

【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】	2022年3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トピックスファンド
【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トピックスファンド(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1万口当たりには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	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

注：電話番号はコールセンターのものであります（以下同じ）。

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

（５）【申込手数料】

申込手数料(受益権1口当たり)は、取得申込日の基準価額に、2.2%(税抜2%)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。

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。

「分配金再投資コース」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。

販売会社で支払いを受けた償還金をもって、当ファンドの受益権の取得申込みをする場合、販売会社によっては取得申込口数のうち当該償還金額の範囲内で取得する口数についての申込手数料を、上記に定める申込手数料の規定にかかわらず、販売会社が独自に定めることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、償還乗換えの際に償還金の支払いを受けたことを証する書類を提示いただくことがあります。

(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。

「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」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、「分配金再投資コース」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】

2022年3月11日から2022年9月9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	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

(9) 【払込期日】

取得申込代金は、取得申込日から起算して4営業日目までに販売会社にお支払いいただきます。なお、販売会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に取得申込代金をお支払いいただく場合があります。

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	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

(11)【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

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】

主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じ、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。

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

なお、東証株価指数（TOPIX）は、東証市場再編に伴い、2022年4月4日付で指数の算出要領が変更される予定です。

1. TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。
2. ㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
3. ㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
4. ㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
5. 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
6. ㈱東京証券取引所は、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。
7. ㈱東京証券取引所は、委託会社または国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
8. 以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資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、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指します。

株式と株価指数先物取引等の合計の組入比率は、原則として高位を保つことを基本とします。

1兆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。

< 商品分類 >

・商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉となる資産)	補足分類
単位型 追加型	国内	株式	インデックス型
	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。

<属性区分>

・属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

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

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

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

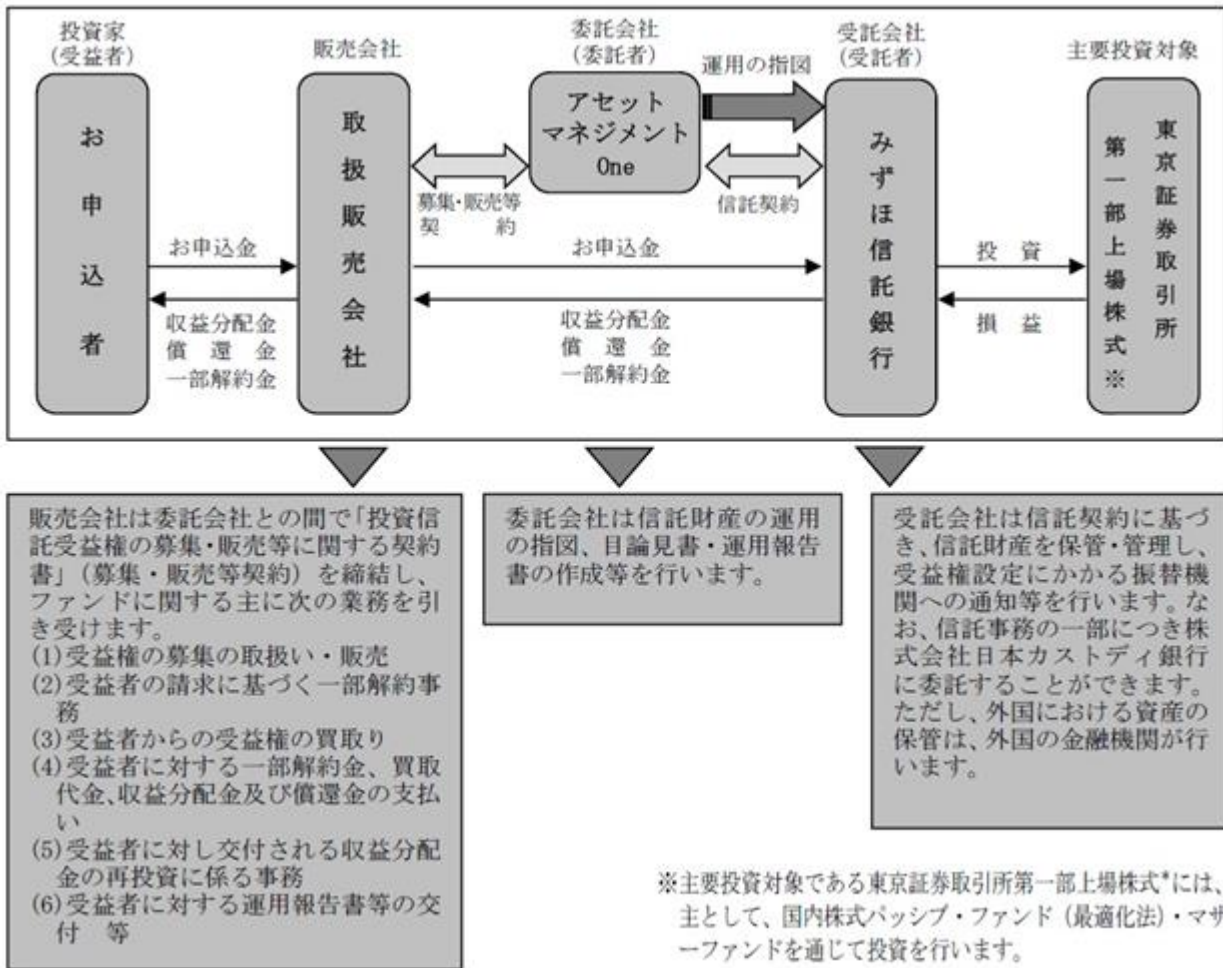
（注3）当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

（2）【ファンドの沿革】

2001年6月29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	ファンドの名称を「DKA TOPIX ファンド」から「MHAMトピックスファンド」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
2018年9月11日	信託財産留保額の撤廃
2021年4月2日	ファンドの主要投資対象に「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」を追加
2021年9月17日	ファンドの主要投資対象から「MHAMトピックスマザーファンド」を削除

(3) 【ファンドの仕組み】

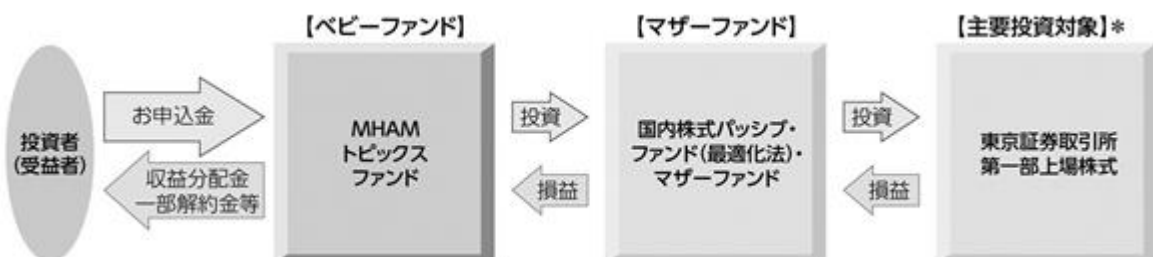
当ファンドの運営の仕組み



ファミリーファンド方式について

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

ファミリーファンド方式



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

マザーファンドのほかに、株式等に直接投資する場合があります。

* 東証市場再編に伴い、投資対象に関する記載を変更する約款変更を予定しております。約款変更日の2022年4月4日に「東京証券取引所第一部上場株式」から「東証株価指数採用銘柄」に変更を行う予定です。

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12月30日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2021年12月30日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

この投資信託は、東証株価指数(TOPIX、配当込み)に連動する投資成果を目指した運用を行います。

運用方法

1.主要投資対象

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

2.投資態度

a.主として国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド受益証券に投資を行い、東証株価指数(TOPIX、配当込み)に連動した投資成果を目指します。

b.投資にあたっては、主として国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド受益証券への投資を通じ、以下の方針に基づき運用を行います。

・東京証券取引所第一部に上場されている株式^{*1}を主要投資対象とします。

・運用の効率化を図るため、ならびに追加設定・一部解約等に対応するため、株価指数先物取引等を利用することがあります。

・原則として、株式と株価指数先物取引等の合計の組入比率(株式の実質組入比率)は、高位を保つことを基本とします。

c.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。

「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。)

d.市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

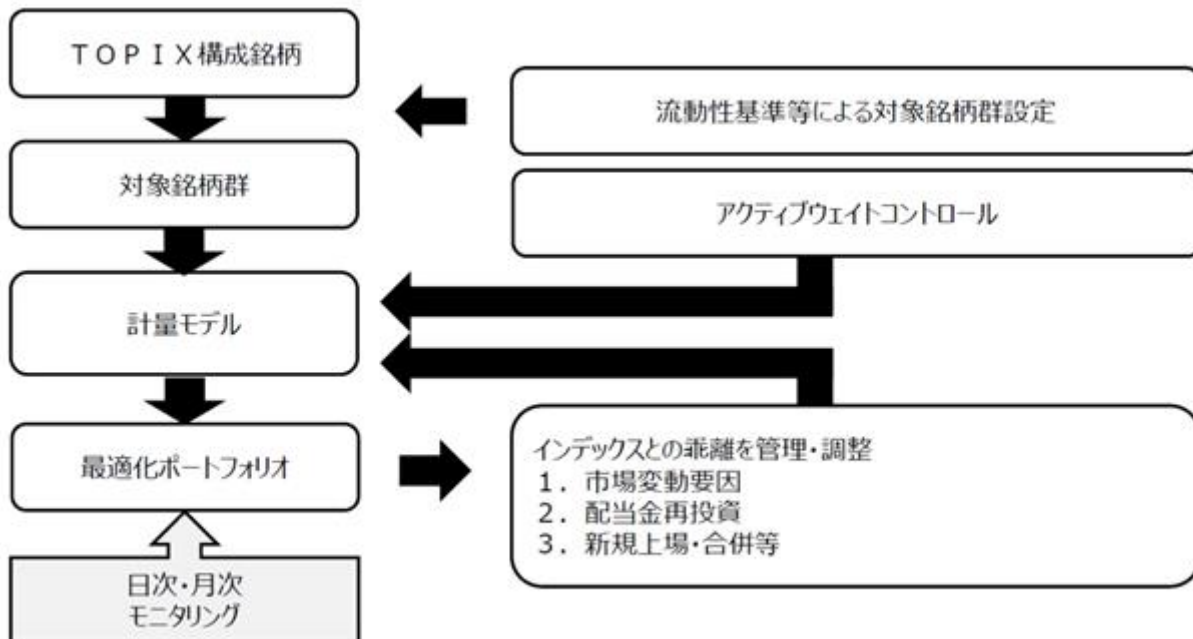
e.国内において行われる有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引(以下「有価証券先物取引等」といいます。)を行うことができます。

f.信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことができます。

g.信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引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、主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券への投資を通じ、以下のプロセスにより東京証券取引所第一部上場株式^{*2}に投資を行います。



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

*1 東証市場再編のため、2022年4月4日に「東京証券取引所第一部に上場されている株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄」に変更を行う予定です。

*2 東証市場再編のため、2022年4月4日に「東京証券取引所第一部上場株式」から「東証株価指数採用銘柄」に変更を行う予定です。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1.次に掲げる特定資産(「特定資産」とは投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)
 - a.有価証券
 - b.デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第27条、第28条および第29条に定めるものに限ります。)
 - c.金銭債権
 - d.約束手形
- 2.次に掲げる特定資産以外の資産
 - a.為替手形

有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドの受益証券(以下「マザーファンド受益証券」といいます。)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、かつ本邦通貨建のものに限ります。)に投資することを指図します。

- 1.株券または新株引受権証書
- 2.国債証券
- 3.地方債証券
- 4.特別の法律により法人が発行する債券
- 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.特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7.特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8.協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)または優先出資引受権を表示する証書
- 9.特定目的会社にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10.コマーシャル・ペーパー
- 11.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
- 12.外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.~11.の証券または証書の性質を有するもの
- 13.投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 14.投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 15.外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)

16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 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。)
20. 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。)
21. 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
22. 外国の者に対する権利で前記21.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、12.および17.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに12.および17.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券(外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

委託会社は、信託金を、 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、 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
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

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（人数60～70人程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施し、必要に応じて対応を指示します。

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

内部管理等のモニタリング

内部監査担当部署(人数10~20人程度)が運用、管理等に関する業務執行の適正性・妥当性・効率性等の観点からモニタリングを実施します。

b. ファンドの関係法人に関する管理

ファンドの関係法人である受託会社に対して、その業務に関する委託会社の管理担当部署は、内部統制に関する外部監査人による報告書等の定期的な提出を求め、必要に応じて具体的な事項に関するヒアリングを行う等の方法により、適切な業務執行体制にあることを確認します。

c. 運用体制に関する社内規則

運用体制に関する社内規則として運用管理規程および職務責任権限規程等を設けており、運用担当者の任務と権限の範囲を明示するほか、各投資対象の取り扱いに関して基準を設け、ファンドの商品性に則った適切な運用の実現を図ります。

また、売買執行、投資信託財産管理および法令遵守チェック等に関する各々の規程・内規を定めています。

運用体制は2021年12月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

年1回の毎決算時(原則として6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、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

1. 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益(繰越分およびマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。))を含みます。)および売買益(評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額)等の全額とします。
2. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。
3. 収益分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

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. 収益分配金の再投資に関する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、)に対し、お支払します。

(5)【投資制限】

a. 約款で定める投資制限

株式、新株引受権証券および新株予約権証券(約款 運用の基本方針 運用方法(3)投資制限、約款第21条、第23条および第24条)

1. 株式への実質投資割合には制限を設けません。
2. 委託会社は、新株引受権証券および新株予約権証券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. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、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。)に上場されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。なお、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができるものとし、
4. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の実質投資割合には制限を設けません。
5. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の実質投資割合が、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。

非株式[株式以外の資産](約款 運用の基本方針 運用方法 (2)投資態度)

非株式(株式以外の資産)への実質投資割合は、原則として信託財産総額の100分の50を超えないものとし、

投資信託証券(約款第21条)

委託会社は、投資信託証券(マザーファンド受益証券を除きます。)への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

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、ならびに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下、会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)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。

外貨建資産(約款 運用の基本方針 運用方法 (3)投資制限)

外貨建資産への投資は行いません。

信用取引(約款第26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、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. 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。
6. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または担保の受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引(約款第29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、ならびに価格変動リスクを回避するため、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. 当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信

託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

5. 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
6. 委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または担保の受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付(約款第30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総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の合計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38条)

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

b. 法令で定める投資制限

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

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

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

1. 基本方針

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

2. 運用方法

（1）投資対象

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

* 東証市場再編のため、2022年4月4日に「東京証券取引所第1部に上場されている株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄」に変更を行う予定です。

3【投資リスク】

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

- ・当ファンドは、主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券への投資を通じて値動きのある有価証券等に投資しますので、ファンドの基準価額は変動しま

す。したがって、元本や一定の投資成果が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。

- ・運用により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者の皆様に帰属します。
- ・投資信託は預金商品や保険商品ではなく、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
- ・登録金融機関が取扱う投資信託は、投資者保護基金の対象ではありません。
- ・投資信託は預貯金とは異なります。
- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。

当ファンドにおいて主として想定されるリスクは以下の通りですが、基準価額の変動要因はこれらに限定されるものではありません。なお、以下のリスクは、主にマザーファンドを通じて当ファンドが行う有価証券等への投資により発生します。

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、株式と株価指数先物取引等の合計の実質組入比率が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>

- ・当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- ・有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用が影響を受ける場合があります。
- ・当ファンドは、証券取引所における取引の停止等があるときには、一部解約の実行の請求の受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。

<その他の留意点>

当ファンドは、ベンチマークである東証株価指数(TOPIX、配当込み)の動きと連動する投資成果を目指しておりますが、追加設定・一部解約による運用資金の変動、株価指数の構成銘柄の一部を組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、株価指数先物取引の最低取引単位の存在、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可能性があります。

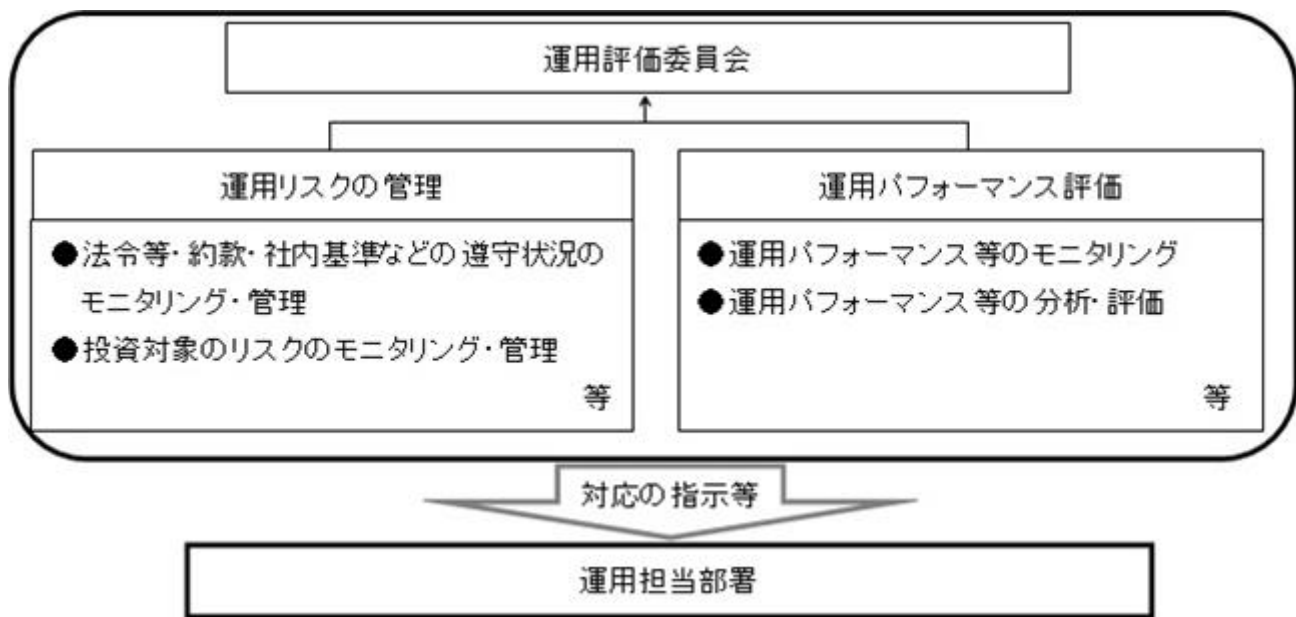
<収益分配金に関する留意点>

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

(2) リスク管理体制

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

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



リスク管理体制は2021年12月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

流動性リスク管理体制

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

流動性リスク管理体制は2022年1月1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>

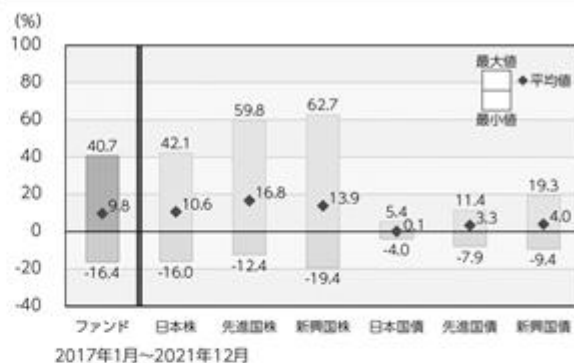
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX)* (配当込み)	[東証株価指数(TOPIX)]は、日本の株式市場を広く網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数は、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。

*東証株価指数(TOPIX)は、東証市場再編に伴い、2022年4月4日付で指数の算出要領が変更される予定です。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込手数料(受益権1口当たり)は、取得申込日の基準価額に、2.2%(税抜2%)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。

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。

「分配金再投資コース」を選択された場合収益分配金は、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。

販売会社で支払いを受けた償還金をもって、当ファンドの受益権の取得申込みをする場合、販売会社によっては、取得申込口数のうち当該償還金額の範囲内で取得する口数についての申込手数料を、上記に定める申込手数料の規定にかかわらず、販売会社が独自に定めることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、償還乗換えの際に償還金の支払いを受けたことを証する書類を提示いただくことがあります。

< 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、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.66%（税抜0.6%）の率を乗じて得た額とします。

その配分（税抜）については、純資産総額の残高に応じて次の通りとします。

純資産総額	委託会社	販売会社	受託会社
200億円以下の部分	0.18%	0.35%	0.07%
200億円超500億円以下の部分	0.14%	0.40%	0.06%
500億円超の部分	0.10%	0.45%	0.05%

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、信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該費用にかかる消費税等相当額、外国における資産の保管等に要する費用、特定資産の価格調査に要する費用、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。なお、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、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するものとします。

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12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ついては販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」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12月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	2,237,373,017	99.98
内 日本	2,237,373,017	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	528,634	0.02
純資産総額	2,237,901,651	100.00

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

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

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	460,374,079,780	97.10
内 日本	460,374,079,780	97.10
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	13,737,792,182	2.90
純資産総額	474,111,871,962	100.00

その他資産の投資状況

2021年12月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	16,155,120,000	3.41
内 日本	16,155,120,000	3.41

(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12月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	678,115,117	3.2142 2,179,660,622	3.2994 2,237,373,017	- -	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12月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.98
合計	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2021年12月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	8,562,300	1,860.24 15,927,978,509	2,105.50 18,027,922,650	- -	3.80
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	1,059,000	12,460.78 13,195,968,735	14,475.00 15,329,025,000	- -	3.23
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	153,100	62,531.25 9,573,534,455	72,280.00 11,066,068,000	- -	2.33
4	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,246,100	6,091.76 7,590,949,062	6,972.00 8,687,809,200	- -	1.83
5	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	107,200	50,058.61 5,366,283,808	66,280.00 7,105,216,000	- -	1.50
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	10,455,700	597.70 6,249,451,689	624.90 6,533,766,930	- -	1.38
7	日本電産 日本	株式 電気機器	438,100	13,258.12 5,808,383,294	13,520.00 5,923,112,000	- -	1.25
8	信越化学工業 日本	株式 化学	284,300	18,792.94 5,342,835,202	19,920.00 5,663,256,000	- -	1.19
9	HOYA 日本	株式 精密機器	329,900	15,403.67 5,081,671,479	17,110.00 5,644,589,000	- -	1.19
10	ダイキン工業 日本	株式 機械	215,400	24,224.10 5,217,873,260	26,090.00 5,619,786,000	- -	1.19
11	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,735,200	2,970.69 5,154,745,133	3,150.00 5,465,880,000	- -	1.15
12	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	994,500	7,504.30 7,463,033,384	5,434.00 5,404,113,000	- -	1.14
13	任天堂 日本	株式 その他製品	95,500	58,009.13 5,539,872,270	53,650.00 5,123,575,000	- -	1.08
14	日立製作所 日本	株式 電気機器	813,000	5,857.89 4,762,464,897	6,230.00 5,064,990,000	- -	1.07
15	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,247,600	3,315.73 4,136,711,370	3,652.00 4,556,235,200	- -	0.96
16	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,153,900	3,813.72 4,400,660,954	3,943.00 4,549,827,700	- -	0.96
17	村田製作所 日本	株式 電気機器	496,600	9,041.10 4,489,811,537	9,157.00 4,547,366,200	- -	0.96

18	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,330,900	3,241.36 4,313,932,109	3,230.00 4,298,807,000	- -	0.91
19	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,328,500	3,495.53 4,643,824,024	3,137.00 4,167,504,500	- -	0.88
20	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,164,500	3,298.28 3,840,849,885	3,518.00 4,096,711,000	- -	0.86
21	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,209,300	3,446.24 4,167,540,981	3,362.00 4,065,666,600	- -	0.86
22	第一三共 日本	株式 医薬品	1,328,400	2,891.18 3,840,653,397	2,925.00 3,885,570,000	- -	0.82
23	S M C 日本	株式 機械	49,500	68,503.89 3,390,942,629	77,590.00 3,840,705,000	- -	0.81
24	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	190,900	17,848.48 3,407,275,308	19,395.00 3,702,505,500	- -	0.78
25	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,512,500	1,488.45 3,739,732,576	1,454.50 3,654,431,250	- -	0.77
26	ファナック 日本	株式 電気機器	148,400	25,813.47 3,830,720,370	24,380.00 3,617,992,000	- -	0.76
27	デンソー 日本	株式 輸送用機器	372,100	7,734.08 2,877,854,385	9,529.00 3,545,740,900	- -	0.75
28	三井物産 日本	株式 卸売業	1,292,800	2,380.20 3,077,123,948	2,723.50 3,520,940,800	- -	0.74
29	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	549,100	5,761.03 3,163,383,379	6,392.00 3,509,847,200	- -	0.74
30	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	651,400	4,727.75 3,079,656,377	5,056.00 3,293,478,400	- -	0.69

（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12月30日現在

種類	投資比率（％）
株式	97.10
合計	97.10

（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12月30日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
電気機器	国内	19.57
輸送用機器		7.89
情報・通信業		7.75
化学		6.56
サービス業		6.12
機械		5.38
卸売業		5.13

医薬品	4.64
銀行業	4.61
小売業	3.97
食料品	3.17
陸運業	2.84
精密機器	2.82
その他製品	2.15
建設業	2.11
保険業	1.91
不動産業	1.78
その他金融業	1.11
電気・ガス業	1.03
ガラス・土石製品	0.76
鉄鋼	0.73
証券、商品先物取引業	0.71
非鉄金属	0.67
ゴム製品	0.66
金属製品	0.62
海運業	0.50
繊維製品	0.45
石油・石炭製品	0.39
空運業	0.38
鉱業	0.22
パルプ・紙	0.20
倉庫・運輸関連業	0.17
水産・農林業	0.08
合計	97.10

（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）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2021年12月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0403月	買建	811	16,072,833,630	16,155,120,000	3.41

（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12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11計算期間末 (2012年6月11日)	1,079	1,096	0.5824	0.5914
第12計算期間末 (2013年6月10日)	1,488	1,503	0.8893	0.8983
第13計算期間末 (2014年6月10日)	1,402	1,415	0.9866	0.9956
第14計算期間末 (2015年6月10日)	1,425	1,446	1.3059	1.3249
第15計算期間末 (2016年6月10日)	1,181	1,196	1.0682	1.0817
第16計算期間末 (2017年6月12日)	1,253	1,275	1.2754	1.2974
第17計算期間末 (2018年6月11日)	1,486	1,511	1.4292	1.4532
第18計算期間末 (2019年6月10日)	1,569	1,594	1.2438	1.2638
第19計算期間末 (2020年6月10日)	1,710	1,739	1.3036	1.3256
第20計算期間末 (2021年6月10日)	2,050	2,086	1.5621	1.5901
2020年12月末日	1,849	-	1.4582	-
2021年1月末日	1,854	-	1.4596	-
2月末日	1,899	-	1.5030	-
3月末日	2,091	-	1.5879	-
4月末日	2,020	-	1.5422	-
5月末日	2,062	-	1.5633	-
6月末日	2,092	-	1.5530	-
7月末日	2,067	-	1.5187	-
8月末日	2,163	-	1.5654	-
9月末日	2,298	-	1.6326	-
10月末日	2,276	-	1.6084	-
11月末日	2,156	-	1.5493	-
12月末日	2,237	-	1.6023	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第11計算期間	0.0090
第12計算期間	0.0090
第13計算期間	0.0090
第14計算期間	0.0190
第15計算期間	0.0135
第16計算期間	0.0220

第17計算期間	0.0240
第18計算期間	0.0200
第19計算期間	0.0220
第20計算期間	0.0280
2021年6月11日～2021年12月10日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第11計算期間	9.28
第12計算期間	54.24
第13計算期間	11.95
第14計算期間	34.29
第15計算期間	17.17
第16計算期間	21.46
第17計算期間	13.94
第18計算期間	11.57
第19計算期間	6.6
第20計算期間	22.0
2021年6月11日～2021年12月10日	1.6

(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】

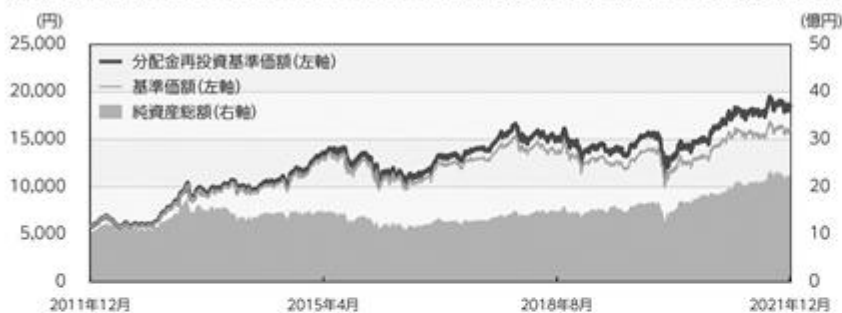
	設定口数	解約口数
第11計算期間	307,480,597	186,115,860
第12計算期間	404,731,479	585,087,054
第13計算期間	415,192,775	667,030,372
第14計算期間	282,452,469	612,472,406
第15計算期間	275,893,672	261,261,712
第16計算期間	235,331,201	358,383,357
第17計算期間	289,202,857	232,412,332
第18計算期間	421,909,161	199,827,190
第19計算期間	439,743,322	389,648,264
第20計算期間	520,353,240	519,915,581
2021年6月11日～ 2021年12月10日	294,445,427	209,035,012

(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12月30日

基準価額・純資産の推移 (2011年12月30日～2021年12月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

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

(設定日:2001年6月29日)

分配の推移(税引前)

2017年 6月	220円
2018年 6月	240円
2019年 6月	200円
2020年 6月	220円
2021年 6月	280円
設定来累計	2,525円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

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

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	97.10
内 日本	97.10
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.90
合計(純資産総額)	100.00

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	3.80
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	3.23
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	2.33
4	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.83
5	東京エレクトロン	株式	日本	電気機器	1.50
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.38
7	日本電産	株式	日本	電気機器	1.25
8	信越化学工業	株式	日本	化学	1.19
9	HOYA	株式	日本	精密機器	1.19
10	ダイキン工業	株式	日本	機械	1.19

その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株債指数先物取引(買建)	3.41

株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	19.57
2	輸送用機器	7.89
3	情報・通信業	7.75
4	化学	6.56
5	サービス業	6.12

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。

○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3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「分配金受取コース」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「分配金再投資コース」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け(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) 収益分配金の再投資に関する契約に基づき、収益分配金を再投資する際は、1口単位で購入できるものとします。なお、その際の受益権の価額は、原則として各計算期間終了日の基準価額とします。
- (9) 当ファンドを確定拠出年金制度に基づき取得する場合については、確定拠出年金に係る法令・制度等の定めに従って取得申込等の手続が行われます。
- (10) 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、販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け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いて、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3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時から午後5時までとさせていただきます。

（以下同じ。）

- (5) 解約代金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として4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。
- (7) 委託会社は、証券取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止すること、およびすでに受け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、受益者が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け付けたものとし、前記(4)の規定に準じた価額とします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは、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	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2001年6月29日から無期限とします。

(4)【計算期間】

原則として毎年6月11日から翌年6月10日までとします。なお、第1期計算期間は、2001年6月29日から2002年6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、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、受益権の総口数が10億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することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
2. 委託会社は、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、受託会社は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ません。）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、「分配金再投資コース」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ません。）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20期計算期間(2020年6月11日から2021年6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トピックスファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第19期 2020年6月10日現在	第20期 2021年6月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	34,838,624	7,582,781
親投資信託受益証券	1,710,070,763	2,049,805,918
未収入金	2,062,000	56,842,000
流動資産合計	1,746,971,387	2,114,230,699
資産合計	1,746,971,387	2,114,230,699
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	28,865,577	36,750,262
未払解約金	2,588,357	20,710,363
未払受託者報酬	600,845	763,014
未払委託者報酬	4,549,649	5,777,385
その他未払費用	12,380	15,399
流動負債合計	36,616,808	64,016,423
負債合計	36,616,808	64,016,423
純資産の部		
元本等		
元本	1,312,071,726	1,312,509,385
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	398,282,853	737,704,891
(分配準備積立金)	199,227,728	370,776,427
元本等合計	1,710,354,579	2,050,214,276
純資産合計	1,710,354,579	2,050,214,276
負債純資産合計	1,746,971,387	2,114,230,699

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第19期 自 2019年6月11日 至 2020年6月10日	第20期 自 2020年6月11日 至 2021年6月10日
営業収益		
受取利息	-	4
有価証券売買等損益	128,489,082	393,559,155
営業収益合計	128,489,082	393,559,159
営業費用		
支払利息	2,085	1,233
受託者報酬	1,201,730	1,443,734
委託者報酬	9,099,335	10,931,631
その他費用	25,350	29,236
営業費用合計	10,328,500	12,405,834
営業利益又は営業損失()	118,160,582	381,153,325
経常利益又は経常損失()	118,160,582	381,153,325
当期純利益又は当期純損失()	118,160,582	381,153,325
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	14,187,088	62,811,617
期首剰余金又は期首欠損金()	307,651,948	398,282,853
剰余金増加額又は欠損金減少額	111,473,592	220,086,247
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	111,473,592	220,086,247
剰余金減少額又は欠損金増加額	95,950,604	162,255,655
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	95,950,604	162,255,655
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	28,865,577	36,750,262
期末剰余金又は期末欠損金()	398,282,853	737,704,891

(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20期	
	自 2020年6月11日	至 2021年6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19期	第20期
	2020年6月10日現在	2021年6月10日現在
1. 期首元本額	1,261,976,668円	1,312,071,726円
期中追加設定元本額	439,743,322円	520,353,240円
期中一部解約元本額	389,648,264円	519,915,581円
2. 受益権の総数	1,312,071,726口	1,312,509,385口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第19期	第20期
	自 2019年6月11日 至 2020年6月10日	自 2020年6月11日 至 2021年6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(35,106,944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(897,096,795円)及び分配準備積立金(192,986,361円)より分配対象収益は1,125,190,100円(1万口当たり8,575.67円)であり、うち28,865,577円(1万口当たり220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(39,290,202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(233,873,756円)、信託約款に規定される収益調整金(964,485,754円)及び分配準備積立金(134,362,731円)より分配対象収益は1,372,012,443円(1万口当たり10,453.35円)であり、うち36,750,262円(1万口当たり280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19期	第20期
	自 2019年6月11日 至 2020年6月10日	自 2020年6月11日 至 2021年6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19期 2020年6月10日現在	第20期 2021年6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19期 2020年6月10日現在	第20期 2021年6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	116,490,553	2,098,659
合計	116,490,553	2,098,659

（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19期 2020年6月10日現在	第20期 2021年6月10日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3036円 (13,036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6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トピックスマザーファンド	22,066,923	50,272,863	
	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	624,054,510	1,999,533,055	
親投資信託受益証券 合計		646,121,433	2,049,805,918	
合計			2,049,805,918	

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

MHAMトピックスマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年6月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	35,559,546
未収配当金	13,094,393
前払金	140,000
差入委託証拠金	1,620,000
流動資産合計	50,413,939
資産合計	50,413,939
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	140,660
流動負債合計	140,660
負債合計	140,660
純資産の部	
元本等	
元本	22,066,923
剰余金	
剰余金又は欠損金()	28,206,356
元本等合計	50,273,279
純資産合計	50,273,279
負債純資産合計	50,413,939

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6月11日 至 2021年6月10日
1. 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。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2021年6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	951,148,987円
同期中追加設定元本額	226,821,588円
同期中一部解約元本額	1,155,903,652円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMトピックスファンド	22,066,923円
計	22,066,923円
2. 受益権の総数	22,066,923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6月11日 至 2021年6月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年6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 該当事項はありません。</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	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2021年6月10日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	39,170,000	-	39,030,000	140,000
合計	39,170,000	-	39,030,000	140,000

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

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

(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6月10日現在	
1口当たり純資産額	2.2782円
(1万口当たり純資産額)	(22,782円)

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

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。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年6月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,716,137,263
株式	330,176,948,320
未収配当金	1,981,519,020
前払金	16,040,000
差入委託証拠金	324,810,000
流動資産合計	338,215,454,603
資産合計	338,215,454,603
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	16,602,940
未払解約金	197,547,000
流動負債合計	214,149,940
負債合計	214,149,940
純資産の部	
元本等	
元本	105,488,606,697
剰余金	
剰余金又は欠損金()	232,512,697,966
元本等合計	338,001,304,663
純資産合計	338,001,304,663
負債純資産合計	338,215,454,603

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6月11日 至 2021年6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6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	88,625,678,965円
同期中追加設定元本額	88,745,517,160円
同期中一部解約元本額	71,882,589,428円
元本の内訳	
ファンド名	
One DC 国内株式インデックスファンド	17,264,288,368円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,408,018,732円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,715,589円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	10,003,727円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	9,898,206円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	28,390,792円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	22,365,487円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	12,648,979円
たわらノーロード TOPIX	978,397,506円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	743,230,746円
たわらノーロード バランス(堅実型)	28,074,376円
たわらノーロード バランス(標準型)	176,232,334円
たわらノーロード バランス(積極型)	264,032,599円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	1,949,381円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	117,203,400円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	277,355,198円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	190,362,099円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	271,831,961円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	527,525円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,319,135円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	9,677,792円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,730,282円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	8,812,620円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	34,356,328,229円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	1,006,660,938円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,353,144,978円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,483,010,163円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	328,583,313円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,126,818,055円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,085,934,545円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	31,447,514円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,023,706,018円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	20,716,814円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	302,674,443円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	268,787,041円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	482,736,111円
投資のソムリエ	16,343,418,089円
クルーズコントロール	518,845,760円
投資のソムリエ<DC年金>	872,128,587円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	287,321,539円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	417,240,327円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	6,209,517円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	15,936,294円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	310,979,155円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,229,366,548円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	25,116,921円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	11,921,995円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,942,216円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	55,391,314円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	124,387,019円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,749,633,754円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	257,945,438円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	18,864,804円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	9,365,795円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	8,783,123円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	28,507,675円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,729,115円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	2,103,877円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	71,844,951円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	978,384円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	1,689,646円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	4,740,953円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-05(適格機関投資家限定)	69,981,863円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	412,926,414円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	37,071,090円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	414,921,481円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	2,653,869円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	62,300,082円

D I A Mグローバル・バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	108,682,957円
D I A M国際分散バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	6,661,635円
D I A M国際分散バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	31,186,598円
D I A M国内重視バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	7,574,152円
D I A M国内重視バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	1,999,653円
D I A M世界バランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	14,056,062円
D I A M世界バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	38,649,364円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	621,980,459円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限定)	683,843,950円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	1,945,303,468円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	78,101,675円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	34,463,517円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	335,653,761円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	90,092,736円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	1,586,832円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	425,030,462円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	23,356,581円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	88,626,712円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	215,615,318円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	291,042,216円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	42,446,943円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	18,892,320円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定)	321,266,809円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定)	992,662,363円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定)	1,314,318,490円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定)	52,594,563円
M H A Mトピックスファンド	624,054,510円
計	105,488,606,697円
2 . 受益権の総数	105,488,606,697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6月11日 至 2021年6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6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>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。</p>
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	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年6月10日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)
株式	4,647,192,163
合計	4,647,192,163

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2021年2月9日から2021年6月10日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2021年6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	8,173,735,000	-	8,157,270,000	16,465,000
合計	8,173,735,000	-	8,157,270,000	16,465,000

(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6月10日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,2041円 (32,041円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年6月10日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,700	2,947.00	16,797,900	
日本水産	154,900	547.00	84,730,300	
マルハニチロ	26,100	2,477.00	64,649,700	
ハウスイ	800	958.00	766,400	
雪国まいたけ	13,700	1,736.00	23,783,200	
カネコ種苗	4,900	1,501.00	7,354,900	
サカタのタネ	20,000	3,865.00	77,300,000	
ホクト	14,100	1,936.00	27,297,600	
ホクリヨウ	2,400	768.00	1,843,200	
ヒノキヤグループ	4,100	2,554.00	10,471,400	
ショーボンドホールディングス	23,800	4,675.00	111,265,000	
ミライト・ホールディングス	58,000	1,939.00	112,462,000	
タマホーム	10,200	2,095.00	21,369,000	
サンヨーホームズ	2,400	730.00	1,752,000	
日本アクア	6,700	570.00	3,819,000	
ファーストコーポレーション	5,200	761.00	3,957,200	
ベステラ	3,000	1,595.00	4,785,000	
Robot Home	31,000	276.00	8,556,000	
キャンディル	2,800	558.00	1,562,400	
スペースバリューホールディングス	20,300	700.00	14,210,000	
住石ホールディングス	28,800	128.00	3,686,400	

日鉄鉱業	4,000	6,440.00	25,760,000
三井松島ホールディングス	7,000	979.00	6,853,000
INPEX	614,000	815.00	500,410,000
石油資源開発	22,000	2,037.00	44,814,000
K&Oエナジーグループ	7,900	1,363.00	10,767,700
ダイセキ環境ソリューション	3,100	969.00	3,003,900
第一カッター興業	4,100	1,416.00	5,805,600
明豊ファシリティワークス	5,500	843.00	4,636,500
安藤・間	106,900	820.00	87,658,000
東急建設	49,000	751.00	36,799,000
コムシスホールディングス	59,100	3,220.00	190,302,000
ビーアールホールディングス	19,600	514.00	10,074,400
高松コンストラクショングループ	10,500	2,054.00	21,567,000
東建コーポレーション	5,200	9,760.00	50,752,000
ソネック	1,700	965.00	1,640,500
ヤマウラ	7,400	907.00	6,711,800
オリエンタル白石	56,000	294.00	16,464,000
大成建設	120,000	3,740.00	448,800,000
大林組	385,600	930.00	358,608,000
清水建設	361,500	939.00	339,448,500
飛鳥建設	10,700	1,085.00	11,609,500
長谷工コーポレーション	126,200	1,533.00	193,464,600
松井建設	15,500	727.00	11,268,500
銭高組	1,200	4,360.00	5,232,000
鹿島建設	282,600	1,491.00	421,356,600
不動テトラ	9,400	1,853.00	17,418,200
大末建設	5,200	1,028.00	5,345,600
鉄建建設	7,700	1,898.00	14,614,600
西松建設	27,500	3,395.00	93,362,500
三井住友建設	93,100	495.00	46,084,500
大豊建設	8,500	4,070.00	34,595,000
前田建設工業	96,700	985.00	95,249,500
佐田建設	7,000	483.00	3,381,000
ナカノフドー建設	10,200	408.00	4,161,600
奥村組	21,100	2,988.00	63,046,800
東鉄工業	16,600	2,357.00	39,126,200
イチケン	2,500	1,838.00	4,595,000
富士ピー・エス	5,300	569.00	3,015,700
浅沼組	4,500	4,610.00	20,745,000
戸田建設	160,200	795.00	127,359,000
熊谷組	17,800	2,912.00	51,833,600
北野建設	2,100	2,405.00	5,050,500
植木組	3,200	1,530.00	4,896,000
矢作建設工業	17,200	723.00	12,435,600
ピーエス三菱	12,600	654.00	8,240,400
日本ハウスホールディングス	26,600	352.00	9,363,200
大東建託	42,300	12,060.00	510,138,000
新日本建設	16,400	888.00	14,563,200
NIPPO	31,900	3,010.00	96,019,000
東亜道路工業	2,400	4,590.00	11,016,000

前田道路	23,800	2,221.00	52,859,800
日本道路	3,900	7,890.00	30,771,000
東亜建設工業	10,300	2,510.00	25,853,000
日本国土開発	37,900	584.00	22,133,600
若築建設	7,000	1,444.00	10,108,000
東洋建設	43,300	569.00	24,637,700
五洋建設	163,900	801.00	131,283,900
世紀東急工業	18,500	876.00	16,206,000
福田組	4,400	4,955.00	21,802,000
日本ドライケミカル	3,000	1,807.00	5,421,000
住友林業	90,700	2,185.00	198,179,500
日本基礎技術	12,200	507.00	6,185,400
巴コーポレーション	17,200	390.00	6,708,000
大和ハウス工業	356,200	3,348.00	1,192,557,600
ライト工業	22,200	1,827.00	40,559,400
積水ハウス	418,200	2,213.00	925,476,600
日特建設	10,200	778.00	7,935,600
北陸電気工事	6,900	1,222.00	8,431,800
ユアテック	22,100	740.00	16,354,000
日本リーテック	7,900	1,743.00	13,769,700
四電工	1,700	3,335.00	5,669,500
中電工	17,800	2,334.00	41,545,200
関電工	62,900	910.00	57,239,000
きんでん	78,300	1,872.00	146,577,600
東京エネシス	12,700	989.00	12,560,300
トーエネック	4,000	3,690.00	14,760,000
住友電設	10,900	2,368.00	25,811,200
日本電設工業	21,100	1,834.00	38,697,400
協和エクシオ	58,300	2,723.00	158,750,900
新日本空調	10,200	2,095.00	21,369,000
日本工営	7,500	3,120.00	23,400,000
九電工	27,400	3,480.00	95,352,000
三機工業	27,500	1,430.00	39,325,000
日揮ホールディングス	128,500	1,081.00	138,908,500
中外炉工業	4,100	2,037.00	8,351,700
ヤマト	12,400	804.00	9,969,600
太平電業	8,700	2,666.00	23,194,200
高砂熱学工業	34,900	1,844.00	64,355,600
三晃金属工業	1,600	2,480.00	3,968,000
NEC ネットエスアイ	39,800	1,756.00	69,888,800
朝日工業社	2,300	2,982.00	6,858,600
明星工業	25,200	750.00	18,900,000
大気社	18,700	3,400.00	63,580,000
ダイダン	8,700	2,677.00	23,289,900
日比谷総合設備	12,700	1,857.00	23,583,900
ニッポン	36,600	1,579.00	57,791,400
日清製粉グループ本社	139,400	1,655.00	230,707,000
日東富士製粉	800	7,020.00	5,616,000
昭和産業	10,500	3,005.00	31,552,500
鳥越製粉	11,100	795.00	8,824,500

中部飼料	15,200	1,193.00	18,133,600
フィード・ワン	17,000	771.00	13,107,000
東洋精糖	1,700	1,194.00	2,029,800
日本甜菜製糖	6,800	1,649.00	11,213,200
D M三井製糖ホールディングス	10,000	1,864.00	18,640,000
塩水港精糖	14,800	226.00	3,344,800
日新製糖	4,700	1,741.00	8,182,700
L I F U L L	40,700	363.00	14,774,100
ミクシィ	29,900	2,841.00	84,945,900
ジェイエイシーリクルートメント	7,700	1,806.00	13,906,200
日本M&Aセンター	192,600	2,689.00	517,901,400
メンバーズ	3,300	3,315.00	10,939,500
中広	1,200	358.00	429,600
UTグループ	17,000	2,978.00	50,626,000
アイティメディア	4,000	1,752.00	7,008,000
タケエイ	13,200	1,315.00	17,358,000
E・Jホールディングス	4,500	1,104.00	4,968,000
夢真ビーネックスグループ	31,200	1,295.00	40,404,000
コシダカホールディングス	31,400	644.00	20,221,600
アルトナー	2,800	846.00	2,368,800
パソナグループ	12,700	2,033.00	25,819,100
C D S	2,400	1,525.00	3,660,000
リンクアンドモチベーション	21,400	634.00	13,567,600
G C A	15,100	1,013.00	15,296,300
エス・エム・エス	39,800	3,280.00	130,544,000
サニーサイドアップグループ	4,100	865.00	3,546,500
パーソルホールディングス	117,600	2,257.00	265,423,200
リニカル	6,800	843.00	5,732,400
クックパッド	36,700	260.00	9,542,000
エスクリ	3,900	516.00	2,012,400
アイ・ケイ・ケイ	5,700	684.00	3,898,800
森永製菓	29,000	3,470.00	100,630,000
中村屋	2,400	3,780.00	9,072,000
江崎グリコ	34,000	4,300.00	146,200,000
名糖産業	5,700	1,554.00	8,857,800
井村屋グループ	7,000	2,329.00	16,303,000
不二家	7,900	2,191.00	17,308,900
山崎製パン	92,500	1,607.00	148,647,500
第一屋製パン	2,900	960.00	2,784,000
モロゾフ	1,700	5,390.00	9,163,000
亀田製菓	7,200	4,465.00	32,148,000
寿スピリッツ	11,900	7,880.00	93,772,000
カルビー	56,200	2,510.00	141,062,000
森永乳業	22,600	5,710.00	129,046,000
六甲バター	8,400	1,623.00	13,633,200
ヤクルト本社	84,700	6,230.00	527,681,000
明治ホールディングス	81,700	6,760.00	552,292,000
雪印メグミルク	29,800	2,183.00	65,053,400
プリマハム	17,300	2,962.00	51,242,600
日本ハム	47,100	4,365.00	205,591,500

林兼産業	3,900	618.00	2,410,200
丸大食品	12,400	1,707.00	21,166,800
S Foods	11,000	3,385.00	37,235,000
柿安本店	4,100	2,568.00	10,528,800
伊藤ハム米久ホールディングス	80,100	698.00	55,909,800
学情	4,100	1,411.00	5,785,100
スタジオアリス	5,800	2,258.00	13,096,400
クロスキャット	3,000	1,011.00	3,033,000
シミックホールディングス	5,700	1,561.00	8,897,700
エブコ	2,800	944.00	2,643,200
システナ	43,100	1,901.00	81,933,100
N J S	2,800	2,114.00	5,919,200
デジタルアーツ	7,000	8,770.00	61,390,000
日鉄ソリューションズ	17,900	3,385.00	60,591,500
総合警備保障	46,900	5,060.00	237,314,000
キューブシステム	6,400	1,034.00	6,617,600
いちご	134,800	368.00	49,606,400
エイジア	1,800	2,119.00	3,814,200
日本駐車場開発	133,000	160.00	21,280,000
コア	5,200	1,445.00	7,514,000
カカクコム	86,900	3,445.00	299,370,500
アイロムグループ	4,100	2,120.00	8,692,000
セントケア・ホールディング	8,700	1,083.00	9,422,100
サイネックス	2,400	703.00	1,687,200
ルネサンス	7,400	1,355.00	10,027,000
ディップ	18,200	3,575.00	65,065,000
S B Sホールディングス	9,100	3,395.00	30,894,500
デジタルホールディングス	8,000	2,386.00	19,088,000
新日本科学	14,100	771.00	10,871,100
キャリアデザインセンター	2,400	1,100.00	2,640,000
ベネフィット・ワン	43,000	3,420.00	147,060,000
エムスリー	207,300	7,297.00	1,512,668,100
ツカダ・グローバルホールディング	9,900	429.00	4,247,100
プラス	1,500	628.00	942,000
アウトソーシング	67,300	2,068.00	139,176,400
ウェルネット	11,900	523.00	6,223,700
ワールドホールディングス	4,100	2,758.00	11,307,800
ディー・エヌ・エー	49,700	2,235.00	111,079,500
博報堂DYホールディングス	163,400	1,795.00	293,303,000
ぐるなび	20,300	615.00	12,484,500
タカミヤ	14,700	531.00	7,805,700
ジャパンベストレスキューシステム	9,100	770.00	7,007,000
ファンコミュニケーションズ	32,200	385.00	12,397,000
ライク	3,000	2,099.00	6,297,000
ビジネス・ブレークスルー	5,400	426.00	2,300,400
エスプール	30,100	929.00	27,962,900
W D Bホールディングス	5,500	2,756.00	15,158,000
手間いらず	1,500	6,450.00	9,675,000
ティア	7,400	475.00	3,515,000
C D G	1,300	1,578.00	2,051,400

アドウェイズ	19,100	837.00	15,986,700
バリューコマース	7,900	3,125.00	24,687,500
インフォマート	119,000	970.00	115,430,000
サッポロホールディングス	42,300	2,357.00	99,701,100
アサヒグループホールディングス	269,800	5,443.00	1,468,521,400
キリンホールディングス	523,400	2,300.00	1,203,820,000
宝ホールディングス	91,400	1,504.00	137,465,600
オエノンホールディングス	35,800	381.00	13,639,800
養命酒製造	4,100	1,855.00	7,605,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	94,400	1,845.00	174,168,000
サントリー食品インターナショナル	82,600	4,235.00	349,811,000
ダイドーグループホールディングス	7,200	5,090.00	36,648,000
伊藤園	37,500	6,640.00	249,000,000
キーコーヒー	12,400	2,111.00	26,176,400
ユニカフェ	4,100	999.00	4,095,900
ジャパンフーズ	1,500	1,214.00	1,821,000
日清オイリオグループ	15,800	3,070.00	48,506,000
不二製油グループ本社	30,300	2,775.00	84,082,500
かどや製油	900	4,035.00	3,631,500
J-オイルミルズ	11,700	1,931.00	22,592,700
ローソン	30,500	4,960.00	151,280,000
サンエー	9,100	4,300.00	39,130,000
カワチ薬品	8,500	2,283.00	19,405,500
エービーシー・マート	18,800	6,460.00	121,448,000
ハードオフコーポレーション	5,700	787.00	4,485,900
高千穂交易	4,900	1,132.00	5,546,800
アスクル	19,600	1,869.00	36,632,400
ゲオホールディングス	16,300	1,211.00	19,739,300
アダストリア	16,700	2,040.00	34,068,000
ジーフット	7,900	415.00	3,278,500
シー・ヴィ・エス・バイエリア	2,200	425.00	935,000
オルパヘルスケアホールディングス	1,600	1,734.00	2,774,400
伊藤忠食品	2,400	5,230.00	12,552,000
くら寿司	14,100	3,900.00	54,990,000
キャンドウ	5,700	1,963.00	11,189,100
エレマテック	9,600	1,233.00	11,836,800
アイケイ	2,400	786.00	1,886,400
パルグループホールディングス	10,600	1,718.00	18,210,800
JALUX	3,300	1,907.00	6,293,100
エディオン	51,300	1,066.00	54,685,800
あらた	9,600	4,130.00	39,648,000
サーラコーポレーション	25,100	600.00	15,060,000
ワッツ	5,500	937.00	5,153,500
トーマンデバイス	1,600	3,960.00	6,336,000
ハローズ	4,500	2,720.00	12,240,000
JPHホールディングス	33,600	283.00	9,508,800
フジオフードグループ本社	10,200	1,383.00	14,106,600
あみやき亭	2,400	2,979.00	7,149,600
東京エレクトロン デバイス	4,100	5,660.00	23,206,000

ひらまつ	22,500	227.00	5,107,500
フィールズ	10,600	483.00	5,119,800
双日	667,300	346.00	230,885,800
アルフレッサホールディングス	125,500	1,698.00	213,099,000
大黒天物産	3,900	7,800.00	30,420,000
ハニーズホールディングス	9,400	1,039.00	9,766,600
ファーマライズホールディングス	3,300	780.00	2,574,000
キッコーマン	88,600	7,180.00	636,148,000
味の素	293,600	2,641.50	775,544,400
ブルドックソース	5,700	2,265.00	12,910,500
キュービー	68,700	2,577.00	177,039,900
ハウス食品グループ本社	46,200	3,265.00	150,843,000
カゴメ	50,500	3,005.00	151,752,500
焼津水産化学工業	5,000	984.00	4,920,000
アリアケジャパン	11,600	6,800.00	78,880,000
ピエトロ	1,200	1,684.00	2,020,800
エバラ食品工業	2,400	2,556.00	6,134,400
やまみ	1,000	1,943.00	1,943,000
ニチレイ	58,900	2,878.00	169,514,200
横浜冷凍	32,100	890.00	28,569,000
東洋水産	63,400	4,290.00	271,986,000
イトアンドホールディングス	4,200	1,890.00	7,938,000
大冷	1,500	1,963.00	2,944,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,000	778.00	5,446,000
日清食品ホールディングス	48,400	7,830.00	378,972,000
永谷園ホールディングス	6,200	2,190.00	13,578,000
一正蒲鉾	4,100	969.00	3,972,900
フジッコ	13,500	1,931.00	26,068,500
ロック・フィールド	13,400	1,519.00	20,354,600
日本たばこ産業	661,800	2,188.00	1,448,018,400
ケンコーマヨネーズ	7,600	1,675.00	12,730,000
わらべや日洋ホールディングス	8,100	2,070.00	16,767,000
なとり	7,200	1,893.00	13,629,600
イフジ産業	2,400	942.00	2,260,800
ピックルスコーポレーション	2,800	3,270.00	9,156,000
ファーマフーズ	11,700	2,892.00	33,836,400
北の達人コーポレーション	42,900	485.00	20,806,500
ユーグレナ	62,700	878.00	55,050,600
紀文食品	7,200	1,487.00	10,706,400
スター・マイカ・ホールディングス	6,400	1,121.00	7,174,400
SREホールディングス	1,800	6,150.00	11,070,000
ADワークスグループ	23,300	167.00	3,891,100
片倉工業	16,300	1,545.00	25,183,500
グンゼ	8,900	4,750.00	42,275,000
ヒューリック	257,300	1,315.00	338,349,500
神栄	1,600	1,421.00	2,273,600
ラサ商事	6,800	914.00	6,215,200
アルペン	9,200	2,873.00	26,431,600
ハブ	3,900	798.00	3,112,200
ラクーンホールディングス	8,700	2,635.00	22,924,500

クオールホールディングス	16,200	1,512.00	24,494,400
アルコニックス	12,800	1,496.00	19,148,800
神戸物産	83,700	2,848.00	238,377,600
ソリトンシステムズ	6,000	1,660.00	9,960,000
ジーンズホールディングス	8,200	7,930.00	65,026,000
ビックカメラ	72,000	1,123.00	80,856,000
DCMホールディングス	74,900	1,054.00	78,944,600
ペッパーフードサービス	13,600	455.00	6,188,000
ハイパー	2,200	547.00	1,203,400
MonotaRO	172,100	2,625.00	451,762,500
東京一番フーズ	2,500	595.00	1,487,500
DDホールディングス	5,500	620.00	3,410,000
あいホールディングス	17,300	2,167.00	37,489,100
ディービーエックス	4,100	987.00	4,046,700
きちりホールディングス	3,600	616.00	2,217,600
アークランドサービスホールディングス	10,200	2,317.00	23,633,400
J.フロントリテイリング	144,500	1,163.00	168,053,500
ドトール・日レスホールディングス	19,200	1,735.00	33,312,000
マツモトキヨシホールディングス	50,000	4,960.00	248,000,000
ブロンコビリー	6,400	2,540.00	16,256,000
ZOZO	71,400	3,745.00	267,393,000
トレジャー・ファクトリー	3,600	1,010.00	3,636,000
物語コーポレーション	6,400	7,290.00	46,656,000
ココカラファイン	10,700	8,330.00	89,131,000
三越伊勢丹ホールディングス	211,800	866.00	183,418,800
東洋紡	47,600	1,355.00	64,498,000
ユニチカ	35,600	376.00	13,385,600
富士紡ホールディングス	5,700	4,090.00	23,313,000
日清紡ホールディングス	75,100	928.00	69,692,800
倉敷紡績	11,000	2,027.00	22,297,000
ダイワボウホールディングス	54,900	1,744.00	95,745,600
シキボウ	6,900	952.00	6,568,800
日東紡績	18,100	3,455.00	62,535,500
トヨタ紡織	35,900	2,243.00	80,523,700
マクニカ・富士エレホールディングス	28,900	2,446.00	70,689,400
Hamee	2,900	1,633.00	4,735,700
ラクト・ジャパン	5,400	2,837.00	15,319,800
ウエルシアホールディングス	64,100	3,430.00	219,863,000
クリエイトSDホールディングス	17,800	3,245.00	57,761,000
グリムス	3,600	1,762.00	6,343,200
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,500	716.00	15,394,000
八洲電機	9,400	984.00	9,249,600
メディアスホールディングス	7,000	1,035.00	7,245,000
レスターホールディングス	12,700	1,881.00	23,888,700
ジュテックホールディングス	2,400	1,014.00	2,433,600
丸善CHIホールディングス	15,800	401.00	6,335,800
大光	5,200	686.00	3,567,200
OCHIホールディングス	3,700	1,286.00	4,758,200

TO K A Iホールディングス	59,000	886.00	52,274,000	
黒谷	3,300	951.00	3,138,300	
ミサワ	2,400	678.00	1,627,200	
ティーライフ	1,700	1,450.00	2,465,000	
C o m i n i x	1,700	754.00	1,281,800	
エー・ピーホールディングス	2,100	481.00	1,010,100	
三洋貿易	12,000	1,304.00	15,648,000	
チムニー	3,700	1,413.00	5,228,100	
シュッピン	8,100	1,037.00	8,399,700	
ビューティガレージ	2,100	3,685.00	7,738,500	
オイシックス・ラ・大地	15,900	3,480.00	55,332,000	
ウイン・パートナーズ	8,800	979.00	8,615,200	
ネクステージ	20,900	1,651.00	34,505,900	
ジョイフル本田	35,600	1,377.00	49,021,200	
鳥貴族ホールディングス	3,300	1,959.00	6,464,700	
ホットランド	8,900	1,422.00	12,655,800	
すかいらくホールディングス	154,300	1,605.00	247,651,500	
S F Pホールディングス	5,700	1,540.00	8,778,000	
綿半ホールディングス	9,000	1,247.00	11,223,000	
日本毛織	39,800	1,002.00	39,879,600	
ダイトウボウ	20,000	103.00	2,060,000	
トーア紡コーポレーション	4,100	464.00	1,902,400	
ダイドーリミテッド	17,100	177.00	3,026,700	
ヨシックス	2,400	2,460.00	5,904,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	35,400	1,096.00	38,798,400	
三栄建築設計	4,900	2,014.00	9,868,600	
野村不動産ホールディングス	73,700	3,025.00	222,942,500	
三重交通グループホールディングス	24,800	492.00	12,201,600	
サムティ	17,100	2,052.00	35,089,200	
ディア・ライフ	17,000	473.00	8,041,000	
コーセーアールイー	3,700	640.00	2,368,000	
日本商業開発	7,500	1,884.00	14,130,000	
プレサンスコーポレーション	20,000	1,506.00	30,120,000	
フィル・カンパニー	2,300	2,957.00	6,801,100	
T H Eグローバル社	7,500	255.00	1,912,500	
ハウスコム	1,200	1,245.00	1,494,000	
日本管理センター	6,400	1,316.00	8,422,400	
サンセイランディック	3,700	888.00	3,285,600	
エストラスト	1,300	682.00	886,600	
フージャースホールディングス	20,000	752.00	15,040,000	
オープンハウス	38,100	5,330.00	203,073,000	
東急不動産ホールディングス	329,600	731.00	240,937,600	
飯田グループホールディングス	101,100	3,035.00	306,838,500	
イーグランド	2,400	1,033.00	2,479,200	
ムゲンエステート	7,500	529.00	3,967,500	
帝国繊維	13,500	2,124.00	28,674,000	
日本コークス工業	103,900	104.00	10,805,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,200	1,366.00	8,469,200	
ミタチ産業	3,000	659.00	1,977,000	

BEENOS	5,700	3,725.00	21,232,500	
あさひ	8,900	1,435.00	12,771,500	
日本調剤	7,400	1,614.00	11,943,600	
コスモス薬品	12,400	15,390.00	190,836,000	
シップヘルスケアホールディングス	42,600	2,582.00	109,993,200	
トーエル	5,700	819.00	4,668,300	
ソフトクリエイイトホールディングス	4,900	2,266.00	11,103,400	
オンリー	2,500	502.00	1,255,000	
セブン&アイ・ホールディングス	473,800	4,857.00	2,301,246,600	
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	64,600	934.00	60,336,400	
明治電機工業	3,100	1,339.00	4,150,900	
ツルハホールディングス	26,600	13,600.00	361,760,000	
デリカフーズホールディングス	5,500	635.00	3,492,500	
スターティアホールディングス	2,400	1,372.00	3,292,800	
サンマルクホールディングス	9,400	1,701.00	15,989,400	
フェリシモ	2,500	1,392.00	3,480,000	
トリドールホールディングス	30,000	1,871.00	56,130,000	
帝人	113,300	1,785.00	202,240,500	
東レ	872,100	752.00	655,819,200	
クラレ	189,600	1,117.00	211,783,200	
旭化成	798,300	1,266.00	1,010,647,800	
サカイオーベックス	3,100	3,040.00	9,424,000	
TOKYO BASE	10,600	788.00	8,352,800	
稲葉製作所	7,000	1,522.00	10,654,000	
宮地エンジニアリンググループ	4,000	2,317.00	9,268,000	
トーカロ	31,500	1,413.00	44,509,500	
アルファ	4,700	1,144.00	5,376,800	
SUMCO	155,500	2,523.00	392,326,500	
川田テクノロジーズ	2,400	3,705.00	8,892,000	
RS Technologies	4,000	5,780.00	23,120,000	
ジェイテックコーポレーション	900	3,020.00	2,718,000	
信和	6,700	729.00	4,884,300	
ビーロット	5,700	645.00	3,676,500	
ファーストブラザーズ	2,400	1,032.00	2,476,800	
ハウズドゥ	5,700	1,055.00	6,013,500	
シーアールイー	3,000	1,584.00	4,752,000	
プロパティエージェント	2,100	2,338.00	4,909,800	
ケイアイスター不動産	3,900	5,010.00	19,539,000	
アグレ都市デザイン	2,300	1,088.00	2,502,400	
グッドコムアセット	5,700	1,399.00	7,974,300	
ジェイ・エス・ビー	2,400	3,545.00	8,508,000	
テンポイノベーション	3,300	969.00	3,197,700	
グローバル・リンク・マネジメント	2,200	881.00	1,938,200	
住江織物	2,300	1,888.00	4,342,400	
日本フェルト	5,700	452.00	2,576,400	
イチカワ	1,300	1,367.00	1,777,100	
エコナックホールディングス	21,400	92.00	1,968,800	
日東製網	1,300	1,534.00	1,994,200	
芦森工業	2,400	1,056.00	2,534,400	

アツギ	9,500	617.00	5,861,500
ウイルプラスホールディングス	2,100	1,262.00	2,650,200
J Mホールディングス	9,100	2,214.00	20,147,400
コメダホールディングス	26,700	2,063.00	55,082,100
サツドラホールディングス	1,500	2,092.00	3,138,000
アレンザホールディングス	9,200	1,278.00	11,757,600
串カツ田中ホールディングス	3,000	1,977.00	5,931,000
バロックジャパンリミテッド	8,400	808.00	6,787,200
クスリのアオキホールディングス	12,100	8,170.00	98,857,000
ダイニック	3,900	775.00	3,022,500
共和レザー	7,000	719.00	5,033,000
ピーバンドットコム	1,500	805.00	1,207,500
力の源ホールディングス	5,700	676.00	3,853,200
FOOD & LIFE COMPANIES	70,800	4,810.00	340,548,000
アセンテック	2,900	1,408.00	4,083,200
セーレン	29,800	2,119.00	63,146,200
ソトー	4,100	806.00	3,304,600
東海染工	1,300	1,136.00	1,476,800
小松マテーレ	19,800	959.00	18,988,200
ワコールホールディングス	30,100	2,581.00	77,688,100
ホギメディカル	16,200	3,485.00	56,457,000
クラウドシアホールディングス	2,400	309.00	741,600
T S Iホールディングス	35,800	354.00	12,673,200
マツオカコーポレーション	4,000	1,786.00	7,144,000
ワールド	15,600	1,602.00	24,991,200
T I S	120,800	2,774.00	335,099,200
J N Sホールディングス	5,700	575.00	3,277,500
電算システム	4,500	2,957.00	13,306,500
グリー	74,100	574.00	42,533,400
G M Oペパボ	800	4,945.00	3,956,000
コーエーテクモホールディングス	31,800	5,110.00	162,498,000
三菱総合研究所	5,400	3,835.00	20,709,000
ボルテージ	2,800	493.00	1,380,400
電算	900	2,450.00	2,205,000
A G S	6,400	872.00	5,580,800
ファインデックス	10,200	1,027.00	10,475,400
ブレインパッド	2,900	4,935.00	14,311,500
K L a b	22,200	711.00	15,784,200
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	15,900	1,134.00	18,030,600
イーブクイニシアティブジャパン	2,100	3,135.00	6,583,500
ネクソン	305,000	2,535.00	773,175,000
アイスタイル	36,500	557.00	20,330,500
エムアップホールディングス	3,000	2,772.00	8,316,000
エイチーム	8,300	1,737.00	14,417,100
エニグモ	11,400	1,408.00	16,051,200
テクノスジャパン	9,100	609.00	5,541,900
e n i s h	6,100	515.00	3,141,500
コロプラ	39,500	846.00	33,417,000

オルトプラス	7,000	436.00	3,052,000
ブロードリーフ	59,800	522.00	31,215,600
クロス・マーケティンググループ	5,700	701.00	3,995,700
デジタルハーツホールディングス	5,500	1,532.00	8,426,000
システム情報	8,800	975.00	8,580,000
メディアドゥ	4,500	4,955.00	22,297,500
じげん	29,000	415.00	12,035,000
ブイキューブ	6,500	2,683.00	17,439,500
エンカレッジ・テクノロジー	2,400	675.00	1,620,000
サイバーリンクス	4,000	1,659.00	6,636,000
ディー・エル・イー	9,400	307.00	2,885,800
フィックスターズ	12,600	895.00	11,277,000
CARTA HOLDINGS	4,900	1,722.00	8,437,800
オブティム	8,500	2,309.00	19,626,500
セレス	4,000	3,485.00	13,940,000
SHIFT	6,000	15,740.00	94,440,000
特種東海製紙	7,400	4,355.00	32,227,000
ティーガイア	12,800	1,957.00	25,049,600
セック	1,700	2,630.00	4,471,000
日本アジアグループ	11,700	912.00	10,670,400
テクマトリックス	18,700	1,634.00	30,555,800
プロシップ	3,600	1,347.00	4,849,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	29,000	2,280.00	66,120,000
GMOペイメントゲートウェイ	23,100	13,760.00	317,856,000
ザッパラス	4,900	584.00	2,861,600
システムリサーチ	3,600	2,099.00	7,556,400
インターネットイニシアティブ	32,000	3,100.00	99,200,000
さくらインターネット	12,600	630.00	7,938,000
ヴィンクス	3,300	988.00	3,260,400
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,400	5,190.00	12,456,000
SRAホールディングス	6,500	2,778.00	18,057,000
システムインテグレータ	3,300	644.00	2,125,200
朝日ネット	9,900	711.00	7,038,900
eBASE	14,200	859.00	12,197,800
アバント	12,800	1,574.00	20,147,200
アドソル日進	4,100	2,409.00	9,876,900
ODKソリューションズ	2,200	846.00	1,861,200
フリービット	7,200	946.00	6,811,200
コムチュア	11,000	2,356.00	25,916,000
サイバーコム	2,300	1,537.00	3,535,100
アステリア	8,700	833.00	7,247,100
アイル	6,800	1,521.00	10,342,800
王子ホールディングス	542,000	652.00	353,384,000
日本製紙	53,100	1,283.00	68,127,300
三菱製紙	17,700	369.00	6,531,300
北越コーポレーション	86,500	587.00	50,775,500
中越パルプ工業	4,900	1,247.00	6,110,300
巴川製紙所	4,000	808.00	3,232,000

大王製紙	58,300	1,736.00	101,208,800
阿波製紙	3,000	424.00	1,272,000
マークライNZ	5,000	3,170.00	15,850,000
メディカル・データ・ビジョン	13,700	2,179.00	29,852,300
gumi	16,500	1,059.00	17,473,500
ショーケース	2,400	775.00	1,860,000
モバイルファクトリー	2,400	1,281.00	3,074,400
テラスカイ	4,000	2,676.00	10,704,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,400	2,079.00	11,226,600
PCIホールディングス	4,500	1,241.00	5,584,500
パイプドHD	2,400	1,696.00	4,070,400
アイビーシー	2,100	1,011.00	2,123,100
ネオジャパン	2,400	1,699.00	4,077,600
PR TIMES	2,400	3,525.00	8,460,000
ラクス	36,400	2,194.00	79,861,600
ランドコンピュータ	1,500	1,099.00	1,648,500
ダブルスタンダード	1,500	5,060.00	7,590,000
オーブンドア	7,200	2,672.00	19,238,400
マイネット	4,000	782.00	3,128,000
アカツキ	4,900	3,700.00	18,130,000
ベネフィットジャパン	800	2,030.00	1,624,000
Ubicomホールディングス	3,000	3,295.00	9,885,000
カナミックネットワーク	10,900	659.00	7,183,100
ノムラシステムコーポレーション	5,400	295.00	1,593,000
レンゴー	124,200	950.00	117,990,000
トーモク	7,400	1,943.00	14,378,200
ザ・パック	9,100	2,790.00	25,389,000
チェンジ	22,200	2,848.00	63,225,600
シンクロ・フード	7,200	428.00	3,081,600
オークネット	6,400	1,394.00	8,921,600
キャピタル・アセット・プランニング	1,500	1,090.00	1,635,000
セグエグループ	2,900	1,135.00	3,291,500
エイトレッド	2,400	2,243.00	5,383,200
AOI TYO HOLDINGS	12,400	899.00	11,147,600
マクロミル	24,600	839.00	20,639,400
ピーグリー	2,400	1,406.00	3,374,400
オロ	3,900	3,505.00	13,669,500
ユーザーローカル	1,800	4,130.00	7,434,000
テモナ	2,400	1,140.00	2,736,000
ニーズウェル	2,400	613.00	1,471,200
サインポスト	2,500	877.00	2,192,500
昭和電工	91,400	3,600.00	329,040,000
住友化学	947,600	610.00	578,036,000
住友精化	5,700	3,610.00	20,577,000
日産化学	66,400	5,540.00	367,856,000
ラサ工業	4,000	1,884.00	7,536,000
クレハ	10,300	6,370.00	65,611,000
多木化学	4,700	5,460.00	25,662,000
テイカ	8,700	1,362.00	11,849,400

石原産業	21,300	1,048.00	22,322,400
片倉コープアグリ	2,400	1,214.00	2,913,600
日本曹達	17,000	3,375.00	57,375,000
東ソー	186,000	1,998.00	371,628,000
トクヤマ	35,600	2,324.00	82,734,400
セントラル硝子	22,900	2,088.00	47,815,200
東亜合成	73,700	1,168.00	86,081,600
大阪ソーダ	12,400	2,492.00	30,900,800
関東電化工業	28,400	1,007.00	28,598,800
デンカ	44,000	3,735.00	164,340,000
イビデン	59,100	5,410.00	319,731,000
信越化学工業	222,700	18,535.00	4,127,744,500
日本カーバイド工業	4,200	1,306.00	5,485,200
堺化学工業	8,500	1,900.00	16,150,000
第一稀元素化学工業	12,200	1,743.00	21,264,600
エア・ウォーター	122,700	1,769.00	217,056,300
日本酸素ホールディングス	98,900	2,099.00	207,591,100
日本化学工業	3,300	2,892.00	9,543,600
東邦アセチレン	2,100	1,213.00	2,547,300
日本パーカライジング	60,600	1,091.00	66,114,600
高圧ガス工業	19,200	647.00	12,422,400
チタン工業	1,500	1,933.00	2,899,500
四国化成工業	16,200	1,235.00	20,007,000
戸田工業	2,400	2,407.00	5,776,800
ステラ ケミファ	6,500	3,070.00	19,955,000
保土谷化学工業	3,600	3,960.00	14,256,000
日本触媒	21,900	5,580.00	122,202,000
大日精化工業	10,200	2,407.00	24,551,400
カネカ	31,200	4,390.00	136,968,000
協和キリン	123,700	3,670.00	453,979,000
三菱瓦斯化学	120,700	2,488.00	300,301,600
三井化学	104,000	3,810.00	396,240,000
J S R	120,800	3,195.00	385,956,000
東京応化工業	20,800	6,930.00	144,144,000
大阪有機化学工業	11,000	4,265.00	46,915,000
三菱ケミカルホールディングス	805,200	894.40	720,170,880
K H ネオケム	19,900	2,714.00	54,008,600
ダイセル	161,700	910.00	147,147,000
住友ベークライト	19,100	4,985.00	95,213,500
積水化学工業	254,700	1,853.00	471,959,100
日本ゼオン	108,700	1,541.00	167,506,700
アイカ工業	33,400	4,000.00	133,600,000
宇部興産	60,600	2,325.00	140,895,000
積水樹脂	19,900	2,079.00	41,372,100
タキロンシーアイ	26,500	586.00	15,529,000
旭有機材	6,900	1,357.00	9,363,300
ニチバン	6,500	1,766.00	11,479,000
リケンテクノス	29,000	582.00	16,878,000
大倉工業	5,700	2,425.00	13,822,500
積水化成品工業	16,200	591.00	9,574,200

群栄化学工業	2,400	2,449.00	5,877,600
タイガースポリマー	7,000	451.00	3,157,000
ミライアル	4,000	1,410.00	5,640,000
ダイキアクシス	4,400	878.00	3,863,200
ダイキョーニシカワ	25,300	738.00	18,671,400
竹本容器	4,200	991.00	4,162,200
森六ホールディングス	6,600	2,330.00	15,378,000
恵和	1,700	3,040.00	5,168,000
日本化薬	74,500	1,045.00	77,852,500
カーリットホールディングス	11,900	675.00	8,032,500
E P Sホールディングス	15,900	1,798.00	28,588,200
ソルクシーズ	4,500	1,040.00	4,680,000
レッグス	2,500	2,732.00	6,830,000
プレステージ・インターナショナル	44,000	710.00	31,240,000
フェイス	3,900	839.00	3,272,100
プロトコーポレーション	14,400	1,182.00	17,020,800
アミューズ	6,500	2,369.00	15,398,500
野村総合研究所	209,600	3,450.00	723,120,000
ドリームインキュベータ	3,700	974.00	3,603,800
サイバネットシステム	8,700	823.00	7,160,100
クイック	7,300	1,248.00	9,110,400
T A C	6,500	233.00	1,514,500
C Eホールディングス	6,400	532.00	3,404,800
日本システム技術	2,300	1,543.00	3,548,900
電通グループ	132,000	3,790.00	500,280,000
インテージホールディングス	15,000	1,536.00	23,040,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,500	1,065.00	5,857,500
東邦システムサイエンス	3,000	920.00	2,760,000
ぴあ	3,300	3,545.00	11,698,500
イオンファンタジー	4,400	2,354.00	10,357,600
ソースネクスト	56,600	323.00	18,281,800
シーティーエス	13,200	880.00	11,616,000
ネクシィーズグループ	3,700	946.00	3,500,200
インフォコム	10,900	3,085.00	33,626,500
メディカルシステムネットワーク	10,600	735.00	7,791,000
日本精化	8,700	1,474.00	12,823,800
扶桑化学工業	9,400	4,030.00	37,882,000
トリケミカル研究所	10,200	3,485.00	35,547,000
HEROZ	3,300	2,496.00	8,236,800
ラクスル	13,200	4,805.00	63,426,000
I P S	2,300	2,779.00	6,391,700
F I G	13,200	291.00	3,841,200
システムサポート	3,600	1,417.00	5,101,200
A D E K A	55,500	1,903.00	105,616,500
日油	45,500	5,750.00	261,625,000
ミヨシ油脂	4,500	1,241.00	5,584,500
新日本理化	19,600	274.00	5,370,400
ハリマ化成グループ	9,000	905.00	8,145,000
イーソル	6,400	1,109.00	7,097,600
アルテリア・ネットワークス	13,300	1,657.00	22,038,100

EDULAB	1,000	5,490.00	5,490,000	
東海ソフト	1,400	1,411.00	1,975,400	
ウイングアーク1st	6,400	2,398.00	15,347,200	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,200	2,198.00	4,835,600	
サーバーワークス	1,000	3,860.00	3,860,000	
東名	800	1,064.00	851,200	
ヴィッツ	500	2,083.00	1,041,500	
トピラシステムズ	1,000	1,340.00	1,340,000	
Sansan	10,600	8,780.00	93,068,000	
Link-U	800	1,197.00	957,600	
ギフトィ	7,300	3,240.00	23,652,000	
花王	294,600	6,797.00	2,002,396,200	
第一工業製薬	4,100	3,420.00	14,022,000	
石原ケミカル	3,000	2,192.00	6,576,000	
日華化学	4,400	1,261.00	5,548,400	
ニイタカ	2,400	2,508.00	6,019,200	
三洋化成工業	7,200	5,580.00	40,176,000	
ベース	1,300	5,270.00	6,851,000	
武田薬品工業	1,023,000	3,767.00	3,853,641,000	
アステラス製薬	1,066,100	1,909.50	2,035,717,950	
大日本住友製薬	91,000	2,340.00	212,940,000	
塩野義製薬	154,700	5,839.00	903,293,300	
わかもと製薬	14,700	328.00	4,821,600	
日本新薬	34,900	8,480.00	295,952,000	
ピオフェルミン製薬	2,400	3,130.00	7,512,000	
中外製薬	384,700	4,267.00	1,641,514,900	
科研製薬	21,000	4,765.00	100,065,000	
エーザイ	135,700	10,000.00	1,357,000,000	
理研ビタミン	11,700	1,558.00	18,228,600	
ロート製薬	58,700	2,899.00	170,171,300	
小野薬品工業	282,600	2,463.50	696,185,100	
久光製薬	35,700	5,820.00	207,774,000	
有機合成薬品工業	9,400	326.00	3,064,400	
持田製薬	17,100	3,745.00	64,039,500	
参天製薬	214,100	1,511.00	323,505,100	
扶桑薬品工業	4,000	2,322.00	9,288,000	
日本ケミファ	1,200	2,600.00	3,120,000	
ツムラ	41,000	3,700.00	151,700,000	
日医工	34,900	961.00	33,538,900	
テルモ	377,100	4,473.00	1,686,768,300	
H.U.グループホールディングス	32,900	2,902.00	95,475,800	
キッセイ薬品工業	21,900	2,170.00	47,523,000	
生化学工業	21,900	1,084.00	23,739,600	
栄研化学	21,700	2,169.00	47,067,300	
日水製薬	5,000	982.00	4,910,000	
鳥居薬品	7,700	2,525.00	19,442,500	
JCRファーマ	34,700	3,400.00	117,980,000	
東和薬品	17,800	2,562.00	45,603,600	
富士製薬工業	8,400	1,191.00	10,004,400	

ゼリア新薬工業	22,400	2,103.00	47,107,200
第一三共	966,000	2,497.00	2,412,102,000
キョーリン製薬ホールディングス	27,400	1,745.00	47,813,000
大幸薬品	15,000	1,066.00	15,990,000
ダイト	7,900	3,405.00	26,899,500
大塚ホールディングス	255,800	4,695.00	1,200,981,000
大正製薬ホールディングス	29,100	6,280.00	182,748,000
ペプチドリーム	62,500	4,925.00	307,812,500
大日本塗料	13,600	850.00	11,560,000
日本ペイントホールディングス	496,200	1,642.00	814,760,400
関西ペイント	135,300	2,918.00	394,805,400
神東塗料	9,500	199.00	1,890,500
中国塗料	29,000	900.00	26,100,000
日本特殊塗料	9,000	1,152.00	10,368,000
藤倉化成	16,500	531.00	8,761,500
太陽ホールディングス	8,900	5,250.00	46,725,000
D I C	50,800	2,905.00	147,574,000
サカタインクス	26,500	1,058.00	28,037,000
東洋インキS Cホールディングス	25,500	2,096.00	53,448,000
T & K T O K A	9,600	822.00	7,891,200
アルプス技研	10,400	1,996.00	20,758,400
サニックス	18,200	379.00	6,897,800
ダイオーズ	2,400	1,027.00	2,464,800
日本空調サービス	12,900	726.00	9,365,400
オリエンタルランド	125,000	16,225.00	2,028,125,000
フォーカスシステムズ	7,900	902.00	7,125,800
ダスキン	27,400	2,588.00	70,911,200
パーク24	65,000	2,511.00	163,215,000
明光ネットワークジャパン	15,000	592.00	8,880,000
ファルコホールディングス	5,700	1,730.00	9,861,000
クレスコ	8,100	1,716.00	13,899,600
フジ・メディア・ホールディングス	125,000	1,264.00	158,000,000
秀英予備校	2,800	401.00	1,122,800
田谷	1,700	551.00	936,700
ラウンドワン	40,000	1,478.00	59,120,000
リゾートトラスト	53,800	1,900.00	102,220,000
オービック	38,100	20,110.00	766,191,000
ジャストシステム	17,100	5,980.00	102,258,000
T D C ソフト	10,600	1,011.00	10,716,600
Zホールディングス	1,657,800	499.80	828,568,440
ビー・エム・エル	15,200	3,685.00	56,012,000
トレンドマイクロ	64,400	5,590.00	359,996,000
りらいあコミュニケーションズ	17,900	1,331.00	23,824,900
I Dホールディングス	4,700	1,358.00	6,382,600
リソー教育	59,300	318.00	18,857,400
日本オラクル	24,500	9,800.00	240,100,000
早稲田アカデミー	4,500	913.00	4,108,500
アルファシステムズ	3,100	3,655.00	11,330,500
フューチャー	14,700	2,084.00	30,634,800
C A C Holdings	7,700	1,462.00	11,257,400

S Bテクノロジー	4,200	3,005.00	12,621,000
トーセ	3,300	812.00	2,679,600
ユー・エス・エス	131,600	1,887.00	248,329,200
オービックビジネスコンサルタント	12,400	6,330.00	78,492,000
伊藤忠テクノソリューションズ	55,100	3,315.00	182,656,500
アイティフォー	15,800	781.00	12,339,800
東京個別指導学院	10,200	618.00	6,303,600
東計電算	1,800	4,805.00	8,649,000
サイバーエージェント	289,500	2,130.00	616,635,000
楽天グループ	547,600	1,279.00	700,380,400
エクスネット	2,400	1,021.00	2,450,400
クリーク・アンド・リバー社	6,000	1,526.00	9,156,000
モーニングスター	12,800	441.00	5,644,800
テー・オー・ダブリュー	20,600	346.00	7,127,600
大塚商会	65,400	6,060.00	396,324,000
サイボウズ	14,100	2,521.00	35,546,100
山田コンサルティンググループ	6,900	1,210.00	8,349,000
セントラルスポーツ	4,200	2,655.00	11,151,000
バラカ	3,100	1,649.00	5,111,900
電通国際情報サービス	14,900	3,860.00	57,514,000
A C C E S S	15,100	875.00	13,212,500
デジタルガレージ	19,900	4,710.00	93,729,000
イーエムシステムズ	20,000	908.00	18,160,000
ウェザーニューズ	3,600	5,760.00	20,736,000
C I J	8,300	854.00	7,088,200
ビジネスエンジニアリング	1,200	3,210.00	3,852,000
日本エンタープライズ	12,000	218.00	2,616,000
WOWOW	5,700	2,422.00	13,805,400
スカラ	10,600	830.00	8,798,000
インテリジェント ウェイブ	7,200	658.00	4,737,600
フルキャストホールディングス	10,200	2,182.00	22,256,400
エン・ジャパン	20,900	3,810.00	79,629,000
あすか製薬ホールディングス	14,000	1,043.00	14,602,000
サワイグループホールディングス	27,200	5,050.00	137,360,000
富士フイルムホールディングス	216,300	7,670.00	1,659,021,000
コニカミノルタ	249,400	642.00	160,114,800
資生堂	244,600	8,108.00	1,983,216,800
ライオン	159,800	1,965.00	314,007,000
高砂香料工業	7,600	2,697.00	20,497,200
マンダム	25,800	2,131.00	54,979,800
ミルボン	16,300	6,450.00	105,135,000
ファンケル	44,700	3,605.00	161,143,500
コーセー	23,000	18,040.00	414,920,000
コタ	7,900	1,437.00	11,352,300
シーボン	1,300	1,960.00	2,548,000
ポーラ・オルビスホールディングス	52,400	2,982.00	156,256,800
ノエビアホールディングス	10,400	5,250.00	54,600,000
アジュバンコスメジャパン	3,000	1,026.00	3,078,000
新日本製薬	2,400	2,137.00	5,128,800
エステー	8,000	1,798.00	14,384,000

アグロ カネショウ	4,700	1,419.00	6,669,300
コニシ	20,300	1,507.00	30,592,100
長谷川香料	21,400	2,300.00	49,220,000
星光P M C	7,200	831.00	5,983,200
小林製薬	34,400	9,320.00	320,608,000
荒川化学工業	10,200	1,220.00	12,444,000
メック	8,400	2,785.00	23,394,000
日本高純度化学	3,300	2,824.00	9,319,200
タカラバイオ	32,200	2,880.00	92,736,000
J C U	13,900	3,520.00	48,928,000
新田ゼラチン	7,900	644.00	5,087,600
O A T アグリオ	2,400	1,428.00	3,427,200
デクセリアルズ	34,300	2,200.00	75,460,000
アース製薬	9,200	6,660.00	61,272,000
北興化学工業	11,400	959.00	10,932,600
大成ラミック	4,100	2,740.00	11,234,000
クミアイ化学工業	50,800	923.00	46,888,400
日本農薬	22,000	518.00	11,396,000
富士興産	3,700	1,221.00	4,517,700
ニチレキ	14,700	1,346.00	19,786,200
ユシロ化学工業	7,000	1,215.00	8,505,000
ピービー・カストロール	4,400	1,397.00	6,146,800
富士石油	29,800	290.00	8,642,000
M O R E S C O	4,700	1,116.00	5,245,200
出光興産	136,400	2,695.00	367,598,000
E N E O S ホールディングス	1,850,000	464.80	859,880,000
コスモエネルギーホールディングス	38,900	2,448.00	95,227,200
テスホールディングス	7,100	1,761.00	12,503,100
横浜ゴム	71,100	2,291.00	162,890,100
T O Y O T I R E	64,600	2,281.00	147,352,600
ブリヂストン	327,200	4,934.00	1,614,404,800
住友ゴム工業	110,300	1,506.00	166,111,800
藤倉コンポジット	11,100	501.00	5,561,100
オカモト	7,600	4,300.00	32,680,000
アキレス	8,700	1,397.00	12,153,900
フコク	4,500	1,038.00	4,671,000
ニッタ	12,700	2,730.00	34,671,000
クリエートメディック	4,200	1,007.00	4,229,400
住友理工	23,800	740.00	17,612,000
三ツ星ベルト	14,900	1,776.00	26,462,400
バンドー化学	21,700	865.00	18,770,500
A G C	112,900	4,845.00	547,000,500
日本板硝子	62,500	619.00	38,687,500
石塚硝子	2,300	1,936.00	4,452,800
有沢製作所	17,200	914.00	15,720,800
日本山村硝子	5,500	941.00	5,175,500
日本電気硝子	45,500	2,681.00	121,985,500
オハラ	4,900	1,527.00	7,482,300
住友大阪セメント	22,200	3,045.00	67,599,000
太平洋セメント	72,800	2,489.00	181,199,200

リソルホールディングス	800	4,150.00	3,320,000	
日本ヒューム	11,600	733.00	8,502,800	
日本コンクリート工業	26,200	343.00	8,986,600	
三谷セキサン	5,700	4,135.00	23,569,500	
アジアパイルホールディングス	19,200	506.00	9,715,200	
東海カーボン	120,000	1,623.00	194,760,000	
日本カーボン	6,900	4,410.00	30,429,000	
東洋炭素	7,300	2,665.00	19,454,500	
ノリタケカンパニーリミテド	7,000	4,215.00	29,505,000	
TOTO	87,900	6,010.00	528,279,000	
日本碍子	135,000	2,023.00	273,105,000	
日本特殊陶業	93,500	1,719.00	160,726,500	
ダントーホールディングス	8,900	296.00	2,634,400	
MARUWA	4,100	10,630.00	43,583,000	
品川リフラクトリーズ	2,800	3,640.00	10,192,000	
黒崎播磨	2,200	4,575.00	10,065,000	
ヨータイ	8,900	1,153.00	10,261,700	
イソライト工業	5,500	630.00	3,465,000	
東京窯業	16,200	327.00	5,297,400	
ニッカトー	5,700	708.00	4,035,600	
フジインコーポレーテッド	10,000	5,020.00	50,200,000	
クニミネ工業	4,000	1,168.00	4,672,000	
エーアンドエーマテリアル	2,400	1,031.00	2,474,400	
ニチアス	31,200	2,805.00	87,516,000	
日本製鉄	580,200	1,951.50	1,132,260,300	
神戸製鋼所	222,700	733.00	163,239,100	
中山製鋼所	17,700	430.00	7,611,000	
合同製鐵	6,600	1,695.00	11,187,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	351,900	1,354.00	476,472,600	
東京製鐵	47,600	1,136.00	54,073,600	
共英製鋼	13,500	1,486.00	20,061,000	
大和工業	25,900	3,800.00	98,420,000	
東京鐵鋼	4,700	1,597.00	7,505,900	
大阪製鐵	6,500	1,136.00	7,384,000	
淀川製鋼所	16,500	2,260.00	37,290,000	
丸一鋼管	39,400	2,775.00	109,335,000	
モリ工業	3,700	2,443.00	9,039,100	
大同特殊鋼	19,900	5,530.00	110,047,000	
日本高周波鋼業	4,100	425.00	1,742,500	
日本冶金工業	9,400	2,345.00	22,043,000	
山陽特殊製鋼	14,700	1,603.00	23,564,100	
愛知製鋼	7,000	3,200.00	22,400,000	
日立金属	114,600	2,122.00	243,181,200	
日本金属	2,900	993.00	2,879,700	
大平洋金属	8,100	1,873.00	15,171,300	
新日本電工	78,700	310.00	24,397,000	
栗本鐵工所	5,700	1,694.00	9,655,800	
虹 技	1,300	1,179.00	1,532,700	
日本鑄鉄管	1,400	1,336.00	1,870,400	

日本製鋼所	36,900	2,894.00	106,788,600
三菱製鋼	9,000	886.00	7,974,000
日亜鋼業	18,500	300.00	5,550,000
日本精線	1,700	4,465.00	7,590,500
エンビプロ・ホールディングス	5,400	1,255.00	6,777,000
大紀アルミニウム工業所	18,200	1,186.00	21,585,200
日本軽金属ホールディングス	33,100	1,881.00	62,261,100
三井金属鉱業	32,800	3,180.00	104,304,000
東邦亜鉛	6,900	1,975.00	13,627,500
三菱マテリアル	80,300	2,293.00	184,127,900
住友金属鉱山	155,300	4,740.00	736,122,000
DOWAホールディングス	30,600	4,355.00	133,263,000
古河機械金属	20,200	1,302.00	26,300,400
エス・サイエンス	56,600	39.00	2,207,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,400	826.00	10,242,400
東邦チタニウム	21,900	973.00	21,308,700
UACJ	18,400	2,672.00	49,164,800
CKサンエツ	2,300	3,400.00	7,820,000
古河電気工業	38,000	2,903.00	110,314,000
住友電気工業	424,100	1,728.00	732,844,800
フジクラ	147,100	472.00	69,431,200
昭和電線ホールディングス	11,800	1,639.00	19,340,200
東京特殊電線	1,500	2,561.00	3,841,500
タツタ電線	21,300	574.00	12,226,200
カナレ電気	2,400	1,811.00	4,346,400
平河ヒューテック	6,800	1,209.00	8,221,200
リョービ	14,700	1,668.00	24,519,600
アーレスティ	15,100	520.00	7,852,000
アサヒホールディングス	45,300	2,338.00	105,911,400
東洋製罐グループホールディングス	77,400	1,598.00	123,685,200
ホッカンホールディングス	6,200	1,434.00	8,890,800
コロナ	7,000	939.00	6,573,000
横河ブリッジホールディングス	21,000	2,094.00	43,974,000
駒井ハルテック	2,400	1,795.00	4,308,000
高田機工	800	2,718.00	2,174,400
三和ホールディングス	114,600	1,361.00	155,970,600
文化シャッター	36,000	1,081.00	38,916,000
三協立山	15,500	798.00	12,369,000
アルインコ	8,000	994.00	7,952,000
東洋シャッター	2,400	702.00	1,684,800
LIXIL	167,300	2,889.00	483,329,700
日本フィルコン	8,800	498.00	4,382,400
ノーリツ	25,200	1,841.00	46,393,200
長府製作所	12,400	2,021.00	25,060,400
リンナイ	23,600	10,560.00	249,216,000
ユニプレス	20,200	1,010.00	20,402,000
ダイニチ工業	5,700	799.00	4,554,300
日東精工	15,600	562.00	8,767,200
三洋工業	1,300	1,854.00	2,410,200
岡部	25,200	669.00	16,858,800

ジーテクト	15,100	1,535.00	23,178,500
東ブレ	22,800	1,665.00	37,962,000
高周波熱錬	23,100	591.00	13,652,100
東京製鋼	8,700	1,220.00	10,614,000
サンコール	10,600	462.00	4,897,200
モリテックスチール	9,200	501.00	4,609,200
パイオラックス	18,000	1,519.00	27,342,000
エイチワン	12,000	814.00	9,768,000
日本発条	121,100	898.00	108,747,800
中央発條	4,000	1,223.00	4,892,000
アドバネクス	1,600	1,359.00	2,174,400
三浦工業	52,600	5,000.00	263,000,000
タクマ	41,200	1,807.00	74,448,400
テクノプロ・ホールディングス	23,600	7,970.00	188,092,000
アトラグループ	2,400	346.00	830,400
インターワークス	3,700	433.00	1,602,100
アイ・アールジャパンホールディングス	4,900	13,570.00	66,493,000
Keeper 技研	7,500	2,571.00	19,282,500
ファーストロジック	2,400	723.00	1,735,200
三機サービス	2,400	1,035.00	2,484,000
Gunosy	7,000	910.00	6,370,000
デザインワン・ジャパン	3,700	227.00	839,900
イー・ガーディアン	5,200	2,704.00	14,060,800
リブセンス	6,400	224.00	1,433,600
ジャパンマテリアル	36,400	1,314.00	47,829,600
ベクトル	14,700	946.00	13,906,200
ウチヤマホールディングス	6,000	408.00	2,448,000
チャーム・ケア・コーポレーション	8,700	1,137.00	9,891,900
キャリアリンク	3,900	2,256.00	8,798,400
IBJ	9,400	1,154.00	10,847,600
アサンテ	4,200	1,781.00	7,480,200
バリューHR	4,700	1,762.00	8,281,400
M&Aキャピタルパートナーズ	9,600	4,685.00	44,976,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,400	1,507.00	6,630,800
ERIホールディングス	2,800	597.00	1,671,600
アピスト	1,800	2,971.00	5,347,800
シグマクシス	6,400	2,135.00	13,664,000
ウィルグループ	8,700	1,014.00	8,821,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	17,100	249.00	4,257,900
メドピア	9,000	4,610.00	41,490,000
レアジョブ	1,600	1,843.00	2,948,800
リクルートホールディングス	841,800	5,805.00	4,886,649,000
エラン	16,200	1,323.00	21,432,600
ツガミ	25,200	1,714.00	43,192,800
オークマ	14,100	5,580.00	78,678,000
芝浦機械	12,700	2,555.00	32,448,500
アマダ	177,900	1,178.00	209,566,200
アイダエンジニアリング	31,900	875.00	27,912,500

滝澤鉄工所	4,100	1,136.00	4,657,600
F U J I	48,500	2,577.00	124,984,500
牧野フライス製作所	14,200	4,400.00	62,480,000
オーエスジー	60,100	1,898.00	114,069,800
ダイジェット工業	900	1,323.00	1,190,700
旭ダイヤモンド工業	32,500	537.00	17,452,500
D M G森精機	76,900	1,933.00	148,647,700
ソディック	26,800	1,112.00	29,801,600
ディスコ	16,500	33,750.00	556,875,000
日東工器	5,800	1,947.00	11,292,600
日進工具	9,500	1,545.00	14,677,500
パンチ工業	10,200	635.00	6,477,000
富士ダイス	6,700	653.00	4,375,100
土木管理総合試験所	5,700	381.00	2,171,700
ネットマーケティング	5,700	422.00	2,405,400
日本郵政	889,500	905.50	805,442,250
ベルシステム24ホールディングス	19,800	1,728.00	34,214,400
鎌倉新書	11,800	1,200.00	14,160,000
S M N	2,400	812.00	1,948,800
一蔵	1,700	443.00	753,100
グローバルキッズCOMPANY	2,300	999.00	2,297,700
エアトリ	7,300	3,025.00	22,082,500
アトラエ	7,200	2,162.00	15,566,400
ストライク	4,200	4,185.00	17,577,000
ソラスト	28,900	1,357.00	39,217,300
セラク	3,700	2,104.00	7,784,800
インソース	11,400	2,065.00	23,541,000
豊田自動織機	99,600	9,690.00	965,124,000
豊和工業	6,800	806.00	5,480,800
O K K	5,000	400.00	2,000,000
石川製作所	3,000	1,700.00	5,100,000
東洋機械金属	8,700	543.00	4,724,100
津田駒工業	2,400	896.00	2,150,400
エンシュウ	2,400	899.00	2,157,600
島精機製作所	17,900	2,067.00	36,999,300
オプトラン	15,200	2,560.00	38,912,000
N Cホールディングス	3,100	1,226.00	3,800,600
イワキ	7,900	999.00	7,892,100
フリーー	11,900	1,221.00	14,529,900
ヤマシンフィルタ	24,500	769.00	18,840,500
日阪製作所	15,400	827.00	12,735,800
やまびこ	23,600	1,222.00	28,839,200
平田機工	5,700	6,430.00	36,651,000
ペガサスミシン製造	12,600	498.00	6,274,800
マルマエ	4,400	2,119.00	9,323,600
タツモ	5,200	1,684.00	8,756,800
ナプテスコ	71,600	4,900.00	350,840,000
三井海洋開発	12,900	2,213.00	28,547,700
レオン自動機	11,800	1,522.00	17,959,600
S M C	35,900	62,840.00	2,255,956,000

ホソカワミクロン	4,100	6,090.00	24,969,000
ユニオンツール	4,500	4,025.00	18,112,500
オイレス工業	17,100	1,561.00	26,693,100
日精エー・エス・ビー機械	4,100	5,300.00	21,730,000
サトーホールディングス	15,900	2,618.00	41,626,200
技研製作所	10,700	4,620.00	49,434,000
日本エアテック	4,000	1,290.00	5,160,000
カワタ	3,300	903.00	2,979,900
日精樹脂工業	9,400	1,327.00	12,473,800
オカダアイオン	4,000	1,309.00	5,236,000
ワイエイシイホールディングス	4,900	1,068.00	5,233,200
小松製作所	557,100	3,145.00	1,752,079,500
住友重機械工業	70,400	3,380.00	237,952,000
日立建機	57,600	3,560.00	205,056,000
日工	18,500	707.00	13,079,500
巴工業	5,000	2,340.00	11,700,000
井関農機	12,300	1,433.00	17,625,900
TOWA	11,700	2,150.00	25,155,000
丸山製作所	2,400	1,850.00	4,440,000
北川鉄工所	5,700	1,772.00	10,100,400
シンニッタン	14,900	260.00	3,874,000
ローツェ	5,500	9,810.00	53,955,000
タカキタ	4,400	668.00	2,939,200
クボタ	646,000	2,385.00	1,540,710,000
荏原実業	2,900	6,170.00	17,893,000
東洋エンジニアリング	15,800	721.00	11,391,800
三菱化工機	4,000	2,754.00	11,016,000
月島機械	22,600	1,184.00	26,758,400
帝国電機製作所	8,700	1,305.00	11,353,500
東京機械製作所	4,400	730.00	3,212,000
新東工業	29,300	793.00	23,234,900
澁谷工業	10,700	3,305.00	35,363,500
アイチコーポレーション	21,500	882.00	18,963,000
小森コーポレーション	31,400	798.00	25,057,200
鶴見製作所	9,400	1,770.00	16,638,000
住友精密工業	2,100	2,617.00	5,495,700
日本ギア工業	6,200	325.00	2,015,000
酒井重工業	2,100	2,475.00	5,197,500
荏原製作所	50,900	5,380.00	273,842,000
石井鐵工所	1,200	3,005.00	3,606,000
西島製作所	12,600	886.00	11,163,600
北越工業	12,800	1,166.00	14,924,800
ダイキン工業	156,600	20,245.00	3,170,367,000
オルガノ	4,000	6,210.00	24,840,000
トーヨーカネツ	4,500	2,465.00	11,092,500
栗田工業	66,500	5,170.00	343,805,000
椿本チエイン	17,400	3,285.00	57,159,000
大同工業	4,900	1,049.00	5,140,100
日機装	39,700	1,183.00	46,965,100
木村化工機	10,200	899.00	9,169,800

レイズネクスト	20,900	1,164.00	24,327,600
アネスト岩田	20,900	1,083.00	22,634,700
ダイフク	67,600	9,320.00	630,032,000
サムコ	2,900	3,220.00	9,338,000
加藤製作所	6,700	1,019.00	6,827,300
油研工業	1,700	1,752.00	2,978,400
タダノ	59,300	1,156.00	68,550,800
フジテック	42,500	2,533.00	107,652,500
C K D	28,500	2,462.00	70,167,000
キトー	10,300	1,705.00	17,561,500
平和	34,200	1,955.00	66,861,000
理想科学工業	9,400	1,758.00	16,525,200
SANKYO	29,000	2,822.00	81,838,000
日本金銭機械	13,600	578.00	7,860,800
マースグループホールディングス	7,900	1,641.00	12,963,900
フクシマガリレイ	8,500	4,535.00	38,547,500
オーイズミ	5,400	383.00	2,068,200
ダイコク電機	5,700	915.00	5,215,500
竹内製作所	20,600	2,853.00	58,771,800
アマノ	32,200	2,966.00	95,505,200
JUKI	17,100	819.00	14,004,900
サンデンホールディングス	17,100	372.00	6,361,200
蛇の目ミシン工業	10,900	786.00	8,567,400
ブラザー工業	150,100	2,298.00	344,929,800
マックス	17,100	1,662.00	28,420,200
モリタホールディングス	19,800	1,598.00	31,640,400
グローリー	31,600	2,310.00	72,996,000
新晃工業	11,600	1,893.00	21,958,800
大和冷機工業	19,600	1,082.00	21,207,200
セガサミーホールディングス	111,700	1,446.00	161,518,200
日本ピストンリング	4,700	1,318.00	6,194,600
リケン	5,700	2,667.00	15,201,900
T P R	16,600	1,533.00	25,447,800
ツバキ・ナカシマ	23,600	1,856.00	43,801,600
ホシザキ	38,600	10,340.00	399,124,000
大豊工業	10,200	1,042.00	10,628,400
日本精工	252,500	1,049.00	264,872,500
NTN	284,000	318.00	90,312,000
ジェイテクト	117,800	1,219.00	143,598,200
不二越	11,700	4,160.00	48,672,000
ミネベアミツミ	211,900	2,893.00	613,026,700
日本トムソン	33,600	626.00	21,033,600
T H K	76,700	3,385.00	259,629,500
ユーシン精機	8,100	830.00	6,723,000
前澤給装工業	8,700	1,092.00	9,500,400
イーグル工業	15,400	1,134.00	17,463,600
前澤工業	7,500	609.00	4,567,500
日本ピラー工業	12,500	2,251.00	28,137,500
キッツ	38,400	795.00	30,528,000
日立製作所	591,000	6,073.00	3,589,143,000

東芝	243,300	4,720.00	1,148,376,000
三菱電機	1,229,900	1,747.50	2,149,250,250
富士電機	73,900	5,130.00	379,107,000
東洋電機製造	4,900	1,201.00	5,884,900
安川電機	132,400	5,160.00	683,184,000
シンフォニアテクノロジー	16,100	1,295.00	20,849,500
明電舎	20,900	2,298.00	48,028,200
オリジン	2,500	1,326.00	3,315,000
山洋電気	5,700	7,750.00	44,175,000
デンヨー	10,500	2,043.00	21,451,500
ベイクレント・コンサルティング	7,600	36,600.00	278,160,000
Orchestra Holdings	2,400	2,866.00	6,878,400
アイモバイル	4,100	1,366.00	5,600,600
キャリアインデックス	4,900	755.00	3,699,500
MS-Japan	4,700	1,098.00	5,160,600
船場	1,600	823.00	1,316,800
グレイステクノロジー	11,700	1,698.00	19,866,600
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	33,900	2,473.00	83,834,700
フルテック	1,800	1,401.00	2,521,800
グリーンズ	4,200	718.00	3,015,600
ツナググループ・ホールディングス	1,700	379.00	644,300
GAMEWITH	3,700	623.00	2,305,100
ソウルドアウト	2,500	1,670.00	4,175,000
MS&Consulting	2,100	612.00	1,285,200
ウェルビー	4,300	1,434.00	6,166,200
エル・ティー・エス	800	3,620.00	2,896,000
ミダック	2,400	6,690.00	16,056,000
日総工産	9,000	834.00	7,506,000
キュービーネットホールディングス	5,500	1,895.00	10,422,500
RPAホールディングス	13,200	757.00	9,992,400
三櫻工業	17,000	1,201.00	20,417,000
マキタ	160,400	5,030.00	806,812,000
東芝テック	13,300	4,480.00	59,584,000
芝浦メカトロニクス	2,300	7,610.00	17,503,000
マブチモーター	34,000	4,445.00	151,130,000
日本電産	296,100	12,260.00	3,630,186,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,300	743.00	5,423,900
トレックス・セミコンダクター	6,700	2,182.00	14,619,400
東光高岳	6,200	1,419.00	8,797,800
ダブル・スコープ	23,900	662.00	15,821,800
宮越ホールディングス	4,500	1,065.00	4,792,500
ダイヘン	13,400	4,880.00	65,392,000
ヤーマン	20,100	1,445.00	29,044,500
JVCケンウッド	105,400	236.00	24,874,400
ミマキエンジニアリング	11,600	706.00	8,189,600
I-PEX	5,700	2,542.00	14,489,400
日新電機	28,900	1,358.00	39,246,200
大崎電気工業	24,400	620.00	15,128,000

オムロン	102,400	8,330.00	852,992,000	
日東工業	17,900	1,803.00	32,273,700	
I D E C	16,600	2,039.00	33,847,400	
正興電機製作所	3,900	1,645.00	6,415,500	
不二電機工業	2,400	1,281.00	3,074,400	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	44,100	3,110.00	137,151,000	
サクサホールディングス	2,800	1,395.00	3,906,000	
メルコホールディングス	4,100	4,940.00	20,254,000	
テクノメディカ	2,800	1,627.00	4,555,600	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	3,600	2,713.00	9,766,800	
日本電気	156,200	5,150.00	804,430,000	
富士通	110,700	18,765.00	2,077,285,500	
沖電気工業	50,000	1,009.00	50,450,000	
岩崎通信機	4,500	943.00	4,243,500	
電気興業	5,800	2,270.00	13,166,000	
サンケン電気	14,300	5,260.00	75,218,000	
ナカヨ	2,100	1,477.00	3,101,700	
アイホン	7,000	2,115.00	14,805,000	
ルネサスエレクトロニクス	529,100	1,183.00	625,925,300	
セイコーエプソン	152,300	1,974.00	300,640,200	
ワコム	89,000	659.00	58,651,000	
アルバック	22,500	5,370.00	120,825,000	
アクセル	5,200	917.00	4,768,400	
E I Z O	10,400	5,080.00	52,832,000	
ジャパンディスプレイ	417,600	41.00	17,121,600	
日本信号	29,000	936.00	27,144,000	
京三製作所	26,800	449.00	12,033,200	
能美防災	16,300	2,001.00	32,616,300	
ホーチキ	8,900	1,226.00	10,911,400	
星和電機	6,100	556.00	3,391,600	
エレコム	28,300	2,002.00	56,656,600	
パナソニック	1,311,700	1,254.50	1,645,527,650	
シャープ	163,500	1,936.00	316,536,000	
アンリツ	73,900	2,056.00	151,938,400	
富士通ゼネラル	37,700	2,798.00	105,484,600	
ソニーグループ	770,300	10,795.00	8,315,388,500	
T D K	59,400	13,840.00	822,096,000	
帝国通信工業	5,700	1,190.00	6,783,000	
タムラ製作所	44,100	568.00	25,048,800	
アルプスアルパイン	100,300	1,205.00	120,861,500	
池上通信機	4,100	850.00	3,485,000	
日本電波工業	11,900	945.00	11,245,500	
鈴木	5,500	1,031.00	5,670,500	
日本トリム	2,400	3,705.00	8,892,000	
ローランド ディー・ジー・	7,300	2,489.00	18,169,700	
フォスター電機	12,800	1,012.00	12,953,600	
S M K	3,100	2,568.00	7,960,800	
ヨコオ	9,100	2,346.00	21,348,600	
ティアック	7,500	132.00	990,000	

ホシデン	33,400	1,001.00	33,433,400
ヒロセ電機	19,000	15,800.00	300,200,000
日本航空電子工業	28,200	1,840.00	51,888,000
TOA	14,600	899.00	13,125,400
マクセルホールディングス	24,300	1,280.00	31,104,000
古野電気	15,600	1,045.00	16,302,000
ユニデンホールディングス	3,000	2,530.00	7,590,000
スミダコーポレーション	10,300	1,104.00	11,371,200
アイコム	5,300	2,399.00	12,714,700
リオン	5,300	2,821.00	14,951,300
本多通信工業	9,600	491.00	4,713,600
横河電機	122,900	1,711.00	210,281,900
新電元工業	4,700	4,205.00	19,763,500
アズビル	83,200	4,370.00	363,584,000
東亜ディーケーケー	6,400	824.00	5,273,600
日本光電工業	50,800	3,185.00	161,798,000
チノー	4,000	1,500.00	6,000,000
共和電業	13,900	391.00	5,434,900
日本電子材料	4,400	1,997.00	8,786,800
堀場製作所	24,300	7,340.00	178,362,000
アドバンテスト	91,400	9,910.00	905,774,000
小野測器	4,400	560.00	2,464,000
エスベック	10,900	2,147.00	23,402,300
キーエンス	120,700	53,850.00	6,499,695,000
日置電機	5,700	5,620.00	32,034,000
シスメックス	95,900	11,270.00	1,080,793,000
日本マイクロニクス	21,400	1,556.00	33,298,400
メガチップス	12,400	3,300.00	40,920,000
OBARA GROUP	5,700	3,915.00	22,315,500
IMAGICA GROUP	10,300	488.00	5,026,400
澤藤電機	1,300	2,237.00	2,908,100
デンソー	270,800	7,789.00	2,109,261,200
原田工業	5,300	925.00	4,902,500
コーセル	15,000	1,090.00	16,350,000
イリソ電子工業	10,300	4,965.00	51,139,500
オブテックスグループ	20,300	1,883.00	38,224,900
千代田インテグレ	5,400	1,850.00	9,990,000
アイ・オー・データ機器	4,500	1,077.00	4,846,500
レーザーテック	53,800	20,560.00	1,106,128,000
スタンレー電気	86,200	3,395.00	292,649,000
岩崎電気	4,400	1,827.00	8,038,800
ウシオ電機	63,100	1,714.00	108,153,400
岡谷電機産業	9,100	353.00	3,212,300
ヘリオス テクノ ホールディング	11,700	354.00	4,141,800
エノモト	3,300	1,731.00	5,712,300
日本セラミック	12,400	2,976.00	36,902,400
遠藤照明	7,000	794.00	5,558,000
古河電池	8,700	1,642.00	14,285,400
双信電機	6,000	574.00	3,444,000
山一電機	7,900	1,729.00	13,659,100

図研	8,000	3,050.00	24,400,000
日本電子	22,400	5,860.00	131,264,000
カシオ計算機	98,900	1,921.00	189,986,900
ファナック	108,000	26,390.00	2,850,120,000
日本シイエムケイ	26,500	448.00	11,872,000
エンプラス	5,700	4,100.00	23,370,000
大真空	4,100	4,110.00	16,851,000
ローム	51,200	9,920.00	507,904,000
浜松ホトニクス	88,100	6,860.00	604,366,000
三井ハイテック	12,100	4,355.00	52,695,500
新光電気工業	41,200	3,645.00	150,174,000
京セラ	187,400	6,891.00	1,291,373,400
協栄産業	1,500	1,394.00	2,091,000
太陽誘電	54,500	5,200.00	283,400,000
村田製作所	361,500	8,284.00	2,994,666,000
双葉電子工業	20,900	815.00	17,033,500
日東電工	74,300	8,450.00	627,835,000
北陸電気工業	4,900	1,004.00	4,919,600
東海理化電機製作所	32,300	1,811.00	58,495,300
ニチコン	38,600	1,152.00	44,467,200
日本ケミコン	12,400	2,422.00	30,032,800
K O A	17,100	1,615.00	27,616,500
三井E & Sホールディングス	47,100	522.00	24,586,200
日立造船	97,500	730.00	71,175,000
三菱重工業	193,000	3,438.00	663,534,000
川崎重工業	95,700	2,535.00	242,599,500
I H I	82,600	2,845.00	234,997,000
名村造船所	36,900	178.00	6,568,200
サノヤスホールディングス	16,100	148.00	2,382,800
スプリックス	3,300	1,375.00	4,537,500
マネジメントソリューションズ	5,700	2,006.00	11,434,200
プロレド・パートナーズ	1,600	3,150.00	5,040,000
and factory	900	709.00	638,100
テノ・ホールディングス	800	1,175.00	940,000
フロンティア・マネジメント	2,200	1,302.00	2,864,400
ピアラ	800	1,112.00	889,600
コプロ・ホールディングス	1,500	1,284.00	1,926,000
ギークス	1,500	1,822.00	2,733,000
カーブスホールディングス	32,300	916.00	29,586,800
フォーラムエンジニアリング	8,100	979.00	7,929,900
日本車輛製造	4,400	2,212.00	9,732,800
三菱ロジスネクスト	16,300	1,061.00	17,294,300
近畿車輛	1,600	1,282.00	2,051,200
F P G	40,800	791.00	32,272,800
島根銀行	4,400	652.00	2,868,800
じもとホールディングス	8,300	654.00	5,428,200
全国保証	31,500	4,815.00	151,672,500
めぶきフィナンシャルグループ	628,600	232.00	145,835,200
ジャパンインベストメントアドバイザ	8,200	1,627.00	13,341,400

東京きらぼしフィナンシャルグループ	15,100	1,442.00	21,774,200	
九州フィナンシャルグループ	247,900	405.00	100,399,500	
かんぼ生命保険	150,300	2,141.00	321,792,300	
ゆうちょ銀行	343,900	930.00	319,827,000	
富山第一銀行	29,700	276.00	8,197,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	738,000	409.00	301,842,000	
ジェイリース	4,000	1,064.00	4,256,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	80,800	665.00	53,732,000	
マーキュリアインベストメント	5,000	759.00	3,795,000	
イントラスト	3,300	720.00	2,376,000	
日本モーゲージサービス	6,100	1,006.00	6,136,600	
CASA	3,300	969.00	3,197,700	
アルヒ	17,800	1,579.00	28,106,200	
プレミアグループ	5,700	3,515.00	20,035,500	
日産自動車	1,450,300	556.70	807,382,010	
いすゞ自動車	326,400	1,582.00	516,364,800	
トヨタ自動車	1,245,900	9,866.00	12,292,049,400	
日野自動車	153,600	1,015.00	155,904,000	
三菱自動車工業	454,700	317.00	144,139,900	
エフテック	8,700	888.00	7,725,600	
レシップホールディングス	4,900	609.00	2,984,100	
GMB	2,400	1,058.00	2,539,200	
ファルテック	2,400	769.00	1,845,600	
武蔵精密工業	27,500	2,442.00	67,155,000	
日産車体	18,000	748.00	13,464,000	
新明和工業	34,800	1,005.00	34,974,000	
極東開発工業	21,300	1,737.00	36,998,100	
トピー工業	10,300	1,375.00	14,162,500	
ティラド	4,000	2,938.00	11,752,000	
曙ブレーキ工業	66,300	181.00	12,000,300	
タチエス	19,000	1,471.00	27,949,000	
NOK	59,500	1,402.00	83,419,000	
フタバ産業	30,800	538.00	16,570,400	
KYB	13,700	3,985.00	54,594,500	
市光工業	18,100	742.00	13,430,200	
大同メタル工業	25,500	636.00	16,218,000	
プレス工業	61,100	352.00	21,507,200	
ミクニ	16,600	321.00	5,328,600	
太平洋工業	25,900	1,188.00	30,769,200	
河西工業	16,900	419.00	7,081,100	
アイシン	90,000	4,870.00	438,300,000	
マツダ	385,600	1,023.00	394,468,800	
今仙電機製作所	10,600	746.00	7,907,600	
本田技研工業	968,100	3,576.00	3,461,925,600	
スズキ	243,900	4,786.00	1,167,305,400	
SUBARU	352,500	2,273.50	801,408,750	
安永	5,700	1,250.00	7,125,000	
ヤマハ発動機	173,800	3,260.00	566,588,000	

小糸製作所	73,700	7,020.00	517,374,000	
T B K	12,300	419.00	5,153,700	
エクセディ	16,700	1,773.00	29,609,100	
ミツバ	22,400	903.00	20,227,200	
豊田合成	39,700	2,793.00	110,882,100	
愛三工業	19,800	895.00	17,721,000	
盟和産業	1,600	986.00	1,577,600	
日本プラスト	10,600	744.00	7,886,400	
ヨロズ	10,600	1,272.00	13,483,200	
エフ・シー・シー	20,200	1,747.00	35,289,400	
新家工業	3,100	1,656.00	5,133,600	
シマノ	46,100	24,265.00	1,118,616,500	
テイ・エス テック	57,300	1,631.00	93,456,300	
三十三フィナンシャルグループ	10,600	1,350.00	14,310,000	
第四北越フィナンシャルグループ	19,800	2,376.00	47,044,800	
ひろぎんホールディングス	179,400	578.00	103,693,200	
ダイレクトマーケティングミックス	6,100	4,015.00	24,491,500	
ポピンズホールディングス	3,100	4,875.00	15,112,500	
L I T A L I C O	4,900	5,180.00	25,382,000	
ジャムコ	7,300	1,285.00	9,380,500	
小野建	10,900	1,319.00	14,377,100	
はるやまホールディングス	6,400	671.00	4,294,400	
南陽	2,300	1,914.00	4,402,200	
ノジマ	21,500	2,996.00	64,414,000	
佐鳥電機	7,900	777.00	6,138,300	
カップ・クリエイト	17,100	1,507.00	25,769,700	
エコートレーディング	2,500	623.00	1,557,500	
伯東	7,400	1,539.00	11,388,600	
コンドーテック	9,400	1,005.00	9,447,000	
中山福	7,400	487.00	3,603,800	
ライトオン	9,000	699.00	6,291,000	
ナガイレーベン	16,200	2,590.00	41,958,000	
三菱食品	13,400	2,931.00	39,275,400	
良品計画	139,300	2,110.00	293,923,000	
三城ホールディングス	15,400	274.00	4,219,600	
松田産業	8,800	2,194.00	19,307,200	
第一興商	24,000	4,475.00	107,400,000	
メディバルホールディングス	121,300	2,182.00	264,676,600	
アドヴァン	12,400	958.00	11,879,200	
S P K	5,700	1,350.00	7,695,000	
萩原電気ホールディングス	4,500	2,441.00	10,984,500	
アルビス	4,000	2,286.00	9,144,000	
アズワン	8,700	12,870.00	111,969,000	
スズデン	3,700	1,470.00	5,439,000	
尾家産業	3,000	1,252.00	3,756,000	
シモジマ	6,800	1,105.00	7,514,000	
ドウシシャ	11,700	1,694.00	19,819,800	
小津産業	2,400	1,932.00	4,636,800	
コナカ	14,700	369.00	5,424,300	
高速	6,500	1,461.00	9,496,500	

ハウス オブ ローゼ	1,200	1,635.00	1,962,000	
G-7ホールディングス	5,800	2,835.00	16,443,000	
たけびし	3,700	1,559.00	5,768,300	
イオン北海道	16,300	1,043.00	17,000,900	
コジマ	20,700	760.00	15,732,000	
ヒマラヤ	4,400	1,020.00	4,488,000	
コーナン商事	17,200	3,810.00	65,532,000	
ネットワンシステムズ	49,200	3,390.00	166,788,000	
エコス	4,400	1,912.00	8,412,800	
ワタミ	15,900	1,040.00	16,536,000	
マルシェ	3,000	525.00	1,575,000	
リックス	2,400	1,548.00	3,715,200	
システムソフト	26,500	156.00	4,134,000	
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	242,400	2,322.00	562,852,800	
丸文	10,900	634.00	6,910,600	
西松屋チェーン	26,700	1,500.00	40,050,000	
ゼンショーホールディングス	65,000	2,806.00	182,390,000	
ハビネット	10,200	1,460.00	14,892,000	
幸楽苑ホールディングス	7,600	1,684.00	12,798,400	
ハークスレイ	2,200	1,027.00	2,259,400	
橋本総業ホールディングス	2,200	2,754.00	6,058,800	
日本ライフライン	39,000	1,408.00	54,912,000	
サイゼリヤ	17,900	2,707.00	48,455,300	
タカショー	7,900	820.00	6,478,000	
VTホールディングス	45,700	479.00	21,890,300	
マルカ	4,000	2,412.00	9,648,000	
アルゴグラフィックス	9,400	3,165.00	29,751,000	
魚力	3,700	1,957.00	7,240,900	
IDOM	40,900	635.00	25,971,500	
日本エム・ディ・エム	7,000	2,243.00	15,701,000	
ポブラ	3,300	303.00	999,900	
フジ・コーポレーション	6,200	1,268.00	7,861,600	
ユナイテッドアローズ	13,700	2,317.00	31,742,900	
進和	7,300	2,140.00	15,622,000	
エスケイジャパン	2,500	452.00	1,130,000	
ダイترون	5,300	2,050.00	10,865,000	
ハイデイ日高	17,300	1,860.00	32,178,000	
シークス	15,400	1,603.00	24,686,200	
京都きもの友禅	6,700	284.00	1,902,800	
コロワイド	40,200	2,056.00	82,651,200	
ピーシーデポコーポレーション	14,000	456.00	6,384,000	
田中商事	3,100	710.00	2,201,000	
オーハシテクニカ	6,400	1,498.00	9,587,200	
壺番屋	8,700	4,900.00	42,630,000	
白銅	3,900	1,888.00	7,363,200	
トップカルチャー	5,000	344.00	1,720,000	
PLANT	3,100	719.00	2,228,900	
スギホールディングス	24,000	8,750.00	210,000,000	
ダイコー通産	1,000	1,488.00	1,488,000	

薬王堂ホールディングス	5,400	2,376.00	12,830,400
島津製作所	158,100	3,995.00	631,609,500
JMS	10,300	865.00	8,909,500
クボテック	3,100	338.00	1,047,800
長野計器	8,800	1,199.00	10,551,200
ブイ・テクノロジー	5,700	5,430.00	30,951,000
スター精密	19,100	1,818.00	34,723,800
東京計器	7,700	1,084.00	8,346,800
愛知時計電機	1,200	4,295.00	5,154,000
インターアクション	6,100	2,439.00	14,877,900
オーバル	10,900	286.00	3,117,400
東京精密	20,800	5,280.00	109,824,000
マニー	48,900	2,478.00	121,174,200
ニコン	187,700	1,211.00	227,304,700
トプコン	61,900	1,814.00	112,286,600
オリンパス	680,400	2,411.50	1,640,784,600
理研計器	10,900	2,784.00	30,345,600
SCREENホールディングス	21,300	10,680.00	227,484,000
キヤノン電子	11,600	1,731.00	20,079,600
タムロン	10,000	2,487.00	24,870,000
HOYA	242,000	13,740.00	3,325,080,000
シード	5,500	836.00	4,598,000
ノーリツ鋼機	10,900	2,302.00	25,091,800
エー・アンド・デイ	10,200	1,043.00	10,638,600
朝日インテック	129,300	2,661.00	344,067,300
キヤノン	610,800	2,643.50	1,614,649,800
リコー	312,800	1,394.00	436,043,200
シチズン時計	155,300	440.00	68,332,000
リズム	3,100	799.00	2,476,900
大研医器	9,900	563.00	5,573,700
メニコン	18,800	7,190.00	135,172,000
シンシア	1,200	641.00	769,200
中本パックス	3,100	1,608.00	4,984,800
スノーピーク	7,300	3,335.00	24,345,500
パラマウントベッドホールディングス	23,700	1,984.00	47,020,800
トランザクション	6,700	1,422.00	9,527,400
粧美堂	3,000	427.00	1,281,000
ニホンフラッシュ	10,400	1,256.00	13,062,400
前田工織	13,500	3,410.00	46,035,000
永大産業	17,200	319.00	5,486,800
アートネイチャー	12,000	671.00	8,052,000
バンダイナムコホールディングス	101,800	8,022.00	816,639,600
アイフィスジャパン	3,300	716.00	2,362,800
共立印刷	22,500	144.00	3,240,000
SHOEI	11,600	3,880.00	45,008,000
フランスベッドホールディングス	16,100	922.00	14,844,200
マーベラス	18,800	793.00	14,908,400
パイロットコーポレーション	21,800	3,650.00	79,570,000
萩原工業	7,000	1,431.00	10,017,000
エイベックス	20,900	1,506.00	31,475,400

トッパン・フォームズ	22,200	1,085.00	24,087,000
フジシールインターナショナル	25,200	2,386.00	60,127,200
タカラトミー	55,100	968.00	53,336,800
廣済堂	8,400	985.00	8,274,000
エステールホールディングス	4,100	649.00	2,660,900
レック	14,700	1,182.00	17,375,400
タカノ	4,700	643.00	3,022,100
三光合成	12,800	446.00	5,708,800
プロネクサス	10,600	1,043.00	11,055,800
ホクシン	8,800	170.00	1,496,000
ウッドワン	3,600	1,295.00	4,662,000
大建工業	8,400	2,094.00	17,589,600
きもと	19,500	255.00	4,972,500
凸版印刷	186,700	1,898.00	354,356,600
大日本印刷	148,600	2,393.00	355,599,800
共同印刷	4,000	2,734.00	10,936,000
N I S S H A	25,200	1,579.00	39,790,800
光村印刷	800	1,701.00	1,360,800
藤森工業	10,900	4,085.00	44,526,500
TAKARA & COMPANY	6,100	1,738.00	10,601,800
前澤化成工業	8,000	1,247.00	9,976,000
未来工業	4,400	1,726.00	7,594,400
アシックス	108,700	2,601.00	282,728,700
ツツミ	3,000	2,334.00	7,002,000
ウェーブロックホールディングス	4,100	712.00	2,919,200
J S P	7,300	1,656.00	12,088,800
ニチハ	17,100	2,945.00	50,359,500
ローランド	9,500	6,290.00	59,755,000
エフピコ	22,600	4,055.00	91,643,000
小松ウオール工業	4,000	1,948.00	7,792,000
ヤマハ	73,100	6,460.00	472,226,000
河合楽器製作所	3,300	3,665.00	12,094,500
クリナップ	11,800	517.00	6,100,600
ビジョン	78,900	3,340.00	263,526,000
天馬	9,100	2,521.00	22,941,100
オリバー	2,400	2,751.00	6,602,400
兼松サステック	800	1,800.00	1,440,000
キングジム	10,700	951.00	10,175,700
象印マホービン	33,100	1,703.00	56,369,300
リンテック	26,600	2,444.00	65,010,400
信越ポリマー	19,200	1,062.00	20,390,400
東リ	32,000	247.00	7,904,000
イトーキ	23,900	379.00	9,058,100
任天堂	70,400	67,090.00	4,723,136,000
三菱鉛筆	20,200	1,433.00	28,946,600
松風	5,700	2,004.00	11,422,800
タカラスタANDARD	25,500	1,568.00	39,984,000
コクヨ	58,900	1,819.00	107,139,100
ナカバヤシ	12,500	605.00	7,562,500
ニフコ	45,200	4,020.00	181,704,000

立川ブラインド工業	5,500	1,323.00	7,276,500
グロープライド	5,700	4,310.00	24,567,000
オカムラ	42,400	1,462.00	61,988,800
バルカー	10,200	2,100.00	21,420,000
MUTOHホールディングス	1,200	1,587.00	1,904,400
伊藤忠商事	847,400	3,363.00	2,849,806,200
丸紅	1,194,300	1,004.00	1,199,077,200
スクロール	17,100	855.00	14,620,500
高島	1,600	1,756.00	2,809,600
ヨンドシーホールディングス	11,300	1,930.00	21,809,000
三陽商会	6,200	1,017.00	6,305,400
長瀬産業	68,000	1,632.00	110,976,000
ナイガイ	4,000	330.00	1,320,000
蝶理	7,700	1,717.00	13,220,900
豊田通商	121,400	5,200.00	631,280,000
オンワードホールディングス	72,400	383.00	27,729,200
三共生興	18,600	538.00	10,006,800
兼松	48,400	1,505.00	72,842,000
美津濃	12,300	2,357.00	28,991,100
ツカモトコーポレーション	1,700	1,400.00	2,380,000
ルックホールディングス	4,100	1,577.00	6,465,700
三井物産	965,900	2,552.00	2,464,976,800
日本紙パルプ商事	6,400	3,605.00	23,072,000
東京エレクトロン	72,100	47,570.00	3,429,797,000
カメイ	15,600	1,156.00	18,033,600
東都水産	1,400	4,590.00	6,426,000
OUGホールディングス	1,800	2,853.00	5,135,400
スターゼン	8,700	2,135.00	18,574,500
セイコーホールディングス	17,200	2,326.00	40,007,200
山善	47,200	971.00	45,831,200
椿本興業	1,700	3,415.00	5,805,500
住友商事	764,400	1,527.50	1,167,621,000
日本ユニシス	42,100	3,165.00	133,246,500
内田洋行	4,900	4,840.00	23,716,000
三菱商事	737,200	3,072.00	2,264,678,400
第一実業	5,500	4,250.00	23,375,000
キヤノンマーケティングジャパン	30,100	2,643.00	79,554,300
西華産業	6,400	1,802.00	11,532,800
佐藤商事	10,500	1,122.00	11,781,000
菱洋エレクトロ	9,100	2,626.00	23,896,600
東京産業	12,000	617.00	7,404,000
ユアサ商事	12,400	3,060.00	37,944,000
神鋼商事	2,500	2,472.00	6,180,000
トルク	6,000	244.00	1,464,000
阪和興業	24,100	3,295.00	79,409,500
正栄食品工業	7,900	4,135.00	32,666,500
カナデン	10,200	1,078.00	10,995,600
菱電商事	8,900	1,621.00	14,426,900
ニプロ	91,700	1,371.00	125,720,700
フルサト工業	6,500	1,869.00	12,148,500

岩谷産業	29,000	6,180.00	179,220,000
ナイス	4,900	1,983.00	9,716,700
ニチモウ	1,600	2,130.00	3,408,000
極東貿易	3,000	2,357.00	7,071,000
アステナホールディングス	15,900	674.00	10,716,600
兼松エレクトロニクス	6,800	3,580.00	24,344,000
三愛石油	30,000	1,195.00	35,850,000
稲畑産業	29,000	1,710.00	49,590,000
G S Iクレオス	5,700	1,005.00	5,728,500
明和産業	11,100	475.00	5,272,500
クワザワホールディングス	4,500	619.00	2,785,500
キムラタン	70,600	24.00	1,694,400
ヤマエ久野	8,800	1,135.00	9,988,000
ゴールドウイン	19,900	6,640.00	132,136,000
ユニ・チャーム	261,000	4,388.00	1,145,268,000
デサント	20,700	2,412.00	49,928,400
キング	4,900	528.00	2,587,200
ワキタ	23,800	1,119.00	26,632,200
ヤマトインターナショナル	10,900	342.00	3,727,800
東邦ホールディングス	38,800	1,732.00	67,201,600
サンゲツ	32,700	1,565.00	51,175,500
ミツウロコグループホールディングス	17,700	1,235.00	21,859,500
シナネンホールディングス	4,500	2,882.00	12,969,000
伊藤忠エネクス	27,400	1,019.00	27,920,600
サンリオ	34,000	1,925.00	65,450,000
サンワテクノス	7,900	1,217.00	9,614,300
リョーサン	13,300	2,016.00	26,812,800
新光商事	16,600	769.00	12,765,400
トーヨー	5,700	1,696.00	9,667,200
三信電気	6,800	2,135.00	14,518,000
東陽テクニカ	12,800	1,106.00	14,156,800
モスフードサービス	17,100	3,090.00	52,839,000
加賀電子	10,900	3,015.00	32,863,500
三益半導体工業	9,400	2,637.00	24,787,800
都築電気	4,400	1,825.00	8,030,000
ソーダニッカ	12,100	574.00	6,945,400
立花エレテック	9,100	1,502.00	13,668,200
木曽路	15,900	2,423.00	38,525,700
S R Sホールディングス	15,400	839.00	12,920,600
千趣会	22,200	422.00	9,368,400
タカキュー	10,200	143.00	1,458,600
リテールパートナーズ	14,700	1,166.00	17,140,200
ケーヨー	22,600	753.00	17,017,800
上新電機	14,200	2,761.00	39,206,200
日本瓦斯	59,700	1,774.00	105,907,800
ロイヤルホールディングス	21,100	2,353.00	49,648,300
東天紅	800	1,076.00	860,800
いなげや	13,500	1,474.00	19,899,000
チヨダ	12,600	920.00	11,592,000
ライフコーポレーション	12,300	3,400.00	41,820,000

リンガーハット	14,900	2,372.00	35,342,800
MrMaxHD	16,400	650.00	10,660,000
テンアライド	12,200	355.00	4,331,000
AOKIホールディングス	23,800	747.00	17,778,600
オークワ	19,100	1,126.00	21,506,600
コメリ	18,700	2,601.00	48,638,700
青山商事	26,800	855.00	22,914,000
しまむら	14,100	9,740.00	137,334,000
はせがわ	5,500	297.00	1,633,500
高島屋	88,100	1,338.00	117,877,800
松屋	26,600	989.00	26,307,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	57,200	977.00	55,884,400
近鉄百貨店	4,700	3,225.00	15,157,500
丸井グループ	102,500	2,254.00	231,035,000
クレディセゾン	70,700	1,442.00	101,949,400
アクシアル リテイリング	10,200	3,875.00	39,525,000
井筒屋	6,500	250.00	1,625,000
イオン	466,000	2,963.00	1,380,758,000
イズミ	24,500	4,230.00	103,635,000
フォーバル	4,400	821.00	3,612,400
平和堂	22,400	2,307.00	51,676,800
フジ	14,700	2,000.00	29,400,000
ヤオコー	13,700	6,450.00	88,365,000
ゼビオホールディングス	14,600	1,009.00	14,731,400
ケーズホールディングス	103,000	1,305.00	134,415,000
PALTAC	19,500	5,850.00	114,075,000
三谷産業	16,200	391.00	6,334,200
Olympicグループ	6,200	794.00	4,922,800
日産東京販売ホールディングス	14,700	242.00	3,557,400
新生銀行	98,900	1,596.00	157,844,400
あおぞら銀行	72,300	2,498.00	180,605,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,297,000	622.30	5,163,223,100
りそなホールディングス	1,398,900	452.60	633,142,140
三井住友トラスト・ホールディングス	229,500	3,684.00	845,478,000
三井住友フィナンシャルグループ	839,400	3,951.00	3,316,469,400
千葉銀行	404,300	691.00	279,371,300
群馬銀行	249,700	355.00	88,643,500
武蔵野銀行	18,000	1,695.00	30,510,000
千葉興業銀行	31,400	265.00	8,321,000
筑波銀行	50,000	170.00	8,500,000
七十七銀行	38,200	1,296.00	49,507,200
青森銀行	9,400	2,129.00	20,012,600
秋田銀行	7,400	1,403.00	10,382,200
山形銀行	13,400	884.00	11,845,600
岩手銀行	7,900	1,772.00	13,998,800
東邦銀行	108,500	206.00	22,351,000
東北銀行	6,100	1,022.00	6,234,200
みちのく銀行	7,700	974.00	7,499,800
ふくおかフィナンシャルグループ	109,300	2,017.00	220,458,100
静岡銀行	295,300	874.00	258,092,200

十六銀行	15,200	1,961.00	29,807,200	
スルガ銀行	105,900	345.00	36,535,500	
八十二銀行	273,000	362.00	98,826,000	
山梨中央銀行	14,000	836.00	11,704,000	
大垣共立銀行	24,000	1,880.00	45,120,000	
福井銀行	10,400	1,461.00	15,194,400	
北國銀行	11,600	2,211.00	25,647,600	
清水銀行	5,200	1,550.00	8,060,000	
富山銀行	2,100	2,631.00	5,525,100	
滋賀銀行	24,100	2,060.00	49,646,000	
南都銀行	17,600	1,830.00	32,208,000	
百五銀行	109,800	303.00	33,269,400	
京都銀行	43,300	5,220.00	226,026,000	
紀陽銀行	43,100	1,457.00	62,796,700	
ほくほくフィナンシャルグループ	80,500	854.00	68,747,000	
山陰合同銀行	76,700	533.00	40,881,100	
中国銀行	104,400	860.00	89,784,000	
鳥取銀行	4,100	1,122.00	4,600,200	
伊予銀行	160,900	564.00	90,747,600	
百十四銀行	12,700	1,471.00	18,681,700	
四国銀行	17,200	694.00	11,936,800	
阿波銀行	18,500	2,060.00	38,110,000	
大分銀行	7,000	1,734.00	12,138,000	
宮崎銀行	7,500	2,026.00	15,195,000	
佐賀銀行	7,000	1,391.00	9,737,000	
沖縄銀行	11,000	2,610.00	28,710,000	
琉球銀行	26,700	740.00	19,758,000	
セブン銀行	404,700	233.00	94,295,100	
みずほフィナンシャルグループ	1,648,100	1,653.50	2,725,133,350	
高知銀行	4,200	863.00	3,624,600	
山口フィナンシャルグループ	151,500	644.00	97,566,000	
芙蓉総合リース	12,700	7,240.00	91,948,000	
みずほリース	18,700	3,585.00	67,039,500	
東京センチュリー	28,300	6,140.00	173,762,000	
SBIホールディングス	148,700	2,710.00	402,977,000	
日本証券金融	51,500	861.00	44,341,500	
アイフル	202,900	378.00	76,696,200	
日本アジア投資	10,400	238.00	2,475,200	
長野銀行	4,100	1,124.00	4,608,400	
名古屋銀行	9,700	2,647.00	25,675,900	
北洋銀行	183,100	244.00	44,676,400	
愛知銀行	4,100	2,823.00	11,574,300	
中京銀行	4,400	1,509.00	6,639,600	
大光銀行	3,700	1,418.00	5,246,600	
愛媛銀行	17,200	835.00	14,362,000	
トマト銀行	4,700	1,063.00	4,996,100	
京葉銀行	51,900	413.00	21,434,700	
栃木銀行	58,000	174.00	10,092,000	
北日本銀行	4,000	1,729.00	6,916,000	
東和銀行	21,100	534.00	11,267,400	

福島銀行	13,600	232.00	3,155,200
大東銀行	6,100	605.00	3,690,500
リコーリース	9,500	3,475.00	33,012,500
イオンフィナンシャルサービス	74,100	1,348.00	99,886,800
アコム	244,000	501.00	122,244,000
ジャックス	13,300	2,639.00	35,098,700
オリエントコーポレーション	327,600	159.00	52,088,400
オリックス	736,400	1,966.50	1,448,130,600
三菱HCキャピタル	418,700	615.00	257,500,500
ジャフコグループ	18,600	7,460.00	138,756,000
九州リースサービス	6,800	685.00	4,658,000
トモニホールディングス	93,700	300.00	28,110,000
大和証券グループ本社	908,500	633.50	575,534,750
野村ホールディングス	1,851,600	592.00	1,096,147,200
岡三証券グループ	103,400	436.00	45,082,400
丸三証券	36,200	643.00	23,276,600
東洋証券	39,500	171.00	6,754,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	129,000	410.00	52,890,000
光世証券	3,000	654.00	1,962,000
水戸証券	32,100	304.00	9,758,400
いちよし証券	23,900	592.00	14,148,800
松井証券	59,500	829.00	49,325,500
SOMPOホールディングス	214,000	4,276.00	915,064,000
日本取引所グループ	327,600	2,526.50	827,681,400
マネックスグループ	108,400	767.00	83,142,800
極東証券	16,200	823.00	13,332,600
岩井コスモホールディングス	12,400	1,688.00	20,931,200
藍澤證券	21,900	1,094.00	23,958,600
フィデアホールディングス	117,800	122.00	14,371,600
池田泉州ホールディングス	139,100	162.00	22,534,200
アニコムホールディングス	34,200	939.00	32,113,800
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	294,800	3,365.00	992,002,000
マネーパートナーズグループ	13,200	250.00	3,300,000
スパークス・グループ	55,600	271.00	15,067,600
小林洋行	3,000	274.00	822,000
第一生命ホールディングス	640,700	2,228.00	1,427,479,600
東京海上ホールディングス	399,300	5,134.00	2,050,006,200
アドバンテッジリスクマネジメント	5,700	1,043.00	5,945,100
イー・ギャランティ	13,900	2,231.00	31,010,900
アサックス	6,800	722.00	4,909,600
NECキャピタルソリューション	5,000	2,136.00	10,680,000
T&Dホールディングス	362,300	1,470.00	532,581,000
アドバンスクリエイト	4,900	906.00	4,439,400
三井不動産	552,600	2,747.00	1,517,992,200
三菱地所	796,500	1,933.50	1,540,032,750
平和不動産	20,900	4,235.00	88,511,500
東京建物	119,500	1,761.00	210,439,500
ダイビル	31,400	1,349.00	42,358,600

京阪神ビルディング	21,000	1,428.00	29,988,000
住友不動産	272,600	4,090.00	1,114,934,000
太平洋興発	5,400	641.00	3,461,400
テーオーシー	23,900	704.00	16,825,600
東京楽天地	2,200	4,355.00	9,581,000
レオパレス21	99,700	153.00	15,254,100
スターツコーポレーション	14,300	2,840.00	40,612,000
フジ住宅	14,000	633.00	8,862,000
空港施設	12,900	694.00	8,952,600
明和地所	5,700	627.00	3,573,900
ゴールドクレスト	10,700	1,820.00	19,474,000
リログループ	64,200	2,477.00	159,023,400
エスリード	4,900	1,662.00	8,143,800
日神グループホールディングス	18,100	466.00	8,434,600
日本エスコン	22,100	788.00	17,414,800
タカラレーベン	50,800	355.00	18,034,000
AVANTIA	6,900	898.00	6,196,200
イオンモール	60,600	1,882.00	114,049,200
毎日コムネット	3,700	700.00	2,590,000
ファースト住建	5,300	1,230.00	6,519,000
ランド	645,900	11.00	7,104,900
カチタス	30,100	3,190.00	96,019,000
東祥	7,400	2,037.00	15,073,800
トーセイ	16,900	1,127.00	19,046,300
穴吹興産	2,500	2,117.00	5,292,500
サンフロンティア不動産	14,700	1,027.00	15,096,900
エフ・ジェー・ネクスト	12,000	1,020.00	12,240,000
インテリックス	2,500	770.00	1,925,000
ランドビジネス	4,500	362.00	1,629,000
サンネクスタグループ	4,000	1,015.00	4,060,000
グランディハウス	8,400	430.00	3,612,000
東武鉄道	128,100	3,105.00	397,750,500
相鉄ホールディングス	42,300	2,292.00	96,951,600
東急	310,100	1,628.00	504,842,800
京浜急行電鉄	157,900	1,526.00	240,955,400
小田急電鉄	196,900	2,953.00	581,445,700
京王電鉄	68,700	7,160.00	491,892,000
京成電鉄	92,100	3,710.00	341,691,000
富士急行	16,700	5,460.00	91,182,000
新京成電鉄	3,000	2,158.00	6,474,000
東日本旅客鉄道	216,400	8,515.00	1,842,646,000
西日本旅客鉄道	109,600	6,947.00	761,391,200
東海旅客鉄道	102,100	18,255.00	1,863,835,500
西武ホールディングス	148,300	1,435.00	212,810,500
鴻池運輸	19,900	1,130.00	22,487,000
西日本鉄道	34,100	2,892.00	98,617,200
ハマキョウレックス	9,400	3,075.00	28,905,000
サカイ引越センター	5,700	5,730.00	32,661,000
近鉄グループホールディングス	116,200	4,215.00	489,783,000
阪急阪神ホールディングス	155,200	3,685.00	571,912,000

南海電気鉄道	55,300	2,502.00	138,360,600
京阪ホールディングス	52,000	3,645.00	189,540,000
神戸電鉄	2,900	3,510.00	10,179,000
名古屋鉄道	95,800	2,271.00	217,561,800
山陽電気鉄道	8,500	1,965.00	16,702,500
アルプス物流	8,000	1,008.00	8,064,000
トランコム	3,600	8,260.00	29,736,000
日本通運	40,400	8,800.00	355,520,000
ヤマトホールディングス	163,200	2,987.00	487,478,400
山九	29,900	4,905.00	146,659,500
日新	9,200	1,527.00	14,048,400
丸運	7,900	267.00	2,109,300
丸全昭和運輸	9,400	3,370.00	31,678,000
センコーグループホールディングス	64,500	1,038.00	66,951,000
トナミホールディングス	2,400	5,040.00	12,096,000
ニッコンホールディングス	39,200	2,388.00	93,609,600
日本石油輸送	800	2,593.00	2,074,400
福山通運	14,900	4,015.00	59,823,500
セイノーホールディングス	87,200	1,488.00	129,753,600
エスライン	3,000	897.00	2,691,000
神奈川中央交通	2,400	3,675.00	8,820,000
日立物流	25,800	3,740.00	96,492,000
丸和運輸機関	24,500	1,568.00	38,416,000
C & F ロジホールディングス	11,900	1,645.00	19,575,500
日本郵船	97,400	5,110.00	497,714,000
商船三井	69,100	4,845.00	334,789,500
川崎汽船	35,800	3,350.00	119,930,000
NSユナイテッド海運	5,700	2,262.00	12,893,400
明治海運	12,700	439.00	5,575,300
飯野海運	54,500	452.00	24,634,000
共栄タンカー	2,400	865.00	2,076,000
九州旅客鉄道	90,000	2,758.00	248,220,000
SGホールディングス	220,200	2,626.00	578,245,200
日本航空	283,800	2,707.00	768,246,600
ANAホールディングス	314,300	2,894.00	909,584,200
パスコ	2,400	1,553.00	3,727,200
西本Wismettacホールディングス	2,500	2,890.00	7,225,000
シルバーライフ	2,400	2,420.00	5,808,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,895.00	1,895,000
一家ダイニングプロジェクト	1,000	639.00	639,000
Genky DrugStores	5,400	3,660.00	19,764,000
コア商事ホールディングス	6,800	725.00	4,930,000
国際紙パルプ商事	26,500	252.00	6,678,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,400	1,193.00	2,863,200
ブックオフグループホールディングス	7,000	940.00	6,580,000
ギフト	1,000	2,346.00	2,346,000
三菱倉庫	40,200	3,445.00	138,489,000
三井倉庫ホールディングス	12,400	2,399.00	29,747,600
住友倉庫	42,100	1,516.00	63,823,600

澁澤倉庫	6,500	2,129.00	13,838,500
ヤマタネ	5,500	1,508.00	8,294,000
東陽倉庫	17,200	324.00	5,572,800
乾汽船	7,900	1,217.00	9,614,300
日本トランスシティ	26,200	532.00	13,938,400
ケイヒン	1,700	1,372.00	2,332,400
中央倉庫	6,700	1,066.00	7,142,200
川西倉庫	2,300	1,148.00	2,640,400
安田倉庫	10,200	950.00	9,690,000
ファイズホールディングス	2,200	830.00	1,826,000
東洋埠頭	3,000	1,537.00	4,611,000
宇徳	8,800	516.00	4,540,800
上組	64,900	2,207.00	143,234,300
サンリツ	2,400	738.00	1,771,200
キムラユニティー	3,700	1,317.00	4,872,900
キューソー流通システム	2,900	1,704.00	4,941,600
近鉄エクスプレス	22,200	2,361.00	52,414,200
東海運	8,100	311.00	2,519,100
エーアイティー	7,400	993.00	7,348,200
内外トランスライン	4,100	1,909.00	7,826,900
ショーエイコーポレーション	2,500	970.00	2,425,000
日本コンセプト	4,000	1,656.00	6,624,000
TBSホールディングス	80,200	1,812.00	145,322,400
日本テレビホールディングス	100,400	1,332.00	133,732,800
朝日放送グループホールディングス	12,800	717.00	9,177,600
テレビ朝日ホールディングス	37,300	1,876.00	69,974,800
スカパーJ S A Tホールディングス	79,600	425.00	33,830,000
テレビ東京ホールディングス	8,900	2,179.00	19,393,100
日本BS放送	4,100	1,114.00	4,567,400
ビジョン	14,700	1,284.00	18,874,800
スマートバリュー	3,100	796.00	2,467,600
USEN-NEXT HOLDINGS	11,600	2,329.00	27,016,400
ワイヤレスゲート	5,000	455.00	2,275,000
コネクシオ	7,200	1,494.00	10,756,800
日本通信	105,500	220.00	23,210,000
クロップス	2,400	873.00	2,095,200
日本電信電話	1,411,500	2,874.50	4,057,356,750
KDDI	967,800	3,632.00	3,515,049,600
ソフトバンク	1,096,900	1,409.00	1,545,532,100
光通信	14,200	20,820.00	295,644,000
エムティーアイ	11,800	679.00	8,012,200
GMOインターネット	43,200	3,105.00	134,136,000
ファイバーゲート	4,000	1,504.00	6,016,000
アイドママーケティングコミュニケーション	2,900	434.00	1,258,600
KADOKAWA	31,200	4,675.00	145,860,000
学研ホールディングス	16,200	1,382.00	22,388,400
ゼンリン	22,000	1,164.00	25,608,000
昭文社ホールディングス	4,500	482.00	2,169,000

インプレスホールディングス	10,300	208.00	2,142,400
東京電力ホールディングス	1,042,600	345.00	359,697,000
中部電力	376,200	1,358.50	511,067,700
関西電力	466,000	1,088.50	507,241,000
中国電力	177,600	1,027.00	182,395,200
北陸電力	112,500	632.00	71,100,000
東北電力	287,900	886.00	255,079,400
四国電力	102,100	754.00	76,983,400
九州電力	271,500	872.00	236,748,000
北海道電力	114,800	521.00	59,810,800
沖縄電力	24,000	1,442.00	34,608,000
電源開発	97,700	1,638.00	160,032,600
エフオン	7,400	975.00	7,215,000
イーレックス	17,900	1,931.00	34,564,900
レノバ	20,800	3,875.00	80,600,000
東京瓦斯	236,400	2,167.00	512,278,800
大阪瓦斯	222,700	2,096.00	466,779,200
東邦瓦斯	60,500	5,610.00	339,405,000
北海道瓦斯	6,900	1,564.00	10,791,600
広島ガス	26,200	374.00	9,798,800
西部ガスホールディングス	13,900	2,494.00	34,666,600
静岡ガス	35,000	1,014.00	35,490,000
メタウォーター	14,000	2,089.00	29,246,000
アイネット	6,200	1,430.00	8,866,000
松竹	7,900	13,240.00	104,596,000
東宝	71,100	4,660.00	331,326,000
エイチ・アイ・エス	18,000	2,597.00	46,746,000
東映	4,000	21,480.00	85,920,000
ラックランド	3,300	2,673.00	8,820,900
エヌ・ティ・ティ・データ	321,500	1,713.00	550,729,500
共立メンテナンス	19,500	4,050.00	78,975,000
イチネンホールディングス	12,400	1,237.00	15,338,800
建設技術研究所	7,600	2,481.00	18,855,600
スペース	7,900	925.00	7,307,500
長 大	4,700	1,925.00	9,047,500
アインホールディングス	17,400	6,990.00	121,626,000
燦ホールディングス	4,900	1,233.00	6,041,700
ピー・シー・エー	1,700	4,160.00	7,072,000
スバル興業	800	8,390.00	6,712,000
東京テアトル	4,900	1,270.00	6,223,000
タナベ経営	2,400	1,442.00	3,460,800
ビジネスブレイン太田昭和	4,100	1,763.00	7,228,300
ナガワ	3,900	8,020.00	31,278,000
東京都競馬	7,600	4,750.00	36,100,000
常磐興産	4,900	1,459.00	7,149,100
カナモト	20,900	2,702.00	56,471,800
D T S	25,100	2,637.00	66,188,700
スクウェア・エニックス・ホールディングス	51,500	5,870.00	302,305,000
シーイーシー	12,700	1,522.00	19,329,400

カブコン	103,400	3,325.00	343,805,000
西尾レントオール	10,700	3,280.00	35,096,000
アイ・エス・ピー	5,500	1,426.00	7,843,000
アゴラ ホスピタリティー グループ	73,500	27.00	1,984,500
日本空港ビルデング	42,100	5,470.00	230,287,000
トランス・コスモス	11,300	2,933.00	33,142,900
乃村工藝社	50,400	971.00	48,938,400
ジャステック	7,700	1,293.00	9,956,100
S C S K	27,800	6,250.00	173,750,000
藤田観光	4,600	2,522.00	11,601,200
K N T - C Tホールディングス	6,200	1,543.00	9,566,600
日本管財	12,700	2,345.00	29,781,500
トーカイ	11,700	2,374.00	27,775,800
白洋舎	900	2,326.00	2,093,400
セコム	115,800	8,666.00	1,003,522,800
日本システムウエア	4,000	2,297.00	9,188,000
セントラル警備保障	5,700	3,175.00	18,097,500
アイネス	11,800	1,350.00	15,930,000
丹青社	22,100	906.00	20,022,600
メイテック	14,300	6,270.00	89,661,000
T K C	20,500	3,335.00	68,367,500
富士ソフト	12,800	5,580.00	71,424,000
応用地質	13,800	1,294.00	17,857,200
船井総研ホールディングス	24,000	2,370.00	56,880,000
N S D	38,900	1,799.00	69,981,100
進学会ホールディングス	5,200	421.00	2,189,200
丸紅建材リース	800	1,817.00	1,453,600
オオバ	8,100	757.00	6,131,700
コナミホールディングス	43,900	7,230.00	317,397,000
いであ	2,500	1,794.00	4,485,000
学究社	3,600	1,368.00	4,924,800
ベネッセホールディングス	43,100	2,672.00	115,163,200
イオンディライト	14,400	3,400.00	48,960,000
ナック	5,700	924.00	5,266,800
福井コンピュータホールディングス	5,500	4,225.00	23,237,500
ダイセキ	19,800	4,345.00	86,031,000
ステップ	4,400	1,602.00	7,048,800
日鉄物産	8,700	4,485.00	39,019,500
泉州電業	3,300	3,580.00	11,814,000
元気寿司	3,300	2,781.00	9,177,300
トラスコ中山	27,700	2,877.00	79,692,900
ヤマダホールディングス	405,800	515.00	208,987,000
オートバックスセブン	44,800	1,492.00	66,841,600
モリト	9,200	613.00	5,639,600
アークランドサカモト	19,000	1,511.00	28,709,000
ニトリホールディングス	48,100	18,400.00	885,040,000
グルメ杵屋	8,900	985.00	8,766,500
愛眼	7,900	230.00	1,817,000
ケーユーホールディングス	6,200	968.00	6,001,600

吉野家ホールディングス	39,700	2,101.00	83,409,700	
加藤産業	17,400	3,305.00	57,507,000	
北恵	3,300	988.00	3,260,400	
イノテック	6,900	1,357.00	9,363,300	
イエローハット	22,800	1,928.00	43,958,400	
松屋フーズホールディングス	5,700	3,575.00	20,377,500	
JBC Cホールディングス	8,100	1,332.00	10,789,200	
J Kホールディングス	10,900	787.00	8,578,300	
サガミホールディングス	16,400	1,055.00	17,302,000	
日伝	10,200	2,126.00	21,685,200	
関西スーパーマーケット	9,000	1,006.00	9,054,000	
ミロク情報サービス	12,000	1,622.00	19,464,000	
北沢産業	7,500	250.00	1,875,000	
杉本商事	6,200	2,204.00	13,664,800	
因幡電機産業	32,200	2,562.00	82,496,400	
王将フードサービス	8,000	5,630.00	45,040,000	
プレナス	13,700	2,038.00	27,920,600	
ミニストップ	9,000	1,416.00	12,744,000	
アークス	23,000	2,415.00	55,545,000	
パローホールディングス	24,800	2,273.00	56,370,400	
東テク	4,100	2,696.00	11,053,600	
ミスミグループ本社	151,800	3,510.00	532,818,000	
藤久	2,500	843.00	2,107,500	
アルテック	9,000	336.00	3,024,000	
ベルク	6,000	5,650.00	33,900,000	
大 庄	6,500	1,150.00	7,475,000	
タキヒヨー	4,100	1,862.00	7,634,200	
ファーストリテイリング	16,200	83,280.00	1,349,136,000	
ソフトバンクグループ	957,500	8,022.00	7,681,065,000	
蔵王産業	2,100	1,461.00	3,068,100	
スズケン	51,200	3,480.00	178,176,000	
サンドラッグ	45,500	3,555.00	161,752,500	
サックスパー ホールディングス	10,300	655.00	6,746,500	
ジェコス	8,700	886.00	7,708,200	
ヤマザワ	2,500	1,717.00	4,292,500	
やまや	2,400	2,328.00	5,587,200	
グローセル	13,300	427.00	5,679,100	
ベルーナ	26,000	1,100.00	28,600,000	
合計	130,470,900		330,176,948,320	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第21期中間計算期間(2021年6月11日から2021年12月10日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【MHAMトピックスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第20期 2021年6月10日現在	第21期中間計算期間末 2021年12月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,582,781	7,744,078
親投資信託受益証券	2,049,805,918	2,218,439,234
未収入金	56,842,000	5,524,000
流動資産合計	2,114,230,699	2,231,707,312
資産合計	2,114,230,699	2,231,707,312
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	36,750,262	-
未払解約金	20,710,363	5,534,395
未払受託者報酬	763,014	848,327
未払委託者報酬	5,777,385	6,423,409
その他未払費用	15,399	17,113
流動負債合計	64,016,423	12,823,244
負債合計	64,016,423	12,823,244
純資産の部		
元本等		
元本	1,312,509,385	1,397,919,800
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	737,704,891	820,964,268
(分配準備積立金)	370,776,427	319,098,989
元本等合計	2,050,214,276	2,218,884,068
純資産合計	2,050,214,276	2,218,884,068
負債純資産合計	2,114,230,699	2,231,707,312

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第20期中間計算期間 自 2020年6月11日 至 2020年12月10日	第21期中間計算期間 自 2021年6月11日 至 2021年12月10日
営業収益		
受取利息	4	7
有価証券売買等損益	184,062,265	45,645,828
その他収益	-	153
営業収益合計	184,062,269	45,645,988
営業費用		
支払利息	905	678
受託者報酬	680,720	848,327
委託者報酬	5,154,246	6,423,409
その他費用	13,837	17,113
営業費用合計	5,849,708	7,289,527
営業利益又は営業損失()	178,212,561	38,356,461
経常利益又は経常損失()	178,212,561	38,356,461
中間純利益又は中間純損失()	178,212,561	38,356,461
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	12,991,926	10,330,242
期首剰余金又は期首欠損金()	398,282,853	737,704,891
剰余金増加額又は欠損金減少額	80,413,686	173,181,589
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	80,413,686	173,181,589
剰余金減少額又は欠損金増加額	86,698,565	117,948,431
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	86,698,565	117,948,431
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	557,218,609	820,964,268

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第21期中間計算期間	
	自 2021年6月11日 至 2021年12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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第20期	第21期中間計算期間末
	2021年6月10日現在	2021年12月10日現在
1. 期首元本額	1,312,071,726円	1,312,509,385円
期中追加設定元本額	520,353,240円	294,445,427円
期中一部解約元本額	519,915,581円	209,035,012円
2. 受益権の総数	1,312,509,385口	1,397,919,800口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第20期	第21期中間計算期間末
	2021年6月10日現在	2021年12月10日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第20期 2021年6月10日現在	第21期中間計算期間末 2021年12月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5621円 (15,621円)	1.5873円 (15,873円)

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年12月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	45,451,858,393
株式	363,415,071,680
派生商品評価勘定	986,850
未収入金	197,116,000
未収配当金	200,829,460
差入委託証拠金	465,300,000
流動資産合計	409,731,162,383
資産合計	409,731,162,383
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	62,611,810
前受金	2,183,800
未払金	35,052,972,208
未払解約金	983,051,000
流動負債合計	36,100,818,818
負債合計	36,100,818,818
純資産の部	
元本等	
元本	114,353,924,593
剰余金	
剰余金又は欠損金()	259,276,418,972
元本等合計	373,630,343,565
純資産合計	373,630,343,565
負債純資産合計	409,731,162,383

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年6月11日 至 2021年12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12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	105,488,606,697円
同期中追加設定元本額	83,943,922,967円
同期中一部解約元本額	75,078,605,071円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	561,857,238円
MHAM TOPIXオープン	2,738,525,145円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	7,140,405,531円
One DC 国内株式インデックスファンド	19,491,079,755円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	5,092,905,012円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	3,076,645円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	18,659,312円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	41,772,187円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	27,476,804円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	21,620,440円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	15,389,744円
たわらノーロード TOPIX	1,205,109,831円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	962,530,899円
たわらノーロード バランス(堅実型)	38,340,747円
たわらノーロード バランス(標準型)	240,723,916円
たわらノーロード バランス(積極型)	366,063,594円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	2,732,559円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	165,032,152円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	412,107,365円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	270,476,122円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	391,983,368円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	668,724円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	3,037,224円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	36,590,521円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,439,869円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	18,232,535円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,844,963,155円
Oneグローバルバランス	2,795,675円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,038,077,412円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,418,344,670円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,674,941,112円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	334,539,744円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,114,656,426円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,110,341,745円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	30,491,676円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,051,270,355円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	18,425,550円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	300,531,320円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	298,771,528円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	533,561,492円
投資のソムリエ	8,076,735,283円
クルーズコントロール	395,842,578円
投資のソムリエ<DC年金>	145,317,841円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	320,289,905円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	501,733,094円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	2,361,422円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	12,702,245円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	95,597,380円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,292,825,242円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	34,351,877円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	18,193,283円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,463,864円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	93,991,444円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	332,079,273円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,428,127,036円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	284,208,734円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	27,102,122円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	13,788,280円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	11,461,068円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	85,401,949円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	596,864円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	3,640,985円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	3,874,015円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	49,670,055円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	2,263,070円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	3,573,608円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	11,591,257円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-05(適格機関投資家限定)	90,058,367円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	134,960,368円

マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-07(適格機関投資家限定)	150,626,538円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-08(適格機関投資家限定)	105,376,936円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	3,668,770円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-09(適格機関投資家限定)	104,416,174円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	86,397,499円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	34,677,974円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	339,900,198円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	6,203,992円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	798,463円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	59,028,220円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	101,937,229円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	6,016,796円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	27,908,621円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,368,057円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,335,829円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	7,896,644円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	34,542,192円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	572,373,620円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	646,708,103円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,855,612,484円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	32,405,414円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	31,859,413円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	309,066,053円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	75,509,574円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,417,591円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	361,064,733円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	21,158,764円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	73,410,368円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	175,521,201円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	250,882,783円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	38,546,882円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	18,298,737円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	291,737,796円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	936,557,239円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,240,495,959円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	49,936,951円
動的パッケージファンド<DC年金>	6,227,551円

コア資産形成ファンド	4,646,214円
MHAMトピックスファンド	678,982,412円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	66,212,427円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	871,495,031円
MHAM日本株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	2,148,345,553円
計	114,353,924,593円
2. 受益権の総数	114,353,924,593口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年12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	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2021年12月10日現在			
	契約額等（円）	うち		評価損益（円）
		1年超		
市場取引				
先物取引				
買建	11,349,856,200	-	11,288,420,000	61,436,200
合計	11,349,856,200	-	11,288,420,000	61,436,200

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年12月10日現在

1口当たり純資産額	3,2673円
(1万口当たり純資産額)	(32,673円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年12月30日現在

資産総額	2,246,182,835円
負債総額	8,281,184円
純資産総額(-)	2,237,901,651円
発行済数量	1,396,692,365口
1口当たり純資産額(/)	1.6023円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2021年12月30日現在

資産総額	474,377,179,361円
負債総額	265,307,399円
純資産総額(-)	474,111,871,962円
発行済数量	143,695,583,472口
1口当たり純資産額(/)	3.2994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12月30日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2021年12月30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. 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年12月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,506,807,208,638
追加型株式投資信託	825	15,911,064,690,034
単位型公社債投資信託	28	59,752,056,358
単位型株式投資信託	220	1,332,625,264,209
合計	1,099	18,810,249,219,239

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．委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第37期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第36期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第37期事業年度の中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

3．委託会社は、第36期事業年度（自2020年4月1日至2021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37期中間会計期間（自2021年4月1日至2021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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	32,932,013	36,734,502
金銭の信託	28,548,165	25,670,526
有価証券	996	-
未収委託者報酬	11,487,393	16,804,456
未収運用受託報酬	4,674,225	5,814,654
未収投資助言報酬	331,543	317,567
未収収益	11,674	7,412
前払費用	480,129	724,591
その他	2,815,351	2,419,487
流動資産計	81,281,494	88,493,198
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 1,006,793	1 915,815
器具備品	1 270,768	1 202,902
建設仮勘定	894	609
無形固定資産		
ソフトウェア	3,299,065	2,878,179
ソフトウェア仮勘定	221,784	1,109,723
電話加入権	3,931	3,931
投資その他の資産		
投資有価証券	261,361	261,360
関係会社株式	5,299,196	5,299,196
長期差入保証金	1,302,402	1,324,203
繰延税金資産	2,508,004	3,676,823
その他	111,162	591,970
固定資産計	14,285,364	16,264,717
資産合計	95,566,859	104,757,915

(単位:千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	3,702,906	3,730,283
未払金	4,803,140	7,337,541
未払収益分配金	966	846
未払償還金	9,999	9,999
未払手数料	4,582,140	6,889,193
その他未払金	210,034	437,502
未払費用	6,673,320	9,713,972
未払法人税等	4,090,268	4,199,922
未払消費税等	1,338,183	2,106,617
賞与引当金	1,373,328	1,789,597
役員賞与引当金	65,290	76,410
流動負債計	22,046,438	28,954,345
固定負債		
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
時効後支払損引当金	174,139	157,945
固定負債計	2,293,087	2,450,431
負債合計	24,339,526	31,404,777
(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	49,674,383	51,800,187
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	49,551,090	51,676,893
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	17,871,090	19,996,893
株主資本計	71,227,341	73,353,144
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	7	6
評価・換算差額等計	7	6
純資産合計	71,227,333	73,353,137
負債・純資産合計	95,566,859	104,757,915

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	84,426,075		89,905,293	
運用受託報酬	16,912,305		17,640,234	
投資助言報酬	1,208,954		1,103,477	
その他営業収益	68,156		781,735	
営業収益計		102,615,492		109,430,741
営業費用				
支払手数料	34,980,736		37,003,102	
広告宣伝費	340,791		424,598	
公告費	375		400	
調査費	25,132,268		30,794,092	
調査費	10,586,542		11,302,420	
委託調査費	14,545,725		19,491,671	
委託計算費	698,723		543,135	
営業雑経費	990,002		938,891	
通信費	44,209		46,358	
印刷費	738,330		680,272	
協会費	71,386		71,361	
諸会費	22,790		23,936	
支払販売手数料	113,286		116,962	
営業費用計		62,142,897		69,704,220
一般管理費				
給料	10,817,861		10,586,117	
役員報酬	174,795		163,394	
給料・手当	9,087,800		9,030,562	
賞与	1,555,264		1,392,160	
交際費	40,436		8,168	
寄付金	8,906		7,757	
旅費交通費	320,037		50,081	
租税公課	651,265		912,570	
不動産賃借料	1,479,503		1,499,753	
退職給付費用	505,189		524,845	
固定資産減価償却費	882,526		1,078,185	
福利厚生費	44,352		44,004	
修繕費	1,843		777	
賞与引当金繰入額	1,373,328		1,789,597	
役員賞与引当金繰入額	65,290		76,410	
機器リース料	233		208	
事務委託費	3,625,424		3,793,883	
事務用消耗品費	104,627		68,534	
器具備品費	1,620		548	
諸経費	197,094		152,830	
一般管理費計		20,119,543		20,594,276
営業利益		20,353,050		19,132,244

（単位：千円）

	第35期 （自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）		第36期 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	
営業外収益				
受取利息	4,440		27,079	
受取配当金	11,185		2,356	
時効成立分配金・償還金	49,164		362	
投資信託償還益	5,528		-	
為替差益	-		7,314	
金銭の信託運用益	-		1,229,697	
受取負担金	297,886		-	
雑収入	7,394		13,505	
時効後支払損引当金戻入額	3,473		13,011	
営業外収益計		379,073		1,293,326
営業外費用				
為替差損	19,750		-	
投資信託償還損	1		3	
金銭の信託運用損	169,505		-	
システム解約料	31,680		-	
早期割増退職金	-		48,755	
雑損失	104		5	
営業外費用計		221,042		48,764
経常利益		20,511,082		20,376,806
特別利益				
投資有価証券売却益	1,169,758		-	
特別利益計		1,169,758		-
特別損失				
固定資産除却損	1 16,085		1 1,511	
特別損失計		16,085		1,511
税引前当期純利益		21,664,754		20,375,294
法人税、住民税及び事業税		7,045,579		7,418,311
法人税等調整額		385,835		1,168,820
法人税等合計		6,659,743		6,249,491
当期純利益		15,005,011		14,125,803

(3)【株主資本等変動計算書】

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								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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				株主資本 合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341
当期変動額									
剰余金の配当							12,000,000	12,000,000	12,000,000
当期純利益							14,125,803	14,125,803	14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,125,803	2,125,803	2,125,803
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	19,996,893	51,800,187	73,353,144

	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	7	7	71,227,333
当期変動額			
剰余金の配当			12,000,000
当期純利益			14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	1	1	1
当期変動額合計	1	1	2,125,804
当期末残高	6	6	73,353,137

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。

(未適用の会計基準等)

1. 収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)

(1) 概要

国際会計基準審議会(IASB)及び米国財務会計基準審議会(FASB)は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、2014年5月に「顧客との契約から生じる収益」(IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic 606)を公表しており、IFRS第15号は2018年1月1日以後開始する事業年度から、Topic 606は2017年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわせない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

(2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等

- ・「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)

(1) 概要

国際会計基準審議会(IASB)及び米国財務会計基準審議会(FASB)が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス(国際財務報告基準(IFRS)においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」)を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされています。

(2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
建物	320,020	407,133
器具備品	949,984	978,763

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第35期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)	第36期 (自2020年4月1日 至2021年3月31日)
建物	-	944
器具備品	9,609	566
ソフトウエア	6,475	-

(株主資本等変動計算書関係)

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

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					

第36期(自2020年4月1日至2021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
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
2021年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種 類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第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	-

第36期(2021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	36,734,502	36,734,502	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	25,670,526	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	16,804,456	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	5,814,654	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	1,990	1,990	-
資産計	85,026,130	85,026,130	-
(1) 未払手数料	6,889,193	6,889,193	-
負債計	6,889,193	6,889,193	-

(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、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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
非上場株式	259,369	259,369
関係会社株式	5,299,196	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 其他有価証券」には含めておりません。

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第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 其他有価証券(投資信託)	996	994	997	-

第36期(2021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	36,734,502	-	-	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1,990	-	-

(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35期の貸借対照表計上額5,299,196千円、第36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、記載しておりません。

2. その他有価証券

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。

第36期(2021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	1,990	2,000	9
小計	1,990	2,000	9
合計	1,990	2,000	9

(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

第36期（自 2020年4月1日 至 2021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)
投資信託	996	-	3

（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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,289,044	2,422,901
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の発生額	18,448	4,319
退職給付の支払額	187,749	245,143
過去勤務費用の発生額	-	1,567
その他	1,476	1,567
退職給付債務の期末残高	2,422,901	2,479,619

(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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未積立退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未認識数理計算上の差異	130,155	84,264
未認識過去勤務費用	173,798	102,868
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の費用処理額	38,861	41,571
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,362
その他	11,303	7,720
確定給付制度に係る退職給付費用	401,711	409,394

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、当事業年度において48,755千円を営業外費用に計上しております。

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021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% ~ 3.76%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度103,477千円、当事業年度100,806千円であります。

(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35期	第36期
	(2020年3月31日現在)	(2021年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	221,053	260,377
未払事業所税	10,778	10,711
賞与引当金	420,513	547,974
未払法定福利費	78,439	92,748
未払給与	10,410	8,535
受取負担金	47,781	-
運用受託報酬	331,395	1,410,516
資産除去債務	14,116	18,079
減価償却超過額(一括償却資産)	50,942	25,808
減価償却超過額	82,684	51,986
繰延資産償却超過額(税法上)	323,132	301,965
退職給付引当金	648,821	701,959
時効後支払損引当金	53,321	48,362
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	11,532	5,283
その他有価証券評価差額金	3	2
繰延税金資産小計	2,508,004	3,676,823
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,508,004	3,676,823
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	2,508,004	3,676,823

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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	94,605,736千円	84,609,003千円
資産合計	94,605,736千円	84,609,003千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	8,278,713千円	5,570,814千円
負債合計	8,278,713千円	5,570,814千円
純資産	86,327,023千円	79,038,188千円

(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	62,885,491千円	59,074,249千円
顧客関連資産	34,810,031千円	29,793,358千円

(2) 損益計算書項目

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	8,954,439千円	8,823,626千円
経常利益	8,954,439千円	8,823,626千円
税引前当期純利益	9,111,312千円	8,823,626千円
当期純利益	7,536,465千円	7,288,834千円
1株当たり当期純利益	188,411円64銭	182,220円85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	5,149,555千円	5,016,672千円

(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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)及び第36期(自 2020年4月1日 至 2021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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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	6,435,839	未払 手数料	1,457,765
	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	12,767,199	未払 手数料	2,524,882

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	1,780,683円32銭	1,833,828円44銭
1株当たり当期純利益金額	375,125円27銭	353,145円08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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
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:百万円)

		第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		28,648
金銭の信託		25,866
未収委託者報酬		18,882
未収運用受託報酬		2,911
未収投資助言報酬		319
未収収益		15
前払費用		996
その他		2,470
	流動資産計	80,112
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	792
器具備品	1	184
無形固定資産		
ソフトウェア		4,193
ソフトウェア仮勘定		3,475
電話加入権		714
電話加入権		3
投資その他の資産		
投資有価証券		10,724
関係会社株式		261
長期差入保証金		5,299
繰延税金資産		1,273
繰延税金資産		3,311
その他		578
	固定資産計	15,895
資産合計		96,007

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,845
未払金	7,922
未払収益分配金	0
未払償還金	9
未払手数料	7,759
その他未払金	153
未払費用	7,337
未払法人税等	3,423
未払消費税等	1,234
契約負債	20
賞与引当金	836
役員賞与引当金	33
	流動負債計
	22,653
固定負債	
退職給付引当金	2,391
時効後支払損引当金	147
	固定負債計
	2,538
負債合計	25,192
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	19,552
資本準備金	2,428
その他資本剰余金	17,124
利益剰余金	49,261
利益準備金	123
その他利益剰余金	49,138
別途積立金	31,680
繰越利益剰余金	17,458
	株主資本計
	70,814
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	0
	評価・換算差額等計
	0
純資産合計	70,814
負債・純資産合計	96,007

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	54,995	
運用受託報酬	7,193	
投資助言報酬	569	
その他営業収益	6	
		営業収益計 62,765
営業費用		
支払手数料	22,800	
広告宣伝費	126	
公告費	0	
調査費	17,656	
調査費	4,722	
委託調査費	12,934	
委託計算費	281	
営業雑経費	437	
通信費	17	
印刷費	315	
協会費	33	
諸会費	17	
支払販売手数料	52	
		営業費用計 41,301
一般管理費		
給料	4,865	
役員報酬	82	
給料・手当	4,565	
賞与	217	
交際費	1	
寄付金	4	
旅費交通費	13	
租税公課	292	
不動産賃借料	892	
退職給付費用	248	
固定資産減価償却費	1 670	
福利厚生費	16	
修繕費	0	
賞与引当金繰入額	836	
役員賞与引当金繰入額	33	
機器リース料	0	
事務委託費	1,971	
事務用消耗品費	26	
器具備品費	0	
諸経費	99	
		一般管理費計 9,973
営業利益		11,490

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	7	
受取配当金	548	
時効成立分配金・償還金	0	
時効後支払損引当金戻入額	10	
為替差益	26	
金銭の信託運用益	288	
雑収入	2	
営業外収益計		884
経常利益		12,374
特別損失		
固定資産除却損	5	
ゴルフ会員権売却損	3	
オフィス再編費用	5	
特別損失計		13
税引前中間純利益		12,360
法人税、住民税及び事業税		3,254
法人税等調整額		364
法人税等合計		3,619
中間純利益		8,741

(3) 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
					別途 積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996
当中間期変動額							
剰余金の配当							11,280
中間純利益							8,741
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	-	-	-	-	-	-	2,538
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	17,458

	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	51,800	73,353	0	0	73,353
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,280	11,280			11,280
中間純利益	8,741	8,741			8,741
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	2,538	2,538	0	0	2,538
当中間期末残高	49,261	70,814	0	0	70,814

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 … 8～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の日翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

6. 重要な収益及び費用の計上基準	<p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年1回受取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(2) 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(3) 投資助言報酬 投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
7. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

会計上の見積りの変更

第37期中間会計期間

(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

当社は、当中間会計期間において、新しい働き方を踏まえたオフィスレイアウトの見直しを決定しました。これに伴い、当中間会計期間において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産の見積耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。また、本社オフィスの不動産賃借契約に伴う原状回復義務として認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積の変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ124百万円減少しております。

(会計方針の変更)

1. 収益認識に関する会計基準等の適用

「収益認識基準に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。当該会計方針の変更による影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等の適用

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することといたしました。当該会計方針の変更による影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うことといたしました。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	520百万円
	器具備品	1,004百万円

(中間損益計算書関係)

項目	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1.減価償却実施額	有形固定資産	156百万円
	無形固定資産	514百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第37期中間会計期間(自2021年4月1日至2021年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当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37期中間会計期間末（2021年9月30日現在）

1. 金融商品の時価等に関する事項

2021年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額 （百万円）	時価 （百万円）	差額 （百万円）
(1) 金銭の信託	25,866	25,866	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	25,868	25,868	-

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	-	5,844	-	5,844
投資有価証券	-	-	-	-
其他有価証券	-	-	-	-
資産計	-	5,844	-	5,844

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日。以下、「時価算定適用指針」という）第26項に従い、経過措置を適用した投資信託は上表には含めておりません。中間貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託20,021百万円、投資有価証券1百万円となります。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券(その他有価証券)	
非上場株式	259
関係会社株式	
非上場株式	5,299

(有価証券関係)

第37期中間会計期間末

(2021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5,299百万円)で市場価格のあるものはありません。

2. その他有価証券

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

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額259百万円)については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

（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

2021年4月1日から2021年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 百万円
固定資産	80,759百万円
資産合計	80,759百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	5,228百万円
負債合計	5,228百万円
純資産	75,530百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額57,168百万円及び顧客関連資産の金額27,484百万円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 百万円
営業利益	4,214百万円
経常利益	4,214百万円
税引前中間純利益	4,214百万円
中間純利益	3,507百万円
1株当たり中間純利益	87,690円34銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額2,309百万円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

（収益認識関係）

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第37期中間会計期間
（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

委託者報酬	54,819百万円
運用受託報酬	7,193百万円
投資助言報酬	569百万円
成功報酬（注）	175百万円
その他営業収益	6百万円
合計	62,765百万円

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

（セグメント情報等）

第37期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021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37期中間会計期間 （自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）	
1株当たり純資産額	1,770,364円46銭
1株当たり中間純利益金額	218,536円02銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
中間純利益金額	8,741百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	8,741百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。
- (3) 通常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（2021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
株式会社北都銀行	12,500	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社荘内銀行	8,500	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社第四北越銀行（ 1）	32,776	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（ 1）	140,409	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社静岡銀行	90,845	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社三十三銀行（ 1）	37,400	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社筑邦銀行（ 1）	8,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社佐賀銀行（ 1）	16,062	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社琉球銀行（ 1）	56,967	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北洋銀行（ 1）	121,101	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社愛知銀行	18,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社高知銀行（ 1）	19,544	日本において銀行業務を営んでおります。
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。
北洋証券株式会社（ 1）	3,000	「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。

楽天証券株式会社	(2) 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。
S M B 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。

(注) 資本金の額は2021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) 2020年12月31日現在

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けならびに収益分配金、償還金および一部解約金の支払等を行います。

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

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

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

委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など

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

- ・目論見書の使用開始日
- ・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
 - 届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
 - 届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
- ・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
- ・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

(2) 有価証券届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」に記載の内容について、投資家の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関する箇所に記載する

ことがあります。また、第二部「ファンド情報」第1「ファンドの状況」5「運用状況」について、有価証券届出書提出後の随時入手可能な直近の情報および同情報についての表での表示に加えて、グラフで表示した情報を目論見書に記載することがあります。

- (3)投資信託説明書(請求目論見書)に約款の全文を掲載します。
- (4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。
- (6)投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

2021年5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

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2021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。

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

利害関係

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

以上

(注1) 上記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) X B R 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7月21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トピックスファンドの2020年6月11日から2021年6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トピックスファンドの2021年6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、継続企業的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。継続企業的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

2021年11月25日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	丘本 正彦 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2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間(2021年4月1日から2021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2021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(2021年4月1日から2021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。

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

利害関係

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

以上

(注1) 上記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。

独立監査人の中間監査報告書

2022年1月21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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMHAMトピックスファンドの2021年6月11日から2021年12月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、MHAMトピックスファンドの2021年12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中間計算期間(2021年6月11日から2021年12月10日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。