

## 【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】	2021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】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

MHAM TOPIXオープン(以下「当ファンド」といいます。)

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

### (3)【発行(売出)価額の総額】

1兆円を上限とします。

### (4)【発行(売出)価格】

取得申込日の基準価額とします。

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

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

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	<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】

2021年6月11日から2021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<sup>\*1</sup>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）<sup>\*2</sup>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「株東京証券取引所」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株東京証券取引所が有しています。
2. 株東京証券取引所は、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. 株東京証券取引所は、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. 株東京証券取引所は、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、株東京証券取引所は、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<sup>\*1</sup>およびMHAM TOPIXマザーファンド<sup>\*1</sup>に投資するファンドは、株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. 株東京証券取引所は、MHAM TOPIXマザーファンド<sup>\*1</sup>およびMHAM TOPIXマザーファンド<sup>\*1</sup>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<sup>\*1</sup>およびMHAM TOPIXマザーファンド<sup>\*1</sup>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. 株東京証券取引所は、委託会社またはMHAM TOPIXマザーファンド<sup>\*1</sup>およびMHAM TOPIXマザーファンド<sup>\*1</sup>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、株東京証券取引所はMHAM TOPIXマザーファンド<sup>\*1</sup>およびMHAM TOPIXマザーファンド<sup>\*1</sup>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）<sup>\*2</sup>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、「日本株式マルチファクターモデル」を活用します。

\*1 マザーファンドの入替えのため、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」を2021年7月2日に投資対象に追加し、「MHAM TOPIXマザーファンド」を2021年12月17日に投資対象から削除する予定です。

\*2 2021年7月2日に「東証株価指数（TOPIX、配当込み）」に変更を行う予定です。

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。

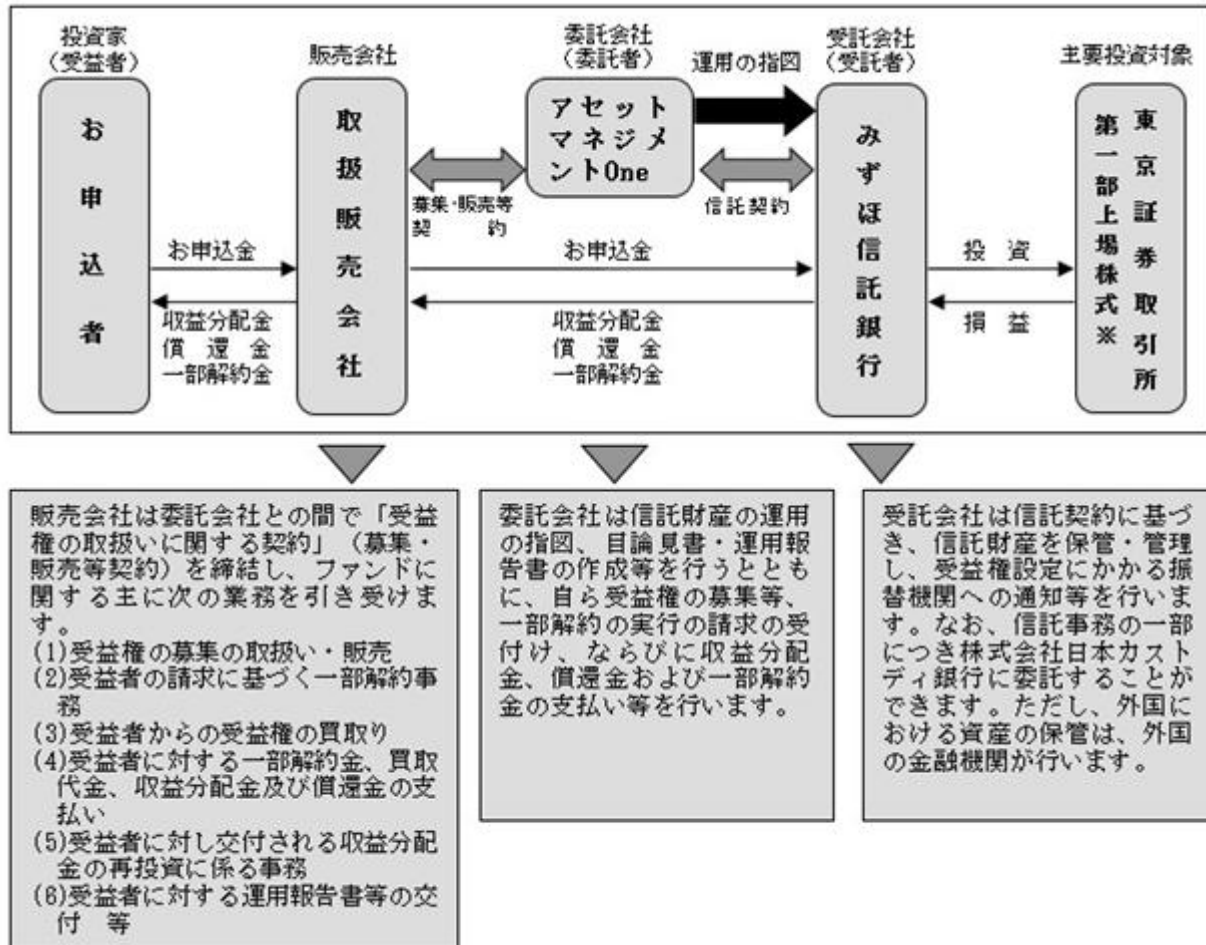
## (2) 【ファンドの沿革】

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
2021年7月2日	ファンドの主要投資対象に「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」を追加(予定)
2021年12月17日	ファンドの主要投資対象から「MHAM TOPIXマザーファンド」を削除(予定)



## (3) 【ファンドの仕組み】

## 当ファンドの運営の仕組み

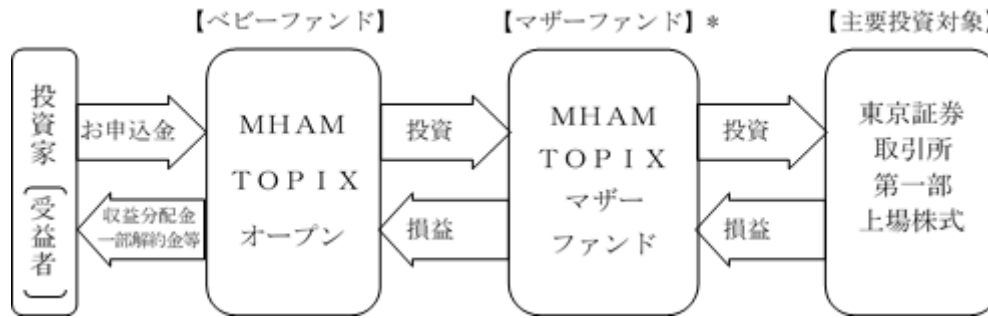


主要投資対象である東京証券取引所第一部上場株式には、主として、MHAM TOPIXマザーファンド<sup>\*</sup>を通じて投資を行います。

## 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」<sup>\*</sup>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。

\* マザーファンドの入替えのため、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」を2021年7月2日に投資対象に追加し、「MHAM TOPIXマザーファンド」を2021年12月17日に投資対象から削除する予定です。

## 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（2021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

(2021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% <sup>2)</sup>

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）<sup>\*1</sup>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<sup>\*2</sup>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<sup>\*2</sup>に投資し、東証株価指数（TOPIX）<sup>\*1</sup>と連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用にあたっては、「日本株式マルチファクターモデル」を活用します。

- ・ 「日本株式マルチファクターモデル」とは、複数のリスクファクターによって株式のリターンを分解・説明するモデルです。このモデルを活用し、TOPIXに連動する銘柄群を効率的に選びます。
- ・ 投資する銘柄群について定期的に見直しを実施することにより、TOPIXに対する連動性を高めます。

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

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

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

\* 株価指数先物取引等の詳細については、後記「(5) 投資制限 a．約款で定める投資制限 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。

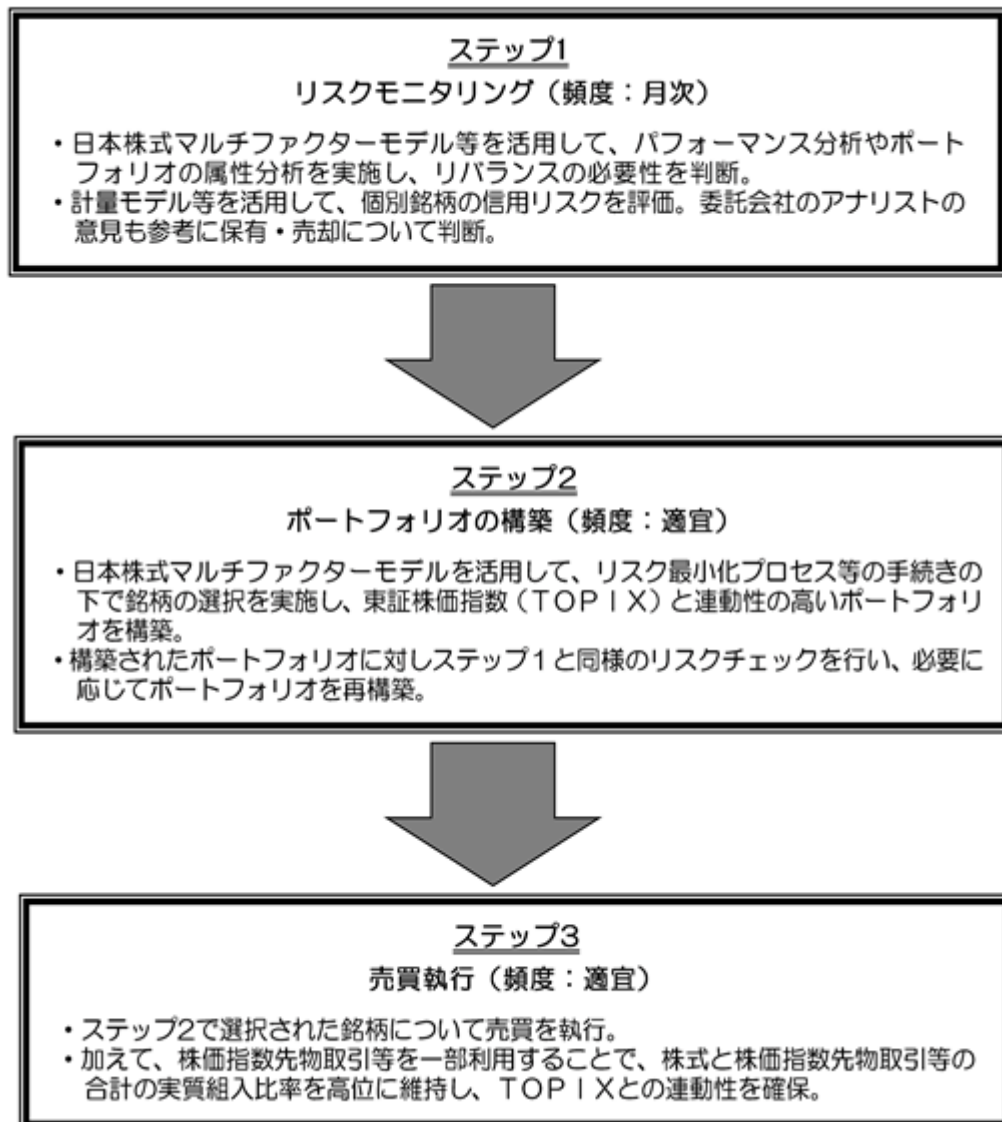
e．現物株式の実質組入比率（信託財産に属する他の投資信託受益証券の時価総額に、当該他の投資信託の信託財産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額と、信託財産に属する株式

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

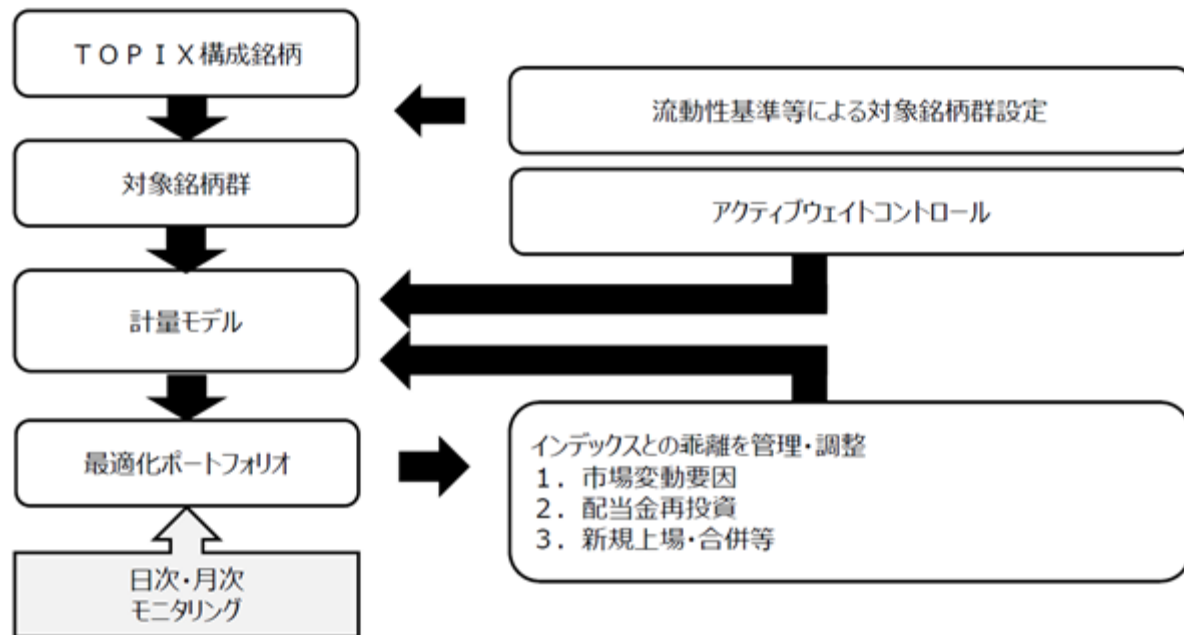
当ファンドは、主としてMHAM TOPIXマザーファンド受益証券<sup>\*2</sup>への投資を通じ、以下のプロセスにより東京証券取引所第一部上場株式に投資を行います。



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。

\* 1 2021年7月2日に「東証株価指数(TOPIX、配当込み)」に変更を行う予定です。  
 \* 2 マザーファンドの入替えのため、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」を2021年7月2日に投資対象に追加し、「MHAM TOPIXマザーファンド」を2021年12月17日に投資対象から削除する予定です。

<国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドの投資プロセス>



#### 1.流動性基準等による対象銘柄群設定

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

#### 2.最適化法によるポートフォリオの構築

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

#### 3.インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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

## (2)【投資対象】

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<sup>\*</sup>の受益証券および次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. コマーシャル・ペーパー
7. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券(両者を総称して「新株引受権証券等」といいます。)
8. 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券または証書で、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。

<p>*マザーファンドの入替えのため、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」を2021年7月2日に投資対象に追加し、「MHAM TOPIXマザーファンド」を2021年12月17日に投資対象から削除する予定です。</p>
---

#### 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

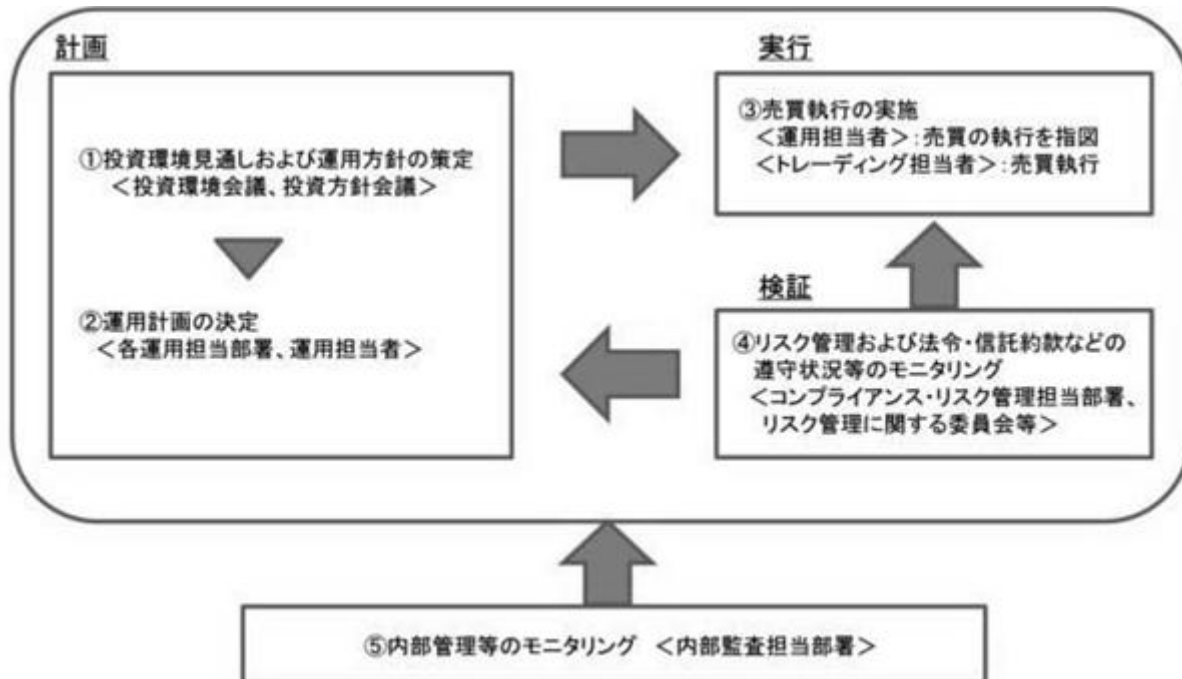
有価証券先物取引等を行うことができます。

## 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。

定期的に行わ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2021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）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ます。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式および新株引受権証券等についてはこの限りではありません。

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、金利先渡し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。

<参考>MHAM TOPIXマザーファンド<sup>\*</sup>の投資方針および主な投資制限

#### (1) 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX(東証株価指数)と連動する投資成果を目標として運用を行います。

#### (2) 運用方法

##### 投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

##### 投資態度

1. 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。
2. 株価指数等の先物取引を含む株式の実質組入比率は、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、一時的に株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価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。
3. 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。
4. 上記1から3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。

#### (3) 投資制限

株式の組入比率には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

有価証券先物取引等は約款第15条の範囲で行います。

スワップ取引は約款第16条の範囲で行います。

金利先渡取引は約款第17条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人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。

\* マザーファンドの入替えのため、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」を2021年7月2日に投資対象に追加し、「MHAM TOPIXマザーファンド」を2021年12月17日に投資対象から削除する予定です。

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

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

### （１）投資対象

東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。

### （２）投資態度

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

### （３）投資制限

- 1) 株式への投資割合には、制限を設けません。
- 2) デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- 3) 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
- 4) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## 3【投資リスク】

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

- ・当ファンドは、主としてMHAM TOPIXマザーファンド受益証券<sup>\*</sup>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。

\* マザーファンドの入替えのため、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」を2021年7月2日に投資対象に追加し、「MHAM TOPIXマザーファンド」を2021年12月17日に投資対象から削除する予定です。

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出入に対応することにより、株式の実質組入比率(現物株式+株価指数先物取引等)が100%を超える場合があります。

#### 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)<sup>\*</sup>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。

\*2021年7月2日に「東証株価指数(TOPIX、配当込み)」に変更を行う予定です。

#### <収益分配金に関する留意点>

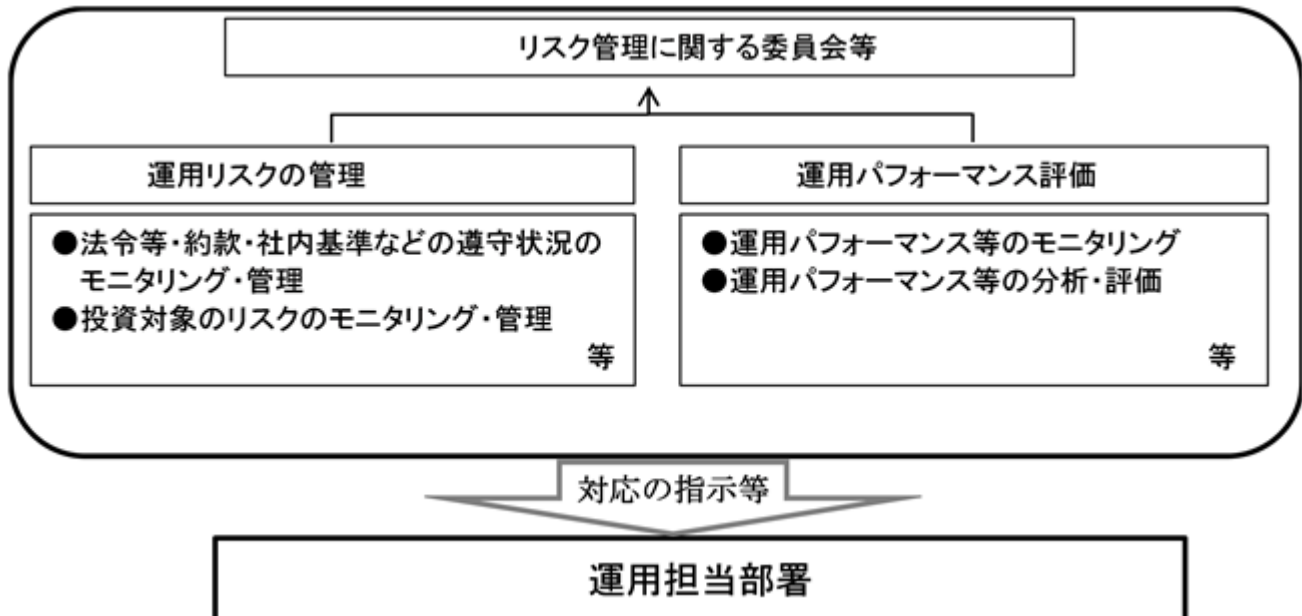
- ・投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- ・分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・投資家(受益者)のファンドの取得価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド取得後の運用状況により、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

#### (2) リスク管理体制

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

- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・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2021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>

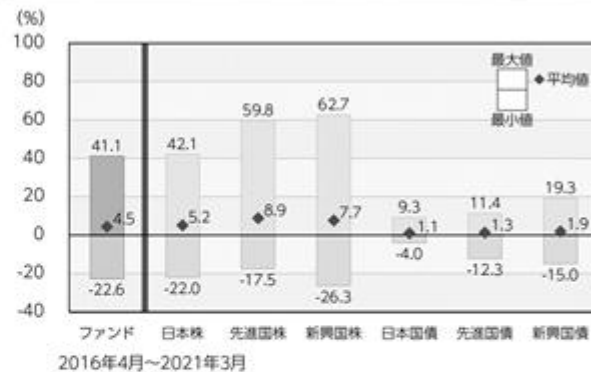
### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



\*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。

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、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	JPMorgan GBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)	「JPMorgan GBI-EMグローバル・ディバーシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

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、2021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】

2021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	9,158,711,715	99.98
内 日本	9,158,711,715	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,634,296	0.02
純資産総額	9,160,346,011	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

2021年3月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	48,126,584,000	94.94
内 日本	48,126,584,000	94.94
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,566,667,948	5.06
純資産総額	50,693,251,948	100.00

その他資産の投資状況

2021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)	2,579,280,000	5.09
内 日本	2,579,280,000	5.09

(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】

2021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	3,771,189,869	2.3657 8,921,530,610	2.4286 9,158,711,715	- -	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

2021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

2021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	182,000	8,128.00 1,479,296,000	8,616.00 1,568,112,000	- -	3.09
2	ソニー 日本	株式 電気機器	112,500	11,000.00 1,237,500,000	11,595.00 1,304,437,500	- -	2.57
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	139,800	10,120.00 1,414,776,000	9,330.00 1,304,334,000	- -	2.57
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	17,700	49,130.00 869,601,000	50,270.00 889,779,000	- -	1.76
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	1,211,700	591.50 716,720,550	591.70 716,962,890	- -	1.41
6	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	122,900	4,919.00 604,545,100	5,401.00 663,782,900	- -	1.31
7	任天堂 日本	株式 その他製品	10,300	59,000.00 607,700,000	61,810.00 636,643,000	- -	1.26
8	信越化学工業 日本	株式 化学	32,600	17,510.00 570,826,000	18,610.00 606,686,000	- -	1.20
9	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	149,500	3,997.00 597,551,500	3,985.00 595,757,500	- -	1.18
10	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	206,200	2,827.50 583,030,500	2,842.00 586,020,400	- -	1.16
11	日本電産 日本	株式 電気機器	43,200	12,485.00 539,352,000	13,435.00 580,392,000	- -	1.14
12	ダイキン工業 日本	株式 機械	22,900	21,930.00 502,197,000	22,320.00 511,128,000	- -	1.01
13	第一三共 日本	株式 医薬品	154,200	3,200.00 493,440,000	3,225.00 497,295,000	- -	0.98
14	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	10,600	40,650.00 430,890,000	46,790.00 495,974,000	- -	0.98
15	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	122,600	3,962.00 485,741,200	4,007.00 491,258,200	- -	0.97
16	KDDI 日本	株式 情報・通信業	141,400	3,489.00 493,344,600	3,395.00 480,053,000	- -	0.95
17	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	141,500	3,218.00 455,347,000	3,319.00 469,638,500	- -	0.93



18	村田製作所 日本	株式 電気機器	52,800	9,020.00 476,256,000	8,842.00 466,857,600	- -	0.92
19	HOYA 日本	株式 精密機器	35,300	11,875.00 419,187,500	13,005.00 459,076,500	- -	0.91
20	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	123,800	3,439.00 425,748,200	3,587.00 444,070,600	- -	0.88
21	日立製作所 日本	株式 電気機器	86,300	5,230.00 451,349,000	5,004.00 431,845,200	- -	0.85
22	ファナック 日本	株式 電気機器	15,700	26,255.00 412,203,500	26,185.00 411,104,500	- -	0.81
23	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	240,700	1,597.50 384,518,250	1,599.00 384,879,300	- -	0.76
24	三菱商事 日本	株式 卸売業	107,700	3,145.00 338,716,500	3,130.00 337,101,000	- -	0.66
25	SMC 日本	株式 機械	5,200	60,130.00 312,676,000	64,310.00 334,412,000	- -	0.66
26	三井物産 日本	株式 卸売業	143,600	2,310.50 331,787,800	2,302.00 330,567,200	- -	0.65
27	花王 日本	株式 化学	43,000	7,221.00 310,503,000	7,313.00 314,459,000	- -	0.62
28	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	58,700	5,632.00 330,598,400	5,265.00 309,055,500	- -	0.61
29	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	69,200	4,384.00 303,372,800	4,463.00 308,839,600	- -	0.61
30	三菱電機 日本	株式 電気機器	179,600	1,666.00 299,213,600	1,686.50 302,895,400	- -	0.60

(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

2021年3月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	94.94
合計	94.94

(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

2021年3月31日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	16.61
情報・通信業		8.75
化学		7.02
輸送用機器		6.99
機械		5.38
サービス業		5.29
医薬品		5.23
銀行業		4.89
卸売業		4.55
小売業		4.47
陸運業		3.25

食料品	3.16
精密機器	2.41
建設業	2.28
その他製品	2.26
不動産業	1.92
保険業	1.76
電気・ガス業	1.30
その他金融業	1.04
ガラス・土石製品	0.79
証券、商品先物取引業	0.75
鉄鋼	0.74
非鉄金属	0.73
金属製品	0.61
ゴム製品	0.58
繊維製品	0.47
空運業	0.44
石油・石炭製品	0.43
パルプ・紙	0.24
海運業	0.22
倉庫・運輸関連業	0.16
鉱業	0.16
水産・農林業	0.09
合計	94.94

（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

2021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 0306月	買建	132	2,584,135,970	2,579,280,000	5.09

（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（2021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14計算期間末 (2012年 3月12日)	8,270	8,345	0.5493	0.5543
第15計算期間末 (2013年 3月11日)	9,410	9,507	0.6796	0.6866
第16計算期間末 (2014年 3月10日)	8,735	8,833	0.8027	0.8117
第17計算期間末 (2015年 3月10日)	9,788	9,877	1.0008	1.0098
第18計算期間末 (2016年 3月10日)	8,408	8,502	0.8879	0.8979
第19計算期間末 (2017年 3月10日)	9,275	9,383	1.0364	1.0484
第20計算期間末 (2018年 3月12日)	9,108	9,211	1.1489	1.1619
第21計算期間末 (2019年 3月11日)	8,288	8,359	1.0502	1.0592
第22計算期間末 (2020年3月10日)	6,843	6,975	0.9339	0.9519
第23計算期間末 (2021年3月10日)	8,814	8,917	1.2812	1.2962
2020年3月末日	7,048	-	0.9426	-
4月末日	7,357	-	0.9829	-
5月末日	7,840	-	1.0491	-
6月末日	7,785	-	1.0469	-
7月末日	7,425	-	1.0042	-
8月末日	7,971	-	1.0855	-
9月末日	8,031	-	1.0987	-
10月末日	7,792	-	1.0672	-
11月末日	8,445	-	1.1854	-
12月末日	8,590	-	1.2201	-
2021年1月末日	8,513	-	1.2220	-
2月末日	8,702	-	1.2596	-
3月末日	9,160	-	1.3148	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
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

第23計算期間	0.0150
---------	--------

**【収益率の推移】**

	収益率(%)
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
第23計算期間	38.8

(注1) 収益率は期間騰落率です。

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

**(4) 【設定及び解約の実績】**

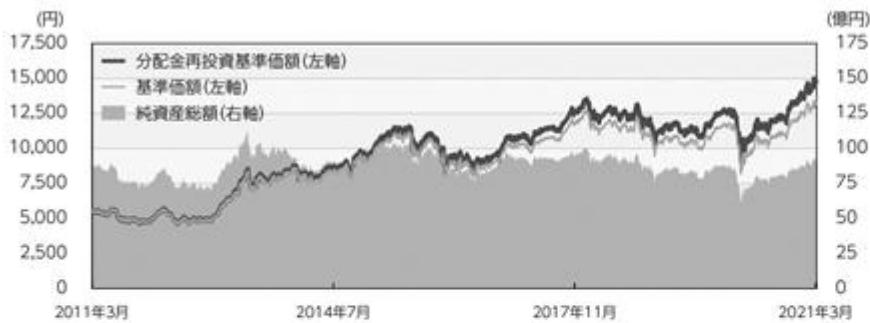
	設定口数	解約口数
第14計算期間	1,913,349,732	2,444,065,993
第15計算期間	1,546,858,797	2,755,516,847
第16計算期間	1,720,491,029	4,684,522,874
第17計算期間	1,297,591,952	2,399,371,648
第18計算期間	1,764,811,465	2,076,291,110
第19計算期間	1,243,083,227	1,762,450,093
第20計算期間	1,277,274,100	2,299,730,471
第21計算期間	1,138,643,487	1,174,485,331
第22計算期間	1,083,065,008	1,646,604,346
第23計算期間	1,239,609,441	1,688,249,680

(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:2021年3月31日

## 基準価額・純資産の推移 (2011年3月31日～2021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)

2017年 3月	120円
2018年 3月	130円
2019年 3月	90円
2020年 3月	180円
2021年 3月	150円
設定来累計	5,320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	94.94
内 日本	94.94
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5.06
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)	5.09

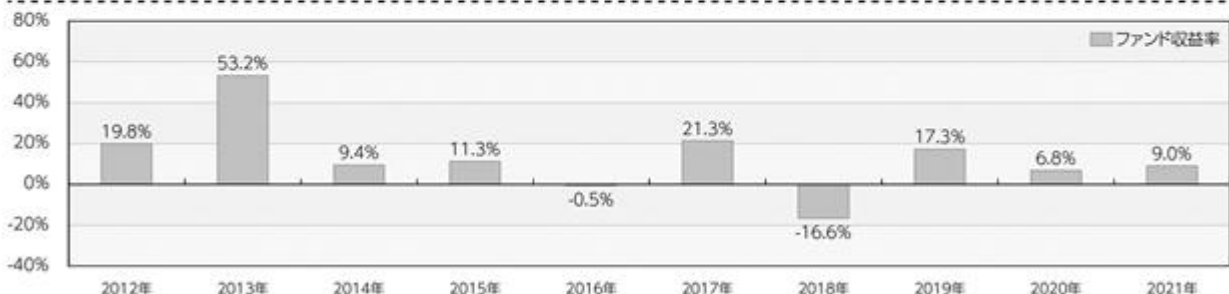
## 株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	16.61
2	情報・通信業	8.75
3	化学	7.02
4	輸送用機器	6.99
5	機械	5.38

## 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	3.09
2	ソニー	株式	日本	電気機器	2.57
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.57
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.76
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.41
6	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.31
7	任天堂	株式	日本	その他製品	1.26
8	信越化学工業	株式	日本	化学	1.20
9	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.18
10	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.16

## 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。

※2021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依り、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、株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

#### 公告

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

<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23期計算期間(2020年3月11日から2021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22期 2020年3月10日現在	第23期 2021年3月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	60,343,465	59,113,776
親投資信託受益証券	6,842,830,433	8,812,692,738
未収入金	131,125,000	108,207,000
流動資産合計	7,034,298,898	8,980,013,514
資産合計	7,034,298,898	8,980,013,514
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	131,913,568	103,198,370
未払解約金	28,491,347	32,522,757
未払受託者報酬	3,465,301	3,459,346
未払委託者報酬	26,567,607	26,521,851
その他未払費用	68,869	65,506
流動負債合計	190,506,692	165,767,830
負債合計	190,506,692	165,767,830
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,328,531,597	6,879,891,358
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	484,739,391	1,934,354,326
(分配準備積立金)	1,717,176,141	2,376,042,428
元本等合計	6,843,792,206	8,814,245,684
純資産合計	6,843,792,206	8,814,245,684
負債純資産合計	7,034,298,898	8,980,013,514

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第22期 自 2019年3月12日 至 2020年3月10日	第23期 自 2020年3月11日 至 2021年3月10日
<b>営業収益</b>		
受取利息	46	31
有価証券売買等損益	624,068,774	2,689,677,305
営業収益合計	624,068,728	2,689,677,336
<b>営業費用</b>		
支払利息	16,265	11,283
受託者報酬	6,840,082	6,578,432
委託者報酬	52,440,888	50,435,175
その他費用	137,199	125,313
営業費用合計	59,434,434	57,150,203
営業利益又は営業損失( )	683,503,162	2,632,527,133
経常利益又は経常損失( )	683,503,162	2,632,527,133
当期純利益又は当期純損失( )	683,503,162	2,632,527,133
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( )	67,174,995	291,907,299
期首剰余金又は期首欠損金( )	396,134,979	484,739,391
剰余金増加額又は欠損金減少額	86,042,498	181,672,253
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	99,329,657
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	86,042,498	82,342,596
剰余金減少額又は欠損金増加額	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	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	131,913,568	103,198,370
期末剰余金又は期末欠損金( )	484,739,391	1,934,354,326

## (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23期	
	自 2020年3月11日	至 2021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。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第22期	第23期
	2020年3月10日現在	2021年3月10日現在
1. 期首元本額	7,892,070,935円	7,328,531,597円
期中追加設定元本額	1,083,065,008円	1,239,609,441円
期中一部解約元本額	1,646,604,346円	1,688,249,680円
2. 受益権の総数	7,328,531,597口	6,879,891,358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22期	第23期
	自 2019年3月12日 至 2020年3月10日	自 2020年3月11日 至 2021年3月10日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(166,613,953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(952,610,478円)、信託約款に規定される収益調整金(3,298,984,333円)及び分配準備積立金(1,360,016,367円)より分配対象収益は5,778,225,131円(1万口当たり8,398.71円)であり、うち103,198,370円(1万口当たり150円)を分配金額としております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第22期	第23期
	自 2019年3月12日 至 2020年3月10日	自 2020年3月11日 至 2021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。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、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。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第22期 2020年3月10日現在	第23期 2021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ん。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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。	同左

(有価証券に関する注記)



## 売買目的有価証券

種類	第22期 2020年3月10日現在	第23期 2021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	660,105,332	2,473,718,471
合計	660,105,332	2,473,718,471

（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22期 2020年3月10日現在	第23期 2021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）	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

2021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	3,725,667,007	8,812,692,738	
親投資信託受益証券	合計	3,725,667,007	8,812,692,738	
合計			8,812,692,738	

（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)

2021年3月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,819,477,393
株式	47,304,937,570
未収入金	2,156,040
未収配当金	64,742,222
前払金	1,645,000
差入委託証拠金	29,760,000
流動資産合計	50,222,718,225
資産合計	50,222,718,225
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,733,100
未払金	2,179,787,479
未払解約金	108,207,000
流動負債合計	2,289,727,579
負債合計	2,289,727,579
純資産の部	
元本等	
元本	20,264,417,398
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	27,668,573,248
元本等合計	47,932,990,646
純資産合計	47,932,990,646
負債純資産合計	50,222,718,225

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2020年3月11日 至 2021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	2021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	20,048,805,260円
同期中追加設定元本額	11,370,685,669円
同期中一部解約元本額	11,155,073,531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	3,725,667,007円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	8,934,851,549円
動的パッケージファンド＜DC年金＞	26,629,144円
コア資産形成ファンド	23,274,951円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	94,638,802円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	4,102,809,039円
MHAM日本株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	2,491,592,208円
計	20,264,417,398円
2. 受益権の総数	20,264,417,398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 2020年3月11日 至 2021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	<p>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。</p> <p>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。</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。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	2021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ん。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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った場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年3月10日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	10,186,596,439
合計	10,186,596,439

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	2021年3月10日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	1,331,010,000	-	1,329,300,000	1,710,000
合計	1,331,010,000	-	1,329,300,000	1,710,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2021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)	2,365.4円 (23,654円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021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	3,120.00	2,496,000	
日本水産	22,700	550.00	12,485,000	
マルハニチロ	3,800	2,713.00	10,309,400	
ハウスイ	100	998.00	99,800	
雪国まいたけ	1,600	1,832.00	2,931,200	
カネコ種苗	700	1,602.00	1,121,400	
サカタのタネ	2,900	3,880.00	11,252,000	
ホクト	2,100	2,149.00	4,512,900	
ホクリヨウ	400	690.00	276,000	
ヒノキヤグループ	600	2,279.00	1,367,400	
ショーボンドホールディングス	3,600	4,610.00	16,596,000	
ミライト・ホールディングス	8,500	1,753.00	14,900,500	
タマホーム	1,500	1,997.00	2,995,500	
サンヨーホームズ	300	826.00	247,800	
日本アクア	900	602.00	541,800	
ファーストコーポレーション	700	712.00	498,400	
ベステラ	600	1,799.00	1,079,400	
TATERU	5,900	183.00	1,079,700	
キャンディル	500	543.00	271,500	
スペースバリューホールディングス	3,000	761.00	2,283,000	
住石ホールディングス	4,200	123.00	516,600	

日鉄鉱業	500	6,540.00	3,270,000
三井松島ホールディングス	1,000	1,049.00	1,049,000
国際石油開発帝石	89,700	804.00	72,118,800
石油資源開発	3,300	2,282.00	7,530,600
K&Oエナジーグループ	1,200	1,457.00	1,748,400
ダイセキ環境ソリューション	600	785.00	471,000
第一カッター興業	600	1,373.00	823,800
明豊ファシリティワークス	800	655.00	524,000
安藤・間	15,600	864.00	13,478,400
東急建設	7,100	619.00	4,394,900
コムシスホールディングス	8,700	3,265.00	28,405,500
ビーアールホールディングス	2,900	618.00	1,792,200
高松コンストラクショングループ	1,600	2,198.00	3,516,800
東建コーポレーション	700	9,200.00	6,440,000
ソネック	200	865.00	173,000
ヤマウラ	1,000	981.00	981,000
大成建設	17,600	4,060.00	71,456,000
大林組	56,300	990.00	55,737,000
清水建設	52,800	884.00	46,675,200
飛鳥建設	1,700	1,172.00	1,992,400
長谷工コーポレーション	18,400	1,449.00	26,661,600
松井建設	2,200	721.00	1,586,200
銭高組	200	4,695.00	939,000
鹿島建設	41,200	1,516.00	62,459,200
不動テトラ	1,400	1,945.00	2,723,000
大末建設	700	929.00	650,300
鉄建建設	1,200	2,046.00	2,455,200
西松建設	4,000	2,850.00	11,400,000
三井住友建設	13,600	523.00	7,112,800
大豊建設	1,300	3,835.00	4,985,500
前田建設工業	14,100	966.00	13,620,600
佐田建設	1,400	460.00	644,000
ナカノフドー建設	1,400	393.00	550,200
奥村組	3,100	2,930.00	9,083,000
東鉄工業	2,400	2,752.00	6,604,800
イチケン	400	2,120.00	848,000
富士ピー・エス	700	608.00	425,600
浅沼組	700	4,825.00	3,377,500
戸田建設	23,400	801.00	18,743,400
熊谷組	2,600	3,070.00	7,982,000
北野建設	300	2,517.00	755,100
植木組	200	2,934.00	586,800
矢作建設工業	2,500	860.00	2,150,000
ピーエス三菱	1,900	717.00	1,362,300
日本ハウスホールディングス	4,600	339.00	1,559,400
大東建託	6,100	11,550.00	70,455,000
新日本建設	2,400	874.00	2,097,600
N I P P O	4,600	3,015.00	13,869,000
東亜道路工業	300	4,300.00	1,290,000
前田道路	3,600	2,168.00	7,804,800

日本道路	500	8,480.00	4,240,000	
東亜建設工業	1,600	2,390.00	3,824,000	
日本国土開発	5,500	596.00	3,278,000	
若築建設	1,000	1,383.00	1,383,000	
東洋建設	6,300	577.00	3,635,100	
五洋建設	23,900	828.00	19,789,200	
世紀東急工業	2,700	943.00	2,546,100	
福田組	600	5,170.00	3,102,000	
日本ドライケミカル	400	1,615.00	646,000	
住友林業	13,200	2,165.00	28,578,000	
日本基礎技術	1,800	501.00	901,800	
巴コーポレーション	2,500	400.00	1,000,000	
大和ハウス工業	52,000	3,232.00	168,064,000	
ライト工業	3,300	1,782.00	5,880,600	
積水ハウス	61,100	2,245.50	137,200,050	
日特建設	1,500	827.00	1,240,500	
北陸電気工事	900	1,258.00	1,132,200	
ユアテック	3,300	805.00	2,656,500	
日本リーテック	1,200	2,309.00	2,770,800	
四電工	300	2,963.00	888,900	
中電工	2,600	2,367.00	6,154,200	
関電工	9,200	948.00	8,721,600	
きんでん	12,200	1,829.00	22,313,800	
東京エネシス	1,900	945.00	1,795,500	
トーエネック	500	3,815.00	1,907,500	
住友電設	1,600	2,413.00	3,860,800	
日本電設工業	3,100	2,000.00	6,200,000	
協和エクシオ	8,600	2,768.00	23,804,800	
新日本空調	1,500	2,324.00	3,486,000	
日本工営	1,000	3,030.00	3,030,000	
九電工	3,900	3,700.00	14,430,000	
三機工業	4,000	1,423.00	5,692,000	
日揮ホールディングス	18,800	1,356.00	25,492,800	
中外炉工業	600	2,079.00	1,247,400	
ヤマト	1,800	670.00	1,206,000	
太平電業	1,300	2,704.00	3,515,200	
高砂熱学工業	5,000	1,724.00	8,620,000	
三晃金属工業	200	3,080.00	616,000	
NECネットエスアイ	5,800	1,838.00	10,660,400	
朝日工業社	400	3,075.00	1,230,000	
明星工業	3,700	814.00	3,011,800	
大気社	2,700	2,918.00	7,878,600	
ダイダン	1,300	2,944.00	3,827,200	
日比谷総合設備	1,900	1,899.00	3,608,100	
ニッポン	5,200	1,668.00	8,673,600	
日清製粉グループ本社	20,300	1,900.00	38,570,000	
日東富士製粉	100	7,120.00	712,000	
昭和産業	1,600	3,250.00	5,200,000	
鳥越製粉	1,600	869.00	1,390,400	
中部飼料	2,200	1,449.00	3,187,800	

フィード・ワン	2,400	926.00	2,222,400	
東洋精糖	300	1,198.00	359,400	
日本甜菜製糖	900	1,728.00	1,555,200	
三井製糖	1,500	2,020.00	3,030,000	
塩水港精糖	2,200	243.00	534,600	
日新製糖	800	1,919.00	1,535,200	
L I F U L L	6,300	413.00	2,601,900	
ミクシィ	3,400	2,690.00	9,146,000	
ジェイエシーリクルートメント	1,200	1,638.00	1,965,600	
日本M&Aセンター	14,100	5,680.00	80,088,000	
メンバーズ	500	2,376.00	1,188,000	
中広	200	381.00	76,200	
UTグループ	2,500	3,235.00	8,087,500	
アイティメディア	600	1,789.00	1,073,400	
タケエイ	2,000	1,218.00	2,436,000	
E・Jホールディングス	600	1,040.00	624,000	
ビーネックスグループ	2,300	1,569.00	3,608,700	
コシダカホールディングス	4,500	565.00	2,542,500	
アルトナー	400	871.00	348,400	
パソナグループ	1,900	1,759.00	3,342,100	
C D S	400	1,428.00	571,200	
リンクアンドモチベーション	3,300	547.00	1,805,100	
G C A	2,300	773.00	1,777,900	
エス・エム・エス	5,800	3,150.00	18,270,000	
サニーサイドアップグループ	700	737.00	515,900	
パーソルホールディングス	17,200	2,156.00	37,083,200	
リニカル	900	811.00	729,900	
クックパッド	5,300	331.00	1,754,300	
エスクリ	700	503.00	352,100	
アイ・ケイ・ケイ	800	644.00	515,200	
森永製菓	4,200	3,910.00	16,422,000	
中村屋	400	4,095.00	1,638,000	
江崎グリコ	4,900	4,510.00	22,099,000	
名糖産業	800	1,562.00	1,249,600	
井村屋グループ	1,000	2,636.00	2,636,000	
不二家	1,200	2,313.00	2,775,600	
山崎製パン	13,500	1,879.00	25,366,500	
第一屋製パン	300	979.00	293,700	
モロゾフ	300	5,720.00	1,716,000	
亀田製菓	1,000	4,795.00	4,795,000	
寿スピリッツ	1,800	7,230.00	13,014,000	
カルビー	8,200	2,829.00	23,197,800	
森永乳業	3,400	5,020.00	17,068,000	
六甲バター	1,300	1,711.00	2,224,300	
ヤクルト本社	12,400	5,670.00	70,308,000	
明治ホールディングス	11,900	7,060.00	84,014,000	
雪印メグミルク	4,300	2,279.00	9,799,700	
プリマハム	2,600	3,415.00	8,879,000	
日本ハム	6,900	4,900.00	33,810,000	
丸大食品	1,800	1,749.00	3,148,200	



S Foods	1,700	3,410.00	5,797,000	
柿安本店	600	2,520.00	1,512,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	11,500	760.00	8,740,000	
学情	600	1,400.00	840,000	
スタジオアリス	800	2,104.00	1,683,200	
クロスキャット	400	1,151.00	460,400	
シミックホールディングス	800	1,591.00	1,272,800	
エブコ	400	943.00	377,200	
システナ	6,300	1,948.00	12,272,400	
N J S	400	1,962.00	784,800	
デジタルアーツ	1,000	9,790.00	9,790,000	
日鉄ソリューションズ	2,700	3,470.00	9,369,000	
総合警備保障	6,800	5,040.00	34,272,000	
キューブシステム	900	1,092.00	982,800	
いちご	21,800	336.00	7,324,800	
エイジア	300	1,728.00	518,400	
日本駐車場開発	17,500	150.00	2,625,000	
コア	700	1,504.00	1,052,800	
カカクコム	12,700	3,260.00	41,402,000	
アイロムグループ	600	1,864.00	1,118,400	
セントケア・ホールディング	1,300	1,033.00	1,342,900	
サイネックス	300	719.00	215,700	
ルネサンス	1,500	1,187.00	1,780,500	
ディップ	2,700	2,844.00	7,678,800	
S B Sホールディングス	1,400	2,562.00	3,586,800	
デジタルホールディングス	1,300	1,897.00	2,466,100	
新日本科学	2,100	646.00	1,356,600	
ツクイホールディングス	4,000	922.00	3,688,000	
キャリアデザインセンター	400	1,022.00	408,800	
ベネフィット・ワン	6,200	2,736.00	16,963,200	
エムスリー	30,300	7,264.00	220,099,200	
ツカダ・グローバルホールディング	1,800	333.00	599,400	
アウトソーシング	9,900	1,604.00	15,879,600	
ウェルネット	2,000	537.00	1,074,000	
ワールドホールディングス	600	2,673.00	1,603,800	
ディー・エヌ・エー	7,200	2,156.00	15,523,200	
博報堂D Yホールディングス	23,900	1,887.00	45,099,300	
ぐるなび	3,300	629.00	2,075,700	
タカミヤ	2,100	565.00	1,186,500	
ジャパンベストレスキューシステム	1,400	867.00	1,213,800	
ファンコミュニケーションズ	4,700	404.00	1,898,800	
ライク	400	1,848.00	739,200	
ビジネス・ブレークスルー	700	448.00	313,600	
エスプール	4,500	925.00	4,162,500	
W D Bホールディングス	800	2,507.00	2,005,600	
手間いらず	200	5,260.00	1,052,000	
ティア	1,000	511.00	511,000	
C D G	200	1,585.00	317,000	
アドウェイズ	2,100	742.00	1,558,200	
バリューコマース	1,200	3,260.00	3,912,000	

インフォマート	17,400	886.00	15,416,400
サッポロホールディングス	6,100	2,414.00	14,725,400
アサヒグループホールディングス	39,400	4,891.00	192,705,400
麒麟ホールディングス	76,500	2,154.00	164,781,000
宝ホールディングス	13,300	1,544.00	20,535,200
オエノンホールディングス	5,100	408.00	2,080,800
養命酒製造	500	1,961.00	980,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	13,700	1,951.00	26,728,700
サントリー食品インターナショナル	12,100	4,015.00	48,581,500
ダイドーグループホールディングス	1,000	5,560.00	5,560,000
伊藤園	5,500	6,800.00	37,400,000
キーコーヒー	1,800	2,258.00	4,064,400
ユニカフェ	500	1,024.00	512,000
ジャパンフーズ	200	1,294.00	258,800
日清オイリオグループ	2,300	3,350.00	7,705,000
不二製油グループ本社	4,300	3,040.00	13,072,000
かどや製油	200	4,245.00	849,000
J-オイルミルズ	800	4,015.00	3,212,000
ローソン	4,400	5,280.00	23,232,000
サンエー	1,400	4,510.00	6,314,000
カワチ薬品	1,300	2,860.00	3,718,000
エービーシー・マート	2,800	6,440.00	18,032,000
ハードオフコーポレーション	800	839.00	671,200
高千穂交易	700	1,235.00	864,500
アスクル	1,600	3,360.00	5,376,000
ゲオホールディングス	2,400	1,235.00	2,964,000
アダストリア	2,500	1,918.00	4,795,000
ジーフット	1,400	409.00	572,600
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	300	414.00	124,200
オルバヘルスケアホールディングス	300	1,561.00	468,300
伊藤忠食品	400	5,520.00	2,208,000
くら寿司	1,000	6,900.00	6,900,000
キャンドゥ	800	1,925.00	1,540,000
エレマテック	1,500	1,010.00	1,515,000
アイケイ	400	809.00	323,600
パルグループホールディングス	1,700	1,567.00	2,663,900
JALUX	600	1,681.00	1,008,600
エディオン	7,400	1,157.00	8,561,800
あらた	1,500	4,765.00	7,147,500
サーラコーポレーション	3,700	605.00	2,238,500
ワッツ	800	892.00	713,600
トーマンデバイス	200	4,060.00	812,000
ハローズ	600	2,874.00	1,724,400
J Pホールディングス	4,800	282.00	1,353,600
フジオフードグループ本社	1,700	1,358.00	2,308,600
あみやき亭	400	3,030.00	1,212,000
東京エレクトロン デバイス	600	3,680.00	2,208,000
フィールズ	1,900	567.00	1,077,300
双日	97,700	305.00	29,798,500

アルフレッサ ホールディングス	18,200	2,024.00	36,836,800
大黒天物産	400	6,310.00	2,524,000
ハニーズホールディングス	1,500	1,054.00	1,581,000
ファーマライズホールディングス	400	785.00	314,000
キッコーマン	12,900	6,880.00	88,752,000
味の素	42,900	2,276.00	97,640,400
ブルドックソース	800	2,602.00	2,081,600
キュービー	10,100	2,424.00	24,482,400
ハウス食品グループ本社	6,700	3,600.00	24,120,000
カゴメ	7,300	3,400.00	24,820,000
焼津水産化学工業	800	1,023.00	818,400
アリアケジャパン	1,700	6,480.00	11,016,000
ピエトロ	200	1,812.00	362,400
エバラ食品工業	400	2,717.00	1,086,800
やまみ	200	2,184.00	436,800
ニチレイ	8,600	2,943.00	25,309,800
横浜冷凍	4,600	948.00	4,360,800
東洋水産	9,300	4,615.00	42,919,500
イトアンドホールディングス	600	1,910.00	1,146,000
大冷	200	1,956.00	391,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,000	893.00	893,000
日清食品ホールディングス	7,000	7,900.00	55,300,000
永谷園ホールディングス	900	2,419.00	2,177,100
一正蒲鉾	700	1,246.00	872,200
フジッコ	2,000	2,005.00	4,010,000
ロック・フィールド	2,000	1,643.00	3,286,000
日本たばこ産業	96,700	2,027.50	196,059,250
ケンコーマヨネーズ	1,200	2,016.00	2,419,200
わらべや日洋ホールディングス	1,200	1,675.00	2,010,000
なとり	1,000	2,015.00	2,015,000
イフジ産業	300	946.00	283,800
ピククルスコーポレーション	400	3,320.00	1,328,000
北の達人コーポレーション	6,300	647.00	4,076,100
ユーグレナ	7,800	911.00	7,105,800
スター・マイカ・ホールディングス	900	1,245.00	1,120,500
SREホールディングス	200	4,290.00	858,000
ADワークスグループ	3,500	158.00	553,000
片倉工業	2,400	1,386.00	3,326,400
グンゼ	1,300	4,005.00	5,206,500
ヒューリック	37,500	1,218.00	45,675,000
ラサ商事	900	920.00	828,000
アルペン	1,400	2,294.00	3,211,600
ハブ	700	680.00	476,000
ラクーンホールディングス	1,300	1,807.00	2,349,100
クオールホールディングス	2,400	1,579.00	3,789,600
アルコニックス	1,900	1,693.00	3,216,700
神戸物産	12,200	2,856.00	34,843,200
ソリトンシステムズ	900	1,624.00	1,461,600
ジンズホールディングス	900	7,340.00	6,606,000
ビックカメラ	10,500	1,162.00	12,201,000

DCMホールディングス	10,900	1,105.00	12,044,500
ハイパー	300	518.00	155,400
Monotaro	12,600	5,730.00	72,198,000
あいホールディングス	2,500	2,152.00	5,380,000
ディーブイエックス	500	1,124.00	562,000
きちりホールディングス	500	635.00	317,500
アークランドサービスホールディングス	1,500	2,085.00	3,127,500
J.フロントリテイリング	21,100	1,135.00	23,948,500
ドトール・日レスホールディングス	3,100	1,738.00	5,387,800
マツモトキヨシホールディングス	7,300	4,965.00	36,244,500
ブロンコビリー	900	2,381.00	2,142,900
ZOZO	10,500	3,210.00	33,705,000
トレジャー・ファクトリー	600	924.00	554,400
物語コーポレーション	1,000	6,620.00	6,620,000
ココカラファイン	1,600	8,570.00	13,712,000
三越伊勢丹ホールディングス	30,900	845.00	26,110,500
東洋紡	6,900	1,476.00	10,184,400
ユニチカ	5,100	437.00	2,228,700
富士紡ホールディングス	800	4,035.00	3,228,000
日清紡ホールディングス	10,900	844.00	9,199,600
倉敷紡績	1,700	1,958.00	3,328,600
ダイワボウホールディングス	1,700	8,150.00	13,855,000
シキボウ	1,000	1,007.00	1,007,000
日東紡績	2,700	4,140.00	11,178,000
トヨタ紡織	5,200	1,797.00	9,344,400
マクニカ・富士エレホールディングス	4,200	2,135.00	8,967,000
Hamee	400	1,611.00	644,400
ラクト・ジャパン	700	2,809.00	1,966,300
ウエルシアホールディングス	9,300	3,590.00	33,387,000
クリエイトSDホールディングス	2,600	3,440.00	8,944,000
グリムス	400	1,793.00	717,200
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,100	805.00	2,495,500
八洲電機	1,400	992.00	1,388,800
メディアスホールディングス	1,000	905.00	905,000
レスターホールディングス	1,900	2,081.00	3,953,900
ジューテックホールディングス	400	1,122.00	448,800
丸善CHIホールディングス	2,100	375.00	787,500
大光	700	685.00	479,500
OCHIホールディングス	500	1,407.00	703,500
TOKAIホールディングス	8,600	949.00	8,161,400
黒谷	600	783.00	469,800
ミサワ	300	673.00	201,900
ティーライフ	300	1,362.00	408,600
Cominix	300	806.00	241,800
三洋貿易	1,800	1,121.00	2,017,800
チムニー	700	1,387.00	970,900
シュッピン	1,500	1,010.00	1,515,000
ビューティガレージ	300	2,699.00	809,700

オイシックス・ラ・大地	1,800	2,590.00	4,662,000	
ウイン・パートナーズ	1,300	1,097.00	1,426,100	
ネクステージ	3,000	1,616.00	4,848,000	
ジョイフル本田	5,100	1,404.00	7,160,400	
鳥貴族ホールディングス	700	1,677.00	1,173,900	
ホットランド	1,400	1,239.00	1,734,600	
すかいらーくホールディングス	19,800	1,689.00	33,442,200	
SFPホールディングス	1,200	1,421.00	1,705,200	
綿半ホールディングス	1,400	1,311.00	1,835,400	
日本毛織	5,800	976.00	5,660,800	
トーア紡コーポレーション	700	486.00	340,200	
ダイドーリミテッド	2,300	193.00	443,900	
ヨシックス	400	2,276.00	910,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,100	1,109.00	5,655,900	
三栄建築設計	700	1,700.00	1,190,000	
野村不動産ホールディングス	10,800	2,570.00	27,756,000	
三重交通グループホールディングス	3,700	499.00	1,846,300	
サムティ	2,500	1,924.00	4,810,000	
ディア・ライフ	2,700	440.00	1,188,000	
コーセーアールイー	700	625.00	437,500	
日本商業開発	1,200	1,673.00	2,007,600	
プレサンスコーポレーション	2,900	1,559.00	4,521,100	
フィル・カンパニー	400	2,062.00	824,800	
ハウスコム	300	1,306.00	391,800	
日本管理センター	900	1,235.00	1,111,500	
サンセイランディック	500	825.00	412,500	
エストラスト	200	702.00	140,400	
フージャースホールディングス	2,900	683.00	1,980,700	
オープンハウス	5,600	4,510.00	25,256,000	
東急不動産ホールディングス	48,100	700.00	33,670,000	
飯田グループホールディングス	14,800	2,668.00	39,486,400	
イーランド	300	936.00	280,800	
ムゲンエステート	1,500	504.00	756,000	
帝国繊維	2,000	2,153.00	4,306,000	
日本コークス工業	15,200	108.00	1,641,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	900	1,192.00	1,072,800	
ミタチ産業	500	600.00	300,000	
B E E N O S	800	2,642.00	2,113,600	
あさひ	1,400	1,525.00	2,135,000	
日本調剤	1,000	1,748.00	1,748,000	
コスモス薬品	1,800	16,400.00	29,520,000	
シップヘルスケアホールディングス	3,100	6,040.00	18,724,000	
トーエル	800	936.00	748,800	
ソフトクリエイイトホールディングス	700	2,495.00	1,746,500	
オンリー	400	470.00	188,000	
セブン&アイ・ホールディングス	69,200	4,384.00	303,372,800	
明治電機工業	600	1,434.00	860,400	
ツルハホールディングス	3,800	14,350.00	54,530,000	
デリカフーズホールディングス	700	632.00	442,400	

スターティアホールディングス	300	1,068.00	320,400	
サンマルクホールディングス	1,800	1,744.00	3,139,200	
フェリシモ	400	1,302.00	520,800	
トリドールホールディングス	4,400	1,699.00	7,475,600	
帝人	16,600	1,945.00	32,287,000	
東レ	127,400	703.60	89,638,640	
クラレ	27,700	1,279.00	35,428,300	
旭化成	116,600	1,227.50	143,126,500	
サカイオーベックス	500	2,999.00	1,499,500	
TOKYO BASE	1,900	765.00	1,453,500	
稲葉製作所	1,000	1,432.00	1,432,000	
宮地エンジニアリンググループ	600	2,330.00	1,398,000	
トーカロ	4,500	1,350.00	6,075,000	
アルファ	600	1,234.00	740,400	
SUMCO	22,800	2,361.00	53,830,800	
川田テクノロジーズ	400	4,690.00	1,876,000	
RS Technologies	600	5,770.00	3,462,000	
ジェイテックコーポレーション	100	3,255.00	325,500	
信和	900	879.00	791,100	
ピーロット	1,000	679.00	679,000	
ファーストブラザーズ	400	973.00	389,200	
ハウズドゥ	1,200	1,182.00	1,418,400	
シーアールイー	400	1,218.00	487,200	
プロパティエージェント	300	1,828.00	548,400	
ケイアイスター不動産	500	4,115.00	2,057,500	
アグレ都市デザイン	300	897.00	269,100	
グッドコムアセット	900	1,497.00	1,347,300	
ジェイ・エス・ビー	300	3,435.00	1,030,500	
テンポイノベーション	600	970.00	582,000	
住江織物	400	2,163.00	865,200	
日本フェルト	1,000	458.00	458,000	
イチカワ	200	1,372.00	274,400	
日東製網	200	1,617.00	323,400	
芦森工業	300	1,111.00	333,300	
アツギ	1,400	560.00	784,000	
ウイルプラスホールディングス	300	1,211.00	363,300	
JMホールディングス	1,400	2,138.00	2,993,200	
コメダホールディングス	3,800	1,982.00	7,531,600	
サツドラホールディングス	300	2,086.00	625,800	
アレンザホールディングス	1,000	1,270.00	1,270,000	
串カツ田中ホールディングス	600	1,940.00	1,164,000	
バロックジャパンリミテッド	1,600	789.00	1,262,400	
クスリのアオキホールディングス	1,800	8,300.00	14,940,000	
ダイニック	600	855.00	513,000	
共和レザー	900	690.00	621,000	
ピーバンドットコム	300	805.00	241,500	
力の源ホールディングス	1,000	612.00	612,000	
スシローグローバルホールディングス	9,800	4,570.00	44,786,000	
アセンテック	400	1,746.00	698,400	
セーレン	4,300	1,937.00	8,329,100	

ソトー	700	824.00	576,800	
東海染工	200	1,126.00	225,200	
小松マテール	2,900	999.00	2,897,100	
ワコールホールディングス	4,300	2,385.00	10,255,500	
ホギメディカル	2,400	3,415.00	8,196,000	
クラウディアホールディングス	400	298.00	119,200	
T S Iホールディングス	5,900	303.00	1,787,700	
マツオカコーポレーション	500	1,945.00	972,500	
ワールド	2,300	1,532.00	3,523,600	
T I S	17,600	2,321.00	40,849,600	
J N Sホールディングス	800	618.00	494,400	
電算システム	600	3,235.00	1,941,000	
グリー	10,800	588.00	6,350,400	
G M Oペパボ	100	6,080.00	608,000	
コーエーテックモホールディングス	3,700	6,130.00	22,681,000	
三菱総合研究所	700	4,210.00	2,947,000	
ボルテージ	600	558.00	334,800	
電算	200	2,601.00	520,200	
A G S	900	827.00	744,300	
ファインデックス	1,500	1,074.00	1,611,000	
ブレインパッド	400	4,760.00	1,904,000	
K L a b	3,300	815.00	2,689,500	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,400	1,177.00	2,824,800	
イーブックイニシアティブジャパン	300	2,498.00	749,400	
ネクソン	44,500	3,385.00	150,632,500	
アイスタイル	6,200	524.00	3,248,800	
エムアップホールディングス	400	2,644.00	1,057,600	
エイチーム	1,300	1,415.00	1,839,500	
エニグモ	1,700	1,197.00	2,034,900	
テクノスジャパン	1,400	671.00	939,400	
コロブラ	5,800	859.00	4,982,200	
ブロードリーフ	8,700	521.00	4,532,700	
クロス・マーケティンググループ	1,000	404.00	404,000	
デジタルハーツホールディングス	800	1,428.00	1,142,400	
システム情報	1,500	1,044.00	1,566,000	
メディアドゥ	600	5,950.00	3,570,000	
じげん	5,000	430.00	2,150,000	
バイキューブ	900	2,529.00	2,276,100	
エンカレッジ・テクノロジー	300	621.00	186,300	
サイバーリンクス	600	1,822.00	1,093,200	
フィックスターズ	2,100	957.00	2,009,700	
C A R T A H O L D I N G S	700	1,571.00	1,099,700	
オブティム	1,300	2,825.00	3,672,500	
セレス	600	4,035.00	2,421,000	
S H I F T	800	11,770.00	9,416,000	
特種東海製紙	1,000	4,915.00	4,915,000	
ティーガイア	1,900	1,888.00	3,587,200	
セック	200	2,841.00	568,200	
日本アジアグループ	1,700	1,159.00	1,970,300	

テクマトリックス	2,700	1,731.00	4,673,700	
プロシップ	500	1,349.00	674,500	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,200	2,167.00	9,101,400	
GMOペイメントゲートウェイ	3,700	13,230.00	48,951,000	
ザッパラス	700	446.00	312,200	
システムリサーチ	500	1,860.00	930,000	
インターネットイニシアティブ	4,600	2,340.00	10,764,000	
さくらインターネット	1,900	675.00	1,282,500	
ヴィンクス	500	1,046.00	523,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	400	7,230.00	2,892,000	
SRAホールディングス	900	2,643.00	2,378,700	
システムインテグレータ	500	627.00	313,500	
朝日ネット	1,500	804.00	1,206,000	
eBASE	2,100	895.00	1,879,500	
アバント	1,900	1,476.00	2,804,400	
アドソル日進	600	2,869.00	1,721,400	
ODKソリューションズ	300	756.00	226,800	
フリービット	1,000	988.00	988,000	
コムチュア	1,700	2,602.00	4,423,400	
サイバーコム	300	1,531.00	459,300	
アステリア	1,300	808.00	1,050,400	
アイル	900	1,578.00	1,420,200	
王子ホールディングス	79,200	704.00	55,756,800	
日本製紙	7,800	1,445.00	11,271,000	
三菱製紙	3,300	374.00	1,234,200	
北越コーポレーション	12,800	531.00	6,796,800	
中越パルプ工業	600	1,230.00	738,000	
大王製紙	8,500	1,936.00	16,456,000	
阿波製紙	600	458.00	274,800	
マークラインズ	700	2,325.00	1,627,500	
メディカル・データ・ビジョン	2,000	1,993.00	3,986,000	
gumi	2,500	871.00	2,177,500	
ショーケース	500	897.00	448,500	
モバイルファクトリー	500	1,125.00	562,500	
テラスカイ	600	3,195.00	1,917,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	800	1,753.00	1,402,400	
PCIホールディングス	600	1,496.00	897,600	
パイプドHD	400	1,540.00	616,000	
アイビーシー	400	988.00	395,200	
ネオジャパン	300	1,714.00	514,200	
PR TIMES	400	3,215.00	1,286,000	
ランドコンピュータ	300	1,139.00	341,700	
ダブルスタンダード	200	3,915.00	783,000	
オーブンドア	1,300	2,142.00	2,784,600	
アカツキ	700	4,225.00	2,957,500	
ベネフィットジャパン	100	1,727.00	172,700	
Ubicomホールディングス	400	2,896.00	1,158,400	



カナミックネットワーク	1,700	725.00	1,232,500	
ノムラシステムコーポレーション	800	321.00	256,800	
レンゴー	18,100	930.00	16,833,000	
トーモク	1,000	1,896.00	1,896,000	
ザ・パック	1,400	2,822.00	3,950,800	
チェンジ	2,500	3,000.00	7,500,000	
シンクロ・フード	1,400	360.00	504,000	
オークネット	900	1,323.00	1,190,700	
キャピタル・アセット・プランニング	200	1,077.00	215,400	
セグエグループ	400	1,201.00	480,400	
エイトレッド	300	2,224.00	667,200	
AOI TYO HOLDINGS	2,300	541.00	1,244,300	
マクロミル	4,300	1,001.00	4,304,300	
ビーグリー	300	1,346.00	403,800	
オロ	500	3,495.00	1,747,500	
ユーザーローカル	300	4,335.00	1,300,500	
テモナ	400	829.00	331,600	
ニーズウェル	300	643.00	192,900	
サインポスト	500	1,108.00	554,000	
昭和電工	13,300	3,055.00	40,631,500	
住友化学	138,400	555.00	76,812,000	
住友精化	800	4,030.00	3,224,000	
日産化学	9,800	5,840.00	57,232,000	
ラサ工業	600	2,064.00	1,238,400	
クレハ	1,600	7,470.00	11,952,000	
多木化学	700	6,280.00	4,396,000	
テイカ	1,300	1,492.00	1,939,600	
石原産業	3,300	922.00	3,042,600	
片倉コープアグリ	400	1,372.00	548,800	
日本曹達	2,500	3,515.00	8,787,500	
東ソー	27,200	2,165.00	58,888,000	
トクヤマ	5,200	2,716.00	14,123,200	
セントラル硝子	3,400	2,338.00	7,949,200	
東亜合成	10,800	1,267.00	13,683,600	
大阪ソーダ	1,800	2,686.00	4,834,800	
関東電化工業	4,100	908.00	3,722,800	
デンカ	6,400	4,200.00	26,880,000	
イビデン	8,700	4,525.00	39,367,500	
信越化学工業	32,600	17,510.00	570,826,000	
日本カーバイド工業	600	1,396.00	837,600	
堺化学工業	1,300	2,101.00	2,731,300	
第一稀元素化学工業	1,800	1,160.00	2,088,000	
エア・ウォーター	17,900	1,924.00	34,439,600	
日本酸素ホールディングス	14,500	2,015.00	29,217,500	
日本化学工業	500	3,035.00	1,517,500	
東邦アセチレン	300	1,319.00	395,700	
日本パーカライジング	8,900	1,159.00	10,315,100	
高圧ガス工業	2,800	740.00	2,072,000	
チタン工業	200	2,009.00	401,800	
四国化成工業	2,400	1,243.00	2,983,200	

戸田工業	400	2,127.00	850,800	
ステラ ケミファ	900	3,265.00	2,938,500	
保土谷化学工業	500	4,435.00	2,217,500	
日本触媒	3,300	6,110.00	20,163,000	
大日精化工業	1,500	2,462.00	3,693,000	
カネカ	4,500	4,545.00	20,452,500	
協和キリン	18,100	3,200.00	57,920,000	
三菱瓦斯化学	17,600	2,549.00	44,862,400	
三井化学	15,200	3,680.00	55,936,000	
J S R	17,700	3,335.00	59,029,500	
東京応化工業	3,000	6,150.00	18,450,000	
大阪有機化学工業	1,700	3,420.00	5,814,000	
三菱ケミカルホールディングス	117,600	811.90	95,479,440	
K Hネオケム	2,900	2,662.00	7,719,800	
ダイセル	23,700	820.00	19,434,000	
住友ベークライト	2,800	4,435.00	12,418,000	
積水化学工業	37,200	2,100.00	78,120,000	
日本ゼオン	15,800	1,597.00	25,232,600	
アイカ工業	4,800	3,925.00	18,840,000	
宇部興産	8,900	2,369.00	21,084,100	
積水樹脂	2,900	2,076.00	6,020,400	
タキロンシーアイ	3,800	700.00	2,660,000	
旭有機材	1,000	1,490.00	1,490,000	
ニチバン	900	2,007.00	1,806,300	
リケンテクノス	4,200	515.00	2,163,000	
大倉工業	800	2,025.00	1,620,000	
積水化成成品工業	2,400	585.00	1,404,000	
群栄化学工業	400	2,545.00	1,018,000	
タイガースポリマー	900	477.00	429,300	
ミライアル	500	1,184.00	592,000	
ダイキアクシス	600	943.00	565,800	
ダイキョーニシカワ	3,700	786.00	2,908,200	
竹本容器	600	858.00	514,800	
森六ホールディングス	900	2,257.00	2,031,300	
恵和	200	2,040.00	408,000	
日本化薬	10,900	1,085.00	11,826,500	
カーリットホールディングス	1,800	706.00	1,270,800	
E P Sホールディングス	2,300	1,110.00	2,553,000	
ソルクシーズ	700	922.00	645,400	
レグス	400	1,642.00	656,800	
プレステージ・インターナショナル	6,400	796.00	5,094,400	
フェイス	500	799.00	399,500	
プロトコーポレーション	1,600	1,161.00	1,857,600	
アミューズ	900	2,679.00	2,411,100	
野村総合研究所	32,200	3,180.00	102,396,000	
ドリームインキュベータ	600	1,176.00	705,600	
サイバネットシステム	1,300	826.00	1,073,800	
クイック	1,000	1,177.00	1,177,000	
T A C	900	259.00	233,100	
C Eホールディングス	900	541.00	486,900	

日本システム技術	300	1,404.00	421,200	
電通グループ	19,300	4,035.00	77,875,500	
インテージホールディングス	2,200	1,281.00	2,818,200	
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,000	916.00	916,000	
東邦システムサイエンス	500	939.00	469,500	
イオンファンタジー	700	2,354.00	1,647,800	
ソースネクスト	8,800	346.00	3,044,800	
シーティーエス	2,000	852.00	1,704,000	
ネクシィーズグループ	700	979.00	685,300	
インフォコム	1,700	2,684.00	4,562,800	
メディカルシステムネットワーク	1,600	730.00	1,168,000	
日本精化	1,300	1,504.00	1,955,200	
扶桑化学工業	1,400	3,795.00	5,313,000	
トリケミカル研究所	1,700	3,520.00	5,984,000	
HEROZ	600	3,075.00	1,845,000	
ラクスル	1,500	3,795.00	5,692,500	
I P S	300	3,030.00	909,000	
F I G	1,900	264.00	501,600	
システムサポート	500	1,538.00	769,000	
A D E K A	8,100	2,112.00	17,107,200	
日油	6,600	5,590.00	36,894,000	
ミヨシ油脂	600	1,229.00	737,400	
新日本理化	2,900	265.00	768,500	
ハリマ化成グループ	1,400	956.00	1,338,400	
イーソル	1,000	1,274.00	1,274,000	
アルテリア・ネットワークス	2,000	1,596.00	3,192,000	
E D U L A B	200	7,570.00	1,514,000	
東海ソフト	200	1,150.00	230,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,857.00	742,800	
東名	100	1,150.00	115,000	
ヴィッツ	100	2,082.00	208,200	
トピラシステムズ	200	1,543.00	308,600	
S a n s a n	1,200	8,670.00	10,404,000	
L i n k - U	100	1,403.00	140,300	
ギフトィ	800	3,800.00	3,040,000	
花王	43,000	7,221.00	310,503,000	
第一工業製薬	600	3,605.00	2,163,000	
石原ケミカル	400	2,206.00	882,400	
日華化学	600	913.00	547,800	
ニイタカ	400	2,660.00	1,064,000	
三洋化成工業	1,000	5,600.00	5,600,000	
ベース	100	5,460.00	546,000	
武田薬品工業	149,500	3,997.00	597,551,500	
アステラス製薬	155,700	1,852.00	288,356,400	
大日本住友製薬	13,300	1,972.00	26,227,600	
塩野義製薬	22,500	5,925.00	133,312,500	
わかもと製薬	2,200	246.00	541,200	
あすか製薬	2,100	1,422.00	2,986,200	
日本新薬	5,000	7,690.00	38,450,000	

Bioフェルミン製薬	300	2,575.00	772,500	
中外製薬	56,100	4,505.00	252,730,500	
科研製薬	3,100	4,455.00	13,810,500	
エーザイ	19,800	7,387.00	146,262,600	
理研ビタミン	1,700	1,375.00	2,337,500	
ロート製薬	8,600	2,946.00	25,335,600	
小野薬品工業	41,200	2,836.50	116,863,800	
久光製薬	5,200	6,900.00	35,880,000	
有機合成薬品工業	1,400	290.00	406,000	
持田製薬	2,500	4,320.00	10,800,000	
参天製薬	31,300	1,446.00	45,259,800	
扶桑薬品工業	600	2,594.00	1,556,400	
日本ケミファ	200	2,368.00	473,600	
ツムラ	6,000	3,600.00	21,600,000	
日医工	5,000	952.00	4,760,000	
テルモ	55,000	4,187.00	230,285,000	
H.U.グループホールディングス	4,700	3,400.00	15,980,000	
キッセイ薬品工業	3,300	2,276.00	7,510,800	
生化学工業	3,300	1,050.00	3,465,000	
栄研化学	3,300	2,103.00	6,939,900	
日水製薬	600	988.00	592,800	
鳥居薬品	1,200	2,987.00	3,584,400	
JCRファーマ	5,000	3,525.00	17,625,000	
東和薬品	2,600	2,315.00	6,019,000	
富士製薬工業	1,300	1,338.00	1,739,400	
沢井製薬	3,900	5,140.00	20,046,000	
ゼリア新薬工業	3,400	2,134.00	7,255,600	
第一三共	154,200	3,200.00	493,440,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,900	1,971.00	7,686,900	
大幸薬品	2,200	1,303.00	2,866,600	
ダイト	1,200	3,540.00	4,248,000	
大塚ホールディングス	37,300	4,575.00	170,647,500	
大正製薬ホールディングス	4,200	7,130.00	29,946,000	
ペプチドリーム	9,100	4,910.00	44,681,000	
大日本塗料	2,000	925.00	1,850,000	
日本ペイントホールディングス	14,500	8,050.00	116,725,000	
関西ペイント	19,700	2,740.00	53,978,000	
神東塗料	1,400	202.00	282,800	
中国塗料	4,200	957.00	4,019,400	
日本特殊塗料	1,400	1,117.00	1,563,800	
藤倉化成	2,400	537.00	1,288,800	
太陽ホールディングス	1,400	5,900.00	8,260,000	
DIC	7,400	2,880.00	21,312,000	
サカタインクス	3,800	1,086.00	4,126,800	
東洋インキSCホールディングス	3,700	1,917.00	7,092,900	
T&K TOKA	1,400	866.00	1,212,400	
アルプス技研	1,600	2,042.00	3,267,200	
ダイオーズ	300	988.00	296,400	
日本空調サービス	1,800	743.00	1,337,400	
オリエンタルランド	18,200	17,235.00	313,677,000	

フォーカスシステムズ	1,200	942.00	1,130,400
ダスキン	3,900	2,860.00	11,154,000
パーク24	9,500	2,302.00	21,869,000
明光ネットワークジャパン	2,200	580.00	1,276,000
ファルコホールディングス	800	1,623.00	1,298,400
クレスコ	1,300	1,514.00	1,968,200
フジ・メディア・ホールディングス	18,200	1,390.00	25,298,000
ラウンドワン	5,900	1,206.00	7,115,400
リゾートトラスト	7,900	1,830.00	14,457,000
オービック	5,600	18,730.00	104,888,000
ジャストシステム	2,500	5,890.00	14,725,000
TDCソフト	1,600	976.00	1,561,600
Zホールディングス	242,100	607.90	147,172,590
ビー・エム・エル	2,200	3,565.00	7,843,000
トレンドマイクロ	9,400	5,250.00	49,350,000
りらいあコミュニケーションズ	2,600	1,482.00	3,853,200
IDホールディングス	600	1,298.00	778,800
リソー教育	8,700	319.00	2,775,300
日本オラクル	3,700	11,430.00	42,291,000
早稲田アカデミー	600	965.00	579,000
アルファシステムズ	500	3,615.00	1,807,500
フューチャー	2,200	1,817.00	3,997,400
CAC Holdings	1,200	1,446.00	1,735,200
S Bテクノロジー	600	3,090.00	1,854,000
トーセ	500	815.00	407,500
ユー・エス・エス	19,200	1,973.00	37,881,600
オービックビジネスコンサルタント	1,800	6,040.00	10,872,000
伊藤忠テクノソリューションズ	8,100	3,235.00	26,203,500
アイティフォー	2,300	860.00	1,978,000
東京個別指導学院	1,600	621.00	993,600
東計電算	300	4,320.00	1,296,000
サイバーエージェント	10,600	6,130.00	64,978,000
楽天	80,000	1,121.00	89,680,000
エクスネット	300	1,038.00	311,400
クリーク・アンド・リバー社	900	1,334.00	1,200,600
モーニングスター	1,900	477.00	906,300
テー・オー・ダブリュー	3,500	306.00	1,071,000
大塚商会	9,500	4,910.00	46,645,000
サイボウズ	2,100	2,216.00	4,653,600
山田コンサルティンググループ	1,000	1,027.00	1,027,000
セントラルスポーツ	600	2,546.00	1,527,600
パラカ	400	1,653.00	661,200
電通国際情報サービス	2,200	3,795.00	8,349,000
ACCESS	1,700	824.00	1,400,800
デジタルガレージ	2,900	4,025.00	11,672,500
イーエムシステムズ	2,900	828.00	2,401,200
ウェザーニューズ	500	5,190.00	2,595,000
CIJ	1,300	897.00	1,166,100
ビジネスエンジニアリング	200	3,330.00	666,000
日本エンタープライズ	1,800	241.00	433,800

WOWOW	800	2,910.00	2,328,000	
スカラ	1,700	716.00	1,217,200	
インテリジェント ウェイブ	1,000	672.00	672,000	
フルキャストホールディングス	1,600	1,849.00	2,958,400	
エン・ジャパン	3,100	3,025.00	9,377,500	
富士フイルムホールディングス	31,600	6,299.00	199,048,400	
コニカミノルタ	36,400	587.00	21,366,800	
資生堂	35,700	8,090.00	288,813,000	
ライオン	23,400	2,212.00	51,760,800	
高砂香料工業	1,200	2,600.00	3,120,000	
マンダム	3,700	1,916.00	7,089,200	
ミルボン	2,400	5,960.00	14,304,000	
ファンケル	6,500	3,720.00	24,180,000	
コーセー	3,500	17,930.00	62,755,000	
コタ	1,000	1,713.00	1,713,000	
シーボン	200	2,079.00	415,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	7,700	2,628.00	20,235,600	
ノエビアホールディングス	1,600	5,070.00	8,112,000	
アジュバンコスメジャパン	400	1,143.00	457,200	
新日本製薬	300	2,327.00	698,100	
エステー	1,200	1,968.00	2,361,600	
アグロ カネショウ	600	1,643.00	985,800	
コニシ	3,000	1,715.00	5,145,000	
長谷川香料	3,100	1,964.00	6,088,400	
星光PMC	1,000	752.00	752,000	
小林製薬	5,000	10,180.00	50,900,000	
荒川化学工業	1,500	1,272.00	1,908,000	
メック	1,300	2,140.00	2,782,000	
日本高純度化学	500	2,794.00	1,397,000	
タカラバイオ	4,600	2,905.00	13,363,000	
JCU	2,100	3,790.00	7,959,000	
新田ゼラチン	1,200	705.00	846,000	
OATアグリオ	300	1,464.00	439,200	
デクセリアルズ	4,900	1,660.00	8,134,000	
アース製薬	1,400	6,530.00	9,142,000	
北興化学工業	1,700	1,034.00	1,757,800	
大成ラミック	500	2,963.00	1,481,500	
クミアイ化学工業	7,400	929.00	6,874,600	
日本農薬	3,300	532.00	1,755,600	
富士興産	600	1,388.00	832,800	
ニチレキ	2,200	1,568.00	3,449,600	
ユシロ化学工業	1,000	1,170.00	1,170,000	
ビービー・カストロール	600	1,281.00	768,600	
富士石油	4,500	228.00	1,026,000	
MORESCO	600	1,131.00	678,600	
出光興産	19,900	2,900.00	57,710,000	
ENEOSホールディングス	270,200	494.30	133,559,860	
コスモエネルギーホールディングス	5,700	2,664.00	15,184,800	
横浜ゴム	10,500	1,929.00	20,254,500	
TOYO TIRE	9,400	1,951.00	18,339,400	

ブリヂストン	47,700	4,472.00	213,314,400	
住友ゴム工業	16,200	1,203.00	19,488,600	
藤倉コンポジット	1,600	476.00	761,600	
オカモト	1,200	4,155.00	4,986,000	
アキレス	1,300	1,508.00	1,960,400	
フコク	800	747.00	597,600	
ニッタ	1,900	2,629.00	4,995,100	
クリエートメディック	600	980.00	588,000	
住友理工	3,600	667.00	2,401,200	
三ツ星ベルト	2,200	1,718.00	3,779,600	
バンドー化学	3,300	775.00	2,557,500	
A G C	16,500	4,280.00	70,620,000	
日本板硝子	9,600	588.00	5,644,800	
石塚硝子	300	2,019.00	605,700	
有沢製作所	2,500	1,059.00	2,647,500	
日本山村硝子	700	986.00	690,200	
日本電気硝子	6,600	2,487.00	16,414,200	
オハラ	900	2,005.00	1,804,500	
住友大阪セメント	3,300	3,705.00	12,226,500	
太平洋セメント	10,700	2,752.00	29,446,400	
リソルホールディングス	200	4,370.00	874,000	
日本ヒューム	1,700	775.00	1,317,500	
日本コンクリート工業	3,800	412.00	1,565,600	
三谷セキサン	800	4,230.00	3,384,000	
アジアパイルホールディングス	2,800	515.00	1,442,000	
東海カーボン	17,600	1,700.00	29,920,000	
日本カーボン	1,000	4,200.00	4,200,000	
東洋炭素	1,000	2,015.00	2,015,000	
ノリタケカンパニーリミテド	1,000	3,740.00	3,740,000	
T O T O	12,800	6,430.00	82,304,000	
日本碍子	19,700	2,066.00	40,700,200	
日本特殊陶業	13,600	1,936.00	26,329,600	
M A R U W A	600	10,450.00	6,270,000	
品川リフクトリーズ	400	2,825.00	1,130,000	
黒崎播磨	300	4,755.00	1,426,500	
ヨータイ	1,300	1,039.00	1,350,700	
イソライト工業	800	645.00	516,000	
東京窯業	2,300	329.00	756,700	
ニッカトー	800	751.00	600,800	
フジミインコーポレーテッド	1,500	3,775.00	5,662,500	
クニミネ工業	500	1,252.00	626,000	
エーアンドエーマテリアル	300	1,095.00	328,500	
ニチアス	4,500	2,762.00	12,429,000	
日本製鉄	84,700	1,783.50	151,062,450	
神戸製鋼所	32,500	728.00	23,660,000	
中山製鋼所	2,500	428.00	1,070,000	
合同製鐵	900	2,138.00	1,924,200	
ジェイ エフ イー ホールディングス	51,400	1,251.00	64,301,400	
東京製鐵	6,900	756.00	5,216,400	

共英製鋼	2,000	1,549.00	3,098,000
大和工業	3,700	2,786.00	10,308,200
東京鐵鋼	700	2,022.00	1,415,400
大阪製鐵	900	1,299.00	1,169,100
淀川製鋼所	2,400	2,408.00	5,779,200
丸一鋼管	5,800	2,470.00	14,326,000
モリ工業	500	2,416.00	1,208,000
大同特殊鋼	2,900	4,745.00	13,760,500
日本高周波鋼業	600	365.00	219,000
日本冶金工業	1,400	2,104.00	2,945,600
山陽特殊製鋼	2,200	1,687.00	3,711,400
愛知製鋼	1,000	3,225.00	3,225,000
日立金属	16,800	1,795.00	30,156,000
日本金属	500	1,043.00	521,500
大平洋金属	1,300	2,095.00	2,723,500
新日本電工	11,400	290.00	3,306,000
栗本鐵工所	800	1,775.00	1,420,000
虹 技	200	1,223.00	244,600
日本鑄鉄管	200	1,428.00	285,600
日本製鋼所	5,300	2,730.00	14,469,000
三菱製鋼	1,400	899.00	1,258,600
日亜鋼業	2,600	300.00	780,000
日本精線	200	3,470.00	694,000
エンビプロ・ホールディングス	700	818.00	572,600
大紀アルミニウム工業所	2,700	979.00	2,643,300
日本輕金属ホールディングス	4,800	2,210.00	10,608,000
三井金属鉱業	4,700	3,550.00	16,685,000
東邦亜鉛	1,000	2,363.00	2,363,000
三菱マテリアル	11,600	2,488.00	28,860,800
住友金属鉱山	22,800	4,533.00	103,352,400
D O W Aホールディングス	4,400	4,495.00	19,778,000
古河機械金属	2,900	1,375.00	3,987,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,300	889.00	2,044,700
東邦チタニウム	3,300	941.00	3,105,300
U A C J	2,700	2,552.00	6,890,400
C Kサンエツ	400	3,880.00	1,552,000
古河電気工業	5,500	2,932.00	16,126,000
住友電気工業	62,000	1,684.50	104,439,000
フジクラ	21,400	556.00	11,898,400
昭和電線ホールディングス	1,800	1,650.00	2,970,000
東京特殊電線	200	2,684.00	536,800
タツタ電線	3,100	614.00	1,903,400
カナレ電気	300	1,741.00	522,300
平河ヒューテック	900	1,248.00	1,123,200
リョービ	2,200	1,503.00	3,306,600
アーレスティ	2,200	417.00	917,400
アサヒホールディングス	3,400	3,980.00	13,532,000
東洋製罐グループホールディングス	11,200	1,418.00	15,881,600
ホッカンホールディングス	900	1,548.00	1,393,200
コロナ	900	965.00	868,500



横河ブリッジホールディングス	3,000	1,970.00	5,910,000
OSJBホールディングス	8,200	280.00	2,296,000
駒井ハルテック	300	2,024.00	607,200
高田機工	200	2,750.00	550,000
三和ホールディングス	16,800	1,422.00	23,889,600
文化シャッター	5,200	1,036.00	5,387,200
三協立山	2,300	832.00	1,913,600
アルインコ	1,200	1,014.00	1,216,800
東洋シャッター	400	657.00	262,800
LIXIL	24,500	3,085.00	75,582,500
日本ファイルコン	1,300	506.00	657,800
ノーリツ	3,700	1,688.00	6,245,600
長府製作所	1,800	2,115.00	3,807,000
リンナイ	3,500	11,120.00	38,920,000
ユニプレス	3,300	1,043.00	3,441,900
ダイニチ工業	800	827.00	661,600
日東精工	2,300	603.00	1,386,900
三洋工業	200	1,846.00	369,200
岡部	3,700	794.00	2,937,800
ジーテクト	2,200	1,426.00	3,137,200
東プレ	3,400	1,537.00	5,225,800
高周波熱錬	3,500	564.00	1,974,000
東京製綱	1,400	1,394.00	1,951,600
サンコール	1,600	484.00	774,400
モリテックスチール	1,400	421.00	589,400
パイオラックス	2,600	1,619.00	4,209,400
エイチワン	1,800	771.00	1,387,800
日本発条	17,700	824.00	14,584,800
中央発條	200	3,605.00	721,000
アドバネクス	200	1,598.00	319,600
三浦工業	7,700	5,400.00	41,580,000
タクマ	6,000	2,290.00	13,740,000
テクノプロ・ホールディングス	3,500	7,540.00	26,390,000
アトラ	500	356.00	178,000
インターワークス	500	407.00	203,500
アイ・アールジャパンホールディングス	700	12,870.00	9,009,000
Keeper 技研	1,200	1,911.00	2,293,200
ファーストロジック	300	778.00	233,400
三機サービス	300	1,089.00	326,700
Gunosy	1,200	779.00	934,800
デザインワン・ジャパン	600	235.00	141,000
イー・ガーディアン	700	2,713.00	1,899,100
リブセンス	900	234.00	210,600
ジャパンマテリアル	5,200	1,274.00	6,624,800
ベクトル	2,400	1,172.00	2,812,800
ウチヤマホールディングス	800	402.00	321,600
チャーム・ケア・コーポレーション	1,300	1,310.00	1,703,000
キャリアリンク	500	1,932.00	966,000
IBJ	1,700	1,071.00	1,820,700

アサンテ	600	1,813.00	1,087,800
N・フィールド	1,200	1,197.00	1,436,400
バリューHR	700	1,564.00	1,094,800
M&Aキャピタルパートナーズ	1,500	4,700.00	7,050,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,705.00	1,023,000
E R Iホールディングス	500	619.00	309,500
アビスト	300	2,941.00	882,300
シグマクシス	900	1,704.00	1,533,600
ウィルグループ	1,300	980.00	1,274,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,600	311.00	808,600
メドピア	800	5,670.00	4,536,000
レアジョブ	200	2,052.00	410,400
リクルートホールディングス	122,900	4,919.00	604,545,100
エラン	2,400	1,340.00	3,216,000
ツガミ	3,700	1,600.00	5,920,000
オークマ	2,100	6,430.00	13,503,000
芝浦機械	1,900	2,931.00	5,568,900
アマダ	26,000	1,351.00	35,126,000
アイダエンジニアリング	4,600	953.00	4,383,800
滝澤鉄工所	500	1,097.00	548,500
F U J I	7,100	2,609.00	18,523,900
牧野フライス製作所	2,100	4,445.00	9,334,500
オーエスジー	8,800	1,968.00	17,318,400
ダイジェット工業	200	1,377.00	275,400
旭ダイヤモンド工業	4,600	533.00	2,451,800
D M G森精機	11,200	1,788.00	20,025,600
ソディック	3,800	1,030.00	3,914,000
ディスコ	2,400	32,650.00	78,360,000
日東工器	800	1,875.00	1,500,000
日進工具	700	2,946.00	2,062,200
パンチ工業	1,500	537.00	805,500
富士ダイス	900	685.00	616,500
土木管理総合試験所	800	358.00	286,400
ネットマーケティング	900	587.00	528,300
日本郵政	129,800	976.60	126,762,680
ベルシステム24ホールディングス	2,900	1,824.00	5,289,600
鎌倉新書	1,800	870.00	1,566,000
S M N	400	756.00	302,400
一蔵	200	404.00	80,800
L I T A L I C O	700	3,570.00	2,499,000
グローバルキッズCOMPANY	300	852.00	255,600
エアトリ	1,300	1,997.00	2,596,100
アトラエ	500	2,894.00	1,447,000
ストライク	600	4,310.00	2,586,000
ソラスト	4,200	1,309.00	5,497,800
セラク	500	1,699.00	849,500
インソース	1,500	2,051.00	3,076,500
豊田自動織機	14,600	10,050.00	146,730,000
豊和工業	900	849.00	764,100

OKK	700	479.00	335,300
東洋機械金属	1,300	464.00	603,200
津田駒工業	300	906.00	271,800
エンシュウ	400	918.00	367,200
島精機製作所	2,800	2,521.00	7,058,800
オプトラン	2,300	2,423.00	5,572,900
NCホールディングス	500	665.00	332,500
イワキ	1,200	885.00	1,062,000
フリー	1,800	1,077.00	1,938,600
ヤマシンフィルタ	3,700	868.00	3,211,600
日阪製作所	2,200	855.00	1,881,000
やまびこ	3,500	1,205.00	4,217,500
平田機工	800	6,530.00	5,224,000
ペガサスマシン製造	2,400	460.00	1,104,000
マルマエ	600	1,225.00	735,000
タツモ	700	1,612.00	1,128,400
ナブテスコ	10,500	4,675.00	49,087,500
三井海洋開発	2,200	1,963.00	4,318,600
レオン自動機	1,800	1,143.00	2,057,400
SMC	5,200	60,130.00	312,676,000
ホソカワミクロン	600	6,500.00	3,900,000
ユニオンツール	600	3,405.00	2,043,000
オイレス工業	2,500	1,738.00	4,345,000
日精エー・エス・ピー機械	500	5,180.00	2,590,000
サトーホールディングス	2,400	2,697.00	6,472,800
技研製作所	1,600	4,920.00	7,872,000
日本エアーテック	600	1,221.00	732,600
カワタ	500	877.00	438,500
日精樹脂工業	1,400	932.00	1,304,800
オカダアイヨン	500	1,293.00	646,500
ワイエイシイホールディングス	700	922.00	645,400
小松製作所	81,400	3,343.00	272,120,200
住友重機械工業	10,300	2,993.00	30,827,900
日立建機	8,400	3,485.00	29,274,000
日工	2,700	731.00	1,973,700
巴工業	700	2,086.00	1,460,200
井関農機	1,800	1,662.00	2,991,600
TOWA	1,700	1,882.00	3,199,400
丸山製作所	400	1,714.00	685,600
北川鉄工所	800	1,552.00	1,241,600
シンニッタン	2,200	255.00	561,000
ローツェ	800	6,820.00	5,456,000
タカキタ	600	708.00	424,800
クボタ	94,300	2,488.50	234,665,550
荏原実業	400	4,545.00	1,818,000
三菱化工機	600	2,869.00	1,721,400
月島機械	3,400	1,335.00	4,539,000
帝国電機製作所	1,300	1,314.00	1,708,200
東京機械製作所	900	321.00	288,900
新東工業	4,200	774.00	3,250,800

澁谷工業	1,600	3,405.00	5,448,000
アイチコーポレーション	3,100	928.00	2,876,800
小森コーポレーション	4,500	758.00	3,411,000
鶴見製作所	1,400	1,793.00	2,510,200
住友精密工業	300	2,075.00	622,500
日本ギア工業	700	317.00	221,900
酒井重工業	300	2,144.00	643,200
荏原製作所	7,400	4,220.00	31,228,000
石井鐵工所	200	2,985.00	597,000
西島製作所	1,900	845.00	1,605,500
北越工業	1,900	1,089.00	2,069,100
ダイキン工業	22,900	21,930.00	502,197,000
オルガノ	600	6,240.00	3,744,000
トヨーカネツ	700	2,801.00	1,960,700
栗田工業	9,800	4,460.00	43,708,000
椿本チエイン	2,600	3,240.00	8,424,000
大同工業	800	867.00	693,600
日機装	5,800	1,199.00	6,954,200
木村化工機	1,500	642.00	963,000
レイズネクスト	3,000	1,249.00	3,747,000
アネスト岩田	3,000	1,040.00	3,120,000
ダイフク	10,000	10,110.00	101,100,000
サムコ	400	3,270.00	1,308,000
加藤製作所	900	1,132.00	1,018,800
油研工業	300	1,675.00	502,500
タダノ	8,700	1,221.00	10,622,700
フジテック	6,200	2,421.00	15,010,200
C K D	4,100	2,164.00	8,872,400
キトー	1,600	1,613.00	2,580,800
平和	4,900	1,880.00	9,212,000
理想科学工業	1,400	1,391.00	1,947,400
SANKYO	4,200	2,994.00	12,574,800
日本金銭機械	2,000	576.00	1,152,000
マースグループホールディングス	1,200	1,681.00	2,017,200
フクシマガリレイ	1,300	4,255.00	5,531,500
オーイズミ	700	423.00	296,100
ダイコク電機	800	999.00	799,200
竹内製作所	3,000	2,923.00	8,769,000
アマノ	4,600	2,640.00	12,144,000
JUKI	3,000	866.00	2,598,000
蛇の目ミシン工業	1,700	897.00	1,524,900
ブラザー工業	21,900	2,393.00	52,406,700
マックス	2,500	1,659.00	4,147,500
モリタホールディングス	2,900	1,793.00	5,199,700
グローリー	4,600	2,371.00	10,906,600
新晃工業	1,700	1,999.00	3,398,300
大和冷機工業	2,900	1,040.00	3,016,000
セガサミーホールディングス	16,400	1,723.00	28,257,200
日本ピストンリング	600	1,085.00	651,000
リケン	800	2,413.00	1,930,400

T P R	2,400	1,568.00	3,763,200
ツバキ・ナカシマ	3,700	1,378.00	5,098,600
ホシザキ	5,700	9,640.00	54,948,000
大豊工業	1,500	966.00	1,449,000
日本精工	36,900	1,166.00	43,025,400
NTN	41,500	335.00	13,902,500
ジェイテクト	17,300	1,174.00	20,310,200
不二越	1,700	4,665.00	7,930,500
ミネベアミツミ	30,900	2,741.00	84,696,900
日本トムソン	4,900	628.00	3,077,200
T H K	11,100	3,570.00	39,627,000
ユーシン精機	1,300	940.00	1,222,000
前澤給装工業	600	2,317.00	1,390,200
イーグル工業	2,200	1,161.00	2,554,200
前澤工業	1,000	568.00	568,000
日本ピラー工業	1,900	1,780.00	3,382,000
キッツ	5,600	615.00	3,444,000
日立製作所	86,300	5,230.00	451,349,000
東芝	26,600	3,645.00	96,957,000
三菱電機	179,600	1,666.00	299,213,600
富士電機	10,900	4,490.00	48,941,000
東洋電機製造	800	1,256.00	1,004,800
安川電機	19,300	5,260.00	101,518,000
シンフォニア テクノロジー	2,400	1,311.00	3,146,400
明電舎	3,100	2,347.00	7,275,700
オリジン	500	1,356.00	678,000
山洋電気	900	5,770.00	5,193,000
デンヨー	1,600	2,121.00	3,393,600
ベイカレント・コンサルティング	1,200	23,510.00	28,212,000
Orchestra Holdings	400	2,965.00	1,186,000
アイモバイル	600	1,393.00	835,800
キャリアインデックス	700	628.00	439,600
MS - Japan	800	1,009.00	807,200
船場	300	880.00	264,000
グレイステクノロジー	800	5,290.00	4,232,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	4,900	2,194.00	10,750,600
フルテック	200	1,366.00	273,200
GAMEWITH	500	608.00	304,000
ソウルドアウト	400	1,675.00	670,000
MS&Consulting	300	599.00	179,700
エル・ティー・エス	100	3,395.00	339,500
ミダック	400	4,170.00	1,668,000
日総工産	1,600	831.00	1,329,600
キュービーネットホールディングス	1,000	1,720.00	1,720,000
RPAホールディングス	2,000	633.00	1,266,000
三櫻工業	2,600	1,167.00	3,034,200
マキタ	23,500	4,815.00	113,152,500
東芝テック	2,000	4,160.00	8,320,000

芝浦メカトロニクス	400	5,000.00	2,000,000	
マブチモーター	4,900	5,240.00	25,676,000	
日本電産	43,200	12,485.00	539,352,000	
トレックス・セミコンダクター	1,200	1,589.00	1,906,800	
東光高岳	900	1,521.00	1,368,900	
ダイヘン	2,000	4,555.00	9,110,000	
ヤーマン	2,900	1,701.00	4,932,900	
JVCケンウッド	16,200	236.00	3,823,200	
ミマキエンジニアリング	1,900	608.00	1,155,200	
I-PEX	900	1,997.00	1,797,300	
日新電機	4,600	1,236.00	5,685,600	
大崎電気工業	3,700	607.00	2,245,900	
オムロン	15,000	8,620.00	129,300,000	
日東工業	2,700	2,053.00	5,543,100	
I D E C	2,600	1,782.00	4,633,200	
正興電機製作所	400	1,920.00	768,000	
不二電機工業	300	1,267.00	380,100	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6,400	2,969.00	19,001,600	
サクサホールディングス	400	1,574.00	629,600	
メルコホールディングス	600	3,700.00	2,220,000	
テクノメディカ	400	1,678.00	671,200	
日本電気	22,900	6,300.00	144,270,000	
富士通	16,200	15,695.00	254,259,000	
沖電気工業	7,300	1,128.00	8,234,400	
岩崎通信機	800	932.00	745,600	
電気興業	800	2,874.00	2,299,200	
サンケン電気	2,200	5,180.00	11,396,000	
ナカヨ	300	1,518.00	455,400	
アイホン	1,000	1,821.00	1,821,000	
ルネサスエレクトロニクス	77,200	1,138.00	87,853,600	
セイコーエプソン	22,300	1,883.00	41,990,900	
ワコム	13,000	737.00	9,581,000	
アルパック	3,400	4,460.00	15,164,000	
アクセル	900	797.00	717,300	
E I Z O	1,600	4,085.00	6,536,000	
日本信号	4,300	979.00	4,209,700	
京三製作所	3,800	423.00	1,607,400	
能美防災	2,400	2,325.00	5,580,000	
ホーチキ	1,400	1,387.00	1,941,800	
星和電機	900	618.00	556,200	
エレコム	2,100	4,810.00	10,101,000	
パナソニック	191,500	1,332.50	255,173,750	
シャープ	20,800	1,957.00	40,705,600	
アンリツ	10,800	2,407.00	25,995,600	
富士通ゼネラル	5,500	2,965.00	16,307,500	
ソニー	112,500	11,000.00	1,237,500,000	
T D K	8,700	14,850.00	129,195,000	
帝国通信工業	800	1,150.00	920,000	
タムラ製作所	7,400	509.00	3,766,600	
アルプスアルパイン	14,700	1,588.00	23,343,600	

池上通信機	600	873.00	523,800	
鈴木	800	1,113.00	890,400	
日本トリム	400	4,130.00	1,652,000	
ローランド ディー・ジー	1,200	1,850.00	2,220,000	
フォスター電機	2,200	1,326.00	2,917,200	
S M K	400	2,974.00	1,189,600	
ヨコオ	1,400	2,861.00	4,005,400	
ホシデン	4,800	1,067.00	5,121,600	
ヒロセ電機	2,800	16,640.00	46,592,000	
日本航空電子工業	4,300	1,748.00	7,516,400	
T O A	2,100	955.00	2,005,500	
マクセルホールディングス	3,900	1,482.00	5,779,800	
古野電気	2,300	1,077.00	2,477,100	
ユニデンホールディングス	400	2,632.00	1,052,800	
スミダコーポレーション	1,600	1,113.00	1,780,800	
アイコム	700	2,834.00	1,983,800	
リオン	700	2,800.00	1,960,000	
本多通信工業	1,900	527.00	1,001,300	
船井電機	2,600	655.00	1,703,000	
横河電機	18,000	2,097.00	37,746,000	
新電元工業	900	3,390.00	3,051,000	
アズビル	12,100	4,430.00	53,603,000	
東亜ディーケーケー	900	853.00	767,700	
日本光電工業	7,400	3,210.00	23,754,000	
チノー	500	1,419.00	709,500	
共和電業	1,900	389.00	739,100	
日本電子材料	700	1,715.00	1,200,500	
堀場製作所	3,600	6,890.00	24,804,000	
アドバンテスト	13,300	8,310.00	110,523,000	
小野測器	700	555.00	388,500	
エスベック	1,600	1,802.00	2,883,200	
キーエンス	17,700	49,130.00	869,601,000	
日置電機	800	3,935.00	3,148,000	
シスメックス	14,100	11,085.00	156,298,500	
日本マイクロニクス	3,400	1,551.00	5,273,400	
メガチップス	1,800	3,185.00	5,733,000	
O B A R A G R O U P	1,000	3,795.00	3,795,000	
I M A G I C A G R O U P	2,000	529.00	1,058,000	
澤藤電機	200	2,149.00	429,800	
デンソー	39,500	7,055.00	278,672,500	
原田工業	700	967.00	676,900	
コーセル	2,200	1,105.00	2,431,000	
イリソ電子工業	1,600	5,260.00	8,416,000	
オブテックスグループ	3,300	1,577.00	5,204,100	
千代田インテグレ	900	1,807.00	1,626,300	
アイ・オー・データ機器	600	1,016.00	609,600	
レーザーテック	7,900	12,210.00	96,459,000	
スタンレー電気	12,600	3,360.00	42,336,000	
岩崎電気	700	1,550.00	1,085,000	
ウシオ電機	9,200	1,396.00	12,843,200	

岡谷電機産業	1,300	379.00	492,700
ヘリオス テクノ ホールディング	2,200	360.00	792,000
エノモト	600	1,956.00	1,173,600
日本セラミック	1,900	2,645.00	5,025,500
遠藤照明	900	637.00	573,300
古河電池	1,400	1,680.00	2,352,000
双信電機	1,200	449.00	538,800
山一電機	1,300	1,390.00	1,807,000
図研	1,200	2,690.00	3,228,000
日本電子	3,400	3,835.00	13,039,000
カシオ計算機	14,500	2,121.00	30,754,500
ファナック	15,700	26,255.00	412,203,500
日本シイエムケイ	4,400	480.00	2,112,000
エンプラス	800	4,205.00	3,364,000
大真空	600	2,472.00	1,483,200
ローム	7,400	10,290.00	76,146,000
浜松ホトニクス	12,900	6,150.00	79,335,000
三井ハイテック	1,800	3,625.00	6,525,000
新光電気工業	6,000	2,783.00	16,698,000
京セラ	27,400	7,402.00	202,814,800
協栄産業	200	1,340.00	268,000
太陽誘電	8,000	5,260.00	42,080,000
村田製作所	52,800	9,020.00	476,256,000
双葉電子工業	3,700	995.00	3,681,500
日東電工	11,400	9,150.00	104,310,000
北陸電気工業	700	920.00	644,000
東海理化電機製作所	4,700	1,908.00	8,967,600
ニチコン	5,800	1,063.00	6,165,400
日本ケミコン	2,000	1,793.00	3,586,000
K O A	2,600	1,509.00	3,923,400
日立造船	14,300	819.00	11,711,700
三菱重工業	28,200	3,309.00	93,313,800
川崎重工業	13,900	2,551.00	35,458,900
I H I	12,100	2,091.00	25,301,100
名村造船所	7,000	192.00	1,344,000
サノヤスホールディングス	2,200	152.00	334,400
スプリックス	500	896.00	448,000
マネジメントソリューションズ	800	1,755.00	1,404,000
プロレド・パートナーズ	200	3,255.00	651,000
and factory	200	716.00	143,200
テノ・ホールディングス	200	1,103.00	220,600
フロンティア・マネジメント	300	1,688.00	506,400
ピアラ	100	1,613.00	161,300
コプロ・ホールディングス	100	2,862.00	286,200
ギークス	300	1,455.00	436,500
カーブスホールディングス	4,700	913.00	4,291,100
フォーラムエンジニアリング	900	1,117.00	1,005,300
日本車輛製造	600	2,494.00	1,496,400
三菱ロジスネクスト	2,500	1,242.00	3,105,000
近畿車輛	300	1,304.00	391,200



F P G	6,100	633.00	3,861,300
島根銀行	600	680.00	408,000
じもとホールディングス	1,300	813.00	1,056,900
全国保証	4,600	4,970.00	22,862,000
めぶきフィナンシャルグループ	92,000	255.00	23,460,000
ジャパンインベストメントアドバイザ	1,000	1,293.00	1,293,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,200	1,354.00	2,978,800
九州フィナンシャルグループ	36,200	466.00	16,869,200
かんぼ生命保険	21,900	2,266.00	49,625,400
ゆうちょ銀行	50,100	1,078.00	54,007,800
富山第一銀行	4,200	303.00	1,272,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	107,900	458.00	49,418,200
西日本フィナンシャルホールディングス	11,700	769.00	8,997,300
マーキュリアインベストメント	700	769.00	538,300
イントラスト	500	698.00	349,000
日本モーゲージサービス	900	1,133.00	1,019,700
C A S A	500	1,043.00	521,500
アルヒ	2,800	1,691.00	4,734,800
プレミアグループ	800	2,368.00	1,894,400
日産自動車	211,700	604.60	127,993,820
いすゞ自動車	52,000	1,140.00	59,280,000
トヨタ自動車	182,000	8,128.00	1,479,296,000
日野自動車	22,400	1,033.00	23,139,200
三菱自動車工業	66,500	339.00	22,543,500
エフテック	1,400	697.00	975,800
レシップホールディングス	700	588.00	411,600
G M B	400	953.00	381,200
ファルテック	400	828.00	331,200
武蔵精密工業	4,000	1,860.00	7,440,000
日産車体	2,600	784.00	2,038,400
新明和工業	5,000	1,000.00	5,000,000
極東開発工業	3,100	1,639.00	5,080,900
トビー工業	1,900	1,478.00	2,808,200
ティラド	700	2,052.00	1,436,400
タチエス	2,800	1,127.00	3,155,600
N O K	8,700	1,542.00	13,415,400
フタバ産業	4,400	549.00	2,415,600
K Y B	2,300	2,999.00	6,897,700
市光工業	3,300	760.00	2,508,000
大同メタル工業	3,700	606.00	2,242,200
プレス工業	9,800	328.00	3,214,400
ミクニ	2,300	293.00	673,900
太平洋工業	3,800	1,292.00	4,909,600
河西工業	3,100	430.00	1,333,000
アイシン精機	13,100	3,950.00	51,745,000
マツダ	56,300	913.00	51,401,900
今仙電機製作所	1,600	768.00	1,228,800

本田技研工業	141,500	3,218.00	455,347,000
スズキ	35,600	4,766.00	169,669,600
S U B A R U	51,500	2,149.00	110,673,500
安永	1,000	1,339.00	1,339,000
ヤマハ発動機	25,400	2,569.00	65,252,600
小糸製作所	10,800	7,710.00	83,268,000
T B K	2,200	446.00	981,200
エクセディ	2,800	1,680.00	4,704,000
豊田合成	5,800	2,915.00	16,907,000
愛三工業	3,600	614.00	2,210,400
盟和産業	300	908.00	272,400
日本プラスト	1,900	601.00	1,141,900
ヨロズ	1,800	1,263.00	2,273,400
エフ・シー・シー	2,900	1,831.00	5,309,900
新家工業	400	1,714.00	685,600
シマノ	6,700	24,340.00	163,078,000
テイ・エス テック	4,100	3,305.00	13,550,500
関西みらいフィナンシャルグループ	8,400	637.00	5,350,800
三十三フィナンシャルグループ	1,600	1,423.00	2,276,800
第四北越フィナンシャルグループ	2,900	2,603.00	7,548,700
ひろぎんホールディングス	26,100	684.00	17,852,400
ダイレクトマーケティングミックス	700	3,300.00	2,310,000
ポピンズホールディングス	300	3,170.00	951,000
ジャムコ	1,400	903.00	1,264,200
小野建	1,600	1,353.00	2,164,800
はるやまホールディングス	800	724.00	579,200
南陽	300	1,608.00	482,400
ノジマ	3,100	2,787.00	8,639,700
佐島電機	1,200	791.00	949,200
カップ・クリエイト	2,500	1,588.00	3,970,000
エコートレーディング	400	635.00	254,000
伯東	1,000	1,289.00	1,289,000
コンドーテック	1,400	1,097.00	1,535,800
中山福	1,000	506.00	506,000
ライトオン	1,400	654.00	915,600
ナガイレーベン	2,400	2,747.00	6,592,800
ジーンズメイト	600	300.00	180,000
三菱食品	2,000	3,100.00	6,200,000
良品計画	23,500	2,660.00	62,510,000
三城ホールディングス	2,200	305.00	671,000
松田産業	1,300	1,917.00	2,492,100
第一興商	2,600	4,540.00	11,804,000
メディバルホールディングス	17,700	2,190.00	38,763,000
アドヴァン	1,800	1,016.00	1,828,800
S P K	700	1,292.00	904,400
萩原電気ホールディングス	600	2,720.00	1,632,000
アルビス	500	2,496.00	1,248,000
アズワン	1,300	12,790.00	16,627,000
スズデン	600	1,289.00	773,400
尾家産業	500	1,431.00	715,500

シモジマ	1,000	1,410.00	1,410,000	
ドウシシャ	1,700	1,883.00	3,201,100	
小津産業	400	1,966.00	786,400	
コナカ	2,500	348.00	870,000	
高速	900	1,527.00	1,374,300	
ハウス オブ ローゼ	200	1,719.00	343,800	
G - 7ホールディングス	1,000	2,577.00	2,577,000	
たけびし	600	1,563.00	937,800	
イオン北海道	2,400	1,138.00	2,731,200	
コジマ	3,000	660.00	1,980,000	
ヒマラヤ	600	966.00	579,600	
コーナン商事	2,500	2,974.00	7,435,000	
ネットワンシステムズ	7,200	3,445.00	24,804,000	
エコス	600	1,940.00	1,164,000	
ワタミ	2,900	1,032.00	2,992,800	
マルシェ	600	504.00	302,400	
リックス	400	1,545.00	618,000	
システムソフト	4,800	159.00	763,200	
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	35,300	2,610.00	92,133,000	
丸文	1,600	527.00	843,200	
西松屋チェーン	3,900	1,437.00	5,604,300	
ゼンショーホールディングス	9,500	2,883.00	27,388,500	
ハビネット	1,500	1,609.00	2,413,500	
幸楽苑ホールディングス	1,400	1,802.00	2,522,800	
ハークスレイ	400	914.00	365,600	
橋本総業ホールディングス	300	2,610.00	783,000	
日本ライフライン	5,700	1,394.00	7,945,800	
サイゼリヤ	2,800	2,387.00	6,683,600	
タカショー	1,200	702.00	842,400	
V Tホールディングス	6,600	423.00	2,791,800	
マルカ	600	2,113.00	1,267,800	
アルゴグラフィックス	1,400	2,927.00	4,097,800	
魚力	500	1,901.00	950,500	
I D O M	6,000	602.00	3,612,000	
日本エム・ディ・エム	1,000	2,027.00	2,027,000	
フジ・コーポレーション	500	2,345.00	1,172,500	
ユナイテッドアローズ	2,500	2,072.00	5,180,000	
進和	1,000	2,130.00	2,130,000	
エスケイジャパン	400	459.00	183,600	
ダイトロン	700	1,634.00	1,143,800	
ハイデイ日高	2,800	1,756.00	4,916,800	
シークス	2,300	1,747.00	4,018,100	
京都きもの友禅	1,200	273.00	327,600	
コロワイド	5,900	2,128.00	12,555,200	
ピーシーデポコーポレーション	2,100	516.00	1,083,600	
田中商事	500	703.00	351,500	
オーハシテクニカ	900	1,583.00	1,424,700	
壱番屋	1,300	4,995.00	6,493,500	
白銅	600	1,460.00	876,000	

PLANT	400	740.00	296,000	
スギホールディングス	3,600	7,920.00	28,512,000	
ダイコー通産	200	1,520.00	304,000	
薬王堂ホールディングス	700	2,712.00	1,898,400	
島津製作所	23,200	3,820.00	88,624,000	
JMS	1,600	923.00	1,476,800	
長野計器	1,400	943.00	1,320,200	
ブイ・テクノロジー	800	5,240.00	4,192,000	
スター精密	2,800	1,589.00	4,449,200	
東京計器	1,200	929.00	1,114,800	
愛知時計電機	200	4,380.00	876,000	
インターアクション	900	2,271.00	2,043,900	
オーバル	1,700	288.00	489,600	
東京精密	3,000	4,660.00	13,980,000	
マニー	7,100	2,427.00	17,231,700	
ニコン	27,400	923.00	25,290,200	
トプコン	9,100	1,361.00	12,385,100	
オリンパス	99,300	2,399.50	238,270,350	
理研計器	1,600	2,666.00	4,265,600	
SCREENホールディングス	3,100	8,200.00	25,420,000	
キヤノン電子	1,800	1,703.00	3,065,400	
タムロン	1,500	2,059.00	3,088,500	
HOYA	35,700	11,875.00	423,937,500	
シード	700	623.00	436,100	
ノーリツ鋼機	1,700	2,578.00	4,382,600	
エー・アンド・デイ	1,600	1,206.00	1,929,600	
朝日インテック	18,900	2,977.00	56,265,300	
キヤノン	89,300	2,361.00	210,837,300	
リコー	45,700	1,190.00	54,383,000	
シチズン時計	23,000	413.00	9,499,000	
リズム	500	850.00	425,000	
大研医器	1,500	577.00	865,500	
メニコン	2,800	5,990.00	16,772,000	
シンシア	200	802.00	160,400	
中本パックス	400	1,633.00	653,200	
スノーピーク	1,000	2,961.00	2,961,000	
パラマウントベッドホールディングス	1,800	4,610.00	8,298,000	
トランザクション	900	1,149.00	1,034,100	
粧美堂	500	404.00	202,000	
ニホンフラッシュ	1,600	1,256.00	2,009,600	
前田工織	2,000	2,975.00	5,950,000	
永大産業	2,400	307.00	736,800	
アートネイチャー	1,800	726.00	1,306,800	
バンダイナムコホールディングス	14,900	7,917.00	117,963,300	
アイフィスジャパン	400	765.00	306,000	
共立印刷	3,000	142.00	426,000	
SHOEI	1,600	4,620.00	7,392,000	
フランスベッドホールディングス	2,300	987.00	2,270,100	
マーベラス	2,800	840.00	2,352,000	
パイロットコーポレーション	3,300	3,545.00	11,698,500	

萩原工業	1,000	1,415.00	1,415,000
エイベックス	3,400	1,513.00	5,144,200
トップパン・フォームズ	3,300	1,053.00	3,474,900
フジシールインターナショナル	3,700	2,390.00	8,843,000
タカラトミー	8,100	1,036.00	8,391,600
廣済堂	1,300	975.00	1,267,500
エステールホールディングス	500	682.00	341,000
レック	2,200	1,319.00	2,901,800
タカノ	600	616.00	369,600
三光合成	1,900	443.00	841,700
プロネクス	1,600	1,279.00	2,046,400
ホクシン	1,200	117.00	140,400
ウッドワン	600	1,111.00	666,600
大建工業	1,300	2,096.00	2,724,800
きもと	2,800	207.00	579,600
凸版印刷	27,300	1,851.00	50,532,300
大日本印刷	21,700	2,321.00	50,365,700
共同印刷	500	3,040.00	1,520,000
N I S S H A	3,700	1,324.00	4,898,800
光村印刷	200	1,766.00	353,200
藤森工業	1,700	4,605.00	7,828,500
T A K A R A & C O M P A N Y	900	1,782.00	1,603,800
前澤化成工業	1,200	990.00	1,188,000
未来工業	600	1,724.00	1,034,400
アシックス	15,900	1,799.00	28,604,100
ツツミ	400	2,166.00	866,400
ウェーブロックホールディングス	600	726.00	435,600
J S P	1,000	1,951.00	1,951,000
ニチハ	2,500	3,090.00	7,725,000
ローランド	1,000	4,105.00	4,105,000
エフピコ	3,400	4,520.00	15,368,000
小松ウオール工業	500	1,993.00	996,500
ヤマハ	10,700	6,200.00	66,340,000
河合楽器製作所	500	3,530.00	1,765,000
クリナップ	1,700	530.00	901,000
ビジョン	11,500	4,060.00	46,690,000
天馬	1,400	2,232.00	3,124,800
オリバー	400	2,652.00	1,060,800
兼松サステック	100	1,819.00	181,900
キングジム	1,500	895.00	1,342,500
象印マホービン	4,800	1,812.00	8,697,600
リンテック	3,800	2,486.00	9,446,800
信越ポリマー	2,800	983.00	2,752,400
東リ	4,400	264.00	1,161,600
イトーキ	3,600	383.00	1,378,800
任天堂	10,300	59,000.00	607,700,000
三菱鉛筆	3,000	1,501.00	4,503,000
松風	800	1,932.00	1,545,600
タカラスタンダード	3,700	1,584.00	5,860,800
コクヨ	8,600	1,641.00	14,112,600

ナカバヤシ	1,800	635.00	1,143,000
ニフコ	6,600	3,800.00	25,080,000
立川ブラインド工業	800	1,420.00	1,136,000
グロープライド	800	4,345.00	3,476,000
オカムラ	6,200	1,212.00	7,514,400
バルカー	1,500	2,144.00	3,216,000
MUTOHホールディングス	200	1,655.00	331,000
伊藤忠商事	123,800	3,439.00	425,748,200
丸紅	174,400	859.90	149,966,560
スクロール	2,500	1,112.00	2,780,000
高島	300	1,712.00	513,600
ヨンドシーホールディングス	1,700	1,903.00	3,235,100
三陽商会	1,200	781.00	937,200
長瀬産業	10,000	1,790.00	17,900,000
ナイガイ	600	328.00	196,800
蝶理	1,200	1,629.00	1,954,800
豊田通商	17,800	4,670.00	83,126,000
オンワードホールディングス	11,600	309.00	3,584,400
三共生興	2,700	569.00	1,536,300
兼松	7,000	1,458.00	10,206,000
美津濃	1,800	2,227.00	4,008,600
ツカモトコーポレーション	300	1,539.00	461,700
ルックホールディングス	600	1,223.00	733,800
三井物産	143,600	2,310.50	331,787,800
日本紙パルプ商事	900	3,755.00	3,379,500
東京エレクトロン	10,600	40,650.00	430,890,000
カメイ	2,300	1,199.00	2,757,700
東都水産	200	4,130.00	826,000
OUGホールディングス	300	2,849.00	854,700
スターゼン	600	4,870.00	2,922,000
セイコーホールディングス	2,600	2,045.00	5,317,000
山善	6,900	1,013.00	6,989,700
椿本興業	300	3,915.00	1,174,500
住友商事	111,700	1,604.50	179,222,650
日本ユニシス	6,100	3,155.00	19,245,500
内田洋行	700	5,140.00	3,598,000
三菱商事	107,700	3,145.00	338,716,500
第一実業	800	4,145.00	3,316,000
キヤノンマーケティングジャパン	4,300	2,437.00	10,479,100
西華産業	900	1,476.00	1,328,400
佐藤商事	1,500	1,103.00	1,654,500
菱洋エレクトロ	1,400	2,750.00	3,850,000
東京産業	1,600	660.00	1,056,000
ユアサ商事	1,800	3,100.00	5,580,000
神鋼商事	400	2,172.00	868,800
トルク	1,000	254.00	254,000
阪和興業	3,600	3,245.00	11,682,000
正栄食品工業	1,200	4,010.00	4,812,000
カナデン	1,500	1,209.00	1,813,500
菱電商事	1,300	1,666.00	2,165,800

ニプロ	13,300	1,355.00	18,021,500
フルサト工業	900	1,370.00	1,233,000
岩谷産業	4,200	6,320.00	26,544,000
ナイス	700	1,782.00	1,247,400
昭光通商	500	806.00	403,000
極東貿易	500	1,519.00	759,500
イワキ	2,300	618.00	1,421,400
兼松エレクトロニクス	900	3,685.00	3,316,500
三愛石油	4,300	1,222.00	5,254,600
稲畑産業	4,200	1,644.00	6,904,800
G S Iクレオス	400	2,542.00	1,016,800
明和産業	1,700	510.00	867,000
クワザワホールディングス	600	715.00	429,000
ヤマエ久野	1,300	1,115.00	1,449,500
ゴールドウイン	2,900	6,960.00	20,184,000
ユニ・チャーム	38,100	4,523.00	172,326,300
デサント	3,000	1,818.00	5,454,000
キング	900	591.00	531,900
ワキタ	3,600	963.00	3,466,800
ヤマトインターナショナル	1,600	337.00	539,200
東邦ホールディングス	5,700	1,889.00	10,767,300
サンゲツ	4,700	1,618.00	7,604,600
ミツウロコグループホールディングス	2,600	1,288.00	3,348,800
シナネンホールディングス	600	3,105.00	1,863,000
伊藤忠エネクス	3,900	1,085.00	4,231,500
サンリオ	4,900	1,776.00	8,702,400
サンワテクノス	1,200	1,065.00	1,278,000
リョーサン	2,000	2,273.00	4,546,000
新光商事	2,400	803.00	1,927,200
トーヨー	800	1,910.00	1,528,000
三信電気	900	2,009.00	1,808,100
東陽テクニカ	1,900	1,095.00	2,080,500
モスフードサービス	2,500	3,285.00	8,212,500
加賀電子	1,600	2,519.00	4,030,400
三益半導体工業	1,400	2,464.00	3,449,600
都築電気	600	1,596.00	957,600
ソーダニッカ	1,700	593.00	1,008,100
立花エレテック	1,400	1,601.00	2,241,400
木曽路	2,300	2,439.00	5,609,700
S R Sホールディングス	2,200	914.00	2,010,800
千趣会	3,300	387.00	1,277,100
リテールパートナーズ	2,200	1,415.00	3,113,000
ケーヨー	3,400	700.00	2,380,000
上新電機	2,100	3,140.00	6,594,000
日本瓦斯	2,900	5,420.00	15,718,000
ロイヤルホールディングス	3,400	1,894.00	6,439,600
東天紅	200	999.00	199,800
いなげや	2,000	1,723.00	3,446,000
チヨダ	1,900	1,029.00	1,955,100
ライフコーポレーション	1,400	3,185.00	4,459,000

リンガーハット	2,400	2,312.00	5,548,800
MrMaxHD	2,400	716.00	1,718,400
AOKIホールディングス	4,200	710.00	2,982,000
オークワ	2,800	1,220.00	3,416,000
コメリ	2,700	2,850.00	7,695,000
青山商事	4,600	836.00	3,845,600
しまむら	2,100	10,580.00	22,218,000
はせがわ	900	296.00	266,400
高島屋	12,900	1,230.00	15,867,000
松屋	4,200	1,044.00	4,384,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,600	955.00	8,213,000
近鉄百貨店	700	3,375.00	2,362,500
丸井グループ	15,000	2,140.00	32,100,000
クレディセゾン	10,400	1,424.00	14,809,600
アクシアル リテイリング	1,500	4,675.00	7,012,500
イオン	68,100	3,133.00	213,357,300
イズミ	3,700	4,005.00	14,818,500
フォーバル	600	849.00	509,400
平和堂	3,400	2,120.00	7,208,000
フジ	2,200	1,975.00	4,345,000
ヤオコー	2,000	6,690.00	13,380,000
ゼビオホールディングス	2,200	961.00	2,114,200
ケーズホールディングス	15,700	1,473.00	23,126,100
PALTAC	2,800	6,020.00	16,856,000
三谷産業	2,400	428.00	1,027,200
Olympicグループ	900	852.00	766,800
日産東京販売ホールディングス	2,600	257.00	668,200
新生銀行	14,500	1,830.00	26,535,000
あおぞら銀行	10,600	2,460.00	26,076,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,211,700	591.50	716,720,550
りそなホールディングス	192,700	454.10	87,505,070
三井住友トラスト・ホールディングス	33,500	3,824.00	128,104,000
三井住友フィナンシャルグループ	122,600	3,962.00	485,741,200
千葉銀行	59,200	739.00	43,748,800
群馬銀行	36,500	384.00	14,016,000
武蔵野銀行	2,700	1,811.00	4,889,700
千葉興業銀行	4,500	270.00	1,215,000
筑波銀行	7,300	192.00	1,401,600
七十七銀行	5,600	1,552.00	8,691,200
青森銀行	1,400	2,552.00	3,572,800
秋田銀行	1,000	1,500.00	1,500,000
山形銀行	2,000	1,122.00	2,244,000
岩手銀行	1,200	2,307.00	2,768,400
東邦銀行	15,800	233.00	3,681,400
東北銀行	800	1,130.00	904,000
みちのく銀行	1,200	1,122.00	1,346,400
ふくおかフィナンシャルグループ	16,000	2,130.00	34,080,000
静岡銀行	43,100	858.00	36,979,800
十六銀行	2,200	2,163.00	4,758,600
スルガ銀行	15,500	385.00	5,967,500



八十二銀行	40,000	387.00	15,480,000
山梨中央銀行	2,100	892.00	1,873,200
大垣共立銀行	3,600	2,155.00	7,758,000
福井銀行	1,600	1,936.00	3,097,600
北國銀行	1,700	2,844.00	4,834,800
清水銀行	700	1,751.00	1,225,700
富山銀行	300	2,975.00	892,500
滋賀銀行	3,600	2,151.00	7,743,600
南都銀行	2,600	1,953.00	5,077,800
百五銀行	15,900	333.00	5,294,700
京都銀行	6,300	6,560.00	41,328,000
紀陽銀行	6,300	1,521.00	9,582,300
ほくほくフィナンシャルグループ	11,700	1,025.00	11,992,500
山陰合同銀行	11,100	528.00	5,860,800
中国銀行	15,200	926.00	14,075,200
鳥取銀行	500	1,154.00	577,000
伊予銀行	23,500	654.00	15,369,000
百十四銀行	1,900	1,714.00	3,256,600
四国銀行	2,500	791.00	1,977,500
阿波銀行	2,700	2,418.00	6,528,600
大分銀行	1,000	2,179.00	2,179,000
宮崎銀行	1,200	2,378.00	2,853,600
佐賀銀行	1,000	1,565.00	1,565,000
沖縄銀行	1,700	3,020.00	5,134,000
琉球銀行	3,800	814.00	3,093,200
セブン銀行	59,200	253.00	14,977,600
みずほフィナンシャルグループ	240,700	1,597.50	384,518,250
高知銀行	600	857.00	514,200
山口フィナンシャルグループ	22,100	730.00	16,133,000
芙蓉総合リース	1,900	7,630.00	14,497,000
みずほリース	2,700	3,370.00	9,099,000
東京センチュリー	4,100	7,130.00	29,233,000
SBIホールディングス	21,700	3,070.00	66,619,000
日本証券金融	7,400	629.00	4,654,600
アイフル	29,700	327.00	9,711,900
長野銀行	600	1,363.00	817,800
名古屋銀行	1,500	3,155.00	4,732,500
北洋銀行	26,600	293.00	7,793,800
愛知銀行	600	3,170.00	1,902,000
中京銀行	600	1,813.00	1,087,800
大光銀行	600	1,406.00	843,600
愛媛銀行	2,500	1,008.00	2,520,000
トマト銀行	700	1,106.00	774,200
京葉銀行	7,600	464.00	3,526,400
栃木銀行	8,600	187.00	1,608,200
北日本銀行	500	2,032.00	1,016,000
東和銀行	3,100	723.00	2,241,300
福島銀行	2,100	278.00	583,800
大東銀行	800	700.00	560,000
リコーリース	1,400	3,530.00	4,942,000

イオンフィナンシャルサービス	10,900	1,464.00	15,957,600
アコム	35,600	510.00	18,156,000
ジャックス	2,000	2,142.00	4,284,000
オリエントコーポレーション	47,800	155.00	7,409,000
日立キャピタル	4,100	3,280.00	13,448,000
オリックス	107,700	1,848.50	199,083,450
三菱UFJリース	40,000	652.00	26,080,000
ジャフコ グループ	2,700	6,500.00	17,550,000
九州リースサービス	800	673.00	538,400
トモニホールディングス	13,600	319.00	4,338,400
大和証券グループ本社	132,700	557.30	73,953,710
野村ホールディングス	270,500	679.00	183,669,500
岡三証券グループ	15,100	429.00	6,477,900
丸三証券	5,200	619.00	3,218,800
東洋証券	5,900	179.00	1,056,100
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,900	381.00	7,200,900
光世証券	400	690.00	276,000
水戸証券	4,700	299.00	1,405,300
いちよし証券	3,600	578.00	2,080,800
松井証券	8,700	949.00	8,256,300
SOMPOホールディングス	31,300	4,131.00	129,300,300
日本取引所グループ	47,800	2,491.50	119,093,700
マネックスグループ	16,200	843.00	13,656,600
極東証券	2,400	814.00	1,953,600
岩井コスモホールディングス	1,900	1,584.00	3,009,600
藍澤證券	3,300	923.00	3,045,900
フィデアホールディングス	17,200	136.00	2,339,200
池田泉州ホールディングス	20,300	172.00	3,491,600
アニコム ホールディングス	4,900	1,035.00	5,071,500
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	43,000	3,206.00	137,858,000
マネーパートナーズグループ	1,900	282.00	535,800
スパークス・グループ	8,200	312.00	2,558,400
第一生命ホールディングス	93,600	1,901.50	177,980,400
東京海上ホールディングス	58,700	5,632.00	330,598,400
アドバンテッジリスクマネジメント	800	741.00	592,800
イー・ギャランティ	2,100	1,976.00	4,149,600
アサックス	900	746.00	671,400
NECキャピタルソリューション	700	2,022.00	1,415,400
T&Dホールディングス	53,000	1,425.00	75,525,000
アドバンスクリエイト	400	1,800.00	720,000
三井不動産	80,800	2,575.50	208,100,400
三菱地所	116,300	1,906.00	221,667,800
平和不動産	3,000	3,380.00	10,140,000
東京建物	17,500	1,663.00	29,102,500
ダイビル	4,700	1,307.00	6,142,900
京阪神ビルディング	3,100	1,521.00	4,715,100
住友不動産	39,900	3,900.00	155,610,000
太平洋興発	700	726.00	508,200

テーオーシー	4,000	773.00	3,092,000
東京楽天地	400	4,600.00	1,840,000
スターツコーポレーション	2,100	3,020.00	6,342,000
フジ住宅	2,100	718.00	1,507,800
空港施設	1,800	587.00	1,056,600
明和地所	900	735.00	661,500
ゴールドクレスト	1,800	1,651.00	2,971,800
リログループ	9,400	2,180.00	20,492,000
エスリード	700	1,762.00	1,233,400
日神グループホールディングス	2,600	481.00	1,250,600
日本エスコン	3,300	786.00	2,593,800
タカラレーベン	8,200	387.00	3,173,400
A V A N T I A	1,000	887.00	887,000
イオンモール	8,900	1,875.00	16,687,500
毎日コムネット	400	710.00	284,000
ファースト住建	700	1,217.00	851,900
カチタス	4,300	2,939.00	12,637,700
東祥	1,200	1,930.00	2,316,000
トーセイ	2,500	1,096.00	2,740,000
穴吹興産	400	1,787.00	714,800
サンフロンティア不動産	2,300	1,009.00	2,320,700
エフ・ジェー・ネクスト	1,800	1,117.00	2,010,600
インテリックス	500	600.00	300,000
ランドビジネス	800	350.00	280,000
サンネクスタグループ	500	976.00	488,000
グランディハウス	1,300	493.00	640,900
東武鉄道	18,700	3,185.00	59,559,500
相鉄ホールディングス	6,200	2,607.00	16,163,400
東急	45,300	1,539.00	69,716,700
京浜急行電鉄	23,100	1,775.00	41,002,500
小田急電鉄	28,700	3,165.00	90,835,500
京王電鉄	10,100	7,900.00	79,790,000
京成電鉄	13,400	3,985.00	53,399,000
富士急行	2,500	5,780.00	14,450,000
新京成電鉄	400	2,280.00	912,000
東日本旅客鉄道	31,700	8,343.00	264,473,100
西日本旅客鉄道	16,000	6,680.00	106,880,000
東海旅客鉄道	14,900	17,655.00	263,059,500
西武ホールディングス	21,600	1,330.00	28,728,000
鴻池運輸	2,900	1,072.00	3,108,800
西日本鉄道	4,900	3,235.00	15,851,500
ハマキョウレックス	1,400	3,305.00	4,627,000
サカイ引越センター	800	5,030.00	4,024,000
近鉄グループホールディングス	17,100	4,580.00	78,318,000
阪急阪神ホールディングス	22,700	3,675.00	83,422,500
南海電気鉄道	8,100	2,676.00	21,675,600
京阪ホールディングス	7,600	5,040.00	38,304,000
神戸電鉄	400	3,730.00	1,492,000
名古屋鉄道	13,900	2,802.00	38,947,800
山陽電気鉄道	1,300	2,049.00	2,663,700

アルプス物流	1,200	992.00	1,190,400
トランコム	500	8,650.00	4,325,000
日本通運	5,900	8,130.00	47,967,000
ヤマトホールディングス	23,900	2,848.00	68,067,200
山九	4,300	4,840.00	20,812,000
日新	1,400	1,473.00	2,062,200
丸運	900	258.00	232,200
丸全昭和運輸	1,400	3,260.00	4,564,000
センコーグループホールディングス	9,400	1,125.00	10,575,000
トナミホールディングス	400	5,510.00	2,204,000
ニッコンホールディングス	5,700	2,199.00	12,534,300
日本石油輸送	200	2,697.00	539,400
福山通運	2,200	4,465.00	9,823,000
セイノーホールディングス	12,700	1,607.00	20,408,900
エスライン	500	918.00	459,000
神奈川中央交通	400	3,900.00	1,560,000
日立物流	3,700	3,585.00	13,264,500
丸和運輸機関	3,700	1,917.00	7,092,900
C & F ロジホールディングス	1,800	1,796.00	3,232,800
日本郵船	14,300	3,150.00	45,045,000
商船三井	10,200	3,355.00	34,221,000
川崎汽船	5,300	1,920.00	10,176,000
NSユナイテッド海運	900	1,704.00	1,533,600
飯野海運	7,900	480.00	3,792,000
共栄タンカー	300	1,012.00	303,600
九州旅客鉄道	13,100	2,799.00	36,666,900
SGホールディングス	32,200	2,442.00	78,632,400
日本航空	41,400	2,505.00	103,707,000
ANAホールディングス	45,900	2,596.00	119,156,400
パスコ	300	1,314.00	394,200
西本Wismettacホールディングス	400	3,060.00	1,224,000
シルバーライフ	300	2,011.00	603,300
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,559.00	311,800
一家ダイニングプロジェクト	300	589.00	176,700
Genky DrugStores	800	3,590.00	2,872,000
コア商事ホールディングス	500	1,194.00	597,000
国際紙パルプ商事	3,700	256.00	947,200
ナルミヤ・インターナショナル	400	1,189.00	475,600
ブックオフグループホールディングス	1,000	912.00	912,000
ギフト	200	2,039.00	407,800
三菱倉庫	5,900	3,465.00	20,443,500
三井倉庫ホールディングス	1,800	2,219.00	3,994,200
住友倉庫	6,100	1,496.00	9,125,600
澁澤倉庫	900	2,261.00	2,034,900
ヤマタネ	700	1,505.00	1,053,500
東陽倉庫	2,900	346.00	1,003,400
乾汽船	800	1,040.00	832,000
日本トランスシティ	3,700	557.00	2,060,900
ケイヒン	300	1,404.00	421,200

中央倉庫	1,000	1,208.00	1,208,000	
川西倉庫	300	1,209.00	362,700	
安田倉庫	1,500	955.00	1,432,500	
ファイズホールディングス	300	866.00	259,800	
東洋埠頭	500	1,515.00	757,500	
宇徳	1,300	497.00	646,100	
上組	9,500	2,178.00	20,691,000	
サンリツ	400	720.00	288,000	
キムラユニティー	400	1,178.00	471,200	
キューソー流通システム	400	1,646.00	658,400	
近鉄エクスプレス	3,300	2,587.00	8,537,100	
東海運	900	333.00	299,700	
エーアイティー	1,000	998.00	998,000	
内外トランスライン	600	1,399.00	839,400	
ショーエイコーポレーション	400	1,062.00	424,800	
日本コンセプト	500	1,708.00	854,000	
TBSホールディングス	11,600	2,154.00	24,986,400	
日本テレビホールディングス	14,700	1,482.00	21,785,400	
朝日放送グループホールディングス	1,800	737.00	1,326,600	
テレビ朝日ホールディングス	5,500	2,114.00	11,627,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	11,500	477.00	5,485,500	
テレビ東京ホールディングス	1,300	2,515.00	3,269,500	
日本BS放送	600	1,085.00	651,000	
ビジョン	2,600	1,200.00	3,120,000	
スマートバリュー	400	912.00	364,800	
USEN-NEXT HOLDINGS	700	1,900.00	1,330,000	
コネクシオ	1,000	1,391.00	1,391,000	
クロップス	300	835.00	250,500	
日本電信電話	206,200	2,827.50	583,030,500	
KDDI	141,400	3,489.00	493,344,600	
ソフトバンク	160,100	1,435.00	229,743,500	
光通信	2,100	20,980.00	44,058,000	
エムティーアイ	1,800	861.00	1,549,800	
GMOインターネット	6,300	3,070.00	19,341,000	
ファイバーゲート	600	1,793.00	1,075,800	
アйдママーケティングコミュニケーション	600	493.00	295,800	
KADOKAWA	4,700	4,110.00	19,317,000	
学研ホールディングス	2,400	1,363.00	3,271,200	
ゼンリン	3,500	1,299.00	4,546,500	
昭文社ホールディングス	700	483.00	338,100	
インプレスホールディングス	1,500	239.00	358,500	
東京電力ホールディングス	152,300	370.00	56,351,000	
中部電力	54,900	1,408.00	77,299,200	
関西電力	68,100	1,184.50	80,664,450	
中国電力	25,900	1,371.00	35,508,900	
北陸電力	16,500	713.00	11,764,500	
東北電力	42,100	1,049.00	44,162,900	
四国電力	14,900	820.00	12,218,000	

九州電力	39,700	1,030.00	40,891,000
北海道電力	16,900	494.00	8,348,600
沖縄電力	3,600	1,575.00	5,670,000
電源開発	14,300	1,897.00	27,127,100
エフオン	1,200	1,032.00	1,238,400
イーレックス	2,700	1,805.00	4,873,500
レノバ	3,000	3,135.00	9,405,000
東京瓦斯	34,500	2,348.50	81,023,250
大阪瓦斯	32,600	2,031.00	66,210,600
東邦瓦斯	8,800	6,530.00	57,464,000
北海道瓦斯	900	1,644.00	1,479,600
広島ガス	3,700	392.00	1,450,400
西部瓦斯	2,100	3,040.00	6,384,000
静岡ガス	5,000	960.00	4,800,000
メタウォーター	2,100	2,115.00	4,441,500
アイネット	900	1,499.00	1,349,100
松竹	1,200	14,960.00	17,952,000
東宝	10,500	4,260.00	44,730,000
エイチ・アイ・エス	2,800	2,152.00	6,025,600
東映	600	22,730.00	13,638,000
ラックランド	500	2,392.00	1,196,000
エヌ・ティ・ティ・データ	47,000	1,749.00	82,203,000
共立メンテナンス	2,900	3,735.00	10,831,500
イチネンホールディングス	1,800	1,385.00	2,493,000
建設技術研究所	1,200	2,377.00	2,852,400
スペース	1,200	920.00	1,104,000
長 大	700	1,690.00	1,183,000
アインホールディングス	2,600	7,050.00	18,330,000
燦ホールディングス	700	1,119.00	783,300
ピー・シー・エー	200	4,175.00	835,000
スバル興業	100	8,050.00	805,000
東京テアトル	600	1,325.00	795,000
タナベ経営	300	1,436.00	430,800
ビジネスブレイン太田昭和	600	1,738.00	1,042,800
ナガワ	500	9,210.00	4,605,000
東京都競馬	1,200	5,370.00	6,444,000
常磐興産	700	1,457.00	1,019,900
カナモト	3,000	2,696.00	8,088,000
D T S	3,700	2,486.00	9,198,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,600	5,860.00	44,536,000
シーイーシー	1,900	1,429.00	2,715,100
カプコン	7,600	6,460.00	49,096,000
西尾レントオール	1,600	2,802.00	4,483,200
アイ・エス・ビー	800	1,231.00	984,800
日本空港ビルデング	5,700	5,080.00	28,956,000
トランス・コスモス	1,700	2,856.00	4,855,200
乃村工藝社	7,400	858.00	6,349,200
ジャステック	1,200	1,252.00	1,502,400
S C S K	4,000	6,460.00	25,840,000

藤田観光	900	1,939.00	1,745,100	
日本管財	1,900	2,176.00	4,134,400	
トーカイ	1,700	2,290.00	3,893,000	
セコム	17,000	9,359.00	159,103,000	
日本システムウェア	600	2,036.00	1,221,600	
セントラル警備保障	800	3,365.00	2,692,000	
アイネス	1,800	1,345.00	2,421,000	
丹青社	3,300	879.00	2,900,700	
メイテック	2,100	5,780.00	12,138,000	
T K C	1,500	6,260.00	9,390,000	
富士ソフト	1,900	5,320.00	10,108,000	
応用地質	2,000	1,248.00	2,496,000	
船井総研ホールディングス	3,600	2,155.00	7,758,000	
N S D	5,700	1,884.00	10,738,800	
進学会ホールディングス	600	480.00	288,000	
丸紅建材リース	200	1,920.00	384,000	
オオバ	1,300	779.00	1,012,700	
コナミホールディングス	6,400	7,060.00	45,184,000	
いであ	400	1,744.00	697,600	
学究社	500	1,424.00	712,000	
ベネッセホールディングス	6,300	2,247.00	14,156,100	
イオンディライト	2,100	3,200.00	6,720,000	
ナック	800	980.00	784,000	
福井コンピュータホールディングス	800	3,655.00	2,924,000	
ダイセキ	2,900	3,515.00	10,193,500	
ステップ	600	1,548.00	928,800	
日鉄物産	1,300	4,040.00	5,252,000	
泉州電業	500	3,455.00	1,727,500	
元気寿司	600	2,629.00	1,577,400	
トラスコ中山	4,000	2,740.00	10,960,000	
ヤマダホールディングス	59,300	539.00	31,962,700	
オートバックスセブン	6,500	1,482.00	9,633,000	
モリト	1,300	627.00	815,100	
アークランドサカモト	2,800	1,643.00	4,600,400	
ニトリホールディングス	7,000	18,995.00	132,965,000	
グルメ杵屋	1,300	1,007.00	1,309,100	
愛眼	1,500	233.00	349,500	
ケーユーホールディングス	900	955.00	859,500	
吉野家ホールディングス	5,800	2,140.00	12,412,000	
加藤産業	2,600	3,710.00	9,646,000	
北恵	400	940.00	376,000	
イノテック	1,000	1,239.00	1,239,000	
イエローハット	3,400	1,859.00	6,320,600	
松屋フーズホールディングス	900	3,620.00	3,258,000	
J B C Cホールディングス	1,300	1,450.00	1,885,000	
J Kホールディングス	1,600	867.00	1,387,200	
サガミホールディングス	2,400	1,210.00	2,904,000	
日伝	1,500	2,185.00	3,277,500	
関西スーパーマーケット	1,400	1,151.00	1,611,400	
ミロク情報サービス	1,800	2,118.00	3,812,400	

北沢産業	1,300	267.00	347,100	
杉本商事	900	2,343.00	2,108,700	
因幡電機産業	4,700	2,712.00	12,746,400	
王将フードサービス	1,200	5,890.00	7,068,000	
プレナス	2,000	1,936.00	3,872,000	
ミニストップ	1,400	1,447.00	2,025,800	
アークス	3,500	2,295.00	8,032,500	
バローホールディングス	3,700	2,511.00	9,290,700	
東テク	600	2,950.00	1,770,000	
ミスミグループ本社	22,100	3,200.00	70,720,000	
藤久	400	742.00	296,800	
アルテック	1,400	306.00	428,400	
ベルク	800	5,760.00	4,608,000	
大 庄	1,300	1,005.00	1,306,500	
タキヒヨー	600	1,827.00	1,096,200	
ファーストリテイリング	2,400	91,750.00	220,200,000	
ソフトバンクグループ	139,800	10,120.00	1,414,776,000	
蔵王産業	300	1,390.00	417,000	
スズケン	7,400	4,125.00	30,525,000	
サンドラッグ	6,600	4,110.00	27,126,000	
サクスパー ホールディングス	1,800	637.00	1,146,600	
ジェコス	1,300	979.00	1,272,700	
ヤマザワ	400	1,725.00	690,000	
やまや	400	2,400.00	960,000	
グローセル	2,000	477.00	954,000	
ベルーナ	3,800	1,180.00	4,484,000	
合計	18,633,900		47,304,937,570	

## ( 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】

2021年3月31日現在

資産総額	9,185,285,562円
負債総額	24,939,551円
純資産総額( - )	9,160,346,011円
発行済数量	6,966,884,897口
1口当たり純資産額( / )	1.3148円

(参考)

MHAM TOPIXマザーファンド

2021年3月31日現在

資産総額	50,732,722,767円
負債総額	39,470,819円
純資産総額( - )	50,693,251,948円
発行済数量	20,873,548,178口
1口当たり純資産額( / )	2.4286円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

### (5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額（2021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（2021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。

2021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	1,532,013,354,329
追加型株式投資信託	849	15,416,086,595,131
単位型公社債投資信託	30	69,619,269,662
単位型株式投資信託	206	1,270,380,506,725
合計	1,111	18,288,099,725,847

### 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35期事業年度(自2019年4月1日至2020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36期中間会計期間(自2020年4月1日至2020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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	41,087,475	32,932,013
金銭の信託	18,773,228	28,548,165
有価証券	153,518	996
未収委託者報酬	12,438,085	11,487,393
未収運用受託報酬	3,295,109	4,674,225
未収投資助言報酬	327,064	331,543
未収収益	56,925	11,674
前払費用	573,874	480,129
その他	491,914	2,815,351
流動資産計	77,197,195	81,281,494
固定資産		
有形固定資産		
建物	1,461,316	1,278,455
建物	1 1,096,916	1 1,006,793
器具備品	1 364,399	1 270,768
建設仮勘定	-	894
無形固定資産		
ソフトウェア	2,411,540	3,524,781
ソフトウェア仮勘定	885,545	3,299,065
ソフトウェア仮勘定	1,522,040	221,784
電話加入権	3,931	3,931
電信電話専用施設利用権	23	-
投資その他の資産		
投資有価証券	9,269,808	9,482,127
関係会社株式	1,611,931	261,361
長期差入保証金	4,499,196	5,299,196
繰延税金資産	1,312,328	1,302,402
繰延税金資産	1,748,459	2,508,004
その他	97,892	111,162
固定資産計	13,142,665	14,285,364
資産合計	90,339,861	95,566,859

(単位:千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	2,183,889	3,702,906
未払金	5,697,942	4,803,140
未払収益分配金	1,053	966
未払償還金	48,968	9,999
未払手数料	4,883,723	4,582,140
その他未払金	764,196	210,034
未払費用	6,724,986	6,673,320
未払法人税等	3,341,238	4,090,268
未払消費税等	576,632	1,338,183
賞与引当金	1,344,466	1,373,328
役員賞与引当金	48,609	65,290
流動負債計	19,917,766	22,046,438
固定負債		
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
時効後支払損引当金	177,851	174,139
固定負債計	2,073,009	2,293,087
負債合計	21,990,776	24,339,526
(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	45,949,372	49,674,383
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	45,826,079	49,551,090
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	14,146,079	17,871,090
株主資本計	67,502,329	71,227,341
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	846,755	7
評価・換算差額等計	846,755	7
純資産合計	68,349,085	71,227,333
負債・純資産合計	90,339,861	95,566,859



## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	84,812,585		84,426,075	
運用受託報酬	16,483,356		16,912,305	
投資助言報酬	1,235,553		1,208,954	
その他営業収益	113,622		68,156	
営業収益計		102,645,117		102,615,492
営業費用				
支払手数料	36,100,556		34,980,736	
広告宣伝費	387,028		340,791	
公告費	375		375	
調査費	24,389,003		25,132,268	
調査費	9,956,757		10,586,542	
委託調査費	14,432,246		14,545,725	
委託計算費	936,075		698,723	
営業雑経費	1,254,114		990,002	
通信費	47,007		44,209	
印刷費	978,185		738,330	
協会費	63,558		71,386	
諸会費	22,877		22,790	
支払販売手数料	142,485		113,286	
営業費用計		63,067,153		62,142,897
一般管理費				
給料	10,859,354		10,817,861	
役員報酬	189,198		174,795	
給料・手当	9,098,957		9,087,800	
賞与	1,571,197		1,555,264	
交際費	60,115		40,436	
寄付金	7,255		8,906	
旅費交通費	361,479		320,037	
租税公課	588,172		651,265	
不動産賃借料	1,511,876		1,479,503	
退職給付費用	521,184		505,189	
固定資産減価償却費	590,667		882,526	
福利厚生費	45,292		44,352	
修繕費	16,247		1,843	
賞与引当金繰入額	1,344,466		1,373,328	
役員賞与引当金繰入額	48,609		65,290	
機器リース料	130		233	
事務委託費	3,302,806		3,625,424	
事務用消耗品費	131,074		104,627	
器具備品費	8,112		1,620	
諸経費	188,367		197,094	
一般管理費計		19,585,212		20,119,543
営業利益		19,992,752		20,353,050

(単位:千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	1,749		4,440	
受取配当金	73,517		11,185	
時効成立分配金・償還金	8,582		49,164	
投資信託償還益	-		5,528	
受取負担金	177,066		297,886	
雑収入	24,919		7,394	
時効後支払損引当金戻入額	19,797		3,473	
営業外収益計		305,633		379,073
営業外費用				
為替差損	17,542		19,750	
投資信託償還損	-		1	
金銭の信託運用損	175,164		169,505	
システム解約料	-		31,680	
雑損失	5,659		104	
営業外費用計		198,365		221,042
経常利益		20,100,019		20,511,082
特別利益				
投資有価証券売却益	353,644		1,169,758	
特別利益計		353,644		1,169,758
特別損失				
固定資産除却損	1 19,121		1 16,085	
特別損失計		19,121		16,085
税引前当期純利益		20,434,543		21,664,754
法人税、住民税及び事業税		6,386,793		7,045,579
法人税等調整額		71,767		385,835
法人税等合計		6,315,026		6,659,743
当期純利益		14,119,516		15,005,011

## (3)【株主資本等変動計算書】

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 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	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
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

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		別途 積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
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	45,949,372	67,502,329
当期変動額									
剰余金の配当							11,280,000	11,280,000	11,280,000
当期純利益							15,005,011	15,005,011	15,005,011
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,725,011	3,725,011	3,725,011
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	846,755	846,755	68,349,085
当期変動額			
剰余金の配当			11,280,000
当期純利益			15,005,011
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)	846,763	846,763	846,763
当期変動額合計	846,763	846,763	2,878,247
当期末残高	7	7	71,227,333

## 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>
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**

(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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
建物	229,897	320,020
器具備品	927,688	949,984

(損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)	第35期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)
建物	1,550	-
器具備品	439	9,609
ソフトウエア	17,130	6,475

(株主資本等変動計算書関係)

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

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					

## 第35期(自 2019年4月1日 至 2020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
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  
2020年6月17日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種 類株式					

## （金融商品関係）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### （1）金融商品に対する取組方針

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

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

#### （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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おります。

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

#### （3）金融商品に係るリスク管理体制

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	-

第35期(2020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	32,932,013	32,932,013	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	28,548,165	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	11,487,393	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	4,674,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	2,988	2,988	-
資産計	77,644,787	77,644,787	-
(1) 未払手数料	4,582,140	4,582,140	-
負債計	4,582,140	4,582,140	-

(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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非上場株式	276,764	259,369
関係会社株式	4,499,196	5,299,196

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。

(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 その他有価証券(投資信託)	153,518	1,995	996	-

第35期(2020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	32,932,013	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	996	994	997	-

## (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34期の貸借対照表計上額4,499,196千円、第35期の貸借対照表計上額5,299,196千円)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、記載していません。

## 2. その他有価証券

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276,764千円)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35期(2020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	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計			
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	2,988	3,000	11
小計	2,988	3,000	11
合計	2,988	3,000	11

(注) 非上場株式(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。

## 3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

## 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	-	-	-

## 第35期(自 2019年4月1日 至 2020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	1,298,377	1,169,758	-
投資信託	159,526	5,528	1

(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、償還によるものであります。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,154,607	2,289,044
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の発生額	10,147	18,448
退職給付の支払額	158,018	187,749
その他	438	1,476
退職給付債務の期末残高	2,289,044	2,422,901

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

(千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未積立退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未認識数理計算上の差異	150,568	130,155
未認識過去勤務費用	243,317	173,798
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の費用処理額	43,920	38,861
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,519
その他	3,640	11,303
確定給付制度に係る退職給付費用	411,963	401,711

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020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. 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104,720千円、当事業年度103,477千円であります。

## (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34期	第35期
	(2019年3月31日現在)	(2020年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	173,805	221,053
未払事業所税	10,915	10,778
賞与引当金	411,675	420,513
未払法定福利費	80,253	78,439
未払給与	7,961	10,410
受取負担金	138,994	47,781
運用受託報酬	102,490	331,395
資産除去債務	10,152	14,116
減価償却超過額(一括償却資産)	4,569	50,942
減価償却超過額	125,839	82,684
繰延資産償却超過額(税法上)	135,542	323,132
退職給付引当金	580,297	648,821
時効後支払損引当金	54,458	53,321
ゴルフ会員権評価損	7,360	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
その他	29,494	11,532
その他有価証券評価差額金	-	3
繰延税金資産小計	2,069,527	2,508,004
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,069,527	2,508,004
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	321,067	-
繰延税金負債合計	321,067	-
繰延税金資産の純額	1,748,459	2,508,004

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	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	

## (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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	104,326,078千円	94,605,736千円
資産合計	104,326,078千円	94,605,736千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	10,571,428千円	8,278,713千円
負債合計	10,571,428千円	8,278,713千円
純資産	93,754,650千円	86,327,023千円

(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	66,696,733千円	62,885,491千円
顧客関連資産	39,959,586千円	34,810,031千円



## (2) 損益計算書項目

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	9,043,138千円	8,954,439千円
経常利益	9,043,138千円	8,954,439千円
税引前当期純利益	9,091,728千円	9,111,312千円
当期純利益	7,489,721千円	7,536,465千円
1株当たり当期純利益	187,243円04銭	188,411円64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	5,241,252千円	5,149,555千円

(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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)及び第35期(自 2019年4月1日 至 2020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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

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

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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	5,793,912	未払 手数料	1,112,061
	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	10,294,840	未払 手数料	1,231,431

## 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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	1,708,727円13銭	1,780,683円32銭
1株当たり当期純利益金額	352,987円92銭	375,125円27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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
当期純利益金額	14,119,516千円	15,005,011千円
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	14,119,516千円	15,005,011千円
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36期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		27,281,363
金銭の信託		25,870,423
有価証券		996
未収委託者報酬		13,747,204
未収運用受託報酬		3,023,356
未収投資助言報酬		304,673
未収収益		24,940
前払費用		757,672
その他		2,912,168
	流動資産計	73,922,799
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	961,771
器具備品	1	237,569
無形固定資産		
ソフトウェア		3,099,921
ソフトウェア仮勘定		556,224
電話加入権		3,931
投資その他の資産		
投資有価証券		261,361
関係会社株式		5,299,196
長期差入保証金		1,295,930
繰延税金資産		2,294,343
その他		793,037
	固定資産計	14,803,286
資産合計		88,726,085

(単位:千円)

	第36期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,297,202
未払金	5,820,782
未払収益分配金	899
未払償還金	19,850
未払手数料	5,549,722
その他未払金	250,310
未払費用	7,902,650
未払法人税等	2,901,506
未払消費税等	824,900
前受収益	20,779
賞与引当金	1,126,713
役員賞与引当金	34,112
流動負債計	19,928,648
固定負債	
退職給付引当金	2,207,043
時効後支払損引当金	156,886
固定負債計	2,363,929
負債合計	22,292,578
(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	44,880,558
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	44,757,265
別途積立金	31,680,000
繰越利益剰余金	13,077,265
株主資本計	66,433,515
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	8
評価・換算差額等計	8
純資産合計	66,433,506
負債・純資産合計	88,726,085

## (2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	40,520,928	
運用受託報酬	6,813,891	
投資助言報酬	548,146	
その他営業収益	773,786	
	営業収益計	48,656,752
営業費用		
支払手数料	16,685,574	
広告宣伝費	116,359	
調査費	12,452,140	
調査費	4,305,114	
委託調査費	8,147,025	
委託計算費	269,176	
営業雑経費	450,999	
通信費	24,247	
印刷費	314,201	
協会費	20,394	
諸会費	32,852	
支払販売手数料	59,302	
	営業費用計	29,974,250
一般管理費		
給料	4,693,004	
役員報酬	75,939	
給料・手当	4,496,351	
賞与	120,714	
交際費	5,108	
寄付金	6,331	
旅費交通費	20,383	
租税公課	277,754	
不動産賃借料	734,008	
退職給付費用	267,068	
固定資産減価償却費	1 534,020	
福利厚生費	17,379	
修繕費	511	
賞与引当金繰入額	1,126,713	
役員賞与引当金繰入額	34,112	
機器リース料	139	
事務委託費	1,899,643	
事務用消耗品費	35,787	
器具備品費	265	
諸経費	66,792	
	一般管理費計	9,719,026
営業利益		8,963,474



(単位:千円)

	第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	17,653	
受取配当金	2,356	
時効成立分配金・償還金	176	
時効後支払損引当金戻入額	16,343	
為替差益	8,484	
金銭の信託運用損益	1,367,091	
雑収入	1,361	
営業外収益計		1,413,467
経常利益		10,376,942
特別損失		
固定資産除却損	0	
特別損失計		0
税引前中間純利益		10,376,942
法人税、住民税及び事業税		2,957,106
法人税等調整額		213,661
法人税等合計		3,170,767
中間純利益		7,206,174

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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	17,871,090
当中間期変動額							
剰余金の配当							12,000,000
中間純利益							7,206,174
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	-	-	-	-	-	-	4,793,825
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	13,077,265

	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	49,674,383	71,227,341	7	7	71,227,333
当中間期変動額					
剰余金の配当	12,000,000	12,000,000			12,000,000
中間純利益	7,206,174	7,206,174			7,206,174
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額 合計	4,793,825	4,793,825	0	0	4,793,826
当中間期末残高	44,800,558	66,433,515	8	8	66,433,506

## 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36期中間会計期間末 （2020年9月30日現在）	
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	365,042千円
	器具備品	980,577千円

## （中間損益計算書関係）

項目	第36期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）	
1.減価償却実施額	有形固定資産	79,115千円
	無形固定資産	454,905千円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18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36期中間会計期間末(2020年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

2020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	27,281,363	27,281,363	-
(2) 金銭の信託	25,870,423	25,870,423	-
(3) 未収委託者報酬	13,747,204	13,747,204	-
(4) 未収運用受託報酬	3,023,356	3,023,356	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	2,987	2,987	-
資産計	69,925,335	69,925,335	-
(1) 未払手数料	5,549,722	5,549,722	-
負債計	5,549,722	5,549,722	-

(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、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	5,299,196

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36期中間会計期間末

(2020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5,299,196千円)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 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	2,987	3,000	12
小計	2,987	3,000	12
合計	2,987	3,000	12

(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

2020年4月1日から2020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	90,405,440千円
資産合計	90,405,440千円
流動負債	- 千円
固定負債	7,722,834千円
負債合計	7,722,834千円
純資産	82,682,605千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額60,979,870千円及び顧客関連資産の金額32,301,694千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	4,411,813千円
経常利益	4,411,813千円
税引前中間純利益	4,411,813千円
中間純利益	3,644,417千円
1株当たり中間純利益	91,110円42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2,508,336千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36期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020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36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,660,837円67銭
1株当たり中間純利益金額	180,154円36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36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
中間純利益金額	7,206,174千円
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	7,206,174千円
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) 通常の実取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記（3）（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項  
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(2020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2020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

2020年5月27日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 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

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第35期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

#### 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

2021年4月16日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 丘本正彦 印  
業務執行社員

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMHAM TOPIXオープンの2020年3月11日から2021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。

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2021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、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

## 利害関係

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

以 上

（注1）上記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）XBRL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

2020年11月26日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

### EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	丘本 正彦 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

#### 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間(2020年4月1日から2020年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2020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(2020年4月1日から2020年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 中間監査意見の根拠

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

#### 中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

#### 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 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) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。