

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年2月10日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集(売出) 内国投資信託受益証券に係るファ ンドの名称】	MHAM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時から午後5時までとさせていただきます。（以下同じ。）

（５）【申込手数料】

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】

2022年2月11日から2022年8月9日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

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

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

(9) 【払込期日】

取得申込金額は、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】

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(以下「マザーファンド」ということがあります。)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、配当込み)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、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、基準時(1968年1月4日終値)の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。なお、東証株価指数(TOPIX)は、東証市場再編に伴い、2022年4月4日付で指数の算出要領が変更される予定です。

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

8. 以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

<ファンドの特色>

- ・ 東証株価指数(TOPIX、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指します。
- ・ 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。

* 東証市場再編に伴い、投資対象に関する記載を変更する約款変更を予定しております。約款変更日の2022年4月4日に「東京証券取引所第一部に上場されている株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている(または採用予定の)銘柄」に変更を行う予定です。

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	株式 債券	インデックス型
	海外	不動産投信	
	内外	その他資産 () 資産複合	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 日本	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 年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東)	ファンド・オブ・ファンズ
不動産投信 その他資産 (投資信託証券)	日々 その他	エマージング	対象インデックス
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型	()		日経225 TOPIX その他 ()

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/>）をご覧ください。

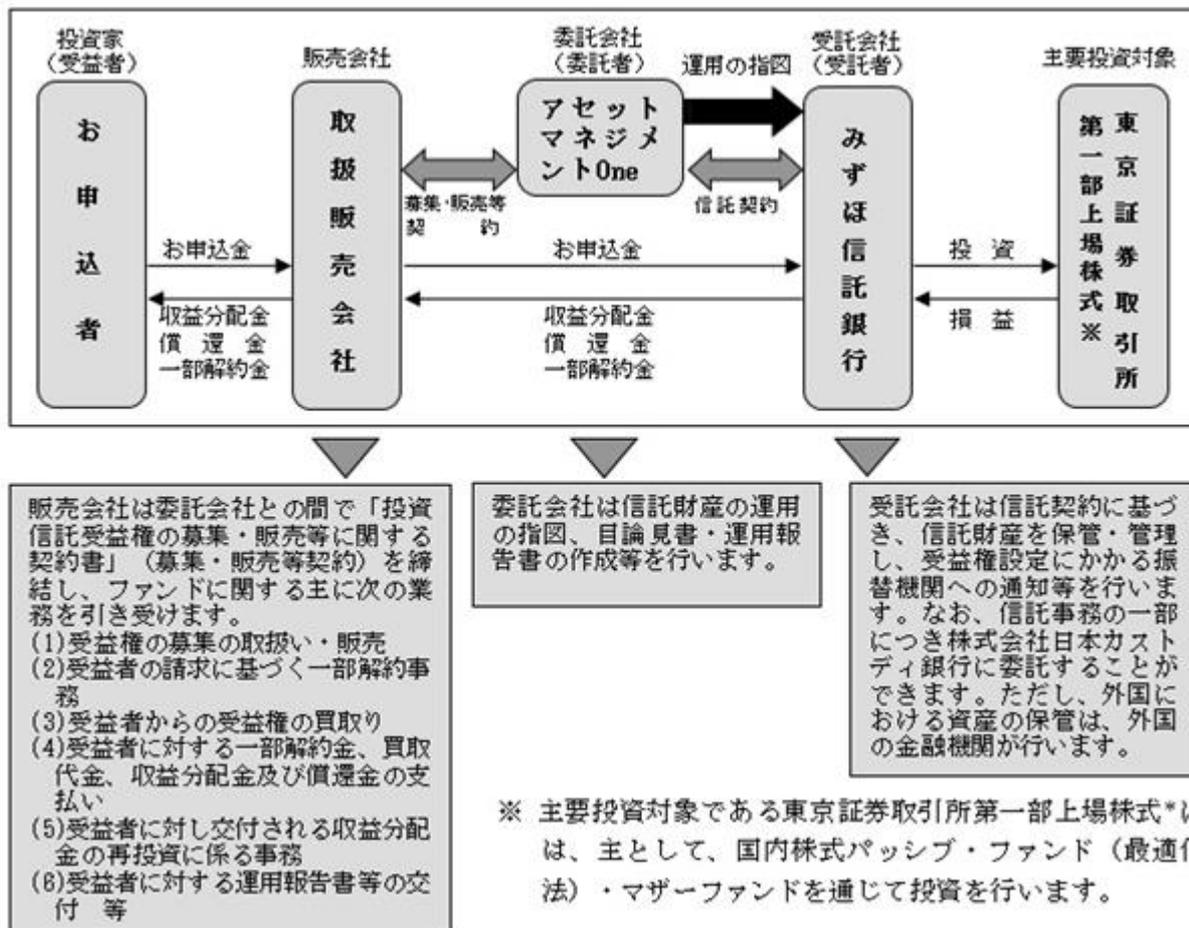
（注3）当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

（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
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

(3) 【ファンドの仕組み】

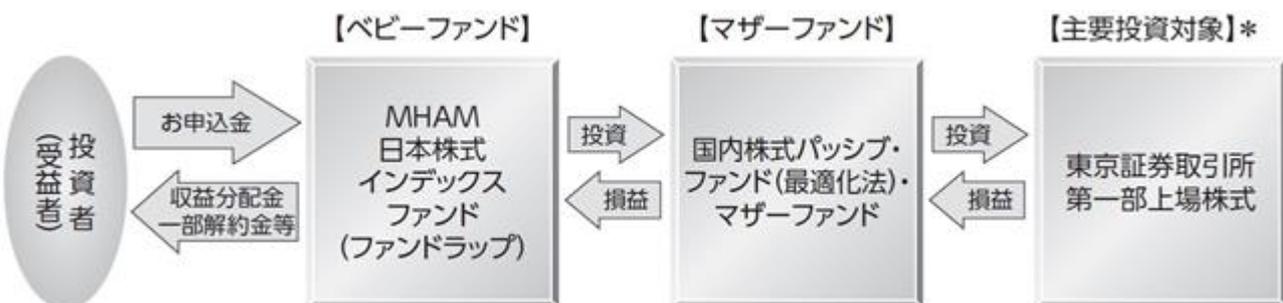
当ファンドの運営の仕組み



ファミリーファンド方式の仕組み

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

ファミリーファンド方式



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

マザーファンドのほかに、株式等に直接投資する場合があります。

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

委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円(2021年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

(2021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、配当込み)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

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

2. 投資態度

a. 主として、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド受益証券に投資を行い、東証株価指数(TOPIX、配当込み)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。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。

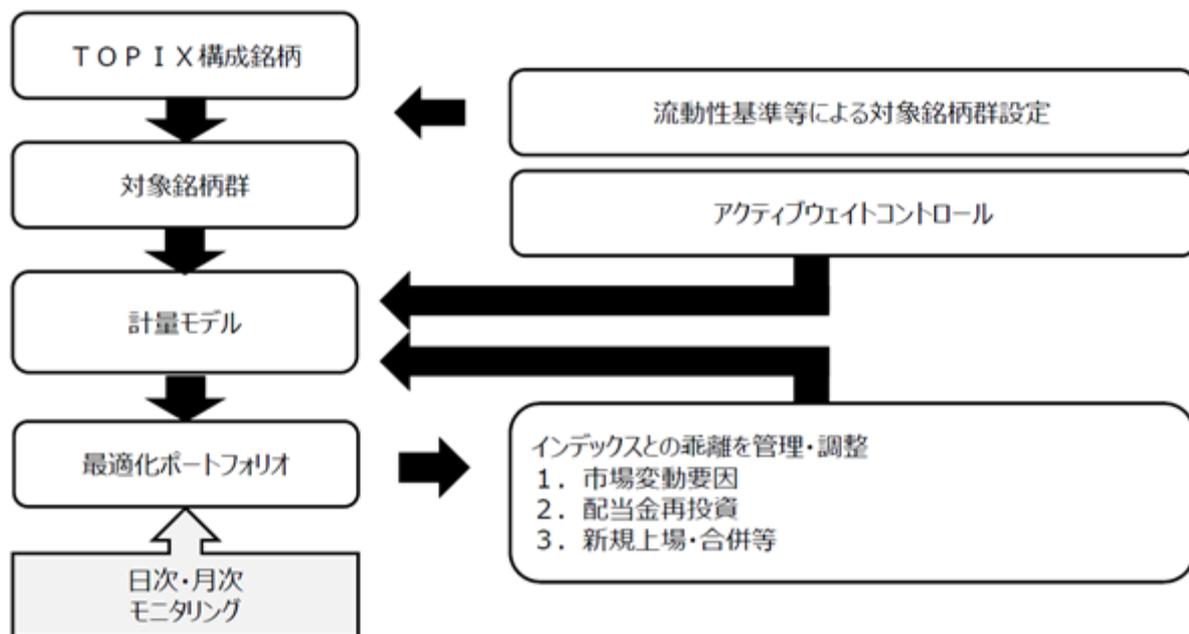
f. 非株式(株式以外の資産)への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

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、主として国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド受益証券への投資を通じ、以下のプロセスにより東京証券取引所第一部上場株式^{*}に投資を行います。



1. 流動性基準等による対象銘柄群設定

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

2. 最適化法によるポートフォリオの構築

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

3. インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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

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

(2) 【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国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドの受益証券(以下「マザーファンド受益証券」といいます。)および次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人が発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)
6. 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。

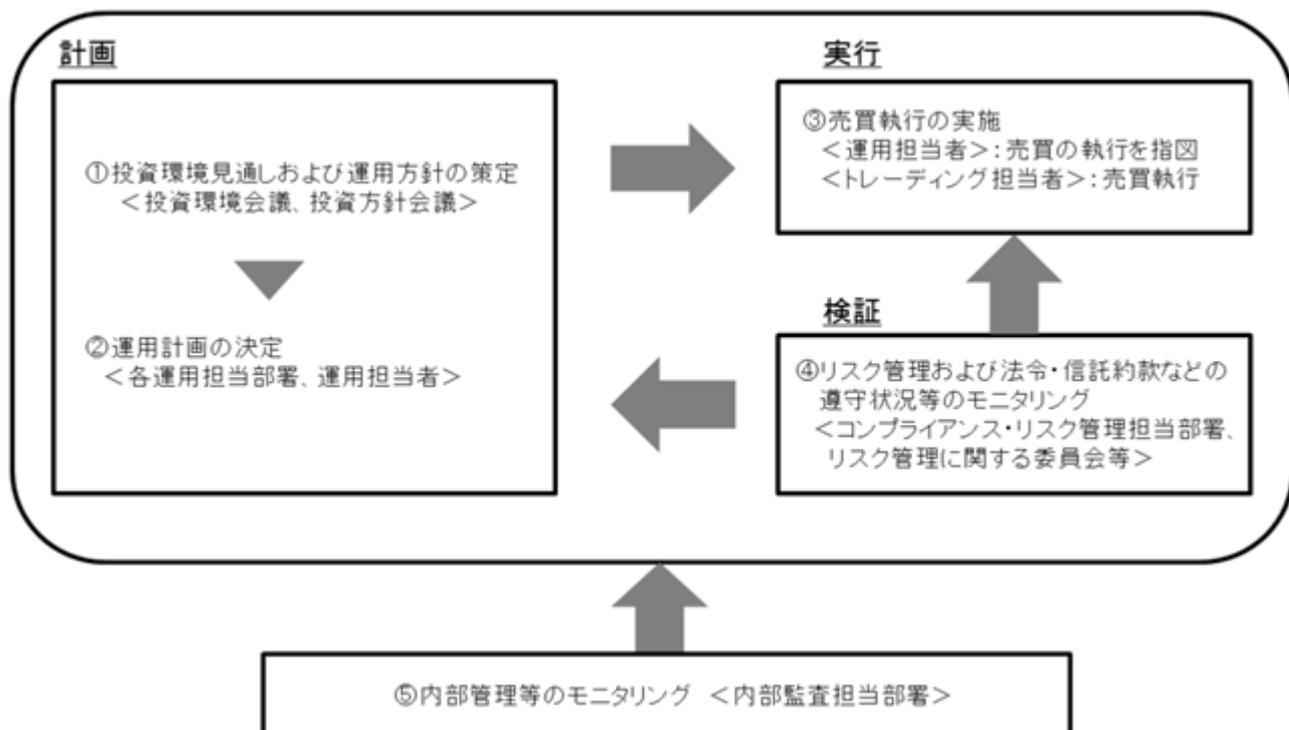
金融商品の指図範囲

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2021年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号ロ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、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ますものとし、
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、
 - 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書に係る取引、選択権付債券売買および商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。）を含みます。以下「デリバティブ取引等」といいます（ただし、この信託において取引可能なものに限り、以下同じ。）。）につ

いて、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

有価証券先物取引等(約款第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たときは、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> 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、市場動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 4) 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
- 5) 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。

(3) 投資制限

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

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

3【投資リスク】

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

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

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

株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

株価変動リスクとは、株式市場および投資先となっている企業の株価が下落するリスクをいいます。当ファンドが投資する企業の株価が下落した場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、当ファンドが投資する企業が業績悪化や倒産等に陥った場合には、当該企業の株価が大きく下落することや無くなることもあり、当ファンドの基準価額に大きな影響を及ぼすことがあります。なお、当ファンドでは、株式と株価指数先物取引等の合計の組入比率を原則として高位に維持するため、株式市場の動向により基準価額は大きく変動します。また、当ファンドでは、追加設定・一部解約に伴う資金の流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>

- ・当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。
- ・有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドに対し、他のペーパ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、配当込み)の動きと連動する投資成果を目指しておりますが、追加設定・一部解約による運用資金の変動、株価指数の構成銘柄の一部を組み入れない場合の影響、銘柄ごとの組入比率が株価指数における構成比率と異なる場合の影響、株価指数先物取引を利用する場合の株価指数と株価指数先物の値動きの差による影響、売買約定価格と取引所終値との差による影響、売買執行に要する費用や信託報酬等が信託財産から支払われることの影響などにより、当ファンドの基準価額の騰落率と、同じ期間におけるベンチマークの騰落率との間に乖離が生じる場合があります。

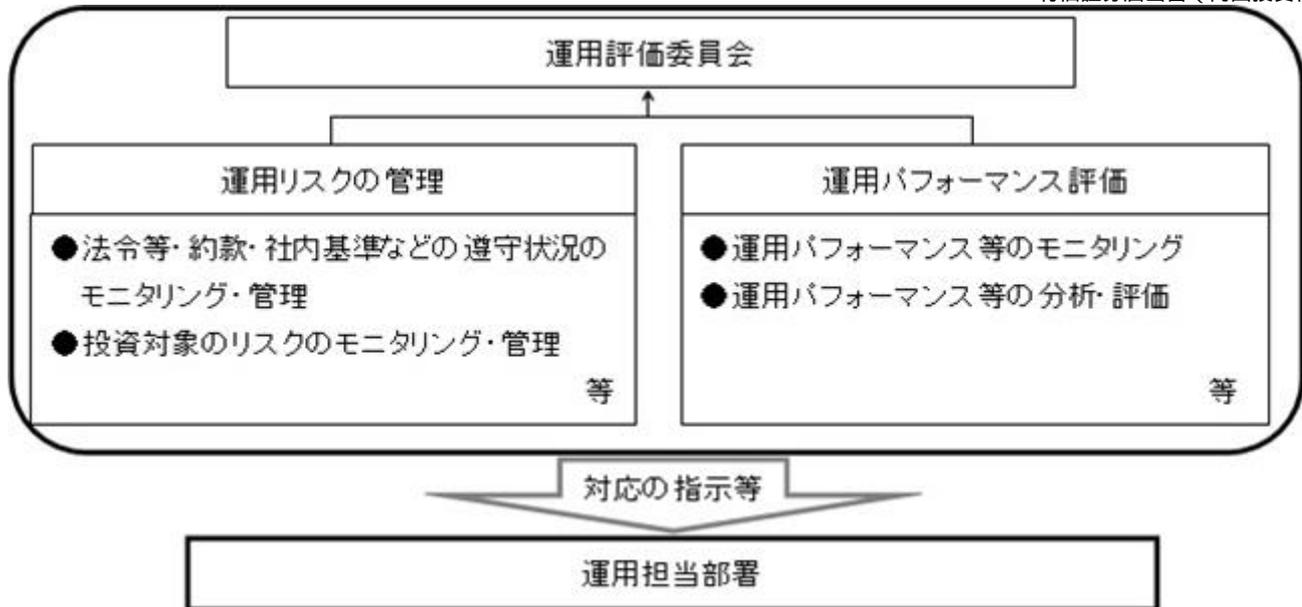
<収益分配金に関する留意点>

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

(2) リスク管理体制

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

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



リスク管理体制は2021年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。

流動性リスク管理体制

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

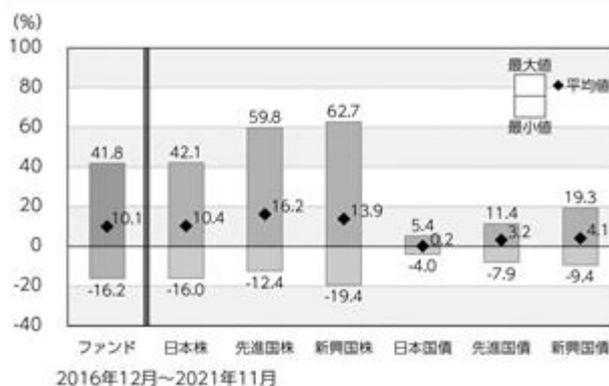
流動性リスク管理体制は2022年1月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンド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、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数は、株式会社東京証券取引所(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、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。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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。

$$\text{信託報酬} = \text{運用期間中の基準価額} \times \text{信託報酬率}$$

< 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、2021年11月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2021年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	22,135,592,701	100.00
内 日本	22,135,592,701	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	819,252	0.00
純資産総額	22,136,411,953	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

MHAM TOPIXマザーファンド

2021年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	60,961,774	100.00
純資産総額	60,961,774	100.00

その他資産の投資状況

2021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）	56,880,000	93.30
内 日本	56,880,000	93.30

（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。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2021年11月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	384,114,626,670	84.81
内 日本	384,114,626,670	84.81
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	68,802,304,124	15.19
純資産総額	452,916,930,794	100.00

その他資産の投資状況

2021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）	4,721,040,000	1.04
内 日本	4,721,040,000	1.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

2021年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	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	6,933,823,693	3.2114 22,267,293,272	3.1886 22,109,190,227	- -	99.88
2	MHAM TOPIXマ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	11,022,157	2.4279 26,761,307	2.3954 26,402,474	- -	0.12

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021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

該当事項はありません。

投資有価証券の種類別投資比率

該当事項はありません。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2021年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	7,363,700	1,773.42 13,058,942,263	2,001.00 14,734,763,700	- -	3.25
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	910,700	11,866.41 10,806,748,623	13,825.00 12,590,427,500	- -	2.78
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	131,700	58,581.74 7,715,215,429	70,330.00 9,262,461,000	- -	2.05
4	リクルートホールディング ス 日本	株式 サービス 業	1,071,600	5,777.42 6,191,088,854	6,901.00 7,395,111,600	- -	1.63
5	三菱UFJフィナンシャ ル・グループ 日本	株式 銀行業	9,195,400	583.54 5,365,901,401	601.40 5,530,113,560	- -	1.22

6	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	92,200	45,389.86 4,184,945,308	59,840.00 5,517,248,000	- -	1.22
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通 信業	1,668,600	2,895.68 4,831,743,720	3,125.00 5,214,375,000	- -	1.15
8	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通 信業	855,400	8,293.53 7,094,289,924	6,030.00 5,158,062,000	- -	1.14
9	HOYA 日本	株式 精密機器	283,700	14,539.90 4,124,971,650	18,020.00 5,112,274,000	- -	1.13
10	日本電産 日本	株式 電気機器	376,800	13,151.70 4,955,564,073	13,000.00 4,898,400,000	- -	1.08
11	日立製作所 日本	株式 電気機器	699,200	5,637.46 3,941,713,366	6,688.00 4,676,249,600	- -	1.03
12	信越化学工業 日本	株式 化学	244,500	18,452.03 4,511,523,489	19,000.00 4,645,500,000	- -	1.03
13	ダイキン工業 日本	株式 機械	185,200	23,406.17 4,334,822,921	23,150.00 4,287,380,000	- -	0.95
14	任天堂 日本	株式 その他製 品	82,100	59,802.34 4,909,772,558	50,100.00 4,113,210,000	- -	0.91
15	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	992,500	3,777.26 3,748,940,242	3,703.00 3,675,227,500	- -	0.81
16	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,072,900	3,201.27 3,434,653,299	3,391.00 3,638,203,900	- -	0.80
17	村田製作所 日本	株式 電気機器	427,000	9,051.58 3,865,026,819	8,380.00 3,578,260,000	- -	0.79
18	本田技研工業 日本	株式 輸送用機 器	1,144,600	3,256.36 3,727,238,705	3,101.00 3,549,404,600	- -	0.78
19	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,142,600	3,640.52 4,159,659,227	3,031.00 3,463,220,600	- -	0.76
20	KDDI 日本	株式 情報・通 信業	1,040,000	3,470.91 3,609,750,638	3,300.00 3,432,000,000	- -	0.76
21	ソフトバンク 日本	株式 情報・通 信業	2,160,700	1,489.02 3,217,336,838	1,562.50 3,376,093,750	- -	0.75
22	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,001,500	3,230.55 3,235,400,480	3,260.00 3,264,890,000	- -	0.72
23	第一三共 日本	株式 医薬品	1,142,400	2,920.55 3,336,437,126	2,824.50 3,226,708,800	- -	0.71
24	S M C 日本	株式 機械	42,600	65,332.99 2,783,185,671	72,650.00 3,094,890,000	- -	0.68
25	オリエンタルランド 日本	株式 サービ ス業	164,200	17,322.41 2,844,340,929	17,840.00 2,929,328,000	- -	0.65
26	三井物産 日本	株式 卸売業	1,111,900	2,284.96 2,540,654,456	2,557.00 2,843,128,300	- -	0.63

27	ファナック 日本	株式 電気機器	127,600	26,437.90 3,373,476,490	22,245.00 2,838,462,000	- -	0.63
28	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	472,200	5,579.87 2,634,815,674	5,708.00 2,695,317,600	- -	0.60
29	デンソー 日本	株式 輸送用機器	320,100	7,226.08 2,313,069,697	8,331.00 2,666,753,100	- -	0.59
30	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,833,700	1,568.33 2,875,848,876	1,402.00 2,570,847,400	- -	0.57

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年11月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	84.81
合計	84.81

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2021年11月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	16.80
情報・通信業		7.31
輸送用機器		6.85
化学		5.76
サービス業		5.44
機械		4.55
卸売業		4.32
医薬品		4.09
銀行業		3.95
小売業		3.56
食料品		2.76
精密機器		2.56
陸運業		2.53
建設業		1.85
その他製品		1.85
保険業		1.62
不動産業		1.59
その他金融業		0.96
電気・ガス業		0.92
ガラス・土石製品		0.66
証券、商品先物取引業		0.62
鉄鋼		0.60
非鉄金属		0.59
ゴム製品		0.56
金属製品		0.54
繊維製品		0.39
海運業		0.36
石油・石炭製品		0.34
空運業		0.32

鉱業	0.19
パルプ・紙	0.17
倉庫・運輸関連業	0.14
水産・農林業	0.07
合計	84.81

(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。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

MHAM TOPIXマザーファンド

2021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 0312月	買建	3	60,615,990	56,880,000	93.30

(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。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2021年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 0312月	買建	249	4,998,402,170	4,721,040,000	1.04

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(2021年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
第14計算期間末 (2021年5月10日)	22,061	22,061	1.7681	1.7681
2020年11月末日	19,030	-	1.5732	-
12月末日	18,369	-	1.6200	-
2021年1月末日	18,140	-	1.6233	-
2月末日	18,452	-	1.6739	-
3月末日	22,364	-	1.7690	-
4月末日	21,494	-	1.7189	-
5月末日	21,599	-	1.7423	-
6月末日	22,011	-	1.7628	-
7月末日	21,857	-	1.7243	-
8月末日	22,651	-	1.7786	-
9月末日	23,332	-	1.8560	-
10月末日	23,017	-	1.8293	-
11月末日	22,136	-	1.7629	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
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
第14計算期間	0.0000
2021年5月11日～2021年11月10日	-

【収益率の推移】

	収益率（％）
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
第14計算期間	36.4
2021年5月11日～2021年11月10日	3.8

（注1）収益率は期間騰落率です。

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

（4）【設定及び解約の実績】

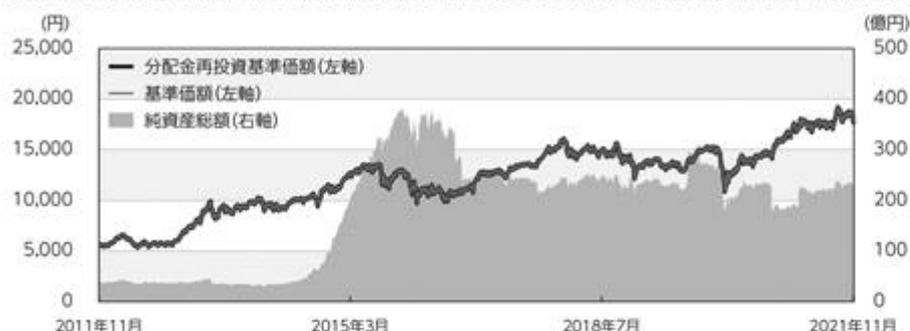
	設定口数	解約口数
第4計算期間	2,755,047,535	2,727,807,935
第5計算期間	3,359,518,776	4,839,867,579
第6計算期間	1,248,985,946	2,655,636,874
第7計算期間	12,620,641,465	1,354,962,285
第8計算期間	3,661,017,401	222,867,697
第9計算期間	18,896,947,423	4,655,481,241
第10計算期間	1,050,077,350	14,973,850,728
第11計算期間	3,135,814,239	5,401,555,184
第12計算期間	3,888,606,333	3,064,145,943
第13計算期間	5,479,157,635	6,756,920,323
第14計算期間	3,489,786,570	6,948,840,767
2021年5月11日～ 2021年11月10日	1,065,239,316	994,048,219

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

参考情報

データの基準日:2021年11月30日

基準価額・純資産の推移 (2011年11月30日～2021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)

2017年 5月	0円
2018年 5月	0円
2019年 5月	0円
2020年 5月	0円
2021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

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約款変更を行いました。以下は2021年11月30日基準日のデータのため、約款変更前の主要な資産の状況です。

■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	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	99.88
2	MHAM TOPIXマザーファンド	0.12

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	84.81
内 日本	84.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	15.19
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)	1.04

株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	16.80
2	情報・通信業	7.31
3	輸送用機器	6.85
4	化学	5.76
5	サービス業	5.44

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	3.25
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.78
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	2.05
4	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.63
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.22
6	東京エレクトロン	株式	日本	電気機器	1.22
7	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.15
8	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.14
9	HOYA	株式	日本	精密機器	1.13
10	日本電産	株式	日本	電気機器	1.08

■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。

資産の状況

資産の種類	比率(%)
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	100.00
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)	93.30

組入銘柄

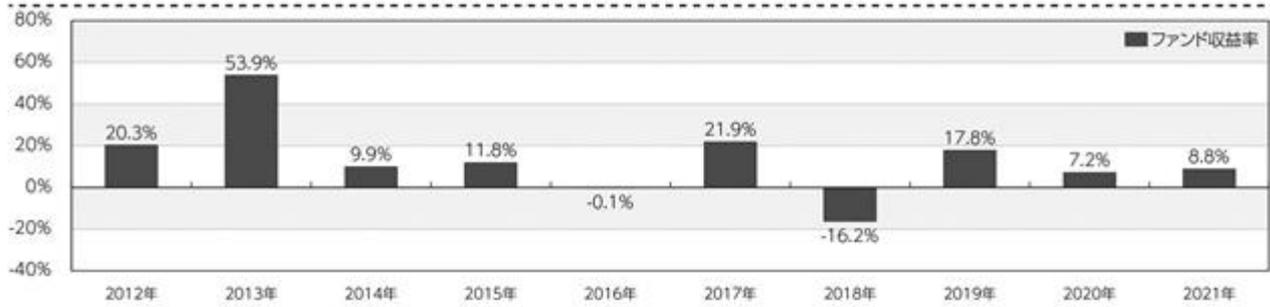
該当事項はありません。

○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。

データの基準日:2021年11月30日

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2021年については年年初から基準日までの収益率を表示しています。

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

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

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

- (5) 解約代金は、受益者の請求を受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付を中止すること、およびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。

ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、前記(4)の規定に準じた価額とします。

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.の変更事項にあっては、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.の併合事項にあっては、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っても、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発送します。
 - 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カ月前までに別段の意思表示のない時は、同一条件にて継続されます。
2. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に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、)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、）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14期計算期間(2020年5月9日から2021年5月10日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【MHAM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13期 2020年5月8日現在	第14期 2021年5月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	37,203,276	16,824,187
親投資信託受益証券	20,648,767,667	22,061,126,691
未収入金	21,672,000	32,073,000
流動資産合計	20,707,642,943	22,110,023,878
資産合計	20,707,642,943	22,110,023,878
負債の部		
流動負債		
未払解約金	22,389,725	33,175,410
未払受託者報酬	6,647,337	4,375,867
未払委託者報酬	27,918,979	10,392,757
その他未払費用	177,186	152,498
流動負債合計	57,133,227	48,096,532
負債合計	57,133,227	48,096,532
純資産の部		
元本等		
元本	15,936,853,293	12,477,799,096
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,713,656,423	9,584,128,250
(分配準備積立金)	3,626,059,169	4,976,592,711
元本等合計	20,650,509,716	22,061,927,346
純資産合計	20,650,509,716	22,061,927,346
負債純資産合計	20,707,642,943	22,110,023,878

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第13期 自 2019年5月9日 至 2020年5月8日	第14期 自 2020年5月9日 至 2021年5月10日
営業収益		
受取利息	19	14
有価証券売買等損益	723,043,650	6,294,802,024
営業収益合計	723,043,631	6,294,802,038
営業費用		
支払利息	15,697	5,868
受託者報酬	13,442,698	10,353,725
委託者報酬	56,459,477	33,627,606
その他費用	363,247	321,096
営業費用合計	70,281,119	44,308,295
営業利益又は営業損失()	793,324,750	6,250,493,743
経常利益又は経常損失()	793,324,750	6,250,493,743
当期純利益又は当期純損失()	793,324,750	6,250,493,743
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()	397,581,427	1,297,519,710
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	2,119,838,559	2,056,535,999
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	2,119,838,559	2,056,535,999
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,492,956,955	2,139,038,205
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,492,956,955	2,139,038,205
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()	4,713,656,423	9,584,128,250

(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14期	
	自 2020年5月9日	至 2021年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年5月8日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を2021年5月10日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第13期	第14期
	2020年5月8日現在	2021年5月10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	3,489,786,570円
期中一部解約元本額	6,756,920,323円	6,948,840,767円
2. 受益権の総数	15,936,853,293口	12,477,799,096口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第13期	第14期
	自 2019年5月9日 至 2020年5月8日	自 2020年5月9日 至 2021年5月10日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(413,305,963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(2,380,872,021円)、信託約款に規定される収益調整金(7,726,958,078円)及び分配準備積立金(2,182,414,727円)より分配対象収益は12,703,550,789円(1万口当たり10,180.92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13期	第14期
	自 2019年5月9日 至 2020年5月8日	自 2020年5月9日 至 2021年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期 2020年5月8日現在	第14期 2021年5月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第13期 2020年5月8日現在	第14期 2021年5月10日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,109,412,648	5,084,142,078
合計	1,109,412,648	5,084,142,078

（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13期 2020年5月8日現在	第14期 2021年5月10日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2958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

2021年5月10日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	MHAM TOPIXマザー ファンド	9,087,254,064	22,061,126,691	
親投資信託受益証券	合計	9,087,254,064	22,061,126,691	
合計			22,061,126,691	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

MHAM TOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年5月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	452,556,673
株式	49,878,530,460
派生商品評価勘定	5,237,360
未収配当金	449,317,294
前払金	8,895,000
差入委託証拠金	36,450,000
流動資産合計	50,830,986,787
資産合計	
50,830,986,787	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,696,550
未払金	481,320
未払解約金	49,345,000
流動負債合計	54,522,870
負債合計	
54,522,870	
純資産の部	
元本等	
元本	20,915,720,167
剰余金	
剰余金又は欠損金()	29,860,743,750
元本等合計	50,776,463,917
純資産合計	
50,776,463,917	
負債純資産合計	
50,830,986,787	

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 2021年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2021年5月10日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	20,061,470,270円
同期中追加設定元本額	11,091,366,560円
同期中一部解約元本額	10,237,116,663円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	864,954,698円
MHAM TOPIXオープン	3,745,654,089円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	9,087,254,064円
動的パッケージファンド＜DC年金＞	29,939,649円
コア資産形成ファンド	24,109,537円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	94,173,437円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	4,180,459,672円
MHAM日本株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	2,889,175,021円
計	20,915,720,167円
2. 受益権の総数	20,915,720,167口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年5月9日 至 2021年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年5月10日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)
株式	801,173,760
合計	801,173,760

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2021年3月11日から2021年5月10日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2021年5月10日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	839,665,000	-	840,220,000	555,000
合計	839,665,000	-	840,220,000	555,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

1. 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2021年5月10日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.4277円 (24,277円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年5月10日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	800	3,005.00	2,404,000	
日本水産	23,500	540.00	12,690,000	
マルハニチロ	3,900	2,662.00	10,381,800	
ハウスイ	100	986.00	98,600	
雪国まいたけ	1,700	1,974.00	3,355,800	
カネコ種苗	700	1,573.00	1,101,100	
サカタのタネ	3,000	3,825.00	11,475,000	
ホクト	2,200	2,030.00	4,466,000	
ホクリヨウ	400	723.00	289,200	
ヒノキヤグループ	600	2,591.00	1,554,600	
ショーボンドホールディングス	3,700	4,660.00	17,242,000	
ミライト・ホールディングス	8,800	1,812.00	15,945,600	
タマホーム	1,600	2,477.00	3,963,200	
サンヨーホームズ	300	766.00	229,800	
日本アクア	900	619.00	557,100	
ファーストコーポレーション	700	779.00	545,300	
ベステラ	600	1,647.00	988,200	
Robot Home	6,100	175.00	1,067,500	
キャンディル	500	541.00	270,500	
スペースバリューホールディングス	3,100	770.00	2,387,000	
住石ホールディングス	4,400	130.00	572,000	

日鉄鉱業	500	6,890.00	3,445,000
三井松島ホールディングス	1,000	990.00	990,000
I N P E X	93,000	813.00	75,609,000
石油資源開発	3,400	2,238.00	7,609,200
K & O エナジーグループ	1,200	1,447.00	1,736,400
ダイセキ環境ソリューション	600	977.00	586,200
第一カッター興業	600	1,416.00	849,600
明豊ファシリティワークス	800	789.00	631,200
安藤・間	16,200	861.00	13,948,200
東急建設	7,400	585.00	4,329,000
コムシスホールディングス	9,000	3,580.00	32,220,000
ビーアールホールディングス	3,000	577.00	1,731,000
高松コンストラクショングループ	1,700	2,076.00	3,529,200
東建コーポレーション	700	9,930.00	6,951,000
ソネック	200	936.00	187,200
ヤマウラ	1,000	924.00	924,000
オリエンタル白石	8,500	300.00	2,550,000
大成建設	18,200	4,230.00	76,986,000
大林組	58,300	1,041.00	60,690,300
清水建設	54,700	935.00	51,144,500
飛鳥建設	1,800	1,135.00	2,043,000
長谷工コーポレーション	19,100	1,536.00	29,337,600
松井建設	2,300	726.00	1,669,800
銭高組	200	4,530.00	906,000
鹿島建設	42,700	1,583.00	67,594,100
不動テトラ	1,500	1,907.00	2,860,500
大末建設	700	974.00	681,800
鉄建建設	1,200	1,868.00	2,241,600
西松建設	4,100	2,944.00	12,070,400
三井住友建設	14,100	486.00	6,852,600
大豊建設	1,300	3,985.00	5,180,500
前田建設工業	14,600	981.00	14,322,600
佐田建設	1,500	436.00	654,000
ナカノフドー建設	1,500	385.00	577,500
奥村組	3,200	2,783.00	8,905,600
東鉄工業	2,500	2,603.00	6,507,500
イチケン	400	1,934.00	773,600
富士ピー・エス	700	591.00	413,700
浅沼組	700	4,535.00	3,174,500
戸田建設	24,300	811.00	19,707,300
熊谷組	2,700	3,140.00	8,478,000
北野建設	300	2,420.00	726,000
植木組	400	1,541.00	616,400
矢作建設工業	2,600	802.00	2,085,200
ピーエス三菱	2,000	661.00	1,322,000
日本ハウスホールディングス	4,800	333.00	1,598,400
大東建託	6,300	11,630.00	73,269,000
新日本建設	2,500	866.00	2,165,000
N I P P O	4,800	2,914.00	13,987,200
東亜道路工業	300	4,495.00	1,348,500

前田道路	3,700	2,193.00	8,114,100	
日本道路	500	8,030.00	4,015,000	
東亜建設工業	1,700	2,487.00	4,227,900	
日本国土開発	5,700	608.00	3,465,600	
若築建設	1,000	1,304.00	1,304,000	
東洋建設	6,500	593.00	3,854,500	
五洋建設	24,800	883.00	21,898,400	
世紀東急工業	2,800	889.00	2,489,200	
福田組	600	4,985.00	2,991,000	
日本ドライケミカル	400	1,735.00	694,000	
住友林業	13,700	2,450.00	33,565,000	
日本基礎技術	1,900	519.00	986,100	
バコーボレーション	2,600	390.00	1,014,000	
大和ハウス工業	53,900	3,421.00	184,391,900	
ライト工業	3,400	1,798.00	6,113,200	
積水ハウス	63,300	2,318.00	146,729,400	
日特建設	1,600	801.00	1,281,600	
北陸電気工事	900	1,140.00	1,026,000	
ユアテック	3,400	793.00	2,696,200	
日本リーテック	1,200	1,806.00	2,167,200	
四電工	300	3,295.00	988,500	
中電工	2,700	2,369.00	6,396,300	
関電工	9,500	955.00	9,072,500	
きんでん	12,600	1,854.00	23,360,400	
東京エネシス	2,000	970.00	1,940,000	
トーエネック	500	3,845.00	1,922,500	
住友電設	1,700	2,339.00	3,976,300	
日本電設工業	3,200	1,801.00	5,763,200	
協和エクシオ	8,900	2,995.00	26,655,500	
新日本空調	1,600	2,253.00	3,604,800	
日本工営	1,000	3,095.00	3,095,000	
九電工	4,000	3,810.00	15,240,000	
三機工業	4,100	1,413.00	5,793,300	
日揮ホールディングス	19,500	1,297.00	25,291,500	
中外炉工業	600	2,167.00	1,300,200	
ヤマト	1,900	698.00	1,326,200	
太平電業	1,300	2,704.00	3,515,200	
高砂熱学工業	5,200	1,695.00	8,814,000	
三晃金属工業	200	2,684.00	536,800	
NEC ネットエスアイ	6,000	1,893.00	11,358,000	
朝日工業社	400	2,915.00	1,166,000	
明星工業	3,800	793.00	3,013,400	
大気社	2,800	3,015.00	8,442,000	
ダイダン	1,300	2,793.00	3,630,900	
日比谷総合設備	2,000	1,925.00	3,850,000	
ニッポン	5,400	1,610.00	8,694,000	
日清製粉グループ本社	21,000	1,844.00	38,724,000	
日東富士製粉	100	7,180.00	718,000	
昭和産業	1,700	3,025.00	5,142,500	
鳥越製粉	1,700	818.00	1,390,600	

中部飼料	2,300	1,410.00	3,243,000
フィード・ワン	2,500	885.00	2,212,500
東洋精糖	300	1,211.00	363,300
日本甜菜製糖	900	1,634.00	1,470,600
D M三井製糖ホールディングス	1,600	1,859.00	2,974,400
塩水港精糖	2,300	237.00	545,100
日新製糖	800	1,795.00	1,436,000
L I F U L L	6,500	409.00	2,658,500
ミクシィ	4,500	2,706.00	12,177,000
ジェイエイシーリクルートメント	1,200	1,792.00	2,150,400
日本M&Aセンター	29,200	2,771.00	80,913,200
メンバーズ	500	2,976.00	1,488,000
中広	200	349.00	69,800
UTグループ	2,600	3,720.00	9,672,000
アイティメディア	600	1,993.00	1,195,800
タケエイ	2,100	1,284.00	2,696,400
E・Jホールディングス	600	1,135.00	681,000
夢真ビーネックスグループ	2,400	1,428.00	3,427,200
コシダカホールディングス	4,700	567.00	2,664,900
アルトナー	400	813.00	325,200
パソナグループ	2,000	1,941.00	3,882,000
C D S	400	1,568.00	627,200
リンクアンドモチベーション	3,400	690.00	2,346,000
G C A	2,400	850.00	2,040,000
エス・エム・エス	6,000	3,060.00	18,360,000
サニーサイドアップグループ	700	756.00	529,200
パーソルホールディングス	17,800	2,118.00	37,700,400
リニカル	900	741.00	666,900
クックパッド	5,500	282.00	1,551,000
エスクリ	700	421.00	294,700
アイ・ケイ・ケイ	800	670.00	536,000
森永製菓	4,400	3,750.00	16,500,000
中村屋	400	3,850.00	1,540,000
江崎グリコ	5,100	4,245.00	21,649,500
名糖産業	800	1,529.00	1,223,200
井村屋グループ	1,000	2,501.00	2,501,000
不二家	1,200	2,180.00	2,616,000
山崎製パン	14,000	1,755.00	24,570,000
第一屋製パン	300	959.00	287,700
モロゾフ	300	5,350.00	1,605,000
亀田製菓	1,000	4,680.00	4,680,000
寿スピリッツ	1,900	6,490.00	12,331,000
カルビー	8,500	2,676.00	22,746,000
森永乳業	3,500	6,280.00	21,980,000
六甲バター	1,300	1,631.00	2,120,300
ヤクルト本社	12,900	5,550.00	71,595,000
明治ホールディングス	12,300	6,930.00	85,239,000
雪印メグミルク	4,500	2,281.00	10,264,500
プリマハム	2,700	3,345.00	9,031,500
日本ハム	7,200	4,830.00	34,776,000

丸大食品	1,900	1,721.00	3,269,900	
S Foods	1,800	3,315.00	5,967,000	
柿安本店	600	2,563.00	1,537,800	
伊藤ハム米久ホールディングス	11,900	733.00	8,722,700	
学情	600	1,375.00	825,000	
スタジオアリス	800	2,400.00	1,920,000	
クロスキャット	400	1,022.00	408,800	
シミックホールディングス	800	1,577.00	1,261,600	
エプコ	400	981.00	392,400	
システナ	6,500	2,280.00	14,820,000	
N J S	400	2,013.00	805,200	
デジタルアーツ	1,000	8,740.00	8,740,000	
日鉄ソリューションズ	2,800	3,325.00	9,310,000	
総合警備保障	7,000	4,875.00	34,125,000	
キューブシステム	900	1,099.00	989,100	
いちご	22,600	349.00	7,887,400	
エイジア	300	1,927.00	578,100	
日本駐車場開発	18,100	159.00	2,877,900	
コア	700	1,504.00	1,052,800	
カカクコム	13,200	2,882.00	38,042,400	
アイロムグループ	600	2,364.00	1,418,400	
セントケア・ホールディング	1,300	1,194.00	1,552,200	
サイネックス	300	666.00	199,800	
ルネサンス	1,600	1,161.00	1,857,600	
ディップ	2,800	3,230.00	9,044,000	
S B Sホールディングス	1,500	2,816.00	4,224,000	
デジタルホールディングス	1,300	1,931.00	2,510,300	
新日本科学	2,200	733.00	1,612,600	
キャリアデザインセンター	400	1,069.00	427,600	
ベネフィット・ワン	6,400	2,742.00	17,548,800	
エムスリー	31,400	7,462.00	234,306,800	
ツカダ・グローバルホールディング	1,900	347.00	659,300	
アウトソーシング	10,300	1,904.00	19,611,200	
ウェルネット	2,100	521.00	1,094,100	
ワールドホールディングス	600	2,781.00	1,668,600	
ディー・エヌ・エー	7,500	2,100.00	15,750,000	
博報堂D Yホールディングス	24,800	1,838.00	45,582,400	
ぐるなび	3,400	592.00	2,012,800	
タカミヤ	2,200	524.00	1,152,800	
ジャパンベストレスキューシステム	1,500	730.00	1,095,000	
ファンコミュニケーションズ	4,900	398.00	1,950,200	
ライク	400	2,315.00	926,000	
ビジネス・ブレークスルー	700	449.00	314,300	
エスプール	4,700	958.00	4,502,600	
W D Bホールディングス	800	2,357.00	1,885,600	
手間いらず	200	5,570.00	1,114,000	
ティア	1,000	491.00	491,000	
C D G	200	1,594.00	318,800	
アドウェイズ	2,200	861.00	1,894,200	
バリューコマース	1,200	3,350.00	4,020,000	

インフォマート	18,000	900.00	16,200,000	
サッポロホールディングス	6,300	2,240.00	14,112,000	
アサヒグループホールディングス	40,800	4,741.00	193,432,800	
麒麟ホールディングス	79,300	2,082.00	165,102,600	
宝ホールディングス	13,800	1,472.00	20,313,600	
オエノンホールディングス	5,300	393.00	2,082,900	
養命酒製造	500	1,859.00	929,500	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	14,200	1,831.00	26,000,200	
サントリー食品インターナショナル	12,500	3,775.00	47,187,500	
ダイトーグループホールディングス	1,000	5,250.00	5,250,000	
伊藤園	5,700	6,240.00	35,568,000	
キーコーヒー	1,900	2,089.00	3,969,100	
ユニカフェ	500	1,005.00	502,500	
ジャパンフーズ	200	1,209.00	241,800	
日清オイリオグループ	2,400	3,135.00	7,524,000	
不二製油グループ本社	4,500	2,842.00	12,789,000	
かどや製油	200	4,160.00	832,000	
J-オイルミルズ	1,700	1,891.00	3,214,700	
ローソン	4,600	5,100.00	23,460,000	
サンエー	1,500	4,310.00	6,465,000	
カワチ薬品	1,300	2,396.00	3,114,800	
エービーシー・マート	2,900	5,990.00	17,371,000	
ハードオフコーポレーション	800	795.00	636,000	
高千穂交易	700	1,121.00	784,700	
アスクル	1,700	3,875.00	6,587,500	
ゲオホールディングス	2,500	1,208.00	3,020,000	
アダストリア	2,600	1,888.00	4,908,800	
ジーフット	1,500	412.00	618,000	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	300	396.00	118,800	
オルバヘルスケアホールディングス	300	1,723.00	516,900	
伊藤忠食品	400	5,090.00	2,036,000	
くら寿司	2,000	3,900.00	7,800,000	
キャンドゥ	800	2,168.00	1,734,400	
エレマテック	1,600	1,215.00	1,944,000	
アイケイ	400	826.00	330,400	
パルグループホールディングス	1,800	1,592.00	2,865,600	
JALUX	600	1,633.00	979,800	
エディオン	7,700	1,188.00	9,147,600	
あらた	1,600	4,600.00	7,360,000	
サーラコーポレーション	3,800	618.00	2,348,400	
ワッツ	800	902.00	721,600	
トーマンデバイス	200	4,160.00	832,000	
ハローズ	600	3,010.00	1,806,000	
J Pホールディングス	5,000	317.00	1,585,000	
フジオフードグループ本社	1,800	1,447.00	2,604,600	
あみやき亭	400	2,864.00	1,145,600	
東京エレクトロン デバイス	600	6,610.00	3,966,000	
フィールズ	2,000	525.00	1,050,000	
双日	101,300	343.00	34,745,900	

アルフレッサ ホールディングス	18,900	2,048.00	38,707,200
大黒天物産	600	8,690.00	5,214,000
ハニーズホールディングス	1,600	1,076.00	1,721,600
ファーマライズホールディングス	400	782.00	312,800
キッコーマン	13,400	6,920.00	92,728,000
味の素	44,500	2,322.50	103,351,250
ブルドックソース	800	2,326.00	1,860,800
キュービー	10,500	2,604.00	27,342,000
ハウス食品グループ本社	6,900	3,495.00	24,115,500
カゴメ	7,600	3,215.00	24,434,000
焼津水産化学工業	800	986.00	788,800
アリアケジャパン	1,800	6,680.00	12,024,000
ピエトロ	200	1,780.00	356,000
エバラ食品工業	400	2,677.00	1,070,800
やまみ	200	2,143.00	428,600
ニチレイ	8,900	2,824.00	25,133,600
横浜冷凍	4,800	895.00	4,296,000
東洋水産	9,600	4,555.00	43,728,000
イートアンドホールディングス	600	1,852.00	1,111,200
大冷	200	1,949.00	389,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,000	826.00	826,000
日清食品ホールディングス	7,300	7,900.00	57,670,000
永谷園ホールディングス	900	2,283.00	2,054,700
一正蒲鉾	700	1,267.00	886,900
フジッコ	2,100	1,942.00	4,078,200
ロック・フィールド	2,100	1,579.00	3,315,900
日本たばこ産業	100,200	2,147.50	215,179,500
ケンコーマヨネーズ	1,200	1,784.00	2,140,800
わらべや日洋ホールディングス	1,200	2,034.00	2,440,800
なとり	1,000	1,931.00	1,931,000
イフジ産業	300	946.00	283,800
ピククルスコーポレーション	400	3,375.00	1,350,000
ファーマフーズ	1,700	3,335.00	5,669,500
北の達人コーポレーション	6,500	492.00	3,198,000
ユーグレナ	8,100	919.00	7,443,900
スター・マイカ・ホールディングス	900	1,110.00	999,000
SREホールディングス	200	5,010.00	1,002,000
ADワークスグループ	3,600	163.00	586,800
片倉工業	2,500	1,462.00	3,655,000
ゲンゼ	1,300	4,055.00	5,271,500
ヒューリック	38,900	1,267.00	49,286,300
ラサ商事	900	903.00	812,700
アルペン	1,500	2,508.00	3,762,000
ハブ	700	655.00	458,500
ラクーンホールディングス	1,300	3,195.00	4,153,500
クオールホールディングス	2,500	1,364.00	3,410,000
アルコニックス	2,000	1,649.00	3,298,000
神戸物産	12,600	2,916.00	36,741,600
ソリトンシステムズ	900	1,772.00	1,594,800
ジンズホールディングス	1,200	7,800.00	9,360,000

ビックカメラ	10,900	1,145.00	12,480,500
DCMホールディングス	11,300	1,091.00	12,328,300
ハイパー	300	559.00	167,700
MonotaRO	26,100	2,550.00	66,555,000
あいホールディングス	2,600	2,242.00	5,829,200
ディービーエックス	500	980.00	490,000
きちりホールディングス	500	576.00	288,000
アークランドサービスホールディングス	1,600	2,287.00	3,659,200
J.フロントリテイリング	21,900	1,050.00	22,995,000
ドトール・日レスホールディングス	3,200	1,649.00	5,276,800
マツモトキヨシホールディングス	7,600	4,455.00	33,858,000
ブロンコビリー	900	2,435.00	2,191,500
ZOZO	10,900	3,595.00	39,185,500
トレジャー・ファクトリー	600	1,160.00	696,000
物語コーポレーション	1,000	6,650.00	6,650,000
ココカラファイン	1,700	7,550.00	12,835,000
三越伊勢丹ホールディングス	32,000	784.00	25,088,000
東洋紡	7,200	1,453.00	10,461,600
ユニチカ	5,300	400.00	2,120,000
富士紡ホールディングス	800	4,540.00	3,632,000
日清紡ホールディングス	11,300	873.00	9,864,900
倉敷紡績	1,800	1,890.00	3,402,000
ダイワボウホールディングス	8,800	1,815.00	15,972,000
シキボウ	1,000	959.00	959,000
日東紡績	2,800	4,025.00	11,270,000
トヨタ紡織	5,400	2,071.00	11,183,400
マクニカ・富士エレホールディングス	4,400	2,331.00	10,256,400
Hamee	400	1,583.00	633,200
ラクト・ジャパン	700	2,893.00	2,025,100
ウエルシアホールディングス	9,600	3,475.00	33,360,000
クリエイトSDホールディングス	2,700	3,400.00	9,180,000
グリムス	400	1,845.00	738,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,200	737.00	2,358,400
八洲電機	1,500	971.00	1,456,500
メディアスホールディングス	1,000	982.00	982,000
レスターホールディングス	2,000	2,037.00	4,074,000
ジューテックホールディングス	400	1,000.00	400,000
丸善CHIホールディングス	2,200	393.00	864,600
大光	700	704.00	492,800
OCHIホールディングス	500	1,295.00	647,500
TOKAIホールディングス	8,900	916.00	8,152,400
黒谷	600	1,202.00	721,200
ミサワ	300	688.00	206,400
ティーライフ	300	1,358.00	407,400
Cominix	300	772.00	231,600
三洋貿易	1,900	1,120.00	2,128,000
チムニー	700	1,255.00	878,500
シュッピン	1,600	1,122.00	1,795,200

ビューティガレージ	300	3,615.00	1,084,500	
オイシックス・ラ・大地	2,400	3,050.00	7,320,000	
ウイン・パートナーズ	1,300	1,014.00	1,318,200	
ネクステージ	3,100	1,762.00	5,462,200	
ジョイフル本田	5,300	1,365.00	7,234,500	
鳥貴族ホールディングス	700	1,632.00	1,142,400	
ホットランド	1,500	1,369.00	2,053,500	
すかいらーくホールディングス	20,500	1,642.00	33,661,000	
SFPホールディングス	1,200	1,324.00	1,588,800	
綿半ホールディングス	1,500	1,305.00	1,957,500	
日本毛織	6,000	1,012.00	6,072,000	
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	2,400	180.00	432,000	
ヨシックス	400	2,009.00	803,600	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,300	1,107.00	5,867,100	
三栄建築設計	700	1,985.00	1,389,500	
野村不動産ホールディングス	11,200	2,818.00	31,561,600	
三重交通グループホールディングス	3,800	492.00	1,869,600	
サムティ	2,600	2,055.00	5,343,000	
ディア・ライフ	2,800	482.00	1,349,600	
コーセーアールイー	700	621.00	434,700	
日本商業開発	1,200	1,743.00	2,091,600	
プレサンスコーポレーション	3,000	1,704.00	5,112,000	
フィル・カンパニー	400	3,035.00	1,214,000	
ハウスコム	300	1,246.00	373,800	
日本管理センター	900	1,286.00	1,157,400	
サンセイランディック	500	849.00	424,500	
エストラスト	200	679.00	135,800	
フージャースホールディングス	3,000	691.00	2,073,000	
オープンハウス	5,800	4,540.00	26,332,000	
東急不動産ホールディングス	49,900	643.00	32,085,700	
飯田グループホールディングス	15,300	2,780.00	42,534,000	
イーグランド	300	942.00	282,600	
ムゲンエステート	1,600	502.00	803,200	
帝国繊維	2,100	2,104.00	4,418,400	
日本コークス工業	15,800	110.00	1,738,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	900	1,492.00	1,342,800	
ミタチ産業	500	689.00	344,500	
B E E N O S	800	3,490.00	2,792,000	
あさひ	1,500	1,490.00	2,235,000	
日本調剤	1,000	1,770.00	1,770,000	
コスモス薬品	1,900	15,790.00	30,001,000	
シップヘルスケアホールディングス	6,400	2,935.00	18,784,000	
トーエル	800	842.00	673,600	
ソフトクリエイイトホールディングス	700	2,511.00	1,757,700	
オンリー	400	465.00	186,000	
セブン&アイ・ホールディングス	71,700	4,703.00	337,205,100	
明治電機工業	600	1,408.00	844,800	
ツルハホールディングス	3,900	13,010.00	50,739,000	

デリカフーズホールディングス	700	629.00	440,300	
スターティアホールディングス	300	1,115.00	334,500	
サンマルクホールディングス	1,900	1,700.00	3,230,000	
フェリシモ	400	1,340.00	536,000	
トリドールホールディングス	4,600	1,754.00	8,068,400	
帝人	17,200	1,876.00	32,267,200	
東レ	132,000	708.10	93,469,200	
クラレ	28,700	1,252.00	35,932,400	
旭化成	120,800	1,207.50	145,866,000	
サカイオーベックス	500	3,080.00	1,540,000	
TOKYO BASE	2,000	736.00	1,472,000	
稲葉製作所	1,000	1,495.00	1,495,000	
宮地エンジニアリンググループ	600	2,348.00	1,408,800	
トーカロ	4,700	1,552.00	7,294,400	
アルファ	600	1,259.00	755,400	
SUMCO	23,600	2,649.00	62,516,400	
川田テクノロジーズ	400	4,375.00	1,750,000	
RS Technologies	600	6,280.00	3,768,000	
ジェイテックコーポレーション	100	2,830.00	283,000	
信和	900	806.00	725,400	
ビーロット	1,000	669.00	669,000	
ファーストブラザーズ	400	1,002.00	400,800	
ハウズドゥ	1,200	1,068.00	1,281,600	
シーアールイー	400	1,475.00	590,000	
プロパティエージェント	300	2,494.00	748,200	
ケイアイスター不動産	500	3,780.00	1,890,000	
アグレ都市デザイン	300	1,009.00	302,700	
グッドコムアセット	900	1,470.00	1,323,000	
ジェイ・エス・ビー	300	3,455.00	1,036,500	
テンポイノベーション	600	886.00	531,600	
住江織物	400	1,996.00	798,400	
日本フェルト	1,000	439.00	439,000	
イチカワ	200	1,334.00	266,800	
日東製網	200	1,548.00	309,600	
芦森工業	300	1,018.00	305,400	
アツギ	1,500	642.00	963,000	
ウイルプラスホールディングス	300	1,320.00	396,000	
JMホールディングス	1,500	2,143.00	3,214,500	
コメダホールディングス	3,900	2,052.00	8,002,800	
サツドラホールディングス	300	2,285.00	685,500	
アレンザホールディングス	1,000	1,230.00	1,230,000	
串カツ田中ホールディングス	600	1,712.00	1,027,200	
バロックジャパンリミテッド	1,700	768.00	1,305,600	
クスリのアオキホールディングス	1,900	7,990.00	15,181,000	
ダイニック	600	814.00	488,400	
共和レザー	900	770.00	693,000	
ピーバンドットコム	300	807.00	242,100	
FOOD & LIFE COMPANIES	10,700	4,725.00	50,557,500	
アセンテック	400	1,464.00	585,600	

セーレン	4,500	1,966.00	8,847,000
ソトー	700	800.00	560,000
東海染工	200	1,125.00	225,000
小松マテーレ	3,000	927.00	2,781,000
ワコールホールディングス	4,500	2,602.00	11,709,000
ホギメディカル	2,500	3,350.00	8,375,000
クラウディアホールディングス	400	286.00	114,400
T S Iホールディングス	6,100	337.00	2,055,700
マツオカコーポレーション	500	1,876.00	938,000
ワールド	2,400	1,459.00	3,501,600
T I S	18,200	2,681.00	48,794,200
J N Sホールディングス	800	545.00	436,000
電算システム	600	3,340.00	2,004,000
グリー	11,200	586.00	6,563,200
G M Oベパボ	100	5,930.00	593,000
コーエーテクモホールディングス	4,000	4,665.00	18,660,000
三菱総合研究所	700	4,140.00	2,898,000
ボルテージ	600	648.00	388,800
電算	200	2,402.00	480,400
A G S	900	805.00	724,500
ファインデックス	1,600	1,205.00	1,928,000
ブレインパッド	400	5,160.00	2,064,000
K L a b	3,400	780.00	2,652,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,500	1,158.00	2,895,000
イーブックイニシアティブジャパン	300	2,722.00	816,600
ネクソン	46,100	3,470.00	159,967,000
アイスタイル	6,400	502.00	3,212,800
エムアップホールディングス	400	2,841.00	1,136,400
エイチーム	1,300	1,632.00	2,121,600
エニグモ	1,800	1,310.00	2,358,000
テクノスジャパン	1,500	658.00	987,000
コロプラ	6,000	814.00	4,884,000
ブロードリーフ	9,000	573.00	5,157,000
クロス・マーケティンググループ	1,000	526.00	526,000
デジタルハーツホールディングス	800	1,589.00	1,271,200
システム情報	1,600	999.00	1,598,400
メディアドゥ	600	5,270.00	3,162,000
じげん	5,200	408.00	2,121,600
ブイキューブ	900	2,828.00	2,545,200
エンカレッジ・テクノロジー	300	655.00	196,500
サイバーリンクス	600	1,639.00	983,400
フィックスターズ	2,200	1,006.00	2,213,200
C A R T A H O L D I N G S	700	1,520.00	1,064,000
オブティム	1,300	2,751.00	3,576,300
セレス	600	3,800.00	2,280,000
S H I F T	800	15,370.00	12,296,000
特種東海製紙	1,000	4,715.00	4,715,000
ティーガイア	2,000	1,929.00	3,858,000
セック	200	2,735.00	547,000

テクマトリックス	2,800	2,076.00	5,812,800	
プロシップ	500	1,412.00	706,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,400	2,111.00	9,288,400	
GMOペイメントゲートウェイ	3,500	13,350.00	46,725,000	
ザッパラス	700	516.00	361,200	
システムリサーチ	500	2,150.00	1,075,000	
インターネットイニシアティブ	4,800	2,436.00	11,692,800	
さくらインターネット	2,000	665.00	1,330,000	
ヴィンクス	500	1,047.00	523,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	400	5,600.00	2,240,000	
SRAホールディングス	900	2,632.00	2,368,800	
システムインテグレータ	500	671.00	335,500	
朝日ネット	1,600	752.00	1,203,200	
eBASE	2,200	990.00	2,178,000	
アバント	2,000	1,647.00	3,294,000	
アドソル日進	600	2,675.00	1,605,000	
ODKソリューションズ	300	844.00	253,200	
フリービット	1,000	925.00	925,000	
コムチュア	1,800	2,607.00	4,692,600	
サイバーコム	300	1,550.00	465,000	
アステリア	1,300	824.00	1,071,200	
アイル	900	1,764.00	1,587,600	
王子ホールディングス	82,100	762.00	62,560,200	
日本製紙	8,100	1,446.00	11,712,600	
三菱製紙	3,400	363.00	1,234,200	
北越コーポレーション	13,300	588.00	7,820,400	
中越パルプ工業	600	1,263.00	757,800	
大王製紙	8,800	1,926.00	16,948,800	
阿波製紙	600	433.00	259,800	
マークラインズ	700	3,210.00	2,247,000	
メディカル・データ・ビジョン	2,100	1,936.00	4,065,600	
gumi	2,600	1,401.00	3,642,600	
ショーケース	500	839.00	419,500	
モバイルファクトリー	500	1,437.00	718,500	
テラスカイ	600	2,783.00	1,669,800	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	800	2,179.00	1,743,200	
PCIホールディングス	600	1,459.00	875,400	
パイプドHD	400	1,673.00	669,200	
アイビーシー	400	996.00	398,400	
ネオジャパン	300	1,773.00	531,900	
PR TIMES	400	3,145.00	1,258,000	
ラクス	5,500	2,068.00	11,374,000	
ランドコンピュータ	300	1,105.00	331,500	
ダブルスタンダード	200	3,580.00	716,000	
オープンドア	1,300	2,073.00	2,694,900	
アカツキ	700	4,035.00	2,824,500	
ベネフィットジャパン	100	1,924.00	192,400	

Ubicomホールディングス	400	3,155.00	1,262,000
カナミックネットワーク	1,800	651.00	1,171,800
ノムラシステムコーポレーション	800	312.00	249,600
レンゴー	18,800	965.00	18,142,000
トーモク	1,000	2,047.00	2,047,000
ザ・バック	1,500	2,832.00	4,248,000
チェンジ	3,400	3,315.00	11,271,000
シンクロ・フード	1,500	378.00	567,000
オークネット	900	1,285.00	1,156,500
キャピタル・アセット・プランニング	200	1,273.00	254,600
セグエグループ	400	1,332.00	532,800
エイトレッド	300	2,617.00	785,100
AOI TYO HOLDINGS	2,400	636.00	1,526,400
マクロミル	4,500	875.00	3,937,500
ビーグリー	300	1,404.00	421,200
オロ	500	3,760.00	1,880,000
ユーザーローカル	300	4,700.00	1,410,000
テモナ	400	906.00	362,400
ニーズウェル	300	635.00	190,500
サインポスト	500	932.00	466,000
昭和電工	13,800	3,670.00	50,646,000
住友化学	143,400	603.00	86,470,200
住友精化	800	3,890.00	3,112,000
日産化学	10,200	5,980.00	60,996,000
ラサ工業	600	2,228.00	1,336,800
クレハ	1,700	7,900.00	13,430,000
多木化学	700	5,890.00	4,123,000
テイカ	1,300	1,427.00	1,855,100
石原産業	3,400	938.00	3,189,200
片倉コープアグリ	400	1,212.00	484,800
日本曹達	2,600	3,365.00	8,749,000
東ソー	28,200	2,038.00	57,471,600
トクヤマ	5,400	2,529.00	13,656,600
セントラル硝子	3,500	2,374.00	8,309,000
東亜合成	11,200	1,249.00	13,988,800
大阪ソーダ	1,900	2,588.00	4,917,200
関東電化工業	4,200	899.00	3,775,800
デンカ	6,600	4,520.00	29,832,000
イビデン	9,000	4,875.00	43,875,000
信越化学工業	33,800	18,575.00	627,835,000
日本カーバイド工業	600	1,351.00	810,600
堺化学工業	1,300	1,955.00	2,541,500
第一稀元素化学工業	1,900	1,400.00	2,660,000
エア・ウォーター	18,600	1,930.00	35,898,000
日本酸素ホールディングス	15,000	2,134.00	32,010,000
日本化学工業	500	2,999.00	1,499,500
東邦アセチレン	300	1,282.00	384,600
日本パーカライジング	9,200	1,086.00	9,991,200
高圧ガス工業	2,900	733.00	2,125,700
チタン工業	200	2,079.00	415,800

四国化成工業	2,500	1,250.00	3,125,000
戸田工業	400	2,153.00	861,200
ステラ ケミファ	900	3,160.00	2,844,000
保土谷化学工業	500	4,470.00	2,235,000
日本触媒	3,400	5,930.00	20,162,000
大日精化工業	1,600	2,376.00	3,801,600
カネカ	4,700	4,465.00	20,985,500
協和キリン	18,800	3,375.00	63,450,000
三菱瓦斯化学	18,200	2,615.00	47,593,000
三井化学	15,800	3,660.00	57,828,000
J S R	18,300	3,365.00	61,579,500
東京応化工業	3,100	7,310.00	22,661,000
大阪有機化学工業	1,800	4,085.00	7,353,000
三菱ケミカルホールディングス	121,900	869.30	105,967,670
K Hネオケム	3,000	2,717.00	8,151,000
ダイセル	24,600	896.00	22,041,600
住友ベークライト	2,900	4,650.00	13,485,000
積水化学工業	38,600	2,004.00	77,354,400
日本ゼオン	16,400	1,751.00	28,716,400
アイカ工業	5,000	4,225.00	21,125,000
宇部興産	9,200	2,333.00	21,463,600
積水樹脂	3,000	2,174.00	6,522,000
タキロンシーアイ	3,900	675.00	2,632,500
旭有機材	1,000	1,448.00	1,448,000
ニチバン	900	1,869.00	1,682,100
リケンテクノス	4,400	553.00	2,433,200
大倉工業	800	1,979.00	1,583,200
積水化成成品工業	2,500	599.00	1,497,500
群栄化学工業	400	2,425.00	970,000
タイガースポリマー	900	489.00	440,100
ミライアル	500	1,354.00	677,000
ダイキアクシス	600	913.00	547,800
ダイキョーニシカワ	3,800	794.00	3,017,200
竹本容器	600	1,003.00	601,800
森六ホールディングス	900	2,136.00	1,922,400
恵和	200	2,526.00	505,200
日本化薬	11,300	1,075.00	12,147,500
カーリットホールディングス	1,900	725.00	1,377,500
E P Sホールディングス	2,400	1,400.00	3,360,000
ソルクシーズ	700	915.00	640,500
レグス	400	2,488.00	995,200
プレステージ・インターナショナル	6,600	744.00	4,910,400
フェイス	500	918.00	459,000
プロトコーポレーション	1,700	1,189.00	2,021,300
アミューズ	900	2,361.00	2,124,900
野村総合研究所	31,700	3,380.00	107,146,000
ドリームインキュベータ	600	1,014.00	608,400
サイバネットシステム	1,300	836.00	1,086,800
クイック	1,000	1,246.00	1,246,000
T A C	900	245.00	220,500

CEホールディングス	900	592.00	532,800	
日本システム技術	300	1,592.00	477,600	
電通グループ	20,000	3,535.00	70,700,000	
インテージホールディングス	2,300	1,370.00	3,151,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,000	844.00	844,000	
東邦システムサイエンス	500	928.00	464,000	
イオンファンタジー	700	2,026.00	1,418,200	
ソースネクスト	9,100	331.00	3,012,100	
シーティーエス	2,100	888.00	1,864,800	
ネクシィーズグループ	700	996.00	697,200	
インフォコム	1,800	2,767.00	4,980,600	
メディカルシステムネットワーク	1,700	715.00	1,215,500	
日本精化	1,300	1,446.00	1,879,800	
扶桑化学工業	1,500	4,280.00	6,420,000	
トリケミカル研究所	1,800	3,655.00	6,579,000	
HEROZ	600	2,783.00	1,669,800	
ラクスル	2,000	4,905.00	9,810,000	
I P S	300	2,509.00	752,700	
F I G	2,000	286.00	572,000	
システムサポート	500	1,520.00	760,000	
A D E K A	8,400	2,184.00	18,345,600	
日油	6,800	6,150.00	41,820,000	
ミヨシ油脂	600	1,230.00	738,000	
新日本理化	3,000	287.00	861,000	
ハリマ化成グループ	1,500	939.00	1,408,500	
イーソル	1,000	1,196.00	1,196,000	
アルテリア・ネットワークス	2,100	1,587.00	3,332,700	
E D U L A B	200	6,330.00	1,266,000	
東海ソフト	200	1,227.00	245,400	
ウイングアーク1st	1,000	2,590.00	2,590,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	2,080.00	832,000	
東名	100	1,132.00	113,200	
ヴィッツ	100	2,073.00	207,300	
トピラシシステムズ	200	1,338.00	267,600	
S a n s a n	1,600	8,660.00	13,856,000	
L i n k - U	100	1,181.00	118,100	
ギフトィ	800	3,140.00	2,512,000	
花王	44,600	6,981.00	311,352,600	
第一工業製薬	600	3,710.00	2,226,000	
石原ケミカル	400	2,128.00	851,200	
日華化学	600	1,232.00	739,200	
ニイタカ	400	2,660.00	1,064,000	
三洋化成工業	1,000	5,400.00	5,400,000	
ベース	100	6,070.00	607,000	
武田薬品工業	154,900	3,730.00	577,777,000	
アステラス製薬	161,400	1,722.00	277,930,800	
大日本住友製薬	13,800	1,954.00	26,965,200	
塩野義製薬	23,300	5,797.00	135,070,100	
わかもと製薬	2,300	332.00	763,600	

日本新薬	5,200	7,410.00	38,532,000	
ビオフェルミン製薬	300	3,025.00	907,500	
中外製薬	58,100	4,171.00	242,335,100	
科研製薬	3,200	4,590.00	14,688,000	
エーザイ	20,500	7,250.00	148,625,000	
理研ビタミン	1,800	1,410.00	2,538,000	
ロート製薬	8,900	2,860.00	25,454,000	
小野薬品工業	42,700	2,880.50	122,997,350	
久光製薬	5,400	6,560.00	35,424,000	
有機合成薬品工業	1,500	292.00	438,000	
持田製薬	2,600	3,940.00	10,244,000	
参天製薬	32,400	1,430.00	46,332,000	
扶桑薬品工業	600	2,477.00	1,486,200	
日本ケミファ	200	2,345.00	469,000	
ツムラ	6,200	3,730.00	23,126,000	
日医工	5,200	973.00	5,059,600	
テルモ	57,000	4,241.00	241,737,000	
H・U・グループホールディングス	4,900	3,655.00	17,909,500	
キッセイ薬品工業	3,400	2,298.00	7,813,200	
生化学工業	3,400	1,040.00	3,536,000	
栄研化学	3,400	2,210.00	7,514,000	
日水製薬	600	990.00	594,000	
鳥居薬品	1,200	2,576.00	3,091,200	
JCRファーマ	5,200	3,060.00	15,912,000	
東和薬品	2,700	2,322.00	6,269,400	
富士製薬工業	1,300	1,224.00	1,591,200	
ゼリア新薬工業	3,500	2,011.00	7,038,500	
第一三共	159,800	2,922.50	467,015,500	
キョーリン製薬ホールディングス	4,000	1,908.00	7,632,000	
大幸薬品	2,300	1,039.00	2,389,700	
ダイト	1,200	3,470.00	4,164,000	
大塚ホールディングス	38,700	4,384.00	169,660,800	
大正製薬ホールディングス	4,400	6,770.00	29,788,000	
ペプチドリーム	9,400	4,870.00	45,778,000	
大日本塗料	2,100	878.00	1,843,800	
日本ペイントホールディングス	75,100	1,753.00	131,650,300	
関西ペイント	20,400	2,814.00	57,405,600	
神東塗料	1,500	210.00	315,000	
中国塗料	4,400	1,004.00	4,417,600	
日本特殊塗料	1,500	1,062.00	1,593,000	
藤倉化成	2,500	551.00	1,377,500	
太陽ホールディングス	1,500	5,490.00	8,235,000	
DIC	7,700	2,945.00	22,676,500	
サカタインクス	3,900	1,086.00	4,235,400	
東洋インキSCホールディングス	3,800	2,090.00	7,942,000	
T&K TOKA	1,500	805.00	1,207,500	
アルプス技研	1,700	2,042.00	3,471,400	
ダイオーズ	300	990.00	297,000	
日本空調サービス	1,900	743.00	1,411,700	
オリエンタルランド	18,900	15,265.00	288,508,500	

フォーカスシステムズ	1,200	929.00	1,114,800
ダスキン	4,000	2,654.00	10,616,000
パーク24	9,800	2,230.00	21,854,000
明光ネットワークジャパン	2,300	589.00	1,354,700
ファルコホールディングス	800	1,698.00	1,358,400
クレスコ	1,300	1,697.00	2,206,100
フジ・メディア・ホールディングス	18,900	1,340.00	25,326,000
ラウンドワン	6,100	1,239.00	7,557,900
リゾートトラスト	8,200	1,698.00	13,923,600
オービック	5,800	19,960.00	115,768,000
ジャストシステム	2,600	6,500.00	16,900,000
TDCソフト	1,700	1,053.00	1,790,100
Zホールディングス	250,900	475.20	119,227,680
ビー・エム・エル	2,300	3,835.00	8,820,500
トレンドマイクロ	9,700	5,350.00	51,895,000
りらいあコミュニケーションズ	2,700	1,334.00	3,601,800
IDホールディングス	600	1,365.00	819,000
リソー教育	9,000	292.00	2,628,000
日本オラクル	3,800	10,850.00	41,230,000
早稲田アカデミー	600	926.00	555,600
アルファシステムズ	500	3,640.00	1,820,000
フューチャー	2,300	2,104.00	4,839,200
CAC Holdings	1,200	1,426.00	1,711,200
SBテクノロジー	600	3,160.00	1,896,000
トーセ	500	801.00	400,500
ユー・エス・エス	19,900	2,001.00	39,819,900
オービックビジネスコンサルタント	1,900	6,340.00	12,046,000
伊藤忠テクノソリューションズ	8,400	3,825.00	32,130,000
アイティフォー	2,400	793.00	1,903,200
東京個別指導学院	1,700	592.00	1,006,400
東計電算	300	4,330.00	1,299,000
サイバーエージェント	43,900	2,190.00	96,141,000
楽天グループ	82,900	1,334.00	110,588,600
エックスネット	300	1,020.00	306,000
クリーク・アンド・リバー社	900	1,581.00	1,422,900
モーニングスター	2,000	461.00	922,000
テー・オー・ダブリュー	3,600	326.00	1,173,600
大塚商会	9,800	5,660.00	55,468,000
サイボウズ	2,200	2,357.00	5,185,400
山田コンサルティンググループ	1,000	1,238.00	1,238,000
セントラルスポーツ	600	2,430.00	1,458,000
パラカ	400	1,700.00	680,000
電通国際情報サービス	2,300	4,015.00	9,234,500
ACCESS	1,800	892.00	1,605,600
デジタルガレージ	3,000	4,605.00	13,815,000
イーエムシステムズ	3,000	825.00	2,475,000
ウェザーニューズ	500	5,420.00	2,710,000
C I J	1,300	869.00	1,129,700
ビジネスエンジニアリング	200	3,495.00	699,000
日本エンタープライズ	1,900	228.00	433,200

WOWOW	800	2,705.00	2,164,000	
スカラ	1,800	759.00	1,366,200	
インテリジェント ウェイブ	1,000	680.00	680,000	
フルキャストホールディングス	1,700	1,979.00	3,364,300	
エン・ジャパン	3,200	3,440.00	11,008,000	
あすか製薬ホールディングス	2,200	1,382.00	3,040,400	
サワイグループホールディングス	4,000	5,330.00	21,320,000	
富士フイルムホールディングス	32,800	7,286.00	238,980,800	
コニカミノルタ	37,700	638.00	24,052,600	
資生堂	37,000	7,920.00	293,040,000	
ライオン	24,300	2,040.00	49,572,000	
高砂香料工業	1,200	2,693.00	3,231,600	
マンダム	3,800	2,062.00	7,835,600	
ミルボン	2,500	5,790.00	14,475,000	
ファンケル	6,700	3,540.00	23,718,000	
コーセー	3,600	16,120.00	58,032,000	
コタ	1,100	1,541.00	1,695,100	
シーボン	200	1,975.00	395,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	8,000	2,871.00	22,968,000	
ノエビアホールディングス	1,700	4,870.00	8,279,000	
アジュバンコスメジャパン	400	1,039.00	415,600	
新日本製薬	300	2,094.00	628,200	
エステー	1,200	1,843.00	2,211,600	
アグロ カネショウ	600	1,485.00	891,000	
コニシ	3,100	1,614.00	5,003,400	
長谷川香料	3,200	2,183.00	6,985,600	
星光PMC	1,000	801.00	801,000	
小林製薬	5,200	9,830.00	51,116,000	
荒川化学工業	1,600	1,273.00	2,036,800	
メック	1,300	2,537.00	3,298,100	
日本高純度化学	500	2,674.00	1,337,000	
タカラバイオ	4,800	2,836.00	13,612,800	
JCU	2,200	4,090.00	8,998,000	
新田ゼラチン	1,200	647.00	776,400	
OATアグリオ	300	1,419.00	425,700	
デクセリアルズ	5,100	2,017.00	10,286,700	
アース製薬	1,500	6,240.00	9,360,000	
北興化学工業	1,800	1,003.00	1,805,400	
大成ラミック	500	2,815.00	1,407,500	
クミアイ化学工業	7,700	899.00	6,922,300	
日本農薬	3,400	576.00	1,958,400	
富士興産	600	1,296.00	777,600	
ニチレキ	2,300	1,414.00	3,252,200	
ユシロ化学工業	1,000	1,150.00	1,150,000	
ビービー・カストロール	600	1,402.00	841,200	
富士石油	4,700	245.00	1,151,500	
MORESCO	600	1,104.00	662,400	
出光興産	20,600	2,808.00	57,844,800	
ENEOSホールディングス	280,000	507.50	142,100,000	
コスモエネルギーホールディングス	5,900	2,603.00	15,357,700	

横浜ゴム	10,900	2,133.00	23,249,700
TOYO TIRE	9,700	2,096.00	20,331,200
ブリヂストン	49,400	4,628.00	228,623,200
住友ゴム工業	16,800	1,408.00	23,654,400
藤倉コンポジット	1,700	493.00	838,100
オカモト	1,200	4,070.00	4,884,000
アキレス	1,300	1,418.00	1,843,400
フコク	800	790.00	632,000
ニッタ	2,000	2,714.00	5,428,000
クリエートメディック	600	1,018.00	610,800
住友理工	3,700	745.00	2,756,500
三ツ星ベルト	2,300	1,728.00	3,974,400
バンドー化学	3,400	754.00	2,563,600
AGC	17,100	5,230.00	89,433,000
日本板硝子	9,900	771.00	7,632,900
石塚硝子	300	1,948.00	584,400
有沢製作所	2,600	970.00	2,522,000
日本山村硝子	700	973.00	681,100
日本電気硝子	6,800	2,794.00	18,999,200
オハラ	900	1,575.00	1,417,500
住友大阪セメント	3,400	3,675.00	12,495,000
太平洋セメント	11,100	2,912.00	32,323,200
リソルホールディングス	200	4,000.00	800,000
日本ヒューム	1,800	729.00	1,312,200
日本コンクリート工業	3,900	406.00	1,583,400
三谷セキサン	800	4,095.00	3,276,000
アジアパイルホールディングス	2,900	523.00	1,516,700
東海カーボン	18,200	1,916.00	34,871,200
日本カーボン	1,000	4,995.00	4,995,000
東洋炭素	1,000	2,274.00	2,274,000
ノリタケカンパニーリミテド	1,000	3,785.00	3,785,000
TOTO	13,300	5,830.00	77,539,000
日本碍子	20,400	2,045.00	41,718,000
日本特殊陶業	14,100	1,708.00	24,082,800
MARUWA	600	11,340.00	6,804,000
品川リフラクトリーズ	400	3,290.00	1,316,000
黒崎播磨	300	4,750.00	1,425,000
ヨータイ	1,300	1,106.00	1,437,800
イソライト工業	800	660.00	528,000
東京窯業	2,400	331.00	794,400
ニッカトー	800	734.00	587,200
フジインコーポレーテッド	1,600	4,655.00	7,448,000
クニミネ工業	500	1,214.00	607,000
エーアンドエーマテリアル	300	1,018.00	305,400
ニチアス	4,700	2,997.00	14,085,900
日本製鉄	87,800	2,281.00	200,271,800
神戸製鋼所	33,700	912.00	30,734,400
中山製鋼所	2,600	489.00	1,271,400
合同製鐵	900	1,902.00	1,711,800

ジェイ エフ イー ホールディングス	53,300	1,725.00	91,942,500	
東京製鐵	7,200	1,189.00	8,560,800	
共英製鋼	2,100	1,526.00	3,204,600	
大和工業	3,800	3,720.00	14,136,000	
東京鐵鋼	700	1,733.00	1,213,100	
大阪製鐵	900	1,407.00	1,266,300	
淀川製鋼所	2,500	2,591.00	6,477,500	
丸一鋼管	6,000	2,899.00	17,394,000	
モリ工業	500	2,727.00	1,363,500	
大同特殊鋼	3,000	6,110.00	18,330,000	
日本高周波鋼業	600	456.00	273,600	
日本冶金工業	1,500	2,494.00	3,741,000	
山陽特殊製鋼	2,300	1,842.00	4,236,600	
愛知製鋼	1,000	3,510.00	3,510,000	
日立金属	17,400	2,130.00	37,062,000	
日本金属	500	1,208.00	604,000	
大平洋金属	1,300	2,565.00	3,334,500	
新日本電工	11,800	407.00	4,802,600	
栗本鐵工所	800	1,750.00	1,400,000	
虹 技	200	1,218.00	243,600	
日本鑄鉄管	200	1,370.00	274,000	
日本製鋼所	5,500	2,787.00	15,328,500	
三菱製鋼	1,500	915.00	1,372,500	
日垂鋼業	2,700	320.00	864,000	
日本精線	200	4,350.00	870,000	
エンビプロ・ホールディングス	700	1,134.00	793,800	
大紀アルミニウム工業所	2,800	1,067.00	2,987,600	
日本軽金属ホールディングス	5,000	2,318.00	11,590,000	
三井金属鉱業	4,900	4,080.00	19,992,000	
東邦亜鉛	1,000	2,592.00	2,592,000	
三菱マテリアル	12,000	2,734.00	32,808,000	
住友金属鉱山	23,600	5,283.00	124,678,800	
DOWAホールディングス	4,600	5,060.00	23,276,000	
古河機械金属	3,000	1,339.00	4,017,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,400	1,071.00	2,570,400	
東邦チタニウム	3,400	1,044.00	3,549,600	
UACJ	2,800	2,884.00	8,075,200	
CKサンエツ	400	3,605.00	1,442,000	
古河電気工業	5,700	3,000.00	17,100,000	
住友電気工業	64,300	1,677.50	107,863,250	
フジクラ	22,200	590.00	13,098,000	
昭和電線ホールディングス	1,900	1,624.00	3,085,600	
東京特殊電線	200	2,614.00	522,800	
タツタ電線	3,200	613.00	1,961,600	
カナレ電気	300	1,788.00	536,400	
平河ヒューテック	900	1,341.00	1,206,900	
リョービ	2,300	1,687.00	3,880,100	
アーレスティ	2,300	502.00	1,154,600	
アサヒホールディングス	7,000	2,359.00	16,513,000	

東洋製罐グループホールディングス	11,600	1,391.00	16,135,600
ホッカシホールディングス	900	1,442.00	1,297,800
コロナ	900	964.00	867,600
横河ブリッジホールディングス	3,100	2,141.00	6,637,100
駒井ハルテック	300	1,987.00	596,100
高田機工	200	2,686.00	537,200
三和ホールディングス	17,400	1,426.00	24,812,400
文化シャッター	5,400	968.00	5,227,200
三協立山	2,400	859.00	2,061,600
アルインコ	1,200	1,038.00	1,245,600
東洋シャッター	400	653.00	261,200
L I X I L	25,400	2,935.00	74,549,000
日本フィルコン	1,300	498.00	647,400
ノーリツ	3,800	1,721.00	6,539,800
長府製作所	1,900	2,041.00	3,877,900
リンナイ	3,600	11,250.00	40,500,000
ユニプレス	3,400	1,110.00	3,774,000
ダイニチ工業	800	835.00	668,000
日東精工	2,400	564.00	1,353,600
三洋工業	200	1,847.00	369,400
岡部	3,800	754.00	2,865,200
ジーテクト	2,300	1,470.00	3,381,000
東プレ	3,500	1,505.00	5,267,500
高周波熱錬	3,600	581.00	2,091,600
東京製綱	1,500	1,100.00	1,650,000
サンコール	1,700	470.00	799,000
モリテックスチール	1,500	451.00	676,500
パイオラックス	2,700	1,517.00	4,095,900
エイチワン	1,900	836.00	1,588,400
日本発条	18,300	817.00	14,951,100
中央発條	800	1,111.00	888,800
アドバネクス	200	1,484.00	296,800
三浦工業	8,000	5,910.00	47,280,000
タクマ	6,200	2,280.00	14,136,000
テクノプロ・ホールディングス	3,600	8,470.00	30,492,000
アトラグループ	500	335.00	167,500
インターワークス	500	390.00	195,000
アイ・アールジャパンホールディングス	700	13,130.00	9,191,000
K e e P e r 技研	1,200	2,308.00	2,769,600
ファーストロジック	300	775.00	232,500
三機サービス	300	1,076.00	322,800
G u n o s y	1,200	1,022.00	1,226,400
デザインワン・ジャパン	600	255.00	153,000
イー・ガーディアン	700	2,786.00	1,950,200
リブセンス	900	231.00	207,900
ジャパンマテリアル	5,400	1,275.00	6,885,000
ベクトル	2,500	958.00	2,395,000
ウチヤマホールディングス	800	378.00	302,400
チャーム・ケア・コーポレーション	1,300	1,263.00	1,641,900

キャリアリンク	500	2,236.00	1,118,000
I B J	1,800	912.00	1,641,600
アサンテ	600	1,823.00	1,093,800
バリューHR	700	1,660.00	1,162,000
M&Aキャピタルパートナーズ	1,600	4,690.00	7,504,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,696.00	1,017,600
E R Iホールディングス	500	588.00	294,000
アビスト	300	3,060.00	918,000
シグマクシス	900	2,139.00	1,925,100
ウィルグループ	1,300	1,018.00	1,323,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,700	253.00	683,100
メドピア	1,400	5,730.00	8,022,000
レアジョブ	200	2,045.00	409,000
リクルートホールディングス	127,400	5,257.00	669,741,800
エラン	2,500	1,372.00	3,430,000
ツガミ	3,800	1,761.00	6,691,800
オークマ	2,200	6,230.00	13,706,000
芝浦機械	2,000	2,718.00	5,436,000
アマダ	26,900	1,235.00	33,221,500
アイダエンジニアリング	4,800	967.00	4,641,600
滝澤鉄工所	500	1,169.00	584,500
F U J I	7,400	2,966.00	21,948,400
牧野フライス製作所	2,200	4,440.00	9,768,000
オーエスジー	9,100	1,862.00	16,944,200
ダイジェット工業	200	1,322.00	264,400
旭ダイヤモンド工業	4,800	540.00	2,592,000
D M G 森精機	11,600	1,813.00	21,030,800
ソディック	3,900	1,078.00	4,204,200
ディスコ	2,500	35,100.00	87,750,000
日東工器	800	1,962.00	1,569,600
日進工具	1,500	1,551.00	2,326,500
パンチ工業	1,600	590.00	944,000
富士ダイス	900	666.00	599,400
土木管理総合試験所	800	406.00	324,800
ネットマーケティング	900	591.00	531,900
日本郵政	134,500	949.40	127,694,300
ベルシステム24ホールディングス	3,000	1,694.00	5,082,000
鎌倉新書	1,900	1,365.00	2,593,500
S M N	400	805.00	322,000
一蔵	200	401.00	80,200
グローバルキッズCOMPANY	300	1,013.00	303,900
エアトリ	1,300	2,246.00	2,919,800
アトラエ	1,000	1,679.00	1,679,000
ストライク	600	4,280.00	2,568,000
ソラスト	4,400	1,410.00	6,204,000
セラク	500	2,311.00	1,155,500
インソース	1,600	2,456.00	3,929,600
豊田自動織機	15,100	9,020.00	136,202,000
豊和工業	900	918.00	826,200

OKK	700	444.00	310,800
東洋機械金属	1,300	531.00	690,300
津田駒工業	300	930.00	279,000
エンシュウ	400	980.00	392,000
島精機製作所	2,900	2,225.00	6,452,500
オプトラン	2,400	2,820.00	6,768,000
NCホールディングス	500	699.00	349,500
イワキ	1,200	1,000.00	1,200,000
フリー	1,900	997.00	1,894,300
ヤマシンフィルタ	3,800	831.00	3,157,800
日阪製作所	2,300	865.00	1,989,500
やまびこ	3,600	1,209.00	4,352,400
平田機工	800	7,270.00	5,816,000
ペガサスマシン製造	2,500	508.00	1,270,000
マルマエ	600	1,754.00	1,052,400
タツモ	700	1,774.00	1,241,800
ナブテスコ	10,900	5,040.00	54,936,000
三井海洋開発	2,300	2,284.00	5,253,200
レオン自動機	1,900	1,232.00	2,340,800
SMC	5,400	65,230.00	352,242,000
ホソカワミクロン	600	6,380.00	3,828,000
ユニオンツール	600	3,545.00	2,127,000
オイレス工業	2,600	1,626.00	4,227,600
日精エー・エス・ピー機械	500	5,230.00	2,615,000
サトーホールディングス	2,500	2,775.00	6,937,500
技研製作所	1,700	4,555.00	7,743,500
日本エアーテック	600	1,203.00	721,800
カワタ	500	935.00	467,500
日精樹脂工業	1,500	1,041.00	1,561,500
オカダアイヨン	500	1,245.00	622,500
ワイエイシイホールディングス	700	967.00	676,900
小松製作所	84,400	3,436.00	289,998,400
住友重機械工業	10,700	3,250.00	34,775,000
日立建機	8,700	3,650.00	31,755,000
日工	2,800	731.00	2,046,800
巴工業	700	2,108.00	1,475,600
井関農機	1,900	1,636.00	3,108,400
TOWA	1,800	2,193.00	3,947,400
丸山製作所	400	1,849.00	739,600
北川鉄工所	800	1,643.00	1,314,400
シンニッタン	2,300	271.00	623,300
ローツェ	800	9,750.00	7,800,000
タカキタ	600	668.00	400,800
クボタ	97,700	2,718.50	265,597,450
荏原実業	400	4,950.00	1,980,000
三菱化工機	600	2,822.00	1,693,200
月島機械	3,500	1,254.00	4,389,000
帝国電機製作所	1,300	1,358.00	1,765,400
東京機械製作所	900	523.00	470,700
新東工業	4,400	778.00	3,423,200

澁谷工業	1,700	3,590.00	6,103,000
アイチコーポレーション	3,200	907.00	2,902,400
小森コーポレーション	4,700	773.00	3,633,100
鶴見製作所	1,500	1,794.00	2,691,000
住友精密工業	300	2,232.00	669,600
日本ギア工業	700	327.00	228,900
酒井重工業	300	2,110.00	633,000
荏原製作所	7,700	4,890.00	37,653,000
石井鐵工所	200	2,949.00	589,800
西島製作所	2,000	887.00	1,774,000
北越工業	2,000	1,109.00	2,218,000
ダイキン工業	23,700	23,115.00	547,825,500
オルガノ	600	7,370.00	4,422,000
トーヨーカネツ	700	2,636.00	1,845,200
栗田工業	10,200	5,020.00	51,204,000
椿本チエイン	2,700	3,040.00	8,208,000
大同工業	800	867.00	693,600
日機装	6,000	1,161.00	6,966,000
木村化工機	1,600	771.00	1,233,600
レイズネクスト	3,100	1,202.00	3,726,200
アネスト岩田	3,100	1,057.00	3,276,700
ダイフク	10,400	11,240.00	116,896,000
サムコ	400	3,255.00	1,302,000
加藤製作所	900	1,089.00	980,100
油研工業	300	1,703.00	510,900
タダノ	9,000	1,170.00	10,530,000
フジテック	6,400	2,592.00	16,588,800
C K D	4,200	2,463.00	10,344,600
キトー	1,700	1,824.00	3,100,800
平和	5,100	1,931.00	9,848,100
理想科学工業	1,500	1,394.00	2,091,000
SANKYO	4,400	2,936.00	12,918,400
日本金銭機械	2,100	602.00	1,264,200
マースグループホールディングス	1,200	1,618.00	1,941,600
フクシマガリレイ	1,300	4,165.00	5,414,500
オーイズミ	700	404.00	282,800
ダイコク電機	800	943.00	754,400
竹内製作所	3,100	3,075.00	9,532,500
アマノ	4,800	2,956.00	14,188,800
JUKI	3,100	863.00	2,675,300
蛇の目ミシン工業	1,800	801.00	1,441,800
ブラザー工業	22,700	2,168.00	49,213,600
マックス	2,600	1,665.00	4,329,000
モリタホールディングス	3,000	1,605.00	4,815,000
グローリー	4,800	2,391.00	11,476,800
新晃工業	1,800	2,376.00	4,276,800
大和冷機工業	3,000	1,120.00	3,360,000
セガサミーホールディングス	17,000	1,604.00	27,268,000
日本ピストンリング	600	1,130.00	678,000
リケン	800	2,395.00	1,916,000

T P R	2,500	1,675.00	4,187,500
ツバキ・ナカシマ	3,800	1,710.00	6,498,000
ホシザキ	5,900	10,240.00	60,416,000
大豊工業	1,600	1,018.00	1,628,800
日本精工	38,200	1,071.00	40,912,200
NTN	43,000	344.00	14,792,000
ジェイテクト	17,900	1,097.00	19,636,300
不二越	1,800	4,360.00	7,848,000
ミネベアミツミ	32,000	2,865.00	91,680,000
日本トムソン	5,100	703.00	3,585,300
THK	11,500	3,875.00	44,562,500
ユーシン精機	1,300	875.00	1,137,500
前澤給装工業	1,200	1,117.00	1,340,400
イーグル工業	2,300	1,200.00	2,760,000
前澤工業	1,000	666.00	666,000
日本ピラー工業	2,000	1,889.00	3,778,000
キッツ	5,800	725.00	4,205,000
日立製作所	89,400	5,384.00	481,329,600
東芝	36,800	4,515.00	166,152,000
三菱電機	186,100	1,696.00	315,625,600
富士電機	11,300	5,150.00	58,195,000
東洋電機製造	800	1,288.00	1,030,400
安川電機	20,000	5,170.00	103,400,000
シンフォニアテクノロジー	2,500	1,520.00	3,800,000
明電舎	3,200	2,419.00	7,740,800
オリジン	500	1,354.00	677,000
山洋電気	900	7,900.00	7,110,000
デンヨー	1,700	2,046.00	3,478,200
ベイカレント・コンサルティング	1,200	34,000.00	40,800,000
Orchestra Holdings	400	2,787.00	1,114,800
アイモバイル	600	1,368.00	820,800
キャリアインデックス	700	602.00	421,400
MS-Japan	800	1,039.00	831,200
船場	300	854.00	256,200
グレイステクノロジー	1,700	2,553.00	4,340,100
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,100	2,242.00	11,434,200
フルテック	200	1,474.00	294,800
GAMewith	500	665.00	332,500
ソウルドアウト	400	1,587.00	634,800
MS&Consulting	300	607.00	182,100
エル・ティー・エス	100	4,445.00	444,500
ミダック	400	5,430.00	2,172,000
日総工産	1,700	776.00	1,319,200
キュービーネットホールディングス	1,000	1,773.00	1,773,000
RPAホールディングス	2,100	765.00	1,606,500
三櫻工業	2,700	1,209.00	3,264,300
マキタ	24,400	5,120.00	124,928,000
東芝テック	2,100	4,430.00	9,303,000

芝浦メカトロニクス	400	6,070.00	2,428,000	
マブチモーター	5,100	4,445.00	22,669,500	
日本電産	44,800	12,490.00	559,552,000	
トレックス・セミコンダクター	1,200	1,846.00	2,215,200	
東光高岳	900	1,434.00	1,290,600	
ダイヘン	2,100	4,930.00	10,353,000	
ヤーマン	3,000	1,512.00	4,536,000	
JVCケンウッド	16,800	236.00	3,964,800	
ミマキエンジニアリング	2,000	679.00	1,358,000	
I-PEX	900	1,980.00	1,782,000	
日新電機	4,800	1,242.00	5,961,600	
大崎電気工業	3,800	613.00	2,329,400	
オムロン	15,500	8,530.00	132,215,000	
日東工業	2,800	1,988.00	5,566,400	
I D E C	2,700	1,736.00	4,687,200	
正興電機製作所	400	1,732.00	692,800	
不二電機工業	300	1,289.00	386,700	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6,600	3,005.00	19,833,000	
サクサホールディングス	400	1,491.00	596,400	
メルコホールディングス	600	4,320.00	2,592,000	
テクノメディカ	400	1,630.00	652,000	
日本電気	23,700	6,350.00	150,495,000	
富士通	16,800	16,775.00	281,820,000	
沖電気工業	7,600	1,197.00	9,097,200	
岩崎通信機	800	922.00	737,600	
電気興業	800	2,586.00	2,068,800	
サンケン電気	2,300	5,060.00	11,638,000	
ナカヨ	300	1,524.00	457,200	
アイホン	1,000	2,085.00	2,085,000	
ルネサスエレクトロニクス	80,000	1,241.00	99,280,000	
セイコーエプソン	23,100	1,891.00	43,682,100	
ワコム	13,500	688.00	9,288,000	
アルパック	3,500	5,040.00	17,640,000	
アクセル	900	1,075.00	967,500	
E I Z O	1,700	4,160.00	7,072,000	
日本信号	4,500	962.00	4,329,000	
京三製作所	3,900	417.00	1,626,300	
能美防災	2,500	2,108.00	5,270,000	
ホーチキ	1,500	1,311.00	1,966,500	
星和電機	900	610.00	549,000	
エレコム	4,400	2,327.00	10,238,800	
パナソニック	198,500	1,290.50	256,164,250	
シャープ	24,800	1,822.00	45,185,600	
アンリツ	11,200	2,236.00	25,043,200	
富士通ゼネラル	5,700	2,916.00	16,621,200	
ソニーグループ	116,600	10,780.00	1,256,948,000	
T D K	9,000	14,820.00	133,380,000	
帝国通信工業	800	1,109.00	887,200	
タムラ製作所	7,700	527.00	4,057,900	
アルプスアルパイン	15,200	1,284.00	19,516,800	

池上通信機	600	888.00	532,800	
鈴木	800	1,204.00	963,200	
日本トリム	400	3,845.00	1,538,000	
ローランド ディー・ジー	1,200	1,867.00	2,240,400	
フォスター電機	2,300	1,194.00	2,746,200	
S M K	400	2,838.00	1,135,200	
ヨコオ	1,500	2,638.00	3,957,000	
ホシデン	5,000	1,089.00	5,445,000	
ヒロセ電機	2,900	15,500.00	44,950,000	
日本航空電子工業	4,500	1,930.00	8,685,000	
T O A	2,200	918.00	2,019,600	
マクセルホールディングス	4,000	1,340.00	5,360,000	
古野電気	2,400	1,117.00	2,680,800	
ユニデンホールディングス	400	2,626.00	1,050,400	
スミダコーポレーション	1,700	1,039.00	1,766,300	
アイコム	700	2,656.00	1,859,200	
リオン	700	2,715.00	1,900,500	
本多通信工業	2,000	510.00	1,020,000	
船井電機	2,700	911.00	2,459,700	
横河電機	18,700	2,066.00	38,634,200	
新電元工業	900	3,610.00	3,249,000	
アズビル	12,500	4,595.00	57,437,500	
東亜ディーケーケー	900	857.00	771,300	
日本光電工業	7,700	3,330.00	25,641,000	
チノー	500	1,369.00	684,500	
共和電業	2,000	385.00	770,000	
日本電子材料	700	2,000.00	1,400,000	
堀場製作所	3,700	7,550.00	27,935,000	
アドバンテスト	13,800	10,200.00	140,760,000	
小野測器	700	527.00	368,900	
エスベック	1,700	1,928.00	3,277,600	
キーエンス	18,300	53,490.00	978,867,000	
日置電機	800	5,400.00	4,320,000	
シスメックス	14,600	11,160.00	162,936,000	
日本マイクロニクス	3,500	1,698.00	5,943,000	
メガチップス	1,900	3,785.00	7,191,500	
O B A R A G R O U P	1,000	3,820.00	3,820,000	
I M A G I C A G R O U P	2,100	503.00	1,056,300	
澤藤電機	200	2,312.00	462,400	
デンソー	40,900	7,274.00	297,506,600	
原田工業	700	904.00	632,800	
コーセル	2,300	1,075.00	2,472,500	
イリソ電子工業	1,700	5,370.00	9,129,000	
オブテックスグループ	3,400	1,732.00	5,888,800	
千代田インテグレ	900	1,830.00	1,647,000	
アイ・オー・データ機器	600	1,104.00	662,400	
レーザーテック	8,200	18,790.00	154,078,000	
スタンレー電気	13,100	3,195.00	41,854,500	
岩崎電気	700	1,509.00	1,056,300	
ウシオ電機	9,500	1,483.00	14,088,500	

岡谷電機産業	1,300	398.00	517,400
ヘリオス テクノ ホールディング	2,300	361.00	830,300
エノモト	600	1,830.00	1,098,000
日本セラミック	2,000	2,768.00	5,536,000
遠藤照明	900	771.00	693,900
古河電池	1,500	1,640.00	2,460,000
双信電機	1,200	508.00	609,600
山一電機	1,300	1,590.00	2,067,000
図研	1,200	2,971.00	3,565,200
日本電子	3,500	6,130.00	21,455,000
カシオ計算機	15,000	1,984.00	29,760,000
ファナック	16,300	26,580.00	433,254,000
日本シイエムケイ	4,600	457.00	2,102,200
エンプラス	800	4,175.00	3,340,000
大真空	600	2,585.00	1,551,000
ローム	7,700	10,600.00	81,620,000
浜松ホトニクス	13,400	6,380.00	85,492,000
三井ハイテック	1,900	4,225.00	8,027,500
新光電気工業	6,200	3,330.00	20,646,000
京セラ	28,400	6,901.00	195,988,400
協栄産業	200	1,375.00	275,000
太陽誘電	8,300	5,000.00	41,500,000
村田製作所	54,700	8,699.00	475,835,300
双葉電子工業	3,800	912.00	3,465,600
日東電工	11,200	9,030.00	101,136,000
北陸電気工業	700	936.00	655,200
東海理化電機製作所	4,900	1,776.00	8,702,400
ニチコン	6,000	1,084.00	6,504,000
日本ケミコン	2,100	1,768.00	3,712,800
K O A	2,700	1,665.00	4,495,500
日立造船	14,800	826.00	12,224,800
三菱重工業	29,200	3,502.00	102,258,400
川崎重工業	14,400	2,807.00	40,420,800
I H I	12,500	2,320.00	29,000,000
名村造船所	7,300	188.00	1,372,400
サノヤスホールディングス	2,300	152.00	349,600
スプリックス	500	1,067.00	533,500
マネジメントソリューションズ	800	1,976.00	1,580,800
プロレド・パートナーズ	200	2,964.00	592,800
and factory	200	703.00	140,600
テノ・ホールディングス	200	1,130.00	226,000
フロンティア・マネジメント	300	1,659.00	497,700
ピアラ	100	1,582.00	158,200
コプロ・ホールディングス	200	1,326.00	265,200
ギークス	300	1,709.00	512,700
カーブスホールディングス	4,900	821.00	4,022,900
フォーラムエンジニアリング	900	1,043.00	938,700
日本車輛製造	600	2,446.00	1,467,600
三菱ロジスネクスト	2,600	1,200.00	3,120,000
近畿車輛	300	1,296.00	388,800

F P G	6,300	742.00	4,674,600
島根銀行	600	724.00	434,400
じもとホールディングス	1,300	713.00	926,900
全国保証	4,800	4,935.00	23,688,000
めぶきフィナンシャルグループ	95,300	249.00	23,729,700
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,000	1,685.00	1,685,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,300	1,254.00	2,884,200
九州フィナンシャルグループ	37,500	442.00	16,575,000
かんぼ生命保険	22,700	2,205.00	50,053,500
ゆうちょ銀行	51,900	1,042.00	54,079,800
富山第一銀行	4,400	291.00	1,280,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	111,800	437.00	48,856,600
西日本フィナンシャルホールディングス	12,100	733.00	8,869,300
マーキュリアインベストメント	700	808.00	565,600
イントラスト	500	660.00	330,000
日本モーゲージサービス	900	1,022.00	919,800
C A S A	500	928.00	464,000
アルヒ	2,900	1,827.00	5,298,300
プレミアグループ	800	2,411.00	1,928,800
日産自動車	219,400	582.40	127,778,560
いすゞ自動車	49,400	1,156.00	57,106,400
トヨタ自動車	188,600	8,506.00	1,604,231,600
日野自動車	23,200	960.00	22,272,000
三菱自動車工業	68,900	311.00	21,427,900
エフテック	1,500	744.00	1,116,000
レシップホールディングス	700	552.00	386,400
G M B	400	962.00	384,800
ファルテック	400	889.00	355,600
武蔵精密工業	4,100	1,968.00	8,068,800
日産車体	2,700	736.00	1,987,200
新明和工業	5,200	1,032.00	5,366,400
極東開発工業	3,200	1,707.00	5,462,400
トビー工業	2,000	1,398.00	2,796,000
ティラド	700	1,968.00	1,377,600
タチエス	2,900	1,185.00	3,436,500
N O K	9,000	1,452.00	13,068,000
フタバ産業	4,600	548.00	2,520,800
K Y B	2,400	3,195.00	7,668,000
市光工業	3,400	714.00	2,427,600
大同メタル工業	3,800	589.00	2,238,200
プレス工業	10,200	337.00	3,437,400
ミクニ	2,400	317.00	760,800
太平洋工業	3,900	1,262.00	4,921,800
河西工業	3,200	472.00	1,510,400
アイシン	13,600	4,320.00	58,752,000
マツダ	58,300	900.00	52,470,000
今仙電機製作所	1,700	740.00	1,258,000

本田技研工業	146,700	3,431.00	503,327,700
スズキ	36,900	4,297.00	158,559,300
S U B A R U	53,400	2,128.00	113,635,200
安永	1,000	1,223.00	1,223,000
ヤマハ発動機	26,300	2,875.00	75,612,500
小糸製作所	11,200	6,990.00	78,288,000
T B K	2,300	416.00	956,800
エクセディ	2,900	1,610.00	4,669,000
豊田合成	6,000	2,713.00	16,278,000
愛三工業	3,700	789.00	2,919,300
盟和産業	300	862.00	258,600
日本プラスト	2,000	588.00	1,176,000
ヨロズ	1,900	1,268.00	2,409,200
エフ・シー・シー	3,000	1,794.00	5,382,000
新家工業	400	1,709.00	683,600
シマノ	6,900	25,205.00	173,914,500
テイ・エス テック	8,500	1,536.00	13,056,000
三十三フィナンシャルグループ	1,700	1,361.00	2,313,700
第四北越フィナンシャルグループ	3,000	2,419.00	7,257,000
ひろぎんホールディングス	27,100	620.00	16,802,000
ダイレクトマーケティングミックス	700	3,485.00	2,439,500
ポピンズホールディングス	300	4,600.00	1,380,000
L I T A L I C O	700	4,620.00	3,234,000
ジャムコ	1,500	910.00	1,365,000
小野建	1,700	1,390.00	2,363,000
はるやまホールディングス	800	669.00	535,200
南陽	300	1,801.00	540,300
ノジマ	3,200	3,265.00	10,448,000
佐島電機	1,200	804.00	964,800
カップ・クリエイト	2,600	1,495.00	3,887,000
エコートレーディング	400	606.00	242,400
伯東	1,000	1,544.00	1,544,000
コンドーテック	1,500	1,031.00	1,546,500
中山福	1,000	475.00	475,000
ライトオン	1,500	705.00	1,057,500
ナガイレーベン	2,500	2,574.00	6,435,000
三菱食品	2,100	3,050.00	6,405,000
良品計画	21,100	2,336.00	49,289,600
三城ホールディングス	2,300	283.00	650,900
松田産業	1,300	2,372.00	3,083,600
第一興商	3,600	4,250.00	15,300,000
メディカルホールディングス	18,300	2,115.00	38,704,500
アドヴァン	1,900	975.00	1,852,500
S P K	700	1,323.00	926,100
萩原電気ホールディングス	600	2,669.00	1,601,400
アルピス	500	2,336.00	1,168,000
アズワン	1,300	13,910.00	18,083,000
スズデン	600	1,346.00	807,600
尾家産業	500	1,227.00	613,500
シモジマ	1,000	1,162.00	1,162,000

ドウシシャ	1,800	1,884.00	3,391,200
小津産業	400	2,151.00	860,400
コナカ	2,600	341.00	886,600
高速	900	1,457.00	1,311,300
ハウス オブ ローゼ	200	1,662.00	332,400
G - 7ホールディングス	1,000	2,873.00	2,873,000
たけびし	600	1,488.00	892,800
イオン北海道	2,500	1,130.00	2,825,000
コジマ	3,100	887.00	2,749,700
ヒマラヤ	600	991.00	594,600
コーナン商事	2,600	3,070.00	7,982,000
ネットワンシステムズ	7,500	3,405.00	25,537,500
エコス	600	1,878.00	1,126,800
ワタミ	3,000	984.00	2,952,000
マルシェ	600	481.00	288,600
リックス	400	1,505.00	602,000
システムソフト	5,000	163.00	815,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	36,600	2,361.00	86,412,600
丸文	1,700	524.00	890,800
西松屋チェーン	4,000	1,733.00	6,932,000
ゼンショーホールディングス	9,800	2,823.00	27,665,400
ハビネット	1,600	1,521.00	2,433,600
幸楽苑ホールディングス	1,500	1,636.00	2,454,000
ハークスレイ	400	914.00	365,600
橋本総業ホールディングス	300	2,622.00	786,600
日本ライフライン	5,900	1,489.00	8,785,100
サイゼリヤ	2,900	2,461.00	7,136,900
タカショー	1,200	762.00	914,400
VTホールディングス	6,800	429.00	2,917,200
マルカ	600	2,150.00	1,290,000
アルゴグラフィックス	1,500	3,075.00	4,612,500
魚力	500	1,902.00	951,000
IDOM	6,200	619.00	3,837,800
日本エム・ディ・エム	1,000	2,250.00	2,250,000
フジ・コーポレーション	1,000	1,316.00	1,316,000
ユナイテッドアローズ	2,600	2,015.00	5,239,000
進和	1,000	2,084.00	2,084,000
エスケイジャパン	400	456.00	182,400
ダイترون	700	2,043.00	1,430,100
ハイデイ日高	2,900	1,736.00	5,034,400
シークス	2,400	1,555.00	3,732,000
京都きもの友禅	1,200	267.00	320,400
コロワイド	6,100	1,862.00	11,358,200
ピーシーデポコーポレーション	2,200	465.00	1,023,000
田中商事	500	667.00	333,500
オーハシテクニカ	900	1,487.00	1,338,300
壱番屋	1,300	4,900.00	6,370,000
白銅	600	1,822.00	1,093,200
PLANT	400	734.00	293,600

スギホールディングス	3,700	8,630.00	31,931,000	
ダイコー通産	200	1,795.00	359,000	
薬王堂ホールディングス	700	2,406.00	1,684,200	
島津製作所	24,000	3,985.00	95,640,000	
JMS	1,700	991.00	1,684,700	
長野計器	1,500	1,241.00	1,861,500	
ブイ・テクノロジー	800	5,520.00	4,416,000	
スター精密	2,900	1,692.00	4,906,800	
東京計器	1,200	1,079.00	1,294,800	
愛知時計電機	200	4,295.00	859,000	
インターアクション	900	2,377.00	2,139,300	
オーバル	1,800	286.00	514,800	
東京精密	3,100	5,260.00	16,306,000	
マニー	7,400	2,562.00	18,958,800	
ニコン	28,400	1,077.00	30,586,800	
トプコン	9,400	1,591.00	14,955,400	
オリンパス	102,900	2,279.00	234,509,100	
理研計器	1,700	2,888.00	4,909,600	
SCREENホールディングス	3,200	10,420.00	33,344,000	
キヤノン電子	1,900	1,787.00	3,395,300	
タムロン	1,600	2,413.00	3,860,800	
HOYA	36,600	13,155.00	481,473,000	
シード	700	720.00	504,000	
ノーリツ鋼機	1,800	2,519.00	4,534,200	
エー・アンド・デイ	1,700	1,355.00	2,303,500	
朝日インテック	19,600	2,968.00	58,172,800	
キヤノン	92,600	2,621.50	242,750,900	
リコー	47,400	1,232.00	58,396,800	
シチズン時計	23,800	392.00	9,329,600	
リズム	500	813.00	406,500	
大研医器	1,600	578.00	924,800	
メニコン	2,900	6,850.00	19,865,000	
シンシア	200	888.00	177,600	
中本パックス	400	1,604.00	641,600	
スノーピーク	1,000	4,165.00	4,165,000	
パラマウントベッドホールディングス	3,700	2,240.00	8,288,000	
トランザクション	900	1,362.00	1,225,800	
粧美堂	500	415.00	207,500	
ニホンフラッシュ	1,700	1,338.00	2,274,600	
前田工織	2,100	3,415.00	7,171,500	
永大産業	2,500	347.00	867,500	
アートネイチャー	1,900	679.00	1,290,100	
バンダイナムコホールディングス	15,400	8,091.00	124,601,400	
アイフイスジャパン	400	743.00	297,200	
共立印刷	3,100	134.00	415,400	
SHOEI	1,700	4,025.00	6,842,500	
フランスベッドホールディングス	2,400	931.00	2,234,400	
マーベラス	2,900	821.00	2,380,900	
パイロットコーポレーション	3,400	3,585.00	12,189,000	
萩原工業	1,000	1,454.00	1,454,000	

エイベックス	3,500	1,501.00	5,253,500
トッパン・フォームズ	3,400	1,155.00	3,927,000
フジシールインターナショナル	3,800	2,479.00	9,420,200
タカラトミー	8,400	965.00	8,106,000
廣済堂	1,300	1,026.00	1,333,800
エステールホールディングス	500	627.00	313,500
レック	2,300	1,177.00	2,707,100
タカノ	600	641.00	384,600
三光合成	2,000	451.00	902,000
プロネクサス	1,700	1,169.00	1,987,300
ホクシン	1,200	249.00	298,800
ウッドワン	600	1,684.00	1,010,400
大建工業	1,300	2,125.00	2,762,500
きもと	2,900	277.00	803,300
凸版印刷	28,300	1,953.00	55,269,900
大日本印刷	22,500	2,297.00	51,682,500
共同印刷	500	2,779.00	1,389,500
N I S S H A	3,800	1,337.00	5,080,600
光村印刷	200	1,769.00	353,800
藤森工業	1,800	4,210.00	7,578,000
TAKARA & COMPANY	900	1,904.00	1,713,600
前澤化成工業	1,200	1,138.00	1,365,600
未来工業	600	1,783.00	1,069,800
アシックス	16,500	1,824.00	30,096,000
ツツミ	400	2,392.00	956,800
ウェーブロックホールディングス	600	736.00	441,600
J S P	1,000	1,741.00	1,741,000
ニチハ	2,600	3,265.00	8,489,000
ローランド	1,400	5,320.00	7,448,000
エフピコ	3,500	4,430.00	15,505,000
小松ウオール工業	500	2,059.00	1,029,500
ヤマハ	11,100	6,290.00	69,819,000
河合楽器製作所	500	3,490.00	1,745,000
クリナップ	1,800	557.00	1,002,600
ピジョン	11,900	3,700.00	44,030,000
天馬	1,500	2,316.00	3,474,000
オリバー	400	2,562.00	1,024,800
兼松サステック	100	1,779.00	177,900
キングジム	1,600	952.00	1,523,200
象印マホービン	5,000	1,738.00	8,690,000
リンテック	3,900	2,507.00	9,777,300
信越ポリマー	2,900	1,090.00	3,161,000
東リ	4,600	258.00	1,186,800
イトーキ	3,700	391.00	1,446,700
任天堂	10,700	62,220.00	665,754,000
三菱鉛筆	3,100	1,487.00	4,609,700
松風	800	2,137.00	1,709,600
タカラスタANDARD	3,800	1,610.00	6,118,000
コクヨ	8,900	1,702.00	15,147,800
ナカバヤシ	1,900	607.00	1,153,300

ニフコ	6,800	3,860.00	26,248,000
立川ブラインド工業	800	1,375.00	1,100,000
グロープライド	800	4,420.00	3,536,000
オカムラ	6,400	1,361.00	8,710,400
バルカー	1,600	2,144.00	3,430,400
MUTOHホールディングス	200	1,571.00	314,200
伊藤忠商事	128,300	3,564.00	457,261,200
丸紅	180,700	992.60	179,362,820
スクロール	2,600	892.00	2,319,200
高島	300	1,780.00	534,000
ヨンドシーホールディングス	1,800	1,892.00	3,405,600
三陽商会	1,200	837.00	1,004,400
長瀬産業	10,400	1,706.00	17,742,400
ナイガイ	600	340.00	204,000
蝶理	1,200	1,552.00	1,862,400
豊田通商	18,400	5,110.00	94,024,000
オンワードホールディングス	12,000	306.00	3,672,000
三共生興	2,800	527.00	1,475,600
兼松	7,300	1,514.00	11,052,200
美津濃	1,900	2,312.00	4,392,800
ツカモトコーポレーション	300	1,396.00	418,800
ルックホールディングス	600	1,276.00	765,600
三井物産	148,800	2,539.50	377,877,600
日本紙パルプ商事	900	3,670.00	3,303,000
東京エレクトロン	10,900	50,060.00	545,654,000
カメイ	2,400	1,165.00	2,796,000
東都水産	200	4,255.00	851,000
OUGホールディングス	300	2,798.00	839,400
スターゼン	1,200	2,288.00	2,745,600
セイコーホールディングス	2,700	2,107.00	5,688,900
山善	7,200	1,025.00	7,380,000
椿本興業	300	3,565.00	1,069,500
住友商事	115,800	1,560.00	180,648,000
日本ユニシス	6,300	3,560.00	22,428,000
内田洋行	700	4,870.00	3,409,000
三菱商事	111,600	3,011.00	336,027,600
第一実業	800	4,210.00	3,368,000
キャノンマーケティングジャパン	4,500	2,602.00	11,709,000
西華産業	900	1,720.00	1,548,000
佐藤商事	1,600	1,091.00	1,745,600
菱洋エレクトロ	1,500	2,719.00	4,078,500
東京産業	1,700	636.00	1,081,200
ユアサ商事	1,900	3,135.00	5,956,500
神鋼商事	400	2,549.00	1,019,600
トルク	1,000	253.00	253,000
阪和興業	3,700	3,605.00	13,338,500
正栄食品工業	1,200	4,115.00	4,938,000
カナデン	1,600	1,170.00	1,872,000
菱電商事	1,300	1,684.00	2,189,200
ニプロ	13,800	1,386.00	19,126,800

フルサト工業	900	1,641.00	1,476,900
岩谷産業	4,400	7,220.00	31,768,000
ナイス	700	2,015.00	1,410,500
極東貿易	500	1,407.00	703,500
イワキ	2,400	759.00	1,821,600
兼松エレクトロニクス	900	3,760.00	3,384,000
三愛石油	4,500	1,272.00	5,724,000
稲畑産業	4,400	1,665.00	7,326,000
G S Iクレオス	800	1,225.00	980,000
明和産業	1,800	489.00	880,200
クワザワホールディングス	600	598.00	358,800
ヤマエ久野	1,300	1,090.00	1,417,000
ゴールドウイン	3,000	6,750.00	20,250,000
ユニ・チャーム	39,500	4,254.00	168,033,000
デサント	3,100	1,942.00	6,020,200
キング	900	532.00	478,800
ワキタ	3,700	1,100.00	4,070,000
ヤマトインターナショナル	1,700	333.00	566,100
東邦ホールディングス	5,900	1,917.00	11,310,300
サンゲツ	4,900	1,630.00	7,987,000
ミツウロコグループホールディングス	2,700	1,358.00	3,666,600
シナネンホールディングス	600	3,065.00	1,839,000
伊藤忠エネクス	4,000	1,094.00	4,376,000
サンリオ	5,100	1,754.00	8,945,400
サンワテクノス	1,200	1,283.00	1,539,600
リョーサン	2,100	2,278.00	4,783,800
新光商事	2,500	762.00	1,905,000
トーホー	800	1,747.00	1,397,600
三信電気	900	2,049.00	1,844,100
東陽テクニカ	2,000	1,114.00	2,228,000
モスフードサービス	2,600	3,075.00	7,995,000
加賀電子	1,700	2,488.00	4,229,600
三益半導体工業	1,500	2,729.00	4,093,500
都築電気	600	1,833.00	1,099,800
ソーダニッカ	1,800	593.00	1,067,400
立花エレテック	1,500	1,599.00	2,398,500
木曽路	2,400	2,280.00	5,472,000
S R Sホールディングス	2,300	830.00	1,909,000
千趣会	3,400	402.00	1,366,800
リテールパートナーズ	2,300	1,208.00	2,778,400
ケーヨー	3,500	723.00	2,530,500
上新電機	2,200	2,827.00	6,219,400
日本瓦斯	9,000	1,889.00	17,001,000
ロイヤルホールディングス	3,500	1,957.00	6,849,500
東天紅	200	1,004.00	200,800
いなげや	2,100	1,569.00	3,294,900
チヨダ	2,000	893.00	1,786,000
ライフコーポレーション	1,500	3,535.00	5,302,500
リンガーハット	2,500	2,267.00	5,667,500
MrMaxHD	2,500	647.00	1,617,500

AOKIホールディングス	4,400	639.00	2,811,600	
オークワ	2,900	1,171.00	3,395,900	
コメリ	2,800	2,868.00	8,030,400	
青山商事	4,800	863.00	4,142,400	
しまむら	2,200	10,990.00	24,178,000	
はせがわ	900	292.00	262,800	
高島屋	13,400	1,230.00	16,482,000	
松屋	4,400	945.00	4,158,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,900	864.00	7,689,600	
近鉄百貨店	700	3,145.00	2,201,500	
丸井グループ	15,500	2,097.00	32,503,500	
クレディセゾン	10,800	1,298.00	14,018,400	
アクシアル リテイリング	1,600	4,245.00	6,792,000	
イオン	70,600	3,088.00	218,012,800	
イズミ	3,800	4,375.00	16,625,000	
フォーバル	600	817.00	490,200	
平和堂	3,500	2,290.00	8,015,000	
フジ	2,300	2,130.00	4,899,000	
ヤオコー	2,100	6,980.00	14,658,000	
ゼビオホールディングス	2,300	916.00	2,106,800	
ケーズホールディングス	16,300	1,466.00	23,895,800	
PALTAC	2,900	5,480.00	15,892,000	
三谷産業	2,500	417.00	1,042,500	
Olympicグループ	900	782.00	703,800	
日産東京販売ホールディングス	2,700	247.00	666,900	
新生銀行	15,000	1,623.00	24,345,000	
あおぞら銀行	11,000	2,437.00	26,807,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,255,800	607.90	763,400,820	
りそなホールディングス	211,800	468.20	99,164,760	
三井住友トラスト・ホールディングス	34,700	3,857.00	133,837,900	
三井住友フィナンシャルグループ	127,100	3,970.00	504,587,000	
千葉銀行	61,400	716.00	43,962,400	
群馬銀行	37,800	378.00	14,288,400	
武蔵野銀行	2,800	1,683.00	4,712,400	
千葉興業銀行	4,700	279.00	1,311,300	
筑波銀行	7,600	177.00	1,345,200	
七十七銀行	5,800	1,436.00	8,328,800	
青森銀行	1,500	2,346.00	3,519,000	
秋田銀行	1,000	1,404.00	1,404,000	
山形銀行	2,100	1,059.00	2,223,900	
岩手銀行	1,200	2,161.00	2,593,200	
東邦銀行	16,400	223.00	3,657,200	
東北銀行	800	1,064.00	851,200	
みちのく銀行	1,200	1,025.00	1,230,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	16,600	1,972.00	32,735,200	
静岡銀行	44,700	867.00	38,754,900	
十六銀行	2,300	2,093.00	4,813,900	
スルガ銀行	16,100	415.00	6,681,500	
八十二銀行	41,500	400.00	16,600,000	
山梨中央銀行	2,200	857.00	1,885,400	

大垣共立銀行	3,700	2,047.00	7,573,900
福井銀行	1,700	1,770.00	3,009,000
北國銀行	1,800	2,483.00	4,469,400
清水銀行	700	1,638.00	1,146,600
富山銀行	300	2,791.00	837,300
滋賀銀行	3,700	2,195.00	8,121,500
南都銀行	2,700	1,880.00	5,076,000
百五銀行	16,500	330.00	5,445,000
京都銀行	6,500	6,000.00	39,000,000
紀陽銀行	6,500	1,500.00	9,750,000
ほくほくフィナンシャルグループ	12,100	981.00	11,870,100
山陰合同銀行	11,500	523.00	6,014,500
中国銀行	15,800	910.00	14,378,000
鳥取銀行	500	1,147.00	573,500
伊予銀行	24,400	635.00	15,494,000
百十四銀行	2,000	1,570.00	3,140,000
四国銀行	2,600	735.00	1,911,000
阿波銀行	2,800	2,309.00	6,465,200
大分銀行	1,000	1,940.00	1,940,000
宮崎銀行	1,200	2,305.00	2,766,000
佐賀銀行	1,000	1,394.00	1,394,000
沖縄銀行	1,800	2,757.00	4,962,600
琉球銀行	3,900	734.00	2,862,600
セブン銀行	61,400	234.00	14,367,600
みずほフィナンシャルグループ	249,500	1,622.50	404,813,750
高知銀行	600	829.00	497,400
山口フィナンシャルグループ	22,900	674.00	15,434,600
芙蓉総合リース	2,000	7,540.00	15,080,000
みずほリース	2,800	3,360.00	9,408,000
東京センチュリー	4,200	6,710.00	28,182,000
SBIホールディングス	22,500	3,030.00	68,175,000
日本証券金融	7,700	823.00	6,337,100
アイフル	30,800	324.00	9,979,200
長野銀行	600	1,199.00	719,400
名古屋銀行	1,600	2,811.00	4,497,600
北洋銀行	27,600	295.00	8,142,000
愛知銀行	600	2,928.00	1,756,800
中京銀行	600	1,726.00	1,035,600
大光銀行	600	1,481.00	888,600
愛媛銀行	2,600	936.00	2,433,600
トマト銀行	700	1,057.00	739,900
京葉銀行	7,900	435.00	3,436,500
栃木銀行	8,900	183.00	1,628,700
北日本銀行	500	1,842.00	921,000
東和銀行	3,200	633.00	2,025,600
福島銀行	2,200	236.00	519,200
大東銀行	800	638.00	510,400
リコーリース	1,500	3,495.00	5,242,500
イオンフィナンシャルサービス	11,300	1,271.00	14,362,300
アコム	36,900	472.00	17,416,800

ジャックス	2,100	2,193.00	4,605,300
オリエントコーポレーション	49,500	148.00	7,326,000
オリックス	111,600	1,821.00	203,223,600
三菱HCキャピタル	63,500	641.00	40,703,500
ジャフコグループ	2,800	7,840.00	21,952,000
九州リースサービス	800	679.00	543,200
トモニホールディングス	14,100	309.00	4,356,900
大和証券グループ本社	137,500	625.10	85,951,250
野村ホールディングス	280,300	580.50	162,714,150
岡三証券グループ	15,600	479.00	7,472,400
丸三証券	5,400	668.00	3,607,200
東洋証券	6,100	176.00	1,073,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19,600	428.00	8,388,800
光世証券	400	712.00	284,800
水戸証券	4,900	312.00	1,528,800
いちよし証券	3,700	633.00	2,342,100
松井証券	9,000	872.00	7,848,000
SOMPOホールディングス	32,400	4,255.00	137,862,000
日本取引所グループ	49,500	2,647.50	131,051,250
マネックスグループ	16,800	918.00	15,422,400
極東証券	2,500	852.00	2,130,000
岩井コスモホールディングス	2,000	1,781.00	3,562,000
藍澤証券	3,400	1,044.00	3,549,600
フィデアホールディングス	17,800	131.00	2,331,800
池田泉州ホールディングス	21,000	178.00	3,738,000
アニコムホールディングス	5,100	1,047.00	5,339,700
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	44,600	3,296.00	147,001,600
マネーパートナーズグループ	2,000	257.00	514,000
スパークス・グループ	8,500	295.00	2,507,500
第一生命ホールディングス	97,000	2,056.50	199,480,500
東京海上ホールディングス	60,400	5,472.00	330,508,800
アドバンテッジリスクマネジメント	800	730.00	584,000
イー・ギャランティ	2,200	2,120.00	4,664,000
アサックス	900	695.00	625,500
NECキャピタルソリューション	700	2,071.00	1,449,700
T&Dホールディングス	54,900	1,397.00	76,695,300
アドバンスクリエイト	800	1,047.00	837,600
三井不動産	83,700	2,515.00	210,505,500
三菱地所	120,500	1,872.50	225,636,250
平和不動産	3,100	3,910.00	12,121,000
東京建物	18,100	1,727.00	31,258,700
ダイビル	4,900	1,278.00	6,262,200
京阪神ビルディング	3,200	1,520.00	4,864,000
住友不動産	41,400	3,913.00	161,998,200
太平洋興発	700	693.00	485,100
テーオーシー	4,100	741.00	3,038,100
東京楽天地	400	4,245.00	1,698,000
スターツコーポレーション	2,200	2,756.00	6,063,200

フジ住宅	2,200	666.00	1,465,200
空港施設	1,900	635.00	1,206,500
明和地所	900	668.00	601,200
ゴールドクレスト	1,900	1,630.00	3,097,000
リログループ	9,700	2,291.00	22,222,700
エスリード	700	1,678.00	1,174,600
日神グループホールディングス	2,700	501.00	1,352,700
日本エスコン	3,400	759.00	2,580,600
タカラレーベン	8,500	369.00	3,136,500
A V A N T I A	1,000	907.00	907,000
イオンモール	9,200	1,757.00	16,164,400
毎日コムネット	400	775.00	310,000
ファースト住建	700	1,244.00	870,800
カチタス	4,500	3,340.00	15,030,000
東祥	1,200	1,679.00	2,014,800
トーセイ	2,600	1,123.00	2,919,800
穴吹興産	400	2,127.00	850,800
サンフロンティア不動産	2,400	1,024.00	2,457,600
エフ・ジェー・ネクスト	1,900	1,053.00	2,000,700
インテリックス	500	862.00	431,000
ランドビジネス	800	402.00	321,600
サンネクスタグループ	500	991.00	495,500
グランディハウス	1,300	465.00	604,500
東武鉄道	19,400	2,948.00	57,191,200
相鉄ホールディングス	6,400	2,253.00	14,419,200
東急	46,900	1,460.00	68,474,000
京浜急行電鉄	23,900	1,445.00	34,535,500
小田急電鉄	29,700	2,998.00	89,040,600
京王電鉄	10,500	7,210.00	75,705,000
京成電鉄	13,900	3,320.00	46,148,000
富士急行	2,600	5,260.00	13,676,000
新京成電鉄	400	2,178.00	871,200
東日本旅客鉄道	32,900	7,683.00	252,770,700
西日本旅客鉄道	16,600	6,221.00	103,268,600
東海旅客鉄道	15,400	16,270.00	250,558,000
西武ホールディングス	22,400	1,167.00	26,140,800
鴻池運輸	3,000	1,177.00	3,531,000
西日本鉄道	5,100	2,849.00	14,529,900
ハマキョウレックス	1,500	3,180.00	4,770,000
サカイ引越センター	800	5,660.00	4,528,000
近鉄グループホールディングス	17,700	4,070.00	72,039,000
阪急阪神ホールディングス	23,500	3,525.00	82,837,500
南海電気鉄道	8,400	2,385.00	20,034,000
京阪ホールディングス	7,900	3,850.00	30,415,000
神戸電鉄	400	3,620.00	1,448,000
名古屋鉄道	14,400	2,560.00	36,864,000
山陽電気鉄道	1,300	1,890.00	2,457,000
アルプス物流	1,200	953.00	1,143,600
トランコム	500	9,020.00	4,510,000
日本通運	6,100	8,940.00	54,534,000

ヤマトホールディングス	24,800	3,105.00	77,004,000	
山九	4,500	4,930.00	22,185,000	
日新	1,500	1,422.00	2,133,000	
丸運	900	282.00	253,800	
丸全昭和運輸	1,500	3,270.00	4,905,000	
センコーグループホールディングス	9,700	1,040.00	10,088,000	
トナミホールディングス	400	5,350.00	2,140,000	
ニッコンホールディングス	5,900	2,335.00	13,776,500	
日本石油輸送	200	2,649.00	529,800	
福山通運	2,300	4,335.00	9,970,500	
セイノーホールディングス	13,200	1,567.00	20,684,400	
エスライン	500	921.00	460,500	
神奈川中央交通	400	3,695.00	1,478,000	
日立物流	3,800	3,470.00	13,186,000	
丸和運輸機関	3,800	1,929.00	7,330,200	
C & F ロジホールディングス	1,900	1,758.00	3,340,200	
日本郵船	14,800	4,415.00	65,342,000	
商船三井	10,600	4,680.00	49,608,000	
川崎汽船	5,500	3,165.00	17,407,500	
NSユナイテッド海運	900	2,385.00	2,146,500	
飯野海運	8,200	561.00	4,600,200	
共栄タンカー	300	1,001.00	300,300	
九州旅客鉄道	13,600	2,530.00	34,408,000	
SGホールディングス	33,400	2,504.00	83,633,600	
日本航空	42,900	2,317.00	99,399,300	
ANAホールディングス	47,600	2,568.00	122,236,800	
パスコ	300	1,410.00	423,000	
西本Wismettacホールディングス	400	2,696.00	1,078,400	
シルバーライフ	300	2,559.00	767,700	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	2,211.00	442,200	
Genky DrugStores	800	3,415.00	2,732,000	
コア商事ホールディングス	1,000	816.00	816,000	
国際紙バルブ商事	3,800	247.00	938,600	
ナルミヤ・インターナショナル	400	1,228.00	491,200	
ブックオフグループホールディングス	1,000	1,006.00	1,006,000	
ギフト	200	2,148.00	429,600	
三菱倉庫	6,100	3,355.00	20,465,500	
三井倉庫ホールディングス	1,900	2,371.00	4,504,900	
住友倉庫	6,300	1,478.00	9,311,400	
澁澤倉庫	900	2,160.00	1,944,000	
ヤマタネ	700	1,489.00	1,042,300	
東陽倉庫	3,000	332.00	996,000	
乾汽船	800	1,146.00	916,800	
日本トランスシティ	3,800	538.00	2,044,400	
ケイヒン	300	1,400.00	420,000	
中央倉庫	1,000	1,102.00	1,102,000	
川西倉庫	300	1,169.00	350,700	
安田倉庫	1,600	953.00	1,524,800	
ファイズホールディングス	300	933.00	279,900	

東洋埠頭	500	1,505.00	752,500	
宇徳	1,300	503.00	653,900	
上組	9,800	2,225.00	21,805,000	
サンリツ	400	717.00	286,800	
キムラユニティー	400	1,282.00	512,800	
キューソー流通システム	400	1,635.00	654,000	
近鉄エクスプレス	3,400	2,727.00	9,271,800	
東海運	900	355.00	319,500	
エーアイテイー	1,000	1,068.00	1,068,000	
内外トランスライン	600	1,858.00	1,114,800	
ショーエイコーポレーション	400	1,006.00	402,400	
日本コンセプト	500	1,599.00	799,500	
TBSホールディングス	12,000	2,185.00	26,220,000	
日本テレビホールディングス	15,200	1,441.00	21,903,200	
朝日放送グループホールディングス	1,900	706.00	1,341,400	
テレビ朝日ホールディングス	5,700	2,011.00	11,462,700	
スカパーJ S A Tホールディングス	11,900	464.00	5,521,600	
テレビ東京ホールディングス	1,300	2,282.00	2,966,600	
日本BS放送	600	1,094.00	656,400	
ビジョン	2,700	1,070.00	2,889,000	
スマートバリュー	400	870.00	348,000	
USEN-NEXT HOLDINGS	1,700	2,113.00	3,592,100	
コネクシオ	1,000	1,474.00	1,474,000	
クロップス	300	896.00	268,800	
日本電信電話	213,700	2,854.00	609,899,800	
KDDI	146,500	3,440.00	503,960,000	
ソフトバンク	165,900	1,449.00	240,389,100	
光通信	2,200	22,180.00	48,796,000	
エムティーアイ	1,900	776.00	1,474,400	
GMOインターネット	6,500	3,160.00	20,540,000	
ファイバーゲート	600	1,571.00	942,600	
アйдママーケティングコミュニケーション	600	413.00	247,800	
KADOKAWA	4,900	3,920.00	19,208,000	
学研ホールディングス	2,500	1,407.00	3,517,500	
ゼンリン	3,600	1,162.00	4,183,200	
昭文社ホールディングス	700	477.00	333,900	
インプレスホールディングス	1,600	240.00	384,000	
東京電力ホールディングス	157,800	345.00	54,441,000	
中部電力	56,900	1,362.50	77,526,250	
関西電力	70,600	1,098.00	77,518,800	
中国電力	26,800	1,243.00	33,312,400	
北陸電力	17,100	679.00	11,610,900	
東北電力	43,600	976.00	42,553,600	
四国電力	15,400	817.00	12,581,800	
九州電力	41,100	1,012.00	41,593,200	
北海道電力	17,500	536.00	9,380,000	
沖縄電力	3,700	1,490.00	5,513,000	
電源開発	14,800	1,692.00	25,041,600	

エフオン	1,200	1,031.00	1,237,200
イーレックス	2,800	1,961.00	5,490,800
レノバ	3,100	3,140.00	9,734,000
東京瓦斯	35,800	2,334.50	83,575,100
大阪瓦斯	33,800	2,152.00	72,737,600
東邦瓦斯	9,100	6,330.00	57,603,000
北海道瓦斯	900	1,568.00	1,411,200
広島ガス	3,800	388.00	1,474,400
西部ガスホールディングス	2,200	2,553.00	5,616,600
静岡ガス	5,200	982.00	5,106,400
メタウォーター	2,200	2,100.00	4,620,000
アイネット	900	1,477.00	1,329,300
松竹	1,200	12,430.00	14,916,000
東宝	10,900	4,410.00	48,069,000
エイチ・アイ・エス	2,900	2,289.00	6,638,100
東映	600	25,090.00	15,054,000
ラックランド	500	2,498.00	1,249,000
エヌ・ティ・ティ・データ	48,700	1,751.00	85,273,700
共立メンテナンス	3,000	3,535.00	10,605,000
イチネンホールディングス	1,900	1,299.00	2,468,100
建設技術研究所	1,200	2,563.00	3,075,600
スペース	1,200	903.00	1,083,600
長 大	700	1,774.00	1,241,800
アインホールディングス	2,700	6,350.00	17,145,000
燦ホールディングス	700	1,065.00	745,500
ピー・シー・エー	200	4,440.00	888,000
スバル興業	100	8,170.00	817,000
東京テアトル	600	1,256.00	753,600
タナベ経営	300	1,396.00	418,800
ビジネスブレイン太田昭和	600	1,814.00	1,088,400
ナガワ	500	8,250.00	4,125,000
東京都競馬	1,200	5,420.00	6,504,000
常磐興産	700	1,425.00	997,500
カナモト	3,100	2,775.00	8,602,500
D T S	3,800	2,610.00	9,918,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,900	6,130.00	48,427,000
シーイーシー	2,000	1,394.00	2,788,000
カプコン	15,800	3,360.00	53,088,000
西尾レントオール	1,700	3,215.00	5,465,500
アイ・エス・ピー	800	1,353.00	1,082,400
日本空港ビルデング	5,900	4,870.00	28,733,000
トランス・コスモス	1,800	3,115.00	5,607,000
乃村工藝社	7,700	831.00	6,398,700
ジャステック	1,200	1,286.00	1,543,200
S C S K	4,100	6,330.00	25,953,000
藤田観光	900	1,937.00	1,743,300
日本管財	2,000	2,245.00	4,490,000
トーカイ	1,800	2,462.00	4,431,600
セコム	17,600	9,317.00	163,979,200

日本システムウエア	600	2,215.00	1,329,000	
セントラル警備保障	800	2,990.00	2,392,000	
アイネス	1,900	1,436.00	2,728,400	
丹青社	3,400	860.00	2,924,000	
メイテック	2,200	6,130.00	13,486,000	
T K C	3,100	3,590.00	11,129,000	
富士ソフト	2,000	5,520.00	11,040,000	
応用地質	2,100	1,328.00	2,788,800	
船井総研ホールディングス	3,700	2,269.00	8,395,300	
N S D	5,900	1,810.00	10,679,000	
進学会ホールディングス	600	423.00	253,800	
丸紅建材リース	200	1,870.00	374,000	
オオバ	1,300	859.00	1,116,700	
コナミホールディングス	6,600	6,740.00	44,484,000	
いであ	400	1,866.00	746,400	
学究社	500	1,311.00	655,500	
ベネッセホールディングス	6,500	2,443.00	15,879,500	
イオンディライト	2,200	3,385.00	7,447,000	
ナック	800	947.00	757,600	
福井コンピュータホールディングス	800	4,140.00	3,312,000	
ダイセキ	3,000	4,115.00	12,345,000	
ステップ	600	1,609.00	965,400	
日鉄物産	1,300	4,685.00	6,090,500	
泉州電業	500	3,480.00	1,740,000	
元気寿司	600	2,452.00	1,471,200	
トラスコ中山	4,100	3,015.00	12,361,500	
ヤマダホールディングス	61,500	562.00	34,563,000	
オートバックスセブン	6,700	1,495.00	10,016,500	
モリト	1,300	614.00	798,200	
アークランドサカモト	2,900	1,547.00	4,486,300	
ニトリホールディングス	7,300	19,710.00	143,883,000	
グルメ杵屋	1,300	960.00	1,248,000	
愛眼	1,600	227.00	363,200	
ケーユーホールディングス	900	989.00	890,100	
吉野家ホールディングス	6,000	2,070.00	12,420,000	
加藤産業	2,700	3,305.00	8,923,500	
北恵	400	942.00	376,800	
イノテック	1,000	1,342.00	1,342,000	
イエローハット	3,500	1,937.00	6,779,500	
松屋フーズホールディングス	900	3,525.00	3,172,500	
J B C Cホールディングス	1,300	1,387.00	1,803,100	
J Kホールディングス	1,700	849.00	1,443,300	
サガミホールディングス	2,500	1,039.00	2,597,500	
日伝	1,600	2,083.00	3,332,800	
関西スーパーマーケット	1,500	1,037.00	1,555,500	
ミロク情報サービス	1,900	1,868.00	3,549,200	
北沢産業	1,300	257.00	334,100	
杉本商事	900	2,268.00	2,041,200	
因幡電機産業	4,900	2,617.00	12,823,300	
王将フードサービス	1,200	5,690.00	6,828,000	

プレナス	2,100	2,045.00	4,294,500	
ミニストップ	1,500	1,459.00	2,188,500	
アークス	3,600	2,431.00	8,751,600	
バローホールディングス	3,800	2,349.00	8,926,200	
東テク	600	2,985.00	1,791,000	
ミスミグループ本社	22,900	3,470.00	79,463,000	
藤久	400	791.00	316,400	
アルテック	1,500	325.00	487,500	
ベルク	800	5,920.00	4,736,000	
大 庄	1,300	1,004.00	1,305,200	
タキヒヨー	600	1,859.00	1,115,400	
ファーストリテイリング	2,400	87,660.00	210,384,000	
ソフトバンクグループ	144,900	10,170.00	1,473,633,000	
蔵王産業	300	1,432.00	429,600	
スズケン	7,700	4,085.00	31,454,500	
サンドラッグ	6,800	3,880.00	26,384,000	
サックスパー ホールディングス	1,900	638.00	1,212,200	
ジェコス	1,300	918.00	1,193,400	
ヤマザワ	400	1,702.00	680,800	
やまや	400	2,326.00	930,400	
グローセル	2,100	431.00	905,100	
ベルーナ	3,900	1,201.00	4,683,900	
合計	19,496,200		49,878,530,460	

(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15期中間計算期間(2021年5月11日から2021年11月10日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【MHAM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14期 2021年5月10日現在	第15期中間計算期間末 2021年11月10日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,824,187	18,959,164
親投資信託受益証券	22,061,126,691	23,038,361,471
未収入金	32,073,000	43,933,000
流動資産合計	22,110,023,878	23,101,253,635
資産合計	22,110,023,878	23,101,253,635
負債の部		
流動負債		
未払解約金	33,175,410	45,088,943
未払受託者報酬	4,375,867	4,974,187
未払委託者報酬	10,392,757	11,813,789
その他未払費用	152,498	166,944
流動負債合計	48,096,532	62,043,863
負債合計	48,096,532	62,043,863
純資産の部		
元本等		
元本	12,477,799,096	12,548,990,193
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	9,584,128,250	10,490,219,579
(分配準備積立金)	4,976,592,711	4,597,745,578
元本等合計	22,061,927,346	23,039,209,772
純資産合計	22,061,927,346	23,039,209,772
負債純資産合計	22,110,023,878	23,101,253,635

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第14期中間計算期間 自 2020年5月9日 至 2020年11月8日	第15期中間計算期間 自 2021年5月11日 至 2021年11月10日
営業収益		
受取利息	-	48
有価証券売買等損益	2,944,314,172	887,985,780
営業収益合計	2,944,314,172	887,985,828
営業費用		
支払利息	4,635	2,616
受託者報酬	5,977,858	4,974,187
委託者報酬	23,234,849	11,813,789
その他費用	168,598	166,944
営業費用合計	29,385,940	16,957,536
営業利益又は営業損失()	2,914,928,232	871,028,292
経常利益又は経常損失()	2,914,928,232	871,028,292
中間純利益又は中間純損失()	2,914,928,232	871,028,292
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()	665,317,701	39,221,704
期首剰余金又は期首欠損金()	4,713,656,423	9,584,128,250
剰余金増加額又は欠損金減少額	555,374,871	837,670,045
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	555,374,871	837,670,045
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,519,145,649	763,385,304
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,519,145,649	763,385,304
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()	5,999,496,176	10,490,219,579

(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15期中間計算期間	
	自 2021年5月11日	至 2021年11月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年5月8日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2021年5月10日、当中間計算期間末日を2021年11月10日としております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第14期	第15期中間計算期間末
	2021年5月10日現在	2021年11月10日現在
1. 期首元本額	15,936,853,293円	12,477,799,096円
期中追加設定元本額	3,489,786,570円	1,065,239,316円
期中一部解約元本額	6,948,840,767円	994,048,219円
2. 受益権の総数	12,477,799,096口	12,548,990,193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14期	第15期中間計算期間末
	2021年5月10日現在	2021年11月10日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	---	----

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第14期 2021年5月10日現在	第15期中間計算期間末 2021年11月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,7681円 (17,681円)	1,8359円 (18,359円)

（参考）

当ファンドは、「MHAM TOPIXマザーファンド」受益証券及び「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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)

2021年11月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	62,358,980
差入委託証拠金	2,385,000
流動資産合計	64,743,980
資産合計	64,743,980
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	330,990
前受金	45,000
流動負債合計	375,990
負債合計	375,990
純資産の部	
元本等	
元本	25,449,380
剰余金	
剰余金又は欠損金()	38,918,610
元本等合計	64,367,990
純資産合計	64,367,990
負債純資産合計	64,743,980

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年5月11日 至 2021年11月10日
1. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年11月10日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	20,915,720,167円
同期中追加設定元本額	174,181,953円
同期中一部解約元本額	21,064,452,740円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	1,493,073円
MHAM TOPIXオープン	4,463,494円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	11,022,157円
動的パッケージファンド<DC年金>	33,373円
コア資産形成ファンド	26,744円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	113,534円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	4,802,530円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	3,494,475円
計	25,449,380円
2. 受益権の総数	25,449,380口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年11月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 該当事項はありません。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2021年11月10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	60,615,000	-	60,285,000	330,000
合計	60,615,000	-	60,285,000	330,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年11月10日現在
1口当たり純資産額	2.5293円
(1万口当たり純資産額)	(25,293円)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年11月10日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,441,717,660
株式	461,776,855,810
派生商品評価勘定	97,723,210
未収配当金	3,104,053,309
差入委託証拠金	343,440,000
流動資産合計	470,763,789,989
資産合計	
470,763,789,989	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	26,081,430
前受金	125,725,000
未払解約金	122,520,000
流動負債合計	274,326,430
負債合計	
274,326,430	
純資産の部	
元本等	
元本	141,696,673,198
剰余金	
剰余金又は欠損金()	328,792,790,361
元本等合計	470,489,463,559
純資産合計	
470,489,463,559	
負債純資産合計	
470,763,789,989	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年5月11日 至 2021年11月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年11月10日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	111,902,695,114円
同期中追加設定元本額	87,576,899,165円
同期中一部解約元本額	57,782,921,081円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	561,857,238円
MHAM TOPIXオープン	2,732,198,964円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	6,930,033,469円
One DC 国内株式インデックスファンド	19,052,126,046円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	5,074,892,744円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	3,076,645円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	16,818,972円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	30,979,669円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	27,689,484円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	21,954,705円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	14,982,758円
たわらノーロード TOPIX	1,145,317,440円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	915,904,629円
たわらノーロード バランス(堅実型)	35,188,203円
たわらノーロード バランス(標準型)	222,628,180円
たわらノーロード バランス(積極型)	342,778,782円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	2,494,044円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	154,364,326円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	385,607,438円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	256,067,681円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	374,128,374円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	616,398円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,691,006円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	31,696,951円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,011,188円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	17,146,795円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,727,888,350円
Oneグローバルバランス	2,033,901円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,011,457,046円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,369,357,517円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,628,419,397円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	327,336,061円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,117,623,397円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,108,643,119円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	30,491,676円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,044,999,679円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	18,322,288円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	300,531,320円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	292,227,832円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	521,135,993円
投資のソムリエ	25,773,578,600円
クルーズコントロール	646,262,631円
投資のソムリエ<DC年金>	1,297,586,409円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	309,774,130円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	487,673,895円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	7,137,157円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	17,321,468円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	848,964,044円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	7,693,453,481円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	32,337,934円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	16,676,371円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	8,397,924円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	86,588,591円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	317,758,282円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,092,293,809円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	266,452,056円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	24,710,921円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	12,338,007円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	9,778,330円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	73,302,407円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	469,621円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	29,593,871円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	30,093,117円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	49,670,055円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	18,379,245円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	28,971,148円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	82,846,631円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-05(適格機関投資家限定)	87,019,592円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	128,882,818円

マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-07(適格機関投資家限定)	141,510,213円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-08(適格機関投資家限定)	99,299,386円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	29,074,996円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-09(適格機関投資家限定)	98,338,624円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	690,947,490円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	33,949,148円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	418,052,171円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	49,345,848円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	10,942,329円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	57,556,354円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	99,770,630円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,860,843円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	27,204,318円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,357,787円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,293,093円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	8,056,636円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	33,673,923円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	565,658,338円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	642,650,692円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,838,363,512円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	32,514,670円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	32,315,756円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	302,820,132円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	75,660,772円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,544,954円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	352,929,076円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	21,259,688円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	72,328,663円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	171,306,067円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	254,481,743円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	38,284,674円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	17,810,193円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	291,737,796円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	936,557,239円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,240,495,959円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	49,936,951円
動的パッケージファンド<DC年金>	18,755,714円

コア資産形成ファンド	14,351,821円
MHAMトピックスファンド	674,970,401円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	66,330,889円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	2,659,425,997円
MHAM日本株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	2,174,915,462円
計	141,696,673,198円
2. 受益権の総数	141,696,673,198口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年11月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2021年11月10日現在			評価損益（円）
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	
市場取引 先物取引 買建	8,649,445,000	-	8,721,230,000	71,785,000
合計	8,649,445,000	-	8,721,230,000	71,785,000

（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）

	2021年11月10日現在

1口当たり純資産額	3,3204円
(1万口当たり純資産額)	(33,204円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年11月30日現在

資産総額	22,145,060,143円
負債総額	8,648,190円
純資産総額(-)	22,136,411,953円
発行済数量	12,556,860,517口
1口当たり純資産額(/)	1.7629円

(参考)

MHAM TOPIXマザーファンド

2021年11月30日現在

資産総額	64,697,764円
負債総額	3,735,990円
純資産総額(-)	60,961,774円
発行済数量	25,449,380口
1口当たり純資産額(/)	2.3954円

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2021年11月30日現在

資産総額	453,787,790,064円
負債総額	870,859,270円
純資産総額(-)	452,916,930,794円
発行済数量	142,044,597,457口
1口当たり純資産額(/)	3.1886円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2021年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(2021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。

2021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	1,423,958,821,203
追加型株式投資信託	826	15,691,923,686,048
単位型公社債投資信託	28	60,158,467,127
単位型株式投資信託	218	1,311,798,129,058
合計	1,098	18,487,839,103,436

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第37期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第36期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第37期事業年度の中間財務諸表の金額については百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第36期事業年度（自2020年4月1日至2021年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受け、第37期中間会計期間（自2021年4月1日至2021年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	3,702,906	3,730,283
未払金	4,803,140	7,337,541
未払収益分配金	966	846
未払償還金	9,999	9,999
未払手数料	4,582,140	6,889,193
その他未払金	210,034	437,502
未払費用	6,673,320	9,713,972
未払法人税等	4,090,268	4,199,922
未払消費税等	1,338,183	2,106,617
賞与引当金	1,373,328	1,789,597
役員賞与引当金	65,290	76,410
流動負債計	22,046,438	28,954,345
固定負債		
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
時効後支払損引当金	174,139	157,945
固定負債計	2,293,087	2,450,431
負債合計	24,339,526	31,404,777
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	49,674,383	51,800,187
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	49,551,090	51,676,893
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	17,871,090	19,996,893
株主資本計	71,227,341	73,353,144
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	7	6
評価・換算差額等計	7	6
純資産合計	71,227,333	73,353,137
負債・純資産合計	95,566,859	104,757,915

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(3)【株主資本等変動計算書】

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

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

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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

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

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	7	7	71,227,333
当期変動額			
剰余金の配当			12,000,000
当期純利益			14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	1	1	1
当期変動額合計	1	1	2,125,804
当期末残高	6	6	73,353,137

重要な会計方針

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

(未適用の会計基準等)

1. 収益認識に関する会計基準等

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

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

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

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

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第35期(自2019年4月1日至2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第36期(自2020年4月1日至2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2021年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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35期(2020年3月31日現在)

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

第36期(2021年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	36,734,502	36,734,502	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	25,670,526	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	16,804,456	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	5,814,654	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	1,990	1,990	-
資産計	85,026,130	85,026,130	-
(1) 未払手数料	6,889,193	6,889,193	-
負債計	6,889,193	6,889,193	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
非上場株式	259,369	259,369
関係会社株式	5,299,196	5,299,196

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

第36期(2021年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	36,734,502	-	-	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	-	-	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	-	1,990	-	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第35期の貸借対照表計上額5,299,196千円、第36期の貸借対照表計上額5,299,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

2. その他有価証券

第35期(2020年3月31日現在)

(千円)

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

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

第36期(2021年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計			
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	1,990	2,000	9
小計	1,990	2,000	9
合計	1,990	2,000	9

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
投資信託	996	-	3

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	1.00% ~ 3.76%

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第35期	第36期
	(2020年3月31日現在)	(2021年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	221,053	260,377
未払事業所税	10,778	10,711
賞与引当金	420,513	547,974
未払法定福利費	78,439	92,748
未払給与	10,410	8,535
受取負担金	47,781	-
運用受託報酬	331,395	1,410,516
資産除去債務	14,116	18,079
減価償却超過額(一括償却資産)	50,942	25,808
減価償却超過額	82,684	51,986
繰延資産償却超過額(税法上)	323,132	301,965
退職給付引当金	648,821	701,959
時効後支払損引当金	53,321	48,362
ゴルフ会員権評価損	7,360	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
その他	11,532	5,283
その他有価証券評価差額金	3	2
繰延税金資産小計	2,508,004	3,676,823
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,508,004	3,676,823
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	2,508,004	3,676,823

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	94,605,736千円	84,609,003千円
資産合計	94,605,736千円	84,609,003千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	8,278,713千円	5,570,814千円
負債合計	8,278,713千円	5,570,814千円
純資産	86,327,023千円	79,038,188千円
(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。		
のれん	62,885,491千円	59,074,249千円
顧客関連資産	34,810,031千円	29,793,358千円

(2) 損益計算書項目

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	8,954,439千円	8,823,626千円
経常利益	8,954,439千円	8,823,626千円
税引前当期純利益	9,111,312千円	8,823,626千円
当期純利益	7,536,465千円	7,288,834千円
1株当たり当期純利益	188,411円64銭	182,220円85銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,149,555千円	5,016,672千円

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,435,839	未払 手数料	1,457,765
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	12,767,199	未払 手数料	2,524,882

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	1,780,683円32銭	1,833,828円44銭
1株当たり当期純利益金額	375,125円27銭	353,145円08銭

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

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

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

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

(単位:百万円)

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

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

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

(単位:百万円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

(単位:百万円)

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

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	51,800	73,353	0	0	73,353
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,280	11,280			11,280
中間純利益	8,741	8,741			8,741
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額 合計	2,538	2,538	0	0	2,538
当中間期末残高	49,261	70,814	0	0	70,814

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の日翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

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

会計上の見積りの変更

第37期中間会計期間

(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

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

(会計方針の変更)

1. 収益認識に関する会計基準等の適用

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

2. 時価の算定に関する会計基準等の適用

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

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

注記事項

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

第37期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

（金融商品関係）

第37期中間会計期間末（2021年9月30日現在）

1. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

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

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

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

(有価証券関係)

第37期中間会計期間末

(2021年9月30日現在)

1. 子会社株式

関係会社株式(中間貸借対照表計上額5,299百万円)で市場価格のあるものはありません。

2. その他有価証券

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

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2021年4月1日から2021年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

(2) 損益計算書項目

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

（収益認識関係）

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第37期中間会計期間
（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

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

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

2. 収益を理解するための基礎となる情報

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

（セグメント情報等）

第37期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（1株当たり情報）

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

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2021年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
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2021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け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

2021年5月26日

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

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2021年6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

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2021年5月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）の2021年5月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年11月25日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年12月17日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦
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2021年5月11日から2021年11月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)の2021年11月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(2021年5月11日から2021年11月10日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注1) 上記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。