

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年6月10日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集(売出) 内国投資信託受益証券に係るファン ドの名称】	MHAM TOPIXオープン
【届出の対象とした募集(売出) 内国投資信託受益証券の金額】	2,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

MHAM TOPIXオープン(以下「当ファンド」といいます。)

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

### (3)【発行(売出)価額の総額】

2,000億円を上限とします。

### (4)【発行(売出)価格】

取得申込日の基準価額とします。

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

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

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

注：電話番号はコールセンターのものであります(以下同じ)。

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

### (5)【申込手数料】

通常のお申込みのお取扱い

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

確定拠出年金制度に基づくお申込みのお取扱い

無手数料とします。

申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。

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

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

#### (6) 【申込単位】

申込単位は、各販売会社が定める単位とします。

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

申込単位および取扱コースについては、販売会社にお問い合わせください。

当初元本は1口当たり1円です。

#### (7) 【申込期間】

2020年6月11日から2020年12月10日まで

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

#### (8) 【申込取扱場所】

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

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

#### (9) 【払込期日】

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

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

#### (10) 【払込取扱場所】

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

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

**（ 1 1 ） 【振替機関に関する事項】**

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**（ 1 2 ） 【その他】**

投資信託振替制度における振替受益権について

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

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

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

確定拠出年金制度に基づくお申込みのお取扱い

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

MHAM TOPIXマザーファンド受益証券への投資を通じて東京証券取引所第一部に上場されている株式に投資を行い、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指します。

東証株価指数(TOPIX=Tokyo Stock Price Index)とは、東京証券取引所第一部全銘柄を対象とした株価指数で、基準時（1968年1月4日終値）の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。

- \*1 TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。
- \*2 ㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- \*3 ㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- \*4 ㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- \*5 MHAM TOPIXマザーファンドおよびMHAM TOPIXマザーファンドに投資するファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- \*6 ㈱東京証券取引所は、MHAM TOPIXマザーファンドおよびMHAM TOPIXマザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、MHAM TOPIXマザーファンドおよびMHAM TOPIXマザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。
- \*7 ㈱東京証券取引所は、委託会社またはMHAM TOPIXマザーファンドおよびMHAM TOPIXマザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、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、㈱東京証券取引所はMHAM TOPIXマザーファンドおよびMHAM TOPIXマザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

##### <ファンドの特色>

東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指します。

運用にあたっては、当社が独自に開発した「日本株式マルチファクターモデル」を活用します。

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

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

## &lt; 商品分類 &gt;

## ・商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## ・商品分類定義

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

## &lt; 属性区分 &gt;

## ・属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## ・属性区分定義

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

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

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

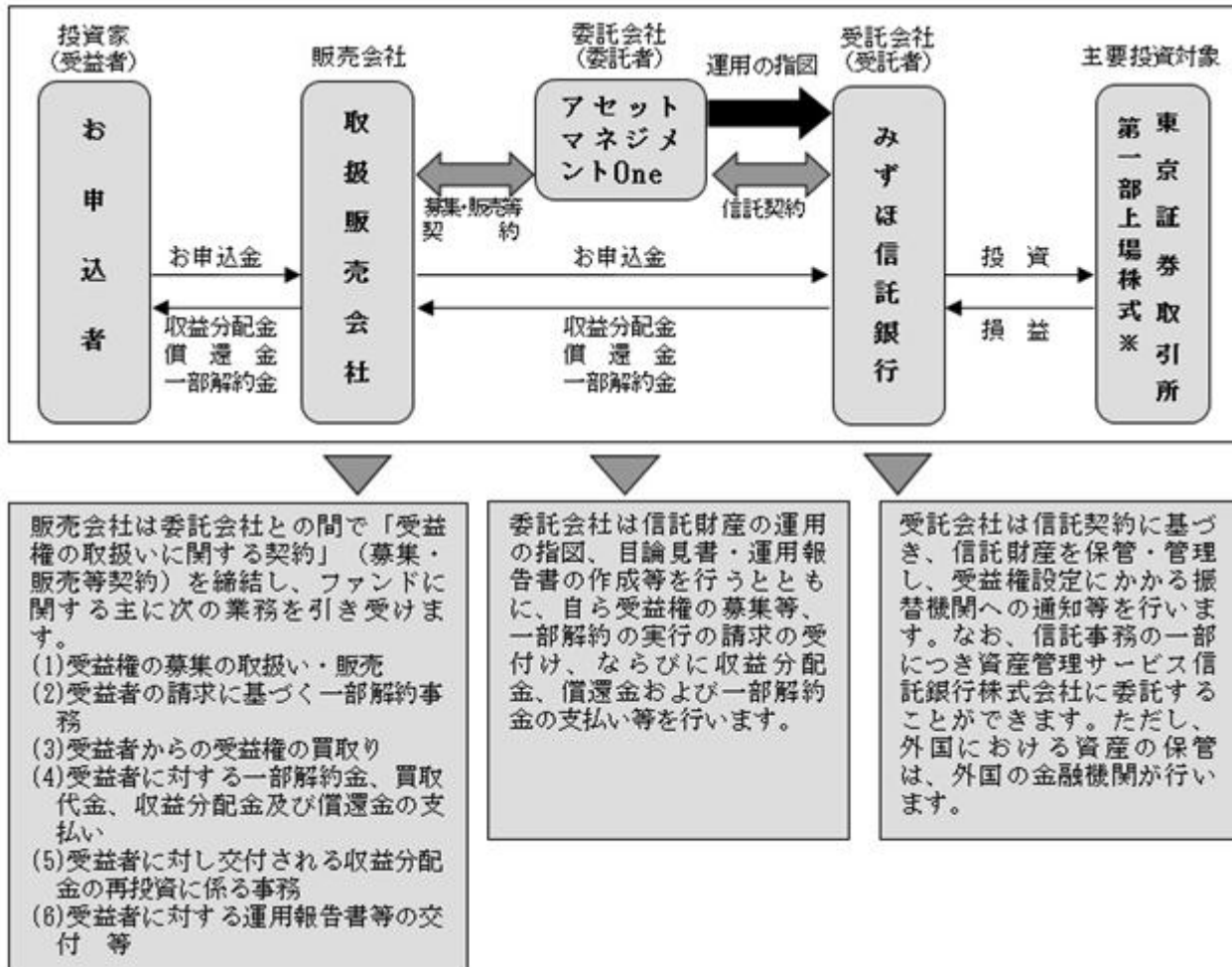
(注3) 当ファンドはマザーファンド受益証券(投資信託証券)への投資を通じて、株式を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

## (2) 【ファンドの沿革】

1998年10月22日	信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
2007年1月4日	投資信託振替制度へ移行
2007年7月1日	当ファンドの名称を「富士TOPIXオープン」から「MHAM TOPIXオープン」に変更
2016年10月1日	ファンドの委託会社としての業務をみずほ投信投資顧問株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継

## (3) 【ファンドの仕組み】

## 当ファンドの運営の仕組み



資産管理サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。(以下同じ)

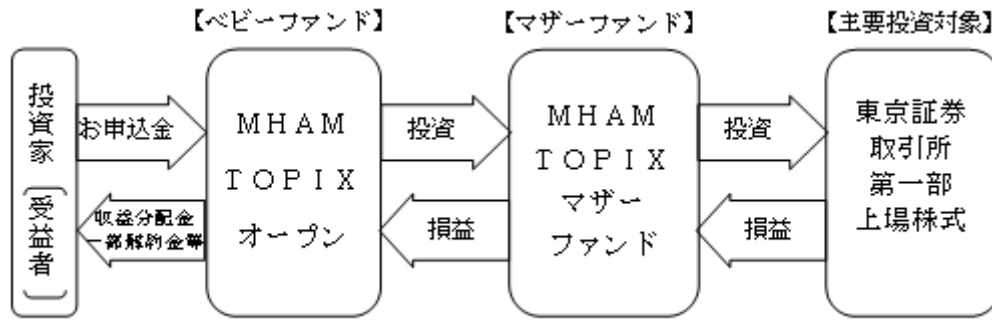
主要投資対象である東京証券取引所第一部上場株式には、主として、MHAM TOPIXマザーファンドを通じて投資を行います。

## ファミリーファンド方式の仕組み

当ファンドは「MHAM TOPIXマザーファンド」をマザーファンドとするファミリーファンド方式で運用を行います。



## ファミリーファンド方式



ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資することにより、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。マザーファンドのほかに、株式等に直接投資する場合があります。

## 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（2020年3月31日現在）

## 委託会社の沿革

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

(2020年3月31日現在)

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### 基本方針

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

#### 運用方法

##### 1. 主要投資対象

MHAM TOPIXマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。

##### 2. 投資態度

a. 主としてMHAM TOPIXマザーファンド受益証券に投資し、東証株価指数(TOPIX)と連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用にあたっては、当社が独自に開発した「日本株式マルチファクターモデル」を活用します。

- ・ 「日本株式マルチファクターモデル」とは、複数のリスクファクターによって株式のリターンを分解・説明するモデルです。このモデルを活用し、TOPIXに連動する銘柄群を効率的に選びます。

日本株式マルチファクターモデルは、1988年に構築以来、随時改良を加えている、アセットマネジメントOneが独自に開発したモデルです。

- ・ 投資する銘柄群について定期的に見直しを実施することにより、TOPIXに対する連動性を高めます。

b. 現物株への投資よりTOPIX先物等を活用する方が有利と認められるときは、TOPIX先物等を活用することがあります。

c. 株価指数等の先物取引を含む株式の実質投資割合は、原則信託財産の純資産総額の範囲内となるよう運用を行いますが、一時的に株式の実質投資総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質投資総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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

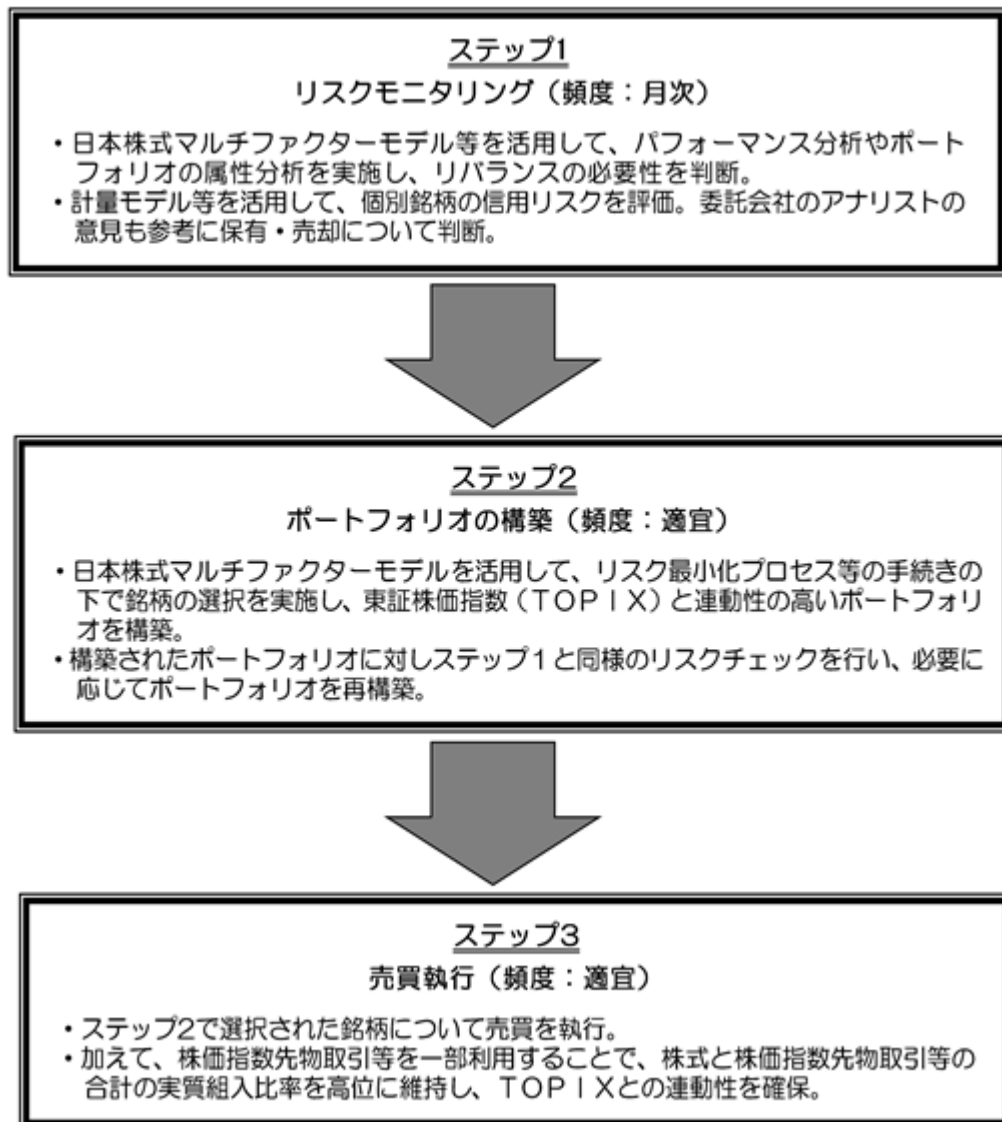
d. 組入対象銘柄は、東京証券取引所第一部上場株式とします。ただし、流動性に著しく欠ける銘柄や信用リスクが高いと判断される銘柄等は組入れません。

e. 現物株式の実質組入比率(信託財産に属する他の投資信託受益証券の時価総額に、当該他の投資信託の信託財産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額と、信託財産に属する株式の時価総額との合計額が信託財産総額に占める割合)は、通常の状態では50%以上とすることを基本とします。

- f．非株式（株式以外の資産）への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- g．上記a．からf．について、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。
- h．国内において行われる有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）、有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

#### ファンドの投資プロセス

当ファンドは、主としてMHAM TOPIXマザーファンド受益証券への投資を通じ、以下のプロセスにより東京証券取引所第一部上場株式に投資を行います。



なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。また、使用するモデル等については、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

## (2) 【投資対象】

### 有価証券の指図範囲

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

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

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

### 金融商品の指図範囲

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

## 5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

## その他の投資対象

## 1．有価証券先物取引等

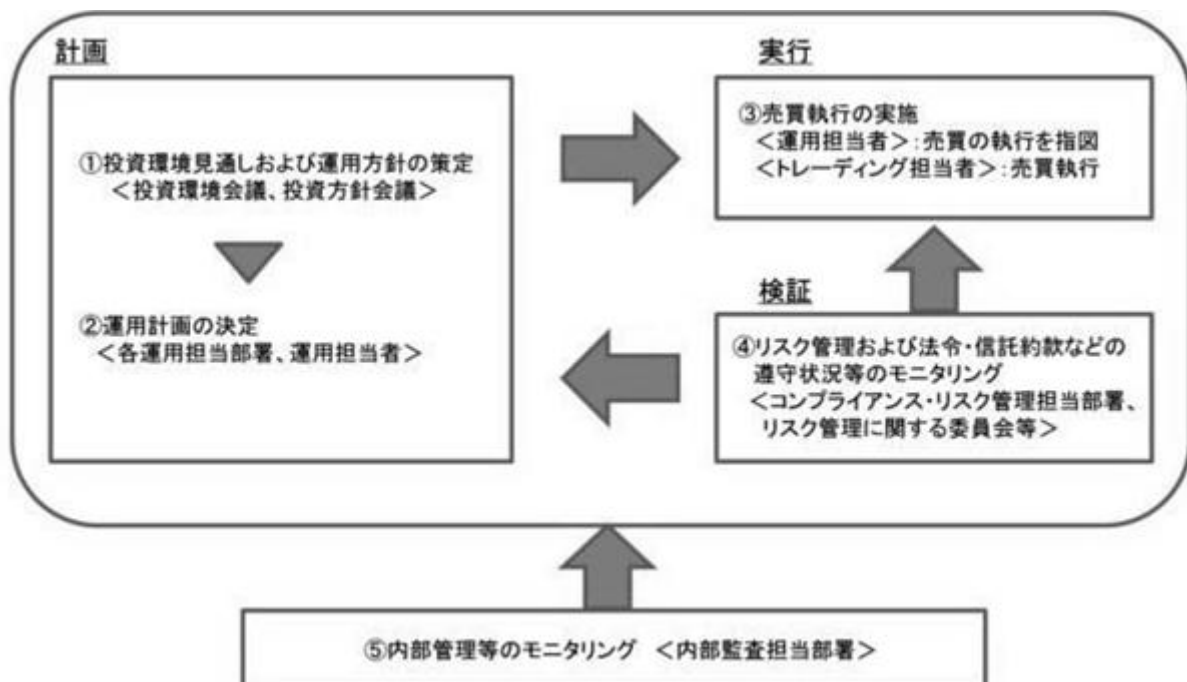
有価証券先物取引等を行うことができます。

## 2．スワップ取引および金利先渡取引

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

## (3) 【運用体制】

## a．ファンドの運用体制



## 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

## 運用計画の決定

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

## 売買執行の実施

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

## モニタリング

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

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

## 内部管理等のモニタリング

内部監査担当部署（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2020年3月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

## （4）【分配方針】

### 収益分配方針

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

#### 1. 分配対象収益の範囲

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

#### 2. 分配対象収益についての分配方針

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

#### 3. 留保金の運用方針

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

将来の収益分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

#### 収益分配金の支払い

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

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

#### （５）【投資制限】

##### a. 約款で定める投資制限

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

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

非株式[株式以外の資産](約款 運用の基本方針(2)運用方法 投資態度)

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

外貨建資産への投資(約款 運用の基本方針(3)運用制限)

外貨建資産への投資は行いません。

信用取引(約款第21条)

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお当該売り付けの決済については、株券の引き渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、且つ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  - a. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  - b. 株式分割により取得する株券
  - c. 有償増資により取得する株券
  - d. 売り出しにより取得する株券

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

#### 信用リスク集中回避のための投資制限(約款第21条の1の2)

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

#### デリバティブ取引等(約款第21条の2)

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

#### 有価証券先物取引等(約款第22条)

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

#### スワップ取引(約款第23条)

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(「スワップ取引」)を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。



3. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
4. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 金利先渡取引(約款第24条)

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

#### 転換社債等(約款第25条)

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

#### 有価証券の貸付(約款第26条)

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

#### 資金の借入れ(約款第33条)

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約にともなう支払資金の手当て(一部解約にともなう支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

2. 一部解約にともなう支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
4. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

#### b. 法令で定める投資制限

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

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

### 3【投資リスク】

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

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

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

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

#### 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

株価変動リスクとは、株式市場および投資先となっている企業の株価が下落するリスクをいいます。当ファンドが投資する企業の株価が下落した場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、当ファンドが投資する企業が業績悪化や倒産等に陥った場合には、当該企業の株価

が大きく下落することや無くなることもあり、当ファンドの基準価額に大きな影響を及ぼすことがあります。

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

#### 流動性リスク

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

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

#### 信用リスク

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

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

#### <その他>

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

< その他の留意点 >

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

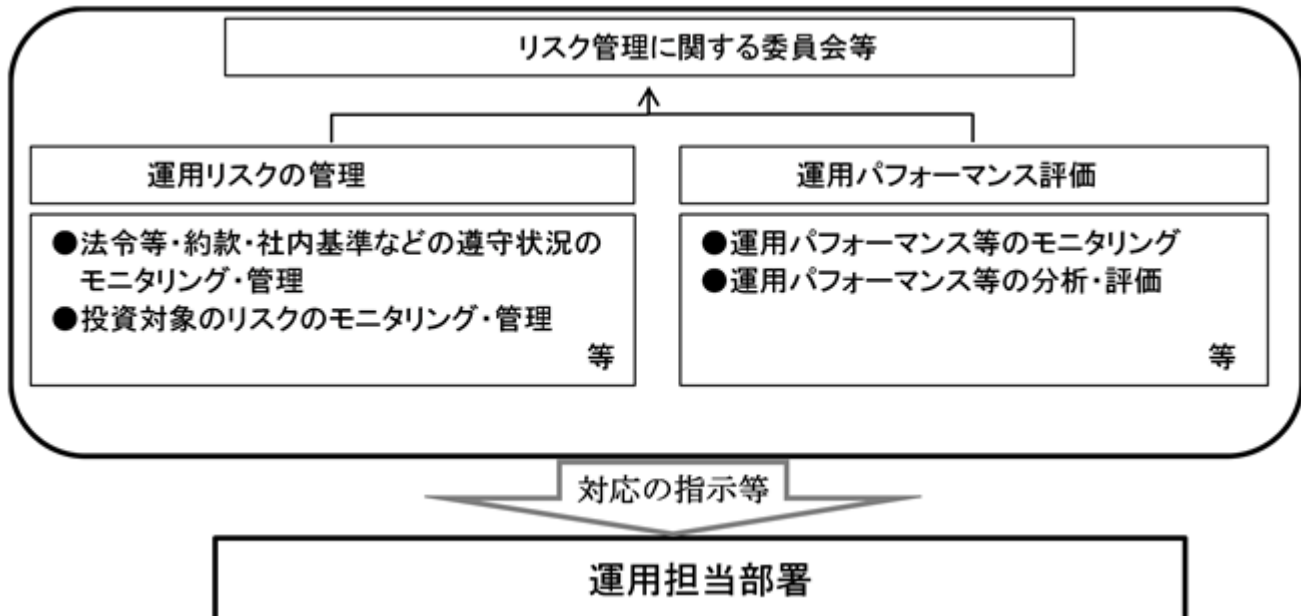
< 収益分配金に関する留意点 >

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

(2) リスク管理体制

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

- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：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、リスク管理に関する委員会等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。



リスク管理体制は2020年3月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

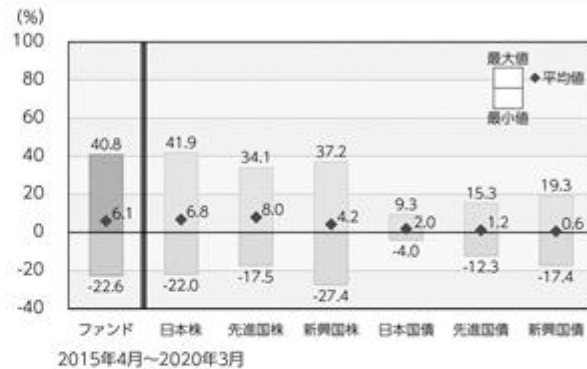
## <参考情報>

### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



- \*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
- \*全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、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)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は、株東京証券取引所が有しています。
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、野村證券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證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

通常のお申込みの場合

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

確定拠出年金制度に基づくお申込みの場合

無手数料とします。

申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。

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

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

#### < 申込手数料を対価とする役務の内容 >

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

### (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

### (3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.715%（税抜0.65%）の率を乗じて得た額とします。

その配分（税抜）については、以下の通りとなります。

委託会社	販売会社	受託会社
0.30%	0.275%	0.075%

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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

< 信託報酬等を対価とする役務の内容 >

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

(4) 【その他の手数料等】

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、当該費用にかかる消費税等相当額とともに毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁します。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。



## 損益通算について

解約（換金）時および償還時の差損（譲渡損）については、確定申告を行うことにより上場株式等（上場株式、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募株式投資信託および特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）など。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限りま

す。）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

## 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、2020年3月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

## 個別元本方式について

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

### < 個別元本について >

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

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

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

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

#### <収益分配金の課税について>

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

令和2年3月31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	7,047,558,049	99.98
内 日本	7,047,558,049	99.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,271,169	0.02
純資産総額	7,048,829,218	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)

MHAM TOPIXマザーファンド

令和2年3月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	32,312,133,780	97.12
内 日本	32,312,133,780	97.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	957,429,194	2.88
純資産総額	33,269,562,974	100.00

その他資産の投資状況

令和2年3月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	925,980,000	2.78
内 日本	925,980,000	2.78

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

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

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

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

令和2年3月31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	MHAM TOPIXマ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	4,125,480,331	1.6910 6,976,584,606	1.7083 7,047,558,049	- -	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年3月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.98
合計	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

MHAM TOPIXマザーファンド

令和2年3月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	181,800	6,610.89 1,201,860,280	6,501.00 1,181,881,800	- -	3.55
2	ソニー 日本	株式 電気機器	103,200	6,421.75 662,725,350	6,421.00 662,647,200	- -	1.99
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	213,200	2,424.29 516,859,480	2,575.50 549,096,600	- -	1.65
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	14,800	32,752.90 484,743,050	34,830.00 515,484,000	- -	1.55
5	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	126,900	4,380.78 555,922,020	3,788.00 480,697,200	- -	1.44
6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	135,600	3,745.27 507,858,750	3,308.00 448,564,800	- -	1.35
7	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	1,096,200	440.01 482,342,940	403.00 441,768,600	- -	1.33
8	任天堂 日本	株式 その他製品	10,000	36,293.57 362,935,720	41,610.00 416,100,000	- -	1.25
9	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	117,900	2,984.26 351,844,410	3,377.00 398,148,300	- -	1.20
10	KDDI 日本	株式 情報・通信業	119,200	3,222.67 384,142,800	3,190.00 380,248,000	- -	1.14
11	第一三共 日本	株式 医薬品	46,800	6,382.87 298,718,400	7,434.00 347,911,200	- -	1.05
12	花王 日本	株式 化学	39,200	8,100.20 317,528,110	8,830.00 346,136,000	- -	1.04
13	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	111,700	3,457.01 386,149,010	2,796.00 312,313,200	- -	0.94
14	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	128,200	2,544.23 326,170,810	2,430.00 311,526,000	- -	0.94
15	HOYA 日本	株式 精密機器	32,700	9,333.67 305,211,160	9,200.00 300,840,000	- -	0.90
16	信越化学工業 日本	株式 化学	27,500	11,261.44 309,689,720	10,730.00 295,075,000	- -	0.89

17	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	111,100	2,947.59 327,477,980	2,623.00 291,415,300	- -	0.88
18	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	57,500	5,086.79 292,490,770	4,950.00 284,625,000	- -	0.86
19	ダイキン工業 日本	株式 機械	20,900	13,344.14 278,892,700	13,170.00 275,253,000	- -	0.83
20	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	2,177,900	122.73 267,305,920	123.60 269,188,440	- -	0.81
21	村田製作所 日本	株式 電気機器	48,000	5,447.18 261,464,640	5,472.00 262,656,000	- -	0.79
22	三菱商事 日本	株式 卸売業	112,500	2,460.62 276,820,310	2,291.50 257,793,750	- -	0.77
23	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	112,200	2,280.68 255,892,590	2,242.50 251,608,500	- -	0.76
24	日立製作所 日本	株式 電気機器	78,300	3,347.37 262,099,850	3,143.00 246,096,900	- -	0.74
25	S M C 日本	株式 機械	5,200	40,109.34 208,568,580	45,750.00 237,900,000	- -	0.72
26	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	141,900	1,645.40 233,483,420	1,671.00 237,114,900	- -	0.71
27	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	28,700	7,986.40 229,209,940	8,176.00 234,651,200	- -	0.71
28	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	13,500	16,975.88 229,174,440	17,320.00 233,820,000	- -	0.70
29	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	16,600	13,200.78 219,133,000	13,820.00 229,412,000	- -	0.69
30	ファナック 日本	株式 電気機器	15,500	16,056.96 248,883,000	14,655.00 227,152,500	- -	0.68

(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

令和2年3月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	97.12
合計	97.12

(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

令和2年3月31日現在

業種	国内 / 外国	投資比率 (%)
電気機器	国内	13.75
情報・通信業		9.38
化学		7.34
輸送用機器		7.07
医薬品		6.36
銀行業		4.99
卸売業		4.82
サービス業		4.80
機械		4.77
小売業		4.66
陸運業		4.38
食料品		4.11
建設業		2.63
精密機器		2.49
その他製品		2.39
保険業		2.14
不動産業		2.09
電気・ガス業		1.74
その他金融業		1.09
証券、商品先物取引業		0.76
ガラス・土石製品		0.73
ゴム製品		0.63
非鉄金属		0.63
鉄鋼		0.57
金属製品		0.54
繊維製品		0.52
石油・石炭製品		0.45
空運業		0.39
パルプ・紙		0.27
鉱業		0.19
倉庫・運輸関連業		0.18
海運業		0.13
水産・農林業		0.10
合計		97.12

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

MHAM TOPIXマザーファンド

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

MHAM TOPIXマザーファンド

令和2年3月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0206月	買建	66	920,299,480	925,980,000	2.78

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日(令和2年3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13計算期間末 (平成23年 3月10日)	9,351	9,429	0.6000	0.6050
第14計算期間末 (平成24年 3月12日)	8,270	8,345	0.5493	0.5543
第15計算期間末 (平成25年 3月11日)	9,410	9,507	0.6796	0.6866
第16計算期間末 (平成26年 3月10日)	8,735	8,833	0.8027	0.8117
第17計算期間末 (平成27年 3月10日)	9,788	9,877	1.0008	1.0098
第18計算期間末 (平成28年 3月10日)	8,408	8,502	0.8879	0.8979
第19計算期間末 (平成29年 3月10日)	9,275	9,383	1.0364	1.0484
第20計算期間末 (平成30年 3月12日)	9,108	9,211	1.1489	1.1619
第21計算期間末 (平成31年 3月11日)	8,288	8,359	1.0502	1.0592
第22計算期間末 (令和2年3月10日)	6,843	6,975	0.9339	0.9519
平成31年3月末日	8,511	-	1.0682	-
4月末日	8,579	-	1.0852	-
令和1年5月末日	8,076	-	1.0140	-
6月末日	8,296	-	1.0412	-
7月末日	8,284	-	1.0499	-
8月末日	7,939	-	1.0139	-
9月末日	8,328	-	1.0744	-
10月末日	8,676	-	1.1275	-
11月末日	8,687	-	1.1487	-
12月末日	8,674	-	1.1646	-
令和2年1月末日	8,457	-	1.1391	-
2月末日	7,537	-	1.0214	-
3月末日	7,048	-	0.9426	-



## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金（円）
第13計算期間	0.0050
第14計算期間	0.0050
第15計算期間	0.0070
第16計算期間	0.0090
第17計算期間	0.0090
第18計算期間	0.0100
第19計算期間	0.0120
第20計算期間	0.0130
第21計算期間	0.0090
第22計算期間	0.0180

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第13計算期間	2.13
第14計算期間	7.62
第15計算期間	25.00
第16計算期間	19.44
第17計算期間	25.80
第18計算期間	10.28
第19計算期間	18.08
第20計算期間	12.11
第21計算期間	7.81
第22計算期間	9.4

（注1）収益率は期間騰落率です。

（注2）計算期間末が令和1年8月29日以前の収益率については、小数点第2位で表示しています。

## （4）【設定及び解約の実績】

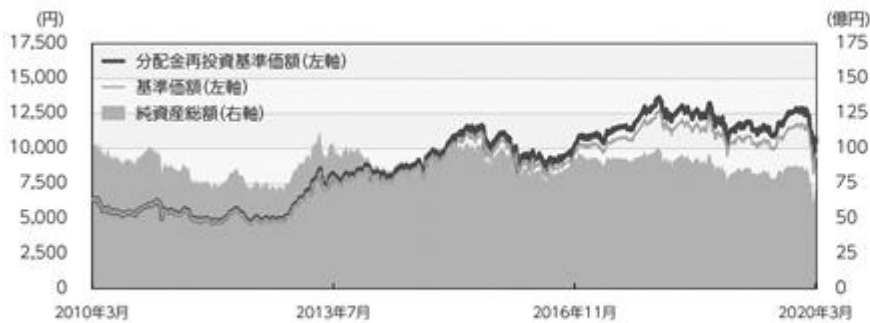
	設定口数	解約口数
第13計算期間	2,723,535,436	3,165,882,534
第14計算期間	1,913,349,732	2,444,065,993
第15計算期間	1,546,858,797	2,755,516,847
第16計算期間	1,720,491,029	4,684,522,874
第17計算期間	1,297,591,952	2,399,371,648
第18計算期間	1,764,811,465	2,076,291,110
第19計算期間	1,243,083,227	1,762,450,093
第20計算期間	1,277,274,100	2,299,730,471
第21計算期間	1,138,643,487	1,174,485,331
第22計算期間	1,083,065,008	1,646,604,346

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

## 参考情報

データの基準日:2020年3月31日

## 基準価額・純資産の推移 (2010年3月31日～2020年3月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日:1998年10月22日)

## 分配の推移(税引前)

2016年 3月	100円
2017年 3月	120円
2018年 3月	130円
2019年 3月	90円
2020年 3月	180円
設定来累計	5,170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	MHAM TOPIXマザーファンド	99.98

## ■MHAM TOPIX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	97.12
内 日本	97.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.88
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)	2.78

## 株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	13.75
2	情報・通信業	9.38
3	化学	7.34
4	輸送用機器	7.07
5	医薬品	6.36

## 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	3.55
2	ソニー	株式	日本	電気機器	1.99
3	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.65
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.55
5	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.44
6	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.35
7	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.33
8	任天堂	株式	日本	その他製品	1.25
9	NTTドコモ	株式	日本	情報・通信業	1.20
10	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.14

## 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。

※2020年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

解約単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

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

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

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

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

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

1998年10月22日から無期限とします。

#### (4)【計算期間】

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

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

(5) 【その他】

信託契約の解約

以下の場合には信託契約を解約し信託を終了することがあります。

1. 委託会社は、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき、もしくは信託契約の一部解約により、受益権の口数が5億口を下回ることとなる場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。
  - a. この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかる全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
  - b. 前記a.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一カ月を下らないものとします。
  - c. 前記b.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記1.の信託契約の解約をしません。
  - d. 委託会社は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
  - e. 前記b.からd.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記b.の一定の期間が一カ月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
  - f. 前記1.に定める信託契約の解約を行う場合において、前記b.の期間内に異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。なお、買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社の協議により決定するものとします。
2. 委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
3. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、この信託は、「信託約款の変更4.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
4. 受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

1. 委託会社は、信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更できるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

2. 委託会社は、前記1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前記2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一ヵ月を下らないものとします。
4. 前記3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、この信託約款を変更しないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前記2.に定める変更を行う場合において、前記3.の期間内に異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。なお、買取請求の取扱いについては、委託会社、受託会社の協議により決定するものとします。
7. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記の規定にしたがいます。

#### 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

#### 関係法人との契約の更改および受託会社の辞任または解任に伴う取扱い

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

#### 信託事務処理の再信託

受託会社は、当ファンドにかかる信託事務処理の一部について、資産管理サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

#### 公告

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

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

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

## 運用報告書

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金請求権

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

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

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

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

### (2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

### (3) 一部解約請求権

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

### (4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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



### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第22期計算期間(平成31年3月12日から令和2年3月10日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【MHAM TOPIXオープン】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第21期 平成31年3月11日現在	第22期 令和2年3月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	37,091,158	60,343,465
親投資信託受益証券	8,286,991,207	6,842,830,433
未収入金	78,394,900	131,125,000
流動資産合計	8,402,477,265	7,034,298,898
資産合計	8,402,477,265	7,034,298,898
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	71,028,638	131,913,568
未払解約金	13,531,967	28,491,347
未払受託者報酬	3,420,137	3,465,301
未払委託者報酬	26,220,973	26,567,607
未払利息	26	-
その他未払費用	69,610	68,869
流動負債合計	114,271,351	190,506,692
負債合計	114,271,351	190,506,692
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,892,070,935	7,328,531,597
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	396,134,979	484,739,391
（分配準備積立金）	2,120,677,699	1,717,176,141
元本等合計	8,288,205,914	6,843,792,206
純資産合計	8,288,205,914	6,843,792,206
負債純資産合計	8,402,477,265	7,034,298,898

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第21期		第22期	
	自	平成30年3月13日 平成31年3月11日	自	平成31年3月12日 令和2年3月10日
<b>営業収益</b>				
受取利息		88		46
有価証券売買等損益		630,031,150		624,068,774
その他収益		30,633		-
<b>営業収益合計</b>		<b>630,000,429</b>		<b>624,068,728</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		22,517		16,265
受託者報酬		7,183,826		6,840,082
委託者報酬		55,075,901		52,440,888
その他費用		149,842		137,199
<b>営業費用合計</b>		<b>62,432,086</b>		<b>59,434,434</b>
営業利益又は営業損失( )		692,432,515		683,503,162
経常利益又は経常損失( )		692,432,515		683,503,162
当期純利益又は当期純損失( )		692,432,515		683,503,162
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( )		14,819,508		67,174,995
期首剰余金又は期首欠損金( )		1,180,702,855		396,134,979
剰余金増加額又は欠損金減少額		138,784,791		86,042,498
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		138,784,791		86,042,498
剰余金減少額又は欠損金増加額		174,711,022		84,325,143
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		174,711,022		84,325,143
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		71,028,638		131,913,568
期末剰余金又は期末欠損金( )		396,134,979		484,739,391

## (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22期	
	自 平成31年3月12日 至 令和2年3月10日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年3月10日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成31年3月11日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第21期	第22期
	平成31年3月11日現在	令和2年3月10日現在
1. 期首元本額	7,927,912,779円	7,892,070,935円
期中追加設定元本額	1,138,643,487円	1,083,065,008円
期中一部解約元本額	1,174,485,331円	1,646,604,346円
2. 受益権の総数	7,892,070,935口	7,328,531,597口
3. 元本の欠損	-	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は484,739,391円であります。

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第21期 自 平成30年3月13日 至 平成31年3月11日		第22期 自 平成31年3月12日 至 令和2年3月10日																						
	1. 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(132,740,962円)、有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(3,210,570,822円)、分配準備積立金(2,058,965,375円)より、分配対象収益は5,402,277,159円(1万口当たり6,845円)であり、うち71,028,638円(1万口当たり90円)を分配金額としております。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>配当等収益</td> <td>A</td> <td>132,740,962円</td> </tr> <tr> <td>有価証券売買等損益</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金</td> <td>C</td> <td>3,210,570,822円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>D</td> <td>2,058,965,375円</td> </tr> <tr> <td>分配可能額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>5,402,277,159円</td> </tr> <tr> <td>収益分配額</td> <td>F</td> <td>71,028,638円</td> </tr> </tbody> </table>		項目			配当等収益	A	132,740,962円	有価証券売買等損益	B	0円	収益調整金	C	3,210,570,822円	分配準備積立金	D	2,058,965,375円	分配可能額	E=A+B+C+D	5,402,277,159円	収益分配額	F	71,028,638円	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(137,402,916円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(3,241,274,559円)及び分配準備積立金(1,711,686,793円)より分配対象収益は5,090,364,268円(1万口当たり6,945.95円)であり、うち131,913,568円(1万口当たり180円)を分配金額としております。</p>
項目																									
配当等収益	A	132,740,962円																							
有価証券売買等損益	B	0円																							
収益調整金	C	3,210,570,822円																							
分配準備積立金	D	2,058,965,375円																							
分配可能額	E=A+B+C+D	5,402,277,159円																							
収益分配額	F	71,028,638円																							

## （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21期 自 平成30年3月13日 至 平成31年3月11日		第22期 自 平成31年3月12日 至 令和2年3月10日	
	1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。</p>		<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>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。なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。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。</p>		<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p>	

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>リスク管理に関する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。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>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。リスク管理に関する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。</p>
-------------------	---	--

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第21期 平成31年3月11日現在	第22期 令和2年3月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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	<p>(1)有価証券 親投資信託受益証券</p> <p>原則として、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	<p>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。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第21期 平成31年3月11日現在	第22期 令和2年3月10日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	613,404,439	660,105,332
合計	613,404,439	660,105,332

## (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21期 平成31年3月11日現在	第22期 令和2年3月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0502円 (10,502円)	0.9339円 (9,339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

令和2年3月10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	MHAM TOPIXマザー ファンド	4,044,943,213	6,842,830,433	
親投資信託受益証券	合計	4,044,943,213	6,842,830,433	
合計			6,842,830,433	

（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、「MHAM TOPIX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。



## MHAM TOPIXマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

令和2年3月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	358,242,152
株式	33,599,475,960
未収配当金	86,953,761
前払金	40,680,000
差入委託証拠金	16,695,000
流動資産合計	34,102,046,873
資産合計	
34,102,046,873	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	29,966,270
未払金	5,606,320
未払解約金	150,648,000
流動負債合計	186,220,590
負債合計	
186,220,590	
純資産の部	
元本等	
元本	20,048,805,260
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	13,867,021,023
元本等合計	33,915,826,283
純資産合計	
33,915,826,283	
負債純資産合計	
34,102,046,873	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成31年3月12日 至 令和2年3月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年3月10日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	21,352,396,579円
同期中追加設定元本額	8,763,346,083円
同期中一部解約元本額	10,066,937,402円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	864,954,698円
MHAM TOPIXオープン	4,044,943,213円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	11,932,247,026円
動的パッケージファンド<DC年金>	8,471,995円
コア資産形成ファンド	6,658,225円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	123,669,533円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	1,286,054,747円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,781,805,823円
計	20,048,805,260円
2. 受益権の総数	20,048,805,260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 平成31年3月12日 至 令和2年3月10日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する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	令和2年3月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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つた場合、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	令和2年3月10日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	4,414,590,807
合計	4,414,590,807

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	令和2年3月10日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	297,290,000	-	267,330,000	29,960,000	
合計	297,290,000	-	267,330,000	29,960,000	

(注) 時価の算定方法

## 株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(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)

令和2年3月10日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6917円 (16,917円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

令和2年3月10日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	800	2,521.00	2,016,800	
日本水産	23,200	470.00	10,904,000	
マルハニチロ	3,300	2,093.00	6,906,900	
ハウスイ	500	705.00	352,500	
カネコ種苗	500	1,068.00	534,000	
サカタのタネ	2,700	2,714.00	7,327,800	
ホクト	1,700	1,727.00	2,935,900	
ホクリヨウ	400	664.00	265,600	
ヒノキヤグループ	500	1,630.00	815,000	
ショーボンドホールディングス	3,600	3,550.00	12,780,000	
ミライト・ホールディングス	6,900	1,335.00	9,211,500	
タマホーム	1,400	1,126.00	1,576,400	
サンヨーホームズ	500	593.00	296,500	
日本アクア	1,100	565.00	621,500	
ファーストコーポレーション	800	427.00	341,600	
ベステラ	500	780.00	390,000	
TATERU	5,300	132.00	699,600	
スペースバリューホールディングス	2,900	408.00	1,183,200	
住石ホールディングス	5,400	108.00	583,200	

日鉄鉱業	500	3,915.00	1,957,500	
三井松島ホールディングス	1,000	925.00	925,000	
国際石油開発帝石	91,200	732.80	66,831,360	
石油資源開発	3,000	2,023.00	6,069,000	
K&Oエナジーグループ	1,200	1,578.00	1,893,600	
ダイセキ環境ソリューション	500	794.00	397,000	
第一カッター興業	400	1,668.00	667,200	
安藤・間	13,700	699.00	9,576,300	
東急建設	6,700	605.00	4,053,500	
コムシスホールディングス	8,200	2,706.00	22,189,200	
ビーアールホールディングス	2,500	427.00	1,067,500	
高松コンストラクショングループ	1,500	2,206.00	3,309,000	
東建コーポレーション	700	6,700.00	4,690,000	
ソネック	300	581.00	174,300	
ヤマウラ	1,100	860.00	946,000	
大成建設	17,700	3,330.00	58,941,000	
大林組	53,100	979.00	51,984,900	
清水建設	54,100	855.00	46,255,500	
飛島建設	1,500	1,057.00	1,585,500	
長谷工コーポレーション	20,600	1,287.00	26,512,200	
松井建設	2,000	597.00	1,194,000	
銭高組	200	2,995.00	599,000	
鹿島建設	41,600	1,038.00	43,180,800	
不動テトラ	1,500	1,285.00	1,927,500	
大末建設	600	805.00	483,000	
鉄建建設	1,200	2,121.00	2,545,200	
西松建設	4,100	2,033.00	8,335,300	
三井住友建設	12,800	481.00	6,156,800	
大豊建設	1,200	2,088.00	2,505,600	
前田建設工業	13,400	828.00	11,095,200	
佐田建設	1,300	310.00	403,000	
ナカノフドー建設	1,500	365.00	547,500	
奥村組	2,900	2,289.00	6,638,100	
東鉄工業	2,300	2,620.00	6,026,000	
イチケン	400	1,510.00	604,000	
富士ピー・エス	800	387.00	309,600	
浅沼組	600	4,135.00	2,481,000	
戸田建設	22,100	563.00	12,442,300	
熊谷組	2,500	2,607.00	6,517,500	
北野建設	400	2,372.00	948,800	
植木組	300	2,245.00	673,500	
矢作建設工業	2,300	744.00	1,711,200	
ピーエス三菱	1,800	516.00	928,800	
日本ハウスホールディングス	3,700	303.00	1,121,100	
大東建託	6,400	10,005.00	64,032,000	
新日本建設	2,200	745.00	1,639,000	
N I P P O	4,500	2,138.00	9,621,000	
東亜道路工業	400	2,931.00	1,172,400	
前田道路	5,600	2,586.00	14,481,600	
日本道路	500	5,960.00	2,980,000	

東亜建設工業	1,700	1,439.00	2,446,300
日本国土開発	3,900	487.00	1,899,300
若築建設	1,000	1,245.00	1,245,000
東洋建設	6,100	428.00	2,610,800
五洋建設	21,300	505.00	10,756,500
世紀東急工業	2,500	765.00	1,912,500
福田組	600	3,540.00	2,124,000
日本ドライケミカル	500	1,387.00	693,500
住友林業	13,500	1,425.00	19,237,500
日本基礎技術	2,100	355.00	745,500
巴コーポレーション	2,500	308.00	770,000
大和ハウス工業	52,500	2,770.00	145,425,000
ライト工業	3,100	1,211.00	3,754,100
積水ハウス	58,200	1,916.00	111,511,200
日特建設	1,500	730.00	1,095,000
北陸電気工事	900	907.00	816,300
ユアテック	3,100	547.00	1,695,700
四電工	300	2,108.00	632,400
中電工	2,100	2,134.00	4,481,400
関電工	7,700	855.00	6,583,500
きんでん	12,700	1,508.00	19,151,600
東京エネシス	1,800	777.00	1,398,600
トーエネック	500	2,952.00	1,476,000
住友電設	1,500	2,018.00	3,027,000
日本電設工業	2,900	2,048.00	5,939,200
協和エクシオ	8,100	2,237.00	18,119,700
新日本空調	1,400	1,679.00	2,350,600
日本工営	1,100	2,630.00	2,893,000
九電工	3,700	2,721.00	10,067,700
三機工業	3,900	1,197.00	4,668,300
日揮ホールディングス	16,400	1,063.00	17,433,200
中外炉工業	600	1,446.00	867,600
ヤマト	1,800	557.00	1,002,600
太平電業	1,400	2,243.00	3,140,200
高砂熱学工業	4,600	1,598.00	7,350,800
三晃金属工業	200	2,084.00	416,800
N E C ネットズエスアイ	1,600	3,995.00	6,392,000
朝日工業社	400	2,612.00	1,044,800
明星工業	3,500	704.00	2,464,000
大気社	2,500	2,831.00	7,077,500
ダイダン	1,300	2,251.00	2,926,300
日比谷総合設備	1,700	1,702.00	2,893,400
日本製粉	5,000	1,569.00	7,845,000
日清製粉グループ本社	19,300	1,671.00	32,250,300
日東富士製粉	100	5,380.00	538,000
昭和産業	1,500	2,961.00	4,441,500
鳥越製粉	1,400	706.00	988,400
中部飼料	2,000	1,309.00	2,618,000
フィード・ワン	12,300	144.00	1,771,200
東洋精糖	200	1,090.00	218,000

日本甜菜製糖	800	1,570.00	1,256,000
三井製糖	1,500	1,806.00	2,709,000
塩水港精糖	2,000	197.00	394,000
日新製糖	700	1,843.00	1,290,100
L I F U L L	5,700	363.00	2,069,100
ジェイエイシーリクルートメント	1,100	1,244.00	1,368,400
日本M&Aセンター	12,300	3,315.00	40,774,500
メンバーズ	500	1,286.00	643,000
中広	400	362.00	144,800
アイティメディア	500	906.00	453,000
タケエイ	1,600	851.00	1,361,600
E・Jホールディングス	400	1,270.00	508,000
ビーネックスグループ	2,000	723.00	1,446,000
アルトナー	500	636.00	318,000
パソナグループ	1,800	996.00	1,792,800
C D S	500	1,135.00	567,500
リンクアンドモチベーション	3,700	383.00	1,417,100
G C A	2,000	650.00	1,300,000
エス・エム・エス	5,100	2,082.00	10,618,200
サニーサイドアップグループ	500	622.00	311,000
パーソルホールディングス	16,300	1,292.00	21,059,600
リニカル	900	797.00	717,300
クックパッド	6,200	266.00	1,649,200
エスクリ	600	435.00	261,000
アイ・ケイ・ケイ	1,000	519.00	519,000
森永製菓	4,000	4,170.00	16,680,000
中村屋	500	3,485.00	1,742,500
江崎グリコ	5,100	4,180.00	21,318,000
名糖産業	800	1,184.00	947,200
井村屋グループ	700	1,569.00	1,098,300
不二家	1,100	1,810.00	1,991,000
山崎製パン	12,800	1,705.00	21,824,000
第一屋製パン	500	838.00	419,000
モロゾフ	300	4,700.00	1,410,000
亀田製菓	1,000	4,440.00	4,440,000
寿スピリッツ	1,600	4,930.00	7,888,000
カルビー	7,800	2,631.00	20,521,800
森永乳業	3,200	3,680.00	11,776,000
六甲バター	1,200	1,212.00	1,454,400
ヤクルト本社	11,700	5,190.00	60,723,000
明治ホールディングス	11,300	6,620.00	74,806,000
雪印メグミルク	4,200	2,034.00	8,542,800
プリマハム	2,600	2,107.00	5,478,200
日本ハム	6,600	3,880.00	25,608,000
丸大食品	1,800	1,684.00	3,031,200
S F o o d s	1,500	2,158.00	3,237,000
伊藤ハム米久ホールディングス	11,200	565.00	6,328,000
学情	600	1,479.00	887,400
スタジオアリス	900	1,430.00	1,287,000
クロスキャット	500	895.00	447,500



シミックホールディングス	1,000	1,362.00	1,362,000	
エブコ	400	905.00	362,000	
システナ	5,900	1,291.00	7,616,900	
N J S	400	1,517.00	606,800	
デジタルアーツ	800	5,170.00	4,136,000	
日鉄ソリューションズ	2,500	2,737.00	6,842,500	
総合警備保障	6,500	4,815.00	31,297,500	
キューブシステム	1,000	570.00	570,000	
いちご	21,400	319.00	6,826,600	
エイジア	400	1,274.00	509,600	
日本駐車場開発	19,100	129.00	2,463,900	
コア	800	1,085.00	868,000	
カカクコム	12,200	2,283.00	27,852,600	
アイロムグループ	600	1,072.00	643,200	
セントケア・ホールディング	1,300	392.00	509,600	
サイネックス	400	580.00	232,000	
ルネサンス	1,000	1,157.00	1,157,000	
ディップ	2,300	2,270.00	5,221,000	
S B Sホールディングス	1,500	1,479.00	2,218,500	
オプトホールディング	1,000	1,408.00	1,408,000	
新日本科学	1,800	511.00	919,800	
ツクイ	4,100	457.00	1,873,700	
キャリアデザインセンター	500	892.00	446,000	
ベネフィット・ワン	4,600	1,437.00	6,610,200	
エムスリー	35,800	2,975.00	106,505,000	
ツカダ・グローバルホールディング	1,200	368.00	441,600	
プラス	400	529.00	211,600	
アウトソーシング	9,300	662.00	6,156,600	
ウェルネット	1,800	502.00	903,600	
ワールドホールディングス	500	1,389.00	694,500	
ディー・エヌ・エー	8,000	1,330.00	10,640,000	
博報堂D Yホールディングス	22,700	1,140.00	25,878,000	
ぐるなび	3,000	619.00	1,857,000	
タカミヤ	1,800	447.00	804,600	
ジャパンベストレスキューシステム	1,200	648.00	777,600	
ファンコミュニケーションズ	4,600	418.00	1,922,800	
ライク	500	1,435.00	717,500	
ビジネス・ブレークスルー	800	350.00	280,000	
エスプール	3,200	624.00	1,996,800	
W D Bホールディングス	700	2,113.00	1,479,100	
ティア	1,100	478.00	525,800	
C D G	300	1,195.00	358,500	
バリューコマース	1,000	1,921.00	1,921,000	
インフォマート	17,800	604.00	10,751,200	
サッポロホールディングス	5,800	2,056.00	11,924,800	
アサヒグループホールディングス	35,600	3,691.00	131,399,600	
麒麟ホールディングス	72,100	2,044.00	147,372,400	
宝ホールディングス	12,700	779.00	9,893,300	
オエノンホールディングス	4,800	358.00	1,718,400	
養命酒製造	500	1,822.00	911,000	

コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	12,000	2,045.00	24,540,000	
サントリー食品インターナショナル	11,400	3,985.00	45,429,000	
ダイドーグループホールディングス	1,000	3,090.00	3,090,000	
伊藤園	5,200	4,590.00	23,868,000	
キーコーヒー	1,800	2,112.00	3,801,600	
ユニカフェ	600	799.00	479,400	
ジャパンフーズ	200	1,072.00	214,400	
日清オイリオグループ	2,200	3,195.00	7,029,000	
不二製油グループ本社	4,200	2,404.00	10,096,800	
かどや製油	200	3,390.00	678,000	
J - オイルミルズ	900	3,685.00	3,316,500	
ローソン	4,300	5,410.00	23,263,000	
サンエー	1,500	3,985.00	5,977,500	
カワチ薬品	1,400	1,942.00	2,718,800	
エービーシー・マート	2,500	5,590.00	13,975,000	
ハードオフコーポレーション	600	676.00	405,600	
高千穂交易	600	968.00	580,800	
アスクル	1,800	2,692.00	4,845,600	
ゲオホールディングス	3,100	1,121.00	3,475,100	
アダストリア	2,300	1,503.00	3,456,900	
ジーフット	1,200	420.00	504,000	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	300	409.00	122,700	
伊藤忠食品	500	4,195.00	2,097,500	
くら寿司	900	4,345.00	3,910,500	
キャンドゥ	900	1,538.00	1,384,200	
エレマテック	1,500	811.00	1,216,500	
パルグループホールディングス	1,800	1,321.00	2,377,800	
JALUX	500	1,614.00	807,000	
エディオン	7,600	877.00	6,665,200	
あらた	1,400	3,980.00	5,572,000	
サーラコーポレーション	3,300	512.00	1,689,600	
ワッツ	1,000	478.00	478,000	
トーマンデバイス	300	3,105.00	931,500	
ハローズ	600	2,340.00	1,404,000	
J Pホールディングス	5,400	254.00	1,371,600	
フジオフードシステム	1,500	1,314.00	1,971,000	
あみやき亭	400	2,936.00	1,174,400	
東京エレクトロン デバイス	600	2,119.00	1,271,400	
ひらまつ	3,200	162.00	518,400	
フィールズ	1,500	331.00	496,500	
双日	91,900	275.00	25,272,500	
アルフレッサ ホールディングス	18,600	1,897.00	35,284,200	
大黒天物産	500	2,748.00	1,374,000	
ハニーズホールディングス	1,500	1,083.00	1,624,500	
ファーマライズホールディングス	500	567.00	283,500	
キッコーマン	12,300	4,710.00	57,933,000	
味の素	37,700	1,747.00	65,861,900	
キュービー	9,600	1,917.00	18,403,200	
ハウス食品グループ本社	6,400	3,240.00	20,736,000	

カゴメ	6,500	2,281.00	14,826,500
焼津水産化学工業	700	896.00	627,200
アリアケジャパン	1,600	6,500.00	10,400,000
ピエトロ	200	1,559.00	311,800
エバラ食品工業	400	2,017.00	806,800
やまみ	200	1,833.00	366,600
ニチレイ	8,200	2,783.00	22,820,600
横浜冷凍	4,800	806.00	3,868,800
東洋水産	8,800	4,170.00	36,696,000
イートアンド	600	1,641.00	984,600
大冷	200	1,649.00	329,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,000	889.00	889,000
日清食品ホールディングス	7,200	8,150.00	58,680,000
永谷園ホールディングス	800	1,983.00	1,586,400
一正蒲鉾	700	746.00	522,200
フジッコ	1,800	1,743.00	3,137,400
ロック・フィールド	1,900	1,221.00	2,319,900
日本たばこ産業	98,000	2,103.50	206,143,000
ケンコーマヨネーズ	1,000	1,959.00	1,959,000
わらべや日洋ホールディングス	1,300	1,588.00	2,064,400
なとり	1,000	1,558.00	1,558,000
イフジ産業	100	766.00	76,600
ピククルスコーポレーション	400	2,050.00	820,000
北の達人コーポレーション	5,900	497.00	2,932,300
ユーグレナ	7,300	714.00	5,212,200
スター・マイカ・ホールディングス	900	1,210.00	1,089,000
片倉工業	2,400	1,059.00	2,541,600
グンゼ	1,300	3,525.00	4,582,500
ヒューリック	35,800	1,093.00	39,129,400
ラサ商事	600	805.00	483,000
アルペン	1,400	1,495.00	2,093,000
ハブ	500	696.00	348,000
ラクーンホールディングス	800	543.00	434,400
クオールホールディングス	2,500	1,178.00	2,945,000
アルコニックス	1,800	1,019.00	1,834,200
神戸物産	5,700	4,050.00	23,085,000
ソリトンシステムズ	800	881.00	704,800
ジンズホールディングス	900	6,390.00	5,751,000
ビックカメラ	9,900	898.00	8,890,200
DCMホールディングス	9,000	960.00	8,640,000
MonotaRO	11,900	2,538.00	30,202,200
東京一番フーズ	500	507.00	253,500
DDホールディングス	700	1,008.00	705,600
あいホールディングス	2,400	1,344.00	3,225,600
ディービーエックス	700	813.00	569,100
きちりホールディングス	500	549.00	274,500
アークランドサービスホールディングス	1,300	1,530.00	1,989,000
J.フロントリテイリング	19,800	978.00	19,364,400
ドトール・日レスホールディングス	2,600	1,659.00	4,313,400

マツモトキヨシホールディングス	6,900	3,510.00	24,219,000
ブロンコビリー	900	2,031.00	1,827,900
Z O Z O	11,600	1,412.00	16,379,200
トレジャー・ファクトリー	600	645.00	387,000
物語コーポレーション	500	6,530.00	3,265,000
ココカラファイン	1,800	5,010.00	9,018,000
三越伊勢丹ホールディングス	29,400	606.00	17,816,400
東洋紡	6,600	1,223.00	8,071,800
ユニチカ	5,600	250.00	1,400,000
富士紡ホールディングス	800	2,623.00	2,098,400
日清紡ホールディングス	11,500	742.00	8,533,000
倉敷紡績	1,600	1,797.00	2,875,200
ダイワボウホールディングス	1,500	4,920.00	7,380,000
シキボウ	900	1,007.00	906,300
日東紡績	2,500	3,805.00	9,512,500
トヨタ紡織	5,100	1,285.00	6,553,500
マクニカ・富士エレホールディングス	4,000	1,365.00	5,460,000
H a m e e	600	1,215.00	729,000
ラクト・ジャパン	600	3,255.00	1,953,000
ウエルシアホールディングス	5,000	6,620.00	33,100,000
クリエイトSDホールディングス	2,700	2,426.00	6,550,200
パイタルケーエスケー・ホールディングス	3,400	1,001.00	3,403,400
八洲電機	1,300	722.00	938,600
メディアスホールディングス	1,300	668.00	868,400
レスターホールディングス	1,800	1,459.00	2,626,200
ジュテックホールディングス	500	928.00	464,000
丸善CHIホールディングス	2,200	313.00	688,600
大光	800	490.00	392,000
O C H Iホールディングス	500	1,208.00	604,000
T O K A Iホールディングス	8,800	844.00	7,427,200
黒谷	500	329.00	164,500
ミサワ	500	581.00	290,500
ティーライフ	200	955.00	191,000
C o m i n i x	300	685.00	205,500
三洋貿易	1,700	833.00	1,416,100
チムニー	500	1,763.00	881,500
シュッピン	1,200	738.00	885,600
ビューティガレージ	300	1,469.00	440,700
ウイン・パートナーズ	1,200	994.00	1,192,800
ネクステージ	2,400	709.00	1,701,600
ジョイフル本田	4,800	1,030.00	4,944,000
鳥貴族	600	1,855.00	1,113,000
キリン堂ホールディングス	700	1,543.00	1,080,100
ホットランド	1,300	982.00	1,276,600
すかいらーくホールディングス	18,800	1,620.00	30,456,000
S F Pホールディングス	700	1,512.00	1,058,400
綿半ホールディングス	600	1,473.00	883,800
日本毛織	5,500	837.00	4,603,500
トーア紡コーポレーション	700	416.00	291,200

ダイドーリミテッド	3,100	190.00	589,000
ヨシックス	300	2,045.00	613,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,200	804.00	4,180,800
三栄建築設計	700	1,240.00	868,000
野村不動産ホールディングス	10,200	2,219.00	22,633,800
三重交通グループホールディングス	3,600	456.00	1,641,600
サムティ	2,400	1,449.00	3,477,600
ディア・ライフ	2,200	429.00	943,800
コーセーアールイー	500	428.00	214,000
エー・ディー・ワークス	34,600	21.00	726,600
日本商業開発	1,100	1,460.00	1,606,000
プレサンスコーポレーション	2,700	1,087.00	2,934,900
ユニゾホールディングス	2,500	5,610.00	14,025,000
THEグローバル社	1,100	332.00	365,200
ハウスコム	300	1,252.00	375,600
日本管理センター	1,200	1,023.00	1,227,600
サンセイランディック	600	678.00	406,800
エストラスト	300	567.00	170,100
フージャースホールディングス	3,500	633.00	2,215,500
オープンハウス	4,900	2,665.00	13,058,500
東急不動産ホールディングス	46,400	634.00	29,417,600
飯田グループホールディングス	14,000	1,474.00	20,636,000
イーグランド	400	670.00	268,000
ムゲンエステート	1,400	457.00	639,800
帝国繊維	1,800	1,681.00	3,025,800
日本コークス工業	14,900	58.00	864,200
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	544.00	435,200
ミタチ産業	500	565.00	282,500
B E E N O S	600	865.00	519,000
あさひ	1,300	1,054.00	1,370,200
日本調剤	500	3,405.00	1,702,500
コスモス薬品	700	22,730.00	15,911,000
シップヘルスケアホールディングス	2,600	4,370.00	11,362,000
トーエル	600	576.00	345,600
ソフトクリエイイトホールディングス	700	1,363.00	954,100
セブン&アイ・ホールディングス	65,300	3,722.00	243,046,600
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	9,600	726.00	6,969,600
明治電機工業	500	1,234.00	617,000
ツルハホールディングス	3,600	12,480.00	44,928,000
デリカフーズホールディングス	700	589.00	412,300
スターティアホールディングス	500	468.00	234,000
サンマルクホールディングス	1,300	1,778.00	2,311,400
フェリシモ	400	885.00	354,000
トリドールホールディングス	2,100	2,313.00	4,857,300
帝人	13,600	1,687.00	22,943,200
東レ	120,700	539.60	65,129,720
クラレ	26,300	1,052.00	27,667,600
旭化成	109,900	790.70	86,897,930

サカイオーベックス	400	1,684.00	673,600
TOKYO BASE	1,500	334.00	501,000
稲葉製作所	900	1,098.00	988,200
宮地エンジニアリンググループ	500	1,635.00	817,500
トーカロ	4,700	901.00	4,234,700
アルファ	500	944.00	472,000
SUMCO	20,100	1,534.00	30,833,400
川田テクノロジーズ	400	5,220.00	2,088,000
RS Technologies	500	2,237.00	1,118,500
信和	700	856.00	599,200
ビーロット	500	1,304.00	652,000
ファーストブラザーズ	500	846.00	423,000
ハウズドゥ	800	909.00	727,200
シーアールイー	500	907.00	453,500
プロパティエージェント	400	795.00	318,000
ケイアイスター不動産	500	1,294.00	647,000
アグレ都市デザイン	500	440.00	220,000
グッドコムアセット	500	1,375.00	687,500
ジェイ・エス・ビー	200	4,210.00	842,000
テンポイノベーション	500	705.00	352,500
グローバル・リンク・マネジメント	500	605.00	302,500
住江織物	400	1,778.00	711,200
日本フェルト	700	397.00	277,900
イチカワ	200	1,214.00	242,800
日東製網	200	1,409.00	281,800
芦森工業	500	898.00	449,000
アツギ	1,300	637.00	828,100
ウイルプラスホールディングス	200	581.00	116,200
JMホールディングス	900	1,914.00	1,722,600
コメダホールディングス	3,700	1,735.00	6,419,500
サツドラホールディングス	500	1,626.00	813,000
アレザホールディングス	900	658.00	592,200
串カツ田中ホールディングス	300	1,516.00	454,800
バロックジャパンリミテッド	1,300	706.00	917,800
クスリのアオキホールディングス	1,500	6,690.00	10,035,000
ダイニック	500	628.00	314,000
共和レザー	600	643.00	385,800
力の源ホールディングス	800	674.00	539,200
スシログローバルホールディングス	1,800	7,100.00	12,780,000
LIXILビバ	1,700	2,000.00	3,400,000
アセンテック	200	2,102.00	420,400
セーレン	4,100	1,260.00	5,166,000
ソトー	500	891.00	445,500
東海染工	300	1,115.00	334,500
小松マテーレ	2,600	653.00	1,697,800
ワコールホールディングス	4,400	2,371.00	10,432,400
ホギメディカル	1,800	2,910.00	5,238,000
クラウドシアホールディングス	500	349.00	174,500
TSIホールディングス	5,700	364.00	2,074,800
マツオカコーポレーション	500	1,671.00	835,500

ワールド	2,400	1,780.00	4,272,000
T I S	5,500	5,970.00	32,835,000
ネオス	700	471.00	329,700
電算システム	700	2,034.00	1,423,800
グリー	10,500	418.00	4,389,000
コーエーテクモホールディングス	3,400	2,603.00	8,850,200
三菱総合研究所	700	3,255.00	2,278,500
ボルテージ	600	350.00	210,000
電算	200	2,018.00	403,600
A G S	1,000	600.00	600,000
ファインデックス	1,500	674.00	1,011,000
ブレインパッド	500	4,200.00	2,100,000
K L a b	3,400	642.00	2,182,800
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,000	758.00	1,516,000
イーブクイニシアティブジャパン	300	1,373.00	411,900
ネクソン	47,400	1,664.00	78,873,600
アイスタイル	4,800	264.00	1,267,200
エムアップ	500	2,210.00	1,105,000
エイチーム	1,200	730.00	876,000
エニグモ	1,300	721.00	937,300
テクノスジャパン	1,400	364.00	509,600
コロブラ	5,500	840.00	4,620,000
ブロードリーフ	8,500	415.00	3,527,500
クロス・マーケティンググループ	1,000	299.00	299,000
デジタルハーツホールディングス	1,000	738.00	738,000
システム情報	900	662.00	595,800
メディアドゥホールディングス	500	2,876.00	1,438,000
じげん	4,400	347.00	1,526,800
ブイキューブ	1,200	730.00	876,000
エンカレッジ・テクノロジー	400	620.00	248,000
サイバーリンクス	400	792.00	316,800
フィックスターズ	1,800	949.00	1,708,200
C A R T A H O L D I N G S	900	906.00	815,400
オブティム	500	3,620.00	1,810,000
セレス	600	926.00	555,600
S H I F T	500	7,030.00	3,515,000
特種東海製紙	1,000	3,555.00	3,555,000
ティーガイア	1,500	1,894.00	2,841,000
セック	300	2,897.00	869,100
豆蔵ホールディングス	1,200	1,871.00	2,245,200
テクマトリックス	1,200	2,240.00	2,688,000
プロシップ	500	1,290.00	645,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,000	1,618.00	6,472,000
G M O ペイメントゲートウェイ	2,700	7,290.00	19,683,000
ザッパラス	1,400	300.00	420,000
システムリサーチ	500	1,572.00	786,000
インターネットイニシアティブ	2,500	2,954.00	7,385,000
さくらインターネット	1,800	438.00	788,400

ヴィンクス	500	767.00	383,500	
GMOクラウド	400	1,821.00	728,400	
SRAホールディングス	800	2,247.00	1,797,600	
システムインテグレータ	600	629.00	377,400	
朝日ネット	1,500	688.00	1,032,000	
eBASE	1,000	1,672.00	1,672,000	
アバント	1,300	823.00	1,069,900	
アドソル日進	600	2,074.00	1,244,400	
フリービット	900	660.00	594,000	
コムチュア	1,800	1,972.00	3,549,600	
サイバーコム	400	1,470.00	588,000	
アステリア	1,100	385.00	423,500	
アイル	600	1,357.00	814,200	
王子ホールディングス	69,500	458.00	31,831,000	
日本製紙	7,600	1,460.00	11,096,000	
三菱製紙	2,500	342.00	855,000	
北越コーポレーション	11,000	384.00	4,224,000	
中越パルプ工業	700	1,181.00	826,700	
大王製紙	7,300	1,390.00	10,147,000	
阿波製紙	700	460.00	322,000	
マークライنز	900	1,631.00	1,467,900	
メディカル・データ・ビジョン	1,400	634.00	887,600	
gumi	2,300	605.00	1,391,500	
ショーケース	500	458.00	229,000	
モバイルファクトリー	400	1,310.00	524,000	
テラスカイ	600	2,657.00	1,594,200	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	700	1,253.00	877,100	
PCIホールディングス	400	1,829.00	731,600	
パイブドHD	300	1,271.00	381,300	
アイビーシー	400	790.00	316,000	
ネオジャパン	400	1,084.00	433,600	
PR TIMES	200	1,937.00	387,400	
ランドコンピュータ	300	976.00	292,800	
ダブルスタンダード	300	3,265.00	979,500	
オープンドア	900	921.00	828,900	
アカツキ	600	3,860.00	2,316,000	
ベネフィットジャパン	200	1,469.00	293,800	
Ubicomホールディングス	500	1,221.00	610,500	
LINE	3,800	5,270.00	20,026,000	
カナミックネットワーク	1,100	563.00	619,300	
ノムラシステムコーポレーション	500	365.00	182,500	
レンゴー	15,700	771.00	12,104,700	
トーモク	1,000	1,506.00	1,506,000	
ザ・バック	1,300	3,180.00	4,134,000	
チェンジ	400	3,635.00	1,454,000	
シンクロ・フード	800	265.00	212,000	
オークネット	1,100	935.00	1,028,500	
セグエグループ	400	646.00	258,400	
エイトレッド	300	1,198.00	359,400	



AOI TYO HOLDINGS	1,800	530.00	954,000	
マクロミル	3,500	711.00	2,488,500	
ビーグリー	500	1,221.00	610,500	
オロ	500	2,658.00	1,329,000	
テモナ	400	605.00	242,000	
ニーズウェル	400	562.00	224,800	
サインポスト	300	1,446.00	433,800	
昭和電工	11,800	1,956.00	23,080,800	
住友化学	121,900	335.00	40,836,500	
住友精化	700	2,659.00	1,861,300	
日産化学	9,300	4,215.00	39,199,500	
ラサ工業	600	1,163.00	697,800	
クレハ	1,500	4,635.00	6,952,500	
多木化学	500	3,425.00	1,712,500	
テイカ	1,200	1,392.00	1,670,400	
石原産業	3,100	612.00	1,897,200	
片倉コープアグリ	400	989.00	395,600	
日本曹達	2,500	2,679.00	6,697,500	
東ソー	25,700	1,292.00	33,204,400	
トクヤマ	4,800	2,332.00	11,193,600	
セントラル硝子	3,400	1,841.00	6,259,400	
東亜合成	10,400	946.00	9,838,400	
大阪ソーダ	1,700	2,429.00	4,129,300	
関東電化工業	4,000	840.00	3,360,000	
デンカ	6,000	2,368.00	14,208,000	
イビデン	10,500	2,263.00	23,761,500	
信越化学工業	28,500	11,275.00	321,337,500	
日本カーバイド工業	500	1,010.00	505,000	
堺化学工業	1,100	1,749.00	1,923,900	
第一稀元素化学工業	1,800	706.00	1,270,800	
エア・ウォーター	15,600	1,321.00	20,607,600	
大陽日酸	16,000	1,894.00	30,304,000	
日本化学工業	500	2,199.00	1,099,500	
東邦アセチレン	200	1,185.00	237,000	
日本パーカライジング	8,400	948.00	7,963,200	
高圧ガス工業	2,400	594.00	1,425,600	
チタン工業	300	1,728.00	518,400	
四国化成工業	2,500	1,005.00	2,512,500	
戸田工業	500	1,450.00	725,000	
ステラ ケミファ	900	2,543.00	2,288,700	
保土谷化学工業	600	3,230.00	1,938,000	
日本触媒	2,500	5,220.00	13,050,000	
大日精化工業	1,400	2,133.00	2,986,200	
カネカ	4,400	2,587.00	11,382,800	
協和キリン	17,100	2,418.00	41,347,800	
三菱瓦斯化学	15,500	1,358.00	21,049,000	
三井化学	15,000	2,261.00	33,915,000	
J S R	15,600	1,774.00	27,674,400	
東京応化工業	2,800	3,740.00	10,472,000	
大阪有機化学工業	1,500	1,440.00	2,160,000	

三菱ケミカルホールディングス	110,700	649.50	71,899,650
KHネオケム	2,900	1,688.00	4,895,200
ダイセル	22,900	815.00	18,663,500
住友ベークライト	2,600	2,845.00	7,397,000
積水化学工業	35,700	1,420.00	50,694,000
日本ゼオン	15,000	907.00	13,605,000
アイカ工業	5,000	2,998.00	14,990,000
宇部興産	8,400	1,709.00	14,355,600
積水樹脂	2,900	1,973.00	5,721,700
タキロンシーアイ	3,500	549.00	1,921,500
旭有機材	1,000	1,311.00	1,311,000
日立化成	7,700	4,545.00	34,996,500
ニチバン	900	1,448.00	1,303,200
リケンテクノス	4,100	372.00	1,525,200
大倉工業	700	1,345.00	941,500
積水化成品工業	2,300	530.00	1,219,000
群栄化学工業	400	2,259.00	903,600
タイガースポリマー	900	468.00	421,200
ミライアル	600	926.00	555,600
ダイキアクシス	600	689.00	413,400
ダイキョーニシカワ	3,500	527.00	1,844,500
竹本容器	700	618.00	432,600
森六ホールディングス	700	1,597.00	1,117,900
日本化薬	10,400	1,077.00	11,200,800
カーリットホールディングス	2,000	445.00	890,000
E P Sホールディングス	2,500	1,031.00	2,577,500
ソルクシーズ	800	624.00	499,200
レグス	500	884.00	442,000
プレステージ・インターナショナル	6,100	809.00	4,934,900
フェイス	700	661.00	462,700
プロトコーポレーション	1,500	894.00	1,341,000
ハイマックス	200	1,617.00	323,400
アミューズ	900	2,087.00	1,878,300
野村総合研究所	23,600	2,184.00	51,542,400
ドリームインキュベータ	500	1,293.00	646,500
サイバネットシステム	1,300	591.00	768,300
クイック	1,100	1,130.00	1,243,000
T A C	1,800	169.00	304,200
C Eホールディングス	1,100	430.00	473,000
ケネディクス	15,200	529.00	8,040,800
日本システム技術	300	880.00	264,000
電通グループ	16,700	2,414.00	40,313,800
インテージホールディングス	2,000	782.00	1,564,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	700	749.00	524,300
東邦システムサイエンス	500	758.00	379,000
ぴあ	500	2,335.00	1,167,500
イオンファンタジー	700	1,682.00	1,177,400
ソースネクスト	8,100	292.00	2,365,200
シーティーエス	1,800	532.00	957,600
ネクシーズグループ	600	1,097.00	658,200

インフォコム	1,800	2,547.00	4,584,600	
メディカルシステムネットワーク	1,800	447.00	804,600	
日本精化	1,300	1,244.00	1,617,200	
扶桑化学工業	1,700	2,786.00	4,736,200	
トリケミカル研究所	400	8,510.00	3,404,000	
ラクスル	900	2,658.00	2,392,200	
F I G	2,100	204.00	428,400	
システムサポート	200	2,355.00	471,000	
A D E K A	7,600	1,303.00	9,902,800	
日油	6,200	3,335.00	20,677,000	
ミヨシ油脂	600	947.00	568,200	
新日本理化	2,900	146.00	423,400	
ハリマ化成グループ	1,400	937.00	1,311,800	
イーソル	600	1,244.00	746,400	
アルテリア・ネットワークス	1,800	1,691.00	3,043,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	500	977.00	488,500	
花王	40,600	8,084.00	328,210,400	
第一工業製薬	600	3,405.00	2,043,000	
石原ケミカル	500	1,627.00	813,500	
日華化学	600	631.00	378,600	
ニイタカ	300	2,106.00	631,800	
三洋化成工業	1,000	4,185.00	4,185,000	
武田薬品工業	140,800	3,759.00	529,267,200	
アステラス製薬	148,900	1,645.00	244,940,500	
大日本住友製薬	12,700	1,453.00	18,453,100	
塩野義製薬	21,700	5,421.00	117,635,700	
わかもと製薬	3,200	221.00	707,200	
あすか製薬	1,900	944.00	1,793,600	
日本新薬	4,500	7,300.00	32,850,000	
バイオフェルミン製薬	300	2,238.00	671,400	
中外製薬	17,700	11,225.00	198,682,500	
科研製薬	2,900	4,830.00	14,007,000	
エーザイ	20,300	7,918.00	160,735,400	
理研ビタミン	800	3,615.00	2,892,000	
ロート製薬	8,700	2,799.00	24,351,300	
小野薬品工業	39,000	2,134.00	83,226,000	
久光製薬	4,500	4,430.00	19,935,000	
有機合成薬品工業	1,800	246.00	442,800	
持田製薬	2,300	3,625.00	8,337,500	
参天製薬	31,600	1,677.00	52,993,200	
扶桑薬品工業	500	1,639.00	819,500	
日本ケミファ	300	2,041.00	612,300	
ツムラ	5,300	2,568.00	13,610,400	
日医工	4,900	1,058.00	5,184,200	
テルモ	48,000	3,413.00	163,824,000	
みらかホールディングス	4,600	2,480.00	11,408,000	
キッセイ薬品工業	3,000	2,443.00	7,329,000	
生化学工業	3,300	1,016.00	3,352,800	
栄研化学	3,000	1,800.00	5,400,000	

日水製薬	600	1,185.00	711,000	
鳥居薬品	1,100	2,844.00	3,128,400	
JCRファーマ	1,200	8,910.00	10,692,000	
東和薬品	2,200	2,053.00	4,516,600	
富士製薬工業	1,200	1,015.00	1,218,000	
沢井製薬	3,500	5,460.00	19,110,000	
ゼリア新薬工業	3,100	1,686.00	5,226,600	
第一三共	48,500	6,355.00	308,217,500	
キョーリン製薬ホールディングス	3,700	2,006.00	7,422,200	
大幸薬品	700	4,285.00	2,999,500	
ダイト	1,000	2,677.00	2,677,000	
大塚ホールディングス	32,300	3,780.00	122,094,000	
大正製薬ホールディングス	3,500	6,140.00	21,490,000	
ペプチドリーム	8,600	4,490.00	38,614,000	
大日本塗料	1,800	800.00	1,440,000	
日本ペイントホールディングス	13,700	5,040.00	69,048,000	
関西ペイント	18,700	2,247.00	42,018,900	
神東塗料	1,600	148.00	236,800	
中国塗料	4,800	860.00	4,128,000	
日本特殊塗料	1,200	922.00	1,106,400	
藤倉化成	1,900	413.00	784,700	
太陽ホールディングス	1,300	3,875.00	5,037,500	
D I C	7,000	2,345.00	16,415,000	
サカタインクス	3,700	843.00	3,119,100	
東洋インキS Cホールディングス	3,500	1,891.00	6,618,500	
T & K T O K A	1,300	699.00	908,700	
アルプス技研	1,500	1,542.00	2,313,000	
ダイオーズ	400	1,128.00	451,200	
日本空調サービス	1,700	618.00	1,050,600	
オリエンタルランド	17,200	13,150.00	226,180,000	
フォーカスシステムズ	1,100	723.00	795,300	
ダスキン	4,300	2,610.00	11,223,000	
パーク24	9,000	1,998.00	17,982,000	
明光ネットワークジャパン	2,000	742.00	1,484,000	
ファルコホールディングス	900	1,536.00	1,382,400	
クレスコ	1,000	1,512.00	1,512,000	
フジ・メディア・ホールディングス	16,000	1,156.00	18,496,000	
田谷	900	561.00	504,900	
ラウンドワン	4,600	706.00	3,247,600	
リゾートトラスト	7,600	1,231.00	9,355,600	
オービック	5,700	14,080.00	80,256,000	
ジャストシステム	2,700	5,000.00	13,500,000	
T D C ソフト	1,500	751.00	1,126,500	
Zホールディングス	228,100	376.00	85,765,600	
ビー・エム・エル	2,100	2,677.00	5,621,700	
ワタベウェディング	500	365.00	182,500	
トレンドマイクロ	7,400	4,995.00	36,963,000	
りらいあコミュニケーションズ	3,000	1,119.00	3,357,000	
I Dホールディングス	600	1,351.00	810,600	
リソー教育	7,600	293.00	2,226,800	

日本オラクル	3,400	7,950.00	27,030,000
早稲田アカデミー	600	854.00	512,400
アルファシステムズ	500	2,424.00	1,212,000
フューチャー	2,000	1,464.00	2,928,000
CAC Holdings	1,200	968.00	1,161,600
S Bテクノロジー	600	1,981.00	1,188,600
トーセ	500	683.00	341,500
ユー・エス・エス	18,200	1,563.00	28,446,600
オービックビジネスコンサルタント	1,700	3,660.00	6,222,000
伊藤忠テクノソリューションズ	7,600	2,815.00	21,394,000
アイティフォー	2,100	607.00	1,274,700
東京個別指導学院	700	463.00	324,100
東計電算	200	3,830.00	766,000
サイバーエージェント	9,300	4,000.00	37,200,000
楽天	75,600	778.00	58,816,800
エクスネット	300	863.00	258,900
クリーク・アンド・リバー社	900	801.00	720,900
テー・オー・ダブリュー	1,400	636.00	890,400
大塚商会	9,000	4,575.00	41,175,000
サイボウズ	1,900	1,619.00	3,076,100
ソフトブレーン	1,100	404.00	444,400
山田コンサルティンググループ	800	1,066.00	852,800
セントラルスポーツ	600	2,158.00	1,294,800
パラカ	500	1,502.00	751,000
電通国際情報サービス	1,100	4,330.00	4,763,000
デジタルガレージ	3,000	3,265.00	9,795,000
イーエムシステムズ	2,400	813.00	1,951,200
ウェザーニューズ	500	3,190.00	1,595,000
C I J	1,300	719.00	934,700
ビジネスエンジニアリング	200	2,382.00	476,400
日本エンタープライズ	2,100	194.00	407,400
WOWOW	800	2,319.00	1,855,200
スカラ	1,200	471.00	565,200
インテリジェント ウェイブ	900	538.00	484,200
フルキャストホールディングス	1,600	1,656.00	2,649,600
エン・ジャパン	2,900	2,777.00	8,053,300
富士フイルムホールディングス	32,500	4,985.00	162,012,500
コニカミノルタ	37,300	521.00	19,433,300
資生堂	33,700	6,484.00	218,510,800
ライオン	22,000	1,937.00	42,614,000
高砂香料工業	1,100	1,878.00	2,065,800
マンダム	3,800	2,171.00	8,249,800
ミルボン	2,300	5,200.00	11,960,000
ファンケル	6,900	2,655.00	18,319,500
コーセー	3,200	13,140.00	42,048,000
コタ	900	1,313.00	1,181,700
シーボン	300	2,100.00	630,000
ポーラ・オルビスホールディングス	7,300	2,029.00	14,811,700
ノエビアホールディングス	1,600	4,570.00	7,312,000
アジュバンコスメジャパン	500	928.00	464,000

エステー	1,200	1,342.00	1,610,400
アグロ カネショウ	500	1,209.00	604,500
コニシ	2,700	1,316.00	3,553,200
長谷川香料	2,200	1,894.00	4,166,800
星光PMC	1,100	698.00	767,800
小林製薬	4,700	8,180.00	38,446,000
荒川化学工業	1,500	1,134.00	1,701,000
メック	1,200	1,205.00	1,446,000
日本高純度化学	500	2,259.00	1,129,500
タカラバイオ	4,500	1,870.00	8,415,000
JCU	2,000	2,292.00	4,584,000
新田ゼラチン	1,100	500.00	550,000
OATアグリオ	400	1,059.00	423,600
デクセリアルズ	4,500	698.00	3,141,000
アース製薬	1,400	5,150.00	7,210,000
北興化学工業	1,500	521.00	781,500
大成ラミック	500	2,359.00	1,179,500
クミアイ化学工業	7,100	687.00	4,877,700
日本農薬	3,300	459.00	1,514,700
富士興産	800	490.00	392,000
ニチレキ	1,900	1,212.00	2,302,800
ユシロ化学工業	900	1,116.00	1,004,400
ビーピー・カストロール	600	1,157.00	694,200
富士石油	4,700	181.00	850,700
MORESCO	600	966.00	579,600
出光興産	19,100	2,428.00	46,374,800
JXTGホールディングス	254,900	370.50	94,440,450
コスモエネルギーホールディングス	4,900	1,455.00	7,129,500
横浜ゴム	9,800	1,579.00	15,474,200
TOYO TIRE	9,700	1,359.00	13,182,300
ブリヂストン	48,700	3,271.00	159,297,700
住友ゴム工業	15,400	1,011.00	15,569,400
藤倉コンポジット	1,600	356.00	569,600
オカモト	1,100	3,405.00	3,745,500
アキレス	1,200	1,416.00	1,699,200
フコク	900	555.00	499,500
ニッタ	1,800	2,097.00	3,774,600
クリエートメディック	400	991.00	396,400
住友理工	3,500	649.00	2,271,500
三ツ星ベルト	2,200	1,396.00	3,071,200
バンドー化学	2,800	615.00	1,722,000
AGC	16,700	2,884.00	48,162,800
日本板硝子	8,300	421.00	3,494,300
石塚硝子	400	1,953.00	781,200
有沢製作所	2,700	791.00	2,135,700
日本山村硝子	700	924.00	646,800
日本電気硝子	6,800	1,557.00	10,587,600
オハラ	800	921.00	736,800
住友大阪セメント	3,200	3,545.00	11,344,000
太平洋セメント	10,700	2,236.00	23,925,200

リソルホールディングス	200	3,595.00	719,000
日本ヒューム	1,800	553.00	995,400
日本コンクリート工業	3,900	220.00	858,000
三谷セキサン	800	3,605.00	2,884,000
アジアパイルホールディングス	2,400	395.00	948,000
東海カーボン	17,700	875.00	15,487,500
日本カーボン	900	3,220.00	2,898,000
東洋炭素	1,000	1,454.00	1,454,000
ノリタケカンパニーリミテド	1,000	3,420.00	3,420,000
TOTO	12,200	3,885.00	47,397,000
日本碍子	20,700	1,495.00	30,946,500
日本特殊陶業	13,200	1,529.00	20,182,800
MARUWA	600	6,660.00	3,996,000
品川リフラクトリーズ	500	2,354.00	1,177,000
黒崎播磨	400	4,770.00	1,908,000
ヨータイ	1,400	594.00	831,600
イソライト工業	900	504.00	453,600
東京窯業	2,100	249.00	522,900
ニッカトー	800	496.00	396,800
フジインコーポレーテッド	1,500	2,509.00	3,763,500
クニミネ工業	800	956.00	764,800
エーアンドエーマテリアル	300	1,113.00	333,900
ニチアス	4,600	1,974.00	9,080,400
日本製鉄	75,400	1,022.50	77,096,500
神戸製鋼所	31,800	342.00	10,875,600
中山製鋼所	2,200	367.00	807,400
合同製鐵	900	2,210.00	1,989,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	45,600	804.00	36,662,400
東京製鐵	8,200	619.00	5,075,800
共英製鋼	1,800	1,428.00	2,570,400
大和工業	3,500	2,025.00	7,087,500
東京鐵鋼	600	1,103.00	661,800
大阪製鐵	800	1,378.00	1,102,400
淀川製鋼所	2,100	1,695.00	3,559,500
丸一鋼管	5,400	2,355.00	12,717,000
モリ工業	500	2,018.00	1,009,000
大同特殊鋼	2,700	3,305.00	8,923,500
日本高周波鋼業	700	319.00	223,300
日本冶金工業	1,500	1,557.00	2,335,500
山陽特殊製鋼	1,300	947.00	1,231,100
愛知製鋼	900	2,751.00	2,475,900
日立金属	18,100	1,300.00	23,530,000
日本金属	400	657.00	262,800
大平洋金属	1,200	1,708.00	2,049,600
新日本電工	11,600	136.00	1,577,600
栗本鐵工所	800	1,657.00	1,325,600
虹 技	200	1,000.00	200,000
日本製鋼所	5,200	1,288.00	6,697,600
三菱製鋼	1,300	758.00	985,400

日亜鋼業	2,300	238.00	547,400
日本精線	300	2,844.00	853,200
エンビプロ・ホールディングス	700	537.00	375,900
大紀アルミニウム工業所	2,700	553.00	1,493,100
日本軽金属ホールディングス	42,600	162.00	6,901,200
三井金属鉱業	4,600	2,143.00	9,857,800
東邦亜鉛	900	1,395.00	1,255,500
三菱マテリアル	11,100	2,100.00	23,310,000
住友金属鉱山	21,400	2,361.50	50,536,100
DOWAホールディングス	4,300	2,928.00	12,590,400
古河機械金属	2,900	1,076.00	3,120,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,800	949.00	1,708,200
東邦チタニウム	3,100	649.00	2,011,900
UACJ	2,500	1,580.00	3,950,000
CKサンエツ	400	2,448.00	979,200
古河電気工業	5,300	1,967.00	10,425,100
住友電気工業	62,600	1,169.50	73,210,700
フジクラ	20,800	286.00	5,948,800
昭和電線ホールディングス	2,000	936.00	1,872,000
東京特殊電線	300	2,190.00	657,000
タツタ電線	3,400	462.00	1,570,800
カナレ電気	300	1,517.00	455,100
平河ヒューテック	600	867.00	520,200
リョービ	2,000	1,237.00	2,474,000
アーレスティ	2,300	377.00	867,100
アサヒホールディングス	2,900	2,382.00	6,907,800
東洋製罐グループホールディングス	10,700	1,520.00	16,264,000
ホッカンホールディングス	800	1,397.00	1,117,600
コロナ	800	925.00	740,000
横河ブリッジホールディングス	3,100	1,814.00	5,623,400
OSJBホールディングス	8,600	231.00	1,986,600
駒井ハルテック	300	1,420.00	426,000
高田機工	100	2,395.00	239,500
三和ホールディングス	16,100	889.00	14,312,900
文化シャッター	4,900	744.00	3,645,600
三協立山	2,300	1,020.00	2,346,000
アルインコ	1,200	910.00	1,092,000
東洋シャッター	500	542.00	271,000
LIXILグループ	24,900	1,352.00	33,664,800
日本フィルコン	1,300	436.00	566,800
ノーリツ	3,600	1,066.00	3,837,600
長府製作所	1,600	1,957.00	3,131,200
リンナイ	3,300	6,720.00	22,176,000
ユニプレス	3,300	1,015.00	3,349,500
ダイニチ工業	900	574.00	516,600
日東精工	2,200	451.00	992,200
三洋工業	200	1,679.00	335,800
岡部	3,400	690.00	2,346,000
ジーテクト	2,000	1,135.00	2,270,000
東プレ	3,100	1,280.00	3,968,000



高周波熱錬	3,100	604.00	1,872,400
東京製鋼	1,300	635.00	825,500
サンコール	900	448.00	403,200
モリテックスチール	1,600	247.00	395,200
パイオラックス	2,400	1,436.00	3,446,400
エイチワン	1,700	538.00	914,600
日本発条	18,000	701.00	12,618,000
中央発條	100	2,474.00	247,400
アドパネクス	300	1,106.00	331,800
三浦工業	7,300	3,110.00	22,703,000
タクマ	5,600	1,132.00	6,339,200
テクノプロ・ホールディングス	3,200	5,730.00	18,336,000
アトラ	600	221.00	132,600
インターワークス	500	438.00	219,000
アイ・アールジャパンホールディングス	600	6,000.00	3,600,000
Keeper 技研	700	1,165.00	815,500
ファーストロジック	500	500.00	250,000
三機サービス	400	889.00	355,600
Gunosy	1,100	919.00	1,010,900
デザインワン・ジャパン	900	204.00	183,600
イー・ガーディアン	900	1,596.00	1,436,400
リブセンス	1,600	236.00	377,600
ジャパンマテリアル	5,000	1,203.00	6,015,000
ベクトル	2,100	847.00	1,778,700
ウチヤマホールディングス	1,300	342.00	444,600
チャーム・ケア・コーポレーション	1,500	789.00	1,183,500
ライクキッズ	400	577.00	230,800
キャリアリンク	900	425.00	382,500
IBJ	1,200	766.00	919,200
アサンテ	600	1,525.00	915,000
N・フィールド	1,300	411.00	534,300
バリューHR	400	2,890.00	1,156,000
M&Aキャピタルパートナーズ	1,200	3,005.00	3,606,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,285.00	899,500
E R Iホールディングス	600	584.00	350,400
アビスト	300	1,939.00	581,700
シグマクシス	1,200	1,374.00	1,648,800
ウィルグループ	1,200	699.00	838,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,400	160.00	384,000
リクルートホールディングス	115,900	3,469.00	402,057,100
エラン	1,100	1,271.00	1,398,100
ツガミ	3,600	784.00	2,822,400
オークマ	1,900	3,910.00	7,429,000
東芝機械	1,900	2,644.00	5,023,600
アマダホールディングス	21,300	884.00	18,829,200
アイダエンジニアリング	4,500	709.00	3,190,500
滝澤鉄工所	500	1,072.00	536,000
F U J I	7,200	1,623.00	11,685,600

牧野フライス製作所	1,900	3,190.00	6,061,000
オーエスジー	7,700	1,479.00	11,388,300
ダイジェット工業	200	973.00	194,600
旭ダイヤモンド工業	4,600	474.00	2,180,400
D M G 森精機	10,600	1,136.00	12,041,600
ソディック	4,000	647.00	2,588,000
ディスコ	2,300	21,540.00	49,542,000
日東工器	900	1,877.00	1,689,300
日進工具	500	2,524.00	1,262,000
パンチ工業	1,800	365.00	657,000
富士ダイス	600	560.00	336,000
土木管理総合試験所	800	303.00	242,400
ネットマーケティング	700	620.00	434,000
日本郵政	132,300	826.00	109,279,800
ベルシステム24ホールディングス	2,800	1,199.00	3,357,200
鎌倉新書	1,300	1,241.00	1,613,300
S M N	400	625.00	250,000
一蔵	200	501.00	100,200
L I T A L I C O	600	2,218.00	1,330,800
グローバルキッズCOMPANY	500	508.00	254,000
エアトリ	800	1,024.00	819,200
アトラエ	500	2,645.00	1,322,500
ストライク	600	3,735.00	2,241,000
ソラスト	4,600	947.00	4,356,200
セラク	500	986.00	493,000
インソース	800	2,239.00	1,791,200
豊田自動織機	13,700	5,150.00	70,555,000
豊和工業	1,100	588.00	646,800
O K K	900	449.00	404,100
東洋機械金属	1,400	423.00	592,200
津田駒工業	500	765.00	382,500
島精機製作所	2,700	1,633.00	4,409,100
オプトラン	1,800	2,598.00	4,676,400
N C ホールディングス	500	490.00	245,000
イワキ	800	914.00	731,200
フリー	1,700	880.00	1,496,000
ヤマシンフィルタ	3,700	645.00	2,386,500
日阪製作所	1,900	737.00	1,400,300
やまびこ	3,200	775.00	2,480,000
平田機工	800	4,550.00	3,640,000
ペガサスミシン製造	1,700	352.00	598,400
マルマエ	700	670.00	469,000
タツモ	800	1,043.00	834,400
ナブテスコ	9,900	2,555.00	25,294,500
三井海洋開発	1,800	1,425.00	2,565,000
レオン自動機	1,600	1,085.00	1,736,000
S M C	5,400	39,880.00	215,352,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	1,800	749.00	1,348,200
ホソカワミクロン	600	4,410.00	2,646,000

ユニオンツール	600	2,386.00	1,431,600	
オイレス工業	2,100	1,275.00	2,677,500	
日精エー・エス・ビー機械	500	3,205.00	1,602,500	
サトーホールディングス	2,400	2,199.00	5,277,600	
技研製作所	1,500	3,300.00	4,950,000	
日本エアテック	500	734.00	367,000	
カワタ	500	789.00	394,500	
日精樹脂工業	1,500	871.00	1,306,500	
オカダアイヨン	500	822.00	411,000	
ワイエイシイホールディングス	800	434.00	347,200	
小松製作所	76,600	1,900.00	145,540,000	
住友重機械工業	9,600	2,119.00	20,342,400	
日立建機	6,800	2,441.00	16,598,800	
日工	2,400	616.00	1,478,400	
巴工業	700	1,737.00	1,215,900	
井関農機	1,800	1,037.00	1,866,600	
TOWA	1,800	797.00	1,434,600	
丸山製作所	500	1,300.00	650,000	
北川鉄工所	700	1,598.00	1,118,600	
シンニッタン	2,500	269.00	672,500	
ローツェ	700	3,115.00	2,180,500	
タカキタ	500	408.00	204,000	
クボタ	89,800	1,330.50	119,478,900	
荏原実業	500	1,938.00	969,000	
三菱化工機	600	1,563.00	937,800	
月島機械	3,100	1,200.00	3,720,000	
帝国電機製作所	1,500	1,195.00	1,792,500	
東京機械製作所	900	212.00	190,800	
新東工業	3,900	696.00	2,714,400	
澁谷工業	1,500	2,309.00	3,463,500	
アイチコーポレーション	2,900	577.00	1,673,300	
小森コーポレーション	4,400	745.00	3,278,000	
鶴見製作所	1,300	1,577.00	2,050,100	
住友精密工業	300	2,457.00	737,100	
日本ギア工業	500	267.00	133,500	
酒井重工業	400	2,293.00	917,200	
荏原製作所	7,000	2,216.00	15,512,000	
石井鐵工所	200	2,304.00	460,800	
西島製作所	1,700	687.00	1,167,900	
北越工業	1,700	1,027.00	1,745,900	
ダイキン工業	21,600	13,320.00	287,712,000	
オルガノ	600	5,380.00	3,228,000	
トーヨーカネツ	700	1,964.00	1,374,800	
栗田工業	9,100	2,543.00	23,141,300	
椿本チエイン	2,400	2,596.00	6,230,400	
大同工業	800	645.00	516,000	
日機装	5,200	848.00	4,409,600	
木村化工機	1,600	438.00	700,800	
レイズネクスト	2,900	1,172.00	3,398,800	
アネスト岩田	2,600	999.00	2,597,400	

ダイフク	8,700	5,730.00	49,851,000	
サムコ	500	1,558.00	779,000	
加藤製作所	1,000	1,107.00	1,107,000	
油研工業	300	1,374.00	412,200	
タダノ	8,300	755.00	6,266,500	
フジテック	6,100	1,271.00	7,753,100	
CKD	4,800	1,508.00	7,238,400	
キトー	1,300	1,149.00	1,493,700	
平和	4,700	1,917.00	9,009,900	
理想科学工業	1,500	1,466.00	2,199,000	
SANKYO	3,700	3,340.00	12,358,000	
日本金銭機械	2,000	613.00	1,226,000	
マースグループホールディングス	1,100	1,668.00	1,834,800	
フクシマガリレイ	1,100	3,385.00	3,723,500	
オーイズミ	800	369.00	295,200	
ダイコク電機	800	1,141.00	912,800	
竹内製作所	2,800	1,388.00	3,886,400	
アマノ	4,500	2,426.00	10,917,000	
JUKI	2,500	574.00	1,435,000	
蛇の目ミシン工業	1,600	281.00	449,600	
ブラザー工業	20,700	1,690.00	34,983,000	
マックス	2,500	1,561.00	3,902,500	
モリタホールディングス	2,900	1,542.00	4,471,800	
グローリー	4,400	2,566.00	11,290,400	
新晃工業	1,600	1,400.00	2,240,000	
大和冷機工業	2,400	898.00	2,155,200	
セガサミーホールディングス	16,800	1,350.00	22,680,000	
日本ピストンリング	500	1,176.00	588,000	
リケン	700	2,837.00	1,985,900	
TPR	2,200	1,265.00	2,783,000	
ツバキ・ナカシマ	3,500	792.00	2,772,000	
ホシザキ	5,000	8,350.00	41,750,000	
大豊工業	1,400	538.00	753,200	
日本精工	32,000	704.00	22,528,000	
NTN	40,400	207.00	8,362,800	
ジェイテクト	16,400	861.00	14,120,400	
不二越	1,600	3,100.00	4,960,000	
ミネベアミツミ	31,500	1,722.00	54,243,000	
日本トムソン	5,300	346.00	1,833,800	
THK	9,900	2,066.00	20,453,400	
ユーシン精機	1,400	795.00	1,113,000	
前澤給装工業	500	1,913.00	956,500	
イーグル工業	2,100	726.00	1,524,600	
前澤工業	1,100	304.00	334,400	
日本ピラー工業	1,700	1,192.00	2,026,400	
キッツ	6,900	568.00	3,919,200	
日立製作所	81,300	3,352.00	272,517,600	
三菱電機	169,300	1,258.00	212,979,400	
富士電機	10,200	2,536.00	25,867,200	
東洋電機製造	600	1,051.00	630,600	

安川電機	18,300	2,975.00	54,442,500
シンフォニアテクノロジー	2,200	980.00	2,156,000
明電舎	3,100	1,584.00	4,910,400
オリジン	500	1,253.00	626,500
山洋電気	800	3,995.00	3,196,000
デンヨー	1,500	1,769.00	2,653,500
ベイクレント・コンサルティング	1,000	6,330.00	6,330,000
Orchestra Holdings	500	742.00	371,000
アイモバイル	800	568.00	454,400
キャリアインデックス	1,000	322.00	322,000
MS-Japan	600	893.00	535,800
船場	300	898.00	269,400
グレイステクノロジー	700	2,540.00	1,778,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,700	2,300.00	3,910,000
フルテック	200	1,044.00	208,800
グリーンズ	500	627.00	313,500
ツナググループ・ホールディングス	400	380.00	152,000
GAMEWITH	600	531.00	318,600
ソウルドアウト	300	1,935.00	580,500
MS&Consulting	400	651.00	260,400
日総工産	1,200	629.00	754,800
キュービーネットホールディングス	800	1,835.00	1,468,000
RPAホールディングス	1,000	875.00	875,000
三櫻工業	2,300	751.00	1,727,300
マキタ	22,100	3,275.00	72,377,500
東芝テック	2,100	3,740.00	7,854,000
芝浦メカトロニクス	300	2,639.00	791,700
マブチモーター	4,700	3,485.00	16,379,500
日本電産	20,400	12,795.00	261,018,000
トレックス・セミコンダクター	1,000	1,075.00	1,075,000
東光高岳	1,000	992.00	992,000
ダブル・スコープ	2,700	622.00	1,679,400
ダイヘン	1,800	2,550.00	4,590,000
ヤーマン	2,800	474.00	1,327,200
JVCケンウッド	14,300	206.00	2,945,800
ミマキエンジニアリング	1,600	380.00	608,000
第一精工	700	1,861.00	1,302,700
日新電機	4,000	1,002.00	4,008,000
大崎電気工業	3,500	489.00	1,711,500
オムロン	15,200	5,340.00	81,168,000
日東工業	2,500	1,767.00	4,417,500
I D E C	2,400	1,387.00	3,328,800
正興電機製作所	500	1,058.00	529,000
不二電機工業	300	985.00	295,500
ジーエス・ユアサコーポレーション	5,600	1,610.00	9,016,000
サクサホールディングス	400	1,503.00	601,200
メルコホールディングス	600	2,045.00	1,227,000
テクノメディカ	400	1,850.00	740,000

日本電気	20,600	3,970.00	81,782,000
富士通	16,300	10,655.00	173,676,500
沖電気工業	6,900	1,107.00	7,638,300
岩崎通信機	800	736.00	588,800
電気興業	800	2,483.00	1,986,400
サンケン電気	1,800	2,343.00	4,217,400
ナカヨ	300	1,326.00	397,800
アイホン	900	1,410.00	1,269,000
ルネサスエレクトロニクス	81,100	539.00	43,712,900
セイコーエプソン	21,000	1,296.00	27,216,000
ワコム	11,600	307.00	3,561,200
アルバック	3,100	2,782.00	8,624,200
アクセル	800	613.00	490,400
E I Z O	1,400	3,235.00	4,529,000
日本信号	4,400	1,082.00	4,760,800
京三製作所	4,100	427.00	1,750,700
能美防災	2,200	1,914.00	4,210,800
ホーチキ	1,300	1,157.00	1,504,100
星和電機	1,000	473.00	473,000
エレコム	1,800	3,580.00	6,444,000
パナソニック	193,400	886.00	171,352,400
シャープ	19,700	1,121.00	22,083,700
アンリツ	11,000	1,739.00	19,129,000
富士通ゼネラル	4,600	1,952.00	8,979,200
ソニー	107,000	6,419.00	686,833,000
T D K	8,200	9,690.00	79,458,000
帝国通信工業	600	1,050.00	630,000
タムラ製作所	5,800	413.00	2,395,400
アルプスアルパイン	15,100	1,344.00	20,294,400
池上通信機	500	821.00	410,500
鈴木	900	678.00	610,200
日本トリム	300	2,862.00	858,600
ローランド ディー・ジー	1,000	1,412.00	1,412,000
フォスター電機	1,800	1,219.00	2,194,200
S M K	500	2,168.00	1,084,000
ヨコオ	1,200	2,407.00	2,888,400
ホシデン	4,700	813.00	3,821,100
ヒロセ電機	2,600	10,670.00	27,742,000
日本航空電子工業	3,900	1,465.00	5,713,500
T O A	1,800	795.00	1,431,000
マクセルホールディングス	3,700	1,164.00	4,306,800
古野電気	2,300	807.00	1,856,100
ユニデンホールディングス	500	1,696.00	848,000
スミダコーポレーション	1,400	868.00	1,215,200
アイコム	900	2,302.00	2,071,800
リオン	700	2,190.00	1,533,000
本多通信工業	1,600	386.00	617,600
船井電機	1,800	531.00	955,800
横河電機	15,600	1,436.00	22,401,600
新電元工業	600	2,814.00	1,688,400

アズビル	10,700	2,517.00	26,931,900
東亜ディーケーケー	900	850.00	765,000
日本光電工業	7,000	3,180.00	22,260,000
チノー	500	1,042.00	521,000
共和電業	1,600	365.00	584,000
日本電子材料	800	812.00	649,600
堀場製作所	3,400	5,140.00	17,476,000
アドバンテスト	12,700	4,790.00	60,833,000
小野測器	700	436.00	305,200
エスペック	1,500	1,767.00	2,650,500
キーエンス	15,400	32,690.00	503,426,000
日置電機	900	2,843.00	2,558,700
シスメックス	12,100	6,659.00	80,573,900
日本マイクロニクス	2,900	807.00	2,340,300
メガチップス	1,600	1,332.00	2,131,200
OBARA GROUP	900	2,698.00	2,428,200
IMAGICA GROUP	1,600	377.00	603,200
澤藤電機	200	1,347.00	269,400
デンソー	37,300	3,638.00	135,697,400
原田工業	800	746.00	596,800
コーセル	2,400	983.00	2,359,200
イリソ電子工業	1,500	3,325.00	4,987,500
オブテックスグループ	2,800	1,090.00	3,052,000
千代田インテグレ	800	1,759.00	1,407,200
アイ・オー・データ機器	500	765.00	382,500
レーザーテック	7,500	4,995.00	37,462,500
スタンレー電気	11,900	2,252.00	26,798,800
岩崎電気	600	1,270.00	762,000
ウシオ電機	9,800	1,261.00	12,357,800
岡谷電機産業	1,500	267.00	400,500
ヘリオス テクノ ホールディング	1,700	278.00	472,600
エノモト	500	864.00	432,000
日本セラミック	1,700	2,004.00	3,406,800
遠藤照明	800	592.00	473,600
古河電池	1,300	548.00	712,400
双信電機	1,200	316.00	379,200
山一電機	1,300	1,511.00	1,964,300
図研	1,200	2,124.00	2,548,800
日本電子	3,400	2,464.00	8,377,600
カシオ計算機	15,000	1,635.00	24,525,000
ファナック	16,100	16,080.00	258,888,000
日本シイエムケイ	4,100	411.00	1,685,100
エンプラス	900	2,312.00	2,080,800
大真空	700	1,663.00	1,164,100
ローム	7,600	6,650.00	50,540,000
浜松ホトニクス	12,200	4,015.00	48,983,000
三井ハイテック	1,900	1,214.00	2,306,600
新光電気工業	5,800	1,101.00	6,385,800
京セラ	23,800	6,556.00	156,032,800
協栄産業	300	1,088.00	326,400

太陽誘電	7,600	3,035.00	23,066,000
村田製作所	49,800	5,445.00	271,161,000
双葉電子工業	2,700	964.00	2,602,800
日東電工	11,700	5,060.00	59,202,000
北陸電気工業	800	832.00	665,600
東海理化電機製作所	4,500	1,385.00	6,232,500
ニチコン	5,800	710.00	4,118,000
日本ケミコン	1,400	1,347.00	1,885,800
K O A	2,600	960.00	2,496,000
三井E & Sホールディングス	6,600	720.00	4,752,000
日立造船	14,100	345.00	4,864,500
三菱重工業	28,400	2,994.00	85,029,600
川崎重工業	13,300	1,642.00	21,838,600
I H I	12,300	1,724.00	21,205,200
名村造船所	6,000	195.00	1,170,000
スプリックス	700	743.00	520,100
マネジメントソリューションズ	200	2,897.00	579,400
日本車輛製造	600	2,366.00	1,419,600
三菱ロジスネクスト	2,300	988.00	2,272,400
近畿車輛	400	1,139.00	455,600
F P G	5,200	777.00	4,040,400
島根銀行	900	390.00	351,000
じもとホールディングス	11,700	92.00	1,076,400
全国保証	4,700	3,790.00	17,813,000
めぶきフィナンシャルグループ	86,800	184.00	15,971,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,300	1,019.00	2,343,700
九州フィナンシャルグループ	27,700	338.00	9,362,600
かんぼ生命保険	6,200	1,454.00	9,014,800
ゆうちょ銀行	47,600	890.00	42,364,000
富山第一銀行	3,200	259.00	828,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	98,600	309.00	30,467,400
ジェイリース	900	251.00	225,900
西日本フィナンシャルホールディングス	10,900	560.00	6,104,000
マーキュリアインベストメント	800	515.00	412,000
イントラスト	700	553.00	387,100
日本モーゲージサービス	400	1,884.00	753,600
C A S A	600	1,129.00	677,400
アルヒ	2,600	1,405.00	3,653,000
プレミアグループ	1,000	1,665.00	1,665,000
日産自動車	200,100	399.90	80,019,990
いすゞ自動車	49,100	852.70	41,867,570
トヨタ自動車	188,700	6,600.00	1,245,420,000
日野自動車	21,400	754.00	16,135,600
三菱自動車工業	63,200	318.00	20,097,600
エフテック	1,300	519.00	674,700
レシップホールディングス	1,000	438.00	438,000
G M B	300	616.00	184,800
ファルテック	400	707.00	282,800



武蔵精密工業	3,900	1,058.00	4,126,200
日産車体	3,500	916.00	3,206,000
新明和工業	4,700	1,184.00	5,564,800
極東開発工業	3,100	1,098.00	3,403,800
日信工業	3,500	2,211.00	7,738,500
トビー工業	1,500	1,309.00	1,963,500
ティラド	600	1,354.00	812,400
タチエス	2,900	931.00	2,699,900
NOK	9,200	1,132.00	10,414,400
フタバ産業	4,900	516.00	2,528,400
K Y B	1,900	2,164.00	4,111,600
市光工業	2,600	541.00	1,406,600
大同メタル工業	3,300	520.00	1,716,000
プレス工業	8,500	262.00	2,227,000
ミクニ	2,100	249.00	522,900
太平洋工業	3,500	1,008.00	3,528,000
ケーヒン	4,000	2,556.00	10,224,000
河西工業	2,400	577.00	1,384,800
アイシン精機	14,000	3,105.00	43,470,000
マツダ	50,100	650.00	32,565,000
今仙電機製作所	1,600	689.00	1,102,400
本田技研工業	133,100	2,542.50	338,406,750
スズキ	33,700	3,794.00	127,857,800
S U B A R U	52,600	2,301.00	121,032,600
安永	800	902.00	721,600
ヤマハ発動機	22,100	1,454.00	32,133,400
ショーワ	4,100	2,257.00	9,253,700
小糸製作所	10,100	3,590.00	36,259,000
T B K	2,000	420.00	840,000
エクセディ	2,300	1,798.00	4,135,400
ミツバ	3,300	535.00	1,765,500
豊田合成	5,500	1,999.00	10,994,500
愛三工業	2,800	522.00	1,461,600
盟和産業	200	918.00	183,600
日本プラスト	1,400	528.00	739,200
ヨロズ	1,700	1,122.00	1,907,400
エフ・シー・シー	2,800	1,685.00	4,718,000
新家工業	400	1,128.00	451,200
シマノ	6,300	15,910.00	100,233,000
テイ・エス テック	3,900	2,469.00	9,629,100
関西みらいフィナンシャルグループ	10,000	430.00	4,300,000
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,302.00	1,822,800
第四北越フィナンシャルグループ	2,700	1,983.00	5,354,100
ジャムコ	900	918.00	826,200
小野建	1,500	1,108.00	1,662,000
はるやまホールディングス	600	729.00	437,400
南陽	400	1,468.00	587,200
ノジマ	2,900	1,740.00	5,046,000
佐鳥電機	1,400	731.00	1,023,400
カッパ・クリエイト	2,400	1,212.00	2,908,800

エコートレーディング	800	455.00	364,000
伯東	1,100	1,037.00	1,140,700
コンドーテック	1,300	877.00	1,140,100
中山福	1,100	438.00	481,800
ライトオン	1,500	464.00	696,000
ナガイレーベン	2,400	2,179.00	5,229,600
ジーンズメイト	600	242.00	145,200
三菱食品	1,800	2,749.00	4,948,200
良品計画	22,200	1,287.00	28,571,400
三城ホールディングス	2,100	252.00	529,200
松田産業	1,300	1,286.00	1,671,800
第一興商	2,500	3,745.00	9,362,500
メディバルホールディングス	18,100	1,916.00	34,679,600
アドヴァン	2,500	1,011.00	2,527,500
S P K	300	2,400.00	720,000
萩原電気ホールディングス	600	2,112.00	1,267,200
アルビス	600	1,774.00	1,064,400
アズワン	1,100	7,950.00	8,745,000
スズデン	600	1,125.00	675,000
尾家産業	600	1,100.00	660,000
シモジマ	1,000	1,017.00	1,017,000
ドウシシャ	1,600	1,248.00	1,996,800
小津産業	500	1,430.00	715,000
コナカ	1,800	311.00	559,800
高速	900	1,084.00	975,600
ハウス オブ ローゼ	200	1,493.00	298,600
G - 7ホールディングス	1,000	1,943.00	1,943,000
たけびし	500	1,178.00	589,000
イオン北海道	1,800	591.00	1,063,800
コジマ	3,100	371.00	1,150,100
ヒマラヤ	600	633.00	379,800
コーナン商事	2,300	2,059.00	4,735,700
ネットワンシステムズ	6,400	2,259.00	14,457,600
エコス	600	1,457.00	874,200
ワタミ	2,100	932.00	1,957,200
マルシェ	600	654.00	392,400
リックス	300	1,417.00	425,100
システムソフト	4,600	68.00	312,800
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	36,800	1,843.00	67,822,400
丸文	1,700	485.00	824,500
西松屋チェーン	3,700	726.00	2,686,200
ゼンショーホールディングス	8,000	1,989.00	15,912,000
ハビネット	1,500	1,100.00	1,650,000
幸楽苑ホールディングス	1,200	1,335.00	1,602,000
ハークスレイ	300	1,080.00	324,000
橋本総業ホールディングス	400	1,428.00	571,200
日本ライフライン	5,000	1,320.00	6,600,000
サイゼリヤ	2,700	1,940.00	5,238,000
タカショー	1,300	403.00	523,900

VTホールディングス	6,900	324.00	2,235,600
マルカ	600	1,781.00	1,068,600
アルゴグラフィックス	1,500	3,290.00	4,935,000
魚力	500	1,488.00	744,000
IDOM	4,700	446.00	2,096,200
日本エム・ディ・エム	1,000	1,519.00	1,519,000
フジ・コーポレーション	500	1,651.00	825,500
ユナイテッドアローズ	1,800	2,169.00	3,904,200
進和	900	1,710.00	1,539,000
エスケイジャパン	500	303.00	151,500
ダイトロン	700	1,535.00	1,074,500
ハイデイ日高	2,400	1,477.00	3,544,800
シークス	2,100	1,126.00	2,364,600
京都きもの友禅	1,800	228.00	410,400
コロワイド	5,600	1,644.00	9,206,400
ピーシーデポコーポレーション	2,200	399.00	877,800
田中商事	400	589.00	235,600
オーハシテクニカ	800	1,268.00	1,014,400
壱番屋	1,200	4,110.00	4,932,000
白銅	500	1,166.00	583,000
PLANT	700	406.00	284,200
スギホールディングス	3,300	5,100.00	16,830,000
薬王堂ホールディングス	700	2,091.00	1,463,700
島津製作所	20,200	2,580.00	52,116,000
JMS	1,600	679.00	1,086,400
長野計器	1,400	753.00	1,054,200
ブイ・テクノロジー	800	3,390.00	2,712,000
スター精密	2,600	1,094.00	2,844,400
東京計器	1,200	706.00	847,200
愛知時計電機	100	3,800.00	380,000
インターアクション	900	2,305.00	2,074,500
オーバル	1,800	197.00	354,600
東京精密	3,100	3,140.00	9,734,000
マニー	6,700	2,168.00	14,525,600
ニコン	27,500	991.00	27,252,500
トプコン	8,600	908.00	7,808,800
オリンパス	93,700	1,911.50	179,107,550
理研計器	1,500	2,050.00	3,075,000
SCREENホールディングス	2,900	5,130.00	14,877,000
キヤノン電子	1,800	1,612.00	2,901,600
タムロン	1,500	2,000.00	3,000,000
HOYA	33,900	9,346.00	316,829,400
シード	800	735.00	588,000
ノーリツ鋼機	1,200	1,044.00	1,252,800
エー・アンド・デイ	1,600	687.00	1,099,200
朝日インテック	14,400	2,733.00	39,355,200
キヤノン	91,100	2,410.50	219,596,550
リコー	43,200	970.00	41,904,000
シチズン時計	20,000	357.00	7,140,000
リズム時計工業	500	715.00	357,500

大研医器	1,400	557.00	779,800
メニコン	2,400	4,250.00	10,200,000
シンシア	400	360.00	144,000
中本パックス	500	1,148.00	574,000
スノーピーク	1,000	637.00	637,000
パラマウントベッドホールディングス	1,800	3,890.00	7,002,000
トランザクション	1,200	773.00	927,600
粧美堂	800	307.00	245,600
ニホンフラッシュ	800	2,270.00	1,816,000
前田工織	1,800	1,961.00	3,529,800
永大産業	2,400	256.00	614,400
アートネイチャー	1,800	583.00	1,049,400
バンダイナムコホールディングス	17,500	5,708.00	99,890,000
アイフィスジャパン	500	588.00	294,000
共立印刷	3,500	144.00	504,000
SHOEI	800	4,120.00	3,296,000
フランスベッドホールディングス	2,400	820.00	1,968,000
マーベラス	2,500	532.00	1,330,000
パイロットコーポレーション	2,700	3,100.00	8,370,000
萩原工業	1,000	1,435.00	1,435,000
エイベックス	2,900	936.00	2,714,400
トッパン・フォームズ	3,700	967.00	3,577,900
フジシールインターナショナル	3,800	1,863.00	7,079,400
タカラトミー	7,600	792.00	6,019,200
廣済堂	1,300	665.00	864,500
エステールホールディングス	500	572.00	286,000
アーク	7,500	72.00	540,000
レック	1,800	962.00	1,731,600
タカノ	600	606.00	363,600
三光合成	2,100	265.00	556,500
プロネクサス	1,500	931.00	1,396,500
ホクシン	1,800	114.00	205,200
ウッドワン	500	879.00	439,500
大建工業	1,200	1,490.00	1,788,000
きもと	3,400	129.00	438,600
凸版印刷	23,900	1,698.00	40,582,200
大日本印刷	22,200	2,291.00	50,860,200
共同印刷	500	2,433.00	1,216,500
N I S S H A	3,500	714.00	2,499,000
光村印刷	200	1,242.00	248,400
藤森工業	1,500	2,532.00	3,798,000
TAKARA & COMPANY	800	1,467.00	1,173,600
前澤化成工業	1,100	982.00	1,080,200
未来工業	900	1,688.00	1,519,200
アシックス	14,100	1,043.00	14,706,300
ツツミ	500	1,785.00	892,500
ウェーブロックホールディングス	600	543.00	325,800
J S P	1,000	1,439.00	1,439,000
ニチハ	2,300	2,100.00	4,830,000
エフピコ	1,800	6,360.00	11,448,000

小松ウオール工業	500	1,746.00	873,000	
ヤマハ	10,100	4,740.00	47,874,000	
河合楽器製作所	500	2,407.00	1,203,500	
クリナップ	1,700	512.00	870,400	
ピジョン	10,300	3,395.00	34,968,500	
天馬	1,100	1,535.00	1,688,500	
兼松サステック	100	1,390.00	139,000	
キングジム	1,500	705.00	1,057,500	
象印マホービン	5,000	1,532.00	7,660,000	
リンテック	4,000	2,119.00	8,476,000	
信越ポリマー	3,100	795.00	2,464,500	
東リ	4,300	248.00	1,066,400	
イトーキ	3,600	313.00	1,126,800	
任天堂	10,400	36,190.00	376,376,000	
三菱鉛筆	2,700	1,302.00	3,515,400	
松風	800	1,642.00	1,313,600	
タカラスタANDARD	3,500	1,416.00	4,956,000	
コクヨ	8,200	1,408.00	11,545,600	
ナカバヤシ	1,600	495.00	792,000	
ニフコ	6,200	2,244.00	13,912,800	
立川ブラインド工業	700	1,009.00	706,300	
グローブライド	800	1,685.00	1,348,000	
オカムラ	5,900	790.00	4,661,000	
バルカー	1,400	1,837.00	2,571,800	
MUTOHホールディングス	300	1,340.00	402,000	
伊藤忠商事	116,500	2,280.00	265,620,000	
丸紅	173,200	603.30	104,491,560	
スクロール	2,500	280.00	700,000	
高島	300	1,717.00	515,100	
ヨンドシーホールディングス	1,700	1,864.00	3,168,800	
三陽商会	1,000	1,298.00	1,298,000	
長瀬産業	9,200	1,172.00	10,782,400	
ナイガイ	1,000	367.00	367,000	
蝶理	1,100	1,585.00	1,743,500	
豊田通商	18,700	2,855.00	53,388,500	
オンワードホールディングス	10,400	468.00	4,867,200	
三共生興	2,400	492.00	1,180,800	
兼松	6,200	1,031.00	6,392,200	
美津濃	1,500	1,922.00	2,883,000	
ツカモトコーポレーション	400	998.00	399,200	
ファミリーマート	13,400	2,124.00	28,461,600	
ルックホールディングス	600	797.00	478,200	
三井物産	146,000	1,622.00	236,812,000	
日本紙パルプ商事	1,000	3,375.00	3,375,000	
東京エレクトロン	11,300	22,045.00	249,108,500	
日立ハイテク	5,700	7,980.00	45,486,000	
カメイ	2,100	933.00	1,959,300	
東都水産	300	2,633.00	789,900	
OUGホールディングス	300	2,321.00	696,300	
スターゼン	600	4,235.00	2,541,000	

セイコーホールディングス	2,400	1,783.00	4,279,200
山善	6,600	796.00	5,253,600
椿本興業	300	3,110.00	933,000
住友商事	104,800	1,356.50	142,161,200
日本ユニシス	5,300	3,110.00	16,483,000
内田洋行	700	3,785.00	2,649,500
三菱商事	116,800	2,460.50	287,386,400
第一実業	800	3,190.00	2,552,000
キヤノンマーケティングジャパン	4,800	2,167.00	10,401,600
西華産業	1,100	1,075.00	1,182,500
佐藤商事	1,400	764.00	1,069,600
菱洋エレクトロ	1,700	1,710.00	2,907,000
東京産業	1,700	478.00	812,600
ユアサ商事	1,600	2,753.00	4,404,800
神鋼商事	400	1,970.00	788,000
小林産業	1,200	210.00	252,000
阪和興業	3,100	1,853.00	5,744,300
正栄食品工業	1,100	3,135.00	3,448,500
カナデン	1,400	1,090.00	1,526,000
菱電商事	1,200	1,335.00	1,602,000
ニプロ	11,800	1,086.00	12,814,800
フルサト工業	900	1,355.00	1,219,500
岩谷産業	3,700	3,455.00	12,783,500
昭光通商	700	514.00	359,800
極東貿易	500	1,420.00	710,000
イワキ	2,300	414.00	952,200
兼松エレクトロニクス	900	3,130.00	2,817,000
三愛石油	4,300	885.00	3,805,500
稲畑産業	3,600	1,145.00	4,122,000
G S Iクレオス	500	1,015.00	507,500
明和産業	1,700	460.00	782,000
クワザワ	800	452.00	361,600
ゴールドウイン	3,000	6,630.00	19,890,000
ユニ・チャーム	32,700	3,556.00	116,281,200
デサント	3,300	1,165.00	3,844,500
キング	800	460.00	368,000
ワキタ	3,500	874.00	3,059,000
ヤマトインターナショナル	1,000	344.00	344,000
東邦ホールディングス	5,400	2,104.00	11,361,600
サンゲツ	4,600	1,503.00	6,913,800
ミツウロコグループホールディングス	2,500	920.00	2,300,000
シナネンホールディングス	800	2,158.00	1,726,400
伊藤忠エネクス	3,900	808.00	3,151,200
サンリオ	4,700	1,392.00	6,542,400
サンワテクノス	1,400	791.00	1,107,400
リョーサン	1,800	2,179.00	3,922,200
新光商事	2,600	699.00	1,817,400
トーヨー	1,100	1,455.00	1,600,500
三信電気	1,000	1,345.00	1,345,000
東陽テクニカ	1,900	851.00	1,616,900

モスフードサービス	2,300	2,343.00	5,388,900
加賀電子	1,700	1,767.00	3,003,900
三益半導体工業	1,400	1,855.00	2,597,000
ソーダニッカ	1,900	515.00	978,500
立花エレテック	1,200	1,425.00	1,710,000
木曽路	2,100	2,368.00	4,972,800
S R Sホールディングス	2,100	870.00	1,827,000
千趣会	3,300	359.00	1,184,700
タカキュー	1,900	129.00	245,100
ケーヨー	3,500	446.00	1,561,000
上新電機	1,900	1,655.00	3,144,500
日本瓦斯	2,600	3,485.00	9,061,000
ロイヤルホールディングス	2,900	1,700.00	4,930,000
東天紅	100	825.00	82,500
いなげや	2,100	1,185.00	2,488,500
島忠	3,100	2,547.00	7,895,700
チヨダ	1,800	1,088.00	1,958,400
ライフコーポレーション	1,300	2,238.00	2,909,400
リンガーハット	2,100	1,965.00	4,126,500
MrMaxHD	2,100	332.00	697,200
テンアライド	1,800	365.00	657,000
AOKIホールディングス	3,200	824.00	2,636,800
オークワ	2,600	1,254.00	3,260,400
コメリ	2,500	1,929.00	4,822,500
青山商事	3,400	1,079.00	3,668,600
しまむら	1,900	6,890.00	13,091,000
はせがわ	800	339.00	271,200
高島屋	12,300	929.00	11,426,700
松屋	3,500	558.00	1,953,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,100	757.00	6,131,700
近鉄百貨店	600	2,152.00	1,291,200
丸井グループ	15,300	1,961.00	30,003,300
クレディセゾン	11,800	1,405.00	16,579,000
アクシアル リテイリング	1,400	3,220.00	4,508,000
イオン	64,300	1,956.50	125,802,950
イズミ	3,400	2,734.00	9,295,600
フォーバル	700	833.00	583,100
平和堂	3,500	1,581.00	5,533,500
フジ	2,000	1,439.00	2,878,000
ヤオコー	1,800	5,620.00	10,116,000
ゼビオホールディングス	2,100	885.00	1,858,500
ケーズホールディングス	16,200	1,090.00	17,658,000
PALTAC	2,600	4,605.00	11,973,000
三谷産業	2,100	308.00	646,800
Olympicグループ	1,000	444.00	444,000
日産東京販売ホールディングス	2,400	210.00	504,000
新生銀行	12,500	1,268.00	15,850,000
あおぞら銀行	9,900	2,246.00	22,235,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,139,700	439.70	501,126,090
りそなホールディングス	183,200	340.80	62,434,560

三井住友トラスト・ホールディングス	31,600	3,161.00	99,887,600
三井住友フィナンシャルグループ	115,300	2,947.50	339,846,750
千葉銀行	58,000	448.00	25,984,000
群馬銀行	33,100	286.00	9,466,600
武蔵野銀行	2,400	1,286.00	3,086,400
千葉興業銀行	4,600	233.00	1,071,800
筑波銀行	7,600	150.00	1,140,000
七十七銀行	5,600	1,222.00	6,843,200
青森銀行	1,400	2,057.00	2,879,800
秋田銀行	1,000	1,486.00	1,486,000
山形銀行	1,900	968.00	1,839,200
岩手銀行	1,100	2,079.00	2,286,900
東邦銀行	15,200	203.00	3,085,600
東北銀行	600	829.00	497,400
みちのく銀行	1,200	957.00	1,148,400
ふくおかフィナンシャルグループ	14,100	1,466.00	20,670,600
静岡銀行	41,800	612.00	25,581,600
十六銀行	1,900	1,670.00	3,173,000
スルガ銀行	17,700	345.00	6,106,500
八十二銀行	40,700	338.00	13,756,600
山梨中央銀行	1,900	728.00	1,383,200
大垣共立銀行	3,300	1,772.00	5,847,600
福井銀行	1,500	1,246.00	1,869,000
北國銀行	1,800	2,463.00	4,433,400
清水銀行	600	1,624.00	974,400
富山銀行	300	1,468.00	440,400
滋賀銀行	3,400	2,092.00	7,112,800
南都銀行	2,700	1,967.00	5,310,900
百五銀行	15,200	274.00	4,164,800
京都銀行	6,000	3,305.00	19,830,000
紀陽銀行	5,800	1,315.00	7,627,000
ほくほくフィナンシャルグループ	11,000	827.00	9,097,000
広島銀行	24,500	414.00	10,143,000
山陰合同銀行	9,600	485.00	4,656,000
中国銀行	14,700	784.00	11,524,800
鳥取銀行	500	1,116.00	558,000
伊予銀行	23,900	448.00	10,707,200
百十四銀行	1,700	1,625.00	2,762,500
四国銀行	2,500	733.00	1,832,500
阿波銀行	2,700	1,933.00	5,219,100
大分銀行	900	1,897.00	1,707,300
宮崎銀行	1,000	1,989.00	1,989,000
佐賀銀行	1,000	1,159.00	1,159,000
沖縄銀行	1,600	2,768.00	4,428,800
琉球銀行	3,800	906.00	3,442,800
セブン銀行	56,600	256.00	14,489,600
みずほフィナンシャルグループ	2,264,800	122.30	276,985,040
高知銀行	500	624.00	312,000
山口フィナンシャルグループ	20,800	507.00	10,545,600
芙蓉総合リース	1,800	5,390.00	9,702,000



みずほリース	2,500	2,395.00	5,987,500	
東京センチュリー	3,400	3,690.00	12,546,000	
SBIホールディングス	18,700	1,842.00	34,445,400	
日本証券金融	7,200	489.00	3,520,800	
アイフル	25,800	255.00	6,579,000	
長野銀行	500	1,096.00	548,000	
名古屋銀行	1,400	2,474.00	3,463,600	
北洋銀行	25,400	180.00	4,572,000	
愛知銀行	600	2,774.00	1,664,400	
中京銀行	700	1,877.00	1,313,900	
大光銀行	500	1,257.00	628,500	
愛媛銀行	2,300	983.00	2,260,900	
トマト銀行	400	910.00	364,000	
京葉銀行	7,300	456.00	3,328,800	
栃木銀行	9,600	149.00	1,430,400	
北日本銀行	500	1,667.00	833,500	
東和銀行	2,800	624.00	1,747,200	
福島銀行	2,700	154.00	415,800	
大東銀行	700	515.00	360,500	
リコーリース	1,400	3,045.00	4,263,000	
イオンフィナンシャルサービス	10,200	1,332.00	13,586,400	
アコム	33,700	412.00	13,884,400	
ジャックス	1,800	1,911.00	3,439,800	
オリエントコーポレーション	45,800	122.00	5,587,600	
日立キャピタル	3,900	2,639.00	10,292,100	
アプラスフィナンシャル	9,500	63.00	598,500	
オリックス	104,300	1,545.50	161,195,650	
三菱UFJリース	42,200	556.00	23,463,200	
ジャフコ	2,500	3,475.00	8,687,500	
九州リースサービス	600	492.00	295,200	
トモニホールディングス	12,700	291.00	3,695,700	
大和証券グループ本社	134,200	421.60	56,578,720	
野村ホールディングス	293,600	432.70	127,040,720	
岡三証券グループ	14,700	310.00	4,557,000	
丸三証券	5,300	398.00	2,109,400	
東洋証券	6,700	121.00	810,700	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19,900	242.00	4,815,800	
光世証券	600	536.00	321,600	
水戸証券	5,400	191.00	1,031,400	
いちよし証券	3,200	508.00	1,625,600	
松井証券	9,700	756.00	7,333,200	
SOMPOホールディングス	31,400	3,504.00	110,025,600	
だいら証券ビジネス	900	447.00	402,300	
日本取引所グループ	48,100	1,779.00	85,569,900	
マネックスグループ	13,000	187.00	2,431,000	
極東証券	2,200	582.00	1,280,400	
岩井コスモホールディングス	1,500	1,038.00	1,557,000	
藍澤証券	2,900	683.00	1,980,700	
フィデアホールディングス	15,700	99.00	1,554,300	

池田泉州ホールディングス	19,900	151.00	3,004,900	
アニコム ホールディングス	1,500	3,080.00	4,620,000	
MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス	43,700	3,075.00	134,377,500	
ソニーフィナンシャルホールディング ス	13,800	1,965.00	27,117,000	
マネーパートナーズグループ	2,000	173.00	346,000	
スパークス・グループ	6,000	204.00	1,224,000	
第一生命ホールディングス	94,500	1,211.50	114,486,750	
東京海上ホールディングス	59,600	5,089.00	303,304,400	
アドバンテッジリスクマネジメント	900	679.00	611,100	
イー・ギャランティ	1,800	1,311.00	2,359,800	
アサックス	900	622.00	559,800	
NECキャピタルソリューション	700	1,937.00	1,355,900	
T & Dホールディングス	50,100	854.00	42,785,400	
アドバンスクリエイト	400	1,354.00	541,600	
三井不動産	82,700	2,176.00	179,955,200	
三菱地所	117,600	1,778.00	209,092,800	
平和不動産	3,100	2,964.00	9,188,400	
東京建物	17,700	1,314.00	23,257,800	
ダイビル	4,500	1,074.00	4,833,000	
京阪神ビルディング	2,800	1,296.00	3,628,800	
住友不動産	37,800	3,130.00	118,314,000	
太平洋興発	600	610.00	366,000	
テーオーシー	3,500	629.00	2,201,500	
東京楽天地	400	4,490.00	1,796,000	
スターツコーポレーション	2,300	2,018.00	4,641,400	
フジ住宅	1,900	523.00	993,700	
空港施設	1,800	454.00	817,200	
明和地所	1,100	545.00	599,500	
ゴールドクレスト	1,400	1,571.00	2,199,400	
リログループ	8,900	2,416.00	21,502,400	
エスリード	600	1,528.00	916,800	
日神グループホールディングス	2,500	410.00	1,025,000	
日本エスコン	3,000	628.00	1,884,000	
タカラレーベン	7,800	397.00	3,096,600	
A V A N T I A	1,100	661.00	727,100	
イオンモール	8,600	1,445.00	12,427,000	
毎日コムネット	500	734.00	367,000	
ファースト住建	700	950.00	665,000	
カチタス	2,000	3,545.00	7,090,000	
東祥	1,200	1,261.00	1,513,200	
トーセイ	2,300	1,067.00	2,454,100	
穴吹興産	500	1,320.00	660,000	
サンフロンティア不動産	2,300	1,046.00	2,405,800	
エフ・ジェー・ネクスト	1,500	867.00	1,300,500	
インテリックス	600	486.00	291,600	
日本社宅サービス	500	821.00	410,500	
グランディハウス	1,400	378.00	529,200	
東武鉄道	17,900	3,090.00	55,311,000	

相鉄ホールディングス	5,400	2,357.00	12,727,800	
東急	42,900	1,582.00	67,867,800	
京浜急行電鉄	21,900	1,576.00	34,514,400	
小田急電鉄	25,400	1,966.00	49,936,400	
京王電鉄	8,900	5,170.00	46,013,000	
京成電鉄	11,800	3,245.00	38,291,000	
富士急行	2,300	2,554.00	5,874,200	
新京成電鉄	400	2,340.00	936,000	
東日本旅客鉄道	29,800	7,973.00	237,595,400	
西日本旅客鉄道	15,100	6,782.00	102,408,200	
東海旅客鉄道	14,000	16,940.00	237,160,000	
西武ホールディングス	22,800	1,351.00	30,802,800	
鴻池運輸	2,700	1,165.00	3,145,500	
西日本鉄道	4,800	2,195.00	10,536,000	
ハマキョウレックス	1,400	2,621.00	3,669,400	
サカイ引越センター	900	5,050.00	4,545,000	
近鉄グループホールディングス	16,100	4,335.00	69,793,500	
阪急阪神ホールディングス	21,400	3,290.00	70,406,000	
南海電気鉄道	7,600	2,152.00	16,355,200	
京阪ホールディングス	7,200	4,105.00	29,556,000	
神戸電鉄	500	3,525.00	1,762,500	
名古屋鉄道	13,200	2,702.00	35,666,400	
山陽電気鉄道	1,200	1,779.00	2,134,800	
トランコム	500	6,460.00	3,230,000	
日本通運	5,600	4,870.00	27,272,000	
ヤマトホールディングス	28,300	1,584.00	44,827,200	
山九	4,500	4,060.00	18,270,000	
日新	1,400	1,355.00	1,897,000	
丸運	1,200	230.00	276,000	
丸全昭和運輸	1,300	2,151.00	2,796,300	
センコーグループホールディングス	9,000	765.00	6,885,000	
トナミホールディングス	400	3,905.00	1,562,000	
ニッコンホールディングス	5,600	1,976.00	11,065,600	
日本石油輸送	200	2,521.00	504,200	
福山通運	2,000	3,100.00	6,200,000	
セイノーホールディングス	12,100	1,077.00	13,031,700	
エスライン	500	832.00	416,000	
神奈川中央交通	400	3,840.00	1,536,000	
日立物流	3,000	2,646.00	7,938,000	
丸和運輸機関	1,700	1,770.00	3,009,000	
C & F ロジホールディングス	1,500	1,083.00	1,624,500	
日本郵船	13,800	1,369.00	18,892,200	
商船三井	10,100	1,904.00	19,230,400	
川崎汽船	5,400	1,038.00	5,605,200	
N S ユナイテッド海運	800	1,445.00	1,156,000	
飯野海運	7,500	301.00	2,257,500	
共栄タンカー	300	768.00	230,400	
九州旅客鉄道	14,300	3,030.00	43,329,000	
S G ホールディングス	16,800	2,183.00	36,674,400	
日本航空	28,900	2,370.50	68,507,450	

ANAホールディングス	29,400	2,830.00	83,202,000
パスコ	400	1,500.00	600,000
西本Wismettacホールディングス	400	2,306.00	922,400
ヤマシタヘルスケアホールディングス	300	1,621.00	486,300
Genky DrugStores	800	1,676.00	1,340,800
国際紙パルプ商事	4,300	219.00	941,700
ナルミヤ・インターナショナル	400	781.00	312,400
総合メディカルホールディングス	1,500	2,544.00	3,816,000
ブックオフグループホールディングス	1,200	754.00	904,800
三菱倉庫	5,200	2,336.00	12,147,200
三井倉庫ホールディングス	1,900	1,425.00	2,707,500
住友倉庫	5,800	1,170.00	6,786,000
澁澤倉庫	800	1,716.00	1,372,800
ヤマタネ	800	1,148.00	918,400
東陽倉庫	2,600	269.00	699,400
乾汽船	1,000	1,022.00	1,022,000
日本トランスシティ	3,500	394.00	1,379,000
ケイヒン	300	1,116.00	334,800
中央倉庫	800	942.00	753,600
川西倉庫	300	831.00	249,300
安田倉庫	1,400	832.00	1,164,800
ファイズホールディングス	500	880.00	440,000
東洋埠頭	400	1,210.00	484,000
宇徳	1,400	457.00	639,800
上組	9,200	1,930.00	17,756,000
サンリツ	200	578.00	115,600
キムラユニティー	400	966.00	386,400
キューソー流通システム	500	1,610.00	805,000
近鉄エクスプレス	3,500	1,661.00	5,813,500
東海運	1,700	236.00	401,200
エーアイティー	1,300	662.00	860,600
内外トランスライン	500	949.00	474,500
ショーエイコーポレーション	200	748.00	149,600
日本コンセプト	500	1,235.00	617,500
東京放送ホールディングス	10,100	1,601.00	16,170,100
日本テレビホールディングス	13,800	1,212.00	16,725,600
朝日放送グループホールディングス	1,600	652.00	1,043,200
テレビ朝日ホールディングス	4,600	1,624.00	7,470,400
スカパーJ S A Tホールディングス	11,000	428.00	4,708,000
テレビ東京ホールディングス	1,500	2,048.00	3,072,000
日本BS放送	600	1,010.00	606,000
ビジョン	1,600	830.00	1,328,000
スマートバリュー	500	787.00	393,500
USEN - NEXT HOLDINGS	700	1,424.00	996,800
コネクシオ	900	1,206.00	1,085,400
クロップス	400	514.00	205,600
日本電信電話	221,600	2,421.50	536,604,400
KDDI	123,800	3,222.00	398,883,600

ソフトバンク	151,000	1,454.00	219,554,000
光通信	1,700	19,800.00	33,660,000
NTTドコモ	122,500	2,977.50	364,743,750
エムティーアイ	1,700	539.00	916,300
GMOインターネット	6,600	1,697.00	11,200,200
ファイバーゲート	500	1,000.00	500,000
アйдママーケティングコミュニケーション	600	426.00	255,600
KADOKAWA	4,600	1,328.00	6,108,800
学研ホールディングス	500	6,430.00	3,215,000
ゼンリン	3,400	1,094.00	3,719,600
昭文社	900	298.00	268,200
インプレスホールディングス	1,700	130.00	221,000
東京電力ホールディングス	135,100	368.00	49,716,800
中部電力	51,700	1,390.50	71,888,850
関西電力	64,200	1,102.00	70,748,400
中国電力	24,600	1,357.00	33,382,200
北陸電力	15,800	679.00	10,728,200
東北電力	42,400	898.00	38,075,200
四国電力	15,400	783.00	12,058,200
九州電力	35,400	769.00	27,222,600
北海道電力	16,000	430.00	6,880,000
沖縄電力	3,100	1,776.00	5,505,600
電源開発	13,400	2,105.00	28,207,000
エフオン	900	463.00	416,700
イーレックス	2,500	1,278.00	3,195,000
レノバ	2,800	951.00	2,662,800
東京瓦斯	32,600	2,276.00	74,197,600
大阪瓦斯	32,900	1,689.00	55,568,100
東邦瓦斯	8,400	3,540.00	29,736,000
北海道瓦斯	800	1,422.00	1,137,600
広島ガス	3,000	325.00	975,000
西部瓦斯	1,800	2,109.00	3,796,200
静岡ガス	4,800	834.00	4,003,200
メタウォーター	800	3,610.00	2,888,000
アイネット	900	1,233.00	1,109,700
松竹	1,100	11,440.00	12,584,000
東宝	9,800	3,415.00	33,467,000
エイチ・アイ・エス	2,600	1,750.00	4,550,000
東映	600	12,450.00	7,470,000
ラックランド	500	1,561.00	780,500
エヌ・ティ・ティ・データ	44,400	1,217.00	54,034,800
共立メンテナンス	2,700	2,933.00	7,919,100
イチネンホールディングス	1,800	1,024.00	1,843,200
建設技術研究所	1,200	1,500.00	1,800,000
スペース	1,100	951.00	1,046,100
長大	600	807.00	484,200
アインホールディングス	2,000	5,870.00	11,740,000
燦ホールディングス	600	1,091.00	654,600
ピー・シー・エー	300	2,918.00	875,400

スバル興業	100	6,800.00	680,000	
東京テアトル	800	1,070.00	856,000	
タナベ経営	300	1,130.00	339,000	
ビジネスブレイン太田昭和	300	2,258.00	677,400	
ナガワ	500	5,730.00	2,865,000	
よみうりランド	400	3,360.00	1,344,000	
東京都競馬	1,100	3,135.00	3,448,500	
常磐興産	700	1,197.00	837,900	
カナモト	2,600	2,166.00	5,631,600	
東京ドーム	6,700	758.00	5,078,600	
D T S	3,700	1,860.00	6,882,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,100	4,465.00	31,701,500	
シーイーシー	1,800	1,489.00	2,680,200	
カプコン	7,800	2,936.00	22,900,800	
西尾レントオール	1,700	2,326.00	3,954,200	
アイ・エス・ピー	400	1,659.00	663,600	
日本空港ビルデング	5,400	4,215.00	22,761,000	
トランス・コスモス	1,600	2,164.00	3,462,400	
乃村工藝社	7,000	889.00	6,223,000	
ジャステック	1,000	880.00	880,000	
S C S K	3,800	5,290.00	20,102,000	
藤田観光	800	1,716.00	1,372,800	
K N T - C Tホールディングス	1,300	837.00	1,088,100	
日本管財	1,800	1,718.00	3,092,400	
トーカイ	1,600	2,337.00	3,739,200	
白洋舎	200	2,450.00	490,000	
セコム	17,200	8,408.00	144,617,600	
日本システムウエア	500	1,770.00	885,000	
セントラル警備保障	800	3,660.00	2,928,000	
アイネス	1,700	1,362.00	2,315,400	
丹青社	3,100	905.00	2,805,500	
メイテック	2,000	4,645.00	9,290,000	
T K C	1,500	4,350.00	6,525,000	
富士ソフト	2,100	3,350.00	7,035,000	
応用地質	1,800	1,249.00	2,248,200	
船井総研ホールディングス	3,400	2,125.00	7,225,000	
N S D	5,400	1,568.00	8,467,200	
進学会ホールディングス	600	472.00	283,200	
丸紅建材リース	100	1,467.00	146,700	
オオバ	1,400	522.00	730,800	
コナミホールディングス	6,000	3,525.00	21,150,000	
いであ	400	1,499.00	599,600	
学究社	500	1,134.00	567,000	
ベネッセホールディングス	5,500	2,658.00	14,619,000	
イオンディライト	2,000	2,982.00	5,964,000	
ナック	1,100	808.00	888,800	
福井コンピュータホールディングス	700	2,410.00	1,687,000	
ニチイ学館	2,500	1,116.00	2,790,000	
ダイセキ	2,700	2,443.00	6,596,100	

ステップ	500	1,335.00	667,500	
日鉄物産	1,200	3,845.00	4,614,000	
泉州電業	500	2,240.00	1,120,000	
元気寿司	500	2,268.00	1,134,000	
トラスコ中山	3,500	2,004.00	7,014,000	
ヤマダ電機	51,000	476.00	24,276,000	
オートバックスセブン	6,200	1,292.00	8,010,400	
モリト	1,200	661.00	793,200	
アークランドサカモト	2,400	985.00	2,364,000	
ニトリホールディングス	7,200	14,430.00	103,896,000	
グルメ杵屋	1,200	946.00	1,135,200	
愛眼	1,500	200.00	300,000	
ケーユーホールディングス	600	788.00	472,800	
吉野家ホールディングス	5,600	2,090.00	11,704,000	
加藤産業	2,600	3,045.00	7,917,000	
北恵	500	650.00	325,000	
イノテック	1,000	1,001.00	1,001,000	
イエローハット	3,100	1,336.00	4,141,600	
松屋フーズホールディングス	800	3,590.00	2,872,000	
JBC Cホールディングス	1,200	1,568.00	1,881,600	
J Kホールディングス	1,600	573.00	916,800	
サガミホールディングス	2,200	1,065.00	2,343,000	
日伝	1,500	1,604.00	2,406,000	
関西スーパーマーケット	1,400	819.00	1,146,600	
ミロク情報サービス	1,500	2,392.00	3,588,000	
北沢産業	1,500	259.00	388,500	
杉本商事	800	1,601.00	1,280,800	
因幡電機産業	4,700	2,283.00	10,730,100	
王将フードサービス	1,300	5,440.00	7,072,000	
プレナス	1,800	1,657.00	2,982,600	
ミニストップ	1,600	1,297.00	2,075,200	
アークス	3,500	1,685.00	5,897,500	
パローホールディングス	3,700	1,596.00	5,905,200	
東テク	500	1,856.00	928,000	
ミスミグループ本社	20,900	2,175.00	45,457,500	
藤久	400	482.00	192,800	
アルテック	1,500	180.00	270,000	
ベルク	800	4,820.00	3,856,000	
大 庄	1,000	1,185.00	1,185,000	
タキヒヨー	500	1,275.00	637,500	
ファーストリテイリング	2,200	52,750.00	116,050,000	
ソフトバンクグループ	131,800	4,388.00	578,338,400	
蔵王産業	200	1,351.00	270,200	
スズケン	7,100	3,555.00	25,240,500	
サンドラッグ	6,300	3,415.00	21,514,500	
サックスパー ホールディングス	1,400	643.00	900,200	
ジェコス	1,200	803.00	963,600	
ヤマザワ	500	1,286.00	643,000	
やまや	400	2,015.00	806,000	
グローセル	2,000	400.00	800,000	

ペルーナ	3,400	494.00	1,679,600	
合計	19,894,200		33,599,475,960	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。



## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

令和2年3月31日現在

資産総額	7,069,424,521円
負債総額	20,595,303円
純資産総額( - )	7,048,829,218円
発行済数量	7,477,803,361口
1口当たり純資産額( / )	0.9426円

(参考)

MHAM TOPIXマザーファンド

令和2年3月31日現在

資産総額	33,289,087,042円
負債総額	19,524,068円
純資産総額( - )	33,269,562,974円
発行済数量	19,475,141,783口
1口当たり純資産額( / )	1.7083円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認め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(2020年3月31日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構(2020年3月31日現在)

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1.投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

## 2. 運用計画、売買計画の決定

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年3月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,233,896,866,001
追加型株式投資信託	860	12,520,759,630,112
単位型公社債投資信託	37	100,336,682,592
単位型株式投資信託	183	1,244,025,880,966
合計	1,106	15,099,019,059,671

### 3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。  
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第34期事業年度（自2018年4月1日至2019年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受け、第35期中間会計期間（自2019年4月1日至2019年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	49,071,217	41,087,475
金銭の信託	12,083,824	18,773,228
有価証券	-	153,518
未収委託者報酬	11,769,015	12,438,085
未収運用受託報酬	4,574,225	3,295,109
未収投資助言報酬	341,689	327,064
未収収益	59,526	56,925
前払費用	569,431	573,874
その他	427,238	491,914
流動資産計	78,896,169	77,197,195
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 1,156,953	1 1,096,916
器具備品	1 476,504	1 364,399
建設仮勘定	10,368	-
無形固定資産		
ソフトウェア	1,026,319	885,545
ソフトウェア仮勘定	904,389	1,522,040
電話加入権	3,931	3,931
電信電話専用施設利用権	60	23
投資その他の資産		
投資有価証券	1,721,433	1,611,931
関係会社株式	3,229,196	4,499,196
長期差入保証金	1,518,725	1,312,328
繰延税金資産	1,699,533	1,748,459
その他	101,425	97,892
固定資産計	11,848,840	13,142,665
資産合計	90,745,010	90,339,861

(単位:千円)

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,003,550	2,183,889
未払金	5,081,728	5,697,942
未払収益分配金	1,031	1,053
未払償還金	57,275	48,968
未払手数料	4,629,133	4,883,723
その他未払金	394,288	764,196
未払費用	7,711,038	6,724,986
未払法人税等	5,153,972	3,341,238
未払消費税等	1,660,259	576,632
賞与引当金	1,393,911	1,344,466
役員賞与引当金	49,986	48,609
本社移転費用引当金	156,587	-
流動負債計	22,211,034	19,917,766
固定負債		
退職給付引当金	1,637,133	1,895,158
時効後支払損引当金	199,026	177,851
固定負債計	1,836,160	2,073,009
負債合計	24,047,195	21,990,776
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	44,349,855	45,949,372
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	44,226,562	45,826,079
別途積立金	24,580,000	31,680,000
研究開発積立金	300,000	-
運用責任準備積立金	200,000	-
繰越利益剰余金	19,146,562	14,146,079
株主資本計	65,902,812	67,502,329
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	795,002	846,755
評価・換算差額等計	795,002	846,755
純資産合計	66,697,815	68,349,085
負債・純資産合計	90,745,010	90,339,861



## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第33期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	84,705,447		84,812,585	
運用受託報酬	19,124,427		16,483,356	
投資助言報酬	1,217,672		1,235,553	
その他営業収益	117,586		113,622	
営業収益計		105,165,133		102,645,117
営業費用				
支払手数料	37,242,284		36,100,556	
広告宣伝費	379,873		387,028	
公告費	1,485		375	
調査費	23,944,438		24,389,003	
調査費	10,677,166		9,956,757	
委託調査費	13,267,272		14,432,246	
委託計算費	1,073,938		936,075	
営業雑経費	1,215,963		1,254,114	
通信費	48,704		47,007	
印刷費	947,411		978,185	
協会費	64,331		63,558	
諸会費	22,412		22,877	
支払販売手数料	133,104		142,485	
営業費用計		63,857,984		63,067,153
一般管理費				
給料	11,304,873		10,859,354	
役員報酬	189,022		189,198	
給料・手当	9,565,921		9,098,957	
賞与	1,549,929		1,571,197	
交際費	58,863		60,115	
寄付金	5,150		7,255	
旅費交通費	395,605		361,479	
租税公課	625,498		588,172	
不動産賃借料	1,534,255		1,511,876	
退職給付費用	595,876		521,184	
固定資産減価償却費	1,226,472		590,667	
福利厚生費	49,797		45,292	
修繕費	4,620		16,247	
賞与引当金繰入額	1,393,911		1,344,466	
役員賞与引当金繰入額	49,986		48,609	
機器リース料	148		130	
事務委託費	3,037,804		3,302,806	
事務用消耗品費	144,804		131,074	
器具備品費	5,253		8,112	
諸経費	149,850		188,367	
一般管理費計		20,582,772		19,585,212
営業利益		20,724,376		19,992,752

(単位:千円)

	第33期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		1,430		1,749
受取配当金		74,278		73,517
時効成立分配金・償還金		256		8,582
為替差益		8,530		-
投資信託解約益		236,398		-
投資信託償還益		93,177		-
受取負担金		-		177,066
雑収入		10,306		24,919
時効後支払損引当金戻入額		17,429		19,797
営業外収益計		441,807		305,633
営業外費用				
為替差損		-		17,542
投資信託解約損		4,138		-
投資信託償還損		17,065		-
金銭の信託運用損		99,303		175,164
雑損失		-		5,659
営業外費用計		120,507		198,365
経常利益		21,045,676		20,100,019
特別利益				
固定資産売却益		1		-
投資有価証券売却益		479,323		353,644
関係会社株式売却益	1	1,492,680	1	-
本社移転費用引当金戻入額		138,294		-
その他特別利益		350		-
特別利益計		2,110,649		353,644
特別損失				
固定資産除却損	2	36,992	2	19,121
固定資産売却損		134		-
退職給付制度終了損		690,899		-
システム移行損失		76,007		-
その他特別損失		50		-
特別損失計		804,083		19,121
税引前当期純利益		22,352,243		20,434,543
法人税、住民税及び事業税		6,951,863		6,386,793
法人税等調整額		249,832		71,767
法人税等合計		6,702,031		6,315,026
当期純利益		15,650,211		14,119,516

## (3)【株主資本等変動計算書】

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350
当期変動額									
剰余金の配当									3,200,000
当期純利益									15,650,211
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	-	12,450,211
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465
当期変動額					
剰余金の配当	3,200,000	3,200,000			3,200,000
当期純利益	15,650,211	15,650,211			15,650,211
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)		-	277,137	277,137	277,137
当期変動額合計	12,450,211	12,450,211	277,137	277,137	12,727,349
当期末残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562
当期変動額									
剰余金の配当									12,520,000
当期純利益									14,119,516
別途積立金の積立						7,100,000			
研究開発積立金の取崩							300,000		
運用責任準備積立金の取崩								200,000	
繰越利益剰余金の取崩									6,600,000
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	7,100,000	300,000	200,000	5,000,483
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	-	-	14,146,079

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計		有価証券 評価差額金		
当期首残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815
当期変動額					
剰余金の配当	12,520,000	12,520,000			12,520,000
当期純利益	14,119,516	14,119,516			14,119,516
別途積立金の積立	7,100,000	7,100,000			7,100,000
研究開発積立金の取崩	300,000	300,000			300,000
運用責任準備積立金の取崩	200,000	200,000			200,000
繰越利益剰余金の取崩	6,600,000	6,600,000			6,600,000
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)		-	51,753	51,753	51,753
当期変動額合計	1,599,516	1,599,516	51,753	51,753	1,651,270
当期末残高	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085

## 重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：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） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 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。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>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。</p> <p>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、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

## 表示方法の変更

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」842,996千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,699,533千円に含めて表示しております。

## 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

（千円）

	第33期 （2018年3月31日現在）	第34期 （2019年3月31日現在）
建物	140,580	229,897
器具備品	847,466	927,688

（損益計算書関係）

1. 関係会社に対する事項

（千円）

	第33期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）	第34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）
関係会社株式売却益	1,492,680	-

2. 固定資産除却損の内訳

（千円）

	第33期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）	第34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）
建物	298	1,550
器具備品	8,217	439
ソフトウェア	28,472	17,130
電話加入権	3	-

（株主資本等変動計算書関係）

第33期（自 2017年4月1日 至 2018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（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2017年6月21日 定時株主総会	普通株式	3,200,000	80,000	2017年3月31日	2017年6月22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（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2018年6月20日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018年6月21日
	A種種類株式					

## 第34期（自 2018年4月1日 至 2019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（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2018年6月20日 定時株主総会	普通株式	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018年6月21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

2019年6月20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（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21日
	A種種類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

預金の預入先については、余資運用規程に従い、格付けの高い預入先に限定することにより、リスクの軽減を図っております。

営業債権の相手先の信用リスクに関しては、当社の信用リスク管理の基本方針に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行うとともに、主な相手先の信用状況を把握する体制としております。

有価証券及び投資有価証券の発行体の信用リスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

組織規程における分掌業務の定めに基づき、リスク管理担当所管にて、取引残高、損益及びリスク量等の実績管理を行い、定期的に社内委員会での報告を実施しております。

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません(注2)参照)。

第33期(2018年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	49,071,217	49,071,217	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	12,083,824	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	11,769,015	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	4,574,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	1,448,968	1,448,968	-
資産計	78,947,251	78,947,251	-
(1) 未払手数料	4,629,133	4,629,133	-
負債計	4,629,133	4,629,133	-

第34期(2019年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	41,087,475	41,087,475	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	18,773,228	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	12,438,085	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	3,295,109	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	1,488,684	1,488,684	-
資産計	77,082,582	77,082,582	-
(1) 未払手数料	4,883,723	4,883,723	-
負債計	4,883,723	4,883,723	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、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。

## (3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

負 債

## (1) 未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
非上場株式	272,464	276,764
関係会社株式	3,229,196	4,499,196

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## (注3) 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33期(2018年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	49,071,217	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	3,995	-	-

## 第34期(2019年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	41,087,475	-	-	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	153,518	1,995	996	-

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第33期の貸借対照表計上額3,229,196千円、第34期の貸借対照表計上額4,499,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

第33期(2018年3月31日現在)

(千円)

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			
株式	1,267,157	146,101	1,121,055
投資信託	177,815	153,000	24,815
小計	1,444,972	299,101	1,145,870
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,995	4,000	4
小計	3,995	4,000	4
合計	1,448,968	303,101	1,145,866

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額272,464千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第34期(2019年3月31日現在)

(千円)

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			
株式	1,326,372	111,223	1,215,148
投資信託	158,321	153,000	5,321
小計	1,484,694	264,223	1,220,470
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,990	4,000	9
小計	3,990	4,000	9
合計	1,488,684	268,223	1,220,460

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額276,674千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## 3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第33期(自2017年4月1日至2018年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	544,326	479,323	-
投資信託	2,480,288	329,576	21,204

(注) 投資信託の「売却額」、「売却益の合計額」及び「売却損の合計額」は、解約又は償還によるものであります。

## 第34期(自2018年4月1日至2019年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	394,222	353,644	-
投資信託	-	-	-

## (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。

なお、当社は2017年10月1日付で、確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行するとともに、退職一時金制度を改定しました。

## 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

(千円)

	第33期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,718,372	2,154,607
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
数理計算上の差異の発生額	61,792	10,147
退職給付の支払額	111,758	158,018
確定拠出制度への移行に伴う減少額	1,316,796	-
退職一時金制度改定に伴う増加額	526,345	-
その他	-	438
退職給付債務の期末残高	2,154,607	2,289,044

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第33期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)
年金資産の期首残高	1,363,437	-
期待運用収益	17,042	-
事業主からの拠出額	36,672	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	1,417,152	-
年金資産の期末残高	-	-

## (3) 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

(千円)

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,154,607	2,289,044
未積立退職給付債務	2,154,607	2,289,044
未認識数理計算上の差異	204,636	150,568
未認識過去勤務費用	312,836	243,317
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,637,133	1,895,158
退職給付引当金	1,637,133	1,895,158
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,637,133	1,895,158

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
期待運用収益	17,042	-
数理計算上の差異の費用処理額	88,417	43,920
過去勤務費用の費用処理額	39,611	69,519
退職一時金制度改定に伴う費用処理額	70,560	-
その他	1,620	3,640
確定給付制度に係る退職給付費用	456,577	411,963
制度移行に伴う損失(注)	690,899	-

(注) 特別損失に計上しております。

## (5) 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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	1.00% ~ 4.42%

## 3. 簡便法を適用した確定給付制度

## (1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	300,927	-
退職給付費用	53,156	-
制度への拠出額	35,640	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	391,600	-
退職一時金制度改定に伴う振替額	108,189	-
退職給付引当金の期末残高	-	-

## (2) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度 53,156千円 当事業年度 - 千円

## 4. 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86,141千円、当事業年度104,720千円であります。

## (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33期	第34期
	(2018年3月31日現在)	(2019年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	290,493	173,805
未払事業所税	11,683	10,915
賞与引当金	426,815	411,675
未払法定福利費	81,186	80,253
未払給与	9,186	7,961
受取負担金	-	138,994
運用受託報酬	-	102,490
資産除去債務	90,524	10,152
減価償却超過額(一括償却資産)	11,331	4,569
減価償却超過額	176,791	125,839
繰延資産償却超過額(税法上)	34,977	135,542
退職給付引当金	501,290	580,297
時効後支払損引当金	60,941	54,458
ゴルフ会員権評価損	13,173	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
本社移転費用引当金	47,947	-
その他	29,193	29,494
繰延税金資産小計	1,981,254	2,069,527
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,981,254	2,069,527
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	281,720	321,067
繰延税金負債合計	281,720	321,067
繰延税金資産の純額	1,699,533	1,748,459

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  
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間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

## (企業結合等関係)

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

当社は、株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という）及び第一生命ホールディングス株式会社（以下「第一生命」という）の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、MHFGと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

会社名	DIAM (存続会社)	MHAM (消滅会社)
合併比率(*)	1	0.0154

(\*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社であるMHFGに対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないIA種類株式15,510株を交付しました。

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるMHFGが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

## 10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理しております。

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

## (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  
76,224,837千円
- 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 40,451,657千円
- うち現金・預金 11,605,537千円
- うち金銭の信託 11,792,364千円
- b. 負債の額 負債合計 9,256,209千円
- うち未払手数料及び未払費用 4,539,592千円

(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 53,030,000千円
- b. 主要な種類別の内訳
- 顧客関連資産 53,030,000千円
- 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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	114,270,495千円	104,326,078千円
資産合計	114,270,495千円	104,326,078千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	13,059,836千円	10,571,428千円
負債合計	13,059,836千円	10,571,428千円
純資産	101,210,659千円	93,754,650千円

(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	70,507,975千円	66,696,733千円
顧客関連資産	45,200,838千円	39,959,586千円

## (2) 損益計算書項目

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	9,012,128千円	9,043,138千円
経常利益	9,012,128千円	9,043,138千円
税引前当期純利益	9,012,128千円	9,091,728千円
当期純利益	7,419,617千円	7,489,721千円
1株当たり当期純利益	185,490円43銭	187,243円04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	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,233,360千円	5,241,252千円



(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。

(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33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)及び第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(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33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019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33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

## 第33期(自 2017年4月1日 至 2018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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						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	6,470,802	未払 手数料	894,336
	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	9,079,083	未払 手数料	1,549,208

## 第34期(自 2018年4月1日 至 2019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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						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	6,048,352	未払 手数料	915,980
								子会社株式 の取得	1,270,000	-	-
	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	10,215,017	未払 手数料	1,670,194

## 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) 子会社株式の取得は、独立した第三者機関により算定された価格を基礎として協議の上、合理的に決定しております。
- (注3) 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33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	1,667,445円37銭	1,708,727円13銭
1株当たり当期純利益金額	391,255円29銭	352,987円92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33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
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。

## (1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

	第35期中間会計期間末 (2019年9月30日現在)	
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		37,156,171
金銭の信託		18,742,684
有価証券		997
未収委託者報酬		11,945,046
未収運用受託報酬		3,120,602
未収投資助言報酬		332,118
未収収益		58,808
前払費用		781,218
その他		2,233,840
	流動資産計	74,371,488
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	1,051,855
器具備品	1	311,144
無形固定資産		
ソフトウェア		3,323,996
ソフトウェア仮勘定		213,219
電話加入権		3,931
電信電話専用施設利用権		6
投資その他の資産		
投資有価証券		958,309
関係会社株式		4,499,196
長期差入保証金		1,307,197
繰延税金資産		2,036,732
その他		95,551
	固定資産計	13,801,139
	資産合計	88,172,628

(単位:千円)

	第35期中間会計期間末 (2019年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	5,192,317
未払金	5,043,713
未払収益分配金	1,047
未払償還金	48,441
未払手数料	4,707,236
その他未払金	286,987
未払費用	6,512,990
未払法人税等	3,526,134
未払消費税等	516,610
前受収益	40,684
賞与引当金	1,281,617
役員賞与引当金	34,112
流動負債計	22,148,179
固定負債	
退職給付引当金	1,993,829
時効後支払損引当金	169,869
固定負債計	2,163,698
負債合計	24,311,878
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	19,552,957
資本準備金	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479
利益剰余金	41,866,681
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	41,743,387
別途積立金	31,680,000
繰越利益剰余金	10,063,387
株主資本計	63,419,638
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	441,111
評価・換算差額等計	441,111
純資産合計	63,860,750
負債・純資産合計	88,172,628

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	42,425,693	
運用受託報酬	7,240,514	
投資助言報酬	601,626	
その他営業収益	57,443	
	営業収益計	50,325,278
営業費用		
支払手数料	17,730,384	
広告宣伝費	125,471	
公告費	125	
調査費	12,182,415	
調査費	4,742,559	
委託調査費	7,439,855	
委託計算費	421,559	
営業雑経費	538,430	
通信費	22,517	
印刷費	410,573	
協会費	34,596	
諸会費	16,711	
支払販売手数料	54,031	
	営業費用計	30,998,386
一般管理費		
給料	4,829,571	
役員報酬	87,372	
給料・手当	4,615,868	
賞与	126,330	
交際費	17,168	
寄付金	6,499	
旅費交通費	165,035	
租税公課	291,415	
不動産賃借料	749,406	
退職給付費用	254,598	
固定資産減価償却費	1 345,421	
福利厚生費	21,538	
修繕費	1,263	
賞与引当金繰入額	1,281,617	
役員賞与引当金繰入額	34,112	
機器リース料	138	
事務委託費	1,700,671	
事務用消耗品費	50,852	
器具備品費	490	
諸経費	100,495	
	一般管理費計	9,850,295
営業利益		9,476,595

(単位:千円)

	第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	1,075	
受取配当金	11,185	
時効成立分配金・償還金	608	
時効後支払損引当金戻入額	7,743	
投資信託償還益	2,466	
受取負担金	287,268	
雑収入	2,670	
	営業外収益計	313,018
営業外費用		
為替差損	9,702	
投資信託償還損	1	
金銭の信託運用損	18,907	
雑損失	104	
	営業外費用計	28,716
経常利益		9,760,897
特別利益		
投資有価証券売却益	634,060	
	特別利益計	634,060
特別損失		
固定資産除却損	7,444	
	特別損失計	7,444
税引前中間純利益		10,387,514
法人税、住民税及び事業税		3,299,452
法人税等調整額		109,246
法人税等合計		3,190,205
中間純利益		7,197,308

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	14,146,079
当中間期変動額							
剰余金の配当							11,280,000
中間純利益							7,197,308
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	4,082,691
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	10,063,387

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,280,000	11,280,000			11,280,000
中間純利益	7,197,308	7,197,308			7,197,308
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)			405,643	405,643	405,643
当中間期変動額 合計	4,082,691	4,082,691	405,643	405,643	4,488,335
当中間期末残高	41,866,681	63,419,638	441,111	441,111	63,860,750



## 重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 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）に基づく定額法によっております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の日翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

項目	第35期中間会計期間末 （2019年9月30日現在）		
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	...	274,959千円
	器具備品	...	965,214千円

## （中間損益計算書関係）

項目	第35期中間会計期間 （自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）		
1.減価償却実施額	有形固定資産	...	97,348千円
	無形固定資産	...	248,073千円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第35期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

## 1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2.配当に関する事項

## （1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21日
	A種種類 株式				

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

## （金融商品関係）

第35期中間会計期間末（2019年9月30日現在）

## 金融商品の時価等に関する事項

2019年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

	中間貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
(1) 現金・預金	37,156,171	37,156,171	-
(2) 金銭の信託	18,742,684	18,742,684	-
(3) 未収委託者報酬	11,945,046	11,945,046	-
(4) 未収運用受託報酬	3,120,602	3,120,602	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	699,937	699,937	-
資産計	71,664,441	71,664,441	-
(1) 未払手数料	4,707,236	4,707,236	-
負債計	4,707,236	4,707,236	-

## （注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金

これは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、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。

## (3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっており、投資信託は基準価額によっております。

## 負債

## (1) 未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	259,369
関係会社株式	4,499,196

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

## (有価証券関係)

第35期中間会計期間末

(2019年9月30日現在)

## 1. 子会社株式

関係会社株式(中間貸借対照表計上額4,499,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

区分	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	691,010	58,146	632,863
投資信託	5,937	3,000	2,937
小計	696,947	61,146	635,800
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	2,990	3,000	9
小計	2,990	3,000	9
合計	699,937	64,146	635,791

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額259,369千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## （企業結合等関係）

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

当社は、株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「MHFG」という）及び第一生命ホールディングス株式会社（以下「第一生命」という）の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、MHFGと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

会社名	DIAM (存続会社)	MHAM (消滅会社)
合併比率(*)	1	0.0154

(\*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社であるMHFGに対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないIA種種類株式15,510株を交付しました。

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるMHFGが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

## 10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」(企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分)に基づき、「3. 企業結合の方法」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理しております。

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2019年4月1日から2019年9月30日まで

## (2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

## (3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

b. 発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

## (4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451,657千円

うち現金・預金 11,605,537千円

うち金銭の信託 11,792,364千円

b. 負債の額 負債合計 9,256,209千円

うち未払手数料及び未払費用 4,539,592千円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030,000千円

## b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030,000千円

## c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	99,557,407千円
資産合計	99,557,407千円
流動負債	- 千円
固定負債	9,515,195千円
負債合計	9,515,195千円
純資産	90,042,211千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額64,791,112千円及び顧客関連資産の金額37,384,808千円が含まれております。

## (2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,477,219千円
経常利益	4,477,219千円
税引前中間純利益	4,551,164千円
中間純利益	3,763,741千円
1株当たり中間純利益	94,093円53銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,574,777千円が含まれております。

## (資産除去債務関係)

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

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

## (セグメント情報等)

第35期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

## 1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2.関連情報

## (1)サービスごとの情報

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

## (2)地域ごとの情報

## 営業収益

本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 有形固定資産

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

## (3)主要な顧客ごとの情報

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

## (1株当たり情報)

第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,596,518円75銭
1株当たり中間純利益金額	179,932円71銭

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



1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
中間純利益金額	7,197,308千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	7,197,308千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項  
該当事項はありません。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項  
委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2019年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

## (2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行（ 1 ）	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社みちのく銀行（ 1 ）	36,986	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東邦銀行	23,519	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北陸銀行	140,409	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社大垣共立銀行	46,773	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社広島銀行	54,573	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社西日本シティ銀行	85,745	日本において銀行業務を営んでおります。
みずほ信託銀行株式会社（ 1 ）	247,369	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。
株式会社名古屋銀行	25,090	日本において銀行業務を営んでおります。
auカブコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社SBI証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
OKB証券株式会社（ 1 ）	1,500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
SMB C日興証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
丸國證券株式会社	601	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は2019年3月末日現在

（注）確定拠出年金向けの取扱販売会社を含みます。

（ 1 ）新規の取得のお申込みのお取扱いを行っておりません。

## 2【関係業務の概要】

## (1) 受託会社

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

## (2) 販売会社

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

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【その他】

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

- ・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
- ・委託会社の金融商品取引業者登録番号
- ・詳細情報の入手方法

委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など

請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨

- ・目論見書の使用開始日
- ・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

- ・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
- ・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

## 独立監査人の監査報告書

2019年5月30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

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 湯原 尚 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 山野 浩 印

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2018年4月1日から2019年3月31日までの第34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。

## 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。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

## 監査意見

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2019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すべ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。

## 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) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

令和2年4月17日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 山野 浩 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMHAM TOPIXオープンの平成31年3月12日から令和2年3月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 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。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、MHAM TOPIXオープンの令和2年3月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべ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。

## 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) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年11月28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

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野 浩 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	長谷川 敬 印

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2019年4月1日から2020年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 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。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 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) 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。