当ファンドの信託金の限度額は、1兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

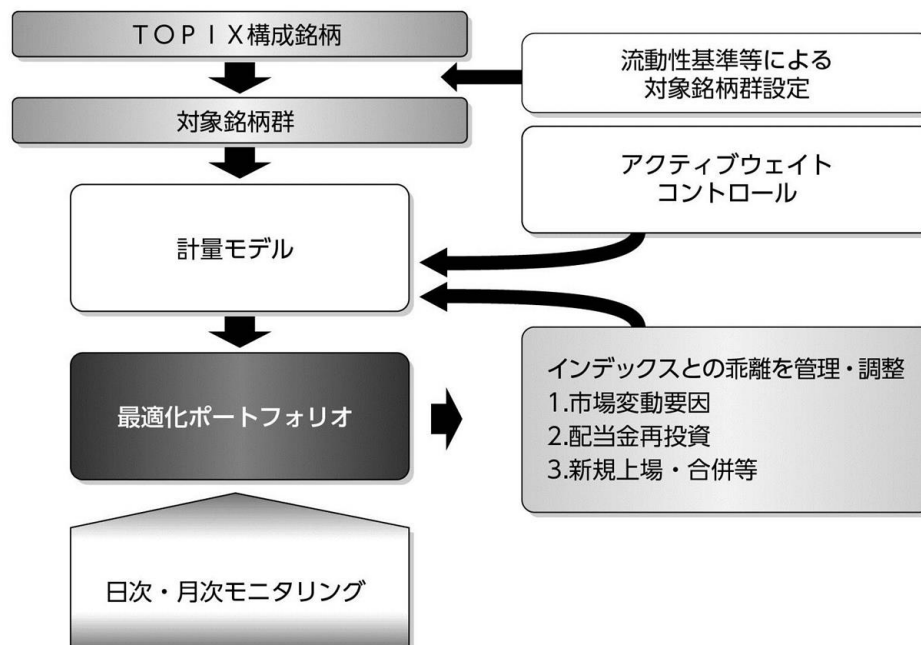
<ファンドの特色>

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

指数の著作権等

- 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。
- ②JPX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。
- ③JPX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。
- ④JPX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。
- ⑥JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ⑦JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（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。

- 2** 流動性基準等により投資対象銘柄を設定し、インデックス(東証株価指数(TOPIX)(配当込み))とポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。



- 3** 株式(株価指数先物取引を含みます。)の実質組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。

■ 分配方針

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

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

○商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国 内	株 式	インデックス型
	海 外	債 券	
		不動産投信	
追加型投信	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

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

○属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

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

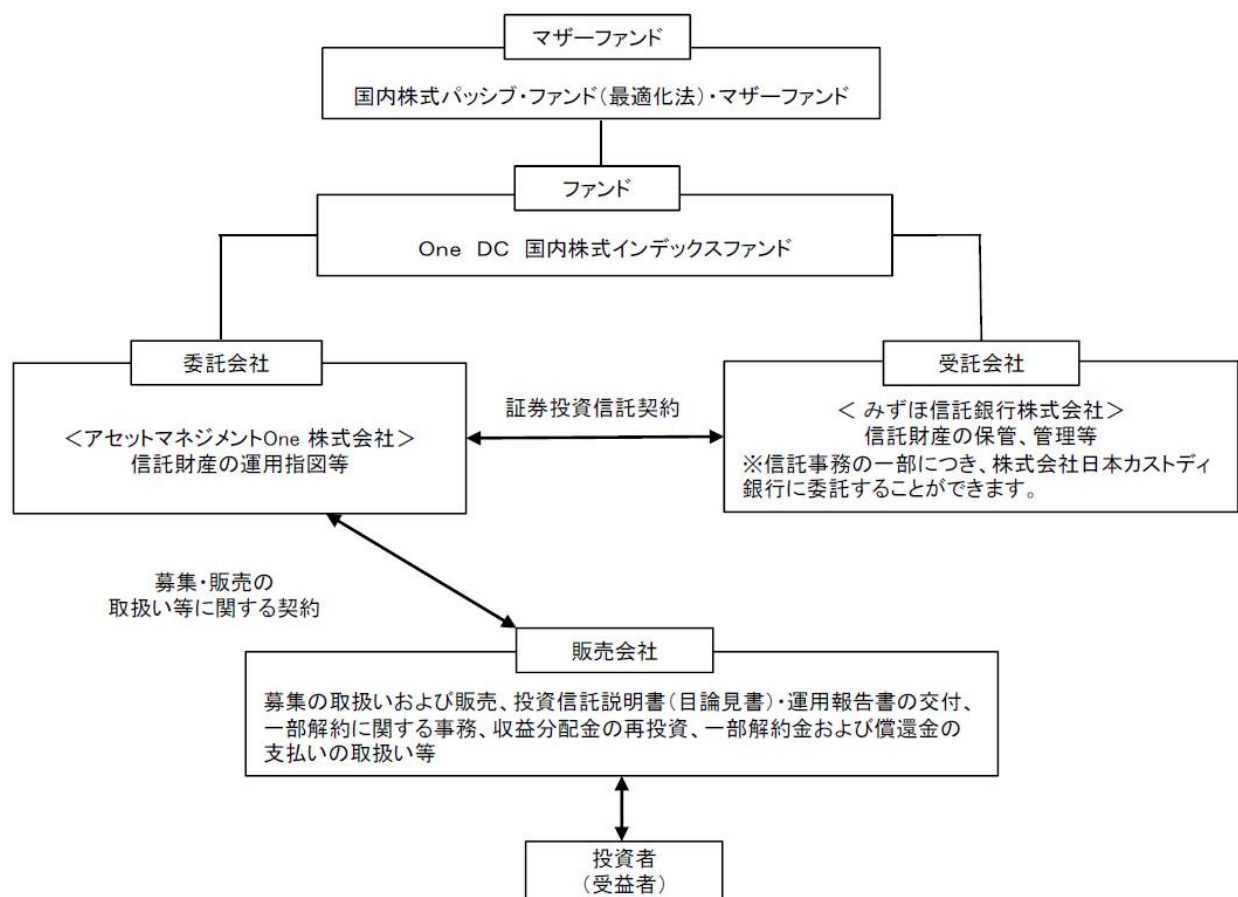
※上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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

(2) 【ファンドの沿革】

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

(3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

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

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

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

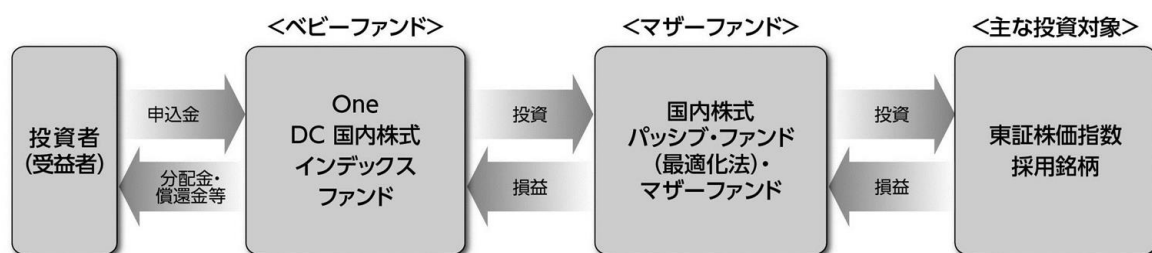
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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

- ファミリーファンド方式とは●

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



○委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2024年8月30日現在）

委託会社の沿革

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

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株※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】

イ. 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）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

ロ. 投資対象

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

ハ. 投資態度

- ・主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券に投資し、東証株価指数（T O P I X）（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。
- ・株式（株価指数先物取引を含みます。）の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- ・株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。

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

(2)【投資対象】

1. 投資の対象とする資産（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

- b. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

2. 有価証券の指図範囲 (約款第17条第1項)

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

- 1) 株券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1)～10)の証券または証書の性質を有するもの
- 12) 外国貸付債権信託受益権（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 13) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 14) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 15) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 16) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 17) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの

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

3. 金融商品の指図範囲（約款第17条第2項）

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

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

4. 上記2. の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3. の1) から4) までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。（約款第17条第3項）

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

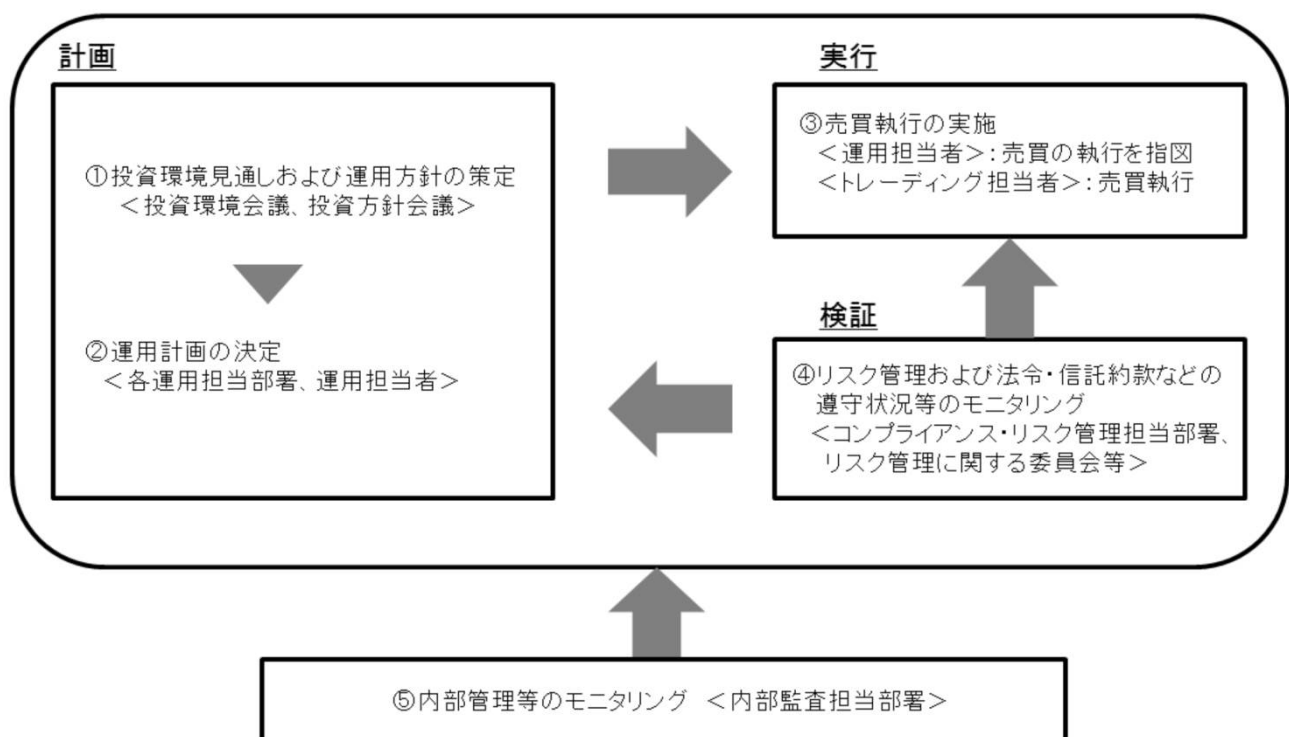
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。
投資態度	1. 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、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。
主な投資制限	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。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



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8月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

①収益分配方針

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

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保金の運用方針

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

②収益の分配方式

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

1. 信託財産に属する配当等収益（利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2. 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

3. 上記1. および2. におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

2) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資されます。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5) 【投資制限】

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

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

4) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（約款「運用の基本方針」 2. 運用方法（3）投資制限）

5) 投資する株式等の範囲（約款第20条）

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

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

6) 信用取引の指図範囲（約款第21条）

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

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

1. 信託財産に属する株券

2. 株式分割により取得する株券

3. 有償増資により取得する株券

4. 売り出しにより取得する株券

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

7) 先物取引等の運用指図（約款第22条）

(a) 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲

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

- (b) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (c) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

8) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第23条)

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (b) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (c) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (d) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

9) デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第23条の2)

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

10) 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第24条)

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1)～2)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
 - 1) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - 2) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (b) 上記(a)1)2)で定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (c) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入の指図を行うものとします。

11) 特別な場合の外貨建資産への投資制限(約款第26条)

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

12) 外貨為替予約の指図および範囲(約款第27条)

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

- (b) 上記(a)の予約取引の指図は、信託財産に属する為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドに信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (c) 上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

13) 資金の借入れ（約款第34条）

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

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

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

3 【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

○株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

○信用リスク

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

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

○当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要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。

○収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。

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

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

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

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

○資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

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

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

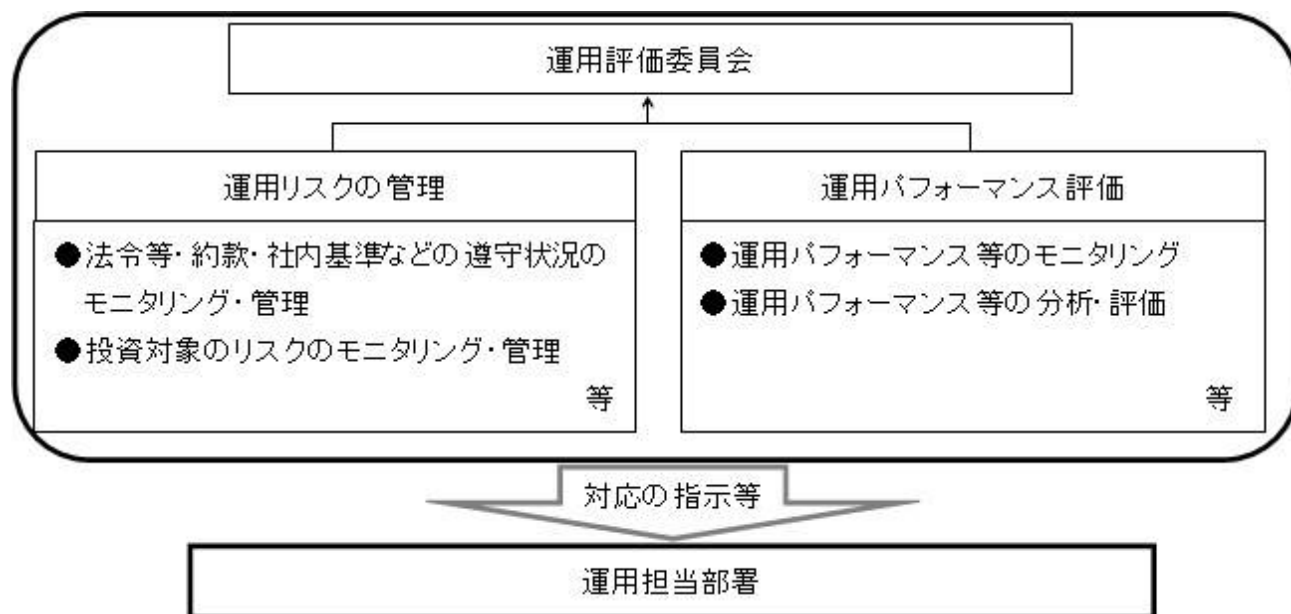
○注意事項

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

<リスク管理体制>

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

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



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

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

<参考情報>

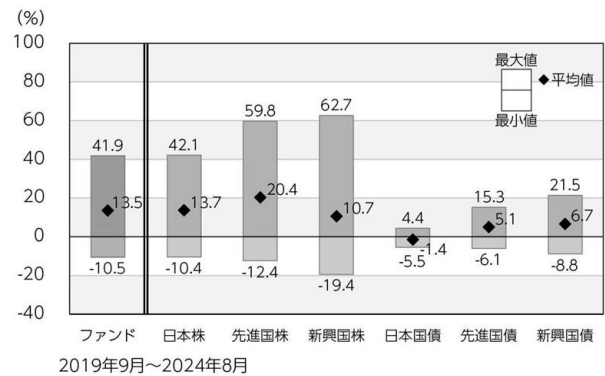
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.154%（税抜0.14%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.06%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.06%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.02%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

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

◆税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

イ. 信託財産留保額

ありません。

ロ. その他の費用

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

- ① 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。
- ② 監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎年8月7日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。
- ③ 有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に関する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。
- ④ マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相

当額および外貨建資産の保管等に関する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

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（配当控除の適用なし）のいずれかを選択することもできます。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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。

○法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

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

※上記は、2024年8月末現在のものです。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
0.16%	0.15%	0.00%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2023年2月8日～2024年2月7日

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

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

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

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2024年8月30日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2024年8月30日現在

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

その他資産の投資状況

2024年8月30日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

(2)【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2024年8月30日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年8月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2024年8月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,971,700	3,243.28 25,854,489,189	2,759.50 21,997,906,150	— —	3.75
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	1,050,200	14,155.09 14,865,684,032	14,200.00 14,912,840,000	— —	2.54
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,994,900	1,415.86 12,735,586,906	1,528.00 13,744,207,200	— —	2.34
4	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,639,500	2,419.85 8,807,052,562	3,572.00 13,000,294,000	— —	2.22
5	キーエンス 日本	株式 電気機器	150,100	64,310.37 9,652,987,618	69,610.00 10,448,461,000	— —	1.78
6	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,110,300	5,949.27 6,605,482,998	9,047.00 10,044,884,100	— —	1.71
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,034,300	7,848.15 8,117,349,236	9,550.00 9,877,565,000	— —	1.68
8	三菱商事 日本	株式 卸売業	3,046,700	2,823.87 8,603,509,587	3,013.00 9,179,707,100	— —	1.56
9	信越化学工業 日本	株式 化学	1,347,000	5,852.78 7,883,697,696	6,422.00 8,650,434,000	— —	1.47
10	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,066,700	6,757.19 7,207,902,143	7,706.00 8,219,990,200	— —	1.40
11	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	317,500	28,784.84 9,139,189,430	25,805.00 8,193,087,500	— —	1.40
12	第一三共 日本	株式 医薬品	1,310,300	4,592.51 6,017,574,938	6,108.00 8,003,312,400	— —	1.36
13	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,442,100	3,992.45 5,757,516,467	5,506.00 7,940,202,600	— —	1.35
14	任天堂 日本	株式 その他製品	946,900	8,317.19 7,875,556,230	7,902.00 7,482,403,800	— —	1.27
15	三井物産 日本	株式 卸売業	2,376,700	2,959.63 7,034,166,158	3,123.00 7,422,434,100	— —	1.26
16	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	44,739,500	181.05 8,100,392,860	155.70 6,965,940,150	— —	1.19
17	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	741,900	6,779.22 5,029,503,785	8,405.00 6,235,669,500	— —	1.06
18	HOYA 日本	株式	295,200	18,437.71	20,595.00	—	1.04

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2024年8月30日現在

種類	投資比率 (%)
株式	97.59
合計	97.59

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2024年8月30日現在

業種	国内／外国	投資比率 (%)
電気機器	国内	17.13
銀行業		7.39
輸送用機器		7.33
情報・通信業		7.28
卸売業		7.14
化学		5.56
機械		5.22
医薬品		4.98
サービス業		4.66
小売業		4.20

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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8月30日現在

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

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

(注2) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場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8月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配付) (円)
第8計算期間末 (2015年2月9日)	8,261	8,261	1.0056	1.0056
第9計算期間末 (2016年2月8日)	11,225	11,225	0.9911	0.9911
第10計算期間末 (2017年2月7日)	13,968	13,968	1.1107	1.1107
第11計算期間末 (2018年2月7日)	22,544	22,544	1.3067	1.3067
第12計算期間末 (2019年2月7日)	30,214	30,214	1.1958	1.1958
第13計算期間末 (2020年2月7日)	37,717	37,717	1.3513	1.3513
第14計算期間末 (2021年2月8日)	49,849	49,849	1.5351	1.5351
第15計算期間末 (2022年2月7日)	65,141	65,141	1.5668	1.5668
第16計算期間末 (2023年2月7日)	83,858	83,858	1.6554	1.6554
第17計算期間末 (2024年2月7日)	137,089	137,089	2.1789	2.1789
2023年8月末日	113,233	—	1.9726	—
9月末日	116,291	—	1.9827	—
10月末日	115,873	—	1.9231	—
11月末日	123,011	—	2.0269	—
12月末日	124,556	—	2.0223	—
2024年1月末日	136,621	—	2.1800	—
2月末日	146,266	—	2.2871	—
3月末日	154,144	—	2.3881	—
4月末日	155,613	—	2.3665	—
5月末日	159,653	—	2.3929	—
6月末日	163,384	—	2.4273	—
7月末日	164,332	—	2.4139	—
8月末日	162,650	—	2.3439	—

②【分配の推移】

	1口当たりの分配金 (円)
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

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

(注) 収益率は期間騰落率です。

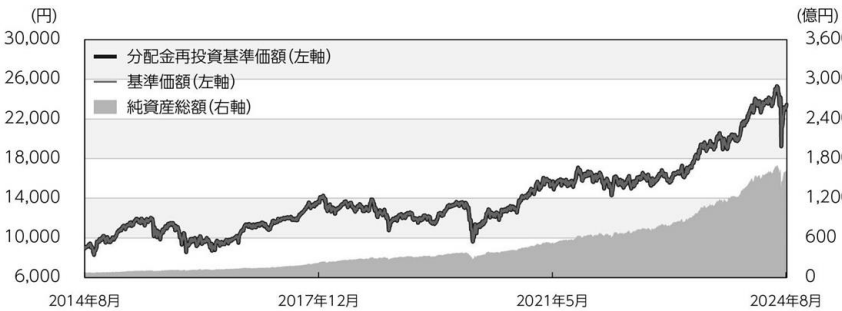
(4) 【設定及び解約の実績】

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

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

データの基準日:2024年8月30日

基準価額・純資産の推移 《2014年8月29日～2024年8月30日》



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2007年9月27日)

分配の推移(税引前)

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

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

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

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

資産の状況

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

その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.34

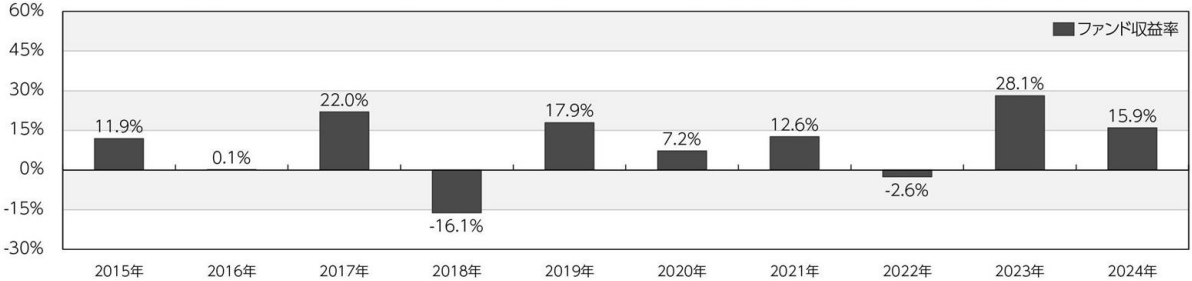
株式組入上位5業種

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

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.75
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.54
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.34
4	日立製作所	株式	日本	電気機器	2.22
5	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.78
6	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.71
7	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.68
8	三菱商事	株式	日本	卸売業	1.56
9	信越化学工業	株式	日本	化学	1.47
10	伊藤忠商事	株式	日本	卸売業	1.40

年間収益率の推移(暦年ベース)



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

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みの方法

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

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

お申込価額（発行価格）

お申込日の基準価額※とします。

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

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

<基準価額の照会方法等>

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ

・ 委託会社への照会

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

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

お申込単位

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

ただし、収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位

お申込手数料

ありません。

払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

解約のお申込み方法

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

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

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

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

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

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

解約価額

解約価額は、解約請求受付日の基準価額とします。

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

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日※における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

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

（2）【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

信託期間は2007年9月27日から無期限です。

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

(4) 【計算期間】

a. 計算期間は原則として毎年2月8日から翌年2月7日までとします。

b. 上記a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5) 【その他】

イ. 償還規定

- a. 委託会社は、信託終了前にこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- b. 委託会社は上記a.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- c. 上記a.につき、上記b.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- d. 委託会社は信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- e. 上記b.～d.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であつて、上記b.の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社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、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更」の規定に従い、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. 上記b. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ロ. 信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、上記a. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a. ～e. の規定に従います。
- g. 上記c. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ハ. 関係法人との契約の更改

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

ニ. 公告

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

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

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

ホ. 運用報告書

- ・委託会社は、毎年2月7日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

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

4【受益者の権利等】

①収益分配金請求権

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

販売会社は、累積投資約款に基づき、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

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、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）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17期計算期間（2023年2月8日から2024年2月7日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年4月5日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、One DC 国内株式インデックスファンドの2024年2月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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】

【One DC 国内株式インデックスファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

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

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第16期 自 2022年2月8日 至 2023年2月7日	第17期 自 2023年2月8日 至 2024年2月7日
営業収益		
受取利息	1,699	2,789
有価証券売買等損益	4,516,931,857	29,981,192,806
営業収益合計	4,516,933,556	29,981,195,595
営業費用		
支払利息	67,712	130,776
受託者報酬	15,893,277	23,710,119
委託者報酬	95,360,042	142,261,137
その他費用	720,239	997,722
営業費用合計	112,041,270	167,099,754
営業利益又は営業損失（△）	4,404,892,286	29,814,095,841
経常利益又は経常損失（△）	4,404,892,286	29,814,095,841
当期純利益又は当期純損失（△）	4,404,892,286	29,814,095,841
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	202,546,302	2,903,477,530
期首剰余金又は期首欠損金（△）	23,566,324,934	33,200,703,037
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,566,539,046	23,103,644,615
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,566,539,046	23,103,644,615
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,134,506,927	9,042,267,945
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,134,506,927	9,042,267,945
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
分配金	—	—
期末剰余金又は期末欠損金（△）	33,200,703,037	74,172,698,018

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第16期	第17期
	自 2022年2月8日 至 2023年2月7日	自 2023年2月8日 至 2024年2月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替	同左

	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16期 2023年2月7日現在	第17期 2024年2月7日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第16期 2023年2月7日現在	第17期 2024年2月7日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	4,475,281,266	29,746,811,107
合計	4,475,281,266	29,746,811,107

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第16期 2023年2月7日現在	第17期 2024年2月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6554円 (16,554円)	2.1789円 (21,789円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2024年2月7日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファン ド	30,809,632,061	137,084,376,892	
親投資信託受益証券	合計	30,809,632,061	137,084,376,892	
合計			137,084,376,892	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2024年2月7日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,373,197,806
株式	528,947,749,730
派生商品評価勘定	569,122,720
未収配当金	703,427,711
差入委託証拠金	621,359,617
流動資産合計	543,214,857,584
資産合計	543,214,857,584
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	107,310
前受金	491,893,000
未払解約金	592,021,000
流動負債合計	1,084,021,310
負債合計	1,084,021,310
純資産の部	
元本等	
元本	121,842,817,407
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	420,288,018,867
元本等合計	542,130,836,274
純資産合計	542,130,836,274
負債純資産合計	543,214,857,584

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年2月7日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	117,622,712,134円
同期中追加設定元本額	59,907,077,380円
同期中一部解約元本額	55,686,972,107円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOPIXオープン	2,457,094,087円
たわらノーロード 国内株式くらっぷ専用＜	3,281,412,558円
One DC 国内株式インデックスファンド	30,809,632,061円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,610,201,313円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	1,572,967円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	9,370,446円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	21,079,024円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	21,608,149円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	28,800,675円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	17,989,649円
たわらノーロード TOPIX	2,226,070,109円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,698,970,509円
たわらノーロード バランス（堅実型）	49,358,924円
たわらノーロード バランス（標準型）	360,326,830円
たわらノーロード バランス（積極型）	607,683,019円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	2,285,856円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	141,103,494円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	406,039,337円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	347,897,665円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	481,585,965円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	365,246円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,354,848円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	27,592,829円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	4,404,483円

たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	12,596,034円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,412,337,171円
O n e グローバルバランス	41,793,827円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	914,089,354円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3,328,302,555円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3,866,884,412円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	294,884,221円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	964,080,357円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	1,090,311,381円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,196,964円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,070,522,519円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	14,869,106円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国10）	283,994,414円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国20）	332,963,584円
D I A M DC 8資産バランスファンド（新興国30）	563,739,113円
投資のソムリエ	8,462,984,252円
クルーズコントロール	331,322,523円
投資のソムリエ<DC年金>	830,639,366円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	315,192,706円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,094,963,321円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	940,176,992円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,070,818,810円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	79,256,153円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	40,575,661円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	8,224,956円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	177,810,319円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	506,884,540円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,363,308,339円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	230,928,569円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	80,685,240円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	43,107,354円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	26,468,340円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	499,441,883円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	6,256,314円
O n e グローバル最適化バランス（安定型）<ラップ向け>	1,630,752円
O n e グローバル最適化バランス（成長型）<ラップ向け>	32,054,533円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12（適格機関投資家限定）	1,852,453円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06（適格機関投資家限定）	1,973,535円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08（適格機関投資家限定）	1,168,057円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09（適格機関投資家限定）	1,140,141円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03（適格機関投資家限定）	21,514,902円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ 2021-04（適格機関投資家限定）	4,850,093円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）2021-06（適格機関投資家限定）	179,053,363円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09（適格機関投資家限定）	1,676,651円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	82,171,987円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）２０２２－１０（適格機関投資家限定）	373,974,618円
予兆モデル活用型戦略ファンド２０２４－０１（適格機関投資家限定）	3,244,839円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	271,164,256円
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）	13,265,462円
D I A Mワールドバランス２５VA（適格機関投資家限定）	22,573,361円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	42,437,517円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	3,180,848円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（FOF s 用）（適格機関投資家専用）	3,641,563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）	34,738,163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）	67,464,810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）	2,592,057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）	10,658,140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）	3,391,442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）	80,001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）	1,346,974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）	17,271,356円
D I A Mバランスファンド２５VA（適格機関投資家限定）	278,577,105円
D I A Mバランスファンド３７．５VA（適格機関投資家限定）	397,261,876円
D I A Mバランスファンド５０VA（適格機関投資家限定）	1,219,167,945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）	10,308,559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）	14,774,714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）	148,488,928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）	28,546,667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）	53,149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）	157,074,573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）	8,107,544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）	38,324,573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）	100,737,648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）	130,670,328円
D I A M世界バランス２５VA（適格機関投資家限定）	17,344,200円
D I A M国内バランス３０VA（適格機関投資家限定）	7,096,700円
動的パッケージファンド＜DC年金＞	26,832,017円
コア資産形成ファンド	13,890,277円
MHAMトピックスファンド	785,854,154円
MHAM T O P I XファンドVA（適格機関投資家専用）	44,680,531円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	3,152,105,329円
MHAM日本株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	1,885,462,391円
計	121,842,817,407円
2. 受益権の総数	121,842,817,407口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年2月7日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	101,966,767,592

合計	101,966,767,592
----	-----------------

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2024年2月7日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	12,759,467,000	—	13,328,655,000	569,188,000
合計	12,759,467,000	—	13,328,655,000	569,188,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2024年2月7日現在

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

住石ホールディングス	23,200	1,795.00	41,644,000	
日鉄鉱業	8,200	5,150.00	42,230,000	
三井松島ホールディングス	12,100	2,794.00	33,807,400	
I N P E X	758,200	2,024.50	1,534,975,900	
石油資源開発	23,800	6,030.00	143,514,000	
K&Oエナジーグループ	9,300	2,286.00	21,259,800	
ダイセキ環境ソリューション	1,800	1,036.00	1,864,800	
第一カッター興業	5,900	1,470.00	8,673,000	
明豊ファシリティワークス	3,300	943.00	3,111,900	
安藤・間	118,700	1,237.00	146,831,900	
東急建設	64,200	830.00	53,286,000	
コムシスホールディングス	65,500	3,199.00	209,534,500	
ビーアールホールディングス	30,100	372.00	11,197,200	
高松コンストラクショングループ	15,200	2,968.00	45,113,600	
東建コーポレーション	5,200	9,560.00	49,712,000	
ソネック	1,000	946.00	946,000	
ヤマウラ	10,400	1,579.00	16,421,600	
オリエンタル白石	75,800	360.00	27,288,000	
大成建設	134,200	5,592.00	750,446,400	
大林組	512,800	1,431.00	733,816,800	
清水建設	406,600	1,048.00	426,116,800	
飛島建設	14,800	1,511.00	22,362,800	
長谷工コーポレーション	131,600	1,918.00	252,408,800	
松井建設	13,400	850.00	11,390,000	
銭高組	1,000	4,605.00	4,605,000	
鹿島建設	318,000	2,774.00	882,132,000	
不動テトラ	9,900	2,265.00	22,423,500	
大末建設	2,500	1,449.00	3,622,500	
鉄建建設	10,300	2,218.00	22,845,400	
西松建設	27,400	4,458.00	122,149,200	
三井住友建設	106,600	413.00	44,025,800	
大豊建設	4,900	3,835.00	18,791,500	
佐田建設	4,100	725.00	2,972,500	
ナカノフドー建設	4,500	521.00	2,344,500	
奥村組	23,200	5,270.00	122,264,000	
東鉄工業	17,800	2,988.00	53,186,400	
イチケン	1,600	2,409.00	3,854,400	
富士ピー・エス	2,900	445.00	1,290,500	
浅沼組	10,600	4,285.00	45,421,000	
戸田建設	194,100	957.10	185,773,110	
熊谷組	23,700	3,940.00	93,378,000	
北野建設	1,200	3,100.00	3,720,000	
植木組	1,800	1,757.00	3,162,600	
矢作建設工業	19,500	1,458.00	28,431,000	
ピーエス三菱	18,200	1,008.00	18,345,600	
日本ハウスホールディングス	30,500	303.00	9,241,500	
大東建託	52,800	16,985.00	896,808,000	
新日本建設	20,100	1,274.00	25,607,400	
東亜道路工業	5,700	6,870.00	39,159,000	
日本道路	16,800	2,085.00	35,028,000	

東亜建設工業	11,100	3,785.00	42,013,500	
日本国土開発	40,800	529.00	21,583,200	
若築建設	5,000	3,075.00	15,375,000	
東洋建設	36,100	1,257.00	45,377,700	
五洋建設	203,300	810.40	164,754,320	
世紀東急工業	18,400	1,975.00	36,340,000	
福田組	5,400	5,390.00	29,106,000	
日本ドライケミカル	1,600	2,912.00	4,659,200	
住友林業	123,900	4,329.00	536,363,100	
日本基礎技術	3,800	490.00	1,862,000	
巴コーポレーション	8,100	612.00	4,957,200	
大和ハウス工業	396,600	4,400.00	1,745,040,000	
ライト工業	29,500	2,060.00	60,770,000	
積水ハウス	434,900	3,263.00	1,419,078,700	
日特建設	13,700	1,213.00	16,618,100	
北陸電気工事	9,800	1,273.00	12,475,400	
ユアテック	31,600	1,374.00	43,418,400	
日本リーテック	11,200	1,319.00	14,772,800	
四電工	6,000	3,920.00	23,520,000	
中電工	22,300	2,880.00	64,224,000	
関電工	89,900	1,617.00	145,368,300	
きんでん	101,000	2,664.50	269,114,500	
東京エネシス	14,300	1,151.00	16,459,300	
トーエネック	4,700	5,400.00	25,380,000	
住友電設	13,700	3,195.00	43,771,500	
日本電設工業	26,900	2,090.00	56,221,000	
エクシオグループ	70,100	3,306.00	231,750,600	
新日本空調	9,300	2,679.00	24,914,700	
九電工	31,000	5,818.00	180,358,000	
三機工業	31,000	1,878.00	58,218,000	
日揮ホールディングス	141,900	1,746.00	247,757,400	
中外炉工業	4,700	2,664.00	12,520,800	
ヤマト	5,300	993.00	5,262,900	
太平電業	8,900	4,425.00	39,382,500	
高砂熱学工業	38,400	3,655.00	140,352,000	
三晃金属工業	900	4,925.00	4,432,500	
NECネットエスアイ	57,200	2,329.00	133,218,800	
朝日工業社	6,700	3,190.00	21,373,000	
明星工業	27,800	1,136.00	31,580,800	
大気社	16,500	4,485.00	74,002,500	
ダイダン	18,900	1,718.00	32,470,200	
日比谷総合設備	10,400	2,665.00	27,716,000	
ニッポン	43,100	2,294.00	98,871,400	
日清製粉グループ本社	133,100	2,087.00	277,779,700	
日東富士製粉	2,300	5,210.00	11,983,000	
昭和産業	14,000	3,325.00	46,550,000	
鳥越製粉	5,600	708.00	3,964,800	
中部飼料	19,900	1,205.00	23,979,500	
フィード・ワン	21,000	988.00	20,748,000	
東洋精糖	1,200	2,320.00	2,784,000	

日本甜菜製糖	8,400	2,154.00	18,093,600	
DM三井製糖ホールディングス	14,300	3,270.00	46,761,000	
塩水港精糖	8,400	304.00	2,553,600	
ウェルネオシュガー	7,200	2,313.00	16,653,600	
L I F U L L	51,300	192.00	9,849,600	
M I X I	32,200	2,509.00	80,789,800	
ジェイエイシーリクルートメント	54,300	689.00	37,412,700	
日本M&Aセンターホールディングス	239,500	915.60	219,286,200	
メンバーズ	5,100	952.00	4,855,200	
中広	1,000	413.00	413,000	
UTグループ	19,400	2,490.00	48,306,000	
アイティメディア	5,700	1,979.00	11,280,300	
ケアネット	23,100	707.00	16,331,700	
E・Jホールディングス	8,800	1,673.00	14,722,400	
オープンアップグループ	45,100	2,318.00	104,541,800	
コシダカホールディングス	45,000	936.00	42,120,000	
アルトナー	2,800	2,203.00	6,168,400	
パソナグループ	18,200	2,705.00	49,231,000	
CDS	1,700	1,711.00	2,908,700	
リンクアンドモチベーション	43,300	568.00	24,594,400	
エス・エム・エス	52,700	2,461.00	129,694,700	
サニーサイドアップグループ	2,300	595.00	1,368,500	
パーソルホールディングス	1,530,100	237.80	363,857,780	
リニカル	4,300	520.00	2,236,000	
クックパッド	41,100	120.00	4,932,000	
エスクリ	2,700	287.00	774,900	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	3,300	727.00	2,399,100	
森永製菓	61,600	2,830.00	174,328,000	
中村屋	3,500	3,130.00	10,955,000	
江崎グリコ	41,200	4,260.00	175,512,000	
名糖産業	5,700	1,760.00	10,032,000	
井村屋グループ	8,600	2,468.00	21,224,800	
不二家	9,900	2,461.00	24,363,900	
山崎製パン	96,400	3,571.00	344,244,400	
第一屋製パン	1,200	778.00	933,600	
モロゾフ	4,600	4,010.00	18,446,000	
亀田製菓	8,200	4,540.00	37,228,000	
寿スピリッツ	68,100	1,925.00	131,092,500	
カルビー	65,900	3,146.00	207,321,400	
森永乳業	50,300	2,991.50	150,472,450	
六甲バター	10,600	1,324.00	14,034,400	
ヤクルト本社	205,700	3,140.00	645,898,000	
明治ホールディングス	176,500	3,615.00	638,047,500	
雪印メグミルク	34,800	2,304.00	80,179,200	
プリマハム	19,300	2,327.00	44,911,100	
日本ハム	61,900	5,218.00	322,994,200	
林兼産業	2,200	589.00	1,295,800	
丸大食品	14,500	1,689.00	24,490,500	
S F o o d s	15,900	3,230.00	51,357,000	
柿安本店	5,600	2,590.00	14,504,000	

伊藤ハム米久ホールディングス	22,000	4,215.00	92,730,000	
学情	7,700	1,805.00	13,898,500	
スタジオアリス	7,500	2,098.00	15,735,000	
クロスキャット	9,300	1,174.00	10,918,200	
エプコ	1,800	944.00	1,699,200	
システナ	221,900	288.00	63,907,200	
N J S	3,300	2,735.00	9,025,500	
デジタルアーツ	9,300	4,220.00	39,246,000	
日鉄ソリューションズ	25,000	4,975.00	124,375,000	
総合警備保障	251,100	798.70	200,553,570	
キューブシステム	7,800	1,139.00	8,884,200	
いちご	165,900	386.00	64,037,400	
日本駐車場開発	152,400	179.00	27,279,600	
コア	6,500	1,792.00	11,648,000	
カカコム	99,300	1,790.50	177,796,650	
アイロムグループ	6,100	2,057.00	12,547,700	
セントケア・ホールディング	11,000	974.00	10,714,000	
サイネックス	1,100	834.00	917,400	
ルネサンス	11,700	929.00	10,869,300	
ディップ	23,000	2,659.00	61,157,000	
S B Sホールディングス	13,000	2,474.00	32,162,000	
デジタルホールディングス	7,800	1,249.00	9,742,200	
新日本科学	13,700	1,557.00	21,330,900	
キャリアデザインセンター	1,400	1,801.00	2,521,400	
ベネフィット・ワン	52,200	2,097.00	109,463,400	
エムスリー	297,000	1,977.50	587,317,500	
ツカダ・グローバルホールディング	4,300	428.00	1,840,400	
プラス	700	719.00	503,300	
アウトソーシング	96,500	1,740.50	167,958,250	
ウェルネット	5,900	556.00	3,280,400	
ワールドホールディングス	6,800	3,040.00	20,672,000	
ディー・エヌ・エー	53,400	1,528.50	81,621,900	
博報堂D Yホールディングス	191,700	1,193.50	228,793,950	
ぐるなび	28,000	264.00	7,392,000	
タカミヤ	20,400	487.00	9,934,800	
ファンコミュニケーションズ	21,000	399.00	8,379,000	
ライク	5,600	1,525.00	8,540,000	
A o b a - B B T	2,500	412.00	1,030,000	
エスプール	43,200	307.00	13,262,400	
WDBホールディングス	7,700	2,285.00	17,594,500	
手間いらず	2,500	2,678.00	6,695,000	
ティア	3,900	484.00	1,887,600	
C D G	800	1,237.00	989,600	
アドウェイズ	20,700	511.00	10,577,700	
パリュエコマース	13,200	1,228.00	16,209,600	
インフォマート	156,000	389.00	60,684,000	
サッポロホールディングス	47,400	6,705.00	317,817,000	
アサヒグループホールディングス	332,700	5,600.00	1,863,120,000	
麒麟ホールディングス	599,700	2,126.00	1,274,962,200	
宝ホールディングス	98,300	1,229.50	120,859,850	

オエノンホールディングス	43,000	369.00	15,867,000	
養命酒製造	4,800	1,876.00	9,004,800	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	112,800	1,992.00	224,697,600	
ライフドリンク カンパニー	2,100	5,980.00	12,558,000	
サントリー食品インターナショナル	101,400	4,922.00	499,090,800	
ダイドーグループホールディングス	16,300	2,911.00	47,449,300	
伊藤園	48,800	4,234.00	206,619,200	
キーコーヒー	16,100	2,061.00	33,182,100	
ユニカフェ	2,200	905.00	1,991,000	
ジャパンフーズ	1,000	1,408.00	1,408,000	
日清オイリオグループ	20,300	4,610.00	93,583,000	
不二製油グループ本社	33,500	2,358.00	78,993,000	
かどや製油	800	3,810.00	3,048,000	
Jーオイルミルズ	16,500	2,086.00	34,419,000	
ローソン	32,900	10,270.00	337,883,000	
サンエー	11,800	4,580.00	54,044,000	
カワチ薬品	12,100	2,713.00	32,827,300	
エービーシー・マート	67,700	2,608.00	176,561,600	
ハードオフコーポレーション	5,500	1,835.00	10,092,500	
高千穂交易	4,900	3,985.00	19,526,500	
アスクル	37,300	1,980.00	73,854,000	
ゲオホールディングス	17,400	2,379.00	41,394,600	
アダストリア	18,700	3,615.00	67,600,500	
ジーフット	5,700	297.00	1,692,900	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	900	763.00	686,700	
オルパヘルスケアホールディングス	1,100	1,873.00	2,060,300	
伊藤忠食品	3,500	7,830.00	27,405,000	
くら寿司	18,100	3,940.00	71,314,000	
キャンドウ	5,500	2,687.00	14,778,500	
エレマテック	13,900	1,807.00	25,117,300	
I Kホールディングス	2,300	382.00	878,600	
パルグループホールディングス	30,400	2,283.00	69,403,200	
エディオン	61,200	1,539.00	94,186,800	
あらた	23,700	3,105.00	73,588,500	
サーラコーポレーション	32,500	803.00	26,097,500	
ワッツ	3,300	588.00	1,940,400	
トーメンデバイス	2,200	5,330.00	11,726,000	
ハローズ	7,000	4,295.00	30,065,000	
J Pホールディングス	38,400	433.00	16,627,200	
フジオフードグループ本社	17,400	1,438.00	25,021,200	
あみやき亭	3,700	4,505.00	16,668,500	
東京エレクトロン デバイス	15,400	6,530.00	100,562,000	
ひらまつ	16,400	270.00	4,428,000	
円谷フィールズホールディングス	26,600	1,786.00	47,507,600	
双日	172,300	3,722.00	641,300,600	
アルフレッサ ホールディングス	155,300	2,394.50	371,865,850	
大黒天物産	4,800	8,770.00	42,096,000	
ハニーズホールディングス	13,700	1,696.00	23,235,200	
ファーマライズホールディングス	1,600	654.00	1,046,400	

キッコーマン	95,400	9,072.00	865,468,800	
味の素	342,100	5,658.00	1,935,601,800	
ブルドックソース	7,600	2,110.00	16,036,000	
キューピー	77,400	2,627.50	203,368,500	
ハウス食品グループ本社	49,600	3,142.00	155,843,200	
カゴメ	61,900	3,638.00	225,192,200	
焼津水産化学工業	2,800	1,348.00	3,774,400	
アリアケジャパン	14,400	4,610.00	66,384,000	
ピエトロ	900	1,808.00	1,627,200	
エバラ食品工業	3,400	2,941.00	9,999,400	
やまみ	900	4,085.00	3,676,500	
ニチレイ	66,000	3,750.00	247,500,000	
横浜冷凍	42,100	1,110.00	46,731,000	
東洋水産	72,800	8,053.00	586,258,400	
イトアンドホールディングス	6,800	2,137.00	14,531,600	
大冷	1,000	1,945.00	1,945,000	
ヨシムラ・フーズ・ホールディングス	6,500	1,172.00	7,618,000	
日清食品ホールディングス	151,900	4,733.00	718,942,700	
永谷園ホールディングス	7,100	2,269.00	16,109,900	
一正蒲鉾	2,800	738.00	2,066,400	
フジッコ	14,800	1,966.00	29,096,800	
ロック・フィールド	17,600	1,615.00	28,424,000	
日本たばこ産業	874,800	3,939.00	3,445,837,200	
ケンコーマヨネーズ	9,900	1,827.00	18,087,300	
わらべや日洋ホールディングス	9,600	2,841.00	27,273,600	
なとり	9,100	2,177.00	19,810,700	
イフジ産業	1,200	1,414.00	1,696,800	
ファーマフーズ	20,700	997.00	20,637,900	
北の達人コーポレーション	61,700	232.00	14,314,400	
ユーグレナ	89,600	658.00	58,956,800	
紀文食品	12,500	1,172.00	14,650,000	
ピックルスホールディングス	8,400	1,295.00	10,878,000	
スター・マイカ・ホールディングス	16,700	545.00	9,101,500	
S R Eホールディングス	6,200	3,320.00	20,584,000	
A Dワークスグループ	16,100	234.00	3,767,400	
片倉工業	13,500	1,787.00	24,124,500	
グンゼ	10,400	5,560.00	57,824,000	
ヒューリック	335,900	1,594.00	535,424,600	
神栄	1,000	1,712.00	1,712,000	
ラサ商事	6,300	1,686.00	10,621,800	
アルペン	12,700	2,008.00	25,501,600	
ハブ	2,200	732.00	1,610,400	
ラクーンホールディングス	10,900	692.00	7,542,800	
クオールホールディングス	21,300	1,627.00	34,655,100	
アルコニックス	20,400	1,401.00	28,580,400	
神戸物産	119,700	3,708.00	443,847,600	
ソリトンシステムズ	7,600	1,410.00	10,716,000	
ジンズホールディングス	9,200	4,130.00	37,996,000	
ビックカメラ	82,300	1,345.00	110,693,500	
D C Mホールディングス	81,800	1,373.00	112,311,400	

ペッパーフードサービス	35,800	93.00	3,329,400	
ハイパー	1,600	301.00	481,600	
M o n o t a R O	219,300	1,381.50	302,962,950	
東京一番フーズ	1,700	532.00	904,400	
DDグループ	4,400	1,520.00	6,688,000	
あい ホールディングス	24,800	2,461.00	61,032,800	
ディーブイエックス	1,900	1,072.00	2,036,800	
きちりホールディングス	1,800	1,027.00	1,848,600	
J. フロント リテイリング	177,500	1,503.50	266,871,250	
ドトール・日レスホールディングス	27,400	2,149.00	58,882,600	
マツキヨココカラ&カンパニー	281,400	2,777.50	781,588,500	
ブロンコビリー	9,100	3,335.00	30,348,500	
Z O Z O	98,600	3,367.00	331,986,200	
トレジャー・ファクトリー	8,500	1,449.00	12,316,500	
物語コーポレーション	25,800	5,280.00	136,224,000	
三越伊勢丹ホールディングス	260,500	1,957.50	509,928,750	
東洋紡	63,300	1,114.00	70,516,200	
ユニチカ	47,300	165.00	7,804,500	
富士紡ホールディングス	6,400	4,280.00	27,392,000	
日清紡ホールディングス	111,000	1,244.50	138,139,500	
倉敷紡績	10,400	3,060.00	31,824,000	
ダイワボウホールディングス	68,500	3,144.00	215,364,000	
シキボウ	7,700	1,202.00	9,255,400	
日東紡績	18,600	5,020.00	93,372,000	
トヨタ紡織	61,600	2,361.50	145,468,400	
マクニカホールディングス	36,600	8,065.00	295,179,000	
H a m e e	6,200	1,093.00	6,776,600	
マーケットエンタープライズ	600	1,028.00	616,800	
ラクト・ジャパン	6,000	2,252.00	13,512,000	
ウエルシアホールディングス	80,200	2,621.50	210,244,300	
クリエイトSDホールディングス	21,900	3,230.00	70,737,000	
グリムス	6,500	2,054.00	13,351,000	
パイタルケーエスケー・ホールディングス	23,400	1,195.00	27,963,000	
八洲電機	12,500	1,294.00	16,175,000	
メディアスホールディングス	9,000	745.00	6,705,000	
レスターホールディングス	13,200	3,025.00	39,930,000	
ジオリーヴグループ	1,600	1,334.00	2,134,400	
丸善CH I ホールディングス	8,300	326.00	2,705,800	
大光	3,600	639.00	2,300,400	
O C H I ホールディングス	1,600	1,600.00	2,560,000	
T O K A I ホールディングス	84,000	1,005.00	84,420,000	
黒谷	2,200	611.00	1,344,200	
ミサワ	1,500	619.00	928,500	
ティーライフ	900	1,409.00	1,268,100	
C o m i n i x	1,400	849.00	1,188,600	
エー・ピーホールディングス	1,700	973.00	1,654,100	
三洋貿易	17,500	1,286.00	22,505,000	
チムニー	2,100	1,457.00	3,059,700	
シュッピン	14,000	1,013.00	14,182,000	

ビューティガレージ	4,900	2,147.00	10,520,300	
オイシックス・ラ・大地	20,800	1,374.00	28,579,200	
ウイン・パートナーズ	10,100	1,260.00	12,726,000	
ネクステージ	35,300	2,388.00	84,296,400	
ジョイフル本田	45,000	1,942.00	87,390,000	
鳥貴族ホールディングス	5,700	3,685.00	21,004,500	
ホットランド	11,800	2,021.00	23,847,800	
すかいらくホールディングス	211,400	2,373.00	501,652,200	
SFPホールディングス	8,500	2,125.00	18,062,500	
綿半ホールディングス	12,000	1,480.00	17,760,000	
日本毛織	37,500	1,404.00	52,650,000	
ダイトウボウ	10,400	90.00	936,000	
トーア紡コーポレーション	2,500	434.00	1,085,000	
ダイドーリミテッド	9,400	585.00	5,499,000	
ヨシックスホールディングス	3,200	2,962.00	9,478,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	43,100	1,001.00	43,143,100	
野村不動産ホールディングス	80,100	3,739.00	299,493,900	
三重交通グループホールディングス	30,900	610.00	18,849,000	
サムティ	22,900	2,502.00	57,295,800	
ディア・ライフ	24,500	980.00	24,010,000	
コーセーアールイー	2,000	913.00	1,826,000	
地主	11,000	2,262.00	24,882,000	
プレサンスコーポレーション	22,900	1,704.00	39,021,600	
フィル・カンパニー	2,200	782.00	1,720,400	
THEグローバル社	4,300	386.00	1,659,800	
ハウスコム	1,000	907.00	907,000	
JPMC	8,300	1,144.00	9,495,200	
サンセイランディック	1,900	1,102.00	2,093,800	
エストラスト	700	645.00	451,500	
フージャースホールディングス	22,200	1,143.00	25,374,600	
オープンハウスグループ	52,700	4,681.00	246,688,700	
東急不動産ホールディングス	432,900	995.00	430,735,500	
飯田グループホールディングス	138,000	2,139.50	295,251,000	
イーランド	1,000	1,587.00	1,587,000	
ムゲンエステート	4,300	1,151.00	4,949,300	
帝国繊維	16,500	2,150.00	35,475,000	
日本コークス工業	148,700	128.00	19,033,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,000	620.00	4,340,000	
ミタチ産業	1,900	1,123.00	2,133,700	
B E N O S	6,300	1,444.00	9,097,200	
あさひ	14,300	1,305.00	18,661,500	
日本調剤	10,500	1,460.00	15,330,000	
コスモス薬品	13,100	16,000.00	209,600,000	
シップヘルスケアホールディングス	55,600	2,218.00	123,320,800	
トーエル	3,100	793.00	2,458,300	
ソフトクリエイトホールディングス	12,100	1,788.00	21,634,800	
セブン&アイ・ホールディングス	533,100	6,074.00	3,238,049,400	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	104,700	1,092.00	114,332,400	

明治電機工業	5,800	1,462.00	8,479,600	
ツルハホールディングス	32,500	11,005.00	357,662,500	
デリカフーズホールディングス	3,000	594.00	1,782,000	
スターティアホールディングス	1,800	1,579.00	2,842,200	
サンマルクホールディングス	12,500	2,240.00	28,000,000	
フェリシモ	1,500	917.00	1,375,500	
トリドールホールディングス	43,400	4,498.00	195,213,200	
帝人	140,700	1,364.00	191,914,800	
東レ	981,200	746.50	732,465,800	
クラレ	213,400	1,553.00	331,410,200	
旭化成	990,800	1,038.50	1,028,945,800	
TOKYO BASE	18,500	309.00	5,716,500	
稲葉製作所	7,500	1,517.00	11,377,500	
宮地エンジニアリンググループ	7,600	3,510.00	26,676,000	
トーカロ	43,600	1,529.00	66,664,400	
アルファ	2,400	1,602.00	3,844,800	
SUMCO	268,000	2,260.00	605,680,000	
川田テクノロジーズ	3,600	7,590.00	27,324,000	
RS Technologies	10,100	2,802.00	28,300,200	
ジェイテックコーポレーション	1,200	2,034.00	2,440,800	
信和	4,300	762.00	3,276,600	
ビーロット	4,400	1,052.00	4,628,800	
ファーストブラザーズ	1,300	1,256.00	1,632,800	
And Doホールディングス	8,700	1,118.00	9,726,600	
シーアールイー	8,000	1,388.00	11,104,000	
ケイアイスター不動産	6,900	3,410.00	23,529,000	
アグレ都市デザイン	1,100	1,620.00	1,782,000	
グッドコムアセット	13,400	788.00	10,559,200	
ジェイ・エス・ビー	7,200	2,711.00	19,519,200	
ロードスターキャピタル	9,400	1,944.00	18,273,600	
テンポイノベーション	1,900	936.00	1,778,400	
グローバル・リンク・マネジメント	1,200	2,481.00	2,977,200	
フェイスネットワーク	1,700	1,581.00	2,687,700	
霞ヶ関キャピタル	3,900	11,680.00	45,552,000	
住江織物	1,300	2,416.00	3,140,800	
日本フエルト	3,700	433.00	1,602,100	
イチカワ	800	1,775.00	1,420,000	
エコナックホールディングス	5,800	129.00	748,200	
日東製網	700	1,566.00	1,096,200	
芦森工業	1,300	2,400.00	3,120,000	
アツギ	4,500	554.00	2,493,000	
ウイルプラスホールディングス	1,400	1,029.00	1,440,600	
JMホールディングス	11,700	2,356.00	27,565,200	
コメダホールディングス	37,900	2,767.00	104,869,300	
サツドラホールディングス	2,800	804.00	2,251,200	
アレンザホールディングス	11,600	1,164.00	13,502,400	
串カツ田中ホールディングス	4,100	1,970.00	8,077,000	
バロックジャパンリミテッド	12,000	819.00	9,828,000	
クスリのアオキホールディングス	46,600	3,139.00	146,277,400	
ダイニック	2,100	704.00	1,478,400	

共和レザー	3,800	807.00	3,066,600	
ピーバندوقトコム	900	404.00	363,600	
力の源ホールディングス	7,900	1,456.00	11,502,400	
FOOD & LIFE COMPANIES	82,500	2,855.50	235,578,750	
アセンテック	5,900	570.00	3,363,000	
セーレン	28,300	2,458.00	69,561,400	
ソトー	2,100	689.00	1,446,900	
東海染工	600	822.00	493,200	
小松マテーレ	21,200	784.00	16,620,800	
ワコールホールディングス	30,000	3,474.00	104,220,000	
ホギメディカル	19,300	3,395.00	65,523,500	
クラウドディアホールディングス	1,500	406.00	609,000	
T S I ホールディングス	47,600	680.00	32,368,000	
マツオカコーポレーション	2,000	1,710.00	3,420,000	
ワールド	20,700	1,990.00	41,193,000	
T I S	160,400	3,409.00	546,803,600	
テクミラホールディングス	3,000	474.00	1,422,000	
グリー	49,100	579.00	28,428,900	
GMOペパボ	1,800	1,194.00	2,149,200	
コーエーテクモホールディングス	91,900	1,796.50	165,098,350	
三菱総合研究所	7,200	4,910.00	35,352,000	
ボルテージ	1,800	271.00	487,800	
電算	800	1,497.00	1,197,600	
A G S	2,700	911.00	2,459,700	
ファインデックス	11,600	1,015.00	11,774,000	
ブレインパッド	12,200	1,262.00	15,396,400	
K L a b	26,900	359.00	9,657,100	
ポールトゥウィンホールディングス	25,000	485.00	12,125,000	
ネクソン	328,200	2,890.50	948,662,100	
アイスタイル	47,800	409.00	19,550,200	
エムアップホールディングス	18,000	998.00	17,964,000	
エイチーム	8,700	559.00	4,863,300	
エニグモ	18,600	350.00	6,510,000	
テクノスジャパン	5,800	638.00	3,700,400	
e n i s h	6,600	184.00	1,214,400	
コロプラ	56,900	627.00	35,676,300	
オルトプラス	5,800	152.00	881,600	
ブロードリーフ	69,600	628.00	43,708,800	
クロス・マーケティンググループ	3,100	574.00	1,779,400	
デジタルハーツホールディングス	9,100	1,044.00	9,500,400	
メディアドゥ	6,600	1,244.00	8,210,400	
じげん	42,800	520.00	22,256,000	
ブイキューブ	17,500	302.00	5,285,000	
エンカレッジ・テクノロジー	1,500	639.00	958,500	
サイバーリンクス	2,500	809.00	2,022,500	
ディー・エル・イー	4,600	184.00	846,400	
フィックスターズ	16,500	1,599.00	26,383,500	
CARTA HOLDINGS	6,900	1,556.00	10,736,400	
オブティム	15,100	915.00	13,816,500	

セレス	5,900	1,246.00	7,351,400	
S H I F T	9,700	27,485.00	266,604,500	
特種東海製紙	8,000	3,940.00	31,520,000	
ティーガイア	15,400	2,035.00	31,339,000	
セック	1,800	5,100.00	9,180,000	
テクマトリックス	26,800	1,901.00	50,946,800	
プロシップ	7,100	1,407.00	9,989,700	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	38,200	2,486.50	94,984,300	
GMOペイメントゲートウェイ	29,300	8,814.00	258,250,200	
ザッパラス	1,500	433.00	649,500	
システムリサーチ	5,000	3,425.00	17,125,000	
インターネットイニシアティブ	70,100	2,827.50	198,207,750	
さくらインターネット	16,500	3,785.00	62,452,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,500	2,749.00	12,370,500	
S R Aホールディングス	7,500	3,880.00	29,100,000	
システムインテグレータ	2,000	434.00	868,000	
朝日ネット	15,800	629.00	9,938,200	
e B A S E	20,700	711.00	14,717,700	
アバントグループ	18,500	1,369.00	25,326,500	
アドソル日進	6,200	1,597.00	9,901,400	
ODKソリューションズ	1,300	602.00	782,600	
フリービット	6,400	1,431.00	9,158,400	
コムチュア	21,200	1,833.00	38,859,600	
アステリア	11,500	629.00	7,233,500	
アイル	6,800	3,230.00	21,964,000	
王子ホールディングス	610,000	576.20	351,482,000	
日本製紙	82,600	1,376.00	113,657,600	
三菱製紙	8,800	619.00	5,447,200	
北越コーポレーション	72,000	1,373.00	98,856,000	
中越パルプ工業	2,600	2,008.00	5,220,800	
巴川コーポレーション	1,800	952.00	1,713,600	
大王製紙	64,700	1,143.00	73,952,100	
阿波製紙	1,800	480.00	864,000	
マークラインズ	7,900	3,000.00	23,700,000	
メディカル・データ・ビジョン	17,500	634.00	11,095,000	
g u m i	23,800	399.00	9,496,200	
ショーケース	1,500	333.00	499,500	
モバイルファクトリー	1,400	726.00	1,016,400	
テラスカイ	6,300	1,527.00	9,620,100	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,600	1,778.00	13,512,800	
P C Iホールディングス	2,400	1,014.00	2,433,600	
アイビーシー	1,000	468.00	468,000	
ネオジャパン	4,900	1,055.00	5,169,500	
P R T I M E S	2,900	2,146.00	6,223,400	
ラクス	69,400	2,384.50	165,484,300	
ランドコンピュータ	3,100	887.00	2,749,700	
ダブルスタンダード	4,500	1,642.00	7,389,000	

オープンドア	8,500	942.00	8,007,000	
マイネット	2,100	278.00	583,800	
アカツキ	7,000	2,504.00	17,528,000	
ベネフィットジャパン	400	1,245.00	498,000	
Ubicomホールディングス	4,600	1,602.00	7,369,200	
カナミックネットワーク	15,800	424.00	6,699,200	
ノムラシステムコーポレーション	7,100	114.00	809,400	
レンゴー	133,400	1,030.00	137,402,000	
トーモク	8,500	2,295.00	19,507,500	
ザ・パック	10,900	3,380.00	36,842,000	
チェンジホールディングス	31,900	1,374.00	43,830,600	
シンクロ・フード	4,100	654.00	2,681,400	
オークネット	5,400	2,127.00	11,485,800	
キャピタル・アセット・プランニング	1,300	753.00	978,900	
セグエグループ	2,100	922.00	1,936,200	
エイトレッド	1,000	1,416.00	1,416,000	
マクロミル	28,800	775.00	22,320,000	
ビーグリー	1,400	1,275.00	1,785,000	
オロ	5,300	2,865.00	15,184,500	
ユーザーローカル	6,200	2,084.00	12,920,800	
デモナ	1,500	256.00	384,000	
ニーズウェル	3,600	795.00	2,862,000	
マネーフォワード	32,700	5,736.00	187,567,200	
サインポスト	2,500	512.00	1,280,000	
レゾナック・ホールディングス	141,500	2,952.50	417,778,750	
住友化学	1,086,700	307.50	334,160,250	
住友精化	6,900	4,980.00	34,362,000	
日産化学	68,800	6,142.00	422,569,600	
ラサ工業	5,600	2,281.00	12,773,600	
クレハ	32,000	2,825.00	90,400,000	
多木化学	5,700	3,170.00	18,069,000	
テイカ	12,700	1,414.00	17,957,800	
石原産業	24,300	1,567.00	38,078,100	
片倉コープアグリ	1,600	1,118.00	1,788,800	
日本曹達	17,300	5,770.00	99,821,000	
東ソー	195,500	1,913.50	374,089,250	
トクヤマ	47,300	2,258.50	106,827,050	
セントラル硝子	15,600	2,911.00	45,411,600	
東亜合成	70,500	1,539.50	108,534,750	
大阪ソーダ	10,200	10,890.00	111,078,000	
関東電化工業	28,300	909.00	25,724,700	
SUN ASTERISK	10,400	961.00	9,994,400	
デンカ	53,300	2,441.00	130,105,300	
イビデン	77,000	7,222.00	556,094,000	
信越化学工業	1,328,100	5,828.00	7,740,166,800	
日本カーバイド工業	6,200	1,562.00	9,684,400	
プラスアルファ・コンサルティング	8,700	2,440.00	21,228,000	
電算システムホールディングス	6,500	2,957.00	19,220,500	
堺化学工業	11,100	1,924.00	21,356,400	
第一稀元素化学工業	16,000	971.00	15,536,000	

エア・ウォーター	138,200	2,034.00	281,098,800	
日本酸素ホールディングス	142,100	4,148.00	589,430,800	
日本化学工業	5,300	1,965.00	10,414,500	
東邦アセチレン	6,900	375.00	2,587,500	
日本パーカライジング	65,300	1,234.00	80,580,200	
高压ガス工業	21,400	864.00	18,489,600	
チタン工業	900	1,124.00	1,011,600	
四国化成ホールディングス	18,700	1,759.00	32,893,300	
戸田工業	3,300	1,617.00	5,336,100	
ステラ ケミファ	7,900	3,290.00	25,991,000	
保土谷化学工業	4,600	3,585.00	16,491,000	
日本触媒	21,300	5,583.00	118,917,900	
大日精化工業	10,200	2,736.00	27,907,200	
カネカ	37,200	3,575.00	132,990,000	
協和キリン	177,200	2,268.00	401,889,600	
A P P I E R G R O U P	50,100	1,710.00	85,671,000	
三菱瓦斯化学	109,400	2,356.00	257,746,400	
三井化学	120,800	4,150.00	501,320,000	
J S R	159,500	3,980.00	634,810,000	
東京応化工業	69,900	3,519.00	245,978,100	
大阪有機化学工業	12,300	3,005.00	36,961,500	
三菱ケミカルグループ	1,070,700	860.30	921,123,210	
KHネオケム	22,300	2,370.00	52,851,000	
ビジョナル	11,200	9,180.00	102,816,000	
ダイセル	188,300	1,446.00	272,281,800	
住友ベークライト	20,500	7,469.00	153,114,500	
積水化学工業	294,300	2,060.00	606,258,000	
日本ゼオン	100,400	1,281.50	128,662,600	
アイカ工業	37,000	3,480.00	128,760,000	
U B E	69,700	2,527.50	176,166,750	
積水樹脂	21,900	2,576.00	56,414,400	
タキロンシーアイ	37,400	622.00	23,262,800	
旭有機材	9,700	3,805.00	36,908,500	
ニチバン	7,900	1,762.00	13,919,800	
リケンテクノス	31,600	981.00	30,999,600	
大倉工業	6,800	3,000.00	20,400,000	
積水化成品工業	20,700	458.00	9,480,600	
群栄化学工業	3,400	3,500.00	11,900,000	
タイガースポリマー	3,000	982.00	2,946,000	
ミライアル	2,200	1,520.00	3,344,000	
ダイキアクシス	2,700	717.00	1,935,900	
ダイキョーニシカワ	32,400	741.00	24,008,400	
竹本容器	2,600	784.00	2,038,400	
森六ホールディングス	7,600	2,868.00	21,796,800	
恵和	10,500	1,429.00	15,004,500	
日本化薬	111,900	1,274.50	142,616,550	
カーリットホールディングス	15,800	978.00	15,452,400	
ソルクシーズ	5,300	404.00	2,141,200	
C Lホールディングス	3,500	935.00	3,272,500	
プレステージ・インターナショナル	70,400	585.00	41,184,000	

フェイス	1,800	486.00	874,800	
プロトコーポレーション	16,100	1,364.00	21,960,400	
ハイマックス	4,500	1,402.00	6,309,000	
アミューズ	9,200	1,605.00	14,766,000	
野村総合研究所	324,900	4,230.00	1,374,327,000	
ドリームインキュベータ	5,200	3,035.00	15,782,000	
クイック	10,400	2,416.00	25,126,400	
T A C	3,300	190.00	627,000	
C Eホールディングス	3,400	608.00	2,067,200	
日本システム技術	5,400	3,255.00	17,577,000	
電通グループ	147,700	3,962.00	585,187,400	
インテージホールディングス	16,600	1,720.00	28,552,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,800	1,198.00	6,948,400	
東邦システムサイエンス	5,500	1,254.00	6,897,000	
ぴあ	5,000	3,360.00	16,800,000	
イオンファンタジー	5,400	2,449.00	13,224,600	
ソースネクスト	67,100	144.00	9,662,400	
シーティーエス	19,000	734.00	13,946,000	
N E X Y Z . G r o u p	2,100	698.00	1,465,800	
インフォコム	18,900	2,201.00	41,598,900	
メディカルシステムネットワーク	16,800	579.00	9,727,200	
日本精化	9,700	2,831.00	27,460,700	
扶桑化学工業	15,500	4,590.00	71,145,000	
トリケミカル研究所	17,800	3,795.00	67,551,000	
シンプレクス・ホールディングス	22,100	2,515.00	55,581,500	
H E R O Z	5,800	1,568.00	9,094,400	
ラクスル	35,300	1,063.00	37,523,900	
メルカリ	71,400	2,437.50	174,037,500	
I P S	4,200	2,027.00	8,513,400	
F I G	7,600	301.00	2,287,600	
システムサポート	5,700	1,903.00	10,847,100	
A D E K A	51,100	2,876.50	146,989,150	
日油	44,200	7,100.00	313,820,000	
ミヨシ油脂	2,500	1,325.00	3,312,500	
新日本理化	8,900	202.00	1,797,800	
ハリマ化成グループ	9,100	896.00	8,153,600	
イーソル	10,600	584.00	6,190,400	
東海ソフト	1,100	1,167.00	1,283,700	
ウイングアーク1 s t	15,200	2,852.00	43,350,400	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,900	1,164.00	4,539,600	
サーバーワークス	3,000	4,040.00	12,120,000	
東名	500	2,281.00	1,140,500	
ヴィッツ	600	823.00	493,800	
トビラシステムズ	1,900	871.00	1,654,900	
S a n s a n	48,100	1,409.00	67,772,900	
L i n k - U	1,600	634.00	1,014,400	
ギフティ	12,900	1,540.00	19,866,000	
花王	331,200	5,748.00	1,903,737,600	
第一工業製薬	5,800	2,966.00	17,202,800	

石原ケミカル	6,600	1,898.00	12,526,800	
日華化学	2,600	912.00	2,371,200	
ニイタカ	1,300	1,892.00	2,459,600	
三洋化成工業	9,000	4,180.00	37,620,000	
メドレー	19,700	4,615.00	90,915,500	
ベース	5,100	3,195.00	16,294,500	
J M D C	25,000	3,676.00	91,900,000	
武田薬品工業	1,297,800	4,219.00	5,475,418,200	
アステラス製薬	1,286,300	1,621.50	2,085,735,450	
住友ファーマ	108,800	345.00	37,536,000	
塩野義製薬	184,900	7,049.00	1,303,360,100	
わかもと製薬	6,800	209.00	1,421,200	
日本新薬	38,400	5,110.00	196,224,000	
中外製薬	459,000	5,193.00	2,383,587,000	
科研製薬	25,100	3,511.00	88,126,100	
エーザイ	178,400	6,521.00	1,163,346,400	
理研ビタミン	12,500	2,322.00	29,025,000	
ロート製薬	142,100	3,018.00	428,857,800	
小野薬品工業	311,200	2,517.50	783,446,000	
久光製薬	32,600	4,164.00	135,746,400	
有機合成薬品工業	5,200	288.00	1,497,600	
持田製薬	16,900	3,170.00	53,573,000	
参天製薬	267,200	1,433.50	383,031,200	
扶桑薬品工業	5,200	2,212.00	11,502,400	
日本ケミファ	700	1,605.00	1,123,500	
ツムラ	46,200	2,933.50	135,527,700	
テルモ	408,800	5,073.00	2,073,842,400	
H. U. グループホールディングス	44,000	2,678.00	117,832,000	
キッセイ薬品工業	24,300	3,160.00	76,788,000	
生化学工業	24,900	773.00	19,247,700	
栄研化学	26,900	1,939.00	52,159,100	
鳥居薬品	7,900	3,675.00	29,032,500	
J C R ファーマ	49,600	1,000.00	49,600,000	
東和薬品	22,500	2,667.00	60,007,500	
富士製薬工業	10,800	1,975.00	21,330,000	
ゼリア新薬工業	20,300	2,211.00	44,883,300	
そーせいグループ	48,100	1,430.00	68,783,000	
第一三共	1,277,500	4,512.00	5,764,080,000	
杏林製薬	31,800	1,764.00	56,095,200	
大幸薬品	30,300	306.00	9,271,800	
ダイト	11,300	1,976.00	22,328,800	
大塚ホールディングス	305,000	5,630.00	1,717,150,000	
大正製薬ホールディングス	32,600	8,598.00	280,294,800	
ペプチドリーム	71,100	1,301.50	92,536,650	
大日本塗料	16,300	1,156.00	18,842,800	
日本ペイントホールディングス	777,700	1,164.00	905,242,800	
関西ペイント	143,500	2,345.00	336,507,500	
神東塗料	5,300	127.00	673,100	
中国塗料	30,100	1,947.00	58,604,700	
日本特殊塗料	4,700	1,360.00	6,392,000	

藤倉化成	16,800	469.00	7,879,200	
太陽ホールディングス	25,500	3,060.00	78,030,000	
D I C	57,200	2,801.50	160,245,800	
サカタインクス	32,600	1,421.00	46,324,600	
a r t i e n c e	31,900	2,772.00	88,426,800	
T & K T O K A	14,000	1,407.00	19,698,000	
アルプス技研	14,300	2,894.00	41,384,200	
サニックス	24,100	288.00	6,940,800	
日本空調サービス	16,200	896.00	14,515,200	
オリエンタルランド	795,400	5,112.00	4,066,084,800	
フォーカスシステムズ	9,800	1,049.00	10,280,200	
ダスキン	33,500	3,455.00	115,742,500	
パーク24	93,500	1,924.50	179,940,750	
明光ネットワークジャパン	18,200	716.00	13,031,200	
ファルコホールディングス	6,800	2,056.00	13,980,800	
クレスコ	12,000	1,967.00	23,604,000	
フジ・メディア・ホールディングス	140,900	1,965.50	276,938,950	
秀英予備校	1,500	308.00	462,000	
田谷	1,200	422.00	506,400	
ラウンドワン	141,400	686.00	97,000,400	
リゾートトラスト	65,300	2,559.00	167,102,700	
オービック	49,000	22,435.00	1,099,315,000	
ジャストシステム	21,100	2,954.00	62,329,400	
T D C ソフト	13,700	2,123.00	29,085,100	
L I N E ヤフー	2,087,700	433.30	904,600,410	
ビー・エム・エル	18,500	2,856.00	52,836,000	
トレンドマイクロ	69,300	8,258.00	572,279,400	
I D ホールディングス	9,900	1,695.00	16,780,500	
リソー教育	76,800	240.00	18,432,000	
日本オラクル	28,100	11,275.00	316,827,500	
早稲田アカデミー	8,300	1,748.00	14,508,400	
アルファシステムズ	3,900	3,140.00	12,246,000	
フューチャー	31,300	1,703.00	53,303,900	
C A C H o l d i n g s	7,900	1,795.00	14,180,500	
S B テクノロジー	6,200	2,196.00	13,615,200	
トーセ	1,900	708.00	1,345,200	
ユー・エス・エス	168,600	2,688.00	453,196,800	
オービックビジネスコンサルタント	20,600	7,062.00	145,477,200	
アイティフォー	18,800	1,209.00	22,729,200	
東京個別指導学院	17,900	450.00	8,055,000	
東計電算	4,100	3,680.00	15,088,000	
サイバーエージェント	332,100	1,023.00	339,738,300	
楽天グループ	1,288,300	635.00	818,070,500	
エックスネット	1,000	1,105.00	1,105,000	
クリーク・アンド・リバー社	7,600	1,998.00	15,184,800	
S B I グローバルアセットマネジメント	29,400	695.00	20,433,000	
デー・オー・ダブリュー	29,400	343.00	10,084,200	
大塚商会	72,700	5,983.00	434,964,100	
サイボウズ	20,200	2,253.00	45,510,600	

山田コンサルティンググループ	6,500	1,751.00	11,381,500	
セントラルスポーツ	5,600	2,489.00	13,938,400	
パラカ	5,100	2,005.00	10,225,500	
電通総研	17,800	5,430.00	96,654,000	
A C C E S S	15,200	840.00	12,768,000	
デジタルガレージ	23,400	3,515.00	82,251,000	
イーエムシステムズ	24,500	682.00	16,709,000	
ウェザーニューズ	4,500	5,110.00	22,995,000	
C I J	24,400	685.00	16,714,000	
ビジネスエンジニアリング	2,800	4,455.00	12,474,000	
日本エンタープライズ	6,600	124.00	818,400	
WOWOW	11,000	1,160.00	12,760,000	
スカラ	13,500	760.00	10,260,000	
インテリジェント ウェイブ	3,500	1,124.00	3,934,000	
フルキャストホールディングス	14,400	1,790.00	25,776,000	
エン・ジャパン	24,500	2,741.00	67,154,500	
セルソース	4,100	1,308.00	5,362,800	
あすか製薬ホールディングス	15,000	1,902.00	28,530,000	
サワイグループホールディングス	33,500	5,695.00	190,782,500	
富士フイルムホールディングス	272,000	9,832.00	2,674,304,000	
コニカミノルタ	329,800	482.10	158,996,580	
資生堂	306,200	4,220.00	1,292,164,000	
ライオン	191,900	1,304.50	250,333,550	
高砂香料工業	11,000	3,635.00	39,985,000	
マンダム	31,700	1,315.00	41,685,500	
ミルボン	19,900	3,482.00	69,291,800	
ファンケル	64,100	2,217.00	142,109,700	
コーセー	29,800	9,384.00	279,643,200	
コタ	13,500	1,569.00	21,181,500	
シーボン	900	1,492.00	1,342,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	75,200	1,538.00	115,657,600	
ノエビアホールディングス	13,100	5,180.00	67,858,000	
アジュバンホールディングス	1,600	931.00	1,489,600	
新日本製薬	8,400	1,786.00	15,002,400	
I - n e	2,900	2,352.00	6,820,800	
アクシージア	7,200	847.00	6,098,400	
エステー	11,300	1,529.00	17,277,700	
アグロ カネショウ	5,900	1,319.00	7,782,100	
コニシ	42,400	1,319.00	55,925,600	
長谷川香料	28,000	3,315.00	92,820,000	
小林製薬	42,700	6,360.00	271,572,000	
荒川化学工業	12,400	1,122.00	13,912,800	
メック	12,100	4,345.00	52,574,500	
日本高純度化学	3,300	2,691.00	8,880,300	
タカラバイオ	39,500	1,228.00	48,506,000	
J C U	16,400	3,795.00	62,238,000	
新田ゼラチン	4,400	758.00	3,335,200	
O A Tアグリオ	4,800	1,899.00	9,115,200	
デクセリアルズ	36,800	5,364.00	197,395,200	
アース製薬	13,300	4,590.00	61,047,000	

北興化学工業	14,800	1,051.00	15,554,800	
大成ラミック	4,200	3,090.00	12,978,000	
クミアイ化学工業	58,300	842.00	49,088,600	
日本農薬	26,900	683.00	18,372,700	
富士興産	1,900	2,182.00	4,145,800	
ニチレキ	19,100	2,445.00	46,699,500	
ユシロ化学工業	7,600	2,068.00	15,716,800	
ビーピー・カストロール	2,500	866.00	2,165,000	
富士石油	42,700	370.00	15,799,000	
MORESCO	2,300	1,436.00	3,302,800	
出光興産	814,300	814.60	663,328,780	
ENEOSホールディングス	2,321,700	594.70	1,380,714,990	
コスモエネルギーホールディングス	43,500	6,035.00	262,522,500	
ANYCOLOR	15,500	3,380.00	52,390,000	
テスホールディングス	30,900	447.00	13,812,300	
インフロニア・ホールディングス	165,300	1,536.00	253,900,800	
横浜ゴム	74,200	3,545.00	263,039,000	
TOYO TIRE	84,300	2,556.00	215,470,800	
ブリヂストン	429,200	6,341.00	2,721,557,200	
住友ゴム工業	143,800	1,740.00	250,212,000	
藤倉コンポジット	11,300	1,441.00	16,283,300	
オカモト	6,900	4,875.00	33,637,500	
アキレス	9,300	1,566.00	14,563,800	
フコク	7,700	1,497.00	11,526,900	
ニッタ	14,900	3,695.00	55,055,500	
クリエートメディック	2,100	891.00	1,871,100	
住友理工	22,800	1,202.00	27,405,600	
三ツ星ベルト	17,800	4,775.00	84,995,000	
バンドー化学	21,800	1,760.00	38,368,000	
AGC	130,800	5,677.00	742,551,600	
日本板硝子	69,900	608.00	42,499,200	
石塚硝子	1,100	3,510.00	3,861,000	
有沢製作所	25,700	1,123.00	28,861,100	
日本山村硝子	2,400	1,462.00	3,508,800	
日本電気硝子	59,800	3,523.00	210,675,400	
オハラ	7,000	1,155.00	8,085,000	
住友大阪セメント	24,400	3,745.00	91,378,000	
太平洋セメント	86,700	3,113.00	269,897,100	
リソルホールディングス	600	6,110.00	3,666,000	
日本ヒューム	12,800	904.00	11,571,200	
日本コンクリート工業	28,400	473.00	13,433,200	
三谷セキサン	5,900	5,240.00	30,916,000	
アジアパイルホールディングス	20,800	812.00	16,889,600	
東海カーボン	135,300	1,031.00	139,494,300	
日本カーボン	7,800	4,420.00	34,476,000	
東洋炭素	10,300	5,020.00	51,706,000	
ノリタケカンパニーリミテド	8,100	7,890.00	63,909,000	
TOTO	96,800	3,743.00	362,322,400	
日本碍子	170,600	1,860.00	317,316,000	
日本特殊陶業	122,800	4,229.00	519,321,200	

ダントーホールディングス	4,300	948.00	4,076,400	
MARUWA	5,400	30,700.00	165,780,000	
品川リフクトリーズ	18,100	2,039.00	36,905,900	
黒崎播磨	3,000	12,890.00	38,670,000	
ヨータイ	9,100	1,459.00	13,276,900	
東京窯業	7,000	517.00	3,619,000	
ニッカトー	3,000	582.00	1,746,000	
フジインコーポレーテッド	39,400	3,375.00	132,975,000	
クニミネ工業	1,900	1,018.00	1,934,200	
エーアンドエーマテリアル	1,400	1,385.00	1,939,000	
ニチアス	37,100	3,440.00	127,624,000	
日本製鉄	675,600	3,565.00	2,408,514,000	
神戸製鋼所	303,400	2,068.00	627,431,200	
中山製鋼所	34,600	943.00	32,627,800	
合同製鐵	8,500	5,860.00	49,810,000	
JFEホールディングス	419,600	2,320.50	973,681,800	
東京製鐵	42,500	1,741.00	73,992,500	
共英製鋼	17,300	2,142.00	37,056,600	
大和工業	28,500	8,469.00	241,366,500	
東京鐵鋼	6,700	5,380.00	36,046,000	
大阪製鐵	7,000	2,208.00	15,456,000	
淀川製鋼所	17,200	3,940.00	67,768,000	
中部鋼鈑	9,900	2,439.00	24,146,100	
丸一鋼管	46,000	3,821.00	175,766,000	
モリ工業	2,600	4,885.00	12,701,000	
大同特殊鋼	95,100	1,678.50	159,625,350	
日本高周波鋼業	2,700	554.00	1,495,800	
日本冶金工業	11,000	4,260.00	46,860,000	
山陽特殊製鋼	15,000	2,209.00	33,135,000	
愛知製鋼	8,700	3,465.00	30,145,500	
日本金属	1,900	882.00	1,675,800	
ミガロホールディングス	1,000	1,481.00	1,481,000	
大平洋金属	12,900	1,358.00	17,518,200	
新日本電工	75,400	283.00	21,338,200	
栗本鐵工所	7,000	3,670.00	25,690,000	
虹 技	900	1,495.00	1,345,500	
日本鑄鉄管	800	1,178.00	942,400	
日本製鋼所	40,700	2,345.50	95,461,850	
三菱製鋼	11,200	1,671.00	18,715,200	
日亜鋼業	7,400	333.00	2,464,200	
日本精線	2,100	5,510.00	11,571,000	
エンビプロ・ホールディングス	11,900	591.00	7,032,900	
大紀アルミニウム工業所	19,200	1,229.00	23,596,800	
日本軽金属ホールディングス	44,200	1,722.00	76,112,400	
三井金属鉱業	43,900	4,864.00	213,529,600	
東邦亜鉛	9,800	1,119.00	10,966,200	
三菱マテリアル	108,000	2,771.00	299,268,000	
住友金属鉱山	174,900	4,004.00	700,299,600	
DOWAホールディングス	37,300	5,084.00	189,633,200	
古河機械金属	20,000	1,920.00	38,400,000	

エス・サイエンス	41,900	22.00	921,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	26,200	2,791.00	73,124,200	
東邦チタニウム	31,200	1,860.00	58,032,000	
UACJ	21,200	4,145.00	87,874,000	
CKサンエツ	2,700	3,850.00	10,395,000	
古河電気工業	50,200	2,759.50	138,526,900	
住友電気工業	564,400	2,073.50	1,170,283,400	
フジクラ	177,900	1,242.00	220,951,800	
SWCC	16,900	3,120.00	52,728,000	
タツタ電線	26,800	688.00	18,438,400	
カナレ電気	1,100	1,691.00	1,860,100	
平河ヒューテック	9,600	1,366.00	13,113,600	
いよぎんホールディングス	171,400	1,019.00	174,656,600	
しずおかフィナンシャルグループ	320,000	1,404.50	449,440,000	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	121,300	1,077.50	130,700,750	
楽天銀行	50,100	2,333.00	116,883,300	
京都フィナンシャルグループ	182,500	2,436.00	444,570,000	
リョービ	16,100	2,761.00	44,452,100	
アーレスティ	7,400	768.00	5,683,200	
AREホールディングス	56,800	1,939.00	110,135,200	
東洋製罐グループホールディングス	86,600	2,404.00	208,186,400	
ホッカンホールディングス	7,400	1,852.00	13,704,800	
コロナ	8,600	953.00	8,195,800	
横河ブリッジホールディングス	23,600	2,847.00	67,189,200	
駒井ハルテック	1,200	2,093.00	2,511,600	
高田機工	500	3,665.00	1,832,500	
三和ホールディングス	151,600	2,358.50	357,548,600	
文化シャッター	39,500	1,488.00	58,776,000	
三協立山	19,000	913.00	17,347,000	
アルインコ	11,500	1,043.00	11,994,500	
東洋シャッター	1,500	731.00	1,096,500	
LIXIL	235,500	1,960.00	461,580,000	
日本ファイルコン	4,400	549.00	2,415,600	
ノーリツ	25,000	1,577.00	39,425,000	
長府製作所	15,000	2,105.00	31,575,000	
リンナイ	72,200	3,249.00	234,577,800	
ユニプレス	26,200	1,109.00	29,055,800	
ダイニチ工業	3,500	705.00	2,467,500	
日東精工	21,900	547.00	11,979,300	
三洋工業	800	3,285.00	2,628,000	
岡部	26,900	797.00	21,439,300	
ジーテクト	19,200	2,113.00	40,569,600	
東プレ	26,600	2,235.00	59,451,000	
高周波熱錬	23,300	1,058.00	24,651,400	
東京製綱	9,800	1,358.00	13,308,400	
サンコール	13,400	480.00	6,432,000	
モリテックスチール	6,100	288.00	1,756,800	
パイオラックス	18,700	2,664.00	49,816,800	
エイチワン	15,500	898.00	13,919,000	
日本発条	133,500	1,240.00	165,540,000	

中央発條	11,200	747.00	8,366,400	
アドバネクス	800	1,074.00	859,200	
三浦工業	61,700	2,793.50	172,358,950	
タクマ	49,900	1,728.00	86,227,200	
テクノプロ・ホールディングス	88,000	3,365.00	296,120,000	
アトラグループ	2,000	181.00	362,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	7,800	1,321.00	10,303,800	
K e e P e r 技研	9,300	6,520.00	60,636,000	
ファーストロジック	1,600	503.00	804,800	
三機サービス	1,200	1,346.00	1,615,200	
G u n o s y	11,900	730.00	8,687,000	
デザインワン・ジャパン	1,600	133.00	212,800	
イー・ガーディアン	5,700	1,409.00	8,031,300	
リブセンス	3,100	243.00	753,300	
ジャパンマテリアル	46,000	2,575.00	118,450,000	
ベクトル	18,400	1,185.00	21,804,000	
ウチヤマホールディングス	2,800	383.00	1,072,400	
チャーム・ケア・コーポレーション	12,500	1,373.00	17,162,500	
キャリアリンク	5,500	2,631.00	14,470,500	
I B J	11,500	680.00	7,820,000	
アサンテ	7,400	1,665.00	12,321,000	
バリューHR	13,100	1,391.00	18,222,100	
M&Aキャピタルパートナーズ	12,200	2,394.00	29,206,800	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,000	1,037.00	6,222,000	
E R I ホールディングス	1,900	1,875.00	3,562,500	
アビスト	1,000	3,115.00	3,115,000	
シグマクシス・ホールディングス	20,300	1,684.00	34,185,200	
ウィルグループ	12,500	1,192.00	14,900,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	7,900	140.00	1,106,000	
メドピア	13,200	688.00	9,081,600	
レアジョブ	1,300	913.00	1,186,900	
リクルートホールディングス	1,112,800	5,783.00	6,435,322,400	
エラン	19,900	1,059.00	21,074,100	
ツガミ	32,800	1,209.00	39,655,200	
オークマ	12,900	6,908.00	89,113,200	
芝浦機械	14,700	3,375.00	49,612,500	
アマダ	235,600	1,589.00	374,368,400	
アイダエンジニアリング	34,200	844.00	28,864,800	
F U J I	69,500	2,474.00	171,943,000	
牧野フライス製作所	16,300	5,710.00	93,073,000	
オーエスジー	65,100	2,003.50	130,427,850	
ダイジェット工業	700	826.00	578,200	
旭ダイヤモンド工業	34,000	866.00	29,444,000	
DMG森精機	89,500	3,272.00	292,844,000	
ソディック	35,900	720.00	25,848,000	
ディスコ	71,100	42,850.00	3,046,635,000	
日東工器	7,200	1,974.00	14,212,800	
日進工具	13,700	1,032.00	14,138,400	

パンチ工業	6,400	433.00	2,771,200	
富士ダイス	8,700	712.00	6,194,400	
土木管理総合試験所	3,100	326.00	1,010,600	
日本郵政	1,766,200	1,416.00	2,500,939,200	
ベルシステム24ホールディングス	16,100	1,789.00	28,802,900	
鎌倉新書	12,800	620.00	7,936,000	
SMN	1,300	324.00	421,200	
一蔵	800	618.00	494,400	
グローバルキッズCOMPANY	1,200	655.00	786,000	
エアトリ	11,000	1,819.00	20,009,000	
アトラエ	8,900	665.00	5,918,500	
ストライク	6,400	4,840.00	30,976,000	
ソラスト	41,400	570.00	23,598,000	
セラク	4,600	1,119.00	5,147,400	
インソース	32,600	779.00	25,395,400	
豊田自動織機	124,700	13,515.00	1,685,320,500	
豊和工業	3,600	773.00	2,782,800	
石川製作所	1,700	1,150.00	1,955,000	
リケンNPR	16,000	2,742.00	43,872,000	
東洋機械金属	5,400	718.00	3,877,200	
津田駒工業	1,200	388.00	465,600	
エンシュウ	1,500	706.00	1,059,000	
島精機製作所	23,500	1,404.00	32,994,000	
オプトラン	24,300	1,742.00	42,330,600	
NCホールディングス	1,600	1,600.00	2,560,000	
イワキ	9,800	2,309.00	22,628,200	
フリュー	13,900	1,288.00	17,903,200	
ヤマシンフィルタ	35,500	361.00	12,815,500	
日阪製作所	16,100	997.00	16,051,700	
やまびこ	24,100	1,617.00	38,969,700	
野村マイクロ・サイエンス	5,000	13,250.00	66,250,000	
平田機工	7,100	6,990.00	49,629,000	
PEGASUS	16,300	444.00	7,237,200	
マルマエ	6,400	1,802.00	11,532,800	
タツモ	8,900	3,090.00	27,501,000	
ナブテスコ	92,700	2,819.50	261,367,650	
三井海洋開発	18,700	2,284.00	42,710,800	
レオン自動機	17,100	1,501.00	25,667,100	
SMC	44,200	79,080.00	3,495,336,000	
ホソカワミクロン	9,500	4,625.00	43,937,500	
ユニオンツール	6,500	3,275.00	21,287,500	
瑞光	10,600	1,864.00	19,758,400	
オイレス工業	20,100	2,078.00	41,767,800	
日精エー・エス・ビー機械	5,900	4,195.00	24,750,500	
サトーホールディングス	21,000	2,124.00	44,604,000	
技研製作所	13,900	2,057.00	28,592,300	
日本エアータック	6,900	1,223.00	8,438,700	
カワタ	2,000	1,028.00	2,056,000	
日精樹脂工業	11,000	1,168.00	12,848,000	
オカダアイヨン	2,200	2,724.00	5,992,800	

ワイエイシイホールディングス	5,500	2,325.00	12,787,500	
小松製作所	692,200	4,299.00	2,975,767,800	
住友重機械工業	87,400	3,933.00	343,744,200	
日立建機	58,800	4,227.00	248,547,600	
日工	21,900	761.00	16,665,900	
巴工業	5,800	3,630.00	21,054,000	
井関農機	13,800	1,192.00	16,449,600	
TOWA	16,400	7,730.00	126,772,000	
丸山製作所	1,100	2,776.00	3,053,600	
北川鉄工所	5,800	1,490.00	8,642,000	
シンニッタン	8,600	274.00	2,356,400	
ローツェ	7,700	18,220.00	140,294,000	
タカキタ	2,200	497.00	1,093,400	
クボタ	772,000	2,217.50	1,711,910,000	
荏原実業	7,800	3,210.00	25,038,000	
東洋エンジニアリング	21,100	809.00	17,069,900	
三菱化工機	5,200	3,685.00	19,162,000	
月島ホールディングス	20,000	1,358.00	27,160,000	
帝国電機製作所	10,400	2,886.00	30,014,400	
東京機械製作所	1,700	468.00	795,600	
新東工業	29,900	1,114.00	33,308,600	
澁谷工業	13,900	2,481.00	34,485,900	
アイチコーポレーション	20,600	1,106.00	22,783,600	
小森コーポレーション	36,400	1,279.00	46,555,600	
鶴見製作所	11,300	3,550.00	40,115,000	
日本ギア工業	2,500	667.00	1,667,500	
酒井重工業	2,300	6,810.00	15,663,000	
荏原製作所	60,600	9,487.00	574,912,200	
石井鐵工所	800	2,708.00	2,166,400	
西島製作所	12,700	2,495.00	31,686,500	
北越工業	14,800	2,453.00	36,304,400	
ダイキン工業	176,300	21,165.00	3,731,389,500	
オルガノ	17,700	6,430.00	113,811,000	
トーヨーカネツ	5,000	4,275.00	21,375,000	
栗田工業	82,600	5,499.00	454,217,400	
椿本チエイン	20,900	4,665.00	97,498,500	
大同工業	2,900	751.00	2,177,900	
日機装	34,100	1,126.00	38,396,600	
木村化工機	11,300	728.00	8,226,400	
レイズネクスト	20,800	1,575.00	32,760,000	
アネスト岩田	22,800	1,299.00	29,617,200	
ダイフク	249,200	2,867.50	714,581,000	
サムコ	4,000	4,710.00	18,840,000	
加藤製作所	3,300	1,520.00	5,016,000	
油研工業	1,100	2,319.00	2,550,900	
タダノ	85,000	1,175.50	99,917,500	
フジテック	34,500	3,650.00	125,925,000	
C K D	40,900	2,519.00	103,027,100	
平和	43,700	2,194.00	95,877,800	
理想科学工業	11,800	3,020.00	35,636,000	

SANKYO	34,000	9,000.00	306,000,000	
日本金銭機械	17,800	1,444.00	25,703,200	
マースグループホールディングス	7,500	2,705.00	20,287,500	
フクシマガリレイ	9,700	5,110.00	49,567,000	
オーイズミ	2,500	450.00	1,125,000	
ダイコク電機	7,300	3,590.00	26,207,000	
竹内製作所	26,800	5,080.00	136,144,000	
アマノ	41,900	3,664.00	153,521,600	
JUKI	22,800	461.00	10,510,800	
サンデン	9,800	191.00	1,871,800	
ジャノメ	15,000	719.00	10,785,000	
ブラザー工業	197,300	2,637.50	520,378,750	
マックス	20,800	3,140.00	65,312,000	
モリタホールディングス	25,700	1,541.00	39,603,700	
グローリー	35,400	2,952.00	104,500,800	
新晃工業	14,900	2,936.00	43,746,400	
大和冷機工業	22,700	1,526.00	34,640,200	
セガサミーホールディングス	131,900	2,184.00	288,069,600	
TPR	18,700	2,104.00	39,344,800	
ツバキ・ナカシマ	29,700	746.00	22,156,200	
ホシザキ	87,100	5,377.00	468,336,700	
大豊工業	12,800	831.00	10,636,800	
日本精工	273,400	797.30	217,981,820	
NTN	320,300	283.40	90,773,020	
ジェイテクト	131,400	1,392.50	182,974,500	
不二越	10,900	3,390.00	36,951,000	
ミネベアミツミ	256,900	2,916.50	749,248,850	
日本トムソン	40,300	594.00	23,938,200	
THK	85,200	2,690.50	229,230,600	
ユーシン精機	11,800	687.00	8,106,600	
前澤給装工業	11,300	1,360.00	15,368,000	
イーグル工業	16,300	1,720.00	28,036,000	
前澤工業	4,200	1,082.00	4,544,400	
日本ピラー工業	13,700	4,640.00	63,568,000	
キッツ	49,500	1,221.00	60,439,500	
日立製作所	709,700	11,720.00	8,317,684,000	
三菱電機	1,643,600	2,015.00	3,311,854,000	
富士電機	89,800	8,090.00	726,482,000	
東洋電機製造	2,300	1,048.00	2,410,400	
安川電機	160,400	5,316.00	852,686,400	
シンフォニアテクノロジー	16,300	2,204.00	35,925,200	
明電舎	27,400	2,776.00	76,062,400	
オリジン	1,500	1,220.00	1,830,000	
山洋電気	6,400	5,820.00	37,248,000	
デンヨー	11,300	2,285.00	25,820,500	
PHCホールディングス	27,600	1,506.00	41,565,600	
KOKUSAI ELECTRIC	57,100	3,980.00	227,258,000	
ソシオネクスト	107,200	3,673.00	393,745,600	
ベイカレント・コンサルティング	110,500	3,129.00	345,754,500	
Orchestra Holding	3,200	990.00	3,168,000	

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

サンケン電気	13,700	7,800.00	106,860,000	
ナカヨ	1,100	1,147.00	1,261,700	
アイホン	8,000	2,867.00	22,936,000	
ルネサスエレクトロニクス	963,800	2,374.00	2,288,061,200	
セイコーエプソン	189,500	2,367.00	448,546,500	
ワコム	112,300	743.00	83,438,900	
アルバック	32,400	7,559.00	244,911,600	
アクセル	5,900	2,278.00	13,440,200	
E I Z O	10,800	4,950.00	53,460,000	
ジャパンディスプレイ	636,300	20.00	12,726,000	
日本信号	33,700	955.00	32,183,500	
京三製作所	30,900	465.00	14,368,500	
能美防災	20,000	2,302.00	46,040,000	
ホーチキ	11,000	2,126.00	23,386,000	
星和電機	2,900	480.00	1,392,000	
エレコム	35,300	1,687.00	59,551,100	
パナソニック ホールディングス	1,744,500	1,430.50	2,495,507,250	
シャープ	248,900	862.10	214,576,690	
アンリツ	104,000	1,164.50	121,108,000	
富士通ゼネラル	41,900	2,100.00	87,990,000	
ソニーグループ	1,034,300	14,300.00	14,790,490,000	
T D K	233,800	7,599.00	1,776,646,200	
帝国通信工業	6,500	1,949.00	12,668,500	
タムラ製作所	58,800	541.00	31,810,800	
アルプスアルパイン	131,900	1,070.00	141,133,000	
池上通信機	2,000	898.00	1,796,000	
日本電波工業	17,700	1,196.00	21,169,200	
鈴木	7,900	1,250.00	9,875,000	
メイコー	14,700	4,580.00	67,326,000	
日本トリム	3,300	3,310.00	10,923,000	
ローランド ディー. ジー.	8,100	3,890.00	31,509,000	
フォスター電機	10,900	1,131.00	12,327,900	
SMK	3,800	2,500.00	9,500,000	
ヨコオ	13,000	1,428.00	18,564,000	
ティアック	10,600	99.00	1,049,400	
ホシデン	33,600	1,795.00	60,312,000	
ヒロセ電機	21,800	16,240.00	354,032,000	
日本航空電子工業	35,300	2,457.00	86,732,100	
T O A	16,800	1,125.00	18,900,000	
マクセル	32,600	1,570.00	51,182,000	
古野電気	19,200	2,034.00	39,052,800	
スミダコーポレーション	19,800	1,158.00	22,928,400	
アイコム	5,700	3,595.00	20,491,500	
リオン	6,100	2,543.00	15,512,300	
横河電機	161,600	2,923.00	472,356,800	
新電元工業	5,600	3,150.00	17,640,000	
アズビル	100,600	4,603.00	463,061,800	
東亜ディーケーケー	3,100	947.00	2,935,700	
日本光電工業	62,700	3,987.00	249,984,900	
チノー	6,100	2,395.00	14,609,500	

共和電業	6,100	423.00	2,580,300	
日本電子材料	9,000	1,912.00	17,208,000	
堀場製作所	27,900	12,365.00	344,983,500	
アドバンテスト	418,900	6,115.00	2,561,573,500	
小野測器	2,700	460.00	1,242,000	
エスベック	11,700	2,554.00	29,881,800	
キーエンス	146,300	64,180.00	9,389,534,000	
日置電機	6,900	6,540.00	45,126,000	
シスメックス	126,200	7,613.00	960,760,600	
日本マイクロニクス	26,300	4,180.00	109,934,000	
メガチップス	11,600	4,750.00	55,100,000	
OBARA GROUP	8,000	3,940.00	31,520,000	
IMAGICA GROUP	14,700	695.00	10,216,500	
澤藤電機	800	1,309.00	1,047,200	
デンソー	1,206,300	2,522.50	3,042,891,750	
原田工業	2,900	752.00	2,180,800	
コーセル	15,600	1,462.00	22,807,200	
イリソ電子工業	13,400	3,045.00	40,803,000	
オブテックスグループ	26,800	1,760.00	47,168,000	
千代田インテグレ	5,700	2,737.00	15,600,900	
レーザーテック	67,000	39,920.00	2,674,640,000	
スタンレー電気	93,600	2,659.50	248,929,200	
ウシオ電機	74,300	2,057.00	152,835,100	
岡谷電機産業	5,000	286.00	1,430,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	6,500	532.00	3,458,000	
エノモト	1,800	1,623.00	2,921,400	
日本セラミック	11,900	2,645.00	31,475,500	
遠藤照明	2,900	1,527.00	4,428,300	
古河電池	10,700	939.00	10,047,300	
双信電機	2,600	295.00	767,000	
山一電機	13,100	2,196.00	28,767,600	
図研	12,700	4,075.00	51,752,500	
日本電子	36,600	6,649.00	243,353,400	
カシオ計算機	105,600	1,260.50	133,108,800	
ファナック	713,000	3,945.00	2,812,785,000	
日本シイエムケイ	31,100	752.00	23,387,200	
エンプラス	4,300	10,890.00	46,827,000	
大真空	21,800	878.00	19,140,400	
ローム	270,300	2,662.00	719,538,600	
浜松ホトニクス	117,300	5,636.00	661,102,800	
三井ハイテック	12,900	7,394.00	95,382,600	
新光電気工業	51,700	5,450.00	281,765,000	
京セラ	908,500	2,077.50	1,887,408,750	
協栄産業	700	2,991.00	2,093,700	
太陽誘電	71,200	3,431.00	244,287,200	
村田製作所	1,330,300	2,989.50	3,976,931,850	
双葉電子工業	27,800	506.00	14,066,800	
日東電工	94,200	12,860.00	1,211,412,000	
北陸電気工業	2,400	1,409.00	3,381,600	
東海理化電機製作所	41,200	2,298.00	94,677,600	

ニチコン	38,400	1,260.00	48,384,000	
日本ケミコン	15,600	1,402.00	21,871,200	
K O A	22,100	1,457.00	32,199,700	
三井E & S	73,300	753.00	55,194,900	
日立造船	130,300	1,007.00	131,212,100	
三菱重工業	258,200	10,360.00	2,674,952,000	
川崎重工業	119,400	3,507.00	418,735,800	
I H I	109,900	2,754.50	302,719,550	
名村造船所	36,400	1,350.00	49,140,000	
サノヤスホールディングス	9,600	145.00	1,392,000	
スプリックス	1,900	794.00	1,508,600	
マネジメントソリューションズ	6,400	2,816.00	18,022,400	
プロレド・パートナーズ	3,500	355.00	1,242,500	
a n d f a c t o r y	2,000	311.00	622,000	
テノ. ホールディングス	800	518.00	414,400	
フロンティア・マネジメント	3,800	1,555.00	5,909,000	
ピアラ	1,200	314.00	376,800	
コプロ・ホールディングス	2,200	1,626.00	3,577,200	
ギークス	900	503.00	452,700	
アンビスホールディングス	16,100	2,755.00	44,355,500	
カープスホールディングス	41,100	751.00	30,866,100	
フォーラムエンジニアリング	20,500	797.00	16,338,500	
FAST FITNESS JAPAN	5,100	1,104.00	5,630,400	
日本車輛製造	4,800	2,286.00	10,972,800	
三菱ロジスネクスト	23,300	1,564.00	36,441,200	
近畿車輛	900	2,007.00	1,806,300	
一家ホールディングス	1,700	704.00	1,196,800	
フルサト・マルカホールディングス	13,800	2,471.00	34,099,800	
ヤマエグループホールディングス	8,700	3,105.00	27,013,500	
ジャパングラフトホールディングス	4,900	168.00	823,200	
F P G	48,700	1,776.00	86,491,200	
島根銀行	1,900	518.00	984,200	
じもとホールディングス	5,600	563.00	3,152,800	
全国保証	37,700	5,481.00	206,633,700	
めぶきフィナンシャルグループ	714,500	433.10	309,449,950	
ジャパンインベストメントアドバイザー	23,400	945.00	22,113,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,400	4,180.00	76,912,000	
九州フィナンシャルグループ	278,700	958.50	267,133,950	
かんぽ生命保険	146,600	2,735.00	400,951,000	
ゆうちょ銀行	1,582,400	1,503.50	2,379,138,400	
あんしん保証	2,900	250.00	725,000	
富山第一銀行	45,700	849.00	38,799,300	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	772,700	699.70	540,658,190	
ジェイリース	4,300	2,331.00	10,023,300	
西日本フィナンシャルホールディングス	81,300	1,708.00	138,860,400	
イントラスト	2,500	785.00	1,962,500	

日本モーゲージサービス	3,500	533.00	1,865,500	
C A S A	2,500	831.00	2,077,500	
S B I アルヒ	13,800	909.00	12,544,200	
プレミアムグループ	24,300	1,686.00	40,969,800	
日産自動車	1,973,100	614.10	1,211,680,710	
いすゞ自動車	425,100	2,044.00	868,904,400	
トヨタ自動車	8,028,600	3,260.00	26,173,236,000	
日野自動車	219,900	466.00	102,473,400	
三菱自動車工業	570,400	455.70	259,931,280	
エフテック	4,500	687.00	3,091,500	
レシップホールディングス	2,800	671.00	1,878,800	
GMB	1,300	1,258.00	1,635,400	
ファルテック	1,300	559.00	726,700	
武蔵精密工業	35,700	1,719.00	61,368,300	
日産車体	14,800	981.00	14,518,800	
新明和工業	42,100	1,166.00	49,088,600	
極東開発工業	24,200	2,397.00	58,007,400	
トピー工業	11,900	2,930.00	34,867,000	
ティラド	3,200	3,775.00	12,080,000	
曙ブレーキ工業	89,100	114.00	10,157,400	
タチエス	27,000	1,980.00	53,460,000	
NOK	56,800	2,052.00	116,553,600	
フタバ産業	39,200	979.00	38,376,800	
カヤバ	14,100	5,040.00	71,064,000	
市光工業	26,400	602.00	15,892,800	
大同メタル工業	28,600	571.00	16,330,600	
プレス工業	58,400	673.00	39,303,200	
ミクニ	8,200	501.00	4,108,200	
太平洋工業	33,500	1,496.00	50,116,000	
河西工業	10,300	188.00	1,936,400	
アイシン	112,800	5,278.00	595,358,400	
マツダ	483,600	1,902.00	919,807,200	
今仙電機製作所	4,100	750.00	3,075,000	
本田技研工業	3,565,600	1,710.50	6,098,958,800	
スズキ	268,500	7,235.00	1,942,597,500	
S U B A R U	453,400	3,095.00	1,403,273,000	
安永	2,800	682.00	1,909,600	
ヤマハ発動機	631,900	1,419.50	896,982,050	
小糸製作所	151,500	2,018.00	305,727,000	
T B K	7,000	423.00	2,961,000	
エクセディ	23,900	2,875.00	68,712,500	
ミツバ	27,400	1,128.00	30,907,200	
豊田合成	41,900	2,953.00	123,730,700	
愛三工業	24,200	1,458.00	35,283,600	
盟和産業	900	1,035.00	931,500	
日本プラスト	5,500	605.00	3,327,500	
ヨロズ	13,700	998.00	13,672,600	
エフ・シー・シー	25,900	2,090.00	54,131,000	
新家工業	1,500	3,205.00	4,807,500	
シマノ	59,100	21,075.00	1,245,532,500	

テイ・エス テック	52,000	1,934.00	100,568,000	
三十三フィナンシャルグループ	12,900	1,907.00	24,600,300	
第四北越フィナンシャルグループ	22,600	4,045.00	91,417,000	
ひろぎんホールディングス	205,000	983.00	201,515,000	
マーキュリアホールディングス	3,300	715.00	2,359,500	
おきなわフィナンシャルグループ	12,300	2,482.00	30,528,600	
ダイレクトマーケティングミックス	15,500	442.00	6,851,000	
ポピンズ	2,200	1,364.00	3,000,800	
L I T A L I C O	11,700	2,167.00	25,353,900	
コンフィデンス・インターワークス	600	1,605.00	963,000	
十六フィナンシャルグループ	18,700	4,175.00	78,072,500	
北國フィナンシャルホールディングス	15,200	4,250.00	64,600,000	
ネットプロテクションズホールディングス	47,700	156.00	7,441,200	
プロクレアホールディングス	16,500	1,841.00	30,376,500	
F P パートナー	2,900	6,500.00	18,850,000	
あいちフィナンシャルグループ	22,200	2,597.00	57,653,400	
ジャムコ	7,100	1,520.00	10,792,000	
小野建	15,400	1,850.00	28,490,000	
はるやまホールディングス	3,300	596.00	1,966,800	
南陽	1,400	2,216.00	3,102,400	
ノジマ	44,900	1,608.00	72,199,200	
佐島電機	8,600	2,324.00	19,986,400	
カップ・クリエイト	24,300	1,725.00	41,917,500	
エコートレーディング	1,300	1,233.00	1,602,900	
伯東	8,900	5,820.00	51,798,000	
コンドーテック	11,900	1,210.00	14,399,000	
中山福	3,900	361.00	1,407,900	
ライトオン	5,200	417.00	2,168,400	
ナガイレーベン	19,600	2,344.00	45,942,400	
三菱食品	14,300	5,080.00	72,644,000	
良品計画	168,900	2,113.00	356,885,700	
パリミキホールディングス	8,600	491.00	4,222,600	
松田産業	11,800	2,646.00	31,222,800	
第一興商	59,900	2,008.00	120,279,200	
メディバルホールディングス	157,300	2,372.50	373,194,250	
アドヴァングループ	14,700	1,062.00	15,611,400	
S P K	6,900	2,012.00	13,882,800	
萩原電気ホールディングス	6,600	5,150.00	33,990,000	
アルビス	5,000	2,669.00	13,345,000	
アズワン	24,200	5,497.00	133,027,400	
スズデン	5,400	2,245.00	12,123,000	
尾家産業	1,600	1,841.00	2,945,600	
シモジマ	10,400	1,296.00	13,478,400	
ドウシシャ	14,300	2,123.00	30,358,900	
小津産業	1,500	1,653.00	2,479,500	
コナカ	7,400	425.00	3,145,000	
高速	9,200	2,356.00	21,675,200	
ハウス オブ ローゼ	900	1,619.00	1,457,100	
G－7ホールディングス	16,900	1,389.00	23,474,100	

たけびし	5,900	2,010.00	11,859,000	
イオン北海道	45,700	931.00	42,546,700	
コジマ	25,600	734.00	18,790,400	
ヒマラヤ	2,200	935.00	2,057,000	
コーナン商事	19,000	3,960.00	75,240,000	
ネットワンシステムズ	59,200	2,704.50	160,106,400	
エコス	5,700	2,515.00	14,335,500	
ワタミ	16,400	1,013.00	16,613,200	
マルシェ	2,500	243.00	607,500	
リックス	2,600	3,570.00	9,282,000	
システムソフト	50,800	58.00	2,946,400	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	312,400	3,305.00	1,032,482,000	
丸文	13,800	1,544.00	21,307,200	
西松屋チェーン	30,400	2,134.00	64,873,600	
ゼンショーホールディングス	78,800	7,361.00	580,046,800	
ハピネット	13,200	2,841.00	37,501,200	
幸楽苑ホールディングス	11,400	1,314.00	14,979,600	
ハークスレイ	2,400	908.00	2,179,200	
橋本総業ホールディングス	6,100	1,298.00	7,917,800	
日本ライフライン	45,400	1,311.00	59,519,400	
サイゼリヤ	22,900	4,885.00	111,866,500	
タカショー	13,500	497.00	6,709,500	
V Tホールディングス	58,800	532.00	31,281,600	
アルゴグラフィックス	13,500	4,150.00	56,025,000	
魚力	5,400	2,416.00	13,046,400	
I D O M	40,900	903.00	36,932,700	
日本エム・ディ・エム	11,600	728.00	8,444,800	
ポプラ	1,800	244.00	439,200	
フジ・コーポレーション	7,400	1,769.00	13,090,600	
ユナイテッドアローズ	18,200	1,960.00	35,672,000	
進和	9,500	2,435.00	23,132,500	
エスケイジャパン	1,700	710.00	1,207,000	
ダイトロン	6,100	3,080.00	18,788,000	
ハイデイ日高	22,900	2,860.00	65,494,000	
シークス	22,000	1,561.00	34,342,000	
YU-WA CREATION HOLDINGS	3,700	145.00	536,500	
コロワイド	66,500	2,316.50	154,047,250	
田中商事	1,900	829.00	1,575,100	
オーハシテクニカ	8,100	1,865.00	15,106,500	
壱番屋	12,200	6,290.00	76,738,000	
白銅	4,500	2,465.00	11,092,500	
トップカルチャー	2,200	157.00	345,400	
P L A N T	1,500	1,615.00	2,422,500	
スギホールディングス	31,200	6,981.00	217,807,200	
ダイコー通産	700	1,208.00	845,600	
薬王堂ホールディングス	7,600	2,564.00	19,486,400	
島津製作所	194,300	3,862.00	750,386,600	
J M S	13,400	522.00	6,994,800	

クボテック	1,800	255.00	459,000	
長野計器	10,600	2,297.00	24,348,200	
ブイ・テクノロジー	7,700	2,690.00	20,713,000	
スター精密	27,500	1,732.00	47,630,000	
東京計器	11,200	1,857.00	20,798,400	
愛知時計電機	6,300	2,588.00	16,304,400	
インターアクション	8,800	1,125.00	9,900,000	
オーバル	5,700	544.00	3,100,800	
東京精密	29,900	9,486.00	283,631,400	
マニー	58,500	2,055.00	120,217,500	
ニコン	211,400	1,509.50	319,108,300	
トプコン	71,100	1,716.50	122,043,150	
オリンパス	900,000	2,145.00	1,930,500,000	
理研計器	10,400	7,930.00	82,472,000	
S C R E E Nホールディングス	50,000	16,345.00	817,250,000	
キャノン電子	16,200	2,081.00	33,712,200	
タムロン	9,000	5,730.00	51,570,000	
H O Y A	287,800	18,400.00	5,295,520,000	
シード	3,300	802.00	2,646,600	
ノーリツ鋼機	13,900	3,280.00	45,592,000	
A&Dホロンホールディングス	21,300	2,120.00	45,156,000	
朝日インテック	178,200	2,891.00	515,176,200	
キャノン	729,300	4,087.00	2,980,649,100	
リコー	366,600	1,269.50	465,398,700	
シチズン時計	134,500	973.00	130,868,500	
リズム	1,500	3,570.00	5,355,000	
大研医器	5,600	541.00	3,029,600	
メニコン	50,300	2,127.50	107,013,250	
シンシア	800	586.00	468,800	
K Y O R I T S U	9,700	202.00	1,959,400	
中本パックス	2,100	1,736.00	3,645,600	
スノーピーク	20,800	851.00	17,700,800	
パラマウントベッドホールディングス	30,400	2,665.00	81,016,000	
トランザクション	9,600	2,464.00	23,654,400	
粧美堂	1,800	777.00	1,398,600	
ニホンフラッシュ	13,700	957.00	13,110,900	
前田工繊	12,400	3,125.00	38,750,000	
永大産業	7,500	236.00	1,770,000	
アートネイチャー	13,200	797.00	10,520,400	
フルヤ金属	3,500	9,340.00	32,690,000	
バンダイナムコホールディングス	400,600	3,026.00	1,212,215,600	
アイフィスジャパン	1,900	603.00	1,145,700	
S H O E I	33,100	1,952.00	64,611,200	
フランスベッドホールディングス	19,000	1,392.00	26,448,000	
マーベラス	23,800	741.00	17,635,800	
パイロットコーポレーション	20,600	4,006.00	82,523,600	
萩原工業	9,800	1,489.00	14,592,200	
エイベックス	25,000	1,409.00	35,225,000	
フジシールインターナショナル	29,600	1,740.00	51,504,000	
タカラトミー	66,600	2,379.50	158,474,700	

広済堂ホールディングス	37,600	739.00	27,786,400	
エステールホールディングス	1,700	655.00	1,113,500	
レック	18,800	1,044.00	19,627,200	
タカノ	2,400	1,005.00	2,412,000	
三光合成	18,500	668.00	12,358,000	
プロネクス	15,200	1,271.00	19,319,200	
ホクシン	4,800	115.00	552,000	
ウッドワン	2,400	1,027.00	2,464,800	
きもと	10,700	211.00	2,257,700	
TOPPANホールディングス	179,700	3,940.00	708,018,000	
大日本印刷	159,800	4,185.00	668,763,000	
共同印刷	4,100	3,400.00	13,940,000	
NISSHA	25,000	1,580.00	39,500,000	
光村印刷	500	1,558.00	779,000	
藤森工業	11,600	4,005.00	46,458,000	
ヴィア・ホールディングス	10,200	153.00	1,560,600	
TAKARA & COMPANY	8,600	2,832.00	24,355,200	
前澤化成工業	9,400	1,605.00	15,087,000	
未来工業	5,300	4,895.00	25,943,500	
アシックス	124,600	4,700.00	585,620,000	
ツツミ	2,400	2,175.00	5,220,000	
ウェーブロックホールディングス	2,400	681.00	1,634,400	
JSP	10,300	2,136.00	22,000,800	
ニチハ	18,400	3,305.00	60,812,000	
ローランド	10,800	4,830.00	52,164,000	
エフピコ	27,700	2,948.00	81,659,600	
小松ウオール工業	6,000	3,235.00	19,410,000	
ヤマハ	92,200	3,437.00	316,891,400	
河合楽器製作所	4,400	3,505.00	15,422,000	
クリナップ	14,300	776.00	11,096,800	
ビジョン	93,100	1,606.50	149,565,150	
天馬	10,700	2,308.00	24,695,600	
キングジム	13,000	871.00	11,323,000	
象印マホービン	39,700	1,421.00	56,413,700	
リンテック	29,400	2,793.00	82,114,200	
信越ポリマー	31,600	1,610.00	50,876,000	
東リ	14,400	399.00	5,745,600	
イトーキ	30,000	1,564.00	46,920,000	
任天堂	923,100	8,369.00	7,725,423,900	
三菱鉛筆	20,800	1,971.00	40,996,800	
松風	6,600	2,685.00	17,721,000	
タカラスタンダード	30,800	1,881.00	57,934,800	
コクヨ	59,900	2,363.50	141,573,650	
ナカバヤシ	15,700	540.00	8,478,000	
ニフコ	43,900	3,792.00	166,468,800	
立川ブラインド工業	6,800	1,482.00	10,077,600	
グローブライド	13,100	2,080.00	27,248,000	
オカムラ	44,100	2,177.00	96,005,700	
バルカー	12,300	4,240.00	52,152,000	
MUTOHホールディングス	900	2,083.00	1,874,700	

伊藤忠商事	1,039,900	6,736.00	7,004,766,400	
丸紅	1,289,800	2,386.00	3,077,462,800	
スクロール	23,000	968.00	22,264,000	
高島	4,700	1,354.00	6,363,800	
ヨンドシーホールディングス	14,600	1,971.00	28,776,600	
三陽商会	5,500	2,833.00	15,581,500	
長瀬産業	70,900	2,406.50	170,620,850	
ナイガイ	2,100	261.00	548,100	
蝶理	9,700	2,951.00	28,624,700	
豊田通商	135,500	9,300.00	1,260,150,000	
オンワードホールディングス	86,300	542.00	46,774,600	
三共生興	21,500	779.00	16,748,500	
兼松	64,700	2,326.00	150,492,200	
美津濃	14,500	4,410.00	63,945,000	
ツカモトコーポレーション	1,000	1,224.00	1,224,000	
ルックホールディングス	4,100	2,688.00	11,020,800	
三井物産	1,165,600	5,840.00	6,807,104,000	
日本紙パルプ商事	7,400	5,070.00	37,518,000	
東京エレクトロン	309,500	28,480.00	8,814,560,000	
カメイ	16,400	1,921.00	31,504,400	
東都水産	400	6,400.00	2,560,000	
ＯＵＧホールディングス	1,000	2,435.00	2,435,000	
スターゼン	10,700	2,725.00	29,157,500	
セイコーグループ	20,400	2,688.00	54,835,200	
山善	46,900	1,257.00	58,953,300	
椿本興業	3,100	6,820.00	21,142,000	
住友商事	936,300	3,357.00	3,143,159,100	
B I P R O G Y	48,000	4,495.00	215,760,000	
内田洋行	6,300	7,830.00	49,329,000	
三菱商事	3,065,300	2,782.00	8,527,664,600	
第一実業	14,600	1,870.00	27,302,000	
キヤノンマーケティングジャパン	35,800	4,334.00	155,157,200	
西華産業	6,100	3,210.00	19,581,000	
佐藤商事	10,900	1,699.00	18,519,100	
菱洋エレクトロ	14,700	3,865.00	56,815,500	
東京産業	14,100	749.00	10,560,900	
ユアサ商事	12,100	4,965.00	60,076,500	
神鋼商事	3,900	6,750.00	26,325,000	
トルク	3,700	294.00	1,087,800	
阪和興業	27,800	5,390.00	149,842,000	
正栄食品工業	10,300	4,575.00	47,122,500	
カナデン	11,600	1,500.00	17,400,000	
RYODEN	12,500	2,632.00	32,900,000	
ニプロ	121,900	1,201.50	146,462,850	
岩谷産業	35,200	6,992.00	246,118,400	
ナイス	2,100	1,587.00	3,332,700	
ニチモウ	2,200	2,251.00	4,952,200	
極東貿易	9,200	2,224.00	20,460,800	
アステナホールディングス	29,000	472.00	13,688,000	
三愛オブリ	37,200	1,730.00	64,356,000	

稲畑産業	30,600	3,160.00	96,696,000	
G S I クレオス	8,300	2,387.00	19,812,100	
明和産業	18,300	718.00	13,139,400	
クワザワホールディングス	2,500	702.00	1,755,000	
キムラタン	42,800	18.00	770,400	
ゴールドウイン	25,900	9,427.00	244,159,300	
ユニ・チャーム	305,500	5,255.00	1,605,402,500	
デサント	25,200	3,300.00	83,160,000	
キング	2,500	696.00	1,740,000	
ワキタ	25,600	1,596.00	40,857,600	
ヤマトインターナショナル	5,100	303.00	1,545,300	
東邦ホールディングス	42,800	3,187.00	136,403,600	
サンゲツ	35,600	3,260.00	116,056,000	
ミツウロコグループホールディングス	19,800	1,634.00	32,353,200	
シナネンホールディングス	4,300	4,100.00	17,630,000	
伊藤忠エネクス	38,400	1,558.00	59,827,200	
サンリオ	43,800	6,269.00	274,582,200	
サンワ テクノス	7,900	2,256.00	17,822,400	
リョーサン	10,900	4,995.00	54,445,500	
新光商事	20,800	1,215.00	25,272,000	
トーヨー	6,000	2,944.00	17,664,000	
三信電気	6,200	2,317.00	14,365,400	
東陽テクニカ	15,700	1,451.00	22,780,700	
モスフードサービス	22,800	3,440.00	78,432,000	
加賀電子	14,100	6,790.00	95,739,000	
三益半導体工業	13,600	3,205.00	43,588,000	
都築電気	7,700	2,421.00	18,641,700	
ソーダニッカ	13,100	1,177.00	15,418,700	
立花エレテック	10,300	3,120.00	32,136,000	
木曽路	23,400	2,614.00	61,167,600	
S R S ホールディングス	25,500	1,171.00	29,860,500	
千趣会	28,400	276.00	7,838,400	
リテールパートナーズ	23,000	1,737.00	39,951,000	
上新電機	15,300	2,376.00	36,352,800	
日本瓦斯	82,000	2,386.50	195,693,000	
ロイヤルホールディングス	27,300	2,548.00	69,560,400	
東天紅	500	843.00	421,500	
いなげや	15,000	1,274.00	19,110,000	
チョダ	14,800	895.00	13,246,000	
ライフコーポレーション	16,200	3,765.00	60,993,000	
リンガーハット	20,000	2,403.00	48,060,000	
M r M a x H D	19,500	630.00	12,285,000	
テンアライド	9,100	317.00	2,884,700	
A O K I ホールディングス	33,200	1,188.00	39,441,600	
オークワ	22,200	902.00	20,024,400	
コメリ	23,800	3,260.00	77,588,000	
青山商事	33,100	1,821.00	60,275,100	
しまむら	18,200	16,125.00	293,475,000	
はせがわ	3,300	361.00	1,191,300	
高島屋	106,900	2,202.00	235,393,800	

松屋	26,200	968.00	25,361,600	
エイチ・ツー・オー リテイリング	68,500	1,818.00	124,533,000	
近鉄百貨店	6,600	2,570.00	16,962,000	
丸井グループ	102,700	2,436.00	250,177,200	
クレディセゾン	91,300	2,721.00	248,427,300	
アクシアル リテイリング	10,600	3,925.00	41,605,000	
井筒屋	3,200	356.00	1,139,200	
イオン	524,400	3,583.00	1,878,925,200	
イズミ	27,400	3,487.00	95,543,800	
フォーバル	6,100	1,382.00	8,430,200	
平和堂	25,900	2,214.00	57,342,600	
フジ	23,700	1,955.00	46,333,500	
ヤオコー	17,500	8,553.00	149,677,500	
ゼビオホールディングス	21,000	1,004.00	21,084,000	
ケーズホールディングス	103,900	1,302.00	135,277,800	
PALTAC	20,900	4,386.00	91,667,400	
三谷産業	27,000	387.00	10,449,000	
Olympicグループ	3,000	548.00	1,644,000	
日産東京販売ホールディングス	10,300	494.00	5,088,200	
あおぞら銀行	103,500	2,183.50	225,992,250	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,769,700	1,404.00	12,312,658,800	
りそなホールディングス	1,679,200	813.60	1,366,197,120	
三井住友トラスト・ホールディングス	517,500	2,901.50	1,501,526,250	
三井住友フィナンシャルグループ	1,023,900	7,687.00	7,870,719,300	
千葉銀行	401,300	1,092.00	438,219,600	
群馬銀行	279,500	764.60	213,705,700	
武蔵野銀行	20,100	2,715.00	54,571,500	
千葉興業銀行	27,200	851.00	23,147,200	
筑波銀行	63,100	242.00	15,270,200	
七十七銀行	41,900	3,675.00	153,982,500	
秋田銀行	9,600	2,046.00	19,641,600	
山形銀行	16,000	1,123.00	17,968,000	
岩手銀行	9,100	2,495.00	22,704,500	
東邦銀行	113,700	310.00	35,247,000	
東北銀行	3,100	1,234.00	3,825,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	125,400	3,698.00	463,729,200	
スルガ銀行	126,900	806.00	102,281,400	
八十二銀行	309,000	793.80	245,284,200	
山梨中央銀行	16,100	1,715.00	27,611,500	
大垣共立銀行	27,400	1,956.00	53,594,400	
福井銀行	12,900	1,733.00	22,355,700	
清水銀行	5,700	1,567.00	8,931,900	
富山銀行	1,100	1,726.00	1,898,600	
滋賀銀行	24,000	3,835.00	92,040,000	
南都銀行	21,700	2,626.00	56,984,200	
百五銀行	135,500	561.00	76,015,500	
紀陽銀行	51,500	1,732.00	89,198,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	89,100	1,588.50	141,535,350	
山陰合同銀行	90,200	1,017.00	91,733,400	
鳥取銀行	2,200	1,403.00	3,086,600	

百十四銀行	14,200	2,725.00	38,695,000	
四国銀行	21,200	1,059.00	22,450,800	
阿波銀行	20,200	2,391.00	48,298,200	
大分銀行	8,700	2,658.00	23,124,600	
宮崎銀行	8,700	2,742.00	23,855,400	
佐賀銀行	8,500	1,936.00	16,456,000	
琉球銀行	30,700	1,141.00	35,028,700	
セブン銀行	451,400	303.10	136,819,340	
みずほフィナンシャルグループ	1,943,700	2,720.00	5,286,864,000	
高知銀行	2,200	936.00	2,059,200	
山口フィナンシャルグループ	141,200	1,435.50	202,692,600	
芙蓉総合リース	13,300	13,525.00	179,882,500	
みずほリース	24,100	5,480.00	132,068,000	
東京センチュリー	107,600	1,631.00	175,495,600	
SBIホールディングス	211,000	3,775.00	796,525,000	
日本証券金融	52,900	1,562.00	82,629,800	
アイフル	212,000	384.00	81,408,000	
日本アジア投資	4,700	280.00	1,316,000	
名古屋銀行	9,300	5,650.00	52,545,000	
北洋銀行	218,200	377.00	82,261,400	
大光銀行	2,100	1,396.00	2,931,600	
愛媛銀行	19,400	1,039.00	20,156,600	
トマト銀行	2,300	1,210.00	2,783,000	
京葉銀行	60,400	709.00	42,823,600	
栃木銀行	71,900	306.00	22,001,400	
北日本銀行	4,700	2,231.00	10,485,700	
東和銀行	26,400	657.00	17,344,800	
福島銀行	6,600	232.00	1,531,200	
大東銀行	2,700	746.00	2,014,200	
リコーリース	13,700	5,050.00	69,185,000	
イオンフィナンシャルサービス	82,700	1,338.50	110,693,950	
アコム	257,100	362.80	93,275,880	
ジャックス	15,300	5,520.00	84,456,000	
オリエントコーポレーション	47,000	1,065.00	50,055,000	
オリックス	877,700	2,877.00	2,525,142,900	
三菱HCキャピタル	641,600	1,045.50	670,792,800	
ジャフコグループ	42,900	1,732.00	74,302,800	
九州リースサービス	2,600	1,197.00	3,112,200	
トモニホールディングス	136,300	391.00	53,293,300	
大和証券グループ本社	1,115,500	1,007.50	1,123,866,250	
野村ホールディングス	2,421,500	807.70	1,955,845,550	
岡三証券グループ	126,500	705.00	89,182,500	
丸三証券	47,900	922.00	44,163,800	
東洋証券	38,200	331.00	12,644,200	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	171,000	570.00	97,470,000	
光世証券	1,400	587.00	821,800	
水戸証券	42,500	451.00	19,167,500	
いちよし証券	27,000	748.00	20,196,000	
松井証券	70,900	850.00	60,265,000	

SOMPOホールディングス	216,600	7,695.00	1,666,737,000
日本取引所グループ	375,700	3,325.00	1,249,202,500
マネックスグループ	141,000	730.00	102,930,000
極東証券	19,700	998.00	19,660,600
岩井コスモホールディングス	16,400	2,113.00	34,653,200
アイザワ証券グループ	20,800	1,210.00	25,168,000
フィデアホールディングス	14,900	1,582.00	23,571,800
池田泉州ホールディングス	199,700	345.00	68,896,500
アニコムホールディングス	48,900	583.00	28,508,700
MS&ADインシュアランスグループ ホールディングス	322,400	5,991.00	1,931,498,400
マネーパートナーズグループ	6,700	298.00	1,996,600
スパークス・グループ	16,100	1,772.00	28,529,200
小林洋行	2,900	255.00	739,500
第一生命ホールディングス	703,600	3,065.00	2,156,534,000
東京海上ホールディングス	1,423,400	3,878.00	5,519,945,200
アドバンテッジリスクマネジメント	3,400	455.00	1,547,000
イー・ギャランティ	23,400	1,849.00	43,266,600
アサックス	3,000	719.00	2,157,000
NECキャピタルソリューション	7,100	3,605.00	25,595,500
T&Dホールディングス	386,700	2,334.50	902,751,150
アドバンスクリエイト	8,300	1,029.00	8,540,700
三井不動産	665,900	3,997.00	2,661,602,300
三菱地所	941,300	2,098.00	1,974,847,400
平和不動産	23,400	3,770.00	88,218,000
東京建物	125,800	2,222.50	279,590,500
京阪神ビルディング	26,900	1,413.00	38,009,700
住友不動産	208,200	4,771.00	993,322,200
太平洋興発	2,500	834.00	2,085,000
テーオーシー	25,700	669.00	17,193,300
レオパレス21	144,100	393.00	56,631,300
スターツコーポレーション	20,700	3,010.00	62,307,000
フジ住宅	18,100	712.00	12,887,200
空港施設	20,300	617.00	12,525,100
明和地所	8,200	1,316.00	10,791,200
ゴールドクレスト	11,700	2,302.00	26,933,400
リログループ	75,300	1,575.50	118,635,150
エスリード	6,800	3,400.00	23,120,000
日神グループホールディングス	23,100	503.00	11,619,300
日本エスコン	26,900	988.00	26,577,200
MIRARTHホールディングス	66,100	502.00	33,182,200
AVANTIA	3,500	904.00	3,164,000
イオンモール	74,600	1,853.50	138,271,100
毎日コムネット	2,400	743.00	1,783,200
ファースト住建	2,500	1,108.00	2,770,000
ランド	798,500	7.00	5,589,500
カチタス	38,700	1,784.00	69,040,800
東祥	10,500	777.00	8,158,500
トーセイ	24,000	2,035.00	48,840,000
穴吹興産	1,500	2,132.00	3,198,000

サンフロンティア不動産	21,300	1,718.00	36,593,400
FJネクストホールディングス	15,200	1,286.00	19,547,200
インテリックス	1,500	565.00	847,500
ランドビジネス	2,400	276.00	662,400
サンネクスタグループ	2,100	956.00	2,007,600
グランディハウス	10,800	658.00	7,106,400
東武鉄道	160,600	3,915.00	628,749,000
相鉄ホールディングス	52,300	2,832.50	148,139,750
東急	410,000	1,719.50	704,995,000
京浜急行電鉄	180,900	1,295.00	234,265,500
小田急電鉄	241,800	2,205.50	533,289,900
京王電鉄	70,300	4,188.00	294,416,400
京成電鉄	94,300	6,900.00	650,670,000
富士急行	18,000	4,365.00	78,570,000
東日本旅客鉄道	268,600	9,000.00	2,417,400,000
西日本旅客鉄道	173,400	6,415.00	1,112,361,000
東海旅客鉄道	563,200	3,772.00	2,124,390,400
西武ホールディングス	176,900	2,120.00	375,028,000
鴻池運輸	24,900	1,907.00	47,484,300
西日本鉄道	39,100	2,462.00	96,264,200
ハマキョウレックス	12,500	4,015.00	50,187,500
サカイ引越センター	16,200	2,643.00	42,816,600
近鉄グループホールディングス	146,000	4,501.00	657,146,000
阪急阪神ホールディングス	194,700	4,560.00	887,832,000
南海電気鉄道	65,100	2,978.00	193,867,800
京阪ホールディングス	80,500	3,589.00	288,914,500
神戸電鉄	4,000	2,877.00	11,508,000
名古屋鉄道	150,600	2,262.00	340,657,200
山陽電気鉄道	11,000	2,187.00	24,057,000
アルプス物流	11,700	1,889.00	22,101,300
トランコム	4,200	6,960.00	29,232,000
ヤマトホールディングス	186,900	2,416.00	451,550,400
山九	37,100	5,386.00	199,820,600
日新	11,100	2,694.00	29,903,400
丸運	3,700	280.00	1,036,000
丸全昭和運輸	9,000	4,150.00	37,350,000
センコーグループホールディングス	77,300	1,128.00	87,194,400
トナミホールディングス	3,200	4,645.00	14,864,000
ニッコンホールディングス	46,700	3,189.00	148,926,300
日本石油輸送	700	2,871.00	2,009,700
福山通運	16,700	4,270.00	71,309,000
セイノーホールディングス	82,100	2,159.50	177,294,950
エスライングループ本社	1,800	869.00	1,564,200
神奈川中央交通	4,000	3,110.00	12,440,000
AZ-COM丸和ホールディングス	37,300	1,522.00	56,770,600
C&Fロジホールディングス	14,100	1,755.00	24,745,500
日本郵船	418,400	4,895.00	2,048,068,000
商船三井	316,800	5,285.00	1,674,288,000
川崎汽船	117,200	7,025.00	823,330,000
NSユニテッド海運	7,900	5,090.00	40,211,000

明海グループ	7,100	779.00	5,530,900	
飯野海運	53,600	1,349.00	72,306,400	
共栄タンカー	1,200	1,021.00	1,225,200	
九州旅客鉄道	103,200	3,373.00	348,093,600	
S Gホールディングス	245,100	1,880.50	460,910,550	
N I P P O N E X P R E S S ホール ディングス	49,500	8,668.00	429,066,000	
I D & E ホールディングス	9,100	3,680.00	33,488,000	
日本航空	358,500	2,792.50	1,001,111,250	
A N A ホールディングス	397,200	3,242.00	1,287,722,400	
ビーウィズ	3,100	1,811.00	5,614,100	
パスコ	1,300	1,879.00	2,442,700	
T R E ホールディングス	28,800	1,261.00	36,316,800	
人・夢・技術グループ	5,700	1,896.00	10,807,200	
西本W i s m e t t a c ホールディン グス	3,900	6,390.00	24,921,000	
シルバーライフ	3,000	837.00	2,511,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	600	2,243.00	1,345,800	
G e n k y D r u g S t o r e s	6,800	6,430.00	43,724,000	
コーア商事ホールディングス	10,900	745.00	8,120,500	
K P P グループホールディングス	40,000	718.00	28,720,000	
ナルミヤ・インターナショナル	1,100	1,212.00	1,333,200	
ブックオフグループホールディングス	9,000	1,245.00	11,205,000	
ギフトホールディングス	6,500	2,810.00	18,265,000	
三菱倉庫	35,900	4,415.00	158,498,500	
三井倉庫ホールディングス	13,600	4,770.00	64,872,000	
住友倉庫	39,400	2,517.00	99,169,800	
澁澤倉庫	6,700	3,125.00	20,937,500	
ヤマタネ	6,800	2,455.00	16,694,000	
東陽倉庫	1,700	1,570.00	2,669,000	
乾汽船	17,100	1,074.00	18,365,400	
日本トランスシティ	29,400	633.00	18,610,200	
ケイヒン	1,100	1,932.00	2,125,200	
中央倉庫	7,800	1,162.00	9,063,600	
川西倉庫	1,300	1,126.00	1,463,800	
安田倉庫	10,000	1,211.00	12,110,000	
ファイズホールディングス	900	1,324.00	1,191,600	
N I S S O ホールディングス	13,000	819.00	10,647,000	
大栄環境	27,300	2,493.00	68,058,900	
日本管財ホールディングス	15,800	2,558.00	40,416,400	
東洋埠頭	1,900	1,392.00	2,644,800	
上組	67,400	3,392.00	228,620,800	
サンリツ	1,600	787.00	1,259,200	
キムラユニティー	3,100	1,623.00	5,031,300	
キューソー流通システム	6,600	915.00	6,039,000	
東海運	3,800	293.00	1,113,400	
エーアイテイー	9,200	1,854.00	17,056,800	
内外トランスライン	5,800	2,417.00	14,018,600	
ショーエイコーポレーション	2,100	614.00	1,289,400	
日本コンセプト	5,300	1,756.00	9,306,800	

TBSホールディングス	73,700	4,040.00	297,748,000	
日本テレビホールディングス	129,800	2,241.50	290,946,700	
朝日放送グループホールディングス	13,700	702.00	9,617,400	
テレビ朝日ホールディングス	35,600	2,205.00	78,498,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	113,900	833.00	94,878,700	
テレビ東京ホールディングス	10,600	3,315.00	35,139,000	
日本BS放送	2,400	911.00	2,186,400	
ビジョン	22,100	1,134.00	25,061,400	
スマートバリュー	1,900	395.00	750,500	
USEN-NEXT HOLDINGS	16,400	4,185.00	68,634,000	
ワイヤレスゲート	2,800	286.00	800,800	
日本通信	144,300	237.00	34,199,100	
クロップス	900	1,020.00	918,000	
日本電信電話	43,620,300	183.40	7,999,963,020	
KDDI	1,133,200	4,599.00	5,211,586,800	
ソフトバンク	2,360,000	1,944.50	4,589,020,000	
光通信	14,800	26,025.00	385,170,000	
エムティーアイ	10,100	614.00	6,201,400	
GMOインターネットグループ	54,200	2,615.00	141,733,000	
ファイバーゲート	7,900	936.00	7,394,400	
アイドママーケティングコミュニケーション	1,800	235.00	423,000	
KADOKAWA	77,500	3,238.00	250,945,000	
学研ホールディングス	24,400	1,010.00	24,644,000	
ゼンリン	25,100	854.00	21,435,400	
昭文社ホールディングス	2,900	372.00	1,078,800	
インプレスホールディングス	6,600	177.00	1,168,200	
東京電力ホールディングス	1,318,000	762.90	1,005,502,200	
中部電力	538,800	1,962.50	1,057,395,000	
関西電力	564,600	1,913.50	1,080,362,100	
中国電力	254,000	988.40	251,053,600	
北陸電力	149,500	710.90	106,279,550	
東北電力	384,900	1,004.50	386,632,050	
四国電力	136,200	1,034.00	140,830,800	
九州電力	337,000	1,155.50	389,403,500	
北海道電力	141,200	636.50	89,873,800	
沖縄電力	37,300	1,093.00	40,768,900	
電源開発	120,100	2,569.50	308,596,950	
エフオン	10,600	444.00	4,706,400	
イーレックス	26,000	769.00	19,994,000	
レノバ	39,000	1,223.00	47,697,000	
東京瓦斯	309,100	3,305.00	1,021,575,500	
大阪瓦斯	296,200	3,101.00	918,516,200	
東邦瓦斯	63,300	2,987.50	189,108,750	
北海道瓦斯	8,700	2,298.00	19,992,600	
広島ガス	30,900	394.00	12,174,600	
西部ガスホールディングス	15,300	1,897.00	29,024,100	
静岡ガス	29,200	1,020.00	29,784,000	
メタウォーター	17,500	2,130.00	37,275,000	

M&A総研ホールディングス	7,200	5,950.00	42,840,000	
アイネット	8,900	1,925.00	17,132,500	
松竹	7,600	10,205.00	77,558,000	
東宝	81,600	4,734.00	386,294,400	
エイチ・アイ・エス	43,700	1,774.00	77,523,800	
東映	4,800	20,130.00	96,624,000	
ラックランド	6,800	2,612.00	17,761,600	
NTTデータグループ	383,400	2,088.50	800,730,900	
共立メンテナンス	23,600	6,174.00	145,706,400	
イチネンホールディングス	16,000	1,596.00	25,536,000	
建設技術研究所	7,700	6,090.00	46,893,000	
スペース	9,800	945.00	9,261,000	
アインホールディングス	21,300	4,733.00	100,812,900	
燦ホールディングス	14,100	1,119.00	15,777,900	
ピー・シー・エー	8,400	1,578.00	13,255,200	
スバル興業	3,000	3,140.00	9,420,000	
東京テアトル	2,400	1,136.00	2,726,400	
タナベコンサルティンググループ	5,200	1,079.00	5,610,800	
ビジネスブレイン太田昭和	5,700	2,240.00	12,768,000	
ナガワ	4,700	7,190.00	33,793,000	
東京都競馬	12,600	4,580.00	57,708,000	
常磐興産	2,500	1,237.00	3,092,500	
カナモト	23,300	2,880.00	67,104,000	
D T S	30,900	3,645.00	112,630,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	67,000	6,218.00	416,606,000	
シーイーシー	18,500	1,659.00	30,691,500	
カプコン	131,100	5,634.00	738,617,400	
ニシオホールディングス	14,000	3,935.00	55,090,000	
アイ・エス・ビー	7,500	1,572.00	11,790,000	
アゴーラ ホスピタリティー グループ	43,400	23.00	998,200	
日本空港ビルデング	50,900	5,883.00	299,444,700	
トランス・コスモス	18,700	2,950.00	55,165,000	
乃村工藝社	65,600	868.00	56,940,800	
ジャステック	9,000	1,326.00	11,934,000	
S C S K	102,600	2,651.50	272,043,900	
藤田観光	6,000	6,700.00	40,200,000	
KNT-CTホールディングス	9,000	1,307.00	11,763,000	
トーカイ	13,300	2,121.00	28,209,300	
白洋舎	1,000	2,736.00	2,736,000	
セコム	153,100	10,710.00	1,639,701,000	
N S W	6,300	2,966.00	18,685,800	
セントラル警備保障	8,100	2,573.00	20,841,300	
アイネス	11,400	1,484.00	16,917,600	
丹青社	29,100	807.00	23,483,700	
メイテックグループホールディングス	54,100	3,044.00	164,680,400	
T K C	23,300	3,790.00	88,307,000	
富士ソフト	29,500	6,400.00	188,800,000	
応用地質	14,000	2,156.00	30,184,000	

船井総研ホールディングス	31,300	2,472.00	77,373,600	
N S D	52,300	2,684.00	140,373,200	
進学会ホールディングス	1,700	255.00	433,500	
丸紅建材リース	500	2,859.00	1,429,500	
オオバ	4,500	1,009.00	4,540,500	
コナミグループ	54,900	9,237.00	507,111,300	
いであ	1,800	2,130.00	3,834,000	
学究社	6,000	2,081.00	12,486,000	
ベネッセホールディングス	50,500	2,599.00	131,249,500	
イオンディライト	16,100	3,755.00	60,455,500	
ナック	12,800	542.00	6,937,600	
福井コンピュータホールディングス	9,100	2,554.00	23,241,400	
ダイセキ	30,700	4,035.00	123,874,500	
ステップ	5,500	2,016.00	11,088,000	
泉州電業	7,200	3,785.00	27,252,000	
元気寿司	8,700	3,560.00	30,972,000	
トラスコ中山	32,500	2,432.00	79,040,000	
ヤマダホールディングス	475,700	444.80	211,591,360	
オートバックスセブン	53,900	1,625.00	87,587,500	
モリト	11,100	1,416.00	15,717,600	
アークランズ	46,000	1,668.00	76,728,000	
ニトリホールディングス	56,300	19,695.00	1,108,828,500	
グルメ杵屋	12,600	1,079.00	13,595,400	
愛眼	5,000	183.00	915,000	
ケーユーホールディングス	7,300	1,199.00	8,752,700	
吉野家ホールディングス	57,000	3,282.00	187,074,000	
加藤産業	19,200	4,655.00	89,376,000	
北恵	1,700	861.00	1,463,700	
イノテック	9,700	1,868.00	18,119,600	
イエローハット	24,600	1,883.00	46,321,800	
松屋フーズホールディングス	7,300	5,610.00	40,953,000	
J B C Cホールディングス	9,700	3,930.00	38,121,000	
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	1,546.00	35,867,200	
日伝	10,500	2,724.00	28,602,000	
関西フードマーケット	10,500	1,529.00	16,054,500	
ミロク情報サービス	13,300	1,952.00	25,961,600	
北沢産業	4,200	310.00	1,302,000	
杉本商事	7,300	2,252.00	16,439,600	
因幡電機産業	40,100	3,500.00	140,350,000	
王将フードサービス	11,500	7,780.00	89,470,000	
ミニストップ	11,200	1,613.00	18,065,600	
アークス	28,400	2,914.00	82,757,600	
バローホールディングス	29,500	2,528.00	74,576,000	
東テク	5,100	6,570.00	33,507,000	
ミスミグループ本社	233,600	2,321.50	542,302,400	
アルテック	3,700	250.00	925,000	
ベルク	7,700	6,540.00	50,358,000	
大 庄	7,400	1,340.00	9,916,000	
タキヒヨー	1,600	1,206.00	1,929,600	

ファーストリテイリング	69,600	38,750.00	2,697,000,000	
ソフトバンクグループ	723,400	6,618.00	4,787,461,200	
蔵王産業	1,200	2,570.00	3,084,000	
スズケン	58,900	4,617.00	271,941,300	
サンドラッグ	52,200	4,479.00	233,803,800	
サックスパー ホールディングス	13,100	844.00	11,056,400	
ジェコス	9,300	1,192.00	11,085,600	
ヤマザワ	1,400	1,264.00	1,769,600	
やまや	1,500	3,295.00	4,942,500	
グローセル	18,100	748.00	13,538,800	
ベルーナ	37,200	617.00	22,952,400	
合計	226,079,000		528,947,749,730	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

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

独立監査人の中間監査報告書

2024年10月11日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 稲葉 宏和
業務執行社員

中間監査意見

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

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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】

【One DC 国内株式インデックスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

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

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

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

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

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

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第17期 2024年2月7日現在	第18期中間計算期間末 2024年8月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1789円 (21,789円)	2.1503円 (21,503円)

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年8月7日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,341,432,100
株式	496,694,668,800
派生商品評価勘定	291,570,170
未収入金	28,012,199,338
未収配当金	712,669,819
前払金	1,057,370,000
差入委託証拠金	1,360,947,173
流動資産合計	538,470,857,400
資産合計	538,470,857,400
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,015,583,450
未払解約金	10,720,704,000
流動負債合計	11,736,287,450
負債合計	11,736,287,450
純資産の部	
元本等	
元本	119,868,212,897
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	406,866,357,053
元本等合計	526,734,569,950
純資産合計	526,734,569,950
負債純資産合計	538,470,857,400

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	2024年8月7日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	121,842,817,407円
同期中追加設定元本額	17,251,514,017円
同期中一部解約元本額	19,226,118,527円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOPIXオープン	2,388,257,401円
たわらノーロード 国内株式くらっぷ専用>	5,811,937,837円
One DC 国内株式インデックスファンド	33,261,485,077円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,459,726,920円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	1,958,569円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	7,816,793円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	18,939,455円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	25,971,845円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	24,226,143円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	12,969,457円
たわらノーロード TOPIX	2,903,776,811円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,851,135,582円
たわらノーロード バランス（堅実型）	51,981,446円
たわらノーロード バランス（標準型）	420,473,037円
たわらノーロード バランス（積極型）	758,696,889円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	2,379,124円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	134,928,627円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	408,790,804円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	374,370,239円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	557,302,304円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	246,406円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,104,019円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	26,516,253円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	6,249,011円

たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	15,118,347円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（安定型）	10,674円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（バランス型）	31,556円
マスターズ・マルチアセット・ファンド（積極型）	52,580円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,012,109,573円
O n e グローバルバランス	79,324,596円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	850,970,215円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3,116,563,231円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3,809,741,494円
D I A M DC バランス 3 0 インデックスファンド	241,996,423円
D I A M DC バランス 5 0 インデックスファンド	851,939,319円
D I A M DC バランス 7 0 インデックスファンド	1,017,106,457円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	26,070,549円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	977,266,719円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	12,880,508円
D I A M DC 8 資産バランスファンド（新興国 1 0）	256,031,078円
D I A M DC 8 資産バランスファンド（新興国 2 0）	323,772,291円
D I A M DC 8 資産バランスファンド（新興国 3 0）	569,803,529円
投資のソムリエ	5,852,920,421円
クルーズコントロール	35,585,879円
投資のソムリエ<DC年金>	659,637,461円
D I A M 8 資産バランスファンドN<DC年金>	364,341,592円
4 資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,350,283,152円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	449,730,821円
リスク抑制世界 8 資産バランスファンド	1,320,305,172円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー 2 0 4 5）	87,190,652円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー 2 0 5 5）	45,187,006円
リスク抑制世界 8 資産バランスファンド（DC）	4,320,707円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー 2 0 3 5）	169,042,021円
4 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	560,537,771円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	189,500,191円
9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	215,380,618円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー 2 0 4 0）	83,112,314円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー 2 0 5 0）	49,223,152円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー 2 0 6 0）	30,014,895円
4 資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	660,129,702円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー 2 0 6 5）	7,688,024円
O n e グローバル最適化バランス（安定型）<ラップ向け>	998,332円
O n e グローバル最適化バランス（成長型）<ラップ向け>	29,139,124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）	19,340,158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）	19,300,226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）	1,374,895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）	11,642,697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）	21,170,803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）	48,872,454円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナル	63,099,453円

ヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	13,339,591円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (内外株式債券型・シグナルヘッジ付き) 2022-05 (適格機関投資家限定)	56,923,651円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (日米資産投資・シグナルヘッジ付き) 2022-10 (適格機関投資家限定)	346,171,924円
予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	32,013,935円
マルチアセット・インカム戦略ファンド (日米資産投資・シグナルヘッジ付き) 2024-05 (適格機関投資家限定)	348,588,445円
投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	98,892,256円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	981,164円
DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	20,282,286円
日米資産配分戦略ファンド (インカム重視型) (為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	35,824,908円
インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	32,069,355円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	3,360,141円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	31,558,641円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	57,656,041円
DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,410,106円
DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	9,125,908円
DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,846,683円
DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	76,013円
DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	509,693円
DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,481,342円
DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	230,509,323円
DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	353,719,988円
DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,098,390,404円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	9,459,792円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	12,623,430円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	119,096,905円
DIAM世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	23,471,923円
DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	49,836円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	113,893,631円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	6,884,335円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	28,666,571円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	58,889,120円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	115,801,110円
DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	15,265,822円
DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	5,873,361円
動的パッケージファンド<DC年金>	18,137,220円
コア資産形成ファンド	8,629,417円
MHAMトピックスファンド	773,467,291円
MHAM TOPIXファンドVA (適格機関投資家専用)	43,995,562円

MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	2,048,816,523円
MHAM日本株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	2,432,424,737円
計	119,868,212,897円
2. 受益権の総数	119,868,212,897口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

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

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

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

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2024年8月30日現在

I 資産総額	162,974,908,062円
II 負債総額	324,666,592円
III 純資産総額（I－II）	162,650,241,470円
IV 発行済数量	69,392,819,234口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.3439円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2024年8月30日現在

I 資産総額	587,744,531,053円
II 負債総額	844,065,274円
III 純資産総額（I－II）	586,900,465,779円
IV 発行済数量	122,512,674,820口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	4.7905円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認め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8月30日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2024年8月30日現在）

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. 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

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

3【委託会社等の経理状況】

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

収益の構成は次の通りです。

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

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

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
One DC 国内株式インデックスファンド
約款

運用の基本方針

約款第19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、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

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」ということがあります。）受益証券を主要投資対象とします。

(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）・マザーファンド受益証券に投資し、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。

2) 株式（株価指数先物取引を含みます。）の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

3) 株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。

4) 有価証券等の効率的な運用に資するため、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。

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

(3) 投資制限

1) マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。

2) 株式への実質投資割合には、制限を設けません。

3) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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。

3. 収益分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

追加型証券投資信託
One DC 国内株式インデックスファンド
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この投資信託は、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)(以下「信託法」といいます。)の適用を受けます。

<信託事務の委託>

第2条 受託者は、信託法第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、金額>

第3条 委託者は、金100万円を、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。

<信託金の限度額>

第4条 委託者は、受託者と合意の上、金1兆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ます。

②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。

③委託者は、受託者と合意のうえ、第1項の限度額を変更することができます。

<信託期間>

第5条 この信託の期間は、信託契約締結日から第48条第1項、第49条第1項、第50条第1項および第52条第2項の規定による信託終了の日までとします。

<受益権の取得申込みの勧誘の種類>

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

<受益権の分割および再分割>

第7条 委託者は、第3条第1項によって生じた受益権については100万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、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、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。

<当初の受益者>

第8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7条第1項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。

<追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法>

第9条 追加信託金は、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係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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金、その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- ③第27条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<信託日時異なる受益権の内容>

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

<受益権の帰属と受益証券の不発行>

第11条 この信託のすべての受益権は、社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、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）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7条第1項の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

<受益権の設定に係る受託者の通知>

第12条 受託者は、信託契約締結時に生じた受益権については信託契約締結時に、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取得価額等>

第13条 委託者は、第7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口単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

- ②委託者の指定する証券会社（委託者の指定する金融商品取引法第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（委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関といいます。以下同じ。）は、第7条第1項の規定により分割される受益権を、委託者の指定する証券会社および登録金融機関と別に定める「累積投資約款」にしたがって契約（以下、「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益権取得申込者に対して、1口単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

- ③前2項の取得価額は、取得申込日の基準価額に、当該基準価額に委託者、委託者の指定する証券会社および登録金融機関がそれぞれ別に定める手数料ならびに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当該取得価額は、1口につき1円に、当該基準価額に委託者、委託者の指定する証券会社および登録金融機関がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

- ④前項の規定にかかわらず、委託者、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、受益者が第44条第1項または第3項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の取得価額は、第37条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑤第1項および第2項の取得申込者は委託者、委託者の指定する証券会社または登録金融機関に、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なわれます。なお、委託者（第45条の委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、当該取得申込みの代金（第3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。
- ⑥前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、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「証券取引所」といいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受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消することができるものとします。

<受益権の譲渡に係る記載または記録>

第14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な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15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。

<投資の対象とする資産の種類>

第16条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条に定めるものに限りません。）
 - ハ. 金銭債権
- 二. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

<運用の指図範囲等>

第17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。）の受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
12. 外国貸付債権信託受益権（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
13. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りします。）
14. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
15. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
16. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りします。）
17. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
18. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
19. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、第11号ならびに第14号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券ならびに第11号および第14号の証券または証書のうち第2号から第6号まで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
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

③第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用

上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、前項第1号から第4号までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

＜受託者の自己または利害関係人等との取引＞

第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、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28条において同じ。）、第28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16条、第17条第1項および第2項に定める資産への投資を、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限り行うことができます。

②前項の取扱いは、第21条から第24条、第27条、第32条から第34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。

＜運用の基本方針＞

第19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。

＜投資する株式等の範囲＞

第20条 委託者が投資することを指図する株式は、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、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、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については、この限りではありません。

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

＜信用リスク集中回避のための投資制限＞

第20条の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。

＜信用取引の指図および範囲＞

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付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

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

＜先物取引等の運用指図＞

第22条 委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の効率的な運用に資するため、わが国の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。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるわが国の有価証券先物取引、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と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)

②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、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

③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、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わが国の金利にかか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。

＜金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図＞

第23条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

②金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第5条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金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。

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

＜デリバティブ取引等にかかる投資制限＞

第23条の2 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

＜有価証券の貸付の指図および範囲＞

第24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合計額を超えないものとします。

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

②前項各号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。

＜外貨建資産への投資制限＞

第25条 委託者は、信託財産に属する外貨建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外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額が、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。ただし、有価証券の値上がり等により100分の10を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

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時価総額

に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

＜特別の場合の外貨建資産への投資制限＞

第26条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

＜外貨為替予約の指図および範囲＞

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引を指図することができます。

②前項の予約取引の指図は、信託財産に属する為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドに信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

③前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

＜信託業務の委託等＞

第28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な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. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

第29条 （削除）

＜混蔵寄託＞

第30条 金融機関または証券会社（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および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）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の名義で混蔵寄託できるものとします。

<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。

<一部解約の請求および有価証券の売却等の指図>

- 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係る信託契約の一部解約請求ならびに信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

<再投資の指図>

- 第33条 委託者は、前条の規定による一部解約代金、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34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を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- 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、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 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35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36条 信託財産に属する有価証券について、借替え、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つど別にこれを

定めます。

<信託の計算期間>

第37条 この信託の計算期間は、原則として毎年2月8日から翌年2月7日までとします。ただし、第1計算期間は信託契約締結日から平成20年2月7日までとし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

- ②前項にかかわらず、前項の原則により計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

<信託財産に関する報告>

第38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>

第39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信託財産の財務諸表監査に要する費用、および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、毎年8月7日（休業日の場合は翌営業日。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中より支弁します。

<信託報酬等の総額および支弁の方法>

第40条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第37条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の14の率を乗じて得た額とします。

- ②前項の信託報酬は、毎年8月7日（休業日のときは翌営業日。）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、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。

- ③第1項の信託報酬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。

<収益の分配>

第41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します。

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

<収益分配金、償還金および一部解約金の払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原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、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1項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第47条第4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2項に規定する支払開始日までに、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。

<償還金および一部解約金の支払い>

第43条 償還金は、信託終了後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な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、委託者の指定する証券会社または登録金融機関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なわれます。

②一部解約金は、第47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。

③前各項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する証券会社および登録金融機関の営業所等において行うものとしします。ただし、委託者が自らの募集にかかる受益権に帰属する償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行うものとしします。

④償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、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します。

<収益分配金の再投資等>

第44条 委託者は、委託者の自らの募集に係る受益権に帰属する収益分配金をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者ごとに当該収益分配金の再投資にかかる受益権の取得申込みに応じたものとしします。当該受益権の取得申込みに応じたことにより増加した受益権は、第11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。

②収益分配金については、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、収益分配金が委託者の指定する証券会社および登録金融機関に交付されます。

③委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、別に定める契約に基づき、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行な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の指定する証券会社または登録金融機関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。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11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。

④収益分配金にかかる収益調整金は、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します。

<委託者の自らの募集にかかる受益権の口座管理機関>

第45条 委託者は、委託者の自らの募集にかかる受益権について、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。

<償還金の時効>

第46条 受益者が、信託終了による償還金について第43条第1項に規定する支払い開始日から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。

<信託契約の一部解約>

第47条 受益者（委託者の指定する証券会社および登録金融機関を含みます。以下本条において同じ。）は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口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、委託者の指定する証券会社または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行うものとします。

③委託者は、第1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なわれます。

④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。

⑤委託者は、証券取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、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消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4項の規定に準じて算出した価額とします。

<信託契約の解約>

第48条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、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。

<信託契約に関する監督官庁の命令>

第49条 委託者は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

②委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第53条の規定にしたがいます。

<委託者の登録取消等に伴う取扱い>

第50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53条第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との間において存続します。

<委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い>

第51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。

<受託者の辞任および解任に伴う取扱い>

第52条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、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53条の規定にしたがい、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53条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この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54条 第48条に規定する信託契約の解約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48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、投資信託及び投資法人に関する法律第30条の2の規定に基づき、受益権の買取を請求することができます。

<公告>

第55条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。
<https://www.am-one.co.jp/>

②前項の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

<運用報告書に記載すべき事項の提供>

第56条 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、これを交付します。

<質権口記載又は記録の受益権の取扱い>

第57条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、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。

<信託約款に関する疑義の取扱い>

第58条 この信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

(付則)

第1条 この約款において「累積投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する証券会社および登録金融機関が締結する「累積投資約款」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「累積投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第43条第4項および第44条第4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、同条同項に規定する「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。

第3条 第23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。

第4条 第23条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率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またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率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。

平成19年9月27日（信託契約締結日）

委託者	興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社
受託者	みずほ信託銀行株式会社

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。