

# One DC 国内株式インデックス ファンド

追加型投信／国内／株式（インデックス型）

- この目論見書により行う「One DC 国内株式インデックスファンド」の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第5条の規定により、有価証券届出書を2023年11月7日に関東財務局長に提出しており、2023年11月8日にその効力が生じております。
- 「One DC 国内株式インデックスファンド」の基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益は全て投資家のみなさまに帰属します。したがって、ファンドは、元本が保証されているものではありません。

## アセットマネジメントOne株式会社

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。  
ファンドは、課税上「株式投資信託」として取り扱われます。

### ■委託会社への照会先

【コールセンター】 **0120-104-694** (受付時間：営業日の午前9時～午後5時)

【ホームページアドレス】 <https://www.am-one.co.jp/>

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 杉原 規之
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
有価証券届出書の写しを縦覧に供する場所	該当事項はありません。

## 目 次

第一部【証券情報】	1
第二部【ファンド情報】	4
第1【ファンドの状況】	4
第2【管理及び運営】	35
第3【ファンドの経理状況】	42
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	113
第三部【委託会社等の情報】	115
第1【委託会社等の概況】	115
約款	144

## 第一部【証券情報】

### (1) 【ファンドの名称】

One DC 国内株式インデックスファンド  
(以下「ファンド」または「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】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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ており、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（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、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）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（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（以下、「委託会社」といいます。）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。

### (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】

お申込日の基準価額※とします。

※「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の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基準価額で表示することがあります。）

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

#### <基準価額の照会方法等>

基準価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

### (5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

ただし、収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2023年11月8日から2024年5月7日まで

ただし、お申込みの取扱いは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。

※継続申込期間は、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】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

※販売会社は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

(9) 【払込期日】

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社の定める方法により、販売会社を買付代金を支払うものとします。

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

(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

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」に従って分配金累積投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものと

します。

お申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。また、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができます。

※受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者に係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係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。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### ○振替受益権について

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。

ファンドの収益分配金、償還金、解約代金は、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。

(参考)

#### ◆投資信託振替制度

投資信託振替制度とは、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するものです。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ので、受益証券は発行されません。

## 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】

- ①当ファンドは、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当ファンドの信託金の限度額は、1兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

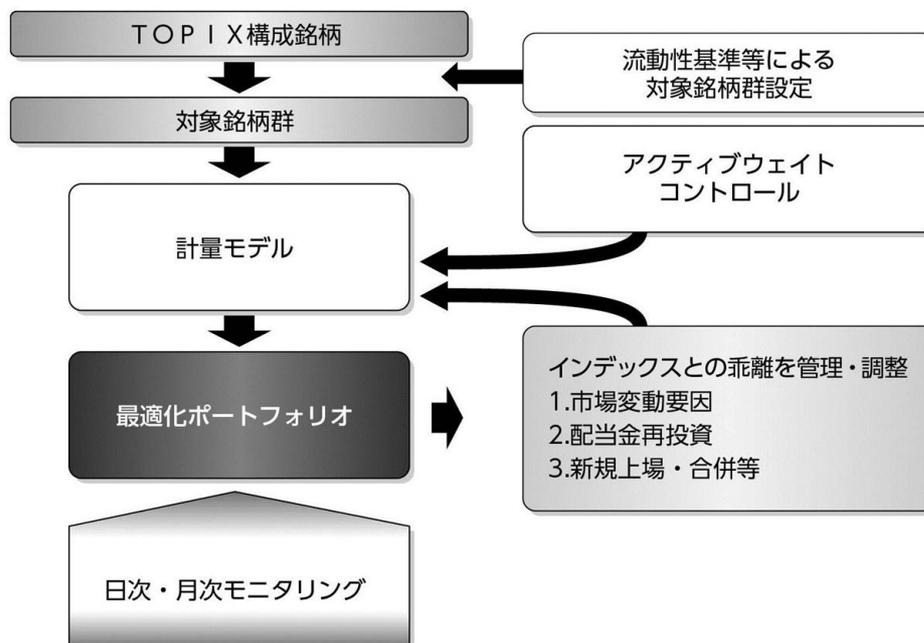
<ファンドの特色>

## 1 主に国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資を行い、「東証株価指数(TOPIX) (配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。

指数の著作権等

- ①東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。
- ②JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数（TOPIX）にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- ③JPXは、東証株価指数（TOPIX）の指数値および東証株価指数（TOPIX）にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（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。
- ④JPXは、東証株価指数（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、JPXは、東証株価指数（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本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ⑦JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（TOPIX）の指数値を算出する銘柄構成および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、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

**2** 流動性基準等により投資対象銘柄を設定し、インデックス(東証株価指数(TOPIX)(配当込み))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。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。



**3** 株式(株価指数先物取引を含みます。)の実質組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。

## ■ 分配方針

年1回の決算時(毎年2月7日(休業日の場合は翌営業日。))に、経費控除後の利子配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

- 将来の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。
- 分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

○商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

追加型投信	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います。
国内	目論見書また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います。
株式	目論見書また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います。
インデックス型	目論見書また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めざす旨の記載があるものをいいます。

○属性区分表

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

(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 (株式))	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として株式へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。 (注) 商品分類表の投資対象資産は株式に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産(投資信託証券(株式))に分類されます。
年1回	目論見書また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います。
日本	目論見書また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います。
ファミリーファンド	目論見書また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います。

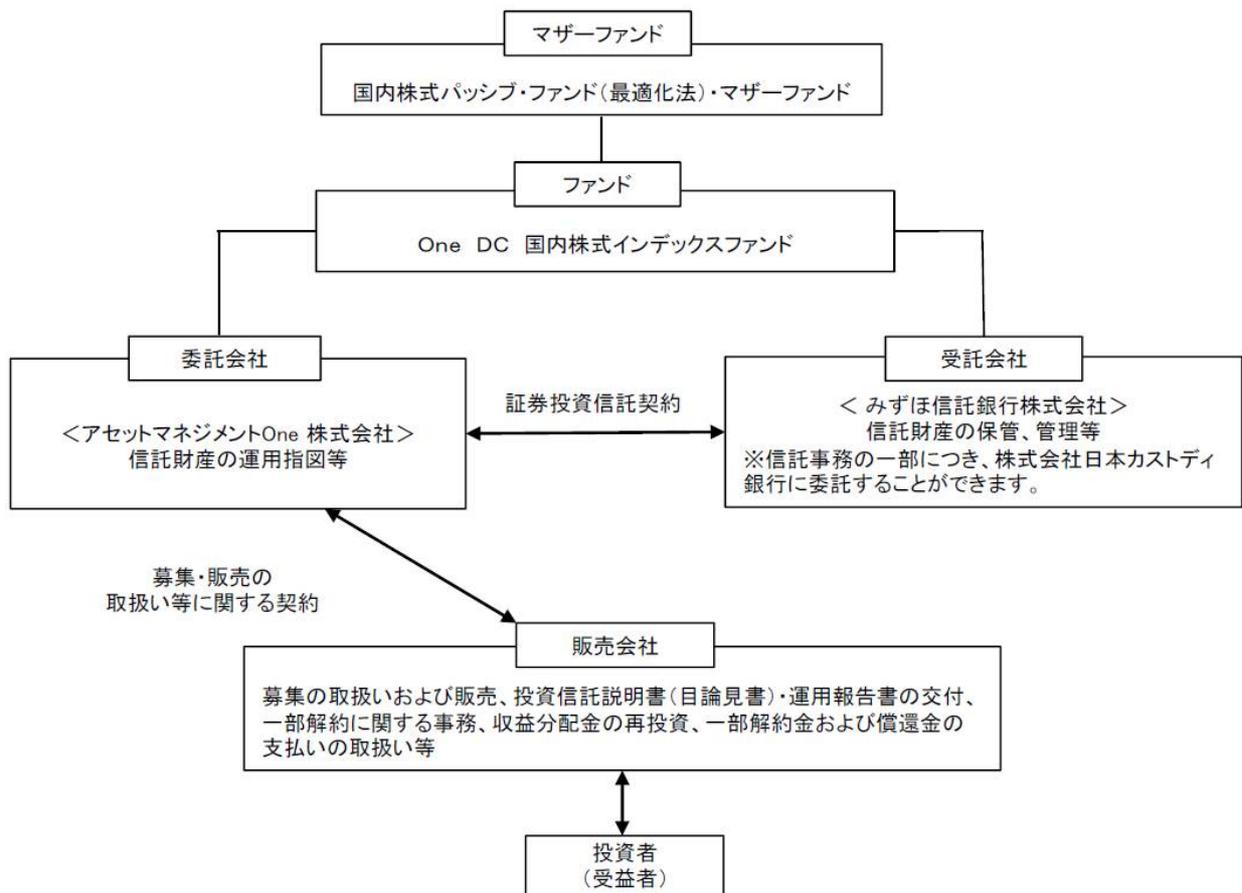
※上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) でご覧いただけます。

## (2) 【ファンドの沿革】

2007年9月27日	信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
2014年8月29日	信託報酬率の変更
2015年8月28日	信託報酬率の変更
2019年4月1日	信託報酬率の変更
2019年10月1日	ファンドの名称を「D I A M DC 国内株式インデックスファンド」から「O n e DC 国内株式インデックスファンド」に変更 信託報酬率の変更

## (3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。

当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

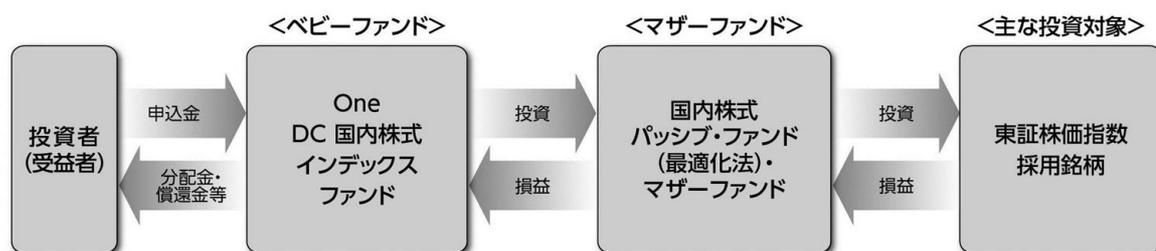
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約事務、収益分配金の再投資、一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

●ファミリーファンド方式とは●

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド受益証券に投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行います。



## ○委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

### 資本金の額

20億円（2023年8月31日現在）

### 委託会社の沿革

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

### 大株主の状況

(2023年8月31日現在)

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株※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】

#### イ. 基本方針

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

#### ロ. 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。

#### ハ. 投資態度

- ・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し、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・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。
- ・株式（株価指数先物取引を含みます。）の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- ・株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。

当ファンドが対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、上記 1ファンドの性格 (1)ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>をご参照ください。

### (2)【投資対象】

#### 1. 投資の対象とする資産（約款第16条）

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。

a. 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。）

イ. 有価証券

ロ. 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22条、第23条に定めるものに限りません。)

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

b. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

## 2. 有価証券の指図範囲 (約款第17条第1項)

委託会社は、信託金を主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの受益証券のほか、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
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1)～10)の証券または証書の性質を有するもの
- 12) 外国貸付債権信託受益権（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 13) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 14) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 15) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 16) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 17) 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。)
- 18) 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
- 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの

なお、1)の証券または証書、11)ならびに14)の証券または証書のうち1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券および11)ならびに14)の証券または証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

3. 金融商品の指図範囲（約款第17条第2項）

委託会社は、信託金を、上記2. 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。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で5) の権利の性質を有するもの

4. 上記2. の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、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は、委託会社は、信託金を、上記3. の1)から4)まで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。（約款第17条第3項）

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

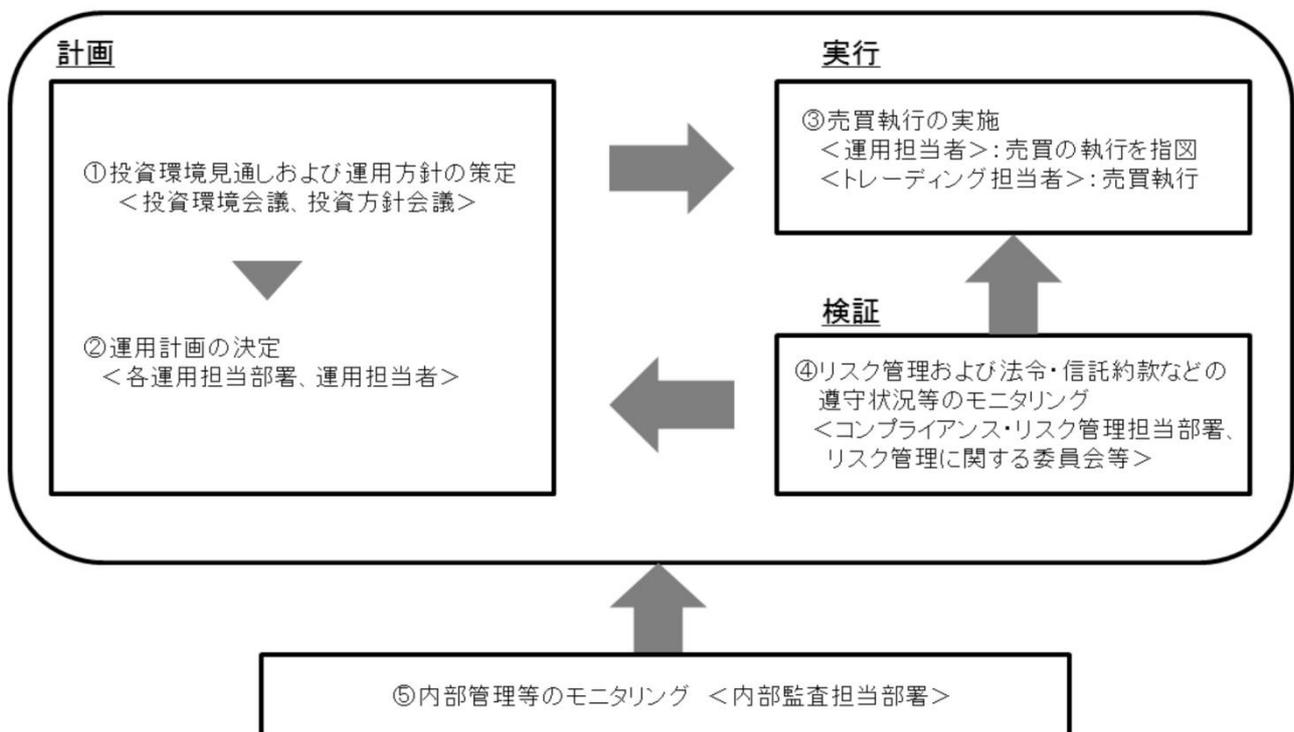
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>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。</li> <li>3. 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>①株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>

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。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

### (3) 【運用体制】

#### a. ファンドの運用体制



#### ① 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

#### ② 運用計画の決定

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。

#### ③ 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。

④ 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。

⑤ 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2023年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

#### (4) 【分配方針】

##### ①収益分配方針

毎決算時（原則として毎年2月7日。ただし、休業日の場合は翌営業日。）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

経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

##### 2) 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

##### 3) 留保金の運用方針

留保金の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

##### ②収益の分配方式

##### 1) 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 信託財産に属する配当等収益（利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）と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。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2. 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

3. 上記1. および2. におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

##### 2) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

##### ③収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資されます。

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。）に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。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。

## (5) 【投資制限】

- 1) 株式への実質投資割合（約款「運用の基本方針」2. 運用方法（3）投資制限）  
株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 外貨建資産への実質投資割合（約款「運用の基本方針」2. 運用方法（3）投資制限）  
外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 3) マザーファンドの受益証券への投資割合には制限を設けません。（約款「運用の基本方針」2. 運用方法（3）投資制限）
- 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。（約款「運用の基本方針」2. 運用方法（3）投資制限）
- 5) 投資する株式等の範囲（約款第20条）
  - (a) 委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。
  - (b) 上記(a)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式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。
- 6) 信用取引の指図範囲（約款第21条）
  - (a) 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、当該売付の決済については、株券の引き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てします。
  - (b) 上記(a)の信用取引の指図は、次の1.～5.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、かつ次の1.～5.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
    1. 信託財産に属する株券
    2. 株式分割により取得する株券
    3. 有償増資により取得する株券
    4. 売り出しにより取得する株券
    5. 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（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。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
- 7) 先物取引等の運用指図（約款第22条）
  - (a) 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所におけ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。)および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。)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。)

(b) 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、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

(c) 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、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。

#### 8) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第23条)

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

(b) 金利先渡取引および為替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。

(c) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、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。

(d) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 9) デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第23条の2)

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、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ないものとします。

#### 10) 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第24条)

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1)~2)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

1) 株式の貸付けは、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。

2) 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。

(b) 上記(a)1)2)で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。

(c) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。

#### 11) 特別な場合の外貨建資産への投資制限(約款第26条)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### 12) 外貨為替予約の指図および範囲(約款第27条)

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引を指図することができます。

- (b) 上記(a)の予約取引の指図は、信託財産に属する為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドに信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (c) 上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

### 13) 資金の借入れ（約款第34条）

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、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。
- (b) 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、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- (c) 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。
- (d) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

### 14) 同一法人の発行する株式への投資制限（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について、委託会社が運用の指図を行う全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（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。）の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図してはなりません。

## 3 【投資リスク】

### < 基準価額の主な変動要因 >

当ファンドは、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。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### ○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。

当ファンドは実質的に株式に投資します。株式の価格は一般に大きく変動します。株式市場全体の価格変動あるいは個別銘柄の価格変動により当ファンドの基準価額が下が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。

当ファンドが実質的に投資する株式の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

○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性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。

○収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、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。

受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、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。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことと、受益者毎に異なります。

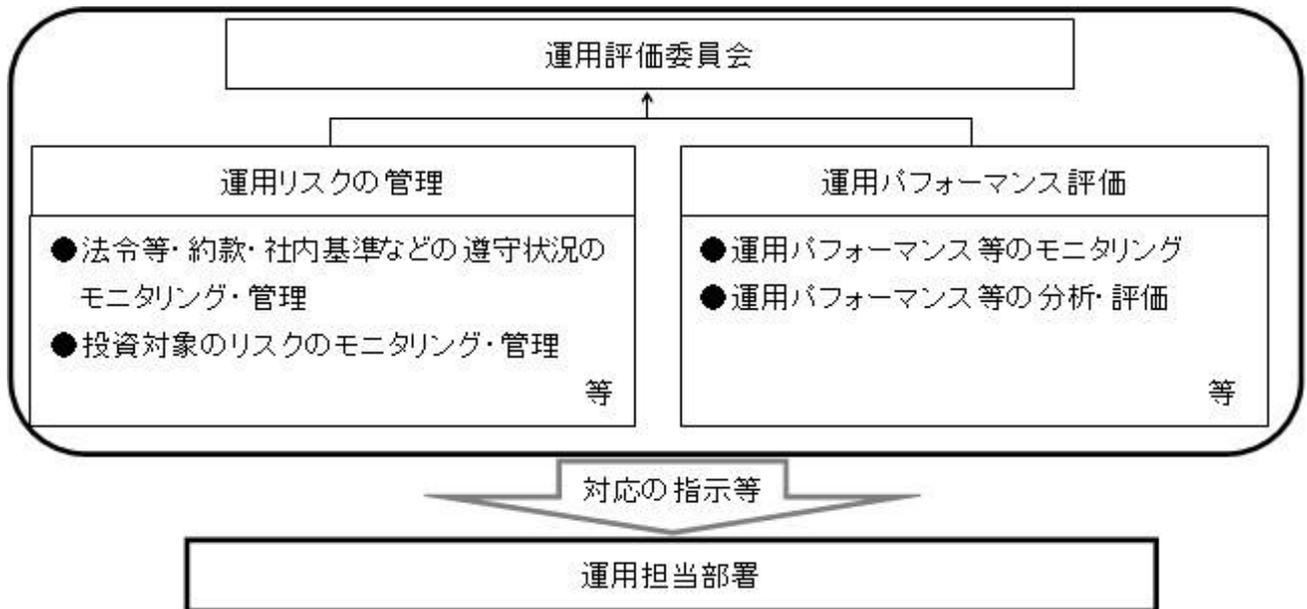
分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

- 当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行いますが、当該インデックス採用全銘柄を組入れない場合があること、資金流入から組入株式の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と当該インデックスが乖離する場合があります。
- 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。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。
- 当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。
- 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。
- 委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。
- 当ファンドは、受益者のため有利と認められる場合、対象インデックスが改廃された場合、その他やむを得ない事情がある場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。
- 注意事項
  - イ. 当ファンドは、実質的に株式など値動きのある有価証券（外貨建資産へ投資する場合には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
  - ロ. 投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
  - ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
  - ニ. 投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<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。



- ・流動性リスク管理：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。

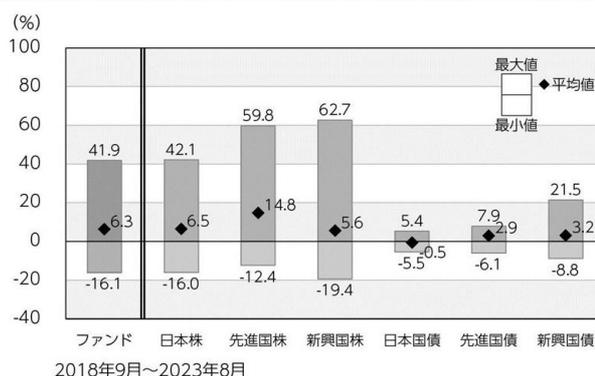
※リスク管理体制は2023年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <参考情報>

### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



### ファンド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く網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）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・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPX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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	[FTSE世界国債インデックス (除く日本)]は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド (円ベース)	[JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド]は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

#### 4 【手数料等及び税金】

##### (1) 【申込手数料】

ありません。

##### (2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

##### (3) 【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.154%（税抜0.14%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.06%	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	年率0.06%	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	年率0.02%	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

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

※信託報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎年8月7日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

◆税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

##### (4) 【その他の手数料等】

###### イ. 信託財産留保額

ありません。

###### ロ. その他の費用

その他費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。

- ① 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。
- ② 監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎年8月7日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。
- ③ 有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に関する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。
- ④ マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相

当額および外貨建資産の保管等に関する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

※上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## (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

### ①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（配当控除の適用なし）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。

### ②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。

### ③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。

※受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

※上記は、2023年8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>

- ①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。
- ②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個別元本の算出が行われる場合があります。
- ③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、①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、②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。

… (参考情報) ファンドの総経費率 …

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.16%	0.15%	0.00%

(表示桁数未満を四捨五入)

※対象期間:2022年2月8日～2023年2月7日

※対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません。消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)です。

※総経費率には、ファンドにより購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税以外にも計算に含まれない費用が存在する場合があります。

※なお、当ファンドについては、入手し得る情報において計算に含まれていない費用はありません。

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

2023年8月31日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	113,227,970,089	100.00
内 日本	113,227,970,089	100.00
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	5,210,800	0.00
純資産総額	113,233,180,889	100.00

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

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

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド

2023年8月31日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	436,095,303,110	97.45
内 日本	436,095,303,110	97.45
コール・ローン、その他の資産 (負債控除後)	11,410,340,250	2.55
純資産総額	447,505,643,360	100.00

その他資産の投資状況

2023年8月31日現在

資産の種類	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引 (買建)	11,535,975,000	2.58
内 日本	11,535,975,000	2.58

(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】

#### ①【投資有価証券の主要銘柄】

2023年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	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	28,129,076,116	3.4158 96,085,649,805	4.0253 113,227,970,089	— —	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年8月31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)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,222,400	1,896.32 13,695,991,310	2,515.00 18,164,336,000	— —	4.06
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	930,400	12,038.97 11,201,060,660	12,145.00 11,299,708,000	— —	2.53
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,113,000	933.17 7,570,847,895	1,163.50 9,439,475,500	— —	2.11
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	131,600	61,162.40 8,048,972,935	60,520.00 7,964,432,000	— —	1.78
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	42,258,400	154.78 6,540,902,793	168.30 7,112,088,720	— —	1.59
6	日立製作所 日本	株式 電気機器	646,000	7,057.14 4,558,915,453	9,694.00 6,262,324,000	— —	1.40
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	920,700	5,622.33 5,176,482,141	6,681.00 6,151,196,700	— —	1.37
8	三菱商事 日本	株式 卸売業	848,500	4,625.78 3,924,975,200	7,196.00 6,105,806,000	— —	1.36
9	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	278,400	15,624.81 4,349,947,981	21,575.00 6,006,480,000	— —	1.34
10	三井物産 日本	株式 卸売業	987,600	3,933.85 3,885,074,565	5,432.00 5,364,643,200	— —	1.20
11	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,167,500	4,197.71 4,900,832,073	4,508.00 5,263,090,000	— —	1.18
12	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,001,000	4,273.35 4,277,626,981	5,220.00 5,225,220,000	— —	1.17
13	任天堂 日本	株式 その他製品	830,400	5,598.37 4,648,893,560	6,267.00 5,204,116,800	— —	1.16
14	信越化学工業 日本	株式 化学	1,095,200	3,874.40 4,243,251,807	4,659.00 5,102,536,800	— —	1.14
15	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,069,200	3,299.16 3,527,463,119	4,703.00 5,028,447,600	— —	1.12
16	第一三共 日本	株式 医薬品	1,149,200	4,128.00 4,743,905,686	4,299.00 4,940,410,800	— —	1.10
17	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	857,500	4,084.33 3,502,316,239	5,472.00 4,692,240,000	— —	1.05
18	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式	1,873,500	2,068.05	2,410.00	—	1.01

	ループ	日本	銀行業		3,874,501,363	4,515,135,000	—	
19	HOYA	日本	株式 精密機器	278,700	14,248.46 3,971,046,437	16,155.00 4,502,398,500	— —	1.01
20	KDDI	日本	株式 情報・通信業	1,019,400	3,979.10 4,056,301,084	4,325.00 4,408,905,000	— —	0.99
21	ソフトバンクグループ	日本	株式 情報・通信業	650,700	6,165.49 4,011,887,771	6,545.00 4,258,831,500	— —	0.95
22	東京海上ホールディングス	日本	株式 保険業	1,280,500	2,721.16 3,484,455,422	3,227.00 4,132,173,500	— —	0.92
23	ダイキン工業	日本	株式 機械	158,600	23,012.64 3,649,805,550	25,225.00 4,000,685,000	— —	0.89
24	オリエンタルランド	日本	株式 サービス業	715,600	4,347.10 3,110,786,535	5,249.00 3,756,184,400	— —	0.84
25	ソフトバンク	日本	株式 情報・通信業	2,120,300	1,529.44 3,242,873,300	1,670.00 3,540,901,000	— —	0.79
26	村田製作所	日本	株式 電気機器	398,900	7,722.21 3,080,390,194	8,185.00 3,264,996,500	— —	0.73
27	SMC	日本	株式 機械	43,100	68,001.90 2,930,882,070	70,600.00 3,042,860,000	— —	0.68
28	セブン&アイ・ホールディングス	日本	株式 小売業	479,600	5,948.12 2,852,721,959	5,981.00 2,868,487,600	— —	0.64
29	アステラス製薬	日本	株式 医薬品	1,246,200	1,915.41 2,386,990,648	2,214.50 2,759,709,900	— —	0.62
30	デンソー	日本	株式 輸送用機器	271,300	7,379.40 2,002,032,144	9,959.00 2,701,876,700	— —	0.60

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2023年8月31日現在

種類	投資比率 (%)
株式	97.45
合計	97.45

(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

2023年8月31日現在

業種	国内／外国	投資比率 (%)
電気機器	国内	16.87
輸送用機器		8.14
情報・通信業		7.89
卸売業		6.66
銀行業		6.41
化学		5.82
機械		5.37

医薬品	5.00
サービス業	4.79
小売業	4.28
食料品	3.30
陸運業	2.90
精密機器	2.33
その他製品	2.22
保険業	2.20
建設業	2.05
不動産業	1.84
電気・ガス業	1.35
その他金融業	1.13
鉄鋼	0.96
証券、商品先物取引業	0.72
ゴム製品	0.67
ガラス・土石製品	0.67
海運業	0.65
非鉄金属	0.64
金属製品	0.50
空運業	0.48
石油・石炭製品	0.45
繊維製品	0.41
鉱業	0.35
パルプ・紙	0.17
倉庫・運輸関連業	0.14
水産・農林業	0.08
合計	97.45

(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。

## ②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド  
該当事項はありません。

## ③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0509月	買建	495	11,309,133,350	11,535,975,000	2.58

(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】

#### ① 【純資産の推移】

直近日（2023年8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7計算期間末 (2014年2月7日)	6,573	6,573	0.8241	0.8241
第8計算期間末 (2015年2月9日)	8,261	8,261	1.0056	1.0056
第9計算期間末 (2016年2月8日)	11,225	11,225	0.9911	0.9911
第10計算期間末 (2017年2月7日)	13,968	13,968	1.1107	1.1107
第11計算期間末 (2018年2月7日)	22,544	22,544	1.3067	1.3067
第12計算期間末 (2019年2月7日)	30,214	30,214	1.1958	1.1958
第13計算期間末 (2020年2月7日)	37,717	37,717	1.3513	1.3513
第14計算期間末 (2021年2月8日)	49,849	49,849	1.5351	1.5351
第15計算期間末 (2022年2月7日)	65,141	65,141	1.5668	1.5668
第16計算期間末 (2023年2月7日)	83,858	83,858	1.6554	1.6554
2022年8月末日	73,926	—	1.6189	—
9月末日	71,196	—	1.5299	—
10月末日	76,926	—	1.6077	—
11月末日	80,377	—	1.6548	—
12月末日	78,605	—	1.5790	—
2023年1月末日	83,543	—	1.6487	—
2月末日	85,282	—	1.6641	—
3月末日	88,577	—	1.6921	—
4月末日	91,714	—	1.7375	—
5月末日	96,756	—	1.7999	—
6月末日	107,217	—	1.9357	—
7月末日	110,672	—	1.9645	—
8月末日	113,233	—	1.9726	—

#### ② 【分配の推移】

	1口当たりの分配金 (円)
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
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
2023年2月8日～2023年8月7日	—

### ③【収益率の推移】

	収益率 (%)
第7計算期間	24.8
第8計算期間	22.0
第9計算期間	△1.4
第10計算期間	12.1
第11計算期間	17.6
第12計算期間	△8.5
第13計算期間	13.0
第14計算期間	13.6
第15計算期間	2.1
第16計算期間	5.7
2023年2月8日～2023年8月7日	16.7

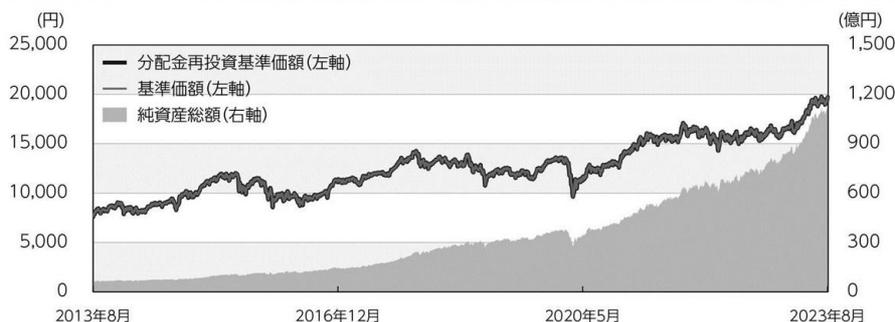
(注) 収益率は期間騰落率です。

### (4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第7計算期間	6,733,843,082	5,604,546,552
第8計算期間	5,119,097,831	4,880,240,628
第9計算期間	8,364,610,514	5,254,249,325
第10計算期間	7,572,230,014	6,321,925,379
第11計算期間	11,590,956,335	6,914,819,396
第12計算期間	14,073,136,483	6,058,109,779
第13計算期間	10,454,492,002	7,809,755,170
第14計算期間	13,421,884,000	8,860,777,863
第15計算期間	16,850,759,487	7,748,660,236
第16計算期間	18,140,275,590	9,057,542,219
2023年2月8日～ 2023年8月7日	12,204,461,250	6,389,763,743

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

### 基準価額・純資産の推移 《2013年8月30日～2023年8月31日》



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。  
 ※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。  
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
 (設定日:2007年9月27日)

### 分配の推移(税引前)

2019年 2月	0円
2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
2022年 2月	0円
2023年 2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

### 主要な資産の状況

#### ■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

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	100.00

#### ■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

##### 資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	97.45
内 日本	97.45
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.55
合計(純資産総額)	100.00

##### 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	4.06
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.53
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.11
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.78
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.59
6	日立製作所	株式	日本	電気機器	1.40
7	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.37
8	三菱商事	株式	日本	卸売業	1.36
9	東京エレクトロン	株式	日本	電気機器	1.34
10	三井物産	株式	日本	卸売業	1.20

##### その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.58

##### 株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	16.87
2	輸送用機器	8.14
3	情報・通信業	7.89
4	卸売業	6.66
5	銀行業	6.41

### 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。  
 ※2023年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。  
 ○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

お申込みの方法

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。  
当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。
- ・当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」に従って分配金累積投資に関する契約を締結します。  
なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。
- ・当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までに申込みが行われ、かつ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。
- ・委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

※受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、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係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係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。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

お申込価額（発行価格）

お申込日の基準価額※とします。

※「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の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基準価額で表示することがあります。）

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

<基準価額の照会方法等>

基準価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

お申込単位

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

ただし、収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位

お申込手数料

ありません。

払込期日

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

## 2【換金（解約）手続等】

### 解約のお申込み方法

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に1口単位をもって解約の請求をすることができます。

受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

※解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

※信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※解約の請求を行う受益者は、その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係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約に係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。

※委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、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解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

## 解約価額

解約価額は、解約請求受付日の基準価額とします。

※解約価額は委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

## 解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して5営業日目から販売会社の営業所等においてお支払いします。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

基準価額とは、純資産総額（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したが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）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※における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日において、委託会社にて計算されます。

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <https://www.am-one.co.jp/>

コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

#### (2) 【保管】

該当事項はありません。

### (3) 【信託期間】

信託期間は2007年9月27日から無期限です。

※下記(5)イ.の場合には信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

### (4) 【計算期間】

a. 計算期間は原則として毎年2月8日から翌年2月7日までとします。

b. 上記a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、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】

#### イ. 償還規定

- a. 委託会社は、信託終了前にこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃の場合、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、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- b. 委託会社は上記a.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- c. 上記a.につき、上記b.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- d. 委託会社は信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- e. 上記b.～d.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であつて、上記b.の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

- h. 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。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更」の規定に従い、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. 上記b. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

#### ロ. 信託約款の変更

- a. 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ができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、上記a. の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b. の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c. に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 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a. ～e. の規定に従います。
- g. 上記c. に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

#### ハ. 関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として期間満了の3ヵ月前までに、当事者間の別段の意思表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

## ニ. 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、委託会社のホームページに掲載します。

(URL <https://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て行います。

## ホ. 運用報告書

- ・委託会社は、毎年2月7日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

(URL <https://www.am-one.co.jp/>)

## 4【受益者の権利等】

### ①収益分配金請求権

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付され、販売会社により自動的に再投資されます。

販売会社は、累積投資約款に基づき、毎計算期間の末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計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）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けを行います。当該売付け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、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

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

③一部解約請求権

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

④帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
  
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第16期計算期間（2022年2月8日から2023年2月7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。

# 独立監査人の監査報告書

2023年4月7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

## 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One DC 国内株式インデックスファンドの2022年2月8日から2023年2月7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、One DC 国内株式インデックスファンドの2023年2月7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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 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、継続企業的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) 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

1【財務諸表】

【One DC 国内株式インデックスファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第15期 2022年2月7日現在	第16期 2023年2月7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	145,933,648	264,167,212
親投資信託受益証券	65,139,109,229	83,855,522,086
未収入金	—	20,219,000
流動資産合計	65,285,042,877	84,139,908,298
資産合計	65,285,042,877	84,139,908,298
負債の部		
流動負債		
未払解約金	95,190,877	221,459,749
未払受託者報酬	6,848,859	8,481,178
未払委託者報酬	41,093,304	50,887,250
その他未払費用	320,496	379,306
流動負債合計	143,453,536	281,207,483
負債合計	143,453,536	281,207,483
純資産の部		
元本等		
元本	41,575,264,407	50,657,997,778
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	23,566,324,934	33,200,703,037
(分配準備積立金)	8,953,582,578	11,053,520,359
元本等合計	65,141,589,341	83,858,700,815
純資産合計	65,141,589,341	83,858,700,815
負債純資産合計	65,285,042,877	84,139,908,298

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第15期 自 2021年2月9日 至 2022年2月7日	第16期 自 2022年2月8日 至 2023年2月7日
営業収益		
受取利息	472	1,699
有価証券売買等損益	951,671,811	4,516,931,857
営業収益合計	951,672,283	4,516,933,556
営業費用		
支払利息	34,662	67,712
受託者報酬	12,741,495	15,893,277
委託者報酬	76,449,382	95,360,042
その他費用	607,914	720,239
営業費用合計	89,833,453	112,041,270
営業利益又は営業損失(△)	861,838,830	4,404,892,286
経常利益又は経常損失(△)	861,838,830	4,404,892,286
当期純利益又は当期純損失(△)	861,838,830	4,404,892,286
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(△)	360,838,678	202,546,302
期首剰余金又は期首欠損金(△)	17,376,821,762	23,566,324,934
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,893,720,432	10,566,539,046
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	9,893,720,432	10,566,539,046
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,205,217,412	5,134,506,927
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,205,217,412	5,134,506,927
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(△)	23,566,324,934	33,200,703,037

(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16期	
	自 2022年2月8日	至 2023年2月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第15期	第16期
	2022年2月7日現在	2023年2月7日現在
1. 期首元本額	32,473,165,156円	41,575,264,407円
期中追加設定元本額	16,850,759,487円	18,140,275,590円
期中一部解約元本額	7,748,660,236円	9,057,542,219円
2. 受益権の総数	41,575,264,407口	50,657,997,778口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第15期	第16期
	自 2021年2月9日 至 2022年2月7日	自 2022年2月8日 至 2023年2月7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(1,090,468,661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(27,732,115,185円)及び分配準備積立金(7,863,113,917円)より分配対象収益は36,685,697,763円(1万口当たり8,823.92円)ですが、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(1,796,011,592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(1,923,491,679円)、信託約款に規定される収益調整金(37,401,893,495円)及び分配準備積立金(7,334,017,088円)より分配対象収益は48,455,413,854円(1万口当たり9,565.20円)ですが、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15期	第16期
	自 2021年2月9日 至 2022年2月7日	自 2022年2月8日 至 2023年2月7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	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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>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。運用評価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>	同左
-------------------	---	----

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第15期 2022年2月7日現在	第16期 2023年2月7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	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	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。	金融商品の時価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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第15期 2022年2月7日現在	第16期 2023年2月7日現在
	当期の 損益に含まれた	当期の 損益に含まれた

	評価差額 (円)	評価差額 (円)
親投資信託受益証券	899,766,148	4,475,281,266
合計	899,766,148	4,475,281,266

(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15期 2022年2月7日現在	第16期 2023年2月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,5668円 (15,668円)	1,6554円 (16,554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

2023年2月7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	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファン ド	24,845,344,460	83,855,522,086	
親投資信託受益証券	合計	24,845,344,460	83,855,522,086	
合計			83,855,522,086	

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

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)

2023年2月7日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,105,053,675
株式	389,230,950,760
派生商品評価勘定	273,527,950
未収入金	5,796,700
未収配当金	620,986,739
差入委託証拠金	315,900,000
流動資産合計	397,552,215,824
資産合計	397,552,215,824
負債の部	
流動負債	
前受金	279,330,000
未払解約金	289,963,000
流動負債合計	569,293,000
負債合計	569,293,000
純資産の部	
元本等	
元本	117,622,712,134
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	279,360,210,690
元本等合計	396,982,922,824
純資産合計	396,982,922,824
負債純資産合計	397,552,215,824

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2022年2月8日 至 2023年2月7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	2023年2月7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	124,570,625,521円
同期中追加設定元本額	128,363,975,255円
同期中一部解約元本額	135,311,888,642円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOPIXオープン	2,645,423,721円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	4,020,227,881円
One DC 国内株式インデックスファンド	24,845,344,460円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,943,887,105円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	2,060,345円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	14,320,221円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	40,143,190円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	26,541,745円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	24,853,218円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	28,002,416円
たわらノーロード TOPIX	1,674,620,773円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,460,942,246円
たわらノーロード バランス（堅実型）	52,176,853円
たわらノーロード バランス（標準型）	349,503,344円
たわらノーロード バランス（積極型）	550,702,894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）	2,858,868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）	171,426,417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）	431,690,813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）	329,347,990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）	441,937,258円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	413,659円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,761,301円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	32,921,123円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	4,228,726円

たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	12,768,526円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,601,320,487円
O n eグローバルバランス	9,945,679円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	1,069,194,980円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3,604,894,445円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3,977,108,233円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	337,230,087円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,073,452,202円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	1,128,091,784円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	31,667,873円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,158,418,676円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	15,484,653円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	305,935,932円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	356,000,978円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	576,024,312円
投資のソムリエ	6,962,375,127円
クルーズコントロール	371,076,985円
投資のソムリエ<DC年金>	512,324,687円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	369,360,628円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	886,808,363円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	690,449,672円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,925,993,896円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	57,858,403円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	29,095,833円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	4,863,218円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	100,473,455円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	494,603,718円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	556,231,620円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	276,065,472円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	42,963,704円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	31,180,825円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	19,176,919円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	373,583,154円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	4,139,504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)	70,190,490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)	71,566,262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)	23,234,424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)	43,811,639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)	69,167,191円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04 (適格機関投資家限定)	173,752,833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)	194,219,300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)	62,459,767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) 2022-05 (適格機関投資家限定)	198,034,533円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）2022-10（適格機関投資家限定）	500,445,383円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	188,318,998円
AMOne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）（適格機関投資家限定）	27,824,141円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	29,351,203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）	230,704,117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）	119,336,352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）	3,665,294円
しあわせの一步・私募（適格機関投資家限定）	7,940,239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）	45,113,121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）	88,905,582円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	3,022,472円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	18,327,200円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	4,076,237円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	90,458円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	5,854,508円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	26,240,499円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	416,572,017円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	515,249,605円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,525,175,305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）	15,914,184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）	21,162,392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）	223,693,267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）	49,325,464円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	65,368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）	274,002,585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）	16,040,531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）	53,951,794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）	122,912,087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）	171,605,339円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	31,023,888円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	15,258,914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）	743,503,325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）	1,220,307,862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）	48,743,066円
動的パッケージファンド<DC年金>	25,881,642円
コア資産形成ファンド	17,452,381円
MHAMトピックスファンド	770,553,770円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	50,331,323円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	3,300,674,671円

MHAM日本株式パッシブファンド [適格機関投資家限定] 計	1,491,222,882円 117,622,712,134円
2. 受益権の総数	117,622,712,134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 2022年2月8日 至 2023年2月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年2月7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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2023年2月7日現在
----	-------------

	当期の 損益に含まれた 評価差額 (円)
株式	12,267,234,809
合計	12,267,234,809

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2023年2月7日現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	7,347,420,000	—	7,621,075,000	273,655,000
合計	7,347,420,000	—	7,621,075,000	273,655,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年2月7日現在
1口当たり純資産額	3,3751円
(1万口当たり純資産額)	(33,751円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2023年2月7日現在

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
極洋	7,300	3,640.00	26,572,000	
ニッセイ	191,500	526.00	100,729,000	
マルハニチロ	28,400	2,385.00	67,734,000	
雪国まいたけ	16,300	1,038.00	16,919,400	
カネコ種苗	5,900	1,650.00	9,735,000	
サカタのタネ	21,800	4,090.00	89,162,000	
ホクト	17,000	1,862.00	31,654,000	
ホクリヨウ	2,500	905.00	2,262,500	
ショーボンドホールディングス	26,100	5,360.00	139,896,000	
ミライト・ワン	66,500	1,521.00	101,146,500	
タマホーム	12,100	3,180.00	38,478,000	
サンヨーホームズ	2,200	728.00	1,601,600	
日本アクア	7,100	955.00	6,780,500	

ファーストコーポレーション	4,300	711.00	3,057,300
ベステラ	3,700	892.00	3,300,400
Robot Home	32,700	167.00	5,460,900
キャンディル	2,700	503.00	1,358,100
住石ホールディングス	26,400	345.00	9,108,000
日鉄鉱業	7,600	3,420.00	25,992,000
三井松島ホールディングス	8,700	3,120.00	27,144,000
INPEX	707,900	1,398.00	989,644,200
石油資源開発	22,200	4,165.00	92,463,000
K&Oエナジーグループ	8,700	2,046.00	17,800,200
ダイセキ環境ソリューション	3,400	951.00	3,233,400
第一カッター興業	5,100	1,030.00	5,253,000
明豊ファシリティワークス	6,300	787.00	4,958,100
安藤・間	110,900	842.00	93,377,800
東急建設	54,600	646.00	35,271,600
コムシスホールディングス	64,800	2,416.00	156,556,800
ビーアールホールディングス	30,500	339.00	10,339,500
高松コンストラクショングループ	12,500	1,916.00	23,950,000
東建コーポレーション	5,500	7,490.00	41,195,000
ソネック	2,000	945.00	1,890,000
ヤマウラ	9,800	1,031.00	10,103,800
オリエンタル白石	68,700	298.00	20,472,600
大成建設	133,200	4,290.00	571,428,000
大林組	478,700	969.00	463,860,300
清水建設	402,500	704.00	283,360,000
飛島建設	14,900	1,037.00	15,451,300
長谷工コーポレーション	138,200	1,474.00	203,706,800
松井建設	12,600	589.00	7,421,400
銭高組	1,500	2,715.00	4,072,500
鹿島建設	296,900	1,518.00	450,694,200
不動テトラ	9,300	1,540.00	14,322,000
大末建設	4,300	1,149.00	4,940,700
鉄建建設	9,600	1,793.00	17,212,800
西松建設	22,700	3,340.00	75,818,000
三井住友建設	107,500	414.00	44,505,000
大豊建設	5,600	3,605.00	20,188,000
佐田建設	7,700	539.00	4,150,300
ナカノブドー建設	8,500	332.00	2,822,000
奥村組	21,700	2,975.00	64,557,500
東鉄工業	18,500	2,619.00	48,451,500
イチケン	2,700	1,808.00	4,881,600
富士ピー・エス	6,100	451.00	2,751,100
浅沼組	10,700	3,150.00	33,705,000
戸田建設	164,600	686.00	112,915,600
熊谷組	23,200	2,572.00	59,670,400
北野建設	2,300	2,734.00	6,288,200
植木組	3,400	1,335.00	4,539,000
矢作建設工業	18,400	790.00	14,536,000
ピーエス三菱	17,200	631.00	10,853,200
日本ハウスホールディングス	26,600	385.00	10,241,000

大東建託	49,200	12,510.00	615,492,000
新日本建設	18,800	835.00	15,698,000
東亜道路工業	2,300	6,170.00	14,191,000
日本道路	2,700	6,140.00	16,578,000
東亜建設工業	11,500	2,480.00	28,520,000
日本国土開発	40,200	544.00	21,868,800
若築建設	6,000	2,992.00	17,952,000
東洋建設	43,400	874.00	37,931,600
五洋建設	189,900	631.00	119,826,900
世紀東急工業	17,700	790.00	13,983,000
福田組	5,100	4,510.00	23,001,000
日本ドライケミカル	3,000	1,617.00	4,851,000
住友林業	102,700	2,427.00	249,252,900
日本基礎技術	7,200	533.00	3,837,600
巴コーポレーション	13,500	410.00	5,535,000
大和ハウス工業	374,100	3,044.00	1,138,760,400
ライト工業	25,500	1,855.00	47,302,500
積水ハウス	419,400	2,475.00	1,038,015,000
日特建設	12,900	920.00	11,868,000
北陸電気工事	9,300	695.00	6,463,500
ユアテック	29,900	741.00	22,155,900
日本リーテック	8,900	877.00	7,805,300
四電工	5,700	1,791.00	10,208,700
中電工	20,800	2,079.00	43,243,200
関電工	73,600	846.00	62,265,600
きんでん	94,500	1,429.00	135,040,500
東京エネシス	13,300	895.00	11,903,500
トーエネック	4,400	3,360.00	14,784,000
住友電設	12,800	2,341.00	29,964,800
日本電設工業	22,000	1,498.00	32,956,000
エクシオグループ	61,500	2,292.00	140,958,000
新日本空調	7,400	1,905.00	14,097,000
日本工営	8,500	3,545.00	30,132,500
九電工	32,600	3,195.00	104,157,000
三機工業	29,700	1,494.00	44,371,800
日揮ホールディングス	132,400	1,662.00	220,048,800
中外炉工業	4,400	1,750.00	7,700,000
ヤマト	10,100	794.00	8,019,400
太平電業	8,400	3,375.00	28,350,000
高砂熱学工業	32,300	1,815.00	58,624,500
三晃金属工業	1,400	3,730.00	5,222,000
NEC ネットエスアイ	45,700	1,610.00	73,577,000
朝日工業社	5,600	2,069.00	11,586,400
明星工業	23,000	783.00	18,009,000
大気社	16,100	3,420.00	55,062,000
ダイダン	8,900	2,176.00	19,366,400
日比谷総合設備	11,500	1,945.00	22,367,500
ニッポン	36,300	1,595.00	57,898,500
日清製粉グループ本社	124,300	1,559.00	193,783,700
日東富士製粉	2,200	4,325.00	9,515,000

昭和産業	11,800	2,476.00	29,216,800
鳥越製粉	9,800	585.00	5,733,000
中部飼料	18,700	1,025.00	19,167,500
フィード・ワン	19,700	675.00	13,297,500
東洋精糖	2,400	867.00	2,080,800
日本甜菜製糖	8,000	1,635.00	13,080,000
DM三井製糖ホールディングス	13,300	2,016.00	26,812,800
塩水港精糖	14,900	194.00	2,890,600
ウェルネオシュガー	7,000	1,643.00	11,501,000
L I F U L L	48,000	221.00	10,608,000
M I X I	31,900	2,475.00	78,952,500
ジェイエイシーリクルートメント	12,700	2,314.00	29,387,800
日本M&Aセンターホールディングス	240,800	1,342.00	323,153,600
メンバーズ	4,100	1,738.00	7,125,800
中広	1,000	387.00	387,000
UTグループ	20,600	2,472.00	50,923,200
アイティメディア	5,400	1,519.00	8,202,600
E・Jホールディングス	8,200	1,345.00	11,029,000
オープンアップグループ	42,000	1,866.00	78,372,000
コシダカホールディングス	42,000	912.00	38,304,000
アルトナー	3,100	994.00	3,081,400
パソナグループ	17,000	2,045.00	34,765,000
CDS	3,200	1,803.00	5,769,600
リンクアンドモチベーション	40,300	641.00	25,832,300
エス・エム・エス	53,400	3,455.00	184,497,000
サニーサイドアップグループ	3,800	557.00	2,116,600
パーソルホールディングス	157,100	2,841.00	446,321,100
リニカル	7,100	709.00	5,033,900
クックパッド	38,400	217.00	8,332,800
エスクリ	5,200	331.00	1,721,200
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,200	626.00	3,881,200
森永製菓	24,900	3,715.00	92,503,500
中村屋	2,800	3,050.00	8,540,000
江崎グリコ	38,500	3,530.00	135,905,000
名糖産業	5,500	1,679.00	9,234,500
井村屋グループ	7,200	2,232.00	16,070,400
不二家	9,300	2,518.00	23,417,400
山崎製パン	90,000	1,492.00	134,280,000
第一屋製パン	2,200	387.00	851,400
モロゾフ	4,300	3,400.00	14,620,000
亀田製菓	8,600	4,260.00	36,636,000
寿スピリッツ	14,300	8,670.00	123,981,000
カルビー	61,500	2,908.00	178,842,000
森永乳業	24,500	4,670.00	114,415,000
六甲バター	9,900	1,338.00	13,246,200
ヤクルト本社	96,100	9,090.00	873,549,000
明治ホールディングス	83,400	6,730.00	561,282,000
雪印メグミルク	32,600	1,768.00	57,636,800
プリマハム	18,200	2,216.00	40,331,200
日本ハム	52,600	3,655.00	192,253,000

林兼産業	3,700	468.00	1,731,600
丸大食品	13,500	1,455.00	19,642,500
S Foods	14,900	2,886.00	43,001,400
柿安本店	5,300	2,004.00	10,621,200
伊藤ハム米久ホールディングス	104,700	702.00	73,499,400
学情	6,400	1,384.00	8,857,600
スタジオアリス	7,000	2,093.00	14,651,000
クロスキャット	7,800	1,348.00	10,514,400
シミックホールディングス	7,700	1,725.00	13,282,500
エプロ	2,700	738.00	1,992,600
システナ	230,200	361.00	83,102,200
N J S	2,600	2,187.00	5,686,200
デジタルアーツ	8,700	5,550.00	48,285,000
日鉄ソリューションズ	23,400	3,300.00	77,220,000
総合警備保障	52,100	3,525.00	183,652,500
キューブシステム	8,300	1,077.00	8,939,100
いちご	154,800	288.00	44,582,400
日本駐車場開発	160,100	258.00	41,305,800
コア	5,900	1,508.00	8,897,200
カカクコム	104,700	2,141.00	224,162,700
アイロムグループ	5,100	2,416.00	12,321,600
セントケア・ホールディング	9,100	820.00	7,462,000
サイネックス	2,200	553.00	1,216,600
ルネサンス	9,800	923.00	9,045,400
ディップ	24,600	3,990.00	98,154,000
S B Sホールディングス	12,200	2,934.00	35,794,800
デジタルホールディングス	10,900	1,273.00	13,875,700
新日本科学	14,900	2,534.00	37,756,600
キャリアデザインセンター	2,600	1,878.00	4,882,800
ベネフィット・ワン	65,000	2,291.00	148,915,000
エムスリー	277,300	3,598.00	997,725,400
ツカダ・グローバルホールディング	7,800	390.00	3,042,000
ブラス	1,700	1,137.00	1,932,900
アウトソーシング	83,600	985.00	82,346,000
ウェルネット	9,500	676.00	6,422,000
ワールドホールディングス	6,300	2,584.00	16,279,200
ディー・エヌ・エー	59,900	1,804.00	108,059,600
博報堂D Yホールディングス	178,900	1,401.00	250,638,900
ぐるなび	25,800	393.00	10,139,400
タカミヤ	19,200	389.00	7,468,800
ジャパンベストレスキューシステム	8,700	830.00	7,221,000
ファンコミュニケーションズ	27,800	411.00	11,425,800
ライク	5,300	2,019.00	10,700,700
ビジネス・ブレークスルー	4,600	388.00	1,784,800
エスプール	40,300	730.00	29,419,000
W D Bホールディングス	7,100	2,139.00	15,186,900
手間いらず	2,300	4,985.00	11,465,500
ティア	7,400	422.00	3,122,800
C D G	1,400	1,136.00	1,590,400
アドウェイズ	19,300	515.00	9,939,500

バリューコマース	10,500	1,815.00	19,057,500
インフォマート	145,600	423.00	61,588,800
サッポロホールディングス	44,300	3,205.00	141,981,500
アサヒグループホールディングス	310,600	4,325.00	1,343,345,000
キリンホールディングス	606,700	2,031.50	1,232,511,050
宝ホールディングス	91,800	1,034.00	94,921,200
オエノンホールディングス	40,100	258.00	10,345,800
養命酒製造	4,400	1,825.00	8,030,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	105,300	1,331.00	140,154,300
サントリー食品インターナショナル	94,700	4,530.00	428,991,000
ダイドーグループホールディングス	7,600	4,765.00	36,214,000
伊藤園	45,500	4,455.00	202,702,500
キーコーヒー	15,100	2,070.00	31,257,000
ユニカフェ	4,100	896.00	3,673,600
ジャパンフーズ	1,500	1,089.00	1,633,500
日清オイリオグループ	19,000	3,165.00	60,135,000
不二製油グループ本社	31,300	2,026.00	63,413,800
かどや製油	1,200	3,555.00	4,266,000
J-オイルミルズ	13,700	1,545.00	21,166,500
ローソン	35,800	5,110.00	182,938,000
サンエー	11,000	4,150.00	45,650,000
カワチ薬品	11,400	2,266.00	25,832,400
エービーシー・マート	21,100	6,910.00	145,801,000
ハードオフコーポレーション	5,200	1,222.00	6,354,400
高千穂交易	4,500	2,377.00	10,696,500
アスクル	29,800	1,752.00	52,209,600
ゲオホールディングス	15,200	1,822.00	27,694,400
アダストリア	17,400	2,142.00	37,270,800
ジーフット	6,800	299.00	2,033,200
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,700	407.00	691,900
オルバヘルスケアホールディングス	2,000	1,628.00	3,256,000
伊藤忠食品	2,700	4,945.00	13,351,500
くら寿司	16,900	3,185.00	53,826,500
キャンドウ	5,200	2,298.00	11,949,600
エレマテック	13,000	1,763.00	22,919,000
I Kホールディングス	4,000	375.00	1,500,000
パルグループホールディングス	14,100	2,858.00	40,297,800
エディオン	57,200	1,278.00	73,101,600
あらた	11,000	4,140.00	45,540,000
サーラコーポレーション	30,300	725.00	21,967,500
ワッツ	6,300	691.00	4,353,300
トーマンデバイス	2,100	6,410.00	13,461,000
ハローズ	6,600	3,185.00	21,021,000
J Pホールディングス	40,300	335.00	13,500,500
フジオフードグループ本社	12,100	1,403.00	16,976,300
あみやき亭	3,500	2,928.00	10,248,000
東京エレクトロン デバイス	5,400	7,670.00	41,418,000
ひらまつ	27,200	191.00	5,195,200
円谷フィールズホールディングス	12,400	2,495.00	30,938,000

双日	153,300	2,565.00	393,214,500
アルフレッサ ホールディングス	144,900	1,595.00	231,115,500
大黒天物産	4,400	5,340.00	23,496,000
ハニーズホールディングス	11,400	1,509.00	17,202,600
ファーマライズホールディングス	2,900	618.00	1,792,200
キッコーマン	89,100	6,650.00	592,515,000
味の素	329,000	4,101.00	1,349,229,000
ブルドックソース	5,400	1,856.00	10,022,400
キューピー	72,200	2,207.00	159,345,400
ハウス食品グループ本社	41,300	2,686.00	110,931,800
カゴメ	62,700	3,085.00	193,429,500
焼津水産化学工業	5,600	906.00	5,073,600
アリアケジャパン	11,800	4,445.00	52,451,000
ピエトロ	1,700	1,808.00	3,073,600
エバラ食品工業	3,300	3,140.00	10,362,000
やまみ	1,200	1,352.00	1,622,400
ニチレイ	61,600	2,623.00	161,576,800
横浜冷凍	39,400	1,064.00	41,921,600
東洋水産	67,900	5,590.00	379,561,000
イトアンドホールディングス	5,800	2,313.00	13,415,400
大冷	1,700	1,898.00	3,226,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,600	903.00	7,765,800
日清食品ホールディングス	47,300	11,220.00	530,706,000
永谷園ホールディングス	6,700	2,019.00	13,527,300
一正蒲鉾	5,200	703.00	3,655,600
フジッコ	13,900	1,859.00	25,840,100
ロック・フィールド	15,100	1,552.00	23,435,200
日本たばこ産業	884,900	2,645.50	2,341,002,950
ケンコーマヨネーズ	9,300	1,309.00	12,173,700
わらべや日洋ホールディングス	9,900	1,900.00	18,810,000
なとり	8,600	2,052.00	17,647,200
イフジ産業	2,200	917.00	2,017,400
ファーマフーズ	20,700	1,358.00	28,110,600
北の達人コーポレーション	57,600	329.00	18,950,400
ユーグレナ	86,600	998.00	86,426,800
紀文食品	10,500	951.00	9,985,500
ピックルスホールディングス	7,900	1,204.00	9,511,600
スター・マイカ・ホールディングス	12,200	669.00	8,161,800
SREホールディングス	6,600	3,360.00	22,176,000
ADワークスグループ	30,000	146.00	4,380,000
片倉工業	12,600	1,747.00	22,012,200
グンゼ	10,200	4,240.00	43,248,000
ヒューリック	313,400	1,061.00	332,517,400
神栄	1,800	844.00	1,519,200
ラサ商事	5,800	1,244.00	7,215,200
アルペン	11,900	1,888.00	22,467,200
ハブ	4,100	689.00	2,824,900
ラクーンホールディングス	11,400	1,156.00	13,178,400
クオールホールディングス	19,900	1,175.00	23,382,500
アルコニックス	19,000	1,375.00	26,125,000

神戸物産	111,800	3,745.00	418,691,000
ソリトンシステムズ	7,000	1,138.00	7,966,000
ジンズホールディングス	8,600	3,795.00	32,637,000
ビックカメラ	96,000	1,195.00	114,720,000
DCMホールディングス	88,100	1,171.00	103,165,100
ペッパーフードサービス	30,200	167.00	5,043,400
ハイパー	2,500	456.00	1,140,000
MonotaRO	204,700	2,037.00	416,973,900
東京一番フーズ	3,100	485.00	1,503,500
DDホールディングス	8,300	774.00	6,424,200
あいホールディングス	23,100	2,161.00	49,919,100
ディーブイエックス	3,500	1,013.00	3,545,500
きちりホールディングス	3,100	572.00	1,773,200
アークランドサービスホールディングス	11,800	2,146.00	25,322,800
J. フロント リテイリング	179,500	1,206.00	216,477,000
ドトール・日レスホールディングス	25,600	1,829.00	46,822,400
マツキヨココカラ&カンパニー	87,600	6,320.00	553,632,000
ブロンコビリー	7,600	2,430.00	18,468,000
ZOZO	95,500	3,270.00	312,285,000
トレジャー・ファクトリー	3,900	2,152.00	8,392,800
物語コーポレーション	8,000	6,450.00	51,600,000
三越伊勢丹ホールディングス	243,100	1,382.00	335,964,200
東洋紡	59,000	1,021.00	60,239,000
ユニチカ	41,400	233.00	9,646,200
富士紡ホールディングス	5,400	3,150.00	17,010,000
日清紡ホールディングス	112,100	961.00	107,728,100
倉敷紡績	10,200	2,182.00	22,256,400
ダイワボウホールディングス	59,000	1,963.00	115,817,000
シキボウ	6,800	976.00	6,636,800
日東紡績	16,300	2,046.00	33,349,800
トヨタ紡織	57,500	2,014.00	115,805,000
マクニカホールディングス	35,400	3,445.00	121,953,000
Hamee	5,000	805.00	4,025,000
マーケットエンタープライズ	1,300	1,032.00	1,341,600
ラクト・ジャパン	5,700	2,069.00	11,793,300
ウエルシアホールディングス	74,900	2,923.00	218,932,700
クリエイトSDホールディングス	23,800	3,465.00	82,467,000
グリムス	6,000	2,546.00	15,276,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,100	833.00	17,576,300
八洲電機	11,800	1,083.00	12,779,400
メディアスホールディングス	9,200	713.00	6,559,600
レスターホールディングス	13,800	2,239.00	30,898,200
ジュテックホールディングス	2,700	1,212.00	3,272,400
丸善CHIホールディングス	15,400	345.00	5,313,000
大光	5,200	658.00	3,421,600
OCHIホールディングス	2,900	1,285.00	3,726,500
TOKAIホールディングス	71,300	857.00	61,104,100
黒谷	3,700	596.00	2,205,200

ミサワ	2,400	620.00	1,488,000
ティーライフ	1,700	1,263.00	2,147,100
Cominix	2,400	760.00	1,824,000
エー・ピーホールディングス	1,900	461.00	875,900
三洋貿易	14,900	1,145.00	17,060,500
チムニー	4,000	1,129.00	4,516,000
シュッピン	10,700	1,074.00	11,491,800
ビューティガレージ	2,300	3,590.00	8,257,000
オイシックス・ラ・大地	19,400	2,163.00	41,962,200
ウイン・パートナーズ	10,500	1,001.00	10,510,500
ネクステージ	32,900	3,035.00	99,851,500
ジョイフル本田	42,800	1,815.00	77,682,000
鳥貴族ホールディングス	5,400	2,059.00	11,118,600
ホットランド	11,000	1,414.00	15,554,000
すかいらーくホールディングス	197,400	1,545.00	304,983,000
SFPホールディングス	7,900	1,776.00	14,030,400
綿半ホールディングス	11,400	1,409.00	16,062,600
日本毛織	36,000	935.00	33,660,000
ダイトウボウ	21,500	85.00	1,827,500
トーア紡コーポレーション	4,200	351.00	1,474,200
ダイドーリミテッド	18,600	254.00	4,724,400
ヨシックスホールディングス	2,600	2,205.00	5,733,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	47,200	1,126.00	53,147,200
三栄建築設計	6,500	1,481.00	9,626,500
野村不動産ホールディングス	84,000	2,858.00	240,072,000
三重交通グループホールディングス	28,800	489.00	14,083,200
サムティ	21,400	2,022.00	43,270,800
ディア・ライフ	20,700	622.00	12,875,400
コーセーアールイー	3,700	738.00	2,730,600
地主	10,200	1,828.00	18,645,600
プレサンスコーポレーション	17,600	1,619.00	28,494,400
フィル・カンパニー	2,400	1,130.00	2,712,000
THEグローバル社	7,000	218.00	1,526,000
ハウスコム	2,000	1,096.00	2,192,000
JPMC	6,800	1,005.00	6,834,000
サンセイランディック	3,700	823.00	3,045,100
エストラスト	1,500	580.00	870,000
フージャースホールディングス	20,600	790.00	16,274,000
オープンハウスグループ	49,200	4,820.00	237,144,000
東急不動産ホールディングス	404,100	644.00	260,240,400
飯田グループホールディングス	117,800	2,132.00	251,149,600
イーグランド	1,900	1,479.00	2,810,100
ムゲンエステート	7,900	500.00	3,950,000
帝国繊維	15,400	1,554.00	23,931,600
日本コークス工業	123,500	87.00	10,744,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,500	1,183.00	7,689,500
ミタチ産業	3,300	1,198.00	3,953,400
BENOS	8,200	2,124.00	17,416,800
あさひ	12,100	1,358.00	16,431,800

日本調剤	9,900	1,157.00	11,454,300
コスモス薬品	14,200	12,890.00	183,038,000
シップヘルスケアホールディングス	51,900	2,462.00	127,777,800
トーエル	5,800	757.00	4,390,600
ソフトクリエイトホールディングス	5,700	3,520.00	20,064,000
セブン&アイ・ホールディングス	497,800	5,953.00	2,963,403,400
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	108,700	981.00	106,634,700
明治電機工業	5,500	1,132.00	6,226,000
ツルハホールディングス	30,300	9,460.00	286,638,000
デリカフーズホールディングス	5,200	513.00	2,667,600
スターティアホールディングス	2,500	984.00	2,460,000
サンマルクホールディングス	11,700	1,732.00	20,264,400
フェリシモ	2,900	998.00	2,894,200
トリドールホールディングス	35,900	2,784.00	99,945,600
帝人	131,600	1,317.00	173,317,200
東レ	916,300	781.10	715,721,930
クラレ	217,300	1,059.00	230,120,700
旭化成	853,900	964.50	823,586,550
TOKYO BASE	14,800	407.00	6,023,600
稲葉製作所	8,300	1,393.00	11,561,900
宮地エンジニアリンググループ	3,900	3,820.00	14,898,000
トーカロ	38,700	1,206.00	46,672,200
アルファ	4,500	946.00	4,257,000
SUMCO	268,100	2,005.00	537,540,500
川田テクノロジーズ	3,300	3,365.00	11,104,500
RS Technologies	9,400	3,995.00	37,553,000
ジェイテックコーポレーション	1,700	3,050.00	5,185,000
信和	6,800	814.00	5,535,200
ビーロッド	8,300	541.00	4,490,300
ファーストブラザーズ	2,300	868.00	1,996,400
And Doホールディングス	8,000	845.00	6,760,000
シーアールイー	6,100	1,058.00	6,453,800
プロパティエージェント	1,500	1,250.00	1,875,000
ケイアイスター不動産	6,500	4,830.00	31,395,000
アグレ都市デザイン	2,200	1,619.00	3,561,800
グッドコムアセット	12,500	805.00	10,062,500
ジェイ・エス・ビー	3,300	4,000.00	13,200,000
ロードスターキャピタル	5,800	1,613.00	9,355,400
テンポイノベーション	3,700	1,184.00	4,380,800
グローバル・リンク・マネジメント	2,300	1,173.00	2,697,900
フェイスネットワーク	1,700	1,616.00	2,747,200
住江織物	2,500	1,854.00	4,635,000
日本フェルト	6,700	408.00	2,733,600
イチカワ	1,500	1,340.00	2,010,000
エコナックホールディングス	22,000	92.00	2,024,000
日東製網	1,300	1,556.00	2,022,800
芦森工業	2,300	1,429.00	3,286,700
アツギ	7,100	384.00	2,726,400
ウイルプラスホールディングス	2,100	1,143.00	2,400,300

J Mホールディングス	12,300	1,840.00	22,632,000
コメダホールディングス	35,300	2,363.00	83,413,900
サツドラホールディングス	5,800	784.00	4,547,200
アレンザホールディングス	10,800	1,045.00	11,286,000
串カツ田中ホールディングス	3,800	1,623.00	6,167,400
バロックジャパンリミテッド	9,400	844.00	7,933,600
クスリのアオキホールディングス	12,900	7,320.00	94,428,000
ダイニック	3,000	680.00	2,040,000
共和レザー	7,100	504.00	3,578,400
ピーバンドットコム	1,700	527.00	895,900
力の源ホールディングス	7,400	1,230.00	9,102,000
FOOD & LIFE COMPANIES	83,000	3,280.00	272,240,000
アセンテック	4,700	562.00	2,641,400
セーレン	26,400	2,429.00	64,125,600
ソトー	3,900	815.00	3,178,500
東海染工	1,300	1,104.00	1,435,200
小松マテーレ	19,900	713.00	14,188,700
ワコールホールディングス	26,300	2,384.00	62,699,200
ホギメディカル	18,400	3,230.00	59,432,000
クラウドディアホールディングス	2,700	362.00	977,400
T S I ホールディングス	48,800	560.00	27,328,000
マツオカコーポレーション	3,300	1,250.00	4,125,000
ワールド	17,500	1,330.00	23,275,000
T I S	153,900	3,465.00	533,263,500
J N S ホールディングス	5,600	321.00	1,797,600
グリー	36,700	706.00	25,910,200
GMOベパボ	2,000	1,884.00	3,768,000
コーエーテクモホールディングス	85,800	2,324.00	199,399,200
三菱総合研究所	6,700	4,855.00	32,528,500
ボルテージ	3,600	316.00	1,137,600
電算	800	1,601.00	1,280,800
A G S	5,300	679.00	3,598,700
ファインデックス	10,700	533.00	5,703,100
ブレインパッド	10,200	721.00	7,354,200
K L a b	27,200	407.00	11,070,400
ポールトゥウィンホールディングス	23,400	872.00	20,404,800
ネクソン	354,000	3,085.00	1,092,090,000
アイスタイル	39,800	495.00	19,701,000
エムアップホールディングス	16,700	1,193.00	19,923,100
エイチーム	9,900	786.00	7,781,400
エニグモ	17,400	611.00	10,631,400
テクノスジャパン	10,000	599.00	5,990,000
e n i s h	9,200	362.00	3,330,400
コロプラ	53,200	633.00	33,675,600
オルトプラス	9,200	194.00	1,784,800
ブロードリーフ	79,900	457.00	36,514,300
クロス・マーケティンググループ	7,300	767.00	5,599,100
デジタルハーツホールディングス	8,600	1,823.00	15,677,800
システム情報	12,100	845.00	10,224,500

メディアドゥ	5,500	1,636.00	8,998,000
じげん	39,900	383.00	15,281,700
ブイキューブ	16,400	715.00	11,726,000
エンカレッジ・テクノロジー	2,900	497.00	1,441,300
サイバーリンクス	3,900	960.00	3,744,000
ディー・エル・イー	8,800	259.00	2,279,200
フィックスターズ	15,500	1,366.00	21,173,000
CARTA HOLDINGS	6,400	1,654.00	10,585,600
オブティム	11,200	1,144.00	12,812,800
セレス	5,500	1,065.00	5,857,500
SHIFT	10,000	23,840.00	238,400,000
特種東海製紙	6,100	2,919.00	17,805,900
ティーガイア	14,300	1,626.00	23,251,800
セック	1,700	3,315.00	5,635,500
テクマトリックス	25,000	1,632.00	40,800,000
プロシップ	6,000	1,435.00	8,610,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41,900	2,162.00	90,587,800
GMOペイメントゲートウェイ	31,300	11,960.00	374,348,000
ザッパラス	3,400	343.00	1,166,200
システムリサーチ	4,200	2,338.00	9,819,600
インターネットイニシアティブ	76,400	2,358.00	180,151,200
さくらインターネット	15,300	602.00	9,210,600
ヴィンクス	3,600	1,460.00	5,256,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,200	4,420.00	18,564,000
SRAホールディングス	7,000	3,070.00	21,490,000
システムインテグレータ	3,700	418.00	1,546,600
朝日ネット	14,800	585.00	8,658,000
eBASE	19,300	660.00	12,738,000
アバントグループ	17,300	1,403.00	24,271,900
アドソル日進	5,800	1,349.00	7,824,200
ODKソリューションズ	2,700	582.00	1,571,400
フリービット	7,100	1,140.00	8,094,000
コムチュア	18,100	2,310.00	41,811,000
サイバーコム	2,000	1,439.00	2,878,000
アステリア	10,700	748.00	8,003,600
アイル	7,600	1,989.00	15,116,400
王子ホールディングス	569,800	522.00	297,435,600
日本製紙	71,100	948.00	67,402,800
三菱製紙	15,100	285.00	4,303,500
北越コーポレーション	86,400	795.00	68,688,000
中越パルプ工業	4,700	1,055.00	4,958,500
巴川製紙所	3,800	702.00	2,667,600
大王製紙	60,300	992.00	59,817,600
阿波製紙	2,900	675.00	1,957,500
マークライNZ	7,400	2,760.00	20,424,000
メディカル・データ・ビジョン	20,400	971.00	19,808,400
gumi	21,100	846.00	17,850,600
ショーケース	3,000	309.00	927,000

モバイルファクトリー	2,600	957.00	2,488,200
テラスカイ	5,900	1,999.00	11,794,100
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	7,900	1,879.00	14,844,100
PCIホールディングス	5,100	1,049.00	5,349,900
アイビーシー	1,900	382.00	725,800
ネオジャパン	4,500	976.00	4,392,000
PR TIMES	3,400	1,870.00	6,358,000
ラクス	64,700	1,862.00	120,471,400
ランドコンピュータ	3,000	940.00	2,820,000
ダブルスタンダード	5,600	2,229.00	12,482,400
オープンドア	9,600	1,730.00	16,608,000
マイネット	4,000	376.00	1,504,000
アカツキ	6,500	2,349.00	15,268,500
ベネフィットジャパン	800	1,212.00	969,600
Ubicomホールディングス	4,200	1,995.00	8,379,000
カナミックネットワーク	19,700	580.00	11,426,000
ノムラシステムコーポレーション	11,700	115.00	1,345,500
レンゴー	124,600	875.00	109,025,000
トーモク	7,900	1,520.00	12,008,000
ザ・パック	10,100	2,670.00	26,967,000
チェンジ	33,500	2,309.00	77,351,500
シンクロ・フード	7,600	482.00	3,663,200
オークネット	6,700	1,897.00	12,709,900
キャピタル・アセット・プランニング	2,400	608.00	1,459,200
セグエグループ	3,300	847.00	2,795,100
エイトレッド	1,900	1,464.00	2,781,600
マクロミル	26,800	1,108.00	29,694,400
ビーグリー	2,100	1,186.00	2,490,600
オロ	4,100	1,996.00	8,183,600
ユーザーローカル	5,000	1,393.00	6,965,000
テモナ	2,300	281.00	646,300
ニーズウェル	3,700	878.00	3,248,600
マネーフォワード	32,900	5,270.00	173,383,000
サインポスト	4,700	587.00	2,758,900
レゾナック・ホールディングス	132,100	2,204.00	291,148,400
住友化学	1,014,500	460.00	466,670,000
住友精化	5,800	4,070.00	23,606,000
日産化学	64,900	6,120.00	397,188,000
ラサ工業	5,300	1,986.00	10,525,800
クレハ	11,700	8,280.00	96,876,000
多木化学	5,400	4,600.00	24,840,000
テイカ	9,200	1,215.00	11,178,000
石原産業	24,700	1,090.00	26,923,000
片倉コープアグリ	2,500	1,720.00	4,300,000
日本曹達	14,700	4,350.00	63,945,000
東ソー	182,600	1,685.00	307,681,000
トクヤマ	44,100	1,957.00	86,303,700
セントラル硝子	21,900	2,944.00	64,473,600
東亜合成	68,500	1,133.00	77,610,500

大阪ソーダ	8,200	4,215.00	34,563,000
関東電化工業	26,400	1,007.00	26,584,800
SUN ASTERISK	7,200	1,461.00	10,519,200
デンカ	49,700	2,662.00	132,301,400
イビデン	79,000	4,995.00	394,605,000
信越化学工業	230,700	19,255.00	4,442,128,500
日本カーバイド工業	4,600	1,278.00	5,878,800
電算システムホールディングス	6,600	2,158.00	14,242,800
堺化学工業	10,400	1,808.00	18,803,200
第一稀元素化学工業	12,500	1,106.00	13,825,000
エア・ウォーター	129,000	1,551.00	200,079,000
日本酸素ホールディングス	132,600	2,260.00	299,676,000
日本化学工業	4,500	1,898.00	8,541,000
東邦アセチレン	2,600	1,159.00	3,013,400
日本パーカライジング	67,800	931.00	63,121,800
高压ガス工業	20,100	660.00	13,266,000
チタン工業	1,400	1,464.00	2,049,600
四国化成ホールディングス	16,200	1,276.00	20,671,200
戸田工業	3,100	2,610.00	8,091,000
ステラ ケミファ	8,000	2,585.00	20,680,000
保土谷化学工業	3,900	3,315.00	12,928,500
日本触媒	20,800	5,480.00	113,984,000
大日精化工業	9,600	1,793.00	17,212,800
カネカ	31,300	3,335.00	104,385,500
協和キリン	165,400	2,898.00	479,329,200
APPIER GROUP	38,900	1,884.00	73,287,600
三菱瓦斯化学	102,100	1,882.00	192,152,200
三井化学	112,700	3,130.00	352,751,000
JSR	127,700	3,105.00	396,508,500
東京応化工業	23,900	6,510.00	155,589,000
大阪有機化学工業	10,300	2,115.00	21,784,500
三菱ケミカルグループ	922,800	708.80	654,080,640
KHネオケム	22,700	2,711.00	61,539,700
ダイセル	201,000	901.00	181,101,000
住友ベークライト	20,200	4,405.00	88,981,000
積水化学工業	279,700	1,831.00	512,130,700
日本ゼオン	82,000	1,232.00	101,024,000
アイカ工業	34,500	2,999.00	103,465,500
UBE	70,400	1,982.00	139,532,800
積水樹脂	19,900	1,936.00	38,526,400
タキロンシーアイ	30,200	493.00	14,888,600
旭有機材	9,100	2,687.00	24,451,700
ニチバン	8,500	1,770.00	15,045,000
リケンテクノス	29,500	537.00	15,841,500
大倉工業	6,400	1,859.00	11,897,600
積水化成成品工業	18,700	390.00	7,293,000
群栄化学工業	2,700	2,487.00	6,714,900
タイガースポリマー	5,800	413.00	2,395,400
ミライアル	3,700	1,518.00	5,616,600
ダイキアクシス	4,400	682.00	3,000,800

ダイキョーニシカワ	30,100	603.00	18,150,300
竹本容器	4,100	817.00	3,349,700
森六ホールディングス	6,900	1,774.00	12,240,600
恵和	8,900	1,596.00	14,204,400
日本化薬	104,300	1,156.00	120,570,800
カーリットホールディングス	12,300	719.00	8,843,700
ソルクシーズ	10,200	365.00	3,723,000
CLホールディングス	3,900	810.00	3,159,000
プレステージ・インターナショナル	59,000	700.00	41,300,000
フェイス	3,400	500.00	1,700,000
プロトコーポレーション	17,100	1,248.00	21,340,800
ハイマックス	4,300	1,435.00	6,170,500
アミューズ	7,600	1,730.00	13,148,000
野村総合研究所	280,900	2,997.00	841,857,300
ドリームインキュベータ	4,300	2,588.00	11,128,400
サイバネットシステム	11,500	992.00	11,408,000
クイック	10,700	1,854.00	19,837,800
TAC	6,800	202.00	1,373,600
CEホールディングス	6,200	509.00	3,155,800
日本システム技術	5,100	1,702.00	8,680,200
電通グループ	137,900	4,095.00	564,700,500
インテージホールディングス	15,500	1,567.00	24,288,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,200	1,331.00	5,590,200
東邦システムサイエンス	3,500	1,026.00	3,591,000
ぴあ	4,700	3,245.00	15,251,500
イオンファンタジー	6,100	2,952.00	18,007,200
ソースネクスト	69,600	283.00	19,696,800
シーティーエス	15,600	813.00	12,682,800
ネクシィーズグループ	3,800	663.00	2,519,400
インフォコム	17,600	2,270.00	39,952,000
メディカルシステムネットワーク	12,600	405.00	5,103,000
日本精化	7,800	2,374.00	18,517,200
扶桑化学工業	12,700	3,635.00	46,164,500
トリケミカル研究所	18,300	2,389.00	43,718,700
シンプレクス・ホールディングス	23,000	2,405.00	55,315,000
HEROZ	4,500	1,130.00	5,085,000
ラクスル	38,700	1,553.00	60,101,100
メルカリ	61,800	2,951.00	182,371,800
I P S	4,400	2,846.00	12,522,400
F I G	14,100	375.00	5,287,500
システムサポート	5,300	1,599.00	8,474,700
ADEKA	47,700	2,134.00	101,791,800
日油	42,300	5,480.00	231,804,000
ミヨシ油脂	4,200	924.00	3,880,800
新日本理化	16,800	226.00	3,796,800
ハリマ化成グループ	8,700	877.00	7,629,900
イーソル	8,800	794.00	6,987,200
アルテリア・ネットワークス	12,700	1,248.00	15,849,600
東海ソフト	1,900	928.00	1,763,200
ウイングアーク1 s t	14,100	1,961.00	27,650,100

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,700	1,552.00	5,742,400
サーバーワークス	2,800	2,346.00	6,568,800
東名	900	2,257.00	2,031,300
ヴィッツ	1,200	941.00	1,129,200
トピラスシステムズ	3,100	823.00	2,551,300
S a n s a n	44,700	1,731.00	77,375,700
L i n k-U	2,300	922.00	2,120,600
ギフトイ	14,900	2,370.00	35,313,000
花王	333,000	5,173.00	1,722,609,000
第一工業製薬	5,000	2,058.00	10,290,000
石原ケミカル	6,300	1,278.00	8,051,400
日華化学	5,000	827.00	4,135,000
ニイタカ	2,200	1,996.00	4,391,200
三洋化成工業	8,500	4,195.00	35,657,500
メドレー	13,700	4,445.00	60,896,500
ベース	4,600	4,770.00	21,942,000
J M D C	22,500	4,345.00	97,762,500
武田薬品工業	1,211,600	4,182.00	5,066,911,200
アステラス製薬	1,312,100	1,914.00	2,511,359,400
住友ファーマ	101,500	867.00	88,000,500
塩野義製薬	175,000	6,295.00	1,101,625,000
わかもと製薬	11,500	223.00	2,564,500
日本新薬	32,300	6,590.00	212,857,000
中外製薬	428,600	3,426.00	1,468,383,600
科研製薬	23,400	3,580.00	83,772,000
エーザイ	166,600	7,597.00	1,265,660,200
理研ビタミン	11,600	1,910.00	22,156,000
ロート製薬	132,600	2,282.00	302,593,200
小野薬品工業	264,200	2,827.50	747,025,500
久光製薬	30,400	3,955.00	120,232,000
有機合成薬品工業	9,200	287.00	2,640,400
持田製薬	16,400	3,330.00	54,612,000
参天製薬	257,600	991.00	255,281,600
扶桑薬品工業	4,300	1,927.00	8,286,100
日本ケミファ	1,200	1,711.00	2,053,200
ツムラ	43,100	2,616.00	112,749,600
テルモ	426,500	3,847.00	1,640,745,500
H. U. グループホールディングス	41,100	2,725.00	111,997,500
キッセイ薬品工業	21,200	2,471.00	52,385,200
生化学工業	26,200	818.00	21,431,600
栄研化学	22,200	1,558.00	34,587,600
鳥居薬品	7,300	3,150.00	22,995,000
J C R ファーマ	46,300	1,680.00	77,784,000
東和薬品	21,100	2,003.00	42,263,300
富士製薬工業	8,900	1,024.00	9,113,600
ゼリア新薬工業	19,000	2,113.00	40,147,000
第一三共	1,192,700	4,070.00	4,854,289,000
キョーリン製薬ホールディングス	29,700	1,667.00	49,509,900
大幸薬品	24,800	387.00	9,597,600

ダイト	9,600	2,528.00	24,268,800
大塚ホールディングス	313,300	4,088.00	1,280,770,400
大正製薬ホールディングス	30,400	5,290.00	160,816,000
ペプチドリーム	66,400	2,027.00	134,592,800
大日本塗料	16,900	790.00	13,351,000
日本ペイントホールディングス	605,100	1,166.00	705,546,600
関西ペイント	125,300	1,788.00	224,036,400
神東塗料	10,400	126.00	1,310,400
中国塗料	22,400	1,049.00	23,497,600
日本特殊塗料	7,700	878.00	6,760,600
藤倉化成	18,600	432.00	8,035,200
太陽ホールディングス	20,700	2,418.00	50,052,600
D I C	53,500	2,422.00	129,577,000
サカタインクス	30,300	1,074.00	32,542,200
東洋インキ S Cホールディングス	26,700	1,848.00	49,341,600
T & K T O K A	12,200	1,263.00	15,408,600
アルプス技研	12,200	2,109.00	25,729,800
サニックス	22,700	229.00	5,198,300
日本空調サービス	15,400	709.00	10,918,600
オリエンタルランド	148,500	21,575.00	3,203,887,500
フォーカスシステムズ	10,000	1,088.00	10,880,000
ダスキン	31,300	2,914.00	91,208,200
パーク 2 4	104,700	2,156.00	225,733,200
明光ネットワークジャパン	18,400	618.00	11,371,200
ファルコホールディングス	6,100	1,865.00	11,376,500
クレスコ	10,500	1,812.00	19,026,000
フジ・メディア・ホールディングス	131,400	1,051.00	138,101,400
秀英予備校	3,100	437.00	1,354,700
田谷	1,700	531.00	902,700
ラウンドワン	117,300	482.00	56,538,600
リゾートトラスト	55,400	2,318.00	128,417,200
オービック	45,700	20,620.00	942,334,000
ジャストシステム	19,700	3,205.00	63,138,500
T D C ソフト	11,600	1,561.00	18,107,600
Zホールディングス	1,948,400	412.40	803,520,160
ビー・エム・エル	17,400	3,125.00	54,375,000
トレンドマイクロ	79,000	6,300.00	497,700,000
りらいあコミュニケーションズ	23,200	1,454.00	33,732,800
I Dホールディングス	9,300	997.00	9,272,100
リソー教育	63,800	347.00	22,138,600
日本オラクル	26,200	9,020.00	236,324,000
早稲田アカデミー	7,800	1,217.00	9,492,600
アルファシステムズ	4,300	4,100.00	17,630,000
フューチャー	34,100	1,638.00	55,855,800
C A C H o l d i n g s	8,600	1,389.00	11,945,400
S Bテクノロジー	5,800	2,017.00	11,698,600
トーセ	3,200	747.00	2,390,400
ユー・エス・エス	144,300	2,170.00	313,131,000
オービックビジネスコンサルタント	26,900	4,945.00	133,020,500
伊藤忠テクノソリューションズ	73,500	3,095.00	227,482,500

アイティフォー	18,200	863.00	15,706,600
東京個別指導学院	16,700	541.00	9,034,700
東計電算	2,000	5,750.00	11,500,000
サイバーエージェント	335,700	1,254.00	420,967,800
楽天グループ	649,500	674.00	437,763,000
エックスネット	1,800	1,008.00	1,814,400
クリーク・アンド・リバー社	8,300	2,278.00	18,907,400
モーニングスター	23,000	473.00	10,879,000
テー・オー・ダブリュー	27,200	294.00	7,996,800
大塚商会	77,600	4,560.00	353,856,000
サイボウズ	18,900	2,661.00	50,292,900
山田コンサルティンググループ	7,100	1,159.00	8,228,900
セントラルスポーツ	5,300	2,411.00	12,778,300
パラカ	4,700	1,947.00	9,150,900
電通国際情報サービス	16,600	4,165.00	69,139,000
ACCESS	16,200	991.00	16,054,200
デジタルガレージ	24,300	4,695.00	114,088,500
イーエムシステムズ	22,800	932.00	21,249,600
ウェザーニューズ	4,200	6,980.00	29,316,000
C I J	11,400	1,036.00	11,810,400
ビジネスエンジニアリング	2,600	2,474.00	6,432,400
日本エンタープライズ	12,400	134.00	1,661,600
WOWOW	7,600	1,259.00	9,568,400
スカラ	12,700	720.00	9,144,000
インテリジェント ウェイブ	6,500	727.00	4,725,500
フルキャストホールディングス	13,400	2,728.00	36,555,200
エン・ジャパン	25,400	2,425.00	61,595,000
あすか製薬ホールディングス	14,000	1,196.00	16,744,000
サワイグループホールディングス	31,300	3,920.00	122,696,000
富士フイルムホールディングス	262,700	6,884.00	1,808,426,800
コニカミノルタ	307,800	542.00	166,827,600
資生堂	285,800	6,623.00	1,892,853,400
ライオン	164,300	1,410.00	231,663,000
高砂香料工業	9,300	2,641.00	24,561,300
マンダム	29,500	1,424.00	42,008,000
ミルボン	20,300	5,520.00	112,056,000
ファンケル	59,900	2,620.00	156,938,000
コーセー	27,900	15,000.00	418,500,000
コタ	11,600	1,726.00	20,021,600
シーボン	1,500	1,595.00	2,392,500
ポーラ・オルビスホールディングス	70,200	1,798.00	126,219,600
ノエビアホールディングス	12,200	5,530.00	67,466,000
アジュバンホールディングス	3,000	988.00	2,964,000
新日本製薬	7,800	1,447.00	11,286,600
エステー	10,600	1,578.00	16,726,800
アグロ カネショウ	5,500	1,548.00	8,514,000
コニシ	22,900	1,746.00	39,983,400
長谷川香料	28,400	3,185.00	90,454,000
星光PMC	6,400	566.00	3,622,400
小林製薬	39,800	9,080.00	361,384,000

荒川化学工業	11,700	978.00	11,442,600
メック	11,200	2,507.00	28,078,400
日本高純度化学	3,400	2,335.00	7,939,000
タカラバイオ	36,900	1,722.00	63,541,800
JCU	15,500	3,245.00	50,297,500
新田ゼラチン	7,500	860.00	6,450,000
OATアグリオ	5,000	1,464.00	7,320,000
デクセリアルズ	39,500	2,847.00	112,456,500
アース製薬	12,400	5,020.00	62,248,000
北興化学工業	13,800	831.00	11,467,800
大成ラミック	4,300	2,886.00	12,409,800
クミアイ化学工業	54,500	867.00	47,251,500
日本農薬	25,100	710.00	17,821,000
富士興産	2,900	1,185.00	3,436,500
ニチレキ	16,300	1,365.00	22,249,500
ユシロ化学工業	7,100	822.00	5,836,200
ビービー・カストロール	4,600	886.00	4,075,600
富士石油	27,900	264.00	7,365,600
MORESCO	4,000	1,199.00	4,796,000
出光興産	152,100	3,145.00	478,354,500
ENEOSホールディングス	2,473,400	460.00	1,137,764,000
コスモエネルギーホールディングス	54,100	3,525.00	190,702,500
テスホールディングス	14,400	1,132.00	16,300,800
インフロニア・ホールディングス	140,200	1,014.00	142,162,800
横浜ゴム	77,900	2,116.00	164,836,400
TOYO TIRE	78,600	1,549.00	121,751,400
ブリヂストン	437,200	4,829.00	2,111,238,800
住友ゴム工業	134,200	1,167.00	156,611,400
藤倉コンポジット	8,700	887.00	7,716,900
オカモト	7,600	3,800.00	28,880,000
WOW WORLD GROUP	2,200	1,497.00	3,293,400
アキレス	8,900	1,247.00	11,098,300
フコク	7,200	1,034.00	7,444,800
ニッタ	13,900	2,837.00	39,434,300
クリエートメディック	4,200	887.00	3,725,400
住友理工	26,700	685.00	18,289,500
三ツ星ベルト	20,000	3,655.00	73,100,000
バンドー化学	21,800	1,003.00	21,865,400
AGC	139,300	4,695.00	654,013,500
日本板硝子	69,800	647.00	45,160,600
石塚硝子	1,900	1,444.00	2,743,600
有沢製作所	22,400	1,396.00	31,270,400
日本山村硝子	4,400	558.00	2,455,200
日本電気硝子	55,800	2,378.00	132,692,400
オハラ	6,500	1,208.00	7,852,000
住友大阪セメント	19,300	3,405.00	65,716,500
太平洋セメント	87,200	2,200.00	191,840,000
リソルホールディングス	1,100	4,705.00	5,175,500
日本ヒューム	12,500	666.00	8,325,000
日本コンクリート工業	27,300	226.00	6,169,800

三谷セキサン	5,800	4,085.00	23,693,000
アジアパイルホールディングス	21,800	643.00	14,017,400
東海カーボン	114,900	1,083.00	124,436,700
日本カーボン	7,800	4,305.00	33,579,000
東洋炭素	8,600	4,065.00	34,959,000
ノリタケカンパニーリミテド	6,800	4,230.00	28,764,000
TOTO	90,400	4,680.00	423,072,000
日本碍子	162,000	1,780.00	288,360,000
日本特殊陶業	104,200	2,618.00	272,795,600
ダントーホールディングス	8,700	316.00	2,749,200
MARUWA	5,100	17,580.00	89,658,000
品川リフラクトリーズ	3,800	3,985.00	15,143,000
黒崎播磨	2,800	5,760.00	16,128,000
ヨータイ	9,200	1,496.00	13,763,200
東京窯業	11,600	286.00	3,317,600
ニッカトー	5,600	541.00	3,029,600
フジインコーポレーテッド	10,900	6,540.00	71,286,000
クニミネ工業	3,600	844.00	3,038,400
エーアンドエーマテリアル	2,400	898.00	2,155,200
ニチアス	34,600	2,521.00	87,226,600
日本製鉄	630,700	2,670.00	1,683,969,000
神戸製鋼所	283,200	681.00	192,859,200
中山製鋼所	29,000	1,060.00	30,740,000
合同製鐵	7,000	2,996.00	20,972,000
JFEホールディングス	376,400	1,556.00	585,678,400
東京製鐵	39,600	1,448.00	57,340,800
共英製鋼	16,100	1,460.00	23,506,000
大和工業	23,200	5,010.00	116,232,000
東京鐵鋼	6,700	1,678.00	11,242,600
大阪製鐵	6,600	1,218.00	8,038,800
淀川製鋼所	16,100	2,569.00	41,360,900
中部鋼鈑	11,700	2,006.00	23,470,200
丸一鋼管	42,900	2,742.00	117,631,800
モリ工業	2,900	2,932.00	8,502,800
大同特殊鋼	17,700	4,870.00	86,199,000
日本高周波鋼業	4,200	325.00	1,365,000
日本冶金工業	10,300	4,210.00	43,363,000
山陽特殊製鋼	13,900	2,658.00	36,946,200
愛知製鋼	8,200	2,213.00	18,146,600
日本金属	2,800	890.00	2,492,000
大平洋金属	10,000	1,939.00	19,390,000
新日本電工	90,000	373.00	33,570,000
栗本鐵工所	6,700	1,855.00	12,428,500
虹 技	1,700	1,003.00	1,705,100
日本鑄鐵管	1,400	946.00	1,324,400
日本製鋼所	38,000	2,694.00	102,372,000
三菱製鋼	8,800	1,157.00	10,181,600
日亜鋼業	13,300	264.00	3,511,200
日本精線	2,000	4,490.00	8,980,000
エンビプロ・ホールディングス	8,700	710.00	6,177,000

大紀アルミニウム工業所	20,000	1,322.00	26,440,000
日本軽金属ホールディングス	38,100	1,425.00	54,292,500
三井金属鉱業	41,000	3,350.00	137,350,000
東邦亜鉛	8,400	2,104.00	17,673,600
三菱マテリアル	94,000	2,142.00	201,348,000
住友金属鉱山	163,400	5,050.00	825,170,000
DOWAホールディングス	31,700	4,415.00	139,955,500
古河機械金属	20,600	1,320.00	27,192,000
エス・サイエンス	76,500	27.00	2,065,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,600	3,645.00	75,087,000
東邦チタニウム	25,500	2,335.00	59,542,500
UACJ	19,700	2,366.00	46,610,200
CKサンエツ	2,600	4,185.00	10,881,000
古河電気工業	46,900	2,482.00	116,405,800
住友電気工業	486,400	1,627.00	791,372,800
フジクラ	151,100	1,002.00	151,402,200
昭和電線ホールディングス	15,800	1,836.00	29,008,800
タツタ電線	28,800	711.00	20,476,800
カナレ電気	2,000	1,310.00	2,620,000
平河ビューテック	8,200	1,299.00	10,651,800
いよぎんホールディングス	160,100	704.00	112,710,400
しずおかフィナンシャルグループ	303,900	1,078.00	327,604,200
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	113,200	928.00	105,049,600
リョービ	15,000	1,264.00	18,960,000
アーレスティ	13,800	480.00	6,624,000
アサヒホールディングス	57,100	1,954.00	111,573,400
東洋製罐グループホールディングス	93,200	1,613.00	150,331,600
ホッカンホールディングス	7,500	1,389.00	10,417,500
コロナ	7,800	900.00	7,020,000
横河ブリッジホールディングス	18,600	1,979.00	36,809,400
駒井ハルテック	2,100	1,536.00	3,225,600
高田機工	600	2,590.00	1,554,000
三和ホールディングス	129,600	1,334.00	172,886,400
文化シャッター	40,600	1,131.00	45,918,600
三協立山	16,100	628.00	10,110,800
アルインコ	10,800	1,040.00	11,232,000
東洋シャッター	2,200	518.00	1,139,600
LIXIL	205,200	2,135.00	438,102,000
日本フィルコン	8,200	450.00	3,690,000
ノーリツ	20,700	1,484.00	30,718,800
長府製作所	14,100	2,074.00	29,243,400
リンナイ	25,500	9,880.00	251,940,000
ユニプレス	24,500	782.00	19,159,000
ダイニチ工業	6,500	667.00	4,335,500
日東精工	20,600	505.00	10,403,000
三洋工業	1,400	1,836.00	2,570,400
岡部	22,600	718.00	16,226,800
ジーテクト	15,700	1,366.00	21,446,200
東プレ	24,900	1,263.00	31,448,700
高周波熱錬	22,800	687.00	15,663,600

東京製綱	8,400	1,108.00	9,307,200
サンコール	11,100	650.00	7,215,000
モリテックスチール	9,400	296.00	2,782,400
パイオラックス	19,400	1,790.00	34,726,000
エイチワン	14,700	650.00	9,555,000
日本発条	124,700	903.00	112,604,100
中央発條	7,800	703.00	5,483,400
アドバネクス	1,500	1,056.00	1,584,000
三浦工業	57,600	3,170.00	182,592,000
タクマ	42,400	1,248.00	52,915,200
テクノプロ・ホールディングス	83,100	3,655.00	303,730,500
アトラグループ	3,000	181.00	543,000
インターワークス	3,200	356.00	1,139,200
アイ・アールジャパンホールディングス	7,300	1,972.00	14,395,600
Ke e P e r 技研	8,700	3,445.00	29,971,500
ファーストロジック	2,000	856.00	1,712,000
三機サービス	2,000	920.00	1,840,000
G u n o s y	11,100	637.00	7,070,700
デザインワン・ジャパン	3,700	191.00	706,700
イー・ガーディアン	5,300	2,469.00	13,085,700
リブセンス	5,800	337.00	1,954,600
ジャパンマテリアル	42,900	2,364.00	101,415,600
ベクトル	22,000	1,243.00	27,346,000
ウチヤマホールディングス	5,600	267.00	1,495,200
チャーム・ケア・コーポレーション	11,700	1,128.00	13,197,600
キャリアリンク	5,200	2,623.00	13,639,600
I B J	8,600	1,030.00	8,858,000
アサンテ	7,000	1,655.00	11,585,000
バリューHR	12,300	1,682.00	20,688,600
M&Aキャピタルパートナーズ	13,000	3,890.00	50,570,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,100	1,074.00	5,477,400
E R I ホールディングス	3,200	1,393.00	4,457,600
アビスト	2,000	2,996.00	5,992,000
シグマクシス・ホールディングス	21,300	1,129.00	24,047,700
ウィルグループ	11,700	1,205.00	14,098,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	13,500	151.00	2,038,500
メドピア	11,000	1,539.00	16,929,000
レアジョブ	2,400	925.00	2,220,000
リクルートホールディングス	1,039,000	4,340.00	4,509,260,000
エラン	18,600	992.00	18,451,200
ツガミ	30,600	1,406.00	43,023,600
オークマ	13,800	5,180.00	71,484,000
芝浦機械	13,700	2,792.00	38,250,400
アマダ	220,000	1,139.00	250,580,000
アイダエンジニアリング	28,400	814.00	23,117,600
TAKI SAWA	3,300	1,110.00	3,663,000
F U J I	60,000	2,145.00	128,700,000
牧野フライス製作所	15,300	4,635.00	70,915,500

オーエスジー	65,800	1,971.00	129,691,800
ダイジェット工業	1,300	816.00	1,060,800
旭ダイヤモンド工業	38,500	741.00	28,528,500
DMG森精機	83,600	1,973.00	164,942,800
ソディック	37,900	749.00	28,387,100
ディスコ	22,100	40,400.00	892,840,000
日東工器	6,800	1,676.00	11,396,800
日進工具	11,600	1,076.00	12,481,600
パンチ工業	10,700	464.00	4,964,800
富士ダイス	5,900	587.00	3,463,300
土木管理総合試験所	5,300	304.00	1,611,200
日本郵政	1,839,200	1,139.00	2,094,848,800
ベルシステム24ホールディングス	18,800	1,505.00	28,294,000
鎌倉新書	15,900	1,076.00	17,108,400
SMN	3,200	464.00	1,484,800
一蔵	1,500	462.00	693,000
グローバルキッズCOMPANY	1,900	800.00	1,520,000
エアトリ	9,100	2,574.00	23,423,400
アトラエ	11,000	1,290.00	14,190,000
ストライク	6,900	4,035.00	27,841,500
ソラスト	38,700	675.00	26,122,500
セラク	5,000	1,538.00	7,690,000
インソース	34,800	1,444.00	50,251,200
豊田自動織機	99,800	7,570.00	755,486,000
豊和工業	6,600	966.00	6,375,600
ニデックオーケーケー	5,000	939.00	4,695,000
石川製作所	3,100	1,414.00	4,383,400
東洋機械金属	8,500	557.00	4,734,500
津田駒工業	2,300	514.00	1,182,200
エンシュウ	2,600	685.00	1,781,000
島精機製作所	21,900	1,864.00	40,821,600
オプトラン	20,400	2,505.00	51,102,000
NCホールディングス	2,500	2,047.00	5,117,500
イワキ	9,300	1,271.00	11,820,300
フリー	14,400	1,197.00	17,236,800
ヤマシンフィルタ	32,800	467.00	15,317,600
日阪製作所	13,300	851.00	11,318,300
やまびこ	22,500	1,124.00	25,290,000
野村マイクロ・サイエンス	4,600	4,690.00	21,574,000
平田機工	6,600	6,450.00	42,570,000
ペガサスミシン製造	15,300	668.00	10,220,400
マルマエ	6,700	1,757.00	11,771,900
タツモ	7,500	1,954.00	14,655,000
ナブテスコ	86,500	3,655.00	316,157,500
三井海洋開発	17,300	1,352.00	23,389,600
レオン自動機	14,600	1,101.00	16,074,600
SMC	44,700	67,810.00	3,031,107,000
ホソカワミクロン	10,600	2,710.00	28,726,000
ユニオンツール	6,100	3,410.00	20,801,000
オイレス工業	19,300	1,590.00	30,687,000

日精エー・エス・ビー機械	6,300	4,575.00	28,822,500
サトーホールディングス	19,600	2,130.00	41,748,000
技研製作所	14,300	2,879.00	41,169,700
日本エアータック	7,000	1,102.00	7,714,000
カワタ	3,600	854.00	3,074,400
日精樹脂工業	10,300	979.00	10,083,700
オカダアイヨン	3,800	1,646.00	6,254,800
ワイエイシイホールディングス	5,200	2,074.00	10,784,800
小松製作所	646,000	3,128.00	2,020,688,000
住友重機械工業	81,500	2,793.00	227,629,500
日立建機	54,900	3,025.00	166,072,500
日工	20,600	625.00	12,875,000
巴工業	6,000	2,445.00	14,670,000
井関農機	12,900	1,204.00	15,531,600
TOWA	14,000	1,964.00	27,496,000
丸山製作所	2,200	1,622.00	3,568,400
北川鉄工所	5,400	1,170.00	6,318,000
シンニッタン	13,700	245.00	3,356,500
ローツェ	7,200	10,460.00	75,312,000
タカキタ	3,600	418.00	1,504,800
クボタ	729,600	1,956.00	1,427,097,600
荏原実業	6,600	2,652.00	17,503,200
東洋エンジニアリング	17,700	592.00	10,478,400
三菱化工機	4,400	2,205.00	9,702,000
月島機械	18,700	1,038.00	19,410,600
帝国電機製作所	10,000	2,486.00	24,860,000
東京機械製作所	2,900	590.00	1,711,000
新東工業	28,200	717.00	20,219,400
澁谷工業	12,900	2,470.00	31,863,000
アイチコーポレーション	19,600	772.00	15,131,200
小森コーポレーション	31,900	828.00	26,413,200
鶴見製作所	10,500	1,981.00	20,800,500
日本ギア工業	4,000	448.00	1,792,000
酒井重工業	2,000	3,740.00	7,480,000
荏原製作所	56,400	5,470.00	308,508,000
石井鐵工所	1,000	2,282.00	2,282,000
西島製作所	12,000	1,505.00	18,060,000
北越工業	13,800	1,378.00	19,016,400
ダイキン工業	164,600	22,955.00	3,778,393,000
オルガノ	19,000	3,240.00	61,560,000
トーヨーカネツ	5,300	2,636.00	13,970,800
栗田工業	77,100	6,160.00	474,936,000
椿本チエイン	19,500	3,070.00	59,865,000
大同工業	5,000	733.00	3,665,000
日機装	34,100	1,047.00	35,702,700
木村化工機	10,500	704.00	7,392,000
レイズネクスト	19,400	1,281.00	24,851,400
アネスト岩田	23,400	859.00	20,100,600
ダイフク	71,100	7,210.00	512,631,000
サムコ	4,500	3,700.00	16,650,000

加藤製作所	5,800	780.00	4,524,000
油研工業	1,700	1,879.00	3,194,300
タダノ	72,600	945.00	68,607,000
フジテック	50,500	3,115.00	157,307,500
CKD	38,100	2,006.00	76,428,600
平和	45,800	2,287.00	104,744,600
理想科学工業	12,300	2,245.00	27,613,500
SANKYO	27,100	5,190.00	140,649,000
日本金銭機械	15,200	1,161.00	17,647,200
マースグループホールディングス	8,200	2,466.00	20,221,200
フクシマガリレイ	10,100	4,390.00	44,339,000
オーイズミ	4,600	480.00	2,208,000
ダイコク電機	7,500	2,118.00	15,885,000
竹内製作所	25,000	2,838.00	70,950,000
アマノ	39,100	2,438.00	95,325,800
JUKI	21,400	608.00	13,011,200
サンデン	18,300	221.00	4,044,300
ジャノメ	14,100	608.00	8,572,800
ブラザー工業	184,200	1,997.00	367,847,400
マックス	17,000	2,107.00	35,819,000
モリタホールディングス	24,000	1,151.00	27,624,000
グローリー	35,700	2,270.00	81,039,000
新晃工業	13,800	1,525.00	21,045,000
大和冷機工業	21,200	1,193.00	25,291,600
セガサミーホールディングス	110,800	2,009.00	222,597,200
日本ピストンリング	4,200	1,270.00	5,334,000
リケン	5,500	2,434.00	13,387,000
T P R	15,800	1,315.00	20,777,000
ツバキ・ナカシマ	34,000	1,175.00	39,950,000
ホシザキ	88,700	4,530.00	401,811,000
大豊工業	12,100	628.00	7,598,800
日本精工	253,000	727.00	183,931,000
NTN	271,800	305.00	82,899,000
ジェイテクト	122,700	980.00	120,246,000
不二越	10,200	3,845.00	39,219,000
ミネベアミツミ	239,800	2,377.00	570,004,600
日本トムソン	33,700	604.00	20,354,800
THK	79,600	2,690.00	214,124,000
ユーシン精機	10,800	720.00	7,776,000
前澤給装工業	9,800	926.00	9,074,800
イーグル工業	15,300	1,128.00	17,258,400
前澤工業	7,100	615.00	4,366,500
日本ピラー工業	12,800	3,175.00	40,640,000
キッツ	50,700	800.00	40,560,000
日立製作所	670,500	7,017.00	4,704,898,500
東芝	265,300	4,504.00	1,194,911,200
三菱電機	1,425,000	1,504.50	2,143,912,500
富士電機	83,800	5,180.00	434,084,000
東洋電機製造	3,900	878.00	3,424,200
安川電機	163,400	5,100.00	833,340,000

シンフォニア テクノロジー	15,200	1,639.00	24,912,800
明電舎	20,900	1,903.00	39,772,700
オリジン	2,800	1,269.00	3,553,200
山洋電気	6,000	5,650.00	33,900,000
デンヨー	10,500	1,523.00	15,991,500
PHCホールディングス	19,200	1,555.00	29,856,000
ソシオネクスト	14,100	8,330.00	117,453,000
ベイカレント・コンサルティング	111,000	5,490.00	609,390,000
Orchestra Holdings	3,000	1,975.00	5,925,000
アイモバイル	7,300	1,284.00	9,373,200
キャリアインデックス	4,200	324.00	1,360,800
MS-Japan	4,100	1,069.00	4,382,900
船場	1,500	701.00	1,051,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	50,000	1,812.00	90,600,000
フルテック	1,700	1,088.00	1,849,600
グリーンズ	4,200	1,192.00	5,006,400
ツナググループ・ホールディングス	3,500	524.00	1,834,000
GAMEWITH	3,700	333.00	1,232,100
MS&Consulting	1,400	599.00	838,600
ウェルビー	10,300	636.00	6,550,800
エル・ティール・エス	1,900	2,864.00	5,441,600
ミダックホールディングス	8,600	2,954.00	25,404,400
日総工産	10,500	617.00	6,478,500
キュービーネットホールディングス	6,600	1,491.00	9,840,600
RPAホールディングス	19,000	327.00	6,213,000
三櫻工業	20,900	659.00	13,773,100
マキタ	171,500	3,525.00	604,537,500
東芝テック	20,600	3,765.00	77,559,000
芝浦メカトロニクス	2,700	11,340.00	30,618,000
マブチモーター	34,300	3,740.00	128,282,000
日本電産	334,900	7,374.00	2,469,552,600
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,900	501.00	4,959,900
トレックス・セミコンダクター	6,500	2,758.00	17,927,000
東光高岳	8,400	1,998.00	16,783,200
ダブル・スコープ	45,100	1,495.00	67,424,500
宮越ホールディングス	6,200	894.00	5,542,800
ダイヘン	12,500	4,140.00	51,750,000
ヤーマン	23,800	1,352.00	32,177,600
JVCケンウッド	125,500	410.00	51,455,000
ミマキエンジニアリング	13,100	599.00	7,846,900
I-PEX	7,600	1,178.00	8,952,800
日新電機	33,000	1,700.00	56,100,000
大崎電気工業	32,500	526.00	17,095,000
オムロン	126,300	7,556.00	954,322,800
日東工業	18,600	2,531.00	47,076,600
IDEC	20,300	3,110.00	63,133,000
正興電機製作所	4,600	1,011.00	4,650,600
不二電機工業	2,500	1,088.00	2,720,000

ジーエス・ユアサ コーポレーション	45,300	2,241.00	101,517,300
サクサホールディングス	2,600	1,222.00	3,177,200
メルコホールディングス	3,700	3,315.00	12,265,500
テクノメディカ	3,300	1,707.00	5,633,100
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,500	1,375.00	6,187,500
日本電気	195,000	4,810.00	937,950,000
富士通	137,400	17,895.00	2,458,773,000
沖電気工業	62,300	732.00	45,603,600
岩崎通信機	5,400	761.00	4,109,400
電気興業	5,500	1,928.00	10,604,000
サンケン電気	12,800	8,120.00	103,936,000
ナカヨ	2,100	1,131.00	2,375,100
アイホン	8,400	1,939.00	16,287,600
ルネサスエレクトロニクス	899,700	1,416.50	1,274,425,050
セイコーエプソン	183,600	1,870.00	343,332,000
ワコム	109,200	660.00	72,072,000
アルバック	32,700	6,040.00	197,508,000
アクセル	4,500	1,637.00	7,366,500
E I Z O	10,100	3,620.00	36,562,000
ジャパンディスプレイ	528,800	46.00	24,324,800
日本信号	31,400	1,032.00	32,404,800
京三製作所	29,000	408.00	11,832,000
能美防災	18,700	1,718.00	32,126,600
ホーチキ	10,300	1,495.00	15,398,500
星和電機	5,200	432.00	2,246,400
エレコム	32,900	1,339.00	44,053,100
パナソニック ホールディングス	1,628,600	1,156.00	1,882,661,600
シャープ	166,000	1,082.00	179,612,000
アンリツ	97,100	1,239.00	120,306,900
富士通ゼネラル	39,100	3,615.00	141,346,500
ソニーグループ	965,700	12,055.00	11,641,513,500
T D K	218,400	4,745.00	1,036,308,000
帝国通信工業	6,200	1,478.00	9,163,600
タムラ製作所	59,100	758.00	44,797,800
アルプスアルパイン	123,100	1,411.00	173,694,100
池上通信機	4,000	618.00	2,472,000
日本電波工業	16,500	1,446.00	23,859,000
鈴木	7,400	986.00	7,296,400
メイコー	15,100	2,915.00	44,016,500
日本トリム	3,100	2,906.00	9,008,600
ローランド ディー. ジー.	7,700	2,936.00	22,607,200
フォスター電機	12,800	980.00	12,544,000
SMK	3,300	2,377.00	7,844,100
ヨコオ	10,900	2,259.00	24,623,100
ティアック	18,800	117.00	2,199,600
ホシデン	33,000	1,620.00	53,460,000
ヒロセ電機	22,800	16,770.00	382,356,000
日本航空電子工業	28,300	2,268.00	64,184,400
T O A	15,700	776.00	12,183,200

マクセル	29,900	1,438.00	42,996,200
古野電気	18,000	930.00	16,740,000
スミダコーポレーション	12,600	1,485.00	18,711,000
アイコム	5,400	2,525.00	13,635,000
リオン	5,700	1,845.00	10,516,500
横河電機	150,900	2,287.00	345,108,300
新電元工業	5,300	3,385.00	17,940,500
アズビル	95,400	3,650.00	348,210,000
東亜ディーケーケー	5,900	758.00	4,472,200
日本光電工業	63,100	3,290.00	207,599,000
チノー	5,700	1,907.00	10,869,900
共和電業	11,600	338.00	3,920,800
日本電子材料	9,000	1,455.00	13,095,000
堀場製作所	30,300	6,100.00	184,830,000
アドバンテスト	107,500	9,860.00	1,059,950,000
小野測器	4,500	418.00	1,881,000
エスベック	10,900	2,050.00	22,345,000
キーエンス	136,500	61,070.00	8,336,055,000
日置電機	7,100	7,300.00	51,830,000
シスメックス	117,700	8,794.00	1,035,053,800
日本マイクロニクス	22,500	1,396.00	31,410,000
メガチップス	11,200	2,935.00	32,872,000
OBARA GROUP	6,400	3,660.00	23,424,000
IMAGICA GROUP	11,200	657.00	7,358,400
澤藤電機	1,400	1,144.00	1,601,600
デンソー	281,600	7,354.00	2,070,886,400
原田工業	5,500	858.00	4,719,000
コーセル	16,400	1,111.00	18,220,400
イリソ電子工業	12,600	4,450.00	56,070,000
オブテックスグループ	25,100	2,023.00	50,777,300
千代田インテグレ	4,700	2,276.00	10,697,200
レーザーテック	62,500	22,650.00	1,415,625,000
スタンレー電気	97,100	2,791.00	271,006,100
岩崎電気	4,400	2,896.00	12,742,400
ウシオ電機	71,300	1,585.00	113,010,500
岡谷電機産業	9,800	257.00	2,518,600
ヘリオス テクノ ホールディング	11,100	436.00	4,839,600
エノモト	3,100	1,874.00	5,809,400
日本セラミック	13,900	2,687.00	37,349,300
遠藤照明	5,400	734.00	3,963,600
古河電池	10,100	1,071.00	10,817,100
双信電機	5,000	376.00	1,880,000
山一電機	11,900	1,755.00	20,884,500
図研	11,900	3,195.00	38,020,500
日本電子	34,200	3,955.00	135,261,000
カシオ計算機	101,600	1,284.00	130,454,400
ファナック	133,900	23,080.00	3,090,412,000
日本シイエムケイ	29,000	502.00	14,558,000
エンプラス	4,000	4,010.00	16,040,000
大真空	16,600	732.00	12,151,200

ローム	63,100	10,510.00	663,181,000
浜松ホトニクス	109,500	7,040.00	770,880,000
三井ハイテック	14,100	7,150.00	100,815,000
新光電気工業	48,300	3,925.00	189,577,500
京セラ	212,100	6,510.00	1,380,771,000
協栄産業	1,100	1,728.00	1,900,800
太陽誘電	66,500	4,560.00	303,240,000
村田製作所	414,000	7,708.00	3,191,112,000
双葉電子工業	25,800	547.00	14,112,600
日東電工	99,400	8,460.00	840,924,000
北陸電気工業	4,500	1,307.00	5,881,500
東海理化電機製作所	38,600	1,461.00	56,394,600
ニチコン	27,900	1,344.00	37,497,600
日本ケミコン	13,500	1,955.00	26,392,500
KOA	20,600	1,867.00	38,460,200
三井E&Sホールディングス	63,200	398.00	25,153,600
日立造船	113,000	883.00	99,779,000
三菱重工業	241,100	4,940.00	1,191,034,000
川崎重工業	102,900	2,887.00	297,072,300
IHI	86,900	3,825.00	332,392,500
名村造船所	31,200	393.00	12,261,600
サノヤスホールディングス	16,800	131.00	2,200,800
スプリックス	4,300	882.00	3,792,600
マネジメントソリューションズ	7,700	3,555.00	27,373,500
プロレド・パートナーズ	3,300	518.00	1,709,400
and factory	3,600	361.00	1,299,600
テノ.ホールディングス	1,500	939.00	1,408,500
フロンティア・マネジメント	4,700	1,471.00	6,913,700
ピアラ	2,000	556.00	1,112,000
コプロ・ホールディングス	2,100	1,200.00	2,520,000
ギークス	1,800	978.00	1,760,400
カーブスホールディングス	43,100	800.00	34,480,000
フォーラムエンジニアリング	8,300	892.00	7,403,600
FAST FITNESS JAPAN	4,700	1,203.00	5,654,100
日本車輛製造	5,300	1,952.00	10,345,600
三菱ロジスネクスト	21,800	787.00	17,156,600
近畿車輛	1,500	1,071.00	1,606,500
一家ホールディングス	2,800	635.00	1,778,000
フルサト・マルカホールディングス	14,300	3,295.00	47,118,500
ヤマエグループホールディングス	8,200	1,438.00	11,791,600
ジャパクラフトホールディングス	4,000	580.00	2,320,000
FPG	54,500	1,162.00	63,329,000
島根銀行	4,200	500.00	2,100,000
じもとホールディングス	7,900	426.00	3,365,400
全国保証	35,200	4,900.00	172,480,000
めぶきフィナンシャルグループ	666,700	338.00	225,344,600
ジャパンインベストメントアドバイザー	10,900	1,081.00	11,782,900
東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,200	2,847.00	48,968,400

九州フィナンシャルグループ	236,800	475.00	112,480,000
かんぽ生命保険	163,300	2,289.00	373,793,700
ゆうちょ銀行	382,900	1,158.00	443,398,200
あんしん保証	6,000	267.00	1,602,000
富山第一銀行	33,400	609.00	20,340,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	740,900	566.00	419,349,400
ジェイリース	4,000	2,720.00	10,880,000
西日本フィナンシャルホールディングス	85,000	1,059.00	90,015,000
イントラスト	4,500	943.00	4,243,500
日本モーゲージサービス	6,700	883.00	5,916,100
CASA	4,500	822.00	3,699,000
アルヒ	16,500	1,067.00	17,605,500
プレミアグループ	22,600	1,651.00	37,312,600
日産自動車	1,939,100	474.10	919,327,310
いすゞ自動車	396,900	1,602.00	635,833,800
トヨタ自動車	7,495,900	1,897.00	14,219,722,300
日野自動車	175,800	560.00	98,448,000
三菱自動車工業	532,600	511.00	272,158,600
エフテック	8,300	540.00	4,482,000
レシップホールディングス	4,700	466.00	2,190,200
GMB	2,400	716.00	1,718,400
ファルテック	2,100	591.00	1,241,100
武蔵精密工業	33,300	1,800.00	59,940,000
日産車体	24,100	852.00	20,533,200
新明和工業	42,900	1,057.00	45,345,300
極東開発工業	24,000	1,439.00	34,536,000
トピー工業	11,100	1,699.00	18,858,900
ティラド	3,400	2,245.00	7,633,000
曙ブレーキ工業	83,300	152.00	12,661,600
タチエス	21,600	1,211.00	26,157,600
NOK	53,000	1,185.00	62,805,000
フタバ産業	36,500	394.00	14,381,000
KYB	13,100	3,640.00	47,684,000
市光工業	19,700	390.00	7,683,000
大同メタル工業	26,600	499.00	13,273,400
プレス工業	60,800	439.00	26,691,200
ミクニ	14,000	339.00	4,746,000
太平洋工業	31,300	1,114.00	34,868,200
河西工業	16,100	155.00	2,495,500
アイシン	105,400	3,625.00	382,075,000
マツダ	451,500	1,064.00	480,396,000
今仙電機製作所	7,700	676.00	5,205,200
本田技研工業	1,109,700	3,260.00	3,617,622,000
スズキ	250,800	4,833.00	1,212,116,400
SUBARU	432,000	2,159.50	932,904,000
安永	5,400	682.00	3,682,800
ヤマハ発動機	214,500	3,310.00	709,995,000
小糸製作所	164,200	2,215.00	363,703,000

T B K	11,700	246.00	2,878,200
エクセディ	22,200	1,733.00	38,472,600
ミツバ	25,600	530.00	13,568,000
豊田合成	39,800	2,156.00	85,808,800
愛三工業	22,600	846.00	19,119,600
盟和産業	1,500	934.00	1,401,000
日本プラスト	9,500	425.00	4,037,500
ヨロズ	12,600	720.00	9,072,000
エフ・シー・シー	24,300	1,433.00	34,821,900
新家工業	2,700	2,474.00	6,679,800
シマノ	55,800	23,890.00	1,333,062,000
テイ・エス テック	62,500	1,582.00	98,875,000
三十三フィナンシャルグループ	12,100	1,659.00	20,073,900
第四北越フィナンシャルグループ	21,200	3,060.00	64,872,000
ひろぎんホールディングス	175,500	666.00	116,883,000
マーキュリアホールディングス	7,100	760.00	5,396,000
おきなわフィナンシャルグループ	12,800	2,360.00	30,208,000
ダイレクトマーケティングミックス	16,800	1,629.00	27,367,200
ポピンズ	2,100	2,058.00	4,321,800
L I T A L I C O	10,900	2,688.00	29,299,200
十六フィナンシャルグループ	17,400	3,005.00	52,287,000
北國フィナンシャルホールディングス	11,400	3,960.00	45,144,000
ネットプロテクションズホールディングス	44,400	598.00	26,551,200
プロクレアホールディングス	16,600	2,308.00	38,312,800
あいちフィナンシャルグループ	18,800	2,266.00	42,600,800
ジャムコ	6,600	1,482.00	9,781,200
小野建	13,400	1,505.00	20,167,000
はるやまホールディングス	5,300	437.00	2,316,100
南陽	2,500	2,004.00	5,010,000
ノジマ	47,200	1,304.00	61,548,800
佐鳥電機	8,000	1,420.00	11,360,000
カップ・クリエイト	22,800	1,435.00	32,718,000
エコトレーディング	2,500	804.00	2,010,000
伯東	8,300	4,635.00	38,470,500
コンドーテック	11,100	1,005.00	11,155,500
中山福	6,600	334.00	2,204,400
ライトオン	9,700	559.00	5,422,300
ナガイレーベン	18,200	1,938.00	35,271,600
三菱食品	13,400	3,275.00	43,885,000
良品計画	186,300	1,382.00	257,466,600
パリミキホールディングス	16,500	277.00	4,570,500
松田産業	10,900	2,324.00	25,331,600
第一興商	27,900	3,925.00	109,507,500
メディパルホールディングス	149,700	1,721.00	257,633,700
アドヴァングループ	13,800	905.00	12,489,000
S P K	6,400	1,516.00	9,702,400
萩原電気ホールディングス	5,500	2,541.00	13,975,500
アルビス	4,700	2,416.00	11,355,200
アズワン	21,200	6,050.00	128,260,000

スズデン	5,100	2,456.00	12,525,600
尾家産業	3,100	942.00	2,920,200
シモジマ	9,900	1,007.00	9,969,300
ドウシシヤ	15,300	1,799.00	27,524,700
小津産業	2,900	1,581.00	4,584,900
コナカ	14,000	343.00	4,802,000
高速	7,500	1,919.00	14,392,500
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,634.00	2,777,800
G-7ホールディングス	18,000	1,494.00	26,892,000
たけびし	5,600	1,599.00	8,954,400
イオン北海道	21,400	888.00	19,003,200
コジマ	28,000	563.00	15,764,000
ヒマラヤ	4,100	929.00	3,808,900
コーナン商事	19,500	3,300.00	64,350,000
ネットワンシステムズ	51,000	3,225.00	164,475,000
エコス	5,400	1,871.00	10,103,400
ワタミ	17,400	972.00	16,912,800
マルシェ	4,000	394.00	1,576,000
リックス	2,700	2,283.00	6,164,100
システムソフト	46,400	90.00	4,176,000
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	291,500	2,377.00	692,895,500
丸文	12,900	1,256.00	16,202,400
西松屋チェーン	32,000	1,533.00	49,056,000
ゼンショーホールディングス	79,000	3,270.00	258,330,000
ハビネット	12,300	2,049.00	25,202,700
幸楽苑ホールディングス	9,500	1,080.00	10,260,000
ハークスレイ	4,500	806.00	3,627,000
橋本総業ホールディングス	5,800	1,063.00	6,165,400
日本ライフライン	42,300	896.00	37,900,800
サイゼリヤ	24,000	3,190.00	76,560,000
タカショー	12,500	675.00	8,437,500
VTホールディングス	54,800	507.00	27,783,600
アルゴグラフィックス	12,600	3,905.00	49,203,000
魚力	4,500	2,155.00	9,697,500
I DOM	43,700	838.00	36,620,600
日本エム・ディ・エム	8,000	1,002.00	8,016,000
ポブラ	3,200	139.00	444,800
フジ・コーポレーション	8,200	1,324.00	10,856,800
ユナイテッドアローズ	15,400	1,728.00	26,611,200
進和	9,600	2,096.00	20,121,600
エスケイジャパン	3,200	560.00	1,792,000
ダイترون	5,700	2,513.00	14,324,100
ハイデイ日高	21,400	2,047.00	43,805,800
シークス	20,500	1,435.00	29,417,500
YU-WA CREATION HOLDINGS	7,100	199.00	1,412,900
コロワイド	66,600	1,839.00	122,477,400
ピーシーデポコーポレーション	15,700	285.00	4,474,500
田中商事	3,900	582.00	2,269,800

オーハシテクニカ	7,200	1,486.00	10,699,200
壺番屋	11,500	4,715.00	54,222,500
白銅	5,300	2,563.00	13,583,900
トップカルチャー	4,200	185.00	777,000
PLANT	3,200	664.00	2,124,800
スギホールディングス	29,100	5,600.00	162,960,000
ダイコー通産	1,400	1,069.00	1,496,600
薬王堂ホールディングス	8,000	2,461.00	19,688,000
島津製作所	166,200	4,000.00	664,800,000
JMS	12,800	501.00	6,412,800
クボテック	3,200	230.00	736,000
長野計器	9,900	1,144.00	11,325,600
ブイ・テクノロジー	6,600	2,776.00	18,321,600
スター精密	26,000	1,675.00	43,550,000
東京計器	10,400	1,277.00	13,280,800
愛知時計電機	5,400	1,399.00	7,554,600
インターアクション	6,400	1,472.00	9,420,800
オーバル	10,700	457.00	4,889,900
東京精密	29,900	4,615.00	137,988,500
マニー	60,100	1,915.00	115,091,500
ニコン	212,300	1,257.00	266,861,100
トプコン	71,800	1,641.00	117,823,800
オリンパス	853,300	2,499.00	2,132,396,700
理研計器	8,500	4,700.00	39,950,000
SCREENホールディングス	23,300	10,250.00	238,825,000
キヤノン電子	15,100	1,708.00	25,790,800
タムロン	10,200	3,230.00	32,946,000
HOYA	291,500	14,220.00	4,145,130,000
シード	6,200	522.00	3,236,400
ノーリツ鋼機	12,900	2,357.00	30,405,300
A&Dホロンホールディングス	19,900	1,099.00	21,870,100
朝日インテック	152,500	2,310.00	352,275,000
キヤノン	749,000	2,914.00	2,182,586,000
リコー	342,200	1,008.00	344,937,600
シチズン時計	149,900	608.00	91,139,200
リズム	3,800	1,638.00	6,224,400
大研医器	9,300	461.00	4,287,300
メニコン	46,900	2,858.00	134,040,200
シンシア	1,200	494.00	592,800
KYORITSU	17,600	123.00	2,164,800
中本パックス	3,800	1,605.00	6,099,000
スノーピーク	23,300	2,132.00	49,675,600
パラマウントベッドホールディングス	31,600	2,314.00	73,122,400
トランザクション	10,500	1,546.00	16,233,000
粧美堂	3,500	378.00	1,323,000
ニホンフラッシュ	12,900	927.00	11,958,300
前田工織	11,600	3,395.00	39,382,000
永大産業	13,000	223.00	2,899,000
アートネイチャー	14,100	735.00	10,363,500
バンダイナムコホールディングス	124,700	8,621.00	1,075,038,700

アイフィスジャパン	3,500	608.00	2,128,000
SHOEI	14,400	5,040.00	72,576,000
フランスベッドホールディングス	16,800	968.00	16,262,400
マーベラス	22,300	700.00	15,610,000
パイロットコーポレーション	21,400	4,500.00	96,300,000
萩原工業	9,100	1,174.00	10,683,400
エイベックス	23,200	1,774.00	41,156,800
フジシールインターナショナル	27,700	1,653.00	45,788,100
タカラトミー	62,900	1,263.00	79,442,700
広済堂ホールディングス	8,200	2,064.00	16,924,800
エステールホールディングス	2,900	629.00	1,824,100
レック	19,500	1,005.00	19,597,500
タカノ	4,600	671.00	3,086,600
三光合成	17,100	577.00	9,866,700
プロネクサス	11,400	970.00	11,058,000
ホクシン	9,400	144.00	1,353,600
ウッドワン	4,000	907.00	3,628,000
大建工業	8,300	2,169.00	18,002,700
きもと	18,100	200.00	3,620,000
凸版印刷	178,500	2,063.00	368,245,500
大日本印刷	162,000	3,075.00	498,150,000
共同印刷	3,800	2,838.00	10,784,400
NISSHA	26,000	1,933.00	50,258,000
光村印刷	600	1,248.00	748,800
藤森工業	10,800	3,175.00	34,290,000
ヴィア・ホールディングス	17,900	98.00	1,754,200
TAKARA & COMPANY	8,800	2,157.00	18,981,600
前澤化成工業	8,800	1,360.00	11,968,000
未来工業	5,000	1,480.00	7,400,000
アシックス	126,000	3,090.00	389,340,000
ツツミ	2,400	1,896.00	4,550,400
ウェーブロックホールディングス	3,700	611.00	2,260,700
JSP	9,600	1,591.00	15,273,600
ニチハ	17,100	2,567.00	43,895,700
ローランド	10,000	3,770.00	37,700,000
エフピコ	25,900	3,685.00	95,441,500
小松ウオール工業	5,100	1,909.00	9,735,900
ヤマハ	86,100	5,090.00	438,249,000
河合楽器製作所	3,700	2,586.00	9,568,200
クリナップ	15,400	619.00	9,532,600
ピジョン	86,900	2,065.00	179,448,500
天馬	11,700	2,208.00	25,833,600
兼松サステック	600	2,245.00	1,347,000
キングジム	12,200	879.00	10,723,800
象印マホービン	40,800	1,663.00	67,850,400
リンテック	27,400	2,208.00	60,499,200
信越ポリマー	25,400	1,317.00	33,451,800
東リ	27,600	254.00	7,010,400
イトーキ	27,900	677.00	18,888,300
任天堂	861,900	5,624.00	4,847,325,600

三菱鉛筆	19,400	1,407.00	27,295,800
松風	6,200	2,192.00	13,590,400
タカラスタンダード	26,400	1,360.00	35,904,000
コクヨ	65,700	1,790.00	117,603,000
ナカバヤシ	15,000	485.00	7,275,000
ニフコ	49,400	3,470.00	171,418,000
立川プラインド工業	6,400	1,202.00	7,692,800
グロープライド	11,000	2,645.00	29,095,000
オカムラ	41,100	1,299.00	53,388,900
バルカー	11,500	3,175.00	36,512,500
MUTOHホールディングス	1,700	1,617.00	2,748,900
伊藤忠商事	890,100	4,056.00	3,610,245,600
丸紅	1,140,300	1,738.00	1,981,841,400
スクロール	21,500	775.00	16,662,500
高島	2,100	2,913.00	6,117,300
ヨンドシーホールディングス	12,400	1,772.00	21,972,800
三陽商会	4,600	1,411.00	6,490,600
長瀬産業	67,900	2,046.00	138,923,400
ナイガイ	4,100	259.00	1,061,900
蝶理	7,800	2,438.00	19,016,400
豊田通商	126,500	5,630.00	712,195,000
オンワードホールディングス	88,500	340.00	30,090,000
三共生興	20,700	511.00	10,577,700
兼松	56,000	1,582.00	88,592,000
美津濃	13,500	2,909.00	39,271,500
ツカモトコーポレーション	1,900	1,388.00	2,637,200
ルックホールディングス	3,500	2,568.00	8,988,000
三井物産	1,056,800	3,912.00	4,134,201,600
日本紙パルプ商事	7,600	5,200.00	39,520,000
東京エレクトロン	96,300	46,710.00	4,498,173,000
カメイ	15,400	1,470.00	22,638,000
東都水産	600	5,250.00	3,150,000
OUGホールディングス	2,000	2,413.00	4,826,000
スターゼン	11,000	2,101.00	23,111,000
セイコーグループ	21,200	2,940.00	62,328,000
山善	38,900	1,051.00	40,883,900
椿本興業	2,100	4,120.00	8,652,000
住友商事	894,600	2,324.50	2,079,497,700
BIPROGY	50,400	3,080.00	155,232,000
内田洋行	6,400	4,715.00	30,176,000
三菱商事	903,100	4,590.00	4,145,229,000
第一実業	5,100	4,845.00	24,709,500
キャノンマーケティングジャパン	33,400	3,050.00	101,870,000
西華産業	5,700	1,585.00	9,034,500
佐藤商事	10,100	1,355.00	13,685,500
菱洋エレクトロ	12,300	2,306.00	28,363,800
東京産業	13,300	774.00	10,294,200
ユアサ商事	13,000	3,535.00	45,955,000
神鋼商事	3,600	5,600.00	20,160,000
トルク	6,600	209.00	1,379,400

阪和興業	25,900	4,140.00	107,226,000
正栄食品工業	9,600	4,160.00	39,936,000
カナデン	11,700	1,103.00	12,905,100
菱電商事	11,600	1,780.00	20,648,000
ニプロ	113,800	1,029.00	117,100,200
岩谷産業	32,900	5,440.00	178,976,000
ナイス	3,500	1,334.00	4,669,000
ニチモウ	1,400	3,075.00	4,305,000
極東貿易	8,700	1,396.00	12,145,200
アステナホールディングス	25,000	421.00	10,525,000
兼松エレクトロニクス	8,500	6,190.00	52,615,000
三愛オブリ	39,800	1,356.00	53,968,800
稲畑産業	29,200	2,458.00	71,773,600
G S I クレオス	8,500	1,585.00	13,472,500
明和産業	19,200	706.00	13,555,200
クワザワホールディングス	4,400	442.00	1,944,800
キムラタン	72,800	21.00	1,528,800
ゴールドウイン	24,300	9,880.00	240,084,000
ユニ・チャーム	285,200	5,045.00	1,438,834,000
デサント	23,500	3,945.00	92,707,500
キング	5,400	508.00	2,743,200
ワキタ	26,500	1,159.00	30,713,500
ヤマトインターナショナル	9,800	250.00	2,450,000
東邦ホールディングス	35,900	2,057.00	73,846,300
サンゲツ	36,300	2,238.00	81,239,400
ミツウロコグループホールディングス	18,600	1,155.00	21,483,000
シナネンホールディングス	4,600	3,555.00	16,353,000
伊藤忠エネクス	35,800	1,070.00	38,306,000
サンリオ	41,000	4,935.00	202,335,000
サンワテクノス	7,400	1,971.00	14,585,400
リョーサン	15,400	2,956.00	45,522,400
新光商事	19,400	1,288.00	24,987,200
トーヨー	6,200	1,744.00	10,812,800
三信電気	5,800	2,451.00	14,215,800
東陽テクニカ	15,900	1,354.00	21,528,600
モスフードサービス	21,300	3,070.00	65,391,000
加賀電子	11,800	4,450.00	52,510,000
三益半導体工業	10,800	2,579.00	27,853,200
都築電気	7,200	1,335.00	9,612,000
ソーダニッカ	9,400	744.00	6,993,600
立花エレテック	10,500	1,827.00	19,183,500
木曽路	21,900	2,096.00	45,902,400
S R S ホールディングス	23,800	907.00	21,586,600
千趣会	27,100	396.00	10,731,600
タカキュー	9,200	78.00	717,600
リテールパートナーズ	21,500	1,321.00	28,401,500
ケーヨー	23,400	887.00	20,755,800
上新電機	12,900	1,924.00	24,819,600
日本瓦斯	77,400	1,894.00	146,595,600
ロイヤルホールディングス	28,000	2,501.00	70,028,000

東天紅	600	750.00	450,000
いなげや	14,100	1,274.00	17,963,400
チョダ	13,800	772.00	10,653,600
ライフコーポレーション	12,600	2,745.00	34,587,000
リンガーハット	18,600	2,253.00	41,905,800
MrMaxHD	20,400	675.00	13,770,000
テンアライド	13,700	270.00	3,699,000
AOKIホールディングス	26,800	685.00	18,358,000
オークワ	23,000	897.00	20,631,000
コメリ	22,300	2,600.00	57,980,000
青山商事	30,900	913.00	28,211,700
しまむら	16,900	12,620.00	213,278,000
はせがわ	6,200	337.00	2,089,400
高島屋	108,900	1,788.00	194,713,200
松屋	24,500	1,135.00	27,807,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	70,300	1,258.00	88,437,400
近鉄百貨店	4,600	2,495.00	11,477,000
丸井グループ	106,500	2,194.00	233,661,000
クレディセゾン	85,100	1,729.00	147,137,900
アクシアル リテイリング	9,900	3,430.00	33,957,000
井筒屋	6,100	333.00	2,031,300
イオン	489,700	2,626.00	1,285,952,200
イズミ	22,000	2,881.00	63,382,000
フォーバル	5,500	1,048.00	5,764,000
平和堂	24,000	2,114.00	50,736,000
フジ	22,200	1,809.00	40,159,800
ヤオコー	16,300	6,700.00	109,210,000
ゼビオホールディングス	19,700	916.00	18,045,200
ケーズホールディングス	114,900	1,174.00	134,892,600
PALTAC	22,700	4,770.00	108,279,000
三谷産業	25,300	315.00	7,969,500
Olympicグループ	5,200	519.00	2,698,800
日産東京販売ホールディングス	16,400	310.00	5,084,000
SBI新生銀行	39,700	2,395.00	95,081,500
あおぞら銀行	84,400	2,624.00	221,465,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,536,500	938.10	8,008,090,650
りそなホールディングス	1,716,000	711.90	1,221,620,400
三井住友トラスト・ホールディングス	244,400	4,795.00	1,171,898,000
三井住友フィナンシャルグループ	982,500	5,634.00	5,535,405,000
千葉銀行	374,700	956.00	358,213,200
群馬銀行	260,600	489.00	127,433,400
武蔵野銀行	17,100	2,315.00	39,586,500
千葉興業銀行	28,000	509.00	14,252,000
筑波銀行	59,100	231.00	13,652,100
七十七銀行	43,000	2,238.00	96,234,000
秋田銀行	9,000	1,831.00	16,479,000
山形銀行	15,000	1,151.00	17,265,000
岩手銀行	9,200	2,291.00	21,077,200
東邦銀行	107,200	238.00	25,513,600
東北銀行	6,000	1,023.00	6,138,000

ふくおかフィナンシャルグループ	107,300	2,924.00	313,745,200
スルガ銀行	118,500	421.00	49,888,500
八十二銀行	275,500	557.00	153,453,500
山梨中央銀行	13,700	1,268.00	17,371,600
大垣共立銀行	25,700	1,916.00	49,241,200
福井銀行	12,000	1,679.00	20,148,000
清水銀行	5,400	1,513.00	8,170,200
富山銀行	1,900	1,767.00	3,357,300
滋賀銀行	22,400	2,804.00	62,809,600
南都銀行	20,200	2,598.00	52,479,600
百五銀行	126,600	405.00	51,273,000
京都銀行	42,600	6,100.00	259,860,000
紀陽銀行	48,100	1,606.00	77,248,600
ほくほくフィナンシャルグループ	85,400	999.00	85,314,600
山陰合同銀行	84,000	804.00	67,536,000
鳥取銀行	3,900	1,229.00	4,793,100
百十四銀行	12,200	1,924.00	23,472,800
四国銀行	21,200	938.00	19,885,600
阿波銀行	19,900	2,122.00	42,227,800
大分銀行	8,000	2,103.00	16,824,000
宮崎銀行	8,800	2,646.00	23,284,800
佐賀銀行	7,800	1,833.00	14,297,400
琉球銀行	30,500	946.00	28,853,000
セブン銀行	481,400	262.00	126,126,800
みずほフィナンシャルグループ	1,944,500	2,077.50	4,039,698,750
高知銀行	4,100	723.00	2,964,300
山口フィナンシャルグループ	148,500	876.00	130,086,000
芙蓉総合リース	12,400	8,850.00	109,740,000
みずほリース	20,000	3,435.00	68,700,000
東京センチュリー	25,100	4,570.00	114,707,000
SBIホールディングス	194,600	2,769.00	538,847,400
日本証券金融	54,000	1,039.00	56,106,000
アイフル	222,600	390.00	86,814,000
日本アジア投資	9,600	224.00	2,150,400
長野銀行	3,700	1,400.00	5,180,000
名古屋銀行	8,900	3,505.00	31,194,500
北洋銀行	204,100	277.00	56,535,700
大光銀行	3,500	1,232.00	4,312,000
愛媛銀行	18,100	931.00	16,851,100
トマト銀行	4,000	1,075.00	4,300,000
京葉銀行	62,500	608.00	38,000,000
栃木銀行	61,600	314.00	19,342,400
北日本銀行	4,700	2,141.00	10,062,700
東和銀行	24,900	600.00	14,940,000
福島銀行	12,800	256.00	3,276,800
大東銀行	4,600	735.00	3,381,000
リコーリース	12,700	3,840.00	48,768,000
イオンフィナンシャルサービス	77,100	1,302.00	100,384,200
アコム	240,200	322.00	77,344,400
ジャックス	14,300	4,155.00	59,416,500

オリエントコーポレーション	35,100	1,155.00	40,540,500
オリックス	899,200	2,333.50	2,098,283,200
三菱HCキャピタル	523,800	666.00	348,850,800
ジャフコ グループ	44,900	2,145.00	96,310,500
九州リースサービス	5,600	808.00	4,524,800
トモニホールディングス	109,000	387.00	42,183,000
大和証券グループ本社	961,300	615.00	591,199,500
野村ホールディングス	2,476,600	540.70	1,339,097,620
岡三証券グループ	118,400	421.00	49,846,400
丸三証券	44,700	424.00	18,952,800
東洋証券	44,600	297.00	13,246,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	146,200	375.00	54,825,000
光世証券	2,700	365.00	985,500
水戸証券	36,200	299.00	10,823,800
いちよし証券	24,600	617.00	15,178,200
松井証券	79,500	780.00	62,010,000
SOMPOホールディングス	230,700	5,551.00	1,280,615,700
日本取引所グループ	377,700	1,957.00	739,158,900
マネックスグループ	150,100	515.00	77,301,500
極東証券	16,800	601.00	10,096,800
岩井コスモホールディングス	15,300	1,341.00	20,517,300
アイザワ証券グループ	19,400	714.00	13,851,600
フィデアホールディングス	13,800	1,469.00	20,272,200
池田泉州ホールディングス	170,800	247.00	42,187,600
アニコム ホールディングス	45,700	591.00	27,008,700
MS&ADインシュアランスグループ ホールディングス	273,600	4,202.00	1,149,667,200
マネーパートナーズグループ	12,500	260.00	3,250,000
スパークス・グループ	15,000	1,719.00	25,785,000
小林洋行	2,800	225.00	630,000
第一生命ホールディングス	684,500	2,966.00	2,030,227,000
東京海上ホールディングス	1,353,800	2,727.00	3,691,812,600
アドバンテッジリスクマネジメント	5,700	465.00	2,650,500
イー・ギャランティ	21,700	2,283.00	49,541,100
アサックス	5,500	612.00	3,366,000
NECキャピタルソリューション	6,700	2,521.00	16,890,700
T&Dホールディングス	360,900	2,012.00	726,130,800
アドバンスクリエイト	7,800	1,168.00	9,110,400
三井不動産	584,300	2,439.50	1,425,399,850
三菱地所	811,200	1,682.00	1,364,438,400
平和不動産	21,800	3,525.00	76,845,000
東京建物	128,100	1,585.00	203,038,500
京阪神ビルディング	16,900	1,242.00	20,989,800
住友不動産	243,000	3,134.00	761,562,000
太平洋興発	4,400	897.00	3,946,800
テーオーシー	24,500	659.00	16,145,500
東京楽天地	2,400	4,290.00	10,296,000
レオパレス21	151,400	325.00	49,205,000
スターツコーポレーション	19,300	2,489.00	48,037,700

フジ住宅	18,800	680.00	12,784,000
空港施設	16,200	518.00	8,391,600
明和地所	6,100	872.00	5,319,200
ゴールドクレスト	12,800	1,615.00	20,672,000
リログループ	78,100	2,141.00	167,212,100
エスリード	6,400	2,100.00	13,440,000
日神グループホールディングス	21,700	445.00	9,656,500
日本エスコン	30,300	823.00	24,936,900
MIRARTHホールディングス	67,700	359.00	24,304,300
AVANTIA	5,900	798.00	4,708,200
イオンモール	69,700	1,795.00	125,111,500
毎日コムネット	4,500	679.00	3,055,500
ファースト住建	5,000	1,055.00	5,275,000
ランド	810,900	9.00	7,298,100
カチタス	36,100	2,809.00	101,404,900
東祥	9,800	1,172.00	11,485,600
トーセイ	22,300	1,422.00	31,710,600
穴吹興産	2,400	2,124.00	5,097,600
サンフロンティア不動産	22,400	1,094.00	24,505,600
FJネクストホールディングス	14,100	988.00	13,930,800
インテリックス	3,100	580.00	1,798,000
ランドビジネス	4,400	232.00	1,020,800
サンネクスタグループ	3,600	939.00	3,380,400
グランディハウス	10,100	575.00	5,807,500
東武鉄道	150,000	3,035.00	455,250,000
相鉄ホールディングス	45,100	2,257.00	101,790,700
東急	382,700	1,614.00	617,677,800
京浜急行電鉄	154,800	1,303.00	201,704,400
小田急電鉄	206,900	1,667.00	344,902,300
京王電鉄	72,200	4,800.00	346,560,000
京成電鉄	88,000	3,740.00	329,120,000
富士急行	16,800	4,425.00	74,340,000
東日本旅客鉄道	231,600	6,873.00	1,591,786,800
西日本旅客鉄道	174,300	5,269.00	918,386,700
東海旅客鉄道	105,200	15,345.00	1,614,294,000
西武ホールディングス	165,100	1,455.00	240,220,500
鴻池運輸	23,300	1,528.00	35,602,400
西日本鉄道	36,400	2,351.00	85,576,400
ハマキョウレックス	10,700	3,235.00	34,614,500
サカイ引越センター	6,500	4,310.00	28,015,000
近鉄グループホールディングス	136,300	4,190.00	571,097,000
阪急阪神ホールディングス	181,700	3,855.00	700,453,500
南海電気鉄道	65,100	2,763.00	179,871,300
京阪ホールディングス	56,300	3,390.00	190,857,000
神戸電鉄	3,700	3,160.00	11,692,000
名古屋鉄道	150,600	2,069.00	311,591,400
山陽電気鉄道	10,300	2,166.00	22,309,800
アルプス物流	10,900	1,312.00	14,300,800
トランコム	3,900	7,130.00	27,807,000
ヤマトホールディングス	174,500	2,440.00	425,780,000

山九	34,700	5,000.00	173,500,000
日新	10,300	2,188.00	22,536,400
丸運	6,500	221.00	1,436,500
丸全昭和運輸	8,500	3,090.00	26,265,000
センコーグループホールディングス	72,200	993.00	71,694,600
トナミホールディングス	2,500	3,725.00	9,312,500
ニッコンホールディングス	43,700	2,475.00	108,157,500
日本石油輸送	800	2,323.00	1,858,400
福山通運	10,400	3,370.00	35,048,000
セイノーホールディングス	84,900	1,315.00	111,643,500
エスライン	3,700	816.00	3,019,200
神奈川中央交通	3,900	3,300.00	12,870,000
AZ-COM丸和ホールディングス	32,900	1,692.00	55,666,800
C&Fロジホールディングス	13,200	1,202.00	15,866,400
日本郵船	364,600	3,194.00	1,164,532,400
商船三井	240,200	3,300.00	792,660,000
川崎汽船	116,100	3,120.00	362,232,000
NSユニテッド海運	7,300	3,895.00	28,433,500
明治海運	11,800	657.00	7,752,600
飯野海運	50,000	922.00	46,100,000
共栄タンカー	2,200	954.00	2,098,800
九州旅客鉄道	96,300	2,851.00	274,551,300
SGホールディングス	261,600	2,113.00	552,760,800
NIPPON EXPRESSホールディングス	50,900	7,510.00	382,259,000
日本航空	334,800	2,614.00	875,167,200
ANAホールディングス	370,800	2,835.00	1,051,218,000
ビーウィズ	2,700	1,466.00	3,958,200
パスコ	2,500	1,460.00	3,650,000
TREホールディングス	29,500	1,419.00	41,860,500
人・夢・技術グループ	6,300	1,394.00	8,782,200
西本Wismettacホールディングス	3,600	3,520.00	12,672,000
シルバーライフ	3,300	1,701.00	5,613,300
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,746.00	1,746,000
Genky Drug Stores	6,300	4,245.00	26,743,500
コア商事ホールディングス	8,200	673.00	5,518,600
KPPグループホールディングス	33,600	879.00	29,534,400
ナルミヤ・インターナショナル	2,100	922.00	1,936,200
ブックオフグループホールディングス	8,400	1,262.00	10,600,800
ギフトホールディングス	3,100	4,215.00	13,066,500
三菱倉庫	29,300	3,115.00	91,269,500
三井倉庫ホールディングス	12,700	3,750.00	47,625,000
住友倉庫	37,500	2,007.00	75,262,500
澁澤倉庫	5,500	2,097.00	11,533,500
ヤマタネ	6,400	1,669.00	10,681,600
東陽倉庫	16,400	277.00	4,542,800
乾汽船	17,300	1,990.00	34,427,000
日本トランスシティ	27,600	541.00	14,931,600
ケイヒン	2,200	1,519.00	3,341,800

中央倉庫	6,700	972.00	6,512,400
川西倉庫	2,100	1,007.00	2,114,700
安田倉庫	9,500	934.00	8,873,000
ファイブホールディングス	2,300	1,157.00	2,661,100
大栄環境	26,700	1,634.00	43,627,800
東洋埠頭	3,500	1,334.00	4,669,000
上組	65,300	2,648.00	172,914,400
サンリツ	2,800	745.00	2,086,000
キムラユニティー	5,900	997.00	5,882,300
キューソー流通システム	7,300	956.00	6,978,800
東海運	7,500	283.00	2,122,500
エーアイテイー	8,600	1,566.00	13,467,600
内外トランスライン	5,000	2,208.00	11,040,000
ショーエイコーポレーション	3,800	584.00	2,219,200
日本コンセプト	4,200	1,522.00	6,392,400
TBSホールディングス	70,200	1,491.00	104,668,200
日本テレビホールディングス	121,300	1,026.00	124,453,800
朝日放送グループホールディングス	13,000	641.00	8,333,000
テレビ朝日ホールディングス	33,300	1,307.00	43,523,100
スカパーJ S A Tホールディングス	121,300	476.00	57,738,800
テレビ東京ホールディングス	9,800	1,909.00	18,708,200
日本BS放送	4,400	904.00	3,977,600
ビジョン	18,100	1,428.00	25,846,800
スマートバリュー	3,000	411.00	1,233,000
USEN-NEXT HOLDINGS	12,300	2,295.00	28,228,500
ワイヤレスゲート	5,500	251.00	1,380,500
コネクシオ	8,900	1,909.00	16,990,100
日本通信	126,200	219.00	27,637,800
クロップス	2,100	1,094.00	2,297,400
日本電信電話	1,754,400	3,857.00	6,766,720,800
KDDI	1,058,000	3,968.00	4,198,144,000
ソフトバンク	2,199,300	1,530.50	3,366,028,650
光通信	16,100	18,720.00	301,392,000
エムティーアイ	12,500	507.00	6,337,500
GMOインターネットグループ	50,900	2,600.00	132,340,000
ファイバーゲート	7,300	933.00	6,810,900
アイドママーケティングコミュニケーション	3,100	281.00	871,100
KADOKAWA	72,300	2,511.00	181,545,300
学研ホールディングス	22,800	947.00	21,591,600
ゼンリン	23,300	865.00	20,154,500
昭文社ホールディングス	5,600	292.00	1,635,200
インプレスホールディングス	10,800	204.00	2,203,200
東京電力ホールディングス	1,230,600	459.00	564,845,400
中部電力	503,100	1,385.00	696,793,500
関西電力	527,100	1,216.00	640,953,600
中国電力	217,400	686.00	149,136,400
北陸電力	128,700	530.00	68,211,000
東北電力	333,700	666.00	222,244,200

四国電力	116,500	727.00	84,695,500
九州電力	315,000	732.00	230,580,000
北海道電力	131,700	476.00	62,689,200
沖縄電力	31,900	1,053.00	33,590,700
電源開発	102,800	2,137.00	219,683,600
エフオン	8,900	501.00	4,458,900
イーレックス	24,300	2,350.00	57,105,000
レノバ	36,300	2,167.00	78,662,100
東京瓦斯	288,600	2,743.00	791,629,800
大阪瓦斯	276,600	2,147.00	593,860,200
東邦瓦斯	53,800	2,480.00	133,424,000
北海道瓦斯	8,200	1,802.00	14,776,400
広島ガス	28,800	339.00	9,763,200
西部ガスホールディングス	12,800	1,767.00	22,617,600
静岡ガス	31,200	1,115.00	34,788,000
メタウォーター	17,000	1,663.00	28,271,000
アイネット	8,400	1,287.00	10,810,800
松竹	7,800	11,040.00	86,112,000
東宝	85,700	4,740.00	406,218,000
エイチ・アイ・エス	36,700	2,065.00	75,785,500
東映	3,800	16,990.00	64,562,000
ラックランド	4,400	2,913.00	12,817,200
エヌ・ティ・ティ・データ	429,600	1,986.00	853,185,600
共立メンテナンス	24,000	5,680.00	136,320,000
イチネンホールディングス	15,000	1,279.00	19,185,000
建設技術研究所	7,200	3,295.00	23,724,000
スペース	10,000	934.00	9,340,000
アインホールディングス	19,900	5,380.00	107,062,000
燦ホールディングス	6,000	1,925.00	11,550,000
ピー・シー・エー	7,800	1,236.00	9,640,800
スバル興業	600	8,970.00	5,382,000
東京テアトル	4,600	1,124.00	5,170,400
タナベコンサルティンググループ	5,000	671.00	3,355,000
ビジネスブレイン太田昭和	5,900	2,030.00	11,977,000
ナガワ	3,700	7,590.00	28,083,000
東京都競馬	11,800	3,865.00	45,607,000
常磐興産	4,300	1,231.00	5,293,300
カナモト	25,700	2,196.00	56,437,200
DTS	29,100	3,120.00	90,792,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	68,800	6,140.00	422,432,000
シーイーシー	19,200	1,571.00	30,163,200
カプコン	136,000	4,185.00	569,160,000
西尾レントオール	13,000	2,988.00	38,844,000
アイ・エス・ビー	7,000	1,197.00	8,379,000
アゴーラ ホスピタリティール グループ	70,200	22.00	1,544,400
日本空港ビルデング	47,600	6,500.00	309,400,000
トランス・コスモス	17,400	3,310.00	57,594,000
乃村工藝社	61,200	916.00	56,059,200

ジャステック	8,400	1,228.00	10,315,200
S C S K	111,700	1,963.00	219,267,100
藤田観光	6,200	3,375.00	20,925,000
KNT-CTホールディングス	8,400	1,707.00	14,338,800
日本管財	14,800	2,500.00	37,000,000
トーカイ	12,500	1,905.00	23,812,500
白洋舎	1,100	1,728.00	1,900,800
セコム	142,900	7,615.00	1,088,183,500
NSW	5,400	2,092.00	11,296,800
セントラル警備保障	7,500	2,548.00	19,110,000
アイネス	9,500	1,318.00	12,521,000
丹青社	27,000	707.00	19,089,000
メイテック	55,900	2,442.00	136,507,800
TKC	24,600	3,625.00	89,175,000
富士ソフト	15,500	7,390.00	114,545,000
応用地質	13,100	1,963.00	25,715,300
船井総研ホールディングス	29,500	2,702.00	79,709,000
NSD	48,800	2,315.00	112,972,000
進学会ホールディングス	4,200	298.00	1,251,600
丸紅建材リース	800	1,876.00	1,500,800
オオバ	7,900	710.00	5,609,000
コナミグループ	58,600	6,130.00	359,218,000
いであ	2,800	1,570.00	4,396,000
学究社	5,600	1,919.00	10,746,400
ベネッセホールディングス	52,300	1,930.00	100,939,000
イオンディライト	15,500	2,989.00	46,329,500
ナック	6,500	962.00	6,253,000
福井コンピュータホールディングス	9,500	3,015.00	28,642,500
ダイセキ	28,700	4,255.00	122,118,500
ステップ	5,800	1,776.00	10,300,800
日鉄物産	9,900	9,230.00	91,377,000
泉州電業	7,200	3,505.00	25,236,000
元気寿司	4,100	2,976.00	12,201,600
トラスコ中山	30,300	2,039.00	61,781,700
ヤマダホールディングス	592,400	467.00	276,650,800
オートバックスセブン	50,200	1,420.00	71,284,000
モリト	10,400	949.00	9,869,600
アー克蘭ズ	21,200	1,440.00	30,528,000
ニトリホールディングス	58,400	17,000.00	992,800,000
グルメ杵屋	11,800	1,010.00	11,918,000
愛眼	7,600	165.00	1,254,000
ケーユーホールディングス	8,500	1,443.00	12,265,500
吉野家ホールディングス	56,400	2,366.00	133,442,400
加藤産業	17,500	3,570.00	62,475,000
北恵	2,900	686.00	1,989,400
イノテック	9,100	1,342.00	12,212,200
イエローハット	25,500	1,733.00	44,191,500
松屋フーズホールディングス	6,800	3,960.00	26,928,000
J B C Cホールディングス	9,900	2,010.00	19,899,000
J Kホールディングス	11,400	1,063.00	12,118,200

サガミホールディングス	23,200	1,250.00	29,000,000
日伝	8,600	1,855.00	15,953,000
関西フードマーケット	13,000	1,287.00	16,731,000
ミロク情報サービス	12,500	1,836.00	22,950,000
北沢産業	7,100	234.00	1,661,400
杉本商事	6,200	1,946.00	12,065,200
因幡電機産業	37,400	2,761.00	103,261,400
王将フードサービス	9,500	5,990.00	56,905,000
ミニストップ	10,400	1,405.00	14,612,000
アークス	26,500	2,152.00	57,028,000
バローホールディングス	27,600	1,838.00	50,728,800
東テク	4,900	3,855.00	18,889,500
ミスミグループ本社	217,900	3,290.00	716,891,000
アルテック	7,100	269.00	1,909,900
ベルク	7,200	5,480.00	39,456,000
大 庄	6,900	1,036.00	7,148,400
タキヒヨー	3,100	953.00	2,954,300
ファーストリテイリング	21,700	82,560.00	1,791,552,000
ソフトバンクグループ	791,600	6,268.00	4,961,748,800
蔵王産業	2,200	1,928.00	4,241,600
スズケン	44,900	3,400.00	152,660,000
サンドラッグ	54,800	3,605.00	197,554,000
サックスパー ホールディングス	13,700	742.00	10,165,400
ジェコス	9,400	850.00	7,990,000
ヤマザワ	2,300	1,372.00	3,155,600
やまや	2,800	2,562.00	7,173,600
グローセル	15,400	407.00	6,267,800
ベルーナ	33,800	685.00	23,153,000
合計	159,799,800		389,230,950,760

(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17期中間計算期間（2023年2月8日から2023年8月7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。

# 独立監査人の中間監査報告書

2023年10月6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 稲葉 宏和  
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One DC 国内株式インデックスファンドの2023年2月8日から2023年8月7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、One DC 国内株式インデックスファンドの2023年8月7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（2023年2月8日から2023年8月7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、継続企業的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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 【中間財務諸表】

## 【One DC 国内株式インデックスファンド】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 2023年2月7日現在	第17期中間計算期間末 2023年8月7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	264,167,212	309,648,104
親投資信託受益証券	83,855,522,086	109,083,887,544
未収入金	20,219,000	27,670,000
流動資産合計	84,139,908,298	109,421,205,648
資産合計	84,139,908,298	109,421,205,648
負債の部		
流動負債		
未払解約金	221,459,749	260,058,115
未払受託者報酬	8,481,178	10,383,984
未払委託者報酬	50,887,250	62,304,048
その他未払費用	379,306	445,997
流動負債合計	281,207,483	333,192,144
負債合計	281,207,483	333,192,144
純資産の部		
元本等		
元本	50,657,997,778	56,472,695,285
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金(△)	33,200,703,037	52,615,318,219
(分配準備積立金)	11,053,520,359	9,804,307,632
元本等合計	83,858,700,815	109,088,013,504
純資産合計	83,858,700,815	109,088,013,504
負債純資産合計	84,139,908,298	109,421,205,648

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第16期中間計算期間 自 2022年2月8日 至 2022年8月7日	第17期中間計算期間 自 2023年2月8日 至 2023年8月7日
営業収益		
受取利息	761	1,796
有価証券売買等損益	1,882,319,923	14,839,339,458
営業収益合計	1,882,320,684	14,839,341,254
営業費用		
支払利息	16,507	77,884
受託者報酬	7,368,185	10,383,984
委託者報酬	44,209,305	62,304,048
その他費用	338,947	445,997
営業費用合計	51,932,944	73,211,913
営業利益又は営業損失(△)	1,830,387,740	14,766,129,341
経常利益又は経常損失(△)	1,830,387,740	14,766,129,341
中間純利益又は中間純損失(△)	1,830,387,740	14,766,129,341
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(△)	△7,373,994	870,491,374
期首剰余金又は期首欠損金(△)	23,566,324,934	33,200,703,037
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,577,140,030	9,758,119,733
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	4,577,140,030	9,758,119,733
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,502,769,514	4,239,142,518
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,502,769,514	4,239,142,518
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(△)	27,478,457,184	52,615,318,219

(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17期中間計算期間	
	自	至
	2023年2月8日	2023年8月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第16期	第17期中間計算期間末
	2023年2月7日現在	2023年8月7日現在
1. 期首元本額	41,575,264,407円	50,657,997,778円
期中追加設定元本額	18,140,275,590円	12,204,461,250円
期中一部解約元本額	9,057,542,219円	6,389,763,743円
2. 受益権の総数	50,657,997,778口	56,472,695,285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16期	第17期中間計算期間末
	2023年2月7日現在	2023年8月7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があります。	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16期 2023年2月7日現在	第17期中間計算期間末 2023年8月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6554円 (16,554円)	1.9317円 (19,317円)

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

2023年8月7日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,523,694,516
株式	427,126,746,124
派生商品評価勘定	38,446,770
未収入金	24,354,000
未収配当金	614,886,389
前払金	33,610,000
差入委託証拠金	257,115,000
流動資産合計	434,618,852,799
資産合計	434,618,852,799
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	24,156,150
未払解約金	1,019,025,000
流動負債合計	1,043,181,150
負債合計	1,043,181,150
純資産の部	
元本等	
元本	110,003,559,907
剰余金	
剰余金又は欠損金(△)	323,572,111,742
元本等合計	433,575,671,649
純資産合計	433,575,671,649
負債純資産合計	434,618,852,799

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2023年2月8日 至 2023年8月7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	2023年8月7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	117,622,712,134円
同期中追加設定元本額	24,767,244,203円
同期中一部解約元本額	32,386,396,430円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM TOPIXオープン	2,551,681,654円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	2,768,580,808円
One DC 国内株式インデックスファンド	27,675,729,429円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	3,767,689,204円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	1,401,759円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	8,999,824円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	21,163,429円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	20,126,491円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	25,635,647円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	15,844,715円
たわらノーロード TOPIX	1,902,320,230円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,574,815,602円
たわらノーロード バランス（堅実型）	50,181,106円
たわらノーロード バランス（標準型）	354,869,569円
たわらノーロード バランス（積極型）	585,879,860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）	3,062,778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）	163,855,718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）	428,805,932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）	345,939,641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）	492,963,039円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	370,540円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,561,784円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	32,299,141円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	3,706,541円

たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	12,526,895円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,301,098,271円
O n eグローバルバランス	23,785,938円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	986,120,247円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	3,488,588,429円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3,899,282,822円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	314,801,257円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,029,925,339円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	1,106,134,254円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,264,986円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,079,733,764円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	14,869,106円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	303,367,667円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	340,413,028円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	560,464,469円
投資のソムリエ	4,261,474,701円
クルーズコントロール	375,914,208円
投資のソムリエ<DC年金>	356,860,459円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	346,957,395円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	967,670,203円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	340,852,018円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,279,890,507円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	71,537,481円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	35,794,092円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	2,549,819円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	112,464,093円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	487,735,046円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	868,717,861円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	246,144,946円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	71,727,756円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	38,957,289円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	23,960,048円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	433,118,514円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	5,610,944円
O n eグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	1,796,545円
O n eグローバル最適化バランス (成長型) <ラップ向け>	41,978,832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)	50,353,320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)	51,315,734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)	29,260,453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)	31,335,572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)	49,492,521円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII 2021-04 (適格機関投資家限定)	127,629,264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)	182,933,732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)	44,683,963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）2022-05（適格機関投資家限定）	147,094,024円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）2022-10（適格機関投資家限定）	482,863,894円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	118,471,198円
AMOne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）（適格機関投資家限定）	27,267,111円
DIAMワールドバランス25VA（適格機関投資家限定）	25,659,880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）	106,449,842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）	83,808,379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）	1,719,038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）	38,627,075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）	80,919,394円
DIAM国際分散バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	2,773,533円
DIAM国際分散バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	12,275,341円
DIAM国内重視バランスファンド30VA（適格機関投資家限定）	3,656,254円
DIAM国内重視バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	84,378円
DIAM世界バランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	1,621,766円
DIAM世界バランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	19,356,065円
DIAMバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	339,572,642円
DIAMバランスファンド37.5VA（適格機関投資家限定）	451,053,305円
DIAMバランスファンド50VA（適格機関投資家限定）	1,346,627,393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）	12,248,684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）	17,604,176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）	176,583,949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）	33,604,686円
DIAM世界バランスファンド55VA（適格機関投資家限定）	58,364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）	213,985,996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）	14,173,923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）	44,084,556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）	102,790,092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）	147,904,005円
DIAM世界バランス25VA（適格機関投資家限定）	19,220,180円
DIAM国内バランス30VA（適格機関投資家限定）	13,076,909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）	7,390,636円
動的パッケージファンド<DC年金>	26,648,205円
コア資産形成ファンド	15,941,080円
MHAMトピックスファンド	781,457,037円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	45,266,387円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	3,128,230,002円
MHAM日本株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	1,452,876,667円
計	110,003,559,907円

## (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	2023年8月7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	2023年8月7日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	6,529,295,000	—		6,543,680,000	14,385,000
合計	6,529,295,000	—		6,543,680,000	14,385,000

## (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ではありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	2023年8月7日現在
1口当たり純資産額	3.9415円
(1万口当たり純資産額)	(39,415円)

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

2023年8月31日現在

I 資産総額	113,563,478,195円
II 負債総額	330,297,306円
III 純資産総額 (I - II)	113,233,180,889円
IV 発行済数量	57,404,116,050口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.9726円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド

2023年8月31日現在

I 資産総額	448,019,121,102円
II 負債総額	513,477,742円
III 純資産総額 (I - II)	447,505,643,360円
IV 発行済数量	111,174,148,705口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	4.0253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。

① 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。

② 上記①の申請のある場合には、上記①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①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。

③ 上記①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（2023年8月31日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構（2023年8月31日現在）

###### ① 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。

###### ② 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。

2023年8月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,540,529,501,058
追加型株式投資信託	779	15,373,139,666,443
単位型公社債投資信託	22	39,167,674,424
単位型株式投資信託	208	1,101,924,931,090
合計	1,035	18,054,761,773,015

### 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。
2. 財務諸表の金額は、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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第38期事業年度（自2022年4月1日至2023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ております。

# 独立監査人の監査報告書

2023年5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

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 稲葉 宏和

### 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2022年4月1日から2023年3月31日までの第38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2023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。

### その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	31,421	33,770
金銭の信託	30,332	29,184
未収委託者報酬	17,567	16,279
未収運用受託報酬	4,348	3,307
未収投資助言報酬	309	283
未収収益	5	15
前払費用	1,167	1,129
その他	2,673	2,377
流動資産計	87,826	86,346
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1 1,109	※1 1,001
器具備品	※1 158	※1 118
リース資産	-	※1 7
無形固定資産		
ソフトウェア	3,107	3,367
ソフトウェア仮勘定	1,449	1,651
電話加入権	3	2
投資その他の資産		
投資有価証券	241	182
関係会社株式	5,349	5,810
長期差入保証金	1,102	775
繰延税金資産	3,092	2,895
その他	367	104
固定資産計	15,983	15,918
資産合計	103,810	102,265

(単位：百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,445	1,481
リース債務	-	1
未払金	7,616	7,246
未払収益分配金	0	0
未払償還金	9	-
未払手数料	7,430	7,005
その他未払金	175	240
未払費用	8,501	7,716
未払法人税等	2,683	1,958
未払消費税等	1,330	277
賞与引当金	1,933	1,730
役員賞与引当金	69	48
流動負債計	23,581	20,460
固定負債		
リース債務	-	6
退職給付引当金	2,507	2,654
時効後支払損引当金	147	108
固定負債計	2,655	2,769
負債合計	26,236	23,230
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金	19,552	19,552
資本準備金	2,428	2,428
その他資本剰余金	17,124	17,124
利益剰余金	56,020	57,481
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	55,896	57,358
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	24,216	25,678
株主資本計	77,573	79,034
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△0	△0
評価・換算差額等計	△0	△0
純資産合計	77,573	79,034
負債・純資産合計	103,810	102,265

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	108,563		95,739	
運用受託報酬	16,716		16,150	
投資助言報酬	1,587		2,048	
その他営業収益	12		23	
営業収益計		126,879		113,962
営業費用				
支払手数料	45,172		41,073	
広告宣伝費	391		216	
公告費	0		0	
調査費	36,488		33,177	
調査費	10,963		12,294	
委託調査費	25,525		20,882	
委託計算費	557		548	
営業雑経費	842		733	
通信費	35		36	
印刷費	606		504	
協会費	66		69	
諸会費	26		29	
支払販売手数料	106		92	
営業費用計		83,453		75,749
一般管理費				
給料	10,377		10,484	
役員報酬	168		168	
給料・手当	8,995		9,199	
賞与	1,213		1,115	
交際費	6		17	
寄付金	15		11	
旅費交通費	40		128	
租税公課	367		330	
不動産賃借料	1,674		1,006	
退職給付費用	495		437	
固定資産減価償却費	1,389		1,388	
福利厚生費	42		47	
修繕費	0		1	
賞与引当金繰入額	1,933		1,730	
役員賞与引当金繰入額	69		48	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,901		4,074	
事務用消耗品費	45		37	
器具備品費	0		1	
諸経費	217		334	
一般管理費計		20,578		20,078
営業利益		22,848		18,135

(単位：百万円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		13		10
受取配当金	※1	559	※1	2,400
時効成立分配金・償還金		0		0
為替差益		7		—
雑収入		19		10
時効後支払損引当金戻入額		10		24
営業外収益計		610		2,446
営業外費用				
為替差損		—		3
金銭の信託運用損		743		1,003
早期割増退職金		20		24
雑損失		—		47
営業外費用計		764		1,079
経常利益		22,694		19,502
特別利益				
固定資産売却益		0		—
投資有価証券売却益		—		4
特別利益計		0		4
特別損失				
固定資産除却損		5		12
投資有価証券売却損		6		9
ゴルフ会員権売却損		3		—
オフィス再編費用	※2	509		—
関係会社株式評価損		—		584
特別損失計		525		606
税引前当期純利益		22,169		18,900
法人税、住民税及び事業税		6,085		4,881
法人税等調整額		584		197
法人税等合計		6,669		5,078
当期純利益		15,499		13,821

(3) 【株主資本等変動計算書】

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

(単位：百万円)

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	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		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	51,800	73,353
当期変動額									
剰余金の配当							△11,280	△11,280	△11,280
当期純利益							15,499	15,499	15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	4,219	4,219	4,219
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573

	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	△0	△0	73,353
当期変動額			
剰余金の配当			△11,280
当期純利益			15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	△0	△0	△0
当期変動額合計	△0	△0	4,219
当期末残高	△0	△0	77,573

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

	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	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573
当期変動額									
剰余金の配当							△12,360	△12,360	△12,360
当期純利益							13,821	13,821	13,821
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,461	1,461	1,461
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034

	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	△0	△0	77,573
当期変動額			
剰余金の配当			△12,360
当期純利益			13,821
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	△0	△0	△0
当期変動額合計	△0	△0	1,461
当期末残高	△0	△0	79,034

## 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 市場価格のない株式等以外のもの 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) 市場価格のない株式等 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(リース資産を除く) 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。 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(リース資産を除く) 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> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする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 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 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 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>①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>②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払引当金 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. 収益及び費用の計上基準	当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投

	<p>資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。</p> <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回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、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回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、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2回又は4回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、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。

(会計方針の変更)

「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 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過の取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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しております。なお、当該適用指針の適用に伴う、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

また、(金融商品会計)注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27-3項に従って、前事業年度に係るものについては記載していません。

## 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

(百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
建物	415	523
器具備品	966	934
リース資産	—	1

(損益計算書関係)

### ※1. 各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

(百万円)

	第37期 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
受取配当金	543	2,393

### ※2. オフィス再編費用

オフィス再編費用は、主に本社オフィスレイアウトの見直しによるものです。

(株主資本等変動計算書関係)

第37期(自 2021年4月1日 至 2022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 (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 (百万円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
2022年6月16日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	12,360	309,000	2022年3月31日	2022年6月17日
	A種種類株式					

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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 (百万円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
2022年6月16日 定時株主総会	普通株式	12,360	309,000	2022年3月31日	2022年6月17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

2023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 (百万円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
2023年6月16日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19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。

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

①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。

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。

②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。

③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。

第37期（2022年3月31日現在）

	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	30,332	30,332	—
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	—
資産計	30,334	30,334	—

第38期（2023年3月31日現在）

	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	29,184	29,184	—
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	—
資産計	29,186	29,186	—

(注1) 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。

(注2) 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37期（2022年3月31日現在）

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	31,421	—	—	—
(2) 金銭の信託	30,332	—	—	—
(3) 未収委託者報酬	17,567	—	—	—
(4) 未収運用受託報酬	4,348	—	—	—
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	—	1	—	—
合計	83,670	1	—	—

第38期（2023年3月31日現在）

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	33,770	—	—	—
(2) 金銭の信託	29,184	—	—	—
(3) 未収委託者報酬	16,279	—	—	—
(4) 未収運用受託報酬	3,307	—	—	—
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	—	1	—	—
合計	82,540	1	—	—

3. 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。

時価で貸借対照表に計上している金融商品

第37期（2022年3月31日現在）

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 金銭の信託	—	6,932	—	6,932
(2) 投資有価証券 その他有価証券	—	—	—	—
資産計	—	6,932	—	6,932

「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）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。貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託23,399百万円、投資有価証券1百万円となります。

第38期（2023年3月31日現在）

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 金銭の信託	—	29,184	—	29,184
(2) 投資有価証券 その他有価証券	—	—	—	—
資産計	—	29,186	—	29,186

(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。

投資有価証券

投資有価証券は市場における取引価格が存在しない投資信託であり、基準価額を時価としておりません。

(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、2. 金融商品の時価等に関する事項及び3. 金融商品の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。

(百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
投資有価証券（その他有価証券）		
非上場株式	239	180
関係会社株式		
非上場株式	5,349	5,810

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（第37期の貸借対照表計上額5,349百万円、第38期の貸借対照表計上額5,810百万円）については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

第37期（2022年3月31日現在）

(百万円)

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 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 投資信託	1	2	△0
小計	1	2	△0
合計	1	2	△0

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額239百万円）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。

第38期（2023年3月31日現在）

(百万円)

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 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 投資信託	1	2	△0
小計	1	2	△0
合計	1	2	△0

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額180百万円）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。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
株式	13	—	6

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
株式	54	4	9

4. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、有価証券について584百万円（関係会社株式584百万円）減損処理を行っております。

（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

	(百万円)	
	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,479	2,576
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	△14	31
退職給付の支払額	△185	△191
退職給付債務の期末残高	2,576	2,698

（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

	(百万円)	
	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,576	2,698
未積立退職給付債務	2,576	2,698
未認識数理計算上の差異	△35	△44
未認識過去勤務費用	△33	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654
退職給付引当金	2,507	2,654
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	34	22
過去勤務費用の費用処理額	69	34
その他	△3	△4
確定給付制度に係る退職給付費用	398	334

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、前事業年度において20百万円、当事業年度において24百万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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00%~3.76%	1.00%~3.56%

## 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97百万円、当事業年度103百万円であります。

(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

	<u>第37期</u>	<u>第38期</u>
	<u>(2022年3月31日現在)</u>	<u>(2023年3月31日現在)</u>
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	156	121
未払事業所税	10	9
賞与引当金	592	529
未払法定福利費	92	94
運用受託報酬	845	390
資産除去債務	13	15
減価償却超過額 (一括償却資産)	12	21
減価償却超過額	58	198
繰延資産償却超過額 (税法上)	292	297
退職給付引当金	767	812
時効後支払損引当金	45	33
ゴルフ会員権評価損	7	7
関係会社株式評価損	166	345
投資有価証券評価損	28	4
その他	2	13
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	<u>3,092</u>	<u>2,895</u>
繰延税金負債	<u>—</u>	<u>—</u>
繰延税金負債合計	<u>—</u>	<u>—</u>
繰延税金資産の純額	<u>3,092</u>	<u>2,895</u>

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

	<u>第37期</u>	<u>第38期</u>
	<u>(2022年3月31日現在)</u>	<u>(2023年3月31日現在)</u>
法定実効税率	—	30.62 %
(調整)		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	—	△3.69 %
その他	—	△0.06 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>—</u>	<u>26.87 %</u>

(注) 前事業年度は、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

①MHAM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、②TB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、③DIAM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」③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」③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A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」③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」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③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	144,212百万円
取得原価		144,212百万円

(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

(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。

(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

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
流動資産	－百万円	－百万円
固定資産	76,763百万円	68,921百万円
資産合計	76,763百万円	68,921百万円
流動負債	－百万円	－百万円
固定負債	4,740百万円	3,643百万円
負債合計	4,740百万円	3,643百万円
純資産	72,022百万円	65,278百万円

(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	55,263百万円	51,451百万円
顧客関連資産	25,175百万円	20,947百万円

(2) 損益計算書項目

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益	－百万円	－百万円
営業利益	△8,429百万円	△8,039百万円
経常利益	△8,429百万円	△8,039百万円
税引前当期純利益	△8,429百万円	△8,039百万円
当期純利益	△7,015百万円	△6,744百万円
1株当たり当期純利益	△175,380円68銭	△168,617円97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	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	4,618百万円	4,228百万円

(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。

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

収益の構成は次の通りです。

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
委託者報酬	108,259百万円	95,739百万円
運用受託報酬	14,425百万円	14,651百万円
投資助言報酬	1,587百万円	2,048百万円
成功報酬(注)	2,594百万円	1,499百万円
その他営業収益	12百万円	23百万円
合計	126,879百万円	113,962百万円

(注) 成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の委託者報酬及び運用受託報酬、当事業年度においては損益計算書の運用受託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. 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)

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37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日) 及び第38期(自 2022年4月1日 至 2023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

① 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。

② 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。

(持分法損益等)

当社は2022年8月1日付でPayPayアセットマネジメント株式会社の株式を取得し持分法適用関連会社としておりますが、重要性が乏しいため、関連会社に対する投資の金額等の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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第37期 (自 2021年4月1日 至 2022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 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						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	7,789	未払 手数料	1,592
	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	16,373	未払 手数料	2,651

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。

第38期 (自 2022年4月1日 至 2023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 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						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	7,474	未払 手数料	1,579
	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	13,932	未払 手数料	2,404

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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	1,939,327円79銭	1,975,862円96銭
1株当たり当期純利益金額	387,499円36銭	345,535円19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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益金額	15,499百万円	13,821百万円
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当期純利益金額	15,499百万円	13,821百万円
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	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。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって見積り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

委託会社の関連会社であるPayPayアセットマネジメント株式会社に対する出資比率が、2023年10月6日付で49.9%から23.4%に引き下がりました。

- (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。

# 約 款

追加型証券投資信託  
One DC 国内株式インデックスファンド  
約款

運用の基本方針

約款第19条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 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（以下、「マザーファンド」ということがあります。）受益証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

1) 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。

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。

2) 株式（株価指数先物取引を含みます。）の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。

3) 株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。

4) 有価証券等の効率的な運用に資するため、国内において行われ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、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかるオプション取引、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。

5) 信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(3) 投資制限

1) マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。

2) 株式への実質投資割合には、制限を設けません。

3) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3. 収益分配方針

毎決算時に、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

経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

3) 留保益の運用方針

留保金の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

追加型証券投資信託  
One DC 国内株式インデックスファンド  
約款

<信託の種類、委託者および受託者>

第1条 この信託は、証券投資信託であり、アセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者とします。

②この投資信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法(大正11年法律第62号)(以下「信託法」といいます。)の適用を受けます。

<信託事務の委託>

第2条 受託者は、信託法第26条第1項に基づく信託事務の委任として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関(受託者の利害関係人(金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条において同じ。)を含みます。)と信託契約を締結し、これを委託することができます。

②前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

<信託の目的、金額>

第3条 委託者は、金100万円を、受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引受けます。

<信託金の限度額>

第4条 委託者は、受託者と合意の上、金1兆円を限度として信託金を追加することができるものとします。

②追加信託が行われたときは、受託者はその引受けを証する書面を委託者に交付します。

③委託者は、受託者と合意のうえ、第1項の限度額を変更することができます。

<信託期間>

第5条 この信託の期間は、信託契約締結日から第48条第1項、第49条第1項、第50条第1項および第52条第2項の規定による信託終了の日までとします。

<受益権の取得申込みの勧誘の種類>

第6条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行われます。

<受益権の分割および再分割>

第7条 委託者は、第3条第1項によって生じた受益権については100万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第9条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

②委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、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。

<当初の受益者>

第8条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第7条第1項の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

<追加信託の価額、口数および基準価額の計算方法>

第9条 追加信託金は、追加信託を行う日の前営業日の基準価額に当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

- ②この約款において基準価額とは、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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金、その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- ③第27条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

#### <信託日時の異なる受益権の内容>

第10条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

#### <受益権の帰属と受益証券の不発行>

第11条 この信託のすべての受益権は、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）及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。）。

- ②委託者は、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、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、委託者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。

- ③委託者は、第7条第1項の規定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。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。

#### <受益権の設定に係る受託者の通知>

第12条 受託者は、信託契約締結時に生じた受益権については信託契約締結時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### <受益権の申込単位および取得価額等>

第13条 委託者は、第7条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、1口単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

- ②委託者の指定する証券会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者をいいます。以下同じ。）および登録金融機関（委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関といいます。以下同じ。）は、第7条第1項の規定により分割される受益権を、委託者の指定する証券会社および登録金融機関と別に定める「累積投資約款」にしたがって契約（以下、「別に定める契約」といいます。）を結んだ受益権取得申込者に対して、1口単位をもって取得申込みに応ずることができるものとします。

- ③前2項の取得価額は、取得申込日の基準価額に、当該基準価額に委託者、委託者の指定する証券会社および登録金融機関がそれぞれ別に定める手数料ならびに当該手数料に係る消費税および地方

消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込みに係る当該取得価額は、1口につき1円に、当該基準価額に委託者、委託者の指定する証券会社および登録金融機関がそれぞれ別に定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

- ④前項の規定にかかわらず、委託者、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、受益者が第44条第1項または第3項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の取得価額は、第37条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑤第1項および第2項の取得申込者は委託者、委託者の指定する証券会社または登録金融機関に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託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係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、委託者（第45条の委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、当該取得申込みの代金（第3項の受益権の価額に当該取得申込みの口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。
- ⑥前各項の規定にかかわらず、委託者は、証券取引所（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「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、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消することができるものとします。

#### <受益権の譲渡に係る記載または記録>

第14条 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係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

- ②前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係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、前項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なわれるよう通知するものとします。
- ③委託者は、第1項に規定する振替について、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係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、委託者が必要と認めるときまたはやむをえ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。

#### <受益権の譲渡の対抗要件>

第15条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

#### <投資の対象とする資産の種類>

第16条 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。）
  - イ. 有価証券
  - ロ. 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22条、第23条に定めるものに限りません。）
  - ハ. 金銭債権
- ニ. 約束手形

## 2. 次に掲げる特定資産以外の資産

### イ. 為替手形

#### <運用の指図範囲等>

第17条 委託者は、信託金を主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券のほか、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
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
12. 外国貸付債権信託受益権（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
13. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
14. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
15. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
16. 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。）
17. 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。）
18. 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
19. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、第11号ならびに第14号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券ならびに第11号および第14号の証券または証書のうち第2号から第6号までの性質を有するものを以下「公社債」といいます。

②委託者は、信託金を前項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ができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

③第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用

上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、前項第1号から第4号まで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。

<受託者の自己または利害関係人等との取引>

第18条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下この条および第28条において同じ。）、第28条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第16条、第17条第1項および第2項に定める資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行うことができます。

②前項の取扱いは、第21条から第24条、第27条、第32条から第34条における委託者の指図による取引についても同様とします。

<運用の基本方針>

第19条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

<投資する株式等の範囲>

第20条 委託者が投資することを指図する株式は、証券取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

②前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式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者が投資することを指図することができるものとします。

<信用リスク集中回避のための投資制限>

第20条の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、委託者は、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。

<信用取引の指図および範囲>

第21条 委託者は、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。

②前項の信用取引の指図は、次の各号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、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 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（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。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

<先物取引等の運用指図>

第22条 委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の効率的な運用に資するため、わが国の証券取引所におけ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。)および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。)ならびに外国の取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション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委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

③委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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わが国の金利にかか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。

<金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図>

第23条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

②金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として第5条に定める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金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、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行うものとします。

④委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

<デリバティブ取引等にかかる投資制限>

第23条の2 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、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ないものとします。

<有価証券の貸付の指図および範囲>

第24条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1. 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。

2. 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前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

<外貨建資産への投資制限>

第25条 委託者は、信託財産に属する外貨建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外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額が、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。ただし、有価証券の値上がり等により100分の10を超えることとなった場合には、速やかにこれを調整します。

②前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額

に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<特別の場合の外貨建資産への投資制限>

第26条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

<外貨為替予約の指図および範囲>

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引を指図することができます。

②前項の予約取引の指図は、信託財産に属する為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドに信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

③前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

<信託業務の委託等>

第28条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みません。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

②受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限ります。）を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

1. 信託財産の保存に係る業務
2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

第29条 （削除）

<混蔵寄託>

第30条 金融機関または証券会社（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または証券会社が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または証券会社の名義で混蔵寄託できるものとします。

<信託財産の登記等および記載等の留保等>

- 第31条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。
- ②前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
  - ③信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
  - ④動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

<一部解約の請求および有価証券の売却等の指図>

- 第32条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約請求ならびに信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

<再投資の指図>

- 第33条 委託者は、前条の規定による一部解約代金、売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

<資金の借入れ>

- 第34条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、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、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
  - 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。

<損益の帰属>

- 第35条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

<受託者による資金の立替え>

- 第36条 信託財産に属する有価証券について、借替え、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。
- ②信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積もりうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
  - ③前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを

定めます。

#### <信託の計算期間>

第37条 この信託の計算期間は、原則として毎年2月8日から翌年2月7日までとします。ただし、第1計算期間は信託契約締結日から平成20年2月7日までとし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

- ②前項にかかわらず、前項の原則により計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

#### <信託財産に関する報告>

第38条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ②受託者は、信託終了のときに最終計算を行い、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

#### <信託事務の諸費用>

第39条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ②信託財産の財務諸表監査に要する費用、および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、毎年8月7日（休業日の場合は翌営業日。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中より支弁します。

#### <信託報酬等の総額および支弁の方法>

第40条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第37条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の14の率を乗じて得た額とします。

- ②前項の信託報酬は、毎年8月7日（休業日のときは翌営業日。）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、委託者および受託者間の配分は別に定めるものとします。  
③第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

#### <収益の分配>

第41条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 信託財産に属する配当等収益（利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）と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。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
  2. 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- ②前項第1号および第2号におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ③毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

<収益分配金、償還金および一部解約金の払込みと支払いに関する受託者の免責>

第42条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第43条第1項に規定する支払開始日までに、一部解約金（第47条第4項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）については第43条第2項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ②受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

<償還金および一部解約金の支払い>

第43条 償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了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委託者、委託者の指定する証券会社または登録金融機関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。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係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なわれます。

- ②一部解約金は、第47条第1項の受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として5営業日目から当該受益者に支払います。
- ③前各項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する証券会社および登録金融機関の営業所等において行うものとし、ただし、委託者が自らの募集にかかる受益権に帰属する償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行うものとし、
- ④償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、

<収益分配金の再投資等>

第44条 委託者は、委託者の自らの募集に係る受益権に帰属する収益分配金をこの信託の受益権の取得申込金として、受益者ごとに当該収益分配金の再投資にかかる受益権の取得申込みに応じたものとし、当該受益権の取得申込みに応じたことにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

- ②収益分配金については、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌日に、収益分配金が委託者の指定する証券会社および登録金融機関に交付されます。
- ③委託者の指定する証券会社および登録金融機関は、別に定める契約に基づき、毎計算期間の末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計算期間の末日以前において一部解約が行な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委託者の指定する証券会社または登録金融機関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。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、第11条第3項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。
- ④収益分配金にかかる収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとし、

<委託者の自らの募集にかかる受益権の口座管理機関>

第45条 委託者は、委託者の自らの募集にかかる受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または登録等に関する業務を委任することができます。

#### <償還金の時効>

第46条 受益者が、信託終了による償還金について第43条第1項に規定する支払い開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

#### <信託契約の一部解約>

第47条 受益者（委託者の指定する証券会社および登録金融機関を含みます。以下本条において同じ。）は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

- ②信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者の指定する証券会社または登録金融機関に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- ③委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その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係るこの信託契約の一部解約を委託者が行うのと引き換えに、当該一部解約に係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なわれます。
- ④前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の基準価額とします。
- ⑤委託者は、証券取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受付け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けを取消することができます。
- ⑥前項により一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止以前に行った当日の一部解約の実行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、当該受付け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、第4項の規定に準じて算出した価額とします。

#### <信託契約の解約>

第48条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、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。

- ②委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約をしません。
- ⑤委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ⑥第3項から前項までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

#### <信託契約に関する監督官庁の命令>

第49条 委託者は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ②委託者は、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、第53条の規定にしたがいます。

<委託者の登録取消等に伴う取扱い>

第50条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ②前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第53条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

<委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い>

第51条 委託者は、事業の全部又は一部を譲渡することがあり、これに伴い、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委託者は、分割により事業の全部又は一部を承継させることがあり、これに伴い、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。

<受託者の辞任および解任に伴う取扱い>

第52条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第53条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

- ②委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

<信託約款の変更>

第53条 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- ②委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

- ③前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

- ④前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。

- ⑤委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

<反対者の買取請求権>

第54条 第48条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第48条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、投資信託及び投資法人に関する法律第30条の2の規定に基づき、受益権の買取を請求することができます。

<公告>

第55条 委託者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。

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

- ②前項の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。

<運用報告書に記載すべき事項の提供>

第56条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

<質権口記載又は記録の受益権の取扱い>

第57条 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、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

<信託約款に関する疑義の取扱い>

第58条 この信託約款の解釈について疑義が生じたときは、委託者と受託者の協議により定めます。

(付則)

第1条 この約款において「累積投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する証券会社および登録金融機関が締結する「累積投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合「累積投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第43条第4項および第44条第4項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

第3条 第23条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

第4条 第23条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差引いた値にあらかじめ元本として定めた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

平成19年9月27日（信託契約締結日）

委託者	興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社
受託者	みずほ信託銀行株式会社

親投資信託  
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド  
約款

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

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

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）銘柄を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- 1) 主として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）銘柄に投資し、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。
- 3) 株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 4) 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
- 5) 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。
- 6) 国内において行われ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、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる先物オプション取引、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。
- 7) 信託財産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(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) 有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行います。
- 3) 金利先渡取引および為替先渡取引は、約款第18条の範囲で行います。
- 4) 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。
- 5) 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。
- 6) 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、委託者は、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。