

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年2月8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日本株式インデックスファンド(ファンドラッ プ)
【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日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)

(以下「当ファンド」といいます。)

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

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

(3)【発行(売出)価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4)【発行(売出)価格】

取得申込日の基準価額とします。

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

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

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	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(以下同じ)。

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

(5)【申込手数料】

ありません。

(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】

2021年2月9日から2021年8月10日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

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

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

(9) 【払込期日】

取得申込金額は、販売会社が定める期日までに、販売会社にお支払いいただきます。なお、取得申込金額には利息は付されません。

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】

取得申込金額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】

お申込みの方法

当ファンドは、ラップ口座にかかる契約¹に基づいて、ラップ口座の資金を運用するためのファンドです。

当ファンドの受益権の取得申込者は、販売会社にラップ口座を開設した者²に限るものとします。

- 1 当該契約については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約を使用することがあります。
- 2 販売会社にSMA(セパレートリー・マネージド・アカウント)にかかる契約に基づくSMA口座を開設した者を含む場合があります。

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、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。

投資信託振替制度(以下「振替制度」といいます。)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。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

MHAM TOPIXマザーファンド^{*1}（以下「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券への投資を通じて、東京証券取引所第一部に上場されている株式に投資を行い、東証株価指数（TOPIX）^{*2}の動きに連動する投資成果を目指します。

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

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

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

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

1,000億円を上限に信託金を追加することができます。なお、信託金の上限額については、受託会社と合意のうえ変更することができます。

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

< 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 海外 内外	株式 債券 不動産投信 その他資産 （ ） 資産複合	インデックス型 特殊型

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・ 商品分類定義

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

< 属性区分 >

・ 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・ 属性区分定義

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

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

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

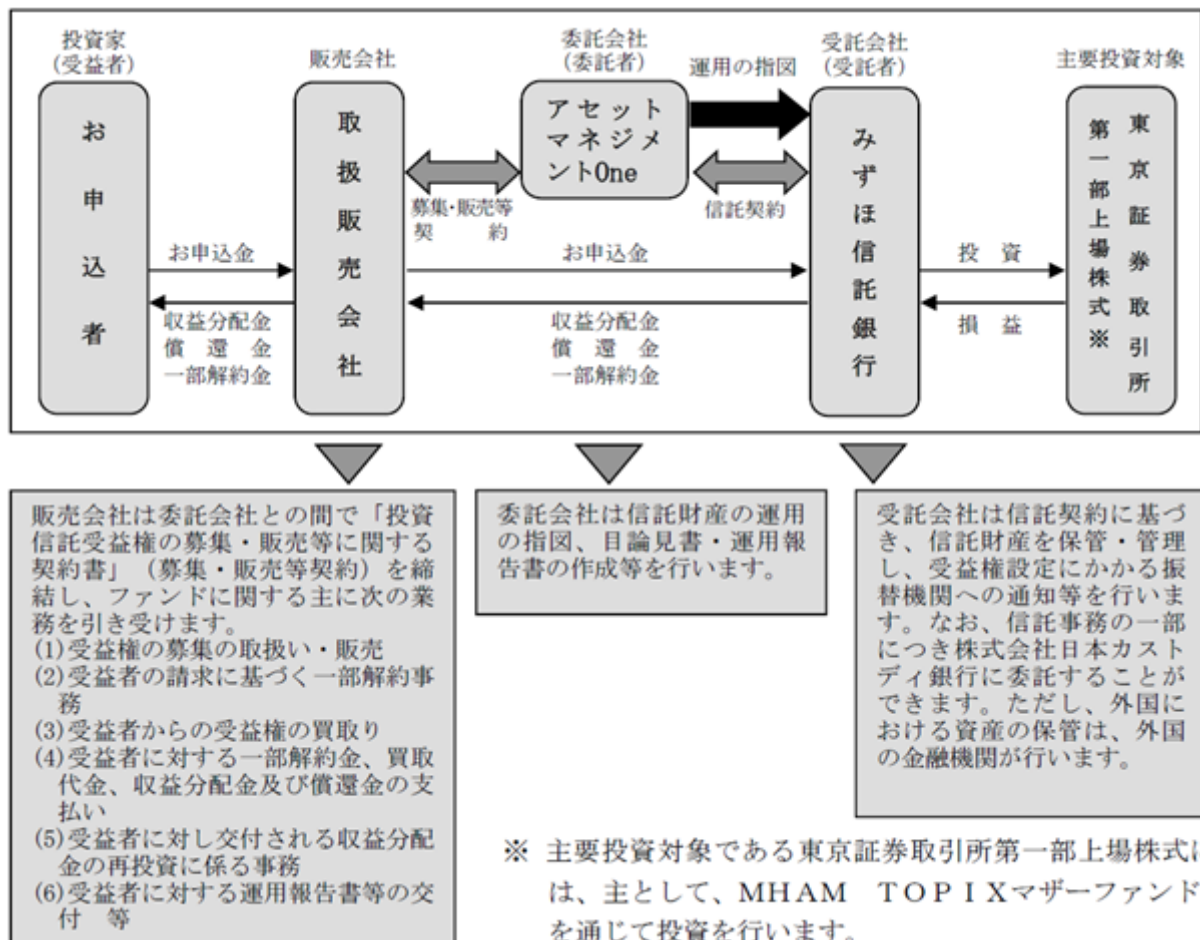
(注3) 当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

（２）【ファンドの沿革】

2008年6月3日	信託契約締結、当ファンドの設定・運用開始
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
2020年10月1日	信託報酬率(税抜)を「年率0.26%」から「年率0.135%」に引き下げ
2021年7月2日	ファンドの主要投資対象に「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」を追加(予定)
2021年12月17日	ファンドの主要投資対象から「MHAM TOPIXマザーファンド」を削除(予定)

（３）【ファンドの仕組み】

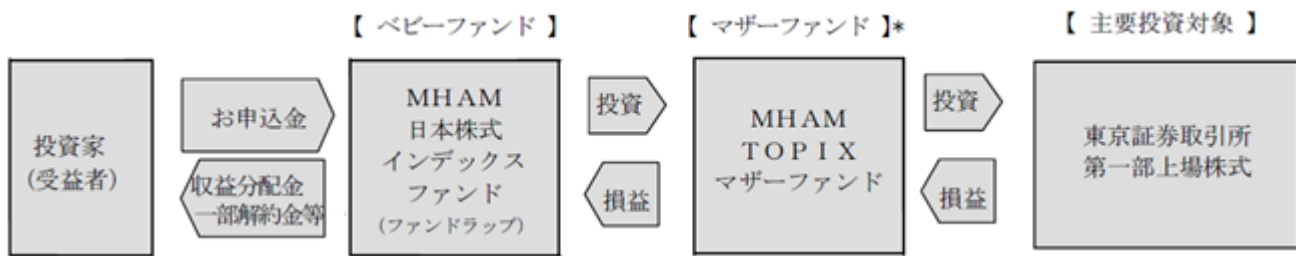
当ファンドの運営の仕組み



ファミリーファンド方式の仕組み

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

ファミリーファンド方式



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

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

委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2020年11月30日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

(2020年11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）^{*1}の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用方法

1．主要投資対象

MHAM TOPIXマザーファンド受益証券^{*2}を主要投資対象とします。

2．投資態度

a．主として、MHAM TOPIXマザーファンド受益証券^{*2}に投資を行い、東証株価指数（TOPIX）^{*1}の動きに連動する投資成果を目指します。

運用にあたっては「日本株式マルチファクターモデル」を活用します。

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

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

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

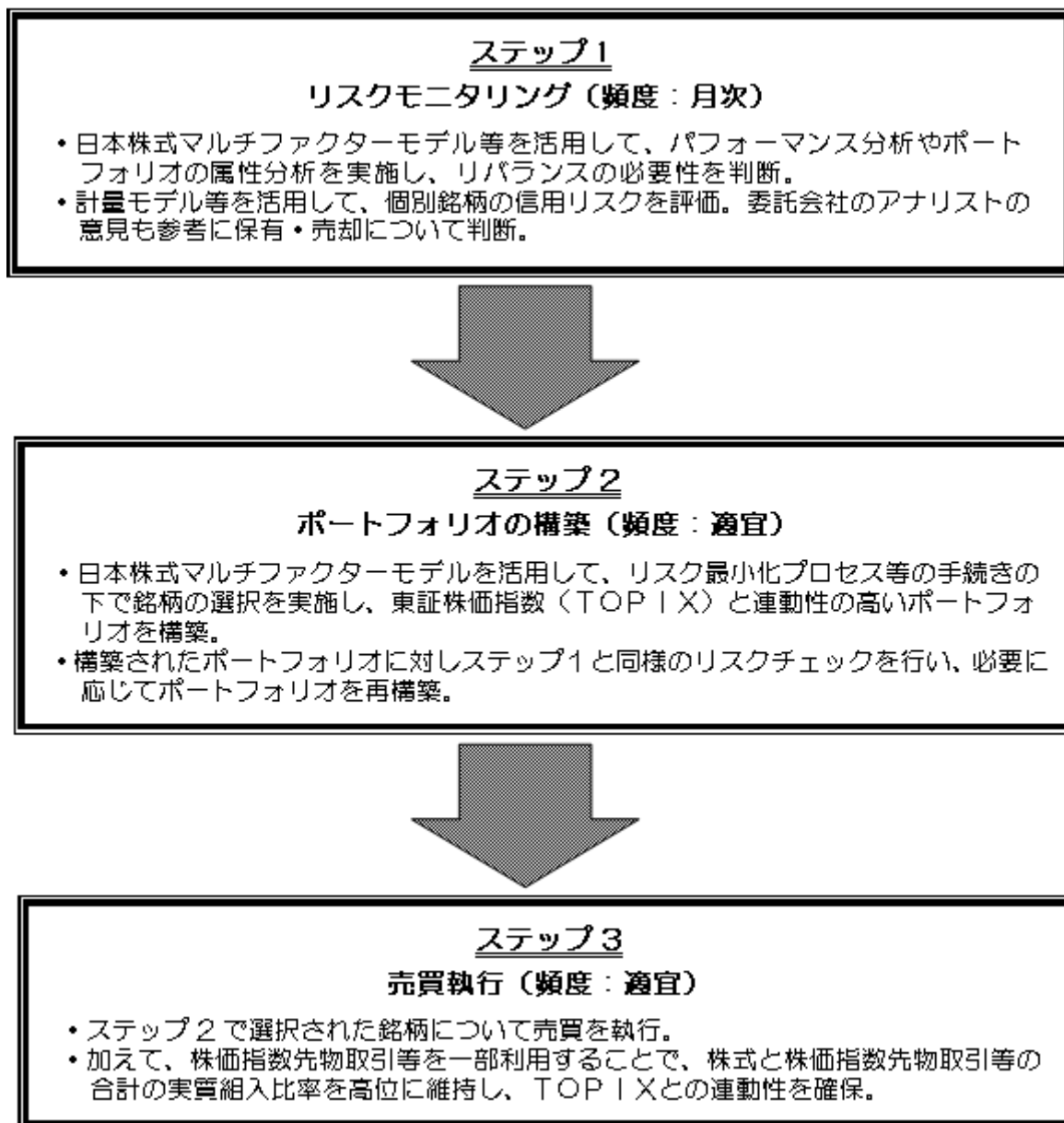
「実質投資割合」とは、投資対象である当該資産につき、当ファンドの信託財産に属する当該資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該資産のうち当ファンドの信託財産に属するとみなした額との合計額の当ファンドの信託財産総額または信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。（以下同じ。）

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

- d . 組入対象銘柄は、東京証券取引所第一部上場株式とします。ただし、流動性に著しく欠ける銘柄や信用リスクが高いと判断される銘柄等は組入れません。
- e . 現物株式の実質組入比率(信託財産に属する他の投資信託受益証券の時価総額に、当該他の投資信託の信託財産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額と、信託財産に属する株式の時価総額との合計額が信託財産総額に占める割合)は、通常の状態では50%以上とすることを基本とします。
- f . 非株式(株式以外の資産)への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- g . 上記a . からf . について、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。
- h . 国内において行われる有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。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。)、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引(以下「有価証券先物取引等」といいます。)を行うことができます。

ファンドの投資プロセス

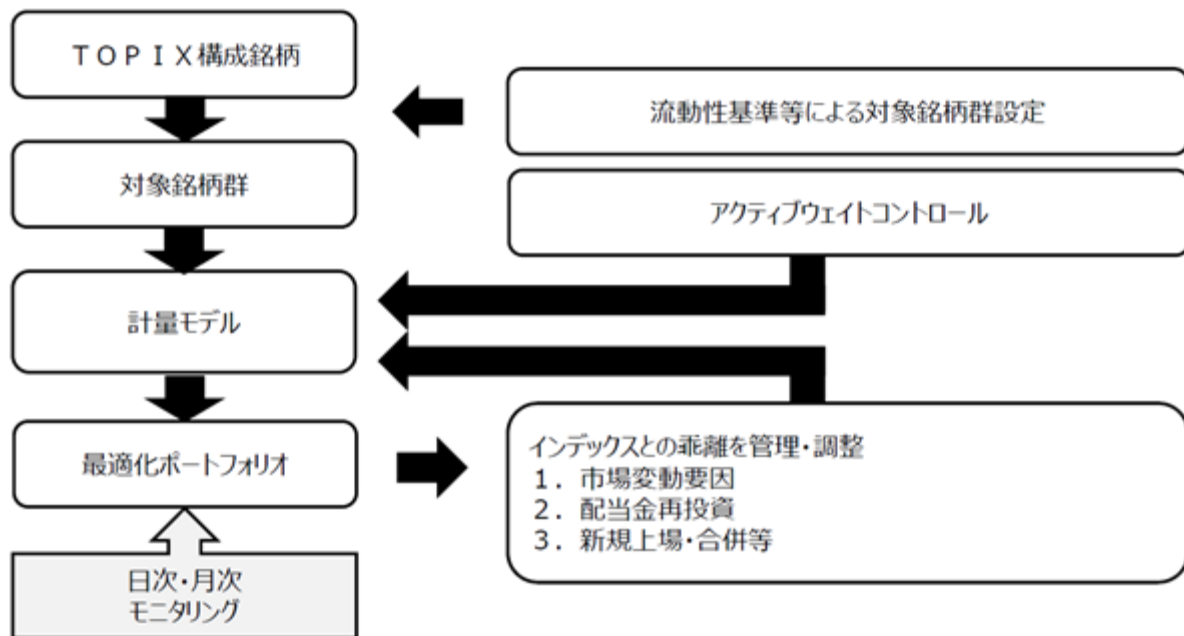
当ファンドは、主としてMHAM TOPIXマザーファンド受益証券^{*2}への投資を通じ、以下のプロセスにより東京証券取引所第一部上場株式に投資を行います。



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

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

<国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの投資プロセス>



1.流動性基準等による対象銘柄群設定

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

2.最適化法によるポートフォリオの構築

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

3.インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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

（２）【投資対象】

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23条、第24条および第25条に定めるものに限りません。）
 - c．金銭債権
 - d．約束手形（a．に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 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親投資信託であるMHAM TOPIX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（新株引受権証書と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6．コマーシャル・ペーパー
- 7．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券（両者を総称して「新株引受権証券等」といいます。）
- 8．外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券または証書で、2．～7．の証券または証書の性質を有するもの
- 9．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
- 10．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 11．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

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

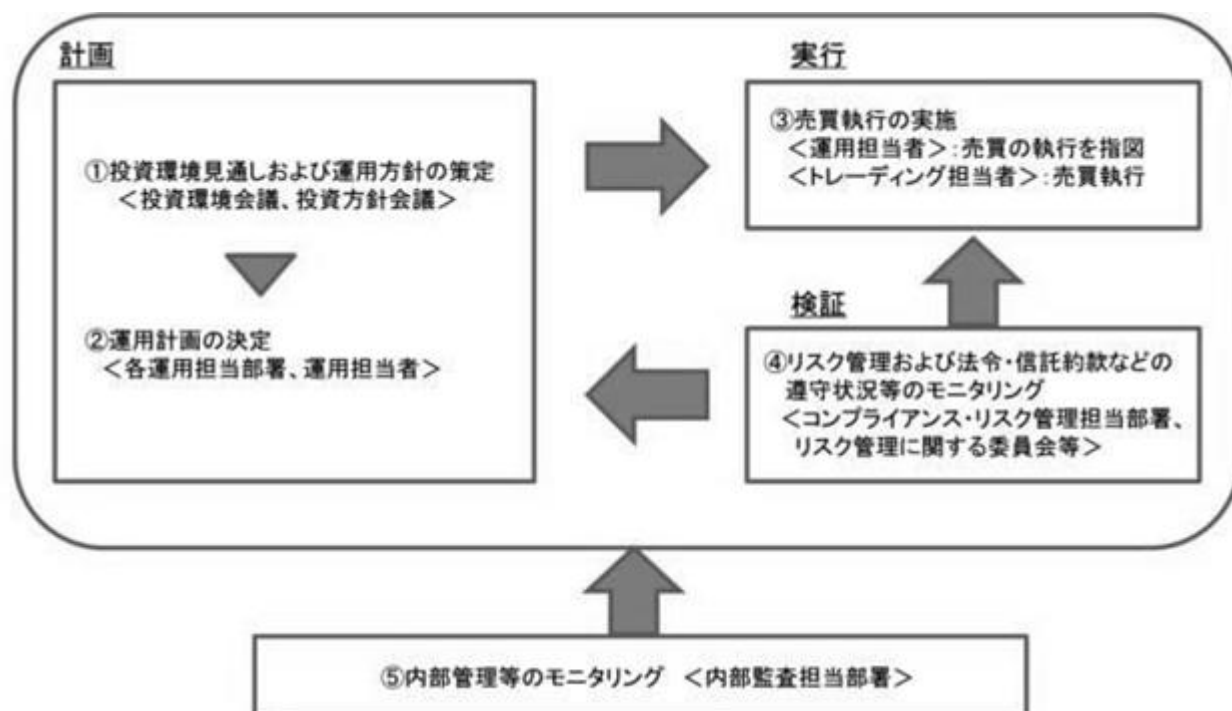
金融商品の指図範囲

委託会社は、信託金を、 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

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2020年11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

毎計算期末（原則として5月8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の水準や市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額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ます。)に対し、お支払いします。

(5) 【投資制限】

a. 約款で定める投資制限

株式および新株引受権証券等(約款 運用の基本方針 運用方法(3) 投資制限、約款第17条および第20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、取得時において新株引受権証券等への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
3. 委託会社が投資することを指図する株式および新株引受権証券等は、取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。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および取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式および新株引受権証券等については、この限りではありません。なお、上場予定または登録予定の株式および新株引受権証券等で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

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50%以下とします。

転換社債等(約款第21条)

委託会社は、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22条)

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
2. 信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - a. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - b. 株式分割により取得する株券
 - c. 有償増資により取得する株券
 - d. 売出しにより取得する株券
 - e. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券
 - f. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前記e.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

信用リスク集中回避のための投資制限(約款第22条の1の2)

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

デリバティブ取引等(約款第22条の2)

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

有価証券先物取引等(約款第23条)

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

スワップ取引(約款第24条)

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
4. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供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25条)

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が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. 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
4. 委託会社は、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26条)

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を以下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合計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32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、解約代金等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> MHAM TOPIX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、わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX(東証株価指数)と連動する投資成果を目標として運用を行います。

(2) 運用方法

投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資態度

1. 現物株への投資よりTOPIX先物等を活用する方が有利と認められるときは、TOPIX先物等を活用することがあります。
2. 株価指数等の先物取引を含む株式の実質組入比率は、原則信託財産の純資産総額の範囲内となるよう運用を行いますが、一時的に株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。
3. 組入対象銘柄は、東京証券取引所第一部上場株式とします。ただし、流動性に著しく欠ける銘柄や信用リスクが高いと判断される銘柄等は組入れません。
4. 上記1から3について、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

(3) 投資制限

株式の組入比率には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

有価証券先物取引等は約款第15条の範囲で行います。

スワップ取引は約款第16条の範囲で行います。

金利先渡取引は約款第17条の範囲で行います。

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

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

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

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

(3) 投資制限

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

3【投資リスク】

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

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

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

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

株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

株価変動リスクとは、株式市場および投資先となっている企業の株価が下落するリスクをいいます。当ファンドが投資する企業の株価が下落した場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、当ファンドが投資する企業が業績悪化や倒産等に陥った場合には、当該企業の株価が大きく下落することや無くなることもあり、当ファンドの基準価額に大きな影響を及ぼすことがあります。なお、当ファンドでは、株式と株価指数先物取引等の合計の組入比率を原則として高位に維持するため、株式市場の動向により基準価額は大きく変動します。また、当ファンドでは、追加設定・一部解約に伴う資金の流出入に対応することにより、株式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。当ファンドが保有する株式等において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。当ファンドが投資対象とする株式の発行企業や、株式以外の運用で投資する公社債等の発行体がこうした状況に陥った場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

<その他>

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

<その他の留意点>

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

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

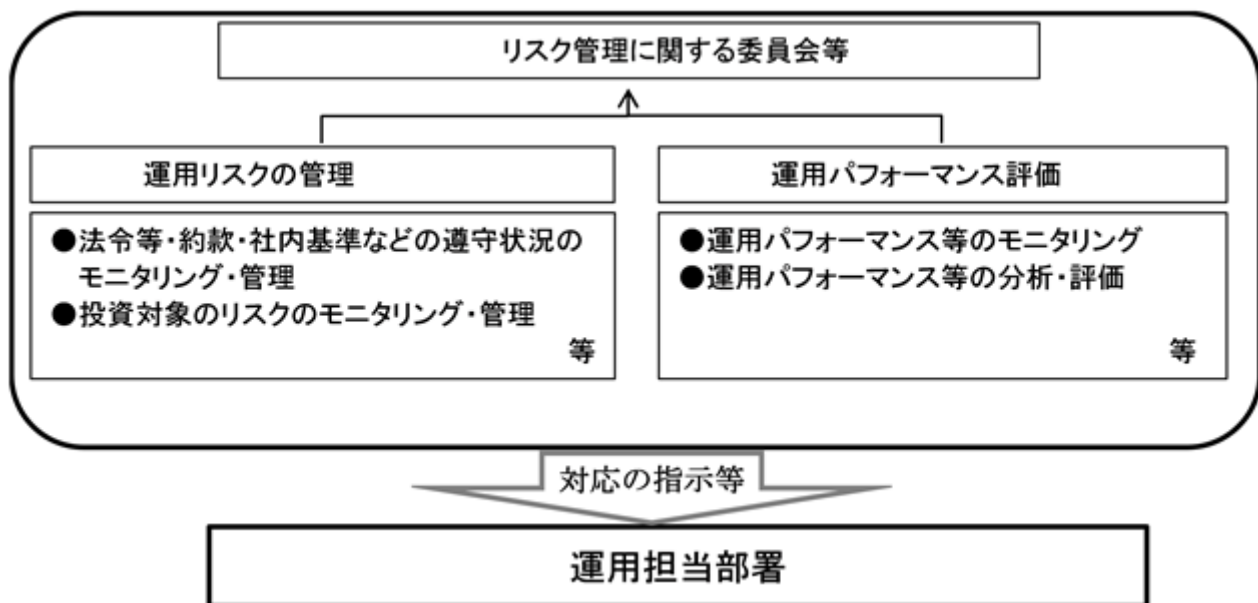
<収益分配金に関する留意点>

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

(2) リスク管理体制

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

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



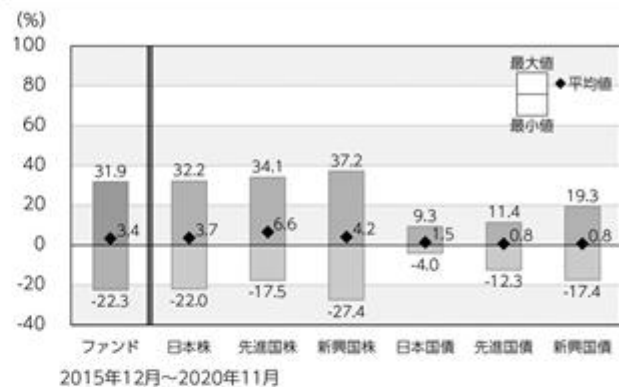
リスク管理体制は2020年11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、(株東京証券取引所)が有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバシファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

当ファンドの信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.1485%（税抜0.135%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分（税抜）については、以下の通りとします。

委託会社	販売会社	受託会社
0.085%	0.010%	0.040%

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。）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、特定資産の価格等の調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、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、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)との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座(源泉徴収口座)をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います(確定申告不要)。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2020年11月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「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】

2020年11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	19,030,270,479	100.00
内 日本	19,030,270,479	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	707,538	0.00
純資産総額	19,030,978,017	100.00

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

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

(参考)

MHAM TOPIXマザーファンド

2020年11月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	42,579,116,440	95.93
内 日本	42,579,116,440	95.93
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,804,802,482	4.07
純資産総額	44,383,918,922	100.00

その他資産の投資状況

2020年11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)	1,755,500,000	3.96
内 日本	1,755,500,000	3.96

(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】

2020年11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	MHAM TOPIXマ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	8,815,616,102	1.7853 15,738,716,789	2.1587 19,030,270,479	- -	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2020年11月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

MHAM TOPIXマザーファンド

2020年11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	193,900	6,721.73 1,303,345,196	6,999.00 1,357,106,100	- -	3.06
2	ソニー 日本	株式 電気機器	108,800	6,890.12 749,646,093	9,704.00 1,055,795,200	- -	2.38
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	135,900	4,902.43 666,240,564	7,272.00 988,264,800	- -	2.23
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	15,800	36,746.02 580,587,230	53,290.00 841,982,000	- -	1.90
5	任天堂 日本	株式 その他製品	10,800	41,622.93 449,527,694	59,260.00 640,008,000	- -	1.44
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	228,900	2,426.33 555,389,036	2,465.00 564,238,500	- -	1.27
7	日本電産 日本	株式 電気機器	41,900	7,032.33 294,654,826	13,305.00 557,479,500	- -	1.26
8	第一三共 日本	株式 医薬品	149,200	2,418.01 360,768,108	3,694.00 551,144,800	- -	1.24
9	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	145,000	3,774.17 547,255,938	3,745.00 543,025,000	- -	1.22
10	ダイキン工業 日本	株式 機械	22,400	14,994.23 335,870,898	23,665.00 530,096,000	- -	1.19
11	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	1,173,300	439.39 515,537,297	448.50 526,225,050	- -	1.19
12	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	119,500	3,614.67 431,953,757	4,400.00 525,800,000	- -	1.18
13	信越化学工業 日本	株式 化学	29,500	11,871.47 350,208,516	17,135.00 505,482,500	- -	1.14
14	HOYA 日本	株式 精密機器	34,700	9,822.39 340,837,119	13,910.00 482,677,000	- -	1.09
15	村田製作所 日本	株式 電気機器	51,000	5,842.39 297,962,015	9,129.00 465,579,000	- -	1.05
16	ファナック 日本	株式 電気機器	16,400	17,234.45 282,645,081	25,365.00 415,986,000	- -	0.94
17	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	11,300	23,416.50 264,606,523	35,470.00 400,811,000	- -	0.90
18	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	137,200	2,607.56 357,758,012	2,871.50 393,969,800	- -	0.89

19	KDDI 日本	株式 情報・通 信業	124,400	3,164.76 393,696,988	2,982.50 371,023,000	- -	0.84
20	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	118,700	2,991.53 355,094,666	3,032.00 359,898,400	- -	0.81
21	エムスリー 日本	株式 サービス 業	36,900	3,878.02 143,098,939	9,622.00 355,051,800	- -	0.80
22	SMC 日本	株式 機械	5,300	45,215.38 239,641,563	66,320.00 351,496,000	- -	0.79
23	日立製作所 日本	株式 電気機器	84,000	3,416.24 286,964,858	3,966.00 333,144,000	- -	0.75
24	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	120,500	2,359.98 284,378,490	2,758.50 332,399,250	- -	0.75
25	花王 日本	株式 化学	41,800	8,153.55 340,818,589	7,808.00 326,374,400	- -	0.74
26	オリエンタルランド 日本	株式 サービス 業	17,700	13,849.99 245,144,930	17,765.00 314,440,500	- -	0.71
27	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	60,500	5,036.71 304,721,515	5,190.00 313,995,000	- -	0.71
28	みずほフィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	233,700	1,270.95 297,021,238	1,327.50 310,236,750	- -	0.70
29	中外製薬 日本	株式 医薬品	54,200	4,101.94 222,325,360	5,044.00 273,384,800	- -	0.62
30	三菱商事 日本	株式 卸売業	112,300	2,457.30 275,955,608	2,433.00 273,225,900	- -	0.62

(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

2020年11月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	95.93
合計	95.93

(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

2020年11月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	16.26
情報・通信業		9.01
化学		7.30
輸送用機器		6.70
医薬品		5.82
サービス業		5.80
機械		5.51
小売業		4.65
銀行業		4.37
卸売業		4.37

食料品	3.39
陸運業	3.36
精密機器	2.68
その他製品	2.60
建設業	2.26
不動産業	1.96
保険業	1.85
電気・ガス業	1.27
その他金融業	1.07
ガラス・土石製品	0.76
証券、商品先物取引業	0.75
非鉄金属	0.64
鉄鋼	0.59
金属製品	0.59
ゴム製品	0.52
繊維製品	0.45
石油・石炭製品	0.34
空運業	0.33
パルプ・紙	0.19
海運業	0.17
倉庫・運輸関連業	0.16
鉱業	0.14
水産・農林業	0.08
合計	95.93

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

MHAM TOPIXマザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

MHAM TOPIXマザーファンド

2020年11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 0212月	買建	100	1,707,918,000	1,755,500,000	3.96

（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（2020年11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3計算期間末 (2011年 3月10日)	4,488	4,488	0.6911	0.6911
第4計算期間末 (2012年 3月12日)	4,181	4,181	0.6412	0.6412
第5計算期間末 (2013年 3月11日)	4,056	4,056	0.8047	0.8047
第6計算期間末 (2014年 3月10日)	3,507	3,507	0.9651	0.9651
第7計算期間末 (2015年 3月10日)	18,168	18,168	1.2193	1.2193
第8計算期間末 (2015年 5月 8日)	23,464	23,464	1.2795	1.2795
第9計算期間末 (2016年 5月 9日)	34,880	34,880	1.0706	1.0706
第10計算期間末 (2017年 5月 8日)	24,701	24,701	1.3241	1.3241
第11計算期間末 (2018年 5月 8日)	24,798	24,798	1.5130	1.5130
第12計算期間末 (2019年 5月 8日)	23,492	23,492	1.3647	1.3647
第13計算期間末 (2020年5月8日)	20,650	20,650	1.2958	1.2958
2019年11月末日	27,088	-	1.4902	-
12月末日	26,890	-	1.5114	-
2020年1月末日	26,095	-	1.4787	-
2月末日	21,739	-	1.3264	-
3月末日	20,204	-	1.2471	-
4月末日	20,762	-	1.3008	-
5月末日	22,008	-	1.3889	-
6月末日	22,950	-	1.3865	-
7月末日	21,725	-	1.3305	-
8月末日	23,195	-	1.4387	-
9月末日	23,240	-	1.4568	-
10月末日	17,488	-	1.4156	-
11月末日	19,030	-	1.5732	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
2020年5月9日～2020年11月8日	-

【収益率の推移】

	収益率（％）
第3計算期間	2.52
第4計算期間	7.22
第5計算期間	25.50
第6計算期間	19.93
第7計算期間	26.34
第8計算期間	4.94
第9計算期間	16.33
第10計算期間	23.68
第11計算期間	14.27
第12計算期間	9.80
第13計算期間	5.0
2020年5月9日～2020年11月8日	14.7

（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】

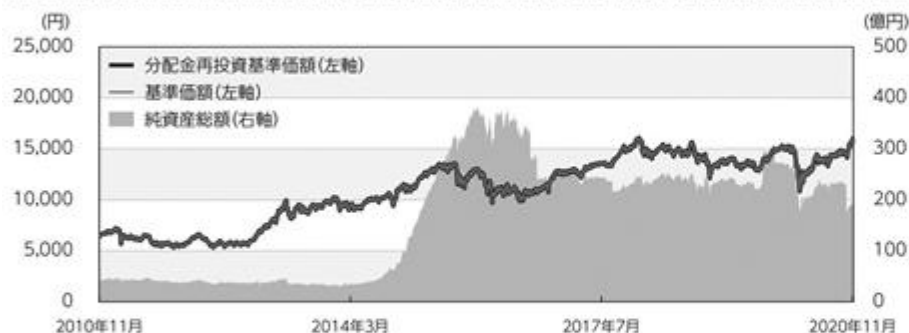
	設定口数	解約口数
第3計算期間	4,459,254,506	2,209,021,365
第4計算期間	2,755,047,535	2,727,807,935
第5計算期間	3,359,518,776	4,839,867,579
第6計算期間	1,248,985,946	2,655,636,874
第7計算期間	12,620,641,465	1,354,962,285
第8計算期間	3,661,017,401	222,867,697
第9計算期間	18,896,947,423	4,655,481,241
第10計算期間	1,050,077,350	14,973,850,728
第11計算期間	3,135,814,239	5,401,555,184
第12計算期間	3,888,606,333	3,064,145,943
第13計算期間	5,479,157,635	6,756,920,323
2020年5月9日～ 2020年11月8日	1,392,096,144	5,006,196,686

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

参考情報

データの基準日:2020年11月30日

基準価額・純資産の推移 (2010年11月30日～2020年11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:2008年6月3日)

分配の推移(税引前)

2016年 5月	0円
2017年 5月	0円
2018年 5月	0円
2019年 5月	0円
2020年 5月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。計理処理の関係上、一時的に100%を超える場合があります。

順位	銘柄名	比率(%)
1	MHAM TOPIXマザーファンド	100.00

■MHAM TOPIXマザーファンド

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

資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	95.93
内 日本	95.93
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4.07
合計(純資産総額)	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	3.96

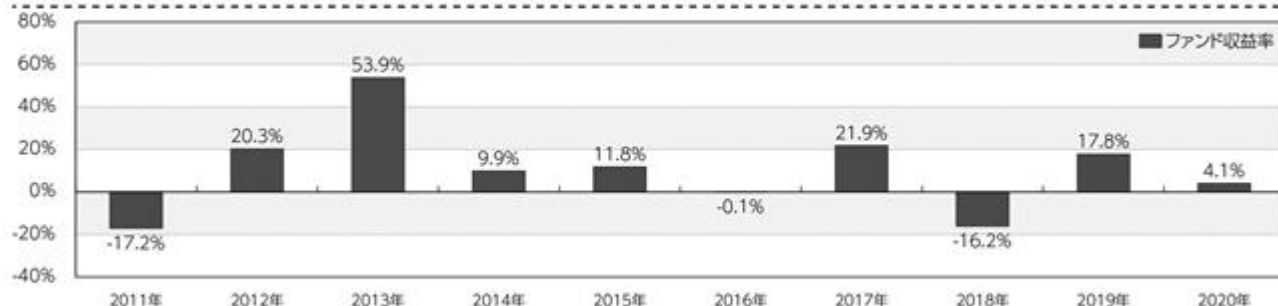
株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	16.26
2	情報・通信業	9.01
3	化学	7.30
4	輸送用機器	6.70
5	医薬品	5.82

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	3.06
2	ソニー	株式	日本	電気機器	2.38
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.23
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.90
5	任天堂	株式	日本	その他製品	1.44
6	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.27
7	日本電産	株式	日本	電気機器	1.26
8	第一三共	株式	日本	医薬品	1.24
9	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.22
10	ダイキン工業	株式	日本	機械	1.19

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
 ※2020年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

- (1) 当ファンドのお申込みは、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後2時までにお買付けのお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日分のお申込みといたします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については翌営業日のお取扱いとなります。
- (2) 取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、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。なお、有価証券届出書提出日現在、「分配金受取コース」を取扱う販売会社はありません。
- (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とします。
- (7) 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。
- (8) 取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

2【換金(解約)手続等】

- (1) 受益者は自己に帰属する受益権につき、委託会社に各販売会社が定める単位をもって解約を請求することができます。
解約単位は、販売会社にお問い合わせください。
- (2) 解約の請求を行う受益者は、振替制度にかかる口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。なお、解約の請求を受益者が行う際は、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

- (3) 解約請求の受け付けについては、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後2時までには解約のお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受け付けにかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日分のお申込みとします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については、翌営業日のお取扱いとなります。
- (4) 解約の価額は、解約請求受付日の基準価額とします。詳しくは、販売会社または委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

- (5) 解約代金は、受益者の請求を受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、取引所における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、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できます。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。

ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、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】

2008年6月3日から無期限とします。

(4) 【計算期間】

原則として毎年5月9日から翌年5月8日までとします。ただし、第1計算期間は、2008年6月3日から2009年3月10日までとし、第8計算期間は、2015年3月11日から2015年5月8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

1. 委託会社は、次のいずれかに該当する場合、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(繰上償還)させることがあります。この場合、委託会社は書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。ただし、当該信託契約の解約についての委託会社による提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには書面決議は行いません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の手続きを行うことが困難な場合にも書面決議は行いません。

a. この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき。

b. やむを得ない事情が発生したとき。

c. 信託契約の一部解約により、受益権の口数が10億口を下回ることとなるとき。

2. 前記1.により信託契約を解約する場合には、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。

3. 委託会社は、次の事象が起きた場合、信託契約を解約し、信託を終了(繰上償還)させます。

a. 委託会社が監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき。

b. 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。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、「信託約款の変更等」の書面決議が否決された場合を除き、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。

c. 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。

信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合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。なお、この信託約款は「信託約款の変更等」および「書面決議」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

2. 委託会社は、前記1.の事項(前記1.の変更事項にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、前記1.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。ただし、当該重大な約款の変更等についての委託会社による提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには書面決議は行いません。
3. この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
4. 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。

書面決議

1. 委託会社は、信託契約の解約または重大な約款の変更等に係る書面決議を行う場合には、あらかじめ、書面決議の日および当該決議の内容に応じて次の事項をそれぞれ定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約または信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
 - a. 信託契約の解約の場合 信託契約の解約の理由など
 - b. 重大な約款の変更等の場合 重大な約款の変更等の内容およびその理由など
2. 書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下この2.において同じ。)は受益権の口数に応じて議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
3. 書面決議は、議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
4. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
5. この信託は、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

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ならびに受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

1. 委託会社と販売会社との間の募集・販売等契約は、締結日から原則1年間とし、期間終了の3ヵ月前までに別段の意思表示のない時は、同一条件にて継続されます。

2. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。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、「信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。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て)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てします。）に、原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

(3) 一部解約請求権

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

(4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間(令和1年5月9日から令和2年5月8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日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第12期 令和1年5月8日現在	第13期 令和2年5月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	47,060,303	37,203,276
親投資信託受益証券	23,490,369,317	20,648,767,667
未収入金	5,130,000	21,672,000
未収利息	25	-
流動資産合計	23,542,559,645	20,707,642,943
資産合計	23,542,559,645	20,707,642,943
負債の部		
流動負債		
未払解約金	17,369,489	22,389,725
未払受託者報酬	6,291,597	6,647,337
未払委託者報酬	26,424,655	27,918,979
その他未払費用	176,927	177,186
流動負債合計	50,262,668	57,133,227
負債合計	50,262,668	57,133,227
純資産の部		
元本等		
元本	17,214,615,981	15,936,853,293
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	6,277,680,996	4,713,656,423
(分配準備積立金)	4,526,683,661	3,626,059,169
元本等合計	23,492,296,977	20,650,509,716
純資産合計	23,492,296,977	20,650,509,716
負債純資産合計	23,542,559,645	20,707,642,943

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第12期 自 平成30年5月9日 至 令和1年5月8日	第13期 自 令和1年5月9日 至 令和2年5月8日
営業収益		
受取利息	122	19
有価証券売買等損益	2,398,816,150	723,043,650
営業収益合計	2,398,816,028	723,043,631
営業費用		
支払利息	24,991	15,697
受託者報酬	12,890,585	13,442,698
委託者報酬	54,140,369	56,459,477
その他費用	367,361	363,247
営業費用合計	67,423,306	70,281,119
営業利益又は営業損失()	2,466,239,334	793,324,750
経常利益又は経常損失()	2,466,239,334	793,324,750
当期純利益又は当期純損失()	2,466,239,334	793,324,750
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()	213,893,946	397,581,427
期首剰余金又は期首欠損金()	8,408,820,697	6,277,680,996
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,675,303,025	2,119,838,559
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	1,675,303,025	2,119,838,559
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,554,097,338	2,492,956,955
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,554,097,338	2,492,956,955
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	6,277,680,996	4,713,656,423

(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13期	
	自 令和1年5月9日	至 令和2年5月8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12期	第13期
	令和1年5月8日現在	令和2年5月8日現在
1. 期首元本額	16,390,155,591円	17,214,615,981円
期中追加設定元本額	3,888,606,333円	5,479,157,635円
期中一部解約元本額	3,064,145,943円	6,756,920,323円
2. 受益権の総数	17,214,615,981口	15,936,853,293口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第12期	第13期
	自 平成30年5月9日 至 令和1年5月8日	自 令和1年5月9日 至 令和2年5月8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(490,335,372円)、有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(8,524,314,760円)、分配準備積立金(4,036,348,289円)より、分配対象収益は13,050,998,421円(1万口当たり7,581円)であります。当期の収益分配金につきましては、見送りとなりました。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(504,711,959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(9,017,468,140円)及び分配準備積立金(3,121,347,210円)より分配対象収益は12,643,527,309円(1万口当たり7,933.51円)であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第12期	第13期
	自 平成30年5月9日 至 令和1年5月8日	自 令和1年5月9日 至 令和2年5月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

<p>2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク</p>	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。</p> <p>これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p>	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p>
<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 令和1年5月8日現在	第13期 令和2年5月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 親投資信託受益証券</p> <p>原則として、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には、合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第12期 令和1年5月8日現在	第13期 令和2年5月8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	2,233,638,572	1,109,412,648
合計	2,233,638,572	1,109,412,648

(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12期 令和1年5月8日現在	第13期 令和2年5月8日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,3647円 (13,647円)	1,2958円 (12,958円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

令和2年5月8日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	MHAM TOPIXマザー ファンド	11,629,832,536	20,648,767,667	
親投資信託受益証券	合計	11,629,832,536	20,648,767,667	
合計			20,648,767,667	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「MHAM TOPIXマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

MHAM TOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

令和2年5月8日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	384,826,875
株式	34,792,997,840
派生商品評価勘定	12,494,480
未収入金	1,784,340
未収配当金	419,513,166
前払金	1,107,700
差入委託証拠金	40,425,000
流動資産合計	35,653,149,401
資産合計	35,653,149,401
負債の部	
流動負債	
未払解約金	33,776,000
流動負債合計	33,776,000
負債合計	33,776,000
純資産の部	
元本等	
元本	20,061,470,270
剰余金	
剰余金又は欠損金()	15,557,903,131
元本等合計	35,619,373,401
純資産合計	35,619,373,401
負債純資産合計	35,653,149,401

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和1年5月9日 至 令和2年5月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年5月8日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	21,543,095,659円
同期中追加設定元本額	9,971,150,472円
同期中一部解約元本額	11,452,775,861円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	864,954,698円
MHAM TOPIXオープン	4,120,211,518円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	11,629,832,536円
動的パッケージファンド<DC年金>	4,668,475円
コア資産形成ファンド	4,240,616円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	116,271,260円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	872,735,808円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,448,555,359円
計	20,061,470,270円
2. 受益権の総数	20,061,470,270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 令和1年5月9日 至 令和2年5月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年5月8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った場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年5月8日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	1,215,798,979
合計	1,215,798,979

(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(令和2年3月11日から令和2年5月8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	令和2年5月8日現在			
	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	773,457,700	-	785,970,000	12,512,300
合計	773,457,700	-	785,970,000	12,512,300

(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)

	令和2年5月8日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7755円 (17,755円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

令和2年5月8日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	800	2,547.00	2,037,600	
日本水産	22,800	472.00	10,761,600	
マルハニチロ	3,200	2,250.00	7,200,000	
ハウスイ	400	886.00	354,400	
カネコ種苗	600	1,421.00	852,600	
サカタのタネ	2,800	3,640.00	10,192,000	
ホクト	1,800	1,958.00	3,524,400	
ホクリヨウ	400	578.00	231,200	
ヒノキヤグループ	500	1,684.00	842,000	
ショーボンドホールディングス	3,600	4,395.00	15,822,000	
ミライト・ホールディングス	6,900	1,433.00	9,887,700	
タマホーム	1,300	1,310.00	1,703,000	
サンヨーホームズ	300	599.00	179,700	
日本アクア	1,100	623.00	685,300	
ファーストコーポレーション	600	488.00	292,800	
ベステラ	400	990.00	396,000	
TATERU	5,100	115.00	586,500	
キャンディル	700	506.00	354,200	
スペースバリューホールディングス	2,900	344.00	997,600	
住石ホールディングス	5,600	113.00	632,800	
日鉄鉱業	500	4,515.00	2,257,500	
三井松島ホールディングス	900	856.00	770,400	
国際石油開発帝石	91,500	692.20	63,336,300	
石油資源開発	3,200	1,883.00	6,025,600	
K&Oエナジーグループ	1,100	1,559.00	1,714,900	
ダイセキ環境ソリューション	700	1,060.00	742,000	
第一カッター興業	300	1,691.00	507,300	
明豊ファシリティワークス	900	550.00	495,000	

安藤・間	13,800	702.00	9,687,600	
東急建設	6,700	571.00	3,825,700	
コムシスホールディングス	8,200	3,080.00	25,256,000	
ビーアールホールディングス	2,600	495.00	1,287,000	
高松コンストラクショングループ	1,500	2,310.00	3,465,000	
東建コーポレーション	700	7,360.00	5,152,000	
ソネック	300	720.00	216,000	
ヤマウラ	1,000	745.00	745,000	
大成建設	17,700	3,495.00	61,861,500	
大林組	53,100	961.00	51,029,100	
清水建設	54,000	874.00	47,196,000	
飛鳥建設	1,500	1,077.00	1,615,500	
長谷工コーポレーション	20,500	1,179.00	24,169,500	
松井建設	1,900	658.00	1,250,200	
銭高組	200	3,390.00	678,000	
鹿島建設	41,500	1,151.00	47,766,500	
不動テトラ	1,400	1,378.00	1,929,200	
大末建設	500	760.00	380,000	
鉄建建設	1,200	2,179.00	2,614,800	
西松建設	4,100	2,087.00	8,556,700	
三井住友建設	12,700	445.00	5,651,500	
大豊建設	1,200	2,304.00	2,764,800	
前田建設工業	13,500	871.00	11,758,500	
佐田建設	1,200	403.00	483,600	
ナカノフドー建設	1,200	361.00	433,200	
奥村組	2,800	2,399.00	6,717,200	
東鉄工業	2,300	2,727.00	6,272,100	
イチケン	300	1,212.00	363,600	
富士ピー・エス	800	516.00	412,800	
浅沼組	600	3,525.00	2,115,000	
戸田建設	22,000	638.00	14,036,000	
熊谷組	2,500	2,479.00	6,197,500	
北野建設	300	2,533.00	759,900	
植木組	200	2,460.00	492,000	
矢作建設工業	2,200	793.00	1,744,600	
ピーエス三菱	1,800	537.00	966,600	
日本ハウスホールディングス	3,400	277.00	941,800	
大東建託	5,800	10,570.00	61,306,000	
新日本建設	2,200	765.00	1,683,000	
N I P P O	4,500	2,507.00	11,281,500	
東亜道路工業	300	2,866.00	859,800	
前田道路	4,800	2,025.00	9,720,000	
日本道路	500	6,650.00	3,325,000	
東亜建設工業	1,700	1,435.00	2,439,500	
日本国土開発	5,200	550.00	2,860,000	
若築建設	900	1,179.00	1,061,100	
東洋建設	6,100	434.00	2,647,400	
五洋建設	21,300	556.00	11,842,800	
世紀東急工業	2,600	788.00	2,048,800	
福田組	600	4,245.00	2,547,000	

日本ドライケミカル	500	1,393.00	696,500	
住友林業	13,600	1,286.00	17,489,600	
日本基礎技術	2,100	402.00	844,200	
巴コーポレーション	2,600	350.00	910,000	
大和ハウス工業	52,500	2,723.50	142,983,750	
ライト工業	3,100	1,393.00	4,318,300	
積水ハウス	58,200	1,860.00	108,252,000	
日特建設	1,400	729.00	1,020,600	
北陸電気工事	900	903.00	812,700	
ユアテック	3,000	622.00	1,866,000	
日本リーテック	1,100	2,079.00	2,286,900	
四電工	200	2,318.00	463,600	
中電工	2,100	2,185.00	4,588,500	
関電工	7,700	901.00	6,937,700	
きんでん	12,700	1,779.00	22,593,300	
東京エネシス	1,700	759.00	1,290,300	
トーエネック	500	3,365.00	1,682,500	
住友電設	1,500	2,299.00	3,448,500	
日本電設工業	2,900	2,088.00	6,055,200	
協和エクシオ	8,000	2,687.00	21,496,000	
新日本空調	1,400	2,239.00	3,134,600	
日本工営	1,100	3,040.00	3,344,000	
九電工	3,700	2,972.00	10,996,400	
三機工業	3,800	1,258.00	4,780,400	
日揮ホールディングス	16,500	1,032.00	17,028,000	
中外炉工業	600	1,563.00	937,800	
ヤマト	1,900	637.00	1,210,300	
太平電業	1,300	2,219.00	2,884,700	
高砂熱学工業	4,600	1,701.00	7,824,600	
三晃金属工業	200	2,150.00	430,000	
NEC ネットエスアイ	1,700	4,900.00	8,330,000	
朝日工業社	300	2,864.00	859,200	
明星工業	3,500	814.00	2,849,000	
大気社	2,600	3,185.00	8,281,000	
ダイダン	1,200	2,775.00	3,330,000	
日比谷総合設備	1,600	1,818.00	2,908,800	
日本製粉	4,800	1,693.00	8,126,400	
日清製粉グループ本社	19,200	1,679.00	32,236,800	
日東富士製粉	100	5,800.00	580,000	
昭和産業	1,500	3,255.00	4,882,500	
鳥越製粉	1,400	889.00	1,244,600	
中部飼料	2,100	1,641.00	3,446,100	
フィード・ワン	10,700	174.00	1,861,800	
東洋精糖	300	1,206.00	361,800	
日本甜菜製糖	800	1,695.00	1,356,000	
三井製糖	1,500	2,197.00	3,295,500	
塩水港精糖	1,700	205.00	348,500	
日新製糖	700	1,896.00	1,327,200	
L I F U L L	5,700	355.00	2,023,500	
ジェイエイシーリクルートメント	1,000	1,180.00	1,180,000	

日本M & Aセンター	12,300	3,655.00	44,956,500	
メンバーズ	500	1,665.00	832,500	
中広	300	518.00	155,400	
UTグループ	2,500	1,600.00	4,000,000	
アイティメディア	800	1,027.00	821,600	
タケエイ	1,700	844.00	1,434,800	
E・Jホールディングス	400	1,550.00	620,000	
ビーネックスグループ	1,600	697.00	1,115,200	
コシダカホールディングス	3,800	467.00	1,774,600	
アルトナー	300	695.00	208,500	
パソナグループ	1,700	1,111.00	1,888,700	
CDS	400	1,315.00	526,000	
リンクアンドモチベーション	3,300	354.00	1,168,200	
GCA	2,000	664.00	1,328,000	
エス・エム・エス	5,100	2,396.00	12,219,600	
サニーサイドアップグループ	600	719.00	431,400	
パーソルホールディングス	16,200	1,210.00	19,602,000	
リニカル	800	900.00	720,000	
クックパッド	6,300	347.00	2,186,100	
エスクリ	500	399.00	199,500	
アイ・ケイ・ケイ	900	607.00	546,300	
森永製菓	4,000	4,415.00	17,660,000	
中村屋	400	3,970.00	1,588,000	
江崎グリコ	5,100	4,805.00	24,505,500	
名糖産業	800	1,271.00	1,016,800	
井村屋グループ	900	1,915.00	1,723,500	
不二家	1,000	1,964.00	1,964,000	
山崎製パン	12,900	1,897.00	24,471,300	
第一屋製パン	400	918.00	367,200	
モロゾフ	300	5,530.00	1,659,000	
亀田製菓	1,000	5,130.00	5,130,000	
寿スピリッツ	1,600	4,465.00	7,144,000	
カルビー	7,800	3,255.00	25,389,000	
森永乳業	3,200	4,155.00	13,296,000	
六甲バター	1,000	1,401.00	1,401,000	
ヤクルト本社	11,700	6,270.00	73,359,000	
明治ホールディングス	11,300	7,550.00	85,315,000	
雪印メグミルク	4,100	2,480.00	10,168,000	
プリマハム	2,700	2,447.00	6,606,900	
日本ハム	6,600	3,895.00	25,707,000	
丸大食品	1,900	1,952.00	3,708,800	
S Foods	1,200	2,333.00	2,799,600	
柿安本店	600	2,343.00	1,405,800	
伊藤ハム米久ホールディングス	11,200	626.00	7,011,200	
学情	700	1,120.00	784,000	
スタジオアリス	800	1,522.00	1,217,600	
クロスキャット	300	1,018.00	305,400	
シミックホールディングス	800	1,529.00	1,223,200	
エプコ	400	899.00	359,600	
システナ	5,900	1,552.00	9,156,800	

N J S	400	1,716.00	686,400
デジタルアーツ	800	6,430.00	5,144,000
日鉄ソリューションズ	2,500	2,738.00	6,845,000
総合警備保障	6,500	5,110.00	33,215,000
キューブシステム	700	714.00	499,800
いちご	21,400	274.00	5,863,600
エイジア	300	1,310.00	393,000
日本駐車場開発	16,800	128.00	2,150,400
コア	700	1,182.00	827,400
カカクコム	12,000	2,200.00	26,400,000
アイロムグループ	600	2,154.00	1,292,400
セントケア・ホールディング	700	410.00	287,000
サイネックス	400	625.00	250,000
ルネサンス	800	1,070.00	856,000
ディップ	2,300	2,385.00	5,485,500
S B Sホールディングス	1,500	1,842.00	2,763,000
オプトホールディング	900	1,487.00	1,338,300
新日本科学	1,800	673.00	1,211,400
ツクイ	3,900	465.00	1,813,500
キャリアデザインセンター	300	847.00	254,100
ベネフィット・ワン	5,900	1,935.00	11,416,500
エムスリー	35,800	3,930.00	140,694,000
ツカダ・グローバルホールディング	800	349.00	279,200
プラス	500	441.00	220,500
アウトソーシング	9,100	560.00	5,096,000
ウェルネット	1,600	612.00	979,200
ワールドホールディングス	500	1,429.00	714,500
ディー・エヌ・エー	8,000	1,307.00	10,456,000
博報堂D Yホールディングス	22,200	1,161.00	25,774,200
ぐるなび	3,200	599.00	1,916,800
タカミヤ	1,600	430.00	688,000
ジャパンベストレスキューシステム	1,200	773.00	927,600
ファンコミュニケーションズ	4,500	452.00	2,034,000
ライク	600	1,683.00	1,009,800
ビジネス・ブレークスルー	700	419.00	293,300
エスプール	4,200	751.00	3,154,200
W D Bホールディングス	700	2,550.00	1,785,000
手間いらず	100	4,280.00	428,000
ティア	700	500.00	350,000
C D G	200	1,443.00	288,600
バリューコマース	900	2,420.00	2,178,000
インフォマート	17,800	813.00	14,471,400
サッポロホールディングス	5,900	2,015.00	11,888,500
アサヒグループホールディングス	35,600	3,700.00	131,720,000
麒麟ホールディングス	72,000	2,070.00	149,040,000
宝ホールディングス	12,600	820.00	10,332,000
オエノンホールディングス	4,200	392.00	1,646,400
養命酒製造	400	1,913.00	765,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	12,000	1,964.00	23,568,000

サントリー食品インターナショナル	11,400	3,980.00	45,372,000
ダイドーグループホールディングス	900	4,375.00	3,937,500
伊藤園	5,200	6,030.00	31,356,000
キーコーヒー	1,700	2,253.00	3,830,100
ユニカフェ	400	914.00	365,600
ジャパンフーズ	100	1,145.00	114,500
日清オイリオグループ	2,200	3,550.00	7,810,000
不二製油グループ本社	4,100	2,520.00	10,332,000
かどや製油	100	3,675.00	367,500
J-オイルミルズ	900	4,105.00	3,694,500
ローソン	4,300	5,550.00	23,865,000
サンエー	1,400	4,190.00	5,866,000
カワチ薬品	1,400	2,442.00	3,418,800
エービーシー・マート	2,600	5,730.00	14,898,000
ハードオフコーポレーション	500	683.00	341,500
高千穂交易	1,100	931.00	1,024,100
アスクル	1,800	3,255.00	5,859,000
ゲオホールディングス	3,000	1,330.00	3,990,000
アダストリア	2,300	1,592.00	3,661,600
ジーフット	800	440.00	352,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	407.00	81,400
カワニシホールディングス	200	1,276.00	255,200
伊藤忠食品	500	4,630.00	2,315,000
くら寿司	900	4,490.00	4,041,000
キャンドゥ	900	1,916.00	1,724,400
エレマテック	1,900	826.00	1,569,400
パルグループホールディングス	1,700	1,302.00	2,213,400
JALUX	500	1,523.00	761,500
エディオン	7,600	946.00	7,189,600
あらた	1,400	4,525.00	6,335,000
サーラコーポレーション	3,000	570.00	1,710,000
ワッツ	700	639.00	447,300
トーメンデバイス	400	3,725.00	1,490,000
ハローズ	600	2,959.00	1,775,400
J Pホールディングス	5,100	275.00	1,402,500
フジオフードシステム	1,400	1,349.00	1,888,600
あみやき亭	300	2,891.00	867,300
東京エレクトロン デバイス	800	2,816.00	2,252,800
ひらまつ	3,100	151.00	468,100
フィールズ	1,700	322.00	547,400
双日	92,600	245.00	22,687,000
アルフレッサ ホールディングス	18,600	2,097.00	39,004,200
大黒天物産	400	4,130.00	1,652,000
ハニーズホールディングス	1,500	1,143.00	1,714,500
ファーマライズホールディングス	500	659.00	329,500
キッコーマン	12,300	4,760.00	58,548,000
味の素	37,800	1,921.50	72,632,700
キュービー	9,500	2,084.00	19,798,000
ハウス食品グループ本社	6,400	3,445.00	22,048,000
カゴメ	6,400	2,771.00	17,734,400

焼津水産化学工業	600	929.00	557,400
アリアケジャパン	1,600	6,220.00	9,952,000
ピエトロ	200	1,602.00	320,400
エバラ食品工業	400	2,200.00	880,000
やまみ	200	2,054.00	410,800
ニチレイ	8,200	2,726.00	22,353,200
横浜冷凍	5,000	887.00	4,435,000
東洋水産	8,800	5,250.00	46,200,000
イトアンド	600	1,750.00	1,050,000
大冷	200	1,880.00	376,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,100	1,107.00	1,217,700
日清食品ホールディングス	7,300	9,020.00	65,846,000
永谷園ホールディングス	700	2,216.00	1,551,200
一正蒲鉾	700	952.00	666,400
フジッコ	1,800	1,925.00	3,465,000
ロック・フィールド	1,900	1,277.00	2,426,300
日本たばこ産業	98,000	1,970.50	193,109,000
ケンコーマヨネーズ	1,000	1,980.00	1,980,000
わらべや日洋ホールディングス	1,200	1,607.00	1,928,400
なとり	900	1,735.00	1,561,500
イフジ産業	200	796.00	159,200
ピクルスコーポレーション	400	2,236.00	894,400
北の達人コーポレーション	6,000	525.00	3,150,000
ユージェナ	7,400	666.00	4,928,400
スター・マイカ・ホールディングス	900	1,504.00	1,353,600
A Dワークスグループ	2,900	170.00	493,000
片倉工業	2,500	1,043.00	2,607,500
グンゼ	1,200	3,710.00	4,452,000
ヒューリック	35,900	1,021.00	36,653,900
ラサ商事	1,100	835.00	918,500
アルペン	1,400	1,623.00	2,272,200
ハブ	400	670.00	268,000
ラクーンホールディングス	900	668.00	601,200
クオールホールディングス	2,500	1,153.00	2,882,500
アルコニックス	1,900	1,138.00	2,162,200
神戸物産	5,800	5,250.00	30,450,000
ソリトンシステムズ	800	1,356.00	1,084,800
ジンズホールディングス	900	5,920.00	5,328,000
ビックカメラ	9,900	1,021.00	10,107,900
D C Mホールディングス	9,200	1,077.00	9,908,400
ハイパー	400	579.00	231,600
Monotaro	11,900	3,765.00	44,803,500
東京一番フーズ	400	439.00	175,600
D Dホールディングス	700	906.00	634,200
あいホールディングス	2,600	1,373.00	3,569,800
ディーブイエックス	900	913.00	821,700
きちりホールディングス	400	588.00	235,200
アークランドサービスホールディングス	1,200	1,752.00	2,102,400
J . フロント リテイリング	19,900	871.00	17,332,900

ドトール・日レスホールディングス	2,700	1,693.00	4,571,100	
マツモトキヨシホールディングス	6,900	3,605.00	24,874,500	
ブロンコビリー	900	2,113.00	1,901,700	
ZOZO	11,500	1,919.00	22,068,500	
トレジャー・ファクトリー	600	679.00	407,400	
物語コーポレーション	400	6,840.00	2,736,000	
ココカラファイン	1,800	4,930.00	8,874,000	
三越伊勢丹ホールディングス	29,400	635.00	18,669,000	
東洋紡	6,700	1,264.00	8,468,800	
ユニチカ	5,600	316.00	1,769,600	
富士紡ホールディングス	800	2,944.00	2,355,200	
日清紡ホールディングス	11,300	760.00	8,588,000	
倉敷紡績	1,700	2,447.00	4,159,900	
ダイワボウホールディングス	1,400	6,990.00	9,786,000	
シキボウ	1,000	1,050.00	1,050,000	
日東紡績	2,600	5,140.00	13,364,000	
トヨタ紡織	5,000	1,320.00	6,600,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	4,100	1,503.00	6,162,300	
Hamee	600	1,338.00	802,800	
ラクト・ジャパン	600	3,630.00	2,178,000	
ウエルシアホールディングス	5,000	7,900.00	39,500,000	
クリエイトSDホールディングス	2,800	3,100.00	8,680,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,500	1,082.00	3,787,000	
八洲電機	1,800	832.00	1,497,600	
メディアスホールディングス	1,200	908.00	1,089,600	
レスターホールディングス	1,800	1,758.00	3,164,400	
ジュテックホールディングス	500	989.00	494,500	
丸善CHIホールディングス	2,000	377.00	754,000	
大光	800	702.00	561,600	
OCHIホールディングス	600	1,405.00	843,000	
TOKAIホールディングス	9,200	989.00	9,098,800	
黒谷	600	435.00	261,000	
ミサワ	800	502.00	401,600	
ティーライフ	400	932.00	372,800	
Cominix	500	765.00	382,500	
三洋貿易	1,800	859.00	1,546,200	
チムニー	500	1,717.00	858,500	
シュッピン	1,200	756.00	907,200	
ビューティガレージ	300	1,604.00	481,200	
ウイン・パートナーズ	1,300	908.00	1,180,400	
ネクステージ	2,300	785.00	1,805,500	
ジョイフル本田	4,800	1,272.00	6,105,600	
鳥貴族	600	1,694.00	1,016,400	
麒麟堂ホールディングス	700	2,084.00	1,458,800	
ホットランド	1,200	1,111.00	1,333,200	
すかいらくホールディングス	18,900	1,700.00	32,130,000	
SFPホールディングス	1,000	1,453.00	1,453,000	
綿半ホールディングス	600	1,781.00	1,068,600	
日本毛織	5,500	937.00	5,153,500	

トーア紡コーポレーション	700	460.00	322,000	
ダイドーリミテッド	3,000	198.00	594,000	
ヨシックス	200	2,004.00	400,800	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,000	1,032.00	5,160,000	
三栄建築設計	600	1,136.00	681,600	
野村不動産ホールディングス	10,300	1,837.00	18,921,100	
三重交通グループホールディングス	3,600	485.00	1,746,000	
サムティ	2,400	1,411.00	3,386,400	
ディア・ライフ	2,300	418.00	961,400	
コーセーアールイー	500	465.00	232,500	
日本商業開発	1,100	1,394.00	1,533,400	
プレサンスコーポレーション	2,800	1,131.00	3,166,800	
フィル・カンパニー	300	2,875.00	862,500	
ハウスコム	400	1,277.00	510,800	
日本管理センター	1,200	1,035.00	1,242,000	
サンセイランディック	600	749.00	449,400	
エストラスト	300	603.00	180,900	
フージャースホールディングス	3,300	611.00	2,016,300	
オープンハウス	4,900	2,398.00	11,750,200	
東急不動産ホールディングス	46,800	529.00	24,757,200	
飯田グループホールディングス	14,000	1,432.00	20,048,000	
イーグランド	300	636.00	190,800	
ムゲンエステート	1,300	459.00	596,700	
帝国繊維	1,800	2,196.00	3,952,800	
日本コークス工業	13,200	58.00	765,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	700	491.00	343,700	
ミタチ産業	600	602.00	361,200	
B E E N O S	800	973.00	778,400	
あさひ	1,300	1,376.00	1,788,800	
日本調剤	1,000	1,680.00	1,680,000	
コスモス薬品	700	28,790.00	20,153,000	
シップヘルスケアホールディングス	2,700	4,810.00	12,987,000	
トーエル	700	696.00	487,200	
ソフトクリエイイトホールディングス	700	1,850.00	1,295,000	
セブン&アイ・ホールディングス	65,300	3,454.00	225,546,200	
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	9,000	655.00	5,895,000	
明治電機工業	600	1,242.00	745,200	
ツルハホールディングス	3,700	14,320.00	52,984,000	
デリカフーズホールディングス	900	627.00	564,300	
スターティアホールディングス	500	589.00	294,500	
サンマルクホールディングス	1,300	1,867.00	2,427,100	
フェリシモ	400	980.00	392,000	
トリドールホールディングス	4,200	1,315.00	5,523,000	
帝人	13,700	1,681.00	23,029,700	
東レ	120,600	479.50	57,827,700	
クラレ	26,200	1,082.00	28,348,400	
旭化成	109,800	741.30	81,394,740	
サカイオーベックス	400	1,892.00	756,800	

TOKYO BASE	1,400	341.00	477,400
稲葉製作所	1,000	1,336.00	1,336,000
宮地エンジニアリンググループ	500	1,613.00	806,500
トーカロ	4,800	1,048.00	5,030,400
アルファ	400	906.00	362,400
SUMCO	20,200	1,549.00	31,289,800
川田テクノロジーズ	300	4,965.00	1,489,500
RS Technologies	500	2,775.00	1,387,500
信和	700	706.00	494,200
ビーロット	800	621.00	496,800
ファーストブラザーズ	400	639.00	255,600
ハウストゥ	800	831.00	664,800
シーアールイー	500	1,196.00	598,000
プロパティエージェント	200	919.00	183,800
ケイアイスター不動産	400	1,101.00	440,400
アグレ都市デザイン	300	413.00	123,900
グッドコムアセット	400	1,519.00	607,600
ジェイ・エス・ビー	400	2,403.00	961,200
テンポイノベーション	600	714.00	428,400
グローバル・リンク・マネジメント	200	588.00	117,600
住江織物	300	1,795.00	538,500
日本フェルト	900	468.00	421,200
イチカワ	200	1,387.00	277,400
日東製網	200	1,416.00	283,200
芦森工業	200	826.00	165,200
アツギ	1,500	624.00	936,000
ウイルプラスホールディングス	100	646.00	64,600
JMホールディングス	1,300	2,500.00	3,250,000
コメダホールディングス	4,200	1,706.00	7,165,200
サツドラホールディングス	300	2,083.00	624,900
アレンザホールディングス	600	877.00	526,200
串カツ田中ホールディングス	300	1,520.00	456,000
パロックジャパンリミテッド	1,100	574.00	631,400
クスリのアオキホールディングス	1,500	8,310.00	12,465,000
ダイニック	600	734.00	440,400
共和レザー	600	671.00	402,600
ビーバンドットコム	500	919.00	459,500
力の源ホールディングス	800	661.00	528,800
スシログローバルホールディングス	9,200	1,977.00	18,188,400
LIXILビバ	1,900	2,047.00	3,889,300
アセンテック	200	3,130.00	626,000
セーレン	4,000	1,262.00	5,048,000
ソトー	500	944.00	472,000
東海染工	200	1,128.00	225,600
小松マテーレ	2,600	730.00	1,898,000
ワコールホールディングス	4,300	2,142.00	9,210,600
ホギメディカル	1,900	3,365.00	6,393,500
クラウドシアホールディングス	400	412.00	164,800
TSIホールディングス	5,400	420.00	2,268,000
マツオカコーポレーション	500	1,968.00	984,000

ワールド	2,300	1,239.00	2,849,700
T I S	16,700	2,082.00	34,769,400
ネオス	700	668.00	467,600
電算システム	600	3,125.00	1,875,000
グリー	10,500	431.00	4,525,500
コーエーテクモホールディングス	3,500	2,988.00	10,458,000
三菱総合研究所	700	3,545.00	2,481,500
ボルテージ	600	409.00	245,400
電算	200	2,007.00	401,400
A G S	800	766.00	612,800
ファインデックス	1,400	889.00	1,244,600
ブレインパッド	400	5,490.00	2,196,000
K L a b	3,300	727.00	2,399,100
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,000	905.00	1,810,000
イーブクイニシアティブジャパン	300	2,219.00	665,700
ネクソン	46,400	1,792.00	83,148,800
アイスタイル	4,500	295.00	1,327,500
エムアップホールディングス	500	2,606.00	1,303,000
エイチーム	1,100	728.00	800,800
エニグモ	1,600	913.00	1,460,800
テクノスジャパン	1,200	433.00	519,600
コロブラ	5,500	910.00	5,005,000
ブロードリーフ	8,300	518.00	4,299,400
クロス・マーケティンググループ	600	291.00	174,600
デジタルハーツホールディングス	900	754.00	678,600
システム情報	1,200	899.00	1,078,800
メディアドゥホールディングス	600	4,110.00	2,466,000
じげん	4,200	332.00	1,394,400
ブイキューブ	1,200	1,204.00	1,444,800
エンカレッジ・テクノロジー	400	859.00	343,600
サイバーリンクス	300	1,339.00	401,700
フィックスターズ	1,800	1,116.00	2,008,800
C A R T A H O L D I N G S	900	837.00	753,300
オブティム	900	2,196.00	1,976,400
セレス	500	844.00	422,000
S H I F T	700	8,450.00	5,915,000
特種東海製紙	1,000	4,050.00	4,050,000
ティーガイア	1,500	2,156.00	3,234,000
セック	300	3,590.00	1,077,000
日本アジアグループ	1,700	248.00	421,600
テクマトリックス	1,200	2,830.00	3,396,000
プロシップ	400	1,229.00	491,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,000	1,706.00	6,824,000
G M O ペイメントゲートウェイ	3,500	9,800.00	34,300,000
ザッパラス	1,000	344.00	344,000
システムリサーチ	400	1,754.00	701,600
インターネットイニシアティブ	2,500	3,840.00	9,600,000
さくらインターネット	1,800	592.00	1,065,600

ヴィンクス	500	1,007.00	503,500	
GMOクラウド	300	3,275.00	982,500	
SRAホールディングス	700	2,195.00	1,536,500	
システムインテグレータ	500	738.00	369,000	
朝日ネット	1,400	1,092.00	1,528,800	
eBASE	2,000	1,075.00	2,150,000	
アバント	1,600	990.00	1,584,000	
アドソル日進	600	2,534.00	1,520,400	
フリービット	900	810.00	729,000	
コムチュア	1,900	2,268.00	4,309,200	
サイバーコム	300	1,885.00	565,500	
アステリア	1,000	442.00	442,000	
アイル	1,000	1,817.00	1,817,000	
王子ホールディングス	69,400	572.00	39,696,800	
日本製紙	7,400	1,532.00	11,336,800	
三菱製紙	2,200	377.00	829,400	
北越コーポレーション	9,700	416.00	4,035,200	
中越パルプ工業	700	1,342.00	939,400	
大王製紙	7,400	1,469.00	10,870,600	
阿波製紙	600	514.00	308,400	
マークライNZ	900	1,784.00	1,605,600	
メディカル・データ・ビジョン	1,300	798.00	1,037,400	
gumi	2,300	740.00	1,702,000	
ショーケース	500	516.00	258,000	
モバイルファクトリー	400	1,055.00	422,000	
テラスカイ	600	2,671.00	1,602,600	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	700	1,368.00	957,600	
PCIホールディングス	500	864.00	432,000	
パイブドHD	400	1,442.00	576,800	
アイビーシー	300	964.00	289,200	
ネオジャパン	300	1,269.00	380,700	
PR TIMES	200	2,187.00	437,400	
ランドコンピュータ	200	1,072.00	214,400	
ダブルスタンダード	200	4,080.00	816,000	
オープンドア	800	1,000.00	800,000	
アカツキ	600	4,225.00	2,535,000	
ベネフィットジャパン	200	1,446.00	289,200	
Ubicomホールディングス	400	1,341.00	536,400	
LINE	3,900	5,300.00	20,670,000	
カナミックネットワーク	1,500	729.00	1,093,500	
ノムラシステムコーポレーション	400	382.00	152,800	
レンゴー	15,800	840.00	13,272,000	
トーモク	900	1,720.00	1,548,000	
ザ・バック	1,300	3,430.00	4,459,000	
チェンジ	600	4,395.00	2,637,000	
シンクロ・フード	700	284.00	198,800	
オークネット	1,000	1,079.00	1,079,000	
セグエグループ	500	928.00	464,000	
エイトレッド	400	1,901.00	760,400	

AOI TYO HOLDINGS	1,400	446.00	624,400	
マクロミル	3,400	698.00	2,373,200	
ビーグリー	500	1,568.00	784,000	
オロ	400	3,175.00	1,270,000	
ユーザーローカル	200	2,943.00	588,600	
テモナ	500	749.00	374,500	
ニーズウェル	400	653.00	261,200	
サインポスト	300	1,454.00	436,200	
昭和電工	11,800	2,272.00	26,809,600	
住友化学	121,800	329.00	40,072,200	
住友精化	700	2,960.00	2,072,000	
日産化学	9,200	4,080.00	37,536,000	
ラサ工業	600	1,303.00	781,800	
クレハ	1,400	4,285.00	5,999,000	
多木化学	600	5,500.00	3,300,000	
テイカ	1,100	1,544.00	1,698,400	
石原産業	3,000	652.00	1,956,000	
片倉コープアグリ	400	1,165.00	466,000	
日本曹達	2,500	2,811.00	7,027,500	
東ソー	25,600	1,317.00	33,715,200	
トクヤマ	4,800	2,283.00	10,958,400	
セントラル硝子	3,400	1,864.00	6,337,600	
東亜合成	10,300	993.00	10,227,900	
大阪ソーダ	1,600	2,453.00	3,924,800	
関東電化工業	4,000	848.00	3,392,000	
デンカ	6,000	2,636.00	15,816,000	
イビデン	10,500	2,911.00	30,565,500	
信越化学工業	28,500	12,045.00	343,282,500	
日本カーバイド工業	500	1,107.00	553,500	
堺化学工業	1,100	1,828.00	2,010,800	
第一稀元素化学工業	1,800	743.00	1,337,400	
エア・ウォーター	15,600	1,522.00	23,743,200	
大陽日酸	16,000	1,666.00	26,656,000	
日本化学工業	600	2,259.00	1,355,400	
東邦アセチレン	100	1,270.00	127,000	
日本パーカライジング	8,400	1,109.00	9,315,600	
高圧ガス工業	2,200	764.00	1,680,800	
チタン工業	300	1,681.00	504,300	
四国化成工業	2,400	1,083.00	2,599,200	
戸田工業	400	1,321.00	528,400	
ステラ ケミファ	900	2,370.00	2,133,000	
保土谷化学工業	600	3,590.00	2,154,000	
日本触媒	2,600	5,210.00	13,546,000	
大日精化工業	1,300	2,310.00	3,003,000	
カネカ	4,300	2,750.00	11,825,000	
協和キリン	17,100	2,614.00	44,699,400	
三菱瓦斯化学	15,400	1,329.00	20,466,600	
三井化学	15,000	2,032.00	30,480,000	
J S R	15,700	1,946.00	30,552,200	
東京応化工業	2,900	4,520.00	13,108,000	

大阪有機化学工業	1,600	1,757.00	2,811,200
三菱ケミカルホールディングス	110,600	605.80	67,001,480
KHネオケム	2,900	1,993.00	5,779,700
ダイセル	21,700	865.00	18,770,500
住友ベークライト	2,600	2,789.00	7,251,400
積水化学工業	35,600	1,359.00	48,380,400
日本ゼオン	15,000	953.00	14,295,000
アイカ工業	4,900	3,030.00	14,847,000
宇部興産	8,300	1,780.00	14,774,000
積水樹脂	3,000	2,320.00	6,960,000
タキロンシーアイ	3,500	618.00	2,163,000
旭有機材	1,000	1,309.00	1,309,000
日立化成	7,700	4,610.00	35,497,000
ニチバン	800	1,450.00	1,160,000
リケンテクノス	3,900	418.00	1,630,200
大倉工業	700	1,574.00	1,101,800
積水化成成品工業	1,900	615.00	1,168,500
群栄化学工業	400	2,609.00	1,043,600
タイガースポリマー	1,000	435.00	435,000
ミライアル	600	1,117.00	670,200
ダイキアクシス	500	745.00	372,500
ダイキョーニシカワ	3,200	548.00	1,753,600
竹本容器	500	746.00	373,000
森六ホールディングス	400	1,449.00	579,600
日本化薬	10,500	1,024.00	10,752,000
カーリットホールディングス	1,700	506.00	860,200
E P Sホールディングス	2,100	1,141.00	2,396,100
ソルクシーズ	600	672.00	403,200
レグス	400	855.00	342,000
プレステージ・インターナショナル	6,100	849.00	5,178,900
フェイス	600	629.00	377,400
プロトコーポレーション	1,600	966.00	1,545,600
ハイマックス	100	1,945.00	194,500
アミューズ	900	2,259.00	2,033,100
野村総合研究所	23,700	2,630.00	62,331,000
ドリームインキュベータ	500	1,250.00	625,000
サイバネットシステム	1,300	661.00	859,300
クイック	900	1,028.00	925,200
T A C	1,300	195.00	253,500
C Eホールディングス	1,000	421.00	421,000
ケネディクス	15,100	490.00	7,399,000
日本システム技術	200	1,184.00	236,800
電通グループ	16,600	2,244.00	37,250,400
インテージホールディングス	2,000	784.00	1,568,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	633.00	379,800
東邦システムサイエンス	400	918.00	367,200
ぴあ	400	2,980.00	1,192,000
イオンファンタジー	600	1,799.00	1,079,400
ソースネクスト	8,000	321.00	2,568,000
シーティーエス	1,800	671.00	1,207,800

ネクシィーズグループ	500	1,039.00	519,500	
インフォコム	1,800	2,565.00	4,617,000	
メディカルシステムネットワーク	1,500	460.00	690,000	
日本精化	1,300	1,350.00	1,755,000	
扶桑化学工業	1,700	3,170.00	5,389,000	
トリケミカル研究所	400	9,600.00	3,840,000	
HEROZ	200	3,555.00	711,000	
ラクスル	1,300	2,569.00	3,339,700	
FIG	1,700	257.00	436,900	
システムサポート	200	2,941.00	588,200	
ADEKA	7,600	1,397.00	10,617,200	
日油	6,200	3,535.00	21,917,000	
ミヨシ油脂	500	1,156.00	578,000	
新日本理化	2,900	177.00	513,300	
ハリマ化成グループ	1,200	914.00	1,096,800	
イーソル	800	1,253.00	1,002,400	
アルテリア・ネットワークス	1,900	2,083.00	3,957,700	
東海ソフト	200	1,266.00	253,200	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	200	961.00	192,200	
花王	40,600	8,510.00	345,506,000	
第一工業製薬	700	4,660.00	3,262,000	
石原ケミカル	500	1,910.00	955,000	
日華化学	500	893.00	446,500	
ニイタカ	500	2,694.00	1,347,000	
三洋化成工業	1,000	4,315.00	4,315,000	
武田薬品工業	140,800	3,736.00	526,028,800	
アステラス製薬	147,000	1,835.00	269,745,000	
大日本住友製薬	12,500	1,500.00	18,750,000	
塩野義製薬	21,600	5,960.00	128,736,000	
わかもと製薬	2,900	243.00	704,700	
あすか製薬	1,900	1,117.00	2,122,300	
日本新薬	4,400	7,110.00	31,284,000	
バイオフェルミン製薬	200	2,313.00	462,600	
中外製薬	17,700	13,090.00	231,693,000	
科研製薬	2,900	5,740.00	16,646,000	
エーザイ	20,300	7,544.00	153,143,200	
理研ビタミン	1,600	2,102.00	3,363,200	
ロート製薬	8,700	3,090.00	26,883,000	
小野薬品工業	39,000	2,619.00	102,141,000	
久光製薬	4,500	5,080.00	22,860,000	
有機合成薬品工業	2,700	348.00	939,600	
持田製薬	2,300	4,095.00	9,418,500	
参天製薬	31,600	1,881.00	59,439,600	
扶桑薬品工業	500	2,378.00	1,189,000	
日本ケミファ	200	2,518.00	503,600	
ツムラ	5,200	2,908.00	15,121,600	
日医工	4,900	1,424.00	6,977,600	
テルモ	48,000	3,563.00	171,024,000	
みらかホールディングス	4,500	2,549.00	11,470,500	

キッセイ薬品工業	3,000	2,640.00	7,920,000
生化学工業	3,300	1,084.00	3,577,200
栄研化学	3,000	1,819.00	5,457,000
日水製薬	700	1,242.00	869,400
鳥居薬品	1,200	2,948.00	3,537,600
JCRファーマ	1,200	10,880.00	13,056,000
東和薬品	2,100	2,300.00	4,830,000
富士製薬工業	1,000	1,168.00	1,168,000
沢井製薬	3,500	5,890.00	20,615,000
ゼリア新薬工業	3,100	2,070.00	6,417,000
第一三共	48,500	7,750.00	375,875,000
キョーリン製薬ホールディングス	3,800	2,225.00	8,455,000
大幸薬品	2,200	1,728.00	3,801,600
ダイト	1,000	4,000.00	4,000,000
大塚ホールディングス	32,300	4,241.00	136,984,300
大正製薬ホールディングス	3,600	6,720.00	24,192,000
ペプチドリーム	8,600	4,260.00	36,636,000
大日本塗料	1,600	945.00	1,512,000
日本ペイントホールディングス	13,700	6,390.00	87,543,000
関西ペイント	18,700	2,047.00	38,278,900
神東塗料	1,800	172.00	309,600
中国塗料	4,700	819.00	3,849,300
日本特殊塗料	1,100	899.00	988,900
藤倉化成	1,600	515.00	824,000
太陽ホールディングス	1,300	4,415.00	5,739,500
DIC	6,900	2,501.00	17,256,900
サカタインクス	3,600	978.00	3,520,800
東洋インキSCホールディングス	3,400	2,003.00	6,810,200
T&K TOKA	1,100	720.00	792,000
アルプス技研	1,400	1,750.00	2,450,000
ダイオーズ	200	1,062.00	212,400
日本空調サービス	1,400	698.00	977,200
オリエンタルランド	17,300	13,730.00	237,529,000
フォーカスシステムズ	900	797.00	717,300
ダスキン	4,000	2,755.00	11,020,000
パーク24	9,000	1,705.00	15,345,000
明光ネットワークジャパン	2,100	793.00	1,665,300
ファルコホールディングス	900	1,605.00	1,444,500
クレスコ	1,000	1,433.00	1,433,000
フジ・メディア・ホールディングス	15,900	1,083.00	17,219,700
ラウンドワン	4,500	881.00	3,964,500
リゾートトラスト	7,400	1,127.00	8,339,800
オービック	5,800	17,110.00	99,238,000
ジャストシステム	2,700	7,070.00	19,089,000
TDCソフト	1,200	850.00	1,020,000
Zホールディングス	228,900	435.00	99,571,500
ビー・エム・エル	2,100	3,075.00	6,457,500
ワタベウェディング	200	390.00	78,000
トレンドマイクロ	7,400	5,420.00	40,108,000
りらいあコミュニケーションズ	3,100	1,144.00	3,546,400

I Dホールディングス	500	1,494.00	747,000	
リソー教育	7,100	267.00	1,895,700	
日本オラクル	3,400	11,870.00	40,358,000	
早稲田アカデミー	800	971.00	776,800	
アルファシステムズ	500	3,355.00	1,677,500	
フューチャー	1,900	1,627.00	3,091,300	
C A C Holdings	1,000	1,129.00	1,129,000	
S Bテクノロジー	600	2,681.00	1,608,600	
トーセ	400	799.00	319,600	
ユー・エス・エス	18,000	1,740.00	31,320,000	
オービックビジネスコンサルタント	1,700	5,020.00	8,534,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	7,600	3,470.00	26,372,000	
アイティフォー	1,900	667.00	1,267,300	
東京個別指導学院	600	569.00	341,400	
東計電算	200	3,980.00	796,000	
サイバーエージェント	10,000	4,520.00	45,200,000	
楽天	75,800	956.00	72,464,800	
エクスネット	200	957.00	191,400	
クリーク・アンド・リバー社	800	939.00	751,200	
テー・オー・ダブリュー	1,800	277.00	498,600	
大塚商会	9,000	4,975.00	44,775,000	
サイボウズ	2,000	2,210.00	4,420,000	
ソフトブレーン	1,000	457.00	457,000	
山田コンサルティンググループ	1,000	1,162.00	1,162,000	
セントラルスポーツ	500	2,266.00	1,133,000	
パラカ	400	1,671.00	668,400	
電通国際情報サービス	1,000	4,550.00	4,550,000	
A C C E S S	1,700	887.00	1,507,900	
デジタルガレージ	3,000	3,940.00	11,820,000	
イーエムシステムズ	2,400	815.00	1,956,000	
ウェザーニューズ	600	3,765.00	2,259,000	
C I J	1,000	776.00	776,000	
ビジネスエンジニアリング	200	2,450.00	490,000	
日本エンタープライズ	2,300	231.00	531,300	
WOWOW	800	2,530.00	2,024,000	
スカラ	1,000	526.00	526,000	
インテリジェント ウェイブ	1,000	602.00	602,000	
フルキャストホールディングス	1,600	1,443.00	2,308,800	
エン・ジャパン	2,900	2,440.00	7,076,000	
富士フイルムホールディングス	32,600	5,287.00	172,356,200	
コニカミノルタ	36,400	389.00	14,159,600	
資生堂	33,700	6,390.00	215,343,000	
ライオン	22,100	2,300.00	50,830,000	
高砂香料工業	1,000	2,207.00	2,207,000	
マンダム	3,800	2,025.00	7,695,000	
ミルボン	2,300	4,860.00	11,178,000	
ファンケル	6,900	2,900.00	20,010,000	
コーセー	3,200	13,100.00	41,920,000	
コタ	1,000	1,215.00	1,215,000	
シーボン	200	2,170.00	434,000	

ポーラ・オルビスホールディングス	7,200	1,919.00	13,816,800
ノエビアホールディングス	1,400	4,965.00	6,951,000
アジュバンコスメジャパン	500	938.00	469,000
エステー	1,100	1,562.00	1,718,200
アグロ カネショウ	600	1,483.00	889,800
コニシ	2,700	1,425.00	3,847,500
長谷川香料	3,000	2,178.00	6,534,000
星光P M C	1,000	662.00	662,000
小林製薬	4,800	9,980.00	47,904,000
荒川化学工業	1,500	1,326.00	1,989,000
メック	1,300	1,654.00	2,150,200
日本高純度化学	400	2,654.00	1,061,600
タカラバイオ	4,500	2,469.00	11,110,500
J C U	2,100	2,752.00	5,779,200
新田ゼラチン	1,100	692.00	761,200
O A T アグリオ	200	1,038.00	207,600
デクセリアルズ	4,500	716.00	3,222,000
アース製薬	1,300	6,180.00	8,034,000
北興化学工業	1,500	570.00	855,000
大成ラミック	500	2,608.00	1,304,000
クミアイ化学工業	7,200	872.00	6,278,400
日本農薬	3,400	436.00	1,482,400
富士興産	1,000	405.00	405,000
ニチレキ	2,000	1,475.00	2,950,000
ユシロ化学工業	900	1,151.00	1,035,900
ビービー・カストロール	500	1,134.00	567,000
富士石油	5,300	180.00	954,000
M O R E S C O	500	909.00	454,500
出光興産	18,700	2,443.00	45,684,100
J X T Gホールディングス	256,800	380.10	97,609,680
コスモエネルギーホールディングス	4,800	1,578.00	7,574,400
横浜ゴム	9,800	1,337.00	13,102,600
T O Y O T I R E	9,900	1,268.00	12,553,200
ブリヂストン	48,900	3,303.00	161,516,700
住友ゴム工業	15,300	1,010.00	15,453,000
藤倉コンポジット	1,600	366.00	585,600
オカモト	1,000	4,365.00	4,365,000
アキレス	1,200	1,622.00	1,946,400
フコク	800	600.00	480,000
ニッタ	1,800	2,024.00	3,643,200
クリエートメディック	500	982.00	491,000
住友理工	3,300	556.00	1,834,800
三ツ星ベルト	2,100	1,474.00	3,095,400
バンドー化学	2,500	630.00	1,575,000
A G C	16,700	2,667.00	44,538,900
日本板硝子	7,700	345.00	2,656,500
石塚硝子	400	2,144.00	857,600
有沢製作所	2,800	762.00	2,133,600
日本山村硝子	400	852.00	340,800
日本電気硝子	6,700	1,583.00	10,606,100

オハラ	800	913.00	730,400	
住友大阪セメント	3,200	3,625.00	11,600,000	
太平洋セメント	10,700	2,184.00	23,368,800	
リソルホールディングス	100	3,360.00	336,000	
日本ヒューム	1,600	639.00	1,022,400	
日本コンクリート工業	4,000	255.00	1,020,000	
三谷セキサン	800	4,865.00	3,892,000	
アジアパイルホールディングス	2,300	423.00	972,900	
東海カーボン	17,700	831.00	14,708,700	
日本カーボン	900	3,305.00	2,974,500	
東洋炭素	1,000	1,498.00	1,498,000	
ノリタケカンパニーリミテド	900	3,485.00	3,136,500	
TOTO	12,100	3,965.00	47,976,500	
日本碍子	20,500	1,374.00	28,167,000	
日本特殊陶業	12,900	1,576.00	20,330,400	
MARUWA	700	7,700.00	5,390,000	
品川リフラクトリーズ	400	2,246.00	898,400	
黒崎播磨	300	3,870.00	1,161,000	
ヨータイ	1,500	604.00	906,000	
イソライト工業	900	442.00	397,800	
東京窯業	2,000	295.00	590,000	
ニッカトー	600	591.00	354,600	
フジインコーポレーテッド	1,600	3,060.00	4,896,000	
クニミネ工業	900	1,048.00	943,200	
エーアンドエーマテリアル	300	1,146.00	343,800	
ニチアス	4,600	2,141.00	9,848,600	
日本製鉄	74,700	896.60	66,976,020	
神戸製鋼所	32,300	351.00	11,337,300	
中山製鋼所	2,400	368.00	883,200	
合同製鉄	900	2,025.00	1,822,500	
ジェイ エフ イー ホールディングス	45,800	707.00	32,380,600	
東京製鉄	8,300	764.00	6,341,200	
共英製鋼	1,900	1,354.00	2,572,600	
大和工業	3,500	2,132.00	7,462,000	
東京鐵鋼	800	1,197.00	957,600	
大阪製鐵	800	1,213.00	970,400	
淀川製鋼所	2,200	1,680.00	3,696,000	
丸一鋼管	5,400	2,445.00	13,203,000	
モリ工業	500	2,334.00	1,167,000	
大同特殊鋼	2,700	3,545.00	9,571,500	
日本高周波鋼業	1,300	362.00	470,600	
日本冶金工業	1,400	1,692.00	2,368,800	
山陽特殊製鋼	1,300	997.00	1,296,100	
愛知製鋼	900	2,800.00	2,520,000	
日立金属	18,300	1,035.00	18,940,500	
日本金属	300	613.00	183,900	
大平洋金属	1,200	1,585.00	1,902,000	
新日本電工	11,200	151.00	1,691,200	
栗本鐵工所	900	1,791.00	1,611,900	

虹 技	200	1,145.00	229,000
日本製鋼所	5,100	1,340.00	6,834,000
三菱製鋼	900	765.00	688,500
日亜鋼業	2,500	260.00	650,000
日本精線	300	2,970.00	891,000
エンビプロ・ホールディングス	700	571.00	399,700
大紀アルミニウム工業所	2,500	568.00	1,420,000
日本軽金属ホールディングス	41,400	169.00	6,996,600
三井金属鉱業	4,600	2,071.00	9,526,600
東邦亜鉛	900	1,349.00	1,214,100
三菱マテリアル	11,100	2,210.00	24,531,000
住友金属鉱山	21,500	2,715.00	58,372,500
DOWAホールディングス	4,300	3,020.00	12,986,000
古河機械金属	2,900	1,088.00	3,155,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,800	951.00	1,711,800
東邦チタニウム	3,100	616.00	1,909,600
UACJ	2,600	1,726.00	4,487,600
CKサンエツ	300	2,906.00	871,800
古河電気工業	5,200	1,998.00	10,389,600
住友電気工業	62,600	1,085.00	67,921,000
フジクラ	21,000	306.00	6,426,000
昭和電線ホールディングス	2,100	1,198.00	2,515,800
東京特殊電線	300	2,427.00	728,100
タツタ電線	3,400	536.00	1,822,400
カナレ電気	300	1,629.00	488,700
平河ヒューテック	800	1,035.00	828,000
リョービ	1,900	1,277.00	2,426,300
アーレスティ	2,200	376.00	827,200
アサヒホールディングス	3,000	2,575.00	7,725,000
東洋製罐グループホールディングス	10,700	1,065.00	11,395,500
ホッカンホールディングス	700	1,542.00	1,079,400
コロナ	800	968.00	774,400
横河ブリッジホールディングス	3,100	1,879.00	5,824,900
OSJBホールディングス	8,500	245.00	2,082,500
駒井ハルテック	300	1,526.00	457,800
高田機工	100	2,250.00	225,000
三和ホールディングス	15,500	834.00	12,927,000
文化シャッター	4,900	791.00	3,875,900
三協立山	2,200	890.00	1,958,000
アルインコ	1,100	938.00	1,031,800
東洋シャッター	400	680.00	272,000
LIXILグループ	24,800	1,382.00	34,273,600
日本フィルコン	1,200	520.00	624,000
ノーリツ	3,400	1,262.00	4,290,800
長府製作所	1,700	2,415.00	4,105,500
リンナイ	3,300	8,250.00	27,225,000
ユニプレス	3,300	938.00	3,095,400
ダイニチ工業	900	697.00	627,300
日東精工	2,100	468.00	982,800
三洋工業	100	1,957.00	195,700

岡部	3,200	775.00	2,480,000
ジーテクト	1,900	1,106.00	2,101,400
東プレ	3,000	1,268.00	3,804,000
高周波熱錬	2,900	586.00	1,699,400
東京製綱	1,200	540.00	648,000
サンコール	1,100	387.00	425,700
モリテックスチール	1,200	276.00	331,200
パイオラックス	2,400	1,586.00	3,806,400
エイチワン	1,500	509.00	763,500
日本発条	17,900	704.00	12,601,600
中央発條	100	2,760.00	276,000
アドバネクス	200	1,381.00	276,200
三浦工業	7,300	4,520.00	32,996,000
タクマ	5,700	1,227.00	6,993,900
テクノプロ・ホールディングス	3,200	5,990.00	19,168,000
アトラ	600	258.00	154,800
インターワークス	200	382.00	76,400
アイ・アールジャパンホールディングス	700	6,800.00	4,760,000
Keepers 技研	700	1,498.00	1,048,600
ファーストロジック	500	567.00	283,500
三機サービス	300	1,185.00	355,500
Gunosy	1,000	899.00	899,000
デザインワン・ジャパン	1,200	217.00	260,400
イー・ガーディアン	700	1,875.00	1,312,500
リブセンス	1,600	275.00	440,000
ジャパンマテリアル	5,000	1,537.00	7,685,000
ベクトル	2,100	740.00	1,554,000
ウチヤマホールディングス	900	347.00	312,300
チャーム・ケア・コーポレーション	1,400	894.00	1,251,600
ライクキッズ	300	634.00	190,200
キャリアリンク	900	490.00	441,000
IBJ	1,200	809.00	970,800
アサンテ	500	1,462.00	731,000
N・フィールド	1,200	453.00	543,600
バリューHR	700	1,438.00	1,006,600
M&Aキャピタルパートナーズ	1,300	3,160.00	4,108,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,498.00	1,048,600
ERIホールディングス	200	660.00	132,000
アビスト	100	2,077.00	207,700
シグマクシス	1,200	1,662.00	1,994,400
ウィルグループ	900	635.00	571,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,200	193.00	424,600
リクルートホールディングス	116,100	3,149.00	365,598,900
エラン	1,000	1,750.00	1,750,000
ツガミ	3,600	995.00	3,582,000
オークマ	2,000	4,290.00	8,580,000
芝浦機械	1,900	2,183.00	4,147,700
アマダ	20,900	974.00	20,356,600

アイダエンジニアリング	4,500	732.00	3,294,000
滝澤鉄工所	400	1,062.00	424,800
F U J I	7,300	1,777.00	12,972,100
牧野フライス製作所	2,000	3,285.00	6,570,000
オーエスジー	7,700	1,415.00	10,895,500
ダイジェット工業	200	1,241.00	248,200
旭ダイヤモンド工業	4,600	489.00	2,249,400
D M G 森精機	10,600	1,130.00	11,978,000
ソディック	4,000	780.00	3,120,000
ディスコ	2,300	24,910.00	57,293,000
日東工器	800	1,932.00	1,545,600
日進工具	700	2,706.00	1,894,200
パンチ工業	1,700	350.00	595,000
富士ダイス	700	587.00	410,900
土木管理総合試験所	700	327.00	228,900
ネットマーケティング	900	719.00	647,100
日本郵政	132,300	814.10	107,705,430
ベルシステム24ホールディングス	2,700	1,252.00	3,380,400
鎌倉新書	1,200	1,034.00	1,240,800
S M N	400	882.00	352,800
一蔵	500	357.00	178,500
L I T A L I C O	600	2,358.00	1,414,800
グローバルキッズCOMPANY	400	647.00	258,800
エアトリ	800	957.00	765,600
アトラエ	500	2,613.00	1,306,500
ストライク	600	4,275.00	2,565,000
ソラスト	4,500	1,120.00	5,040,000
セラク	600	866.00	519,600
インソース	700	2,472.00	1,730,400
豊田自動織機	13,800	5,350.00	73,830,000
豊和工業	1,000	786.00	786,000
O K K	900	477.00	429,300
東洋機械金属	1,100	405.00	445,500
津田駒工業	400	777.00	310,800
エンシュウ	400	995.00	398,000
島精機製作所	2,600	1,629.00	4,235,400
オプトラン	1,900	3,000.00	5,700,000
N C ホールディングス	900	526.00	473,400
イワキ	1,100	956.00	1,051,600
フリー	1,700	840.00	1,428,000
ヤマシンフィルタ	3,700	843.00	3,119,100
日阪製作所	1,900	736.00	1,398,400
やまびこ	3,100	833.00	2,582,300
平田機工	800	5,220.00	4,176,000
ペガサスミシン製造	1,400	317.00	443,800
マルマエ	600	890.00	534,000
タツモ	800	1,195.00	956,000
ナブテスコ	9,900	3,280.00	32,472,000
三井海洋開発	1,700	1,589.00	2,701,300
レオン自動機	1,600	1,276.00	2,041,600

S M C	5,300	50,560.00	267,968,000	
ホソカワミクロン	600	5,060.00	3,036,000	
ユニオンツール	700	2,769.00	1,938,300	
オイレス工業	2,100	1,351.00	2,837,100	
日精エー・エス・ピー機械	500	2,942.00	1,471,000	
サトーホールディングス	2,400	2,278.00	5,467,200	
技研製作所	1,500	4,010.00	6,015,000	
日本エアーテック	700	1,053.00	737,100	
カワタ	400	712.00	284,800	
日精樹脂工業	1,400	968.00	1,355,200	
オカダアイヨン	500	879.00	439,500	
ワイエイシイホールディングス	800	439.00	351,200	
小松製作所	76,700	2,034.50	156,046,150	
住友重機械工業	9,600	2,244.00	21,542,400	
日立建機	6,800	2,538.00	17,258,400	
日工	2,500	563.00	1,407,500	
巴工業	700	1,900.00	1,330,000	
井関農機	1,600	1,175.00	1,880,000	
T O W A	1,900	944.00	1,793,600	
丸山製作所	500	1,256.00	628,000	
北川鉄工所	600	1,567.00	940,200	
シンニッタン	1,900	260.00	494,000	
ローツェ	800	4,900.00	3,920,000	
タカキタ	500	547.00	273,500	
クボタ	90,000	1,336.00	120,240,000	
荏原実業	500	2,229.00	1,114,500	
三菱化工機	600	1,590.00	954,000	
月島機械	3,100	1,238.00	3,837,800	
帝国電機製作所	1,500	1,348.00	2,022,000	
東京機械製作所	1,100	240.00	264,000	
新東工業	3,800	755.00	2,869,000	
澁谷工業	1,500	2,642.00	3,963,000	
アイチコーポレーション	2,900	689.00	1,998,100	
小森コーポレーション	4,200	757.00	3,179,400	
鶴見製作所	1,200	1,880.00	2,256,000	
住友精密工業	300	2,183.00	654,900	
日本ギア工業	700	268.00	187,600	
酒井重工業	300	2,046.00	613,800	
荏原製作所	7,000	2,420.00	16,940,000	
石井鐵工所	200	2,422.00	484,400	
西島製作所	1,600	739.00	1,182,400	
北越工業	1,700	1,010.00	1,717,000	
ダイキン工業	21,600	14,090.00	304,344,000	
オルガノ	700	5,730.00	4,011,000	
トーヨーカネツ	800	1,936.00	1,548,800	
栗田工業	9,200	2,995.00	27,554,000	
椿本チエイン	2,300	2,471.00	5,683,300	
大同工業	600	629.00	377,400	
日機装	5,000	847.00	4,235,000	
木村化工機	1,700	431.00	732,700	

レイズネクスト	2,800	1,191.00	3,334,800
アネスト岩田	2,600	848.00	2,204,800
ダイフク	8,700	7,470.00	64,989,000
サムコ	500	1,895.00	947,500
加藤製作所	1,000	1,243.00	1,243,000
油研工業	300	1,337.00	401,100
タダノ	8,300	801.00	6,648,300
フジテック	6,200	1,543.00	9,566,600
C K D	4,900	1,811.00	8,873,900
キトー	1,200	1,088.00	1,305,600
平和	4,800	1,868.00	8,966,400
理想科学工業	1,500	1,473.00	2,209,500
SANKYO	3,800	2,909.00	11,054,200
日本金銭機械	1,900	569.00	1,081,100
マースグループホールディングス	1,000	1,682.00	1,682,000
フクシマガリレイ	1,000	3,210.00	3,210,000
オーイズミ	900	430.00	387,000
ダイコク電機	800	1,211.00	968,800
竹内製作所	2,900	1,634.00	4,738,600
アマノ	4,400	2,212.00	9,732,800
JUKI	2,400	615.00	1,476,000
蛇の目ミシン工業	1,500	419.00	628,500
ブラザー工業	20,600	1,809.00	37,265,400
マックス	2,700	1,623.00	4,382,100
モリタホールディングス	2,900	1,627.00	4,718,300
グローリー	4,400	2,448.00	10,771,200
新晃工業	1,600	1,387.00	2,219,200
大和冷機工業	2,200	940.00	2,068,000
セガサミーホールディングス	16,900	1,322.00	22,341,800
日本ピストンリング	500	1,142.00	571,000
リケン	600	2,809.00	1,685,400
T P R	2,200	1,247.00	2,743,400
ツバキ・ナカシマ	2,800	770.00	2,156,000
ホシザキ	5,000	8,250.00	41,250,000
大豊工業	1,200	551.00	661,200
日本精工	32,000	764.00	24,448,000
NTN	39,800	205.00	8,159,000
ジェイテクト	16,100	759.00	12,219,900
不二越	1,600	3,210.00	5,136,000
ミネベアミツミ	31,600	1,768.00	55,868,800
日本トムソン	5,200	380.00	1,976,000
THK	10,000	2,604.00	26,040,000
ユーシン精機	1,400	673.00	942,200
前澤給装工業	600	2,067.00	1,240,200
イーグル工業	1,900	687.00	1,305,300
前澤工業	1,000	344.00	344,000
日本ピラー工業	1,800	1,317.00	2,370,600
キッツ	6,700	685.00	4,589,500
日立製作所	81,500	3,205.00	261,207,500
三菱電機	169,500	1,335.00	226,282,500

富士電機	10,200	2,672.00	27,254,400
東洋電機製造	600	1,249.00	749,400
安川電機	18,300	3,500.00	64,050,000
シンフォニアテクノロジー	2,100	1,046.00	2,196,600
明電舎	3,200	1,694.00	5,420,800
オリジン	500	1,459.00	729,500
山洋電気	800	4,615.00	3,692,000
デンヨー	1,500	2,000.00	3,000,000
ベイカレント・コンサルティング	1,000	6,320.00	6,320,000
Orchestra Holdings	400	882.00	352,800
アイモバイル	800	632.00	505,600
キャリアインデックス	800	319.00	255,200
MS - Japan	400	757.00	302,800
船場	100	927.00	92,700
グレイステクノロジー	800	3,210.00	2,568,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,700	2,679.00	4,554,300
フルテック	200	1,280.00	256,000
GAMEWITH	700	623.00	436,100
ソウルドアウト	300	2,259.00	677,700
MS&Consulting	200	586.00	117,200
ミダック	400	1,142.00	456,800
日総工産	1,000	503.00	503,000
キュービーネットホールディングス	800	2,021.00	1,616,800
RPAホールディングス	1,200	820.00	984,000
三櫻工業	2,400	692.00	1,660,800
マキタ	22,100	3,385.00	74,808,500
東芝テック	2,200	3,520.00	7,744,000
芝浦メカトロニクス	300	2,829.00	848,700
マブチモーター	4,700	3,280.00	15,416,000
日本電産	40,800	6,169.00	251,695,200
トレックス・セミコンダクター	1,000	1,060.00	1,060,000
東光高岳	800	922.00	737,600
ダイヘン	1,800	3,075.00	5,535,000
ヤーマン	2,800	696.00	1,948,800
JVCケンウッド	14,100	167.00	2,354,700
ミマキエンジニアリング	1,500	409.00	613,500
第一精工	800	2,202.00	1,761,600
日新電機	4,000	1,083.00	4,332,000
大崎電気工業	3,300	518.00	1,709,400
オムロン	15,300	6,700.00	102,510,000
日東工業	2,400	1,807.00	4,336,800
I D E C	2,400	1,635.00	3,924,000
正興電機製作所	400	895.00	358,000
不二電機工業	300	1,247.00	374,100
ジーエス・ユアサコーポレーション	5,700	1,530.00	8,721,000
サクサホールディングス	400	1,702.00	680,800
メルコホールディングス	500	2,587.00	1,293,500
テクノメディカ	300	1,860.00	558,000

日本電気	20,600	4,100.00	84,460,000
富士通	16,400	10,545.00	172,938,000
沖電気工業	6,900	1,049.00	7,238,100
岩崎通信機	700	843.00	590,100
電気興業	800	2,533.00	2,026,400
サンケン電気	2,000	2,258.00	4,516,000
ナカヨ	300	1,374.00	412,200
アイホン	800	1,570.00	1,256,000
ルネサスエレクトロニクス	81,400	580.00	47,212,000
セイコーエプソン	21,000	1,206.00	25,326,000
ワコム	11,500	377.00	4,335,500
アルバック	3,100	2,927.00	9,073,700
アクセル	900	728.00	655,200
E I Z O	1,300	3,270.00	4,251,000
日本信号	4,400	1,047.00	4,606,800
京三製作所	4,100	513.00	2,103,300
能美防災	2,300	2,157.00	4,961,100
ホーチキ	1,200	1,317.00	1,580,400
星和電機	800	589.00	471,200
エレコム	1,900	4,360.00	8,284,000
パナソニック	193,800	799.60	154,962,480
シャープ	19,700	1,181.00	23,265,700
アンリツ	11,000	2,208.00	24,288,000
富士通ゼネラル	4,700	1,792.00	8,422,400
ソニー	106,200	6,948.00	737,877,600
T D K	8,200	9,370.00	76,834,000
帝国通信工業	400	1,206.00	482,400
タムラ製作所	5,600	439.00	2,458,400
アルプスアルパイン	15,000	1,122.00	16,830,000
池上通信機	400	842.00	336,800
鈴木	900	721.00	648,900
日本トリム	200	3,130.00	626,000
ローランド ディー・ジー	900	1,358.00	1,222,200
フォスター電機	1,800	1,197.00	2,154,600
S M K	400	2,645.00	1,058,000
ヨコオ	1,200	2,474.00	2,968,800
ホシデン	4,600	912.00	4,195,200
ヒロセ電機	2,600	12,030.00	31,278,000
日本航空電子工業	4,000	1,428.00	5,712,000
T O A	1,600	737.00	1,179,200
マクセルホールディングス	4,000	984.00	3,936,000
古野電気	2,200	809.00	1,779,800
ユニデンホールディングス	500	1,882.00	941,000
スミダコーポレーション	1,100	663.00	729,300
アイコム	1,000	2,600.00	2,600,000
リオン	700	2,330.00	1,631,000
本多通信工業	1,300	431.00	560,300
船井電機	2,000	424.00	848,000
横河電機	15,500	1,497.00	23,203,500
新電元工業	600	2,518.00	1,510,800

アズビル	10,700	2,848.00	30,473,600
東亜ディーケーケー	800	872.00	697,600
日本光電工業	7,000	3,975.00	27,825,000
チノー	500	1,337.00	668,500
共和電業	1,400	398.00	557,200
日本電子材料	900	953.00	857,700
堀場製作所	3,400	5,790.00	19,686,000
アドバンテスト	12,700	5,370.00	68,199,000
小野測器	700	489.00	342,300
エスペック	1,500	1,705.00	2,557,500
キーエンス	15,400	39,490.00	608,146,000
日置電機	800	3,105.00	2,484,000
シスメックス	12,100	7,461.00	90,278,100
日本マイクロニクス	3,000	890.00	2,670,000
メガチップス	1,600	1,580.00	2,528,000
OBARA GROUP	1,000	2,918.00	2,918,000
IMAGICA GROUP	1,400	364.00	509,600
澤藤電機	200	2,377.00	475,400
デンソー	37,400	3,682.00	137,706,800
原田工業	800	847.00	677,600
コーセル	2,400	868.00	2,083,200
イリソ電子工業	1,400	3,055.00	4,277,000
オブテックスグループ	2,700	1,252.00	3,380,400
千代田インテグレ	700	1,776.00	1,243,200
アイ・オー・データ機器	500	964.00	482,000
レーザーテック	7,500	7,670.00	57,525,000
スタンレー電気	11,900	2,399.00	28,548,100
岩崎電気	700	1,489.00	1,042,300
ウシオ電機	9,300	1,134.00	10,546,200
岡谷電機産業	1,300	319.00	414,700
ヘリオス テクノ ホールディング	1,400	331.00	463,400
エノモト	600	1,038.00	622,800
日本セラミック	1,600	2,019.00	3,230,400
遠藤照明	700	565.00	395,500
古河電池	1,200	552.00	662,400
双信電機	1,000	332.00	332,000
山一電機	1,300	1,497.00	1,946,100
図研	1,200	2,533.00	3,039,600
日本電子	3,400	3,355.00	11,407,000
カシオ計算機	15,100	1,678.00	25,337,800
ファナック	16,100	17,910.00	288,351,000
日本シイエムケイ	4,000	425.00	1,700,000
エンプラス	900	2,304.00	2,073,600
大真空	800	1,805.00	1,444,000
ローム	7,600	6,870.00	52,212,000
浜松ホトニクス	12,200	4,665.00	56,913,000
三井ハイテック	2,100	1,277.00	2,681,700
新光電気工業	5,900	1,364.00	8,047,600
京セラ	23,900	5,803.00	138,691,700
協栄産業	300	1,120.00	336,000

太陽誘電	7,700	3,050.00	23,485,000
村田製作所	49,800	6,054.00	301,489,200
双葉電子工業	2,500	1,056.00	2,640,000
日東電工	11,700	5,410.00	63,297,000
北陸電気工業	700	922.00	645,400
東海理化電機製作所	4,500	1,380.00	6,210,000
ニチコン	5,700	685.00	3,904,500
日本ケミコン	1,400	1,217.00	1,703,800
K O A	2,500	890.00	2,225,000
日立造船	14,200	359.00	5,097,800
三菱重工業	28,300	2,686.00	76,013,800
川崎重工業	13,300	1,599.00	21,266,700
I H I	12,200	1,302.00	15,884,400
名村造船所	5,900	177.00	1,044,300
サノヤホールディングス	2,700	150.00	405,000
スプリックス	400	923.00	369,200
マネジメントソリューションズ	800	1,097.00	877,600
and factory	300	1,017.00	305,100
カーブスホールディングス	4,300	552.00	2,373,600
日本車輛製造	700	2,662.00	1,863,400
三菱ロジスネクスト	2,300	1,035.00	2,380,500
近畿車輛	300	1,069.00	320,700
F P G	5,000	515.00	2,575,000
島根銀行	1,400	481.00	673,400
じもとホールディングス	11,500	93.00	1,069,500
全国保証	4,700	3,195.00	15,016,500
めぶきフィナンシャルグループ	86,900	231.00	20,073,900
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,300	1,048.00	2,410,400
九州フィナンシャルグループ	37,100	440.00	16,324,000
かんぽ生命保険	6,100	1,290.00	7,869,000
ゆうちょ銀行	47,500	1,010.00	47,975,000
富山第一銀行	2,800	268.00	750,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	95,400	324.00	30,909,600
西日本フィナンシャルホールディングス	11,100	611.00	6,782,100
マーキュリアインベストメント	800	566.00	452,800
イントラスト	800	641.00	512,800
日本モーゲージサービス	400	1,584.00	633,600
C A S A	700	1,127.00	788,900
アルヒ	2,600	1,273.00	3,309,800
プレミアグループ	1,000	1,765.00	1,765,000
日産自動車	200,100	347.60	69,554,760
いすゞ自動車	49,000	813.30	39,851,700
トヨタ自動車	189,200	6,492.00	1,228,286,400
日野自動車	21,500	652.00	14,018,000
三菱自動車工業	62,800	289.00	18,149,200
エフテック	1,100	459.00	504,900
レシップホールディングス	800	464.00	371,200
G M B	100	659.00	65,900

ファルテック	400	640.00	256,000	
武蔵精密工業	3,700	851.00	3,148,700	
日産車体	3,600	889.00	3,200,400	
新明和工業	4,700	1,081.00	5,080,700	
極東開発工業	3,100	1,224.00	3,794,400	
日信工業	3,700	2,210.00	8,177,000	
トピー工業	1,400	1,260.00	1,764,000	
ティラド	400	1,364.00	545,600	
タチエス	2,800	929.00	2,601,200	
NOK	9,300	1,206.00	11,215,800	
フタバ産業	4,900	483.00	2,366,700	
KYB	2,000	2,081.00	4,162,000	
市光工業	2,600	480.00	1,248,000	
大同メタル工業	3,200	530.00	1,696,000	
プレス工業	7,800	251.00	1,957,800	
ミクニ	1,800	256.00	460,800	
太平洋工業	3,400	940.00	3,196,000	
ケーヒン	4,100	2,545.00	10,434,500	
河西工業	2,300	507.00	1,166,100	
アイシン精機	13,900	3,060.00	42,534,000	
マツダ	49,800	585.00	29,133,000	
今仙電機製作所	1,500	762.00	1,143,000	
本田技研工業	133,400	2,538.00	338,569,200	
スズキ	33,600	3,345.00	112,392,000	
SUBARU	52,600	2,115.00	111,249,000	
安永	800	993.00	794,400	
ヤマハ発動機	22,000	1,365.00	30,030,000	
ショーワ	4,100	2,256.00	9,249,600	
小糸製作所	10,100	4,005.00	40,450,500	
TBK	2,100	460.00	966,000	
エクセディ	2,300	1,664.00	3,827,200	
豊田合成	5,600	2,012.00	11,267,200	
愛三工業	2,700	551.00	1,487,700	
盟和産業	200	938.00	187,600	
日本プラスト	1,100	444.00	488,400	
ヨロズ	1,700	1,093.00	1,858,100	
エフ・シー・シー	2,800	1,539.00	4,309,200	
新家工業	200	1,078.00	215,600	
シマノ	6,300	17,150.00	108,045,000	
テイ・エス テック	4,000	2,869.00	11,476,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	8,500	344.00	2,924,000	
三十三フィナンシャルグループ	1,600	1,524.00	2,438,400	
第四北越フィナンシャルグループ	2,900	2,263.00	6,562,700	
ジャムコ	800	652.00	521,600	
小野建	1,400	1,155.00	1,617,000	
はるやまホールディングス	700	741.00	518,700	
南陽	400	1,379.00	551,600	
ノジマ	2,900	1,874.00	5,434,600	
佐島電機	1,400	828.00	1,159,200	
カッパ・クリエイト	2,400	1,383.00	3,319,200	

エコートレーディング	1,200	500.00	600,000
伯東	1,400	965.00	1,351,000
コンドーテック	1,500	964.00	1,446,000
中山福	1,900	477.00	906,300
ライトオン	1,200	499.00	598,800
ナガイレーベン	2,300	2,585.00	5,945,500
ジーンズメイト	600	238.00	142,800
三菱食品	1,900	2,610.00	4,959,000
良品計画	22,100	1,366.00	30,188,600
三城ホールディングス	600	268.00	160,800
松田産業	1,400	1,371.00	1,919,400
第一興商	2,500	3,375.00	8,437,500
メディカルホールディングス	18,200	2,077.00	37,801,400
アドヴァン	2,500	1,105.00	2,762,500
S P K	1,000	1,300.00	1,300,000
萩原電気ホールディングス	600	2,174.00	1,304,400
アルビス	600	2,049.00	1,229,400
アズワン	1,100	9,930.00	10,923,000
スズデン	600	1,177.00	706,200
尾家産業	700	1,500.00	1,050,000
シモジマ	1,300	1,248.00	1,622,400
ドウシシャ	1,700	1,386.00	2,356,200
小津産業	700	1,917.00	1,341,900
コナカ	1,700	321.00	545,700
高速	1,100	1,451.00	1,596,100
ハウス オブ ローゼ	100	1,545.00	154,500
G - 7ホールディングス	1,000	2,404.00	2,404,000
たけびし	700	1,385.00	969,500
イオン北海道	2,200	795.00	1,749,000
コジマ	2,800	399.00	1,117,200
ヒマラヤ	400	745.00	298,000
コーナン商事	2,300	2,645.00	6,083,500
ネットワンシステムズ	6,400	3,255.00	20,832,000
エコス	600	1,914.00	1,148,400
ワタミ	2,000	1,052.00	2,104,000
マルシェ	200	595.00	119,000
リックス	500	1,464.00	732,000
システムソフト	3,800	74.00	281,200
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	36,700	2,100.00	77,070,000
丸文	1,700	504.00	856,800
西松屋チェーン	3,800	843.00	3,203,400
ゼンショーホールディングス	8,000	2,187.00	17,496,000
ハビネット	1,500	1,075.00	1,612,500
幸楽苑ホールディングス	1,100	1,564.00	1,720,400
ハークスレイ	200	1,015.00	203,000
橋本総業ホールディングス	400	1,854.00	741,600
日本ライフライン	5,000	1,282.00	6,410,000
サイゼリヤ	2,600	2,293.00	5,961,800
タカショー	2,100	469.00	984,900

VTホールディングス	6,400	291.00	1,862,400
マルカ	800	1,775.00	1,420,000
アルゴグラフィックス	1,400	3,485.00	4,879,000
魚力	400	1,496.00	598,400
IDOM	4,900	447.00	2,190,300
日本エム・ディ・エム	1,000	1,595.00	1,595,000
フジ・コーポレーション	400	1,865.00	746,000
ユナイテッドアローズ	1,700	1,800.00	3,060,000
進和	1,000	1,766.00	1,766,000
エスケイジャパン	400	297.00	118,800
ダイトロン	800	1,499.00	1,199,200
ハイデイ日高	2,400	1,735.00	4,164,000
シークス	2,300	931.00	2,141,300
京都きもの友禅	700	221.00	154,700
コロワイド	5,600	1,499.00	8,394,400
ピーシーデポコーポレーション	2,300	574.00	1,320,200
田中商事	900	695.00	625,500
オーハシテクニカ	1,100	1,461.00	1,607,100
壱番屋	1,200	4,570.00	5,484,000
白銅	700	1,285.00	899,500
PLANT	400	622.00	248,800
スギホールディングス	3,400	6,370.00	21,658,000
薬王堂ホールディングス	800	2,648.00	2,118,400
島津製作所	20,200	2,635.00	53,227,000
JMS	1,600	842.00	1,347,200
長野計器	1,300	784.00	1,019,200
ブイ・テクノロジー	800	3,870.00	3,096,000
スター精密	2,600	1,187.00	3,086,200
東京計器	1,000	740.00	740,000
愛知時計電機	100	4,390.00	439,000
インターアクション	900	2,459.00	2,213,100
オーバル	1,600	229.00	366,400
東京精密	3,100	3,415.00	10,586,500
マニー	6,800	2,433.00	16,544,400
ニコン	25,700	984.00	25,288,800
トプコン	8,600	842.00	7,241,200
オリンパス	93,900	1,681.50	157,892,850
理研計器	1,300	1,975.00	2,567,500
SCREENホールディングス	3,000	5,180.00	15,540,000
キヤノン電子	1,700	1,566.00	2,662,200
タムロン	1,400	1,807.00	2,529,800
HOYA	33,900	9,872.00	334,660,800
シード	700	822.00	575,400
ノーリツ鋼機	1,100	1,225.00	1,347,500
エー・アンド・デイ	1,500	777.00	1,165,500
朝日インテック	19,200	2,778.00	53,337,600
キヤノン	90,900	2,184.50	198,571,050
リコー	43,000	763.00	32,809,000
シチズン時計	19,600	371.00	7,271,600
リズム時計工業	400	641.00	256,400

大研医器	1,300	641.00	833,300
メニコン	2,400	4,640.00	11,136,000
シンシア	400	352.00	140,800
中本パックス	300	1,461.00	438,300
スノーピーク	900	812.00	730,800
パラマウントベッドホールディングス	1,800	4,475.00	8,055,000
トランザクション	1,000	981.00	981,000
粧美堂	500	369.00	184,500
ニホンフラッシュ	1,600	1,236.00	1,977,600
前田工織	1,900	2,050.00	3,895,000
永大産業	1,700	277.00	470,900
アートネイチャー	1,800	671.00	1,207,800
バンダイナムコホールディングス	17,500	5,479.00	95,882,500
アイフィスジャパン	500	690.00	345,000
共立印刷	2,500	145.00	362,500
SHOEI	1,500	2,081.00	3,121,500
フランスベッドホールディングス	2,400	884.00	2,121,600
マーベラス	2,500	557.00	1,392,500
パイロットコーポレーション	2,800	3,530.00	9,884,000
萩原工業	1,000	1,289.00	1,289,000
エイベックス	2,700	817.00	2,205,900
トッパン・フォームズ	4,000	956.00	3,824,000
フジシールインターナショナル	3,700	1,854.00	6,859,800
タカラトミー	7,500	876.00	6,570,000
廣済堂	1,300	780.00	1,014,000
エステールホールディングス	300	598.00	179,400
アーク	6,900	90.00	621,000
レック	1,800	1,293.00	2,327,400
タカノ	600	717.00	430,200
三光合成	1,900	299.00	568,100
プロネクサス	1,300	1,099.00	1,428,700
ホクシン	1,600	114.00	182,400
ウッドワン	500	1,042.00	521,000
大建工業	1,000	1,595.00	1,595,000
きもと	3,300	140.00	462,000
凸版印刷	24,100	1,558.00	37,547,800
大日本印刷	22,200	2,216.00	49,195,200
共同印刷	500	2,800.00	1,400,000
N I S S H A	3,600	797.00	2,869,200
光村印刷	100	1,638.00	163,800
藤森工業	1,500	3,220.00	4,830,000
TAKARA & COMPANY	700	1,842.00	1,289,400
前澤化成工業	1,100	1,048.00	1,152,800
未来工業	800	1,958.00	1,566,400
アシックス	14,200	1,005.00	14,271,000
ツツミ	600	1,624.00	974,400
ウェーブロックホールディングス	500	721.00	360,500
J S P	1,000	1,374.00	1,374,000
ニチハ	2,300	2,053.00	4,721,900
エフピコ	1,900	8,170.00	15,523,000

小松ウオール工業	500	1,840.00	920,000
ヤマハ	10,100	4,385.00	44,288,500
河合楽器製作所	500	3,025.00	1,512,500
クリナップ	1,600	525.00	840,000
ピジョン	10,300	4,040.00	41,612,000
天馬	1,000	1,524.00	1,524,000
オリバー	400	2,707.00	1,082,800
兼松サステック	100	1,497.00	149,700
キングジム	1,400	885.00	1,239,000
象印マホービン	5,000	1,656.00	8,280,000
リンテック	4,000	2,380.00	9,520,000
信越ポリマー	3,400	850.00	2,890,000
東リ	3,800	257.00	976,600
イトーキ	3,500	330.00	1,155,000
任天堂	10,400	44,300.00	460,720,000
三菱鉛筆	2,700	1,370.00	3,699,000
松風	800	1,587.00	1,269,600
タカラスタンダード	3,500	1,588.00	5,558,000
コクヨ	8,100	1,305.00	10,570,500
ナカバヤシ	1,400	535.00	749,000
ニフコ	6,200	2,043.00	12,666,600
立川ブラインド工業	600	1,128.00	676,800
グローブライト	700	1,979.00	1,385,300
オカムラ	5,800	797.00	4,622,600
バルカー	1,200	1,819.00	2,182,800
MUTOHホールディングス	200	1,332.00	266,400
伊藤忠商事	117,200	2,159.50	253,093,400
丸紅	174,400	471.40	82,212,160
スクロール	2,300	332.00	763,600
高島	400	1,542.00	616,800
ヨンドシーホールディングス	1,600	1,679.00	2,686,400
三陽商会	1,000	889.00	889,000
長瀬産業	9,700	1,259.00	12,212,300
ナイガイ	900	418.00	376,200
蝶理	1,200	1,682.00	2,018,400
豊田通商	18,700	2,532.00	47,348,400
オンワードホールディングス	10,300	331.00	3,409,300
三共生興	3,200	463.00	1,481,600
兼松	6,400	1,142.00	7,308,800
美津濃	1,500	1,819.00	2,728,500
ツカモトコーポレーション	500	1,109.00	554,500
ファミリーマート	13,400	1,826.00	24,468,400
ルックホールディングス	500	790.00	395,000
三井物産	147,400	1,590.50	234,439,700
日本紙パルプ商事	1,000	3,615.00	3,615,000
東京エレクトロン	10,800	22,490.00	242,892,000
カメイ	2,200	1,050.00	2,310,000
東都水産	300	2,921.00	876,300
OUGホールディングス	400	2,690.00	1,076,000
スターゼン	700	4,390.00	3,073,000

セイコーホールディングス	2,400	1,767.00	4,240,800
山善	6,700	917.00	6,143,900
椿本興業	400	3,300.00	1,320,000
住友商事	105,900	1,292.00	136,822,800
日本ユニシス	5,200	3,125.00	16,250,000
内田洋行	700	5,390.00	3,773,000
三菱商事	117,400	2,341.50	274,892,100
第一実業	900	3,645.00	3,280,500
キヤノンマーケティングジャパン	4,400	2,136.00	9,398,400
西華産業	1,100	1,133.00	1,246,300
佐藤商事	1,400	867.00	1,213,800
菱洋エレクトロ	1,900	2,484.00	4,719,600
東京産業	2,000	492.00	984,000
ユアサ商事	1,600	2,993.00	4,788,800
神鋼商事	500	1,815.00	907,500
トルク	1,500	278.00	417,000
阪和興業	3,000	1,733.00	5,199,000
正栄食品工業	1,100	3,915.00	4,306,500
カナデン	1,700	1,227.00	2,085,900
菱電商事	1,600	1,347.00	2,155,200
ニプロ	11,700	1,198.00	14,016,600
フルサト工業	1,000	1,370.00	1,370,000
岩谷産業	3,900	3,730.00	14,547,000
ナイス	1,100	806.00	886,600
昭光通商	1,400	570.00	798,000
極東貿易	500	1,406.00	703,000
イワキ	2,800	440.00	1,232,000
兼松エレクトロニクス	800	3,740.00	2,992,000
三愛石油	4,400	1,139.00	5,011,600
稲畑産業	3,800	1,187.00	4,510,600
G S Iクレオス	500	1,050.00	525,000
明和産業	2,000	489.00	978,000
クワザワ	1,100	498.00	547,800
ゴールドウイン	3,000	5,670.00	17,010,000
ユニ・チャーム	32,700	4,011.00	131,159,700
デザート	3,200	1,360.00	4,352,000
キング	700	489.00	342,300
ワキタ	3,800	1,008.00	3,830,400
ヤマトインターナショナル	1,300	348.00	452,400
東邦ホールディングス	5,500	2,216.00	12,188,000
サンゲツ	4,800	1,580.00	7,584,000
ミツウロコグループホールディングス	2,900	1,151.00	3,337,900
シナネンホールディングス	900	2,765.00	2,488,500
伊藤忠エネクス	4,100	802.00	3,288,200
サンリオ	4,800	1,636.00	7,852,800
サンワテクノス	1,500	821.00	1,231,500
リョーサン	2,000	2,362.00	4,724,000
新光商事	2,900	869.00	2,520,100
トーヨー	900	1,780.00	1,602,000
三信電気	1,000	1,530.00	1,530,000

東陽テクニカ	2,200	1,021.00	2,246,200
モスフードサービス	2,500	2,796.00	6,990,000
加賀電子	1,700	1,974.00	3,355,800
三益半導体工業	1,500	2,161.00	3,241,500
ソーダニッカ	2,300	602.00	1,384,600
立花エレテック	1,500	1,561.00	2,341,500
木曽路	2,200	2,324.00	5,112,800
S R S ホールディングス	2,100	882.00	1,852,200
千趣会	4,000	331.00	1,324,000
タカキュー	1,700	130.00	221,000
ケーヨー	3,300	590.00	1,947,000
上新電機	1,900	2,057.00	3,908,300
日本瓦斯	2,700	3,900.00	10,530,000
ロイヤルホールディングス	2,900	1,812.00	5,254,800
東天紅	200	868.00	173,600
いなげや	2,100	1,590.00	3,339,000
島忠	3,200	2,769.00	8,860,800
チヨダ	1,500	1,044.00	1,566,000
ライフコーポレーション	1,300	3,155.00	4,101,500
リンガーハット	2,100	2,225.00	4,672,500
MrMaxHD	1,900	432.00	820,800
テナアライド	1,800	371.00	667,800
AOKIホールディングス	2,900	638.00	1,850,200
オークワ	2,700	1,382.00	3,731,400
コメリ	2,600	2,326.00	6,047,600
青山商事	3,100	882.00	2,734,200
しまむら	2,000	6,820.00	13,640,000
はせがわ	700	408.00	285,600
高島屋	12,400	953.00	11,817,200
松屋	3,400	606.00	2,060,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,600	798.00	6,064,800
近鉄百貨店	600	2,590.00	1,554,000
丸井グループ	15,300	1,727.00	26,423,100
クレディセゾン	11,800	1,189.00	14,030,200
アクシアル リテイリング	1,400	3,945.00	5,523,000
イオン	64,200	2,175.00	139,635,000
イズミ	3,300	3,195.00	10,543,500
フォーバル	900	1,150.00	1,035,000
平和堂	3,400	1,814.00	6,167,600
フジ	2,000	1,713.00	3,426,000
ヤオコー	1,900	6,720.00	12,768,000
ゼビオホールディングス	2,100	900.00	1,890,000
ケーズホールディングス	16,100	1,191.00	19,175,100
PALTAC	2,700	5,440.00	14,688,000
三谷産業	3,100	430.00	1,333,000
Olympicグループ	800	641.00	512,800
日産東京販売ホールディングス	2,300	217.00	499,100
新生銀行	12,600	1,321.00	16,644,600
あおぞら銀行	10,000	1,895.00	18,950,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,141,600	419.20	478,558,720

りそなホールディングス	183,000	324.50	59,383,500	
三井住友トラスト・ホールディングス	31,600	3,061.00	96,727,600	
三井住友フィナンシャルグループ	115,300	2,763.50	318,631,550	
千葉銀行	56,100	491.00	27,545,100	
群馬銀行	32,700	333.00	10,889,100	
武蔵野銀行	2,300	1,324.00	3,045,200	
千葉興業銀行	5,700	233.00	1,328,100	
筑波銀行	7,800	166.00	1,294,800	
七十七銀行	5,900	1,385.00	8,171,500	
青森銀行	1,300	2,281.00	2,965,300	
秋田銀行	1,000	1,463.00	1,463,000	
山形銀行	1,800	1,282.00	2,307,600	
岩手銀行	1,100	2,529.00	2,781,900	
東邦銀行	15,100	238.00	3,593,800	
東北銀行	500	893.00	446,500	
みちのく銀行	1,100	1,077.00	1,184,700	
ふくおかフィナンシャルグループ	13,900	1,574.00	21,878,600	
静岡銀行	41,800	646.00	27,002,800	
十六銀行	2,200	1,879.00	4,133,800	
スルガ銀行	17,700	369.00	6,531,300	
八十二銀行	40,900	363.00	14,846,700	
山梨中央銀行	1,600	798.00	1,276,800	
大垣共立銀行	3,400	2,206.00	7,500,400	
福井銀行	1,400	1,618.00	2,265,200	
北國銀行	1,800	3,075.00	5,535,000	
清水銀行	700	1,790.00	1,253,000	
富山銀行	200	2,167.00	433,400	
滋賀銀行	3,500	2,559.00	8,956,500	
南都銀行	2,900	2,233.00	6,475,700	
百五銀行	15,900	307.00	4,881,300	
京都銀行	6,100	3,655.00	22,295,500	
紀陽銀行	6,000	1,587.00	9,522,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	11,300	866.00	9,785,800	
広島銀行	24,200	442.00	10,696,400	
山陰合同銀行	9,700	548.00	5,315,600	
中国銀行	14,700	994.00	14,611,800	
鳥取銀行	500	1,130.00	565,000	
伊予銀行	24,500	585.00	14,332,500	
百十四銀行	1,800	1,938.00	3,488,400	
四国銀行	2,400	856.00	2,054,400	
阿波銀行	2,800	2,275.00	6,370,000	
大分銀行	800	2,132.00	1,705,600	
宮崎銀行	1,000	2,330.00	2,330,000	
佐賀銀行	600	1,119.00	671,400	
沖縄銀行	1,500	3,145.00	4,717,500	
琉球銀行	3,800	1,021.00	3,879,800	
セブン銀行	56,100	280.00	15,708,000	
みずほフィナンシャルグループ	2,268,700	122.60	278,142,620	
高知銀行	500	720.00	360,000	
山口フィナンシャルグループ	20,900	570.00	11,913,000	

芙蓉総合リース	1,700	5,830.00	9,911,000	
みずほリース	2,500	2,069.00	5,172,500	
東京センチュリー	3,300	3,585.00	11,830,500	
SBIホールディングス	18,600	2,112.00	39,283,200	
日本証券金融	7,400	487.00	3,603,800	
アイフル	25,900	244.00	6,319,600	
長野銀行	300	1,108.00	332,400	
名古屋銀行	1,200	2,266.00	2,719,200	
北洋銀行	25,500	191.00	4,870,500	
愛知銀行	600	3,135.00	1,881,000	
中京銀行	700	2,109.00	1,476,300	
大光銀行	500	1,506.00	753,000	
愛媛銀行	2,300	1,106.00	2,543,800	
トマト銀行	600	993.00	595,800	
京葉銀行	7,200	517.00	3,722,400	
栃木銀行	9,200	157.00	1,444,400	
北日本銀行	600	1,934.00	1,160,400	
東和銀行	2,800	658.00	1,842,400	
福島銀行	3,100	166.00	514,600	
大東銀行	900	578.00	520,200	
リコーリース	1,300	2,963.00	3,851,900	
イオンフィナンシャルサービス	10,100	1,074.00	10,847,400	
アコム	33,900	435.00	14,746,500	
ジャックス	1,900	1,769.00	3,361,100	
オリエントコーポレーション	46,500	121.00	5,626,500	
日立キャピタル	3,900	2,060.00	8,034,000	
アプラスフィナンシャル	10,000	62.00	620,000	
オリックス	104,300	1,248.00	130,166,400	
三菱UFJリース	42,200	504.00	21,268,800	
ジャフコ	2,600	3,430.00	8,918,000	
九州リースサービス	400	445.00	178,000	
トモニホールディングス	12,900	346.00	4,463,400	
大和証券グループ本社	134,600	432.00	58,147,200	
野村ホールディングス	295,500	441.10	130,345,050	
岡三証券グループ	14,200	323.00	4,586,600	
丸三証券	5,200	412.00	2,142,400	
東洋証券	7,500	121.00	907,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19,300	228.00	4,400,400	
光世証券	700	516.00	361,200	
水戸証券	5,100	191.00	974,100	
いちよし証券	2,400	456.00	1,094,400	
松井証券	9,600	759.00	7,286,400	
SOMPOホールディングス	31,300	3,244.00	101,537,200	
だいがく証券ビジネス	1,200	920.00	1,104,000	
日本取引所グループ	48,000	2,120.00	101,760,000	
マネックスグループ	12,500	219.00	2,737,500	
極東証券	2,100	508.00	1,066,800	
岩井コスモホールディングス	1,400	940.00	1,316,000	
藍澤証券	3,000	695.00	2,085,000	

フィデアホールディングス	14,700	106.00	1,558,200
池田泉州ホールディングス	19,400	167.00	3,239,800
アニコムホールディングス	1,400	3,915.00	5,481,000
MS & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	43,600	2,963.00	129,186,800
ソニーフィナンシャルホールディング ス	13,800	1,985.00	27,393,000
マネーパートナーズグループ	1,900	199.00	378,100
スパークス・グループ	7,800	190.00	1,482,000
第一生命ホールディングス	94,700	1,296.50	122,778,550
東京海上ホールディングス	59,000	4,447.00	262,373,000
アドバンテッジリスクマネジメント	800	763.00	610,400
イー・ギャランティ	1,800	1,926.00	3,466,800
アサックス	900	633.00	569,700
NECキャピタルソリューション	700	1,867.00	1,306,900
T & Dホールディングス	50,100	876.00	43,887,600
アドバンスクリエイト	300	1,954.00	586,200
三井不動産	83,200	1,896.00	157,747,200
三菱地所	118,200	1,781.50	210,573,300
平和不動産	3,200	2,929.00	9,372,800
東京建物	18,000	1,205.00	21,690,000
ダイビル	4,700	1,000.00	4,700,000
京阪神ビルディング	3,000	1,425.00	4,275,000
住友不動産	37,700	2,866.00	108,048,200
太平洋興発	1,000	591.00	591,000
テオーシー	3,700	692.00	2,560,400
東京楽天地	300	4,100.00	1,230,000
スターツコーポレーション	2,300	2,059.00	4,735,700
フジ住宅	1,500	513.00	769,500
空港施設	1,800	425.00	765,000
明和地所	800	436.00	348,800
ゴールドクレスト	1,400	1,621.00	2,269,400
リログループ	8,800	2,268.00	19,958,400
エスリード	700	1,350.00	945,000
日神グループホールディングス	2,500	394.00	985,000
日本エスコン	3,000	729.00	2,187,000
タカラレーベン	7,900	355.00	2,804,500
A V A N T I A	800	696.00	556,800
イオンモール	8,600	1,425.00	12,255,000
毎日コムネット	600	799.00	479,400
ファースト住建	700	927.00	648,900
カチタス	4,200	2,003.00	8,412,600
東祥	900	1,052.00	946,800
トーセイ	2,400	1,018.00	2,443,200
穴吹興産	400	1,530.00	612,000
サンフロンティア不動産	2,300	854.00	1,964,200
エフ・ジェー・ネクスト	1,500	789.00	1,183,500
インテリックス	500	527.00	263,500
ランドビジネス	600	293.00	175,800
日本社宅サービス	600	1,038.00	622,800

グランディハウス	900	342.00	307,800	
東武鉄道	17,800	3,570.00	63,546,000	
相鉄ホールディングス	5,400	2,759.00	14,898,600	
東急	42,800	1,600.00	68,480,000	
京浜急行電鉄	21,800	1,735.00	37,823,000	
小田急電鉄	25,300	2,331.00	58,974,300	
京王電鉄	8,800	5,610.00	49,368,000	
京成電鉄	11,900	2,993.00	35,616,700	
富士急行	2,300	3,040.00	6,992,000	
新京成電鉄	500	2,096.00	1,048,000	
東日本旅客鉄道	29,800	7,811.00	232,767,800	
西日本旅客鉄道	15,100	6,274.00	94,737,400	
東海旅客鉄道	14,100	17,105.00	241,180,500	
西武ホールディングス	22,700	1,261.00	28,624,700	
鴻池運輸	2,500	1,146.00	2,865,000	
西日本鉄道	4,800	2,590.00	12,432,000	
ハマキョウレックス	1,300	3,030.00	3,939,000	
サカイ引越センター	900	5,430.00	4,887,000	
近鉄グループホールディングス	16,100	5,130.00	82,593,000	
阪急阪神ホールディングス	21,400	3,755.00	80,357,000	
南海電気鉄道	7,600	2,404.00	18,270,400	
京阪ホールディングス	7,200	4,780.00	34,416,000	
神戸電鉄	400	3,770.00	1,508,000	
名古屋鉄道	13,300	3,080.00	40,964,000	
山陽電気鉄道	1,100	2,130.00	2,343,000	
トランコム	500	6,820.00	3,410,000	
日本通運	5,600	5,090.00	28,504,000	
ヤマトホールディングス	28,200	1,912.00	53,918,400	
山九	4,400	4,025.00	17,710,000	
日新	1,300	1,606.00	2,087,800	
丸運	800	224.00	179,200	
丸全昭和運輸	1,200	2,450.00	2,940,000	
センコーグループホールディングス	8,800	870.00	7,656,000	
トナミホールディングス	400	4,960.00	1,984,000	
ニッコンホールディングス	5,600	2,049.00	11,474,400	
日本石油輸送	200	3,000.00	600,000	
福山通運	2,100	3,700.00	7,770,000	
セイノーホールディングス	12,100	1,286.00	15,560,600	
エスライン	400	994.00	397,600	
神奈川中央交通	400	4,050.00	1,620,000	
日立物流	3,000	2,599.00	7,797,000	
丸和運輸機関	1,700	3,280.00	5,576,000	
C & F ロジホールディングス	1,500	1,347.00	2,020,500	
日本郵船	14,000	1,370.00	19,180,000	
商船三井	10,200	1,795.00	18,309,000	
川崎汽船	5,300	1,023.00	5,421,900	
NSユニテッド海運	700	1,459.00	1,021,300	
飯野海運	7,100	317.00	2,250,700	
共栄タンカー	300	882.00	264,600	
九州旅客鉄道	14,100	2,873.00	40,509,300	

SGホールディングス	16,800	3,030.00	50,904,000
日本航空	28,100	1,792.00	50,355,200
ANAホールディングス	29,300	2,186.00	64,049,800
パスコ	500	1,504.00	752,000
西本Wismettacホールディングス	400	1,962.00	784,800
シルバーライフ	300	2,066.00	619,800
ヤマシタヘルスケアホールディングス	400	1,936.00	774,400
一家ダイニングプロジェクト	200	599.00	119,800
Genky DrugStores	800	2,482.00	1,985,600
国際紙パルプ商事	4,400	317.00	1,394,800
ナルミヤ・インターナショナル	100	590.00	59,000
ブックオフグループホールディングス	1,100	791.00	870,100
三菱倉庫	5,300	2,380.00	12,614,000
三井倉庫ホールディングス	1,800	1,450.00	2,610,000
住友倉庫	5,700	1,241.00	7,073,700
澁澤倉庫	800	2,226.00	1,780,800
ヤマタネ	1,000	1,205.00	1,205,000
東陽倉庫	2,500	314.00	785,000
乾汽船	1,000	1,213.00	1,213,000
日本トランスシティ	3,200	480.00	1,536,000
ケイヒン	100	1,272.00	127,200
中央倉庫	900	1,066.00	959,400
川西倉庫	300	1,010.00	303,000
安田倉庫	1,400	865.00	1,211,000
ファイズホールディングス	400	1,135.00	454,000
東洋埠頭	400	1,306.00	522,400
宇徳	1,300	455.00	591,500
上組	9,100	1,916.00	17,435,600
キムラユニティー	400	998.00	399,200
キューソー流通システム	400	1,706.00	682,400
近鉄エクスプレス	3,500	1,525.00	5,337,500
東海運	1,800	252.00	453,600
エーアイティー	900	739.00	665,100
内外トランスライン	500	1,104.00	552,000
ショーエイコーポレーション	200	734.00	146,800
日本コンセプト	600	1,446.00	867,600
東京放送ホールディングス	10,100	1,664.00	16,806,400
日本テレビホールディングス	13,800	1,188.00	16,394,400
朝日放送グループホールディングス	1,400	704.00	985,600
テレビ朝日ホールディングス	4,600	1,610.00	7,406,000
スカパーJ S A Tホールディングス	10,800	410.00	4,428,000
テレビ東京ホールディングス	1,300	2,450.00	3,185,000
日本BS放送	600	1,029.00	617,400
ビジョン	1,500	789.00	1,183,500
スマートバリュー	500	833.00	416,500
USEN-NEXT HOLDINGS	800	1,438.00	1,150,400
コネクシオ	900	1,542.00	1,387,800
クロップス	100	642.00	64,200

日本電信電話	222,000	2,447.50	543,345,000
KDDI	124,000	3,175.00	393,700,000
ソフトバンク	151,100	1,455.50	219,926,050
光通信	1,700	22,180.00	37,706,000
NTTドコモ	123,000	3,135.00	385,605,000
エムティーアイ	1,600	581.00	929,600
GMOインターネット	6,600	2,363.00	15,595,800
ファイバーゲート	600	1,355.00	813,000
アйдママーケティングコミュニケーション	600	439.00	263,400
KADOKAWA	4,600	1,649.00	7,585,400
学研ホールディングス	2,300	1,716.00	3,946,800
ゼンリン	3,200	1,245.00	3,984,000
昭文社ホールディングス	1,100	387.00	425,700
インプレスホールディングス	1,700	160.00	272,000
東京電力ホールディングス	135,400	359.00	48,608,600
中部電力	51,800	1,454.00	75,317,200
関西電力	64,000	1,053.50	67,424,000
中国電力	24,600	1,456.00	35,817,600
北陸電力	15,900	710.00	11,289,000
東北電力	42,000	1,024.00	43,008,000
四国電力	15,100	799.00	12,064,900
九州電力	34,700	868.00	30,119,600
北海道電力	16,100	413.00	6,649,300
沖縄電力	3,200	2,026.00	6,483,200
電源開発	13,400	1,977.00	26,491,800
エフオン	900	517.00	465,300
イーレックス	2,400	1,568.00	3,763,200
レノバ	2,900	903.00	2,618,700
東京瓦斯	32,700	2,491.50	81,472,050
大阪瓦斯	33,000	2,061.00	68,013,000
東邦瓦斯	8,300	5,670.00	47,061,000
北海道瓦斯	800	1,575.00	1,260,000
広島ガス	3,100	355.00	1,100,500
西部瓦斯	1,800	2,718.00	4,892,400
静岡ガス	4,800	957.00	4,593,600
メタウォーター	900	4,335.00	3,901,500
アイネット	700	1,570.00	1,099,000
松竹	1,100	12,340.00	13,574,000
東宝	9,800	3,565.00	34,937,000
エイチ・アイ・エス	2,500	1,477.00	3,692,500
東映	600	13,880.00	8,328,000
ラックランド	400	1,919.00	767,600
エヌ・ティ・ティ・データ	44,400	1,131.00	50,216,400
共立メンテナンス	2,600	2,878.00	7,482,800
イチネンホールディングス	1,800	1,145.00	2,061,000
建設技術研究所	1,200	1,751.00	2,101,200
スペース	800	998.00	798,400
長大	700	856.00	599,200
アインホールディングス	2,100	6,160.00	12,936,000

燦ホールディングス	600	1,271.00	762,600	
ピー・シー・エー	300	3,740.00	1,122,000	
スバル興業	100	7,850.00	785,000	
東京テアトル	700	1,192.00	834,400	
タナベ経営	200	1,220.00	244,000	
ビジネスブレイン太田昭和	300	2,772.00	831,600	
ナガワ	500	7,530.00	3,765,000	
よみうりランド	400	3,340.00	1,336,000	
東京都競馬	1,100	3,715.00	4,086,500	
常磐興産	600	1,344.00	806,400	
カナモト	2,700	2,141.00	5,780,700	
東京ドーム	6,600	803.00	5,299,800	
D T S	3,700	2,153.00	7,966,100	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,100	4,545.00	32,269,500	
シーイーシー	1,700	1,670.00	2,839,000	
カプコン	7,900	3,385.00	26,741,500	
西尾レントオール	1,500	2,261.00	3,391,500	
アイ・エス・ビー	300	1,670.00	501,000	
日本空港ビルデング	5,400	3,945.00	21,303,000	
トランス・コスモス	1,600	2,182.00	3,491,200	
乃村工藝社	6,700	836.00	5,601,200	
ジャステック	900	1,158.00	1,042,200	
S C S K	3,800	4,930.00	18,734,000	
藤田観光	700	1,793.00	1,255,100	
K N T - C Tホールディングス	1,100	939.00	1,032,900	
日本管財	1,700	1,848.00	3,141,600	
トーカイ	1,600	2,816.00	4,505,600	
白洋舎	100	2,755.00	275,500	
セコム	17,200	9,029.00	155,298,800	
日本システムウエア	500	2,129.00	1,064,500	
セントラル警備保障	800	4,330.00	3,464,000	
アイネス	1,700	1,485.00	2,524,500	
丹青社	2,900	694.00	2,012,600	
メイテック	2,000	4,730.00	9,460,000	
T K C	1,400	5,120.00	7,168,000	
富士ソフト	2,100	3,900.00	8,190,000	
応用地質	1,800	1,287.00	2,316,600	
船井総研ホールディングス	3,300	2,345.00	7,738,500	
N S D	5,400	1,593.00	8,602,200	
進学会ホールディングス	600	528.00	316,800	
丸紅建材リース	200	1,423.00	284,600	
オオバ	1,200	645.00	774,000	
コナミホールディングス	6,000	3,435.00	20,610,000	
いであ	500	1,561.00	780,500	
学究社	300	1,103.00	330,900	
ベネッセホールディングス	5,500	3,110.00	17,105,000	
イオンディライト	2,000	3,125.00	6,250,000	
ナック	800	872.00	697,600	
福井コンピュータホールディングス	700	2,891.00	2,023,700	

ニチイ学館	2,300	1,155.00	2,656,500
ダイセキ	2,800	2,455.00	6,874,000
ステップ	500	1,396.00	698,000
日鉄物産	1,200	3,305.00	3,966,000
泉州電業	600	2,510.00	1,506,000
元気寿司	400	2,414.00	965,600
トラスコ中山	3,700	2,365.00	8,750,500
ヤマダ電機	50,900	520.00	26,468,000
オートバックスセブン	6,500	1,303.00	8,469,500
モリト	1,700	674.00	1,145,800
アークランドサカモト	2,400	1,067.00	2,560,800
ニトリホールディングス	7,200	16,795.00	120,924,000
グルメ杵屋	1,100	928.00	1,020,800
愛眼	1,300	210.00	273,000
ケーユーホールディングス	500	772.00	386,000
吉野家ホールディングス	5,600	2,276.00	12,745,600
加藤産業	2,500	3,645.00	9,112,500
北恵	700	856.00	599,200
イノテック	1,000	927.00	927,000
イエローハット	3,300	1,491.00	4,920,300
松屋フーズホールディングス	800	3,810.00	3,048,000
JBC Cホールディングス	1,100	2,028.00	2,230,800
J Kホールディングス	1,800	728.00	1,310,400
サガミホールディングス	2,300	1,279.00	2,941,700
日伝	1,800	2,049.00	3,688,200
関西スーパーマーケット	1,300	1,062.00	1,380,600
ミロク情報サービス	1,400	2,681.00	3,753,400
北沢産業	2,100	272.00	571,200
杉本商事	1,000	1,766.00	1,766,000
因幡電機産業	5,000	2,284.00	11,420,000
王将フードサービス	1,200	5,800.00	6,960,000
プレナス	1,900	1,814.00	3,446,600
ミニストップ	1,400	1,496.00	2,094,400
アークス	3,400	2,035.00	6,919,000
パローホールディングス	3,600	2,009.00	7,232,400
東テク	600	2,090.00	1,254,000
ミスミグループ本社	21,100	2,630.00	55,493,000
藤久	400	807.00	322,800
アルテック	2,200	206.00	453,200
ベルク	800	6,070.00	4,856,000
大 庄	800	1,217.00	973,600
タキヒヨー	800	1,676.00	1,340,800
ファーストリテイリング	2,200	51,930.00	114,246,000
ソフトバンクグループ	132,000	4,668.00	616,176,000
蔵王産業	600	1,427.00	856,200
スズケン	7,100	4,095.00	29,074,500
サンドラッグ	6,300	3,640.00	22,932,000
サックスパー ホールディングス	1,100	531.00	584,100
ジェコス	1,300	879.00	1,142,700
ヤマザワ	400	1,710.00	684,000

やまや	300	2,237.00	671,100	
グローセル	2,500	426.00	1,065,000	
ベルーナ	3,300	502.00	1,656,600	
合計	19,885,400		34,792,997,840	

(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14期中間計算期間(2020年5月9日から2020年11月8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日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第13期 2020年5月8日現在	第14期中間計算期間末 2020年11月8日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	757,517
コール・ローン	37,203,276	41,861,452
親投資信託受益証券	20,648,767,667	18,336,716,839
未収入金	21,672,000	27,275,000
流動資産合計	20,707,642,943	18,406,610,808
資産合計	20,707,642,943	18,406,610,808
負債の部		
流動負債		
未払解約金	22,389,725	54,980,486
未払受託者報酬	6,647,337	5,977,858
未払委託者報酬	27,918,979	23,234,849
未払利息	-	90
その他未払費用	177,186	168,598
流動負債合計	57,133,227	84,361,881
負債合計	57,133,227	84,361,881
純資産の部		
元本等		
元本	15,936,853,293	12,322,752,751
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	4,713,656,423	5,999,496,176
(分配準備積立金)	3,626,059,169	2,573,013,497
元本等合計	20,650,509,716	18,322,248,927
純資産合計	20,650,509,716	18,322,248,927
負債純資産合計	20,707,642,943	18,406,610,808

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第13期中間計算期間 自 2019年5月9日 至 2019年11月8日	第14期中間計算期間 自 2020年5月9日 至 2020年11月8日
営業収益		
受取利息	19	-
有価証券売買等損益	2,626,098,343	2,944,314,172
営業収益合計	2,626,098,362	2,944,314,172
営業費用		
支払利息	9,032	4,635
受託者報酬	6,795,361	5,977,858
委託者報酬	28,540,498	23,234,849
その他費用	186,061	168,598
営業費用合計	35,530,952	29,385,940
営業利益又は営業損失()	2,590,567,410	2,914,928,232
経常利益又は経常損失()	2,590,567,410	2,914,928,232
中間純利益又は中間純損失()	2,590,567,410	2,914,928,232
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()	14,849,766	665,317,701
期首剰余金又は期首欠損金()	6,277,680,996	4,713,656,423
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,902,397,766	555,374,871
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	1,902,397,766	555,374,871
剰余金減少額又は欠損金増加額	553,824,623	1,519,145,649
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	553,824,623	1,519,145,649
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()	10,201,971,783	5,999,496,176

(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14期中間計算期間	
	自 2020年5月9日	至 2020年11月8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13期	第14期中間計算期間末
	2020年5月8日現在	2020年11月8日現在
1. 期首元本額	17,214,615,981円	15,936,853,293円
期中追加設定元本額	5,479,157,635円	1,392,096,144円
期中一部解約元本額	6,756,920,323円	5,006,196,686円
2. 受益権の総数	15,936,853,293口	12,322,752,751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13期	第14期中間計算期間末
	2020年5月8日現在	2020年11月8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13期 2020年5月8日現在	第14期中間計算期間末 2020年11月8日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2958円 (12,958円)	1,4869円 (14,869円)

(参考)

当ファンドは、「MHAM TOPIXマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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。

MHAM TOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2020年11月8日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	592,178,336
株式	39,293,380,800
派生商品評価勘定	21,801,520
未収入金	843,862
未収配当金	382,944,364
差入委託証拠金	43,500,000
流動資産合計	40,334,648,882
資産合計	40,334,648,882
負債の部	
流動負債	
前受金	14,930,000
未払金	1,320
未払解約金	43,094,000
未払利息	1,280
流動負債合計	58,026,600
負債合計	58,026,600
純資産の部	
元本等	
元本	19,743,819,553
剰余金	
剰余金又は欠損金()	20,532,802,729
元本等合計	40,276,622,282
純資産合計	40,276,622,282
負債純資産合計	40,334,648,882

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5月9日 至 2020年11月8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	2020年11月8日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	20,061,470,270円
同期中追加設定元本額	7,459,947,397円
同期中一部解約元本額	7,777,598,114円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	864,954,698円
MHAM TOPIXオープン	4,004,745,108円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	8,988,586,686円
動的パッケージファンド<DC年金>	20,289,119円
コア資産形成ファンド	17,032,177円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	104,126,743円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	3,057,454,140円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,686,630,882円
計	19,743,819,553円
2. 受益権の総数	19,743,819,553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	2020年11月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

2. 時価の算定方法	<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>

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2020年11月8日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	908,060,000	-	929,880,000	21,820,000
合計	908,060,000	-	929,880,000	21,820,000

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	2020年11月8日現在
1口当たり純資産額	2.0400円
(1万口当たり純資産額)	(20,400円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2020年11月30日現在

資産総額	19,077,029,537円
負債総額	46,051,520円
純資産総額(-)	19,030,978,017円
発行済数量	12,096,744,320口
1口当たり純資産額(/)	1.5732円

(参考)

MHAM TOPIXマザーファンド

2020年11月30日現在

資産総額	44,437,419,702円
負債総額	53,500,780円
純資産総額(-)	44,383,918,922円
発行済数量	20,560,847,248口
1口当たり純資産額(/)	2.1587円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2020年11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(2020年11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. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年11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	1,424,219,612,532
追加型株式投資信託	853	14,458,430,616,466
単位型公社債投資信託	34	77,591,955,040
単位型株式投資信託	196	1,282,801,429,704
合計	1,109	17,243,043,613,742

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第35期事業年度（自2019年4月1日至2020年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受け、第36期中間会計期間（自2020年4月1日至2020年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	2,183,889	3,702,906
未払金	5,697,942	4,803,140
未払収益分配金	1,053	966
未払償還金	48,968	9,999
未払手数料	4,883,723	4,582,140
その他未払金	764,196	210,034
未払費用	6,724,986	6,673,320
未払法人税等	3,341,238	4,090,268
未払消費税等	576,632	1,338,183
賞与引当金	1,344,466	1,373,328
役員賞与引当金	48,609	65,290
流動負債計	19,917,766	22,046,438
固定負債		
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
時効後支払損引当金	177,851	174,139
固定負債計	2,073,009	2,293,087
負債合計	21,990,776	24,339,526
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	45,949,372	49,674,383
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	45,826,079	49,551,090
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	14,146,079	17,871,090
株主資本計	67,502,329	71,227,341
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	846,755	7
評価・換算差額等計	846,755	7
純資産合計	68,349,085	71,227,333
負債・純資産合計	90,339,861	95,566,859

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

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

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

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		別途 積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	14,146,079	45,949,372	67,502,329
当期変動額									
剰余金の配当							11,280,000	11,280,000	11,280,000
当期純利益							15,005,011	15,005,011	15,005,011
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,725,011	3,725,011	3,725,011
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第34期(自2018年4月1日至2019年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月20日 定時株主総会	普通株式	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018年6月21日
	A種種類 株式				

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

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

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2020年6月17日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第34期(2019年3月31日現在)

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

第35期(2020年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	32,932,013	32,932,013	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	28,548,165	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	11,487,393	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	4,674,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	2,988	2,988	-
資産計	77,644,787	77,644,787	-
(1) 未払手数料	4,582,140	4,582,140	-
負債計	4,582,140	4,582,140	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第34期(2019年3月31日現在)

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

第35期(2020年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	32,932,013	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	996	994	997	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第34期の貸借対照表計上額4,499,196千円、第35期の貸借対照表計上額5,299,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

2. その他有価証券

第34期(2019年3月31日現在)

(千円)

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

(注)非上場株式(貸借対照表計上額276,764千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第35期(2020年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計			
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	2,988	3,000	11
小計	2,988	3,000	11
合計	2,988	3,000	11

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	1,298,377	1,169,758	-
投資信託	159,526	5,528	1

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	1.00% ~ 4.42%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度104,720千円、当事業年度103,477千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生的主要原因別の内訳

	第34期	第35期
	(2019年3月31日現在)	(2020年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	173,805	221,053
未払事業所税	10,915	10,778
賞与引当金	411,675	420,513
未払法定福利費	80,253	78,439
未払給与	7,961	10,410
受取負担金	138,994	47,781
運用受託報酬	102,490	331,395
資産除去債務	10,152	14,116
減価償却超過額(一括償却資産)	4,569	50,942
減価償却超過額	125,839	82,684
繰延資産償却超過額(税法上)	135,542	323,132
退職給付引当金	580,297	648,821
時効後支払損引当金	54,458	53,321
ゴルフ会員権評価損	7,360	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
その他	29,494	11,532
その他有価証券評価差額金	-	3
繰延税金資産小計	2,069,527	2,508,004
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,069,527	2,508,004
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	321,067	-
繰延税金負債合計	321,067	-
繰延税金資産の純額	1,748,459	2,508,004

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳
 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212,500千円
取得原価		144,212,500千円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん	金額	76,224,837千円
b. 発生原因	被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。	
c. のれんの償却方法及び償却期間	20年間の均等償却	

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額	53,030,000千円
b. 主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030,000千円
c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間	
顧客関連資産	16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

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

(2) 損益計算書項目

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	9,043,138千円	8,954,439千円
経常利益	9,043,138千円	8,954,439千円
税引前当期純利益	9,091,728千円	9,111,312千円
当期純利益	7,489,721千円	7,536,465千円
1株当たり当期純利益	187,243円04銭	188,411円64銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,241,252千円	5,149,555千円

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業 上 の 関 係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,048,352	未払 手数料	915,980
								子会社株式 の取得	1,270,000	-	-
子 会 社	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	10,215,017	未払 手数料	1,670,194

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業 上 の 関 係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	5,793,912	未払 手数料	1,112,061
子 会 社	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	10,294,840	未払 手数料	1,231,431

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2) 子会社株式の取得は、独立した第三者機関により算定された価格を基礎として協議の上、合理的に決定しております。

(注3) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ
(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	1,708,727円13銭	1,780,683円32銭
1株当たり当期純利益金額	352,987円92銭	375,125円27銭

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

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

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
当期純利益金額	14,119,516千円	15,005,011千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	14,119,516千円	15,005,011千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

		第36期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		27,281,363
金銭の信託		25,870,423
有価証券		996
未収委託者報酬		13,747,204
未収運用受託報酬		3,023,356
未収投資助言報酬		304,673
未収収益		24,940
前払費用		757,672
その他		2,912,168
	流動資産計	73,922,799
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	961,771
器具備品	1	237,569
無形固定資産		
ソフトウェア		3,099,921
ソフトウェア仮勘定		556,224
電話加入権		3,931
投資その他の資産		
投資有価証券		261,361
関係会社株式		5,299,196
長期差入保証金		1,295,930
繰延税金資産		2,294,343
その他		793,037
	固定資産計	14,803,286
資産合計		88,726,085

(単位:千円)

	第36期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,297,202
未払金	5,820,782
未払収益分配金	899
未払償還金	19,850
未払手数料	5,549,722
その他未払金	250,310
未払費用	7,902,650
未払法人税等	2,901,506
未払消費税等	824,900
前受収益	20,779
賞与引当金	1,126,713
役員賞与引当金	34,112
流動負債計	19,928,648
固定負債	
退職給付引当金	2,207,043
時効後支払損引当金	156,886
固定負債計	2,363,929
負債合計	22,292,578
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	19,552,957
資本準備金	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479
利益剰余金	44,880,558
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	44,757,265
別途積立金	31,680,000
繰越利益剰余金	13,077,265
株主資本計	66,433,515
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	8
評価・換算差額等計	8
純資産合計	66,433,506
負債・純資産合計	88,726,085

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090
当中間期変動額							
剰余金の配当							12,000,000
中間純利益							7,206,174
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	4,793,825
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	13,077,265

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	49,674,383	71,227,341	7	7	71,227,333
当中間期変動額					
剰余金の配当	12,000,000	12,000,000			12,000,000
中間純利益	7,206,174	7,206,174			7,206,174
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額 合計	4,793,825	4,793,825	0	0	4,793,826
当中間期末残高	44,800,558	66,433,515	8	8	66,433,506

重要な会計方針

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

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

（中間損益計算書関係）

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種類 株式				

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

(金融商品関係)

第36期中間会計期間末(2020年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

2020年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	27,281,363	27,281,363	-
(2) 金銭の信託	25,870,423	25,870,423	-
(3) 未収委託者報酬	13,747,204	13,747,204	-
(4) 未収運用受託報酬	3,023,356	3,023,356	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	2,987	2,987	-
資産計	69,925,335	69,925,335	-
(1) 未払手数料	5,549,722	5,549,722	-
負債計	5,549,722	5,549,722	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

負債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	259,369
関係会社株式	5,299,196

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

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

(有価証券関係)

第36期中間会計期間末

(2020年9月30日現在)

1. 子会社株式

関係会社株式（中間貸借対照表計上額5,299,196千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

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

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2020年4月1日から2020年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451,657千円

うち現金・預金 11,605,537千円

うち金銭の信託 11,792,364千円

b. 負債の額 負債合計 9,256,209千円

うち未払手数料及び未払費用 4,539,592千円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030,000千円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030,000千円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	90,405,440千円
資産合計	90,405,440千円
流動負債	- 千円
固定負債	7,722,834千円
負債合計	7,722,834千円
純資産	82,682,605千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額60,979,870千円及び顧客関連資産の金額32,301,694千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,411,813千円
経常利益	4,411,813千円
税引前中間純利益	4,411,813千円
中間純利益	3,644,417千円
1株当たり中間純利益	91,110円42銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,508,336千円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

第36期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

(1)サービスごとの情報

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,660,837円67銭
1株当たり中間純利益金額	180,154円36銭

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

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36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
中間純利益金額	7,206,174千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	7,206,174千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2020年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
みずほ証券株式会社	125,167	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2020年3月末日現在

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

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。

(7)有価証券届出書第一部「証券情報」(12)その他に記載の「ラップ口座にかかる契約に基づいて、ラップ口座の資金を運用するためのファンド」におけるラップ口座については、目論見書において、各販売会社で用いる固有の名称を記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

2020年5月27日

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

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

(注1) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

令和2年6月19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 山野 浩 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日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）の令和1年5月9日から令和2年5月8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日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）の令和2年5月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

（注1）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年11月26日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

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

中間監査意見

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

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

(注1) 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年12月18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

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日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)の2020年5月9日から2020年11月8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日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)の2020年11月8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(2020年5月9日から2020年11月8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 データは監査の対象には含まれておりません。