

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2018年11月7日
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	三木谷 正直
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	D I A M D C 国内株式インデックスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DIAM 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（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（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 <http://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：2018年11月8日から2019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っております。

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。

(1 0) 【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社所定の方法により、販売会社に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）

(1 1) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

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】

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。

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。

東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。

株東京証券取引所は、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TOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

株東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（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。

株東京証券取引所は、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、株東京証券取引所は、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。

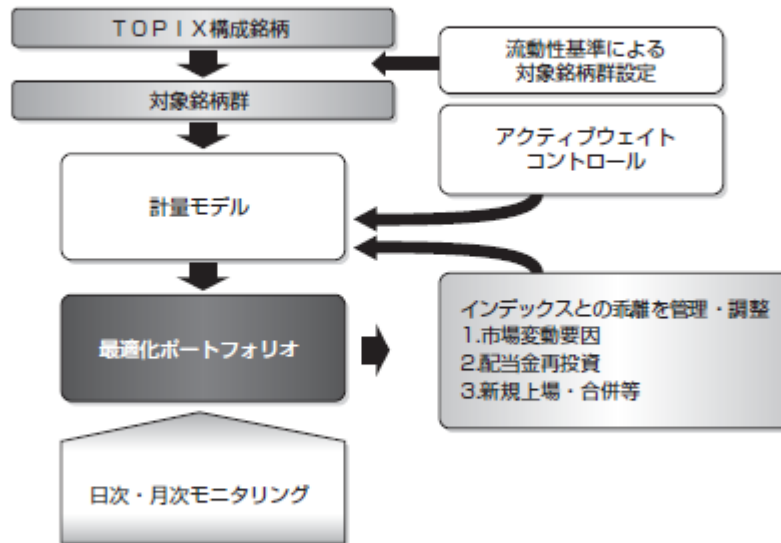
当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数（TOPIX）の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

- ② 流動性を基準に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	
		不動産投信	
	内外	その他資産 ()	特殊型
		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 年4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)	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		エマージング		

(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。

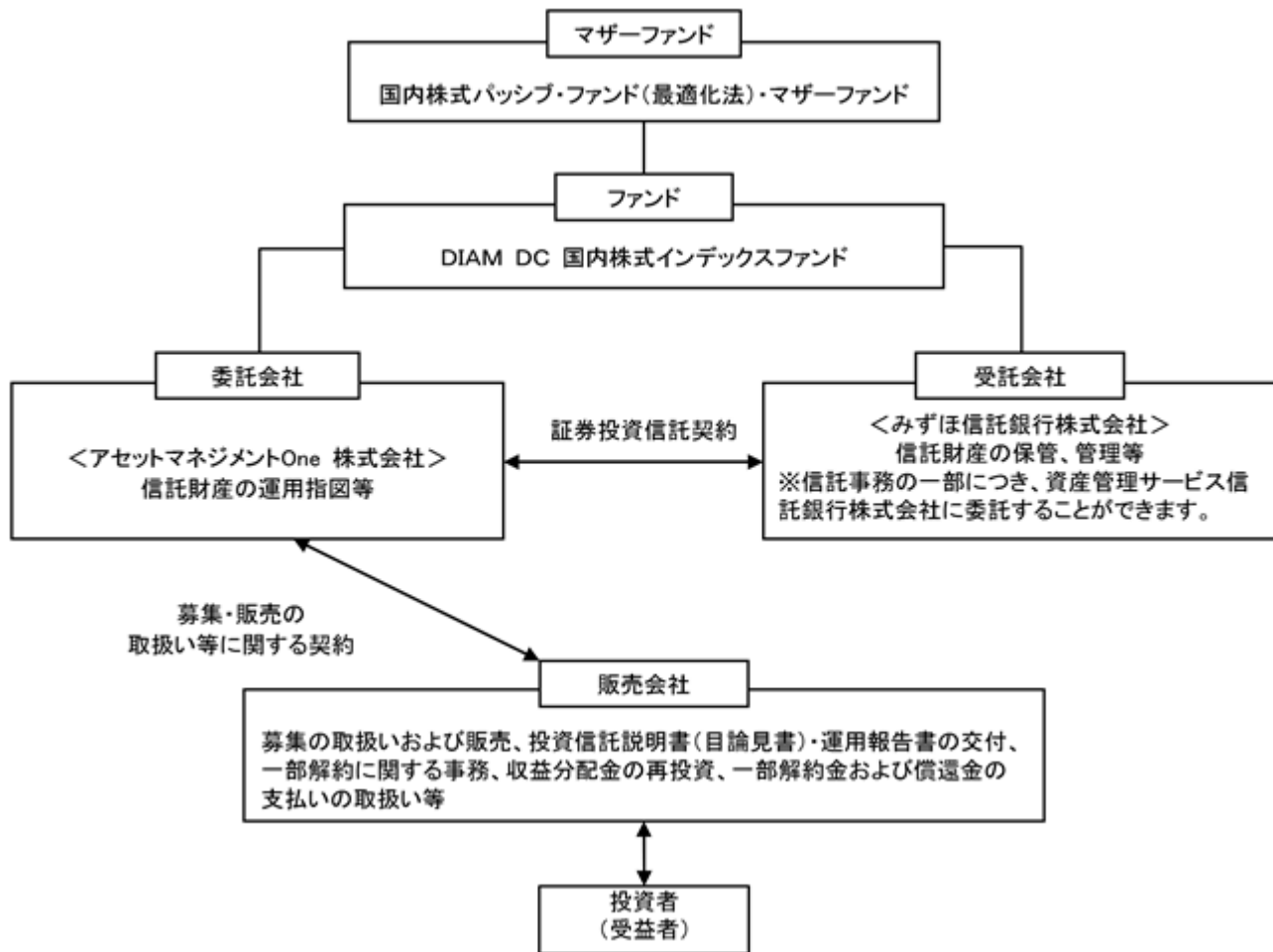
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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
(<http://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

(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（2018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「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月 1日	DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

(2018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

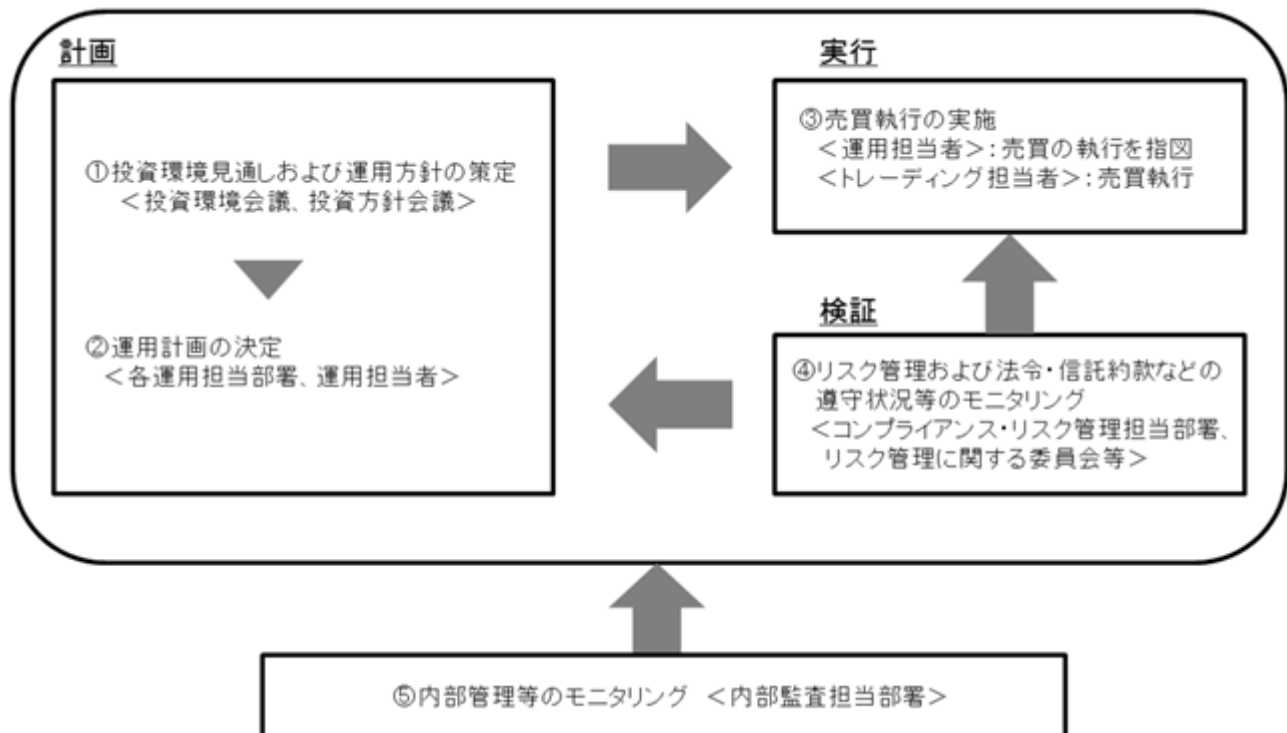
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小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。

主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
--------	---

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



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

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

売買執行の実施

運用担当者は、売買計画に基づいて売買の執行を指図します。トレーディング担当者は、最良執行をめざして売買の執行を行います。

モニタリング

運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署(人数60~70人程度)は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施し、必要に応じて対応を指示します。

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

当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2018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】

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。

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。

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せん。)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。

- (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るものとします。
- (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の議決権(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、当該株式の議決権の総数に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、当該株式を投資信託財産をもって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】

(1) 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

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

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。

(2) 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。

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で、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。

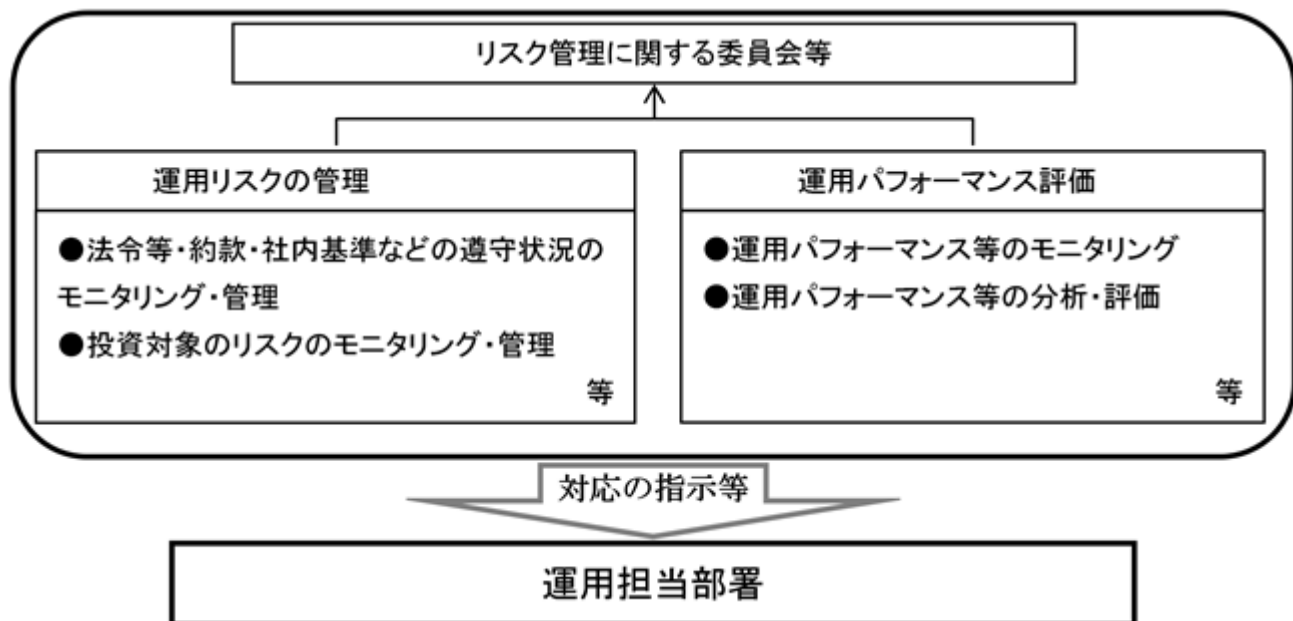
注意事項

- 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。
- 二. 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、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。
- ・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



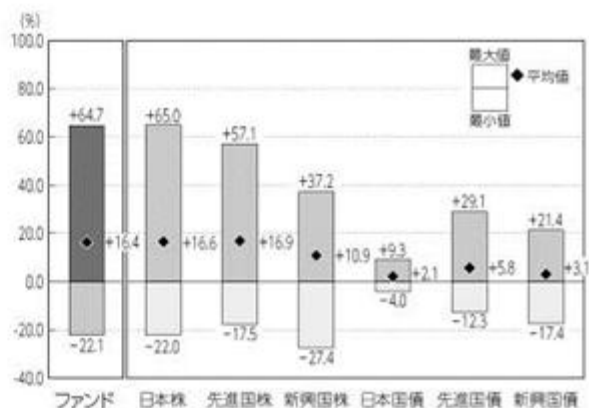
リスク管理体制は2018年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<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



2013年9月～2018年8月

*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。

*全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)
 - 先進国株…MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
 - 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)
 - 日本国債…NOMURA-BPI国債
 - 先進国債…FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
 - 新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)
- (注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

- 「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(兼東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株式会社東京証券取引所が有しています。
- 「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。
- 「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。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- 「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。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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0.1674%（税抜0.155%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.067%	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0.060%	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0.028%	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。

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。

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。

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。

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

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。

解約時および償還時

解約時および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率での申告分離課税が適用されます。

原則として確定申告が必要ですが、特定口座（源泉徴収口座）を利用する場合、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。

解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を含みます。）を控除した利益。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

解約（換金）時および償還時の差損（譲渡損）については、確定申告を行うことにより上場株式等（上場株式、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募株式投資信託および特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）など。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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、2018年8月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成30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	28,790,046,661	99.96
内 日本	28,790,046,661	99.96
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	12,273,876	0.04
純資産総額	28,802,320,537	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

平成30年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	287,453,418,570	95.86
内 日本	287,453,418,570	95.86
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	12,403,112,143	4.14
純資産総額	299,856,530,713	100.00

その他資産の投資状況

平成30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）	11,995,820,000	4.00
内 日本	11,995,820,000	4.00

(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。

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成30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	10,854,747,450	2.6446 28,706,661,490	2.6523 28,790,046,661	- -	99.96%

(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

平成30年8月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.96%
合計	99.96%

(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

平成30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	1,411,200	7,353.87 10,377,786,345	6,930.00 9,779,616,000	- -	3.26%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	7,972,900	789.07 6,291,203,280	670.80 5,348,221,320	- -	1.78%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	515,800	8,663.60 4,468,688,360	10,300.00 5,312,740,000	- -	1.77%
4	ソニー 日本	株式 電気機器	777,600	5,411.76 4,208,186,809	6,348.00 4,936,204,800	- -	1.65%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	817,500	4,995.06 4,083,466,930	4,950.00 4,046,625,000	- -	1.35%
6	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	866,800	4,791.32 4,153,117,332	4,381.00 3,797,450,800	- -	1.27%
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	57,000	64,031.51 3,649,796,094	62,890.00 3,584,730,000	- -	1.20%
8	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,044,500	3,838.03 4,008,829,431	3,292.00 3,438,494,000	- -	1.15%
9	みずほフィナンシャルグル ープ 日本	株式 銀行業	15,556,900	199.50 3,103,658,490	195.10 3,035,151,190	- -	1.01%

10	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,003,900	2,674.23 2,684,662,699	2,941.00 2,952,469,900	- -	0.98%
11	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	856,100	2,477.02 2,120,583,308	3,387.00 2,899,610,700	- -	0.97%
12	任天堂 日本	株式 その他製品	71,500	44,902.63 3,210,538,396	40,160.00 2,871,440,000	- -	0.96%
13	三菱商事 日本	株式 卸売業	802,300	2,958.44 2,373,562,664	3,171.00 2,544,093,300	- -	0.85%
14	花王 日本	株式 化学	285,500	7,687.57 2,194,801,419	8,625.00 2,462,437,500	- -	0.82%
15	ファナック 日本	株式 電気機器	110,300	27,144.55 2,994,044,085	21,775.00 2,401,782,500	- -	0.80%
16	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	817,600	2,668.82 2,182,031,540	2,885.00 2,358,776,000	- -	0.79%
17	村田製作所 日本	株式 電気機器	121,800	15,196.94 1,850,987,684	19,185.00 2,336,733,000	- -	0.78%
18	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	104,000	20,244.20 2,105,397,760	22,315.00 2,320,760,000	- -	0.77%
19	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	431,400	4,965.41 2,142,078,650	5,237.00 2,259,241,800	- -	0.75%
20	日本電産 日本	株式 電気機器	139,700	16,216.97 2,265,510,748	16,105.00 2,249,868,500	- -	0.75%
21	ダイキン工業 日本	株式 機械	158,500	12,218.86 1,936,690,552	14,170.00 2,245,945,000	- -	0.75%
22	キヤノン 日本	株式 電気機器	624,600	4,052.58 2,531,245,392	3,563.00 2,225,449,800	- -	0.74%
23	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	479,200	4,463.47 2,138,896,768	4,525.00 2,168,380,000	- -	0.72%
24	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,141,800	1,468.95 1,677,252,355	1,882.00 2,148,867,600	- -	0.72%
25	信越化学工業 日本	株式 化学	200,400	11,520.24 2,308,656,944	10,425.00 2,089,170,000	- -	0.70%
26	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	206,400	10,438.62 2,154,533,010	10,055.00 2,075,352,000	- -	0.69%
27	日立製作所 日本	株式 電気機器	2,787,000	811.45 2,261,513,650	725.50 2,021,968,500	- -	0.67%
28	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	427,800	5,994.30 2,564,363,530	4,653.00 1,990,553,400	- -	0.66%
29	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	672,700	3,289.46 2,212,826,210	2,922.00 1,965,629,400	- -	0.66%
30	資生堂 日本	株式 化学	230,600	5,713.92 1,317,632,225	7,824.00 1,804,214,400	- -	0.60%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年8月31日現在

種類	投資比率
株式	95.86%
合計	95.86%

（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

平成30年8月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	13.27%
輸送用機器		8.22%
情報・通信業		7.61%
化学		7.22%
銀行業		6.55%
機械		4.99%
医薬品		4.72%
小売業		4.60%
卸売業		4.59%
サービス業		4.54%
陸運業		4.04%
食料品		3.83%
建設業		2.79%
不動産業		2.23%
保険業		2.22%
その他製品		2.04%
精密機器		1.71%
電気・ガス業		1.63%
その他金融業		1.15%
鉄鋼		1.01%
ガラス・土石製品		0.94%
証券、商品先物取引業		0.87%
石油・石炭製品		0.82%
非鉄金属		0.78%
ゴム製品		0.70%
繊維製品		0.60%
金属製品		0.59%
空運業		0.54%
鋳業		0.29%
パルプ・紙		0.28%
海運業	0.19%	
倉庫・運輸関連業	0.17%	
水産・農林業	0.10%	
合計	95.86%	

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【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

平成30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 3009月	買建	692	11,878,899,208	11,995,820,000	4.00%

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(平成30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2計算期間末 (平成21年2月9日)	990	990	0.4906	0.4906
第3計算期間末 (平成22年2月8日)	1,420	1,420	0.5658	0.5658
第4計算期間末 (平成23年2月7日)	2,000	2,000	0.6132	0.6132
第5計算期間末 (平成24年2月7日)	2,823	2,823	0.5150	0.5150
第6計算期間末 (平成25年2月7日)	4,521	4,521	0.6603	0.6603
第7計算期間末 (平成26年2月7日)	6,573	6,573	0.8241	0.8241
第8計算期間末 (平成27年2月9日)	8,261	8,261	1.0056	1.0056
第9計算期間末 (平成28年2月8日)	11,225	11,225	0.9911	0.9911
第10計算期間末 (平成29年2月7日)	13,968	13,968	1.1107	1.1107
第11計算期間末 (平成30年2月7日)	22,544	22,544	1.3067	1.3067
平成29年8月末日	17,941	-	1.1976	-
9月末日	18,553	-	1.2494	-
10月末日	19,997	-	1.3174	-
11月末日	21,101	-	1.3370	-
12月末日	22,478	-	1.3574	-
平成30年1月末日	23,789	-	1.3716	-
2月末日	24,303	-	1.3208	-
3月末日	24,544	-	1.2937	-
4月末日	26,197	-	1.3397	-
5月末日	26,245	-	1.3176	-
6月末日	27,539	-	1.3066	-
7月末日	28,369	-	1.3232	-
8月末日	28,802	-	1.3100	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
平成30年2月8日～ 平成30年8月7日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第2計算期間	39.3
第3計算期間	15.3
第4計算期間	8.4
第5計算期間	16.0
第6計算期間	28.2
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
平成30年2月8日～ 平成30年8月7日	0.9

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第2計算期間	2,103,679,461	890,672,245
第3計算期間	1,667,777,180	1,175,183,209
第4計算期間	1,536,529,943	786,254,485
第5計算期間	3,335,462,010	1,114,450,026
第6計算期間	3,710,441,727	2,345,929,733
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
平成30年2月8日～ 平成30年8月7日	7,109,387,715	2,855,991,537

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

<< 参考情報 >>

データの基準日：2018年8月31日

基準価額・純資産の推移

(2008年8月29日～2018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、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)

※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移(税引前)

第7期	(2014.02.07)	0円
第8期	(2015.02.09)	0円
第9期	(2016.02.08)	0円
第10期	(2017.02.07)	0円
第11期	(2018.02.07)	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	99.96%

■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	95.86
内 日本	95.86
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4.14
合計(純資産総額)	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	4.00

株式組入上位5業種

順位	業種	比率
1	電気機器	13.27%
2	輸送用機器	8.22%
3	情報・通信業	7.61%
4	化学	7.22%
5	銀行業	6.55%

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.26%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.78%
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.77%
4	ソニー	株式	日本	電気機器	1.65%
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.35%
6	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.27%
7	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.20%
8	本田技研工業	株式	日本	輸送用機器	1.15%
9	みずほフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.01%
10	KDDI	株式	日本	情報・通信業	0.98%

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。

※2018年については年年初から基準日までの収益率を表示しています。

○掲載データ等は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。
- ・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 <http://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

ホームページ URL <http://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）

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 <http://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って、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対し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。

二．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 <http://www.am-one.co.jp/>)

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載して行います。

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 <http://www.am-one.co.jp/>)

4【受益者の権利等】

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てします。)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。

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、委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。)に、原則として償還日(休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

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。

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11期計算期間(平成29年2月8日から平成30年2月7日まで)の財務諸表について、PWCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【DIAM 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10期 平成29年2月7日現在	第11期 平成30年2月7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	54,249,793	156,083,110
親投資信託受益証券	13,962,862,644	22,539,666,965
未収入金	-	156,000,000
流動資産合計	14,017,112,437	22,851,750,075
資産合計	14,017,112,437	22,851,750,075
負債の部		
流動負債		
未払解約金	37,328,045	290,114,752
未払受託者報酬	2,041,139	3,092,734
未払委託者報酬	9,258,157	14,027,947
その他未払費用	145,711	220,822
流動負債合計	48,773,052	307,456,255
負債合計	48,773,052	307,456,255
純資産の部		
元本等		
元本	12,576,158,544	17,252,295,483
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,392,180,841	5,291,998,337
（分配準備積立金）	1,563,525,832	2,959,723,412
元本等合計	13,968,339,385	22,544,293,820
純資産合計	13,968,339,385	22,544,293,820
負債純資産合計	14,017,112,437	22,851,750,075

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第10期		第11期	
	自	平成28年2月9日 平成29年2月7日	自	平成29年2月8日 平成30年2月7日
営業収益				
受取利息		726		42
有価証券売買等損益		1,706,874,040		2,713,380,321
営業収益合計		1,706,874,766		2,713,380,363
営業費用				
支払利息		49,427		70,202
受託者報酬		3,791,811		5,425,521
委託者報酬		17,198,866		24,608,954
その他費用		317,463		387,359
営業費用合計		21,357,567		30,492,036
営業利益又は営業損失()		1,685,517,199		2,682,888,327
経常利益又は経常損失()		1,685,517,199		2,682,888,327
当期純利益又は当期純損失()		1,685,517,199		2,682,888,327
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()		226,849,979		691,574,750
期首剰余金又は期首欠損金()		100,636,512		1,392,180,841
剰余金増加額又は欠損金減少額		106,951,617		2,834,360,246
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		106,951,617		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		2,834,360,246
剰余金減少額又は欠損金増加額		72,801,484		925,856,327
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		925,856,327
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		72,801,484		-
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		1,392,180,841		5,291,998,337

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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10期 平成29年2月7日現在	第11期 平成30年2月7日現在
1. 1 期首元本額	11,325,853,909円	12,576,158,544円
期中追加設定元本額	7,572,230,014円	11,590,956,335円
期中一部解約元本額	6,321,925,379円	6,914,819,396円
2. 受益権の総数	12,576,158,544口	17,252,295,483口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第10期 自 平成28年2月9日 至 平成29年2月7日	第11期 自 平成29年2月8日 至 平成30年2月7日
1. 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(261,468,321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(630,517,852円)、信託約款に規定される収益調整金(4,009,150,083円)及び分配準備積立金(671,539,659円)より分配対象収益は5,572,675,915円(1万口当たり4,431.14円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(343,455,085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(1,647,858,492円)、信託約款に規定される収益調整金(6,689,184,612円)及び分配準備積立金(968,409,835円)より分配対象収益は9,648,908,024円(1万口当たり5,592.83円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第10期 自 平成28年2月9日 至 平成29年2月7日	第11期 自 平成29年2月8日 至 平成30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、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第10期 平成29年2月7日現在	第11期 平成30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	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第10期 平成29年2月7日現在	第11期 平成30年2月7日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,581,105,140	2,537,460,553
合計	1,581,105,140	2,537,460,553

(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10期 平成29年2月7日現在	第11期 平成30年2月7日現在
1口当たり純資産額	1.1107円	1.3067円
(1万口当たり純資産額)	(11,107円)	(13,067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

平成30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	8,527,416,376	22,539,666,965	
親投資信託受益証券	合計	8,527,416,376	22,539,666,965	
合計		8,527,416,376	22,539,666,965	

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」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成29年2月7日現在	平成30年2月7日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		6,578,745,130	5,221,962,696
株式	2	277,454,420,930	283,752,429,300
未収入金		-	3,207,349,100
未収配当金		416,723,486	408,873,079
前払金		144,461,700	129,630,000
流動資産合計		284,594,351,246	292,720,244,175
資産合計		284,594,351,246	292,720,244,175
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		155,490,616	107,685,500
未払金		4,635,124	1,215,648
未払解約金		184,794,000	3,372,773,000
流動負債合計		344,919,740	3,481,674,148
負債合計		344,919,740	3,481,674,148
純資産の部			
元本等			
元本	1	126,730,528,618	109,428,148,369
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		157,518,902,888	179,810,421,658
元本等合計		284,249,431,506	289,238,570,027
純資産合計		284,249,431,506	289,238,570,027
負債純資産合計		284,594,351,246	292,720,244,175

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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	平成29年2月7日現在	平成30年2月7日現在
1 . 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	143,582,065,487円	126,730,528,618円
同期中追加設定元本額	31,895,226,101円	21,919,995,643円
同期中一部解約元本額	48,746,762,970円	39,222,375,892円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	6,225,361,204円	8,527,416,376円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,668,812,063円	1,876,669,491円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	4,626,916円	4,058,956円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	12,027,439円	9,163,587円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	25,367,529円	17,247,960円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	14,362,796円	19,644,822円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	11,463,058円	15,103,701円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	14,507,613円	11,638,894円
たわらノーロード TOPIX	- 円	133,947,908円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	- 円	11,761,649円
たわらノーロード バランス（堅実型）	- 円	125,101円
たわらノーロード バランス（標準型）	- 円	1,076,337円

たわらノーロード バランス (積極型)	- 円	3,879,083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)	- 円	14,597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)	- 円	186,393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)	- 円	349,317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)	- 円	441,025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)	- 円	944,055円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	- 円	37,778円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	33,023円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	299,108円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	- 円	326,987円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	- 円	954,131円
D I A M国内株式インデックス ファンド< D C年金>	36,751,622,753円	36,179,079,727円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	831,977,748円	740,060,350円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,911,107,155円	2,660,351,109円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	2,958,943,396円	2,764,797,796円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	382,522,985円	323,312,556円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,247,411,604円	1,119,268,669円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	1,101,637,707円	1,049,315,773円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	59,530,357円	47,106,085円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,323,202,308円	1,171,577,546円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	29,654,177円	24,024,004円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	35,207,524円	38,663,041円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	68,501,796円	96,018,721円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	138,115,824円	187,463,022円
投資のソムリエ	737,581,150円	1,425,039,544円
クルーズコントロール	994,925,241円	742,851,962円
投資のソムリエ< D C年金>	21,909,381円	98,587,223円

D I A M 8 資産バランスファン ドN<DC年金>	114,690,983円	146,987,989円
D I A M DC バランス・F (成長型)	122,403,177円	200,841,570円
クルーズコントロール<DC年 金>	362,468円	280,295円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	8,655,666円	4,871,101円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	24,905,651円	14,849,802円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	5,679,470円	31,638,887円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バランス ファンド	1,959,663円	2,035,658円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	13,656,955円	480,182,820円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	- 円	563,249円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	- 円	625,990円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	- 円	150,120円
D I A Mアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	- 円	1,043,053円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	313,751,716円	- 円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	88,264,704円	70,701,371円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投 資家限定)	215,433,771円	134,139,818円
D I A M国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	404,699,772円	293,336,654円
D I A M国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	27,745,336円	16,233,373円
D I A M国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	121,678,076円	70,316,222円
D I A M国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	30,140,688円	19,820,211円
D I A M国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	33,363,257円	24,744,260円
D I A M世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	1,086,480,641円	31,638,558円
D I A M世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	462,558,924円	58,546,806円

D I A Mバランスファンド25 V A (適格機関投資家限定)	1,499,138,856円	1,078,582,552円
D I A Mバランスファンド3 7.5 V A (適格機関投資家限 定)	1,318,666,795円	1,021,293,696円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	3,594,704,089円	2,792,304,258円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	279,956,927円	202,887,062円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	475,695,865円	98,032,612円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	813,891,427円	599,115,283円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	3,192,555,936円	1,746,402,985円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	44,963,165円	10,313,671円
D I A M世界バランスファンド 55 V A (適格機関投資家限 定)	1,068,353,473円	39,787,583円
D I A M世界バランスファンド 35 V A (適格機関投資家限 定)	4,854,751,930円	1,187,470,230円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	18,832,685,135円	15,107,175,247円
D I A M世界アセットバランス ファンド40 V A (適格機関投 資家限定)	686,951,680円	541,990,149円
D I A M世界アセットバランス ファンド25 V A (適格機関投 資家限定)	2,144,274,950円	1,727,888,538円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	11,925,835,750円	9,861,006,706円
D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定)	6,826,388円	519,843円
D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定)	328,366円	9,093,798円
D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定)	4,672,150円	3,718,064円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	10,678,056,698円	8,771,394,616円
D I A M世界バランス25 V A (適格機関投資家限定)	95,074,077円	70,413,424円
D I A M国内バランス30 V A (適格機関投資家限定)	34,152,004円	27,752,854円

	D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	36,517,217円	18,240,489円
	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	73,509円	15,682,249円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	119,539円	109,957円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	621,830,741円	426,902,115円
	D I A M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)	1,622,373,744円	1,323,021,834円
	D I A M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)	2,159,696,264円	1,764,382,103円
	D I A M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)	91,571,301円	76,281,237円
	計	126,730,528,618円	109,428,148,369円
2.	受益権の総数	126,730,528,618口	109,428,148,369口
3.	2 差入代用有価証券	株式 3,173,000,000円	株式 3,686,000,000円

(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 平成28年2月9日 至 平成29年2月7日	自 平成29年2月8日 至 平成30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、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、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。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。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年2月7日現在	平成30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ぬ。	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 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	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つた場合、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。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年2月7日現在	平成30年2月7日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	25,897,750,063	37,076,096,022
合計	25,897,750,063	37,076,096,022

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	平成29年2月7日 現在				平成30年2月7日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	6,728,280,000	-	6,572,930,000	155,350,000	2,293,270,000	-	2,185,625,000	107,645,000
合計	6,728,280,000	-	6,572,930,000	155,350,000	2,293,270,000	-	2,185,625,000	107,645,000

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成29年2月7日現在	平成30年2月7日現在
1口当たり純資産額	2.2429円	2.6432円
（1万口当たり純資産額）	（22,429円）	（26,432円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成30年2月7日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,000	3,880.00	19,400,000	
日本水産	143,000	543.00	77,649,000	
マルハニチロ	24,100	3,325.00	80,132,500	
ハウスイ	900	1,152.00	1,036,800	
カネコ種苗	4,400	1,582.00	6,960,800	
サカタのタネ	18,800	3,610.00	67,868,000	
ホクト	12,900	1,995.00	25,735,500	
ホクリヨウ	1,600	1,420.00	2,272,000	
ショーボンドホールディングス	12,000	8,160.00	97,920,000	
ミライト・ホールディングス	39,100	1,599.00	62,520,900	
タマホーム	9,600	1,105.00	10,608,000	
サンヨーホームズ	2,300	795.00	1,828,500	
ファーストコーポレーション	4,300	1,467.00	6,308,100	
ベステラ	1,800	1,910.00	3,438,000	
インベスターズクラウド	11,200	1,576.00	17,651,200	
住石ホールディングス	33,700	152.00	5,122,400	
日鉄鉱業	3,500	7,380.00	25,830,000	
三井松島産業	6,500	1,441.00	9,366,500	
国際石油開発帝石	617,800	1,350.00	834,030,000	
日本海洋掘削	4,400	2,798.00	12,311,200	
石油資源開発	20,100	2,782.00	55,918,200	
K&Oエナジーグループ	7,500	1,704.00	12,780,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,000	1,197.00	3,591,000	
第一カッター興業	1,300	1,728.00	2,246,400	
安藤・間	97,800	837.00	81,858,600	
東急建設	48,900	1,091.00	53,349,900	
コムシスホールディングス	44,700	2,781.00	124,310,700	
ミサワホーム	10,600	865.00	9,169,000	
ピーアールホールディングス	12,600	449.00	5,657,400	
高松コンストラクショングループ	8,200	3,040.00	24,928,000	
東建コーポレーション	4,700	11,580.00	54,426,000	
ソネック	1,600	767.00	1,227,200	
ヤマウラ	6,000	902.00	5,412,000	
大成建設	126,500	5,080.00	642,620,000	
大林組	381,000	1,221.00	465,201,000	
清水建設	388,600	1,027.00	399,092,200	
飛島建設	115,900	172.00	19,934,800	
長谷工コーポレーション	148,300	1,614.00	239,356,200	
松井建設	14,000	844.00	11,816,000	
銭高組	1,800	5,790.00	10,422,000	
鹿島建設	558,000	986.00	550,188,000	
不動テトラ	96,500	173.00	16,694,500	
大末建設	4,100	1,031.00	4,227,100	

鉄建建設	7,700	3,050.00	23,485,000
西松建設	29,300	2,821.00	82,655,300
三井住友建設	91,600	591.00	54,135,600
大豊建設	46,000	537.00	24,702,000
前田建設工業	90,600	1,394.00	126,296,400
佐田建設	8,400	453.00	3,805,200
ナカノフドー建設	9,700	602.00	5,839,400
奥村組	20,900	4,490.00	93,841,000
東鉄工業	15,300	3,180.00	48,654,000
イチケン	2,300	2,251.00	5,177,300
浅沼組	45,000	372.00	16,740,000
戸田建設	148,000	788.00	116,624,000
熊谷組	19,900	2,883.00	57,371,700
青木あすなる建設	8,300	979.00	8,125,700
北野建設	27,000	431.00	11,637,000
植木組	1,600	2,677.00	4,283,200
三井ホーム	16,000	652.00	10,432,000
矢作建設工業	17,300	864.00	14,947,200
ピーエス三菱	15,100	867.00	13,091,700
日本ハウスホールディングス	24,300	636.00	15,454,800
大東建託	46,000	17,885.00	822,710,000
新日本建設	15,100	936.00	14,133,600
N I P P O	29,400	2,376.00	69,854,400
東亜道路工業	2,600	4,045.00	10,517,000
前田道路	40,000	2,301.00	92,040,000
日本道路	3,400	5,820.00	19,788,000
東亜建設工業	10,300	2,805.00	28,891,500
若築建設	6,900	1,660.00	11,454,000
東洋建設	39,900	583.00	23,261,700
五洋建設	151,100	775.00	117,102,500
世紀東急工業	17,200	609.00	10,474,800
福田組	4,100	6,180.00	25,338,000
日本ドライケミカル	1,500	2,500.00	3,750,000
住友林業	81,200	1,827.00	148,352,400
日本基礎技術	14,200	374.00	5,310,800
日成ビルド工業	18,800	1,296.00	24,364,800
ヤマダ・エスバイエルホーム	58,000	81.00	4,698,000
巴コーポレーション	15,900	555.00	8,824,500
大和ハウス工業	375,300	4,008.00	1,504,202,400
ライト工業	24,500	1,128.00	27,636,000
積水ハウス	413,300	1,887.00	779,897,100
日特建設	10,900	642.00	6,997,800
北陸電気工事	7,100	1,099.00	7,802,900
ユアテック	20,000	859.00	17,180,000
西部電気工業	2,100	2,801.00	5,882,100
四電工	1,900	2,755.00	5,234,500
中電工	16,400	2,996.00	49,134,400
関電工	50,600	1,167.00	59,050,200
きんでん	84,500	1,725.00	145,762,500
東京エネシス	14,400	1,112.00	16,012,800

トーエネック	3,600	3,070.00	11,052,000
住友電設	10,100	2,231.00	22,533,100
日本電設工業	19,500	2,196.00	42,822,000
協和エクシオ	45,600	2,664.00	121,478,400
新日本空調	9,800	1,459.00	14,298,200
日本工営	7,300	3,340.00	24,382,000
N D S	2,000	4,235.00	8,470,000
九電工	25,100	4,800.00	120,480,000
三機工業	26,900	1,149.00	30,908,100
日揮	109,400	2,164.00	236,741,600
中外炉工業	3,900	2,247.00	8,763,300
ヤマト	10,500	859.00	9,019,500
太平電業	8,600	2,678.00	23,030,800
高砂熱学工業	35,000	1,937.00	67,795,000
三晃金属工業	1,400	4,065.00	5,691,000
N E C ネットズエスアイ	12,300	2,712.00	33,357,600
朝日工業社	2,600	3,050.00	7,930,000
明星工業	23,000	757.00	17,411,000
大気社	16,800	3,605.00	60,564,000
ダイダン	8,500	2,427.00	20,629,500
日比谷総合設備	14,200	1,977.00	28,073,400
東芝プラントシステム	27,500	2,131.00	58,602,500
日本製粉	37,700	1,568.00	59,113,600
日清製粉グループ本社	139,300	2,078.00	289,465,400
日東富士製粉	800	4,695.00	3,756,000
昭和産業	10,400	2,716.00	28,246,400
鳥越製粉	10,100	912.00	9,211,200
中部飼料	13,900	2,019.00	28,064,100
フィード・ワン	76,600	229.00	17,541,400
東洋精糖	2,000	1,215.00	2,430,000
日本甜菜製糖	6,500	2,564.00	16,666,000
三井製糖	9,000	4,090.00	36,810,000
塩水港精糖	13,700	264.00	3,616,800
日新製糖	5,400	2,100.00	11,340,000
L I F U L L	37,700	848.00	31,969,600
ジェイエイシーリクルートメント	8,700	2,067.00	17,982,900
日本M & Aセンター	37,500	6,420.00	240,750,000
メンバーズ	2,700	769.00	2,076,300
中広	1,200	727.00	872,400
タケエイ	11,300	1,217.00	13,752,100
トラスト・テック	4,900	2,874.00	14,082,600
コシダカホールディングス	5,700	6,040.00	34,428,000
パソナグループ	10,300	2,238.00	23,051,400
C D S	3,000	1,269.00	3,807,000
リンクアンドモチベーション	19,900	842.00	16,755,800
G C A	12,400	962.00	11,928,800
エス・エム・エス	21,400	3,890.00	83,246,000
パーソルホールディングス	100,000	2,476.00	247,600,000
リニカル	7,000	1,492.00	10,444,000
クックパッド	34,100	624.00	21,278,400

エスクリ	3,800	998.00	3,792,400
アイ・ケイ・ケイ	6,400	750.00	4,800,000
森永製菓	26,700	5,350.00	142,845,000
中村屋	2,900	4,700.00	13,630,000
江崎グリコ	31,800	5,030.00	159,954,000
名糖産業	5,500	1,547.00	8,508,500
井村屋グループ	4,500	4,100.00	18,450,000
不二家	7,300	2,403.00	17,541,900
山崎製パン	93,100	2,084.00	194,020,400
第一屋製パン	2,000	1,153.00	2,306,000
モロゾフ	1,900	6,580.00	12,502,000
亀田製菓	7,100	5,010.00	35,571,000
寿スピリッツ	11,000	5,640.00	62,040,000
カルビー	51,800	3,505.00	181,559,000
森永乳業	22,800	4,675.00	106,590,000
六甲バター	5,700	2,644.00	15,070,800
ヤクルト本社	68,100	8,270.00	563,187,000
明治ホールディングス	75,300	8,580.00	646,074,000
雪印メグミルク	27,400	2,883.00	78,994,200
プリマハム	80,000	646.00	51,680,000
日本ハム	98,000	2,453.00	240,394,000
林兼産業	4,100	827.00	3,390,700
丸大食品	61,000	480.00	29,280,000
S Foods	8,000	4,445.00	35,560,000
伊藤ハム米久ホールディングス	73,300	913.00	66,922,900
学情	5,000	1,506.00	7,530,000
スタジオアリス	5,400	2,706.00	14,612,400
シミックホールディングス	6,000	2,524.00	15,144,000
システナ	8,900	4,380.00	38,982,000
NJS	2,700	1,539.00	4,155,300
デジタルアーツ	5,500	3,715.00	20,432,500
新日鉄住金ソリューションズ	17,500	2,785.00	48,737,500
総合警備保障	43,100	5,060.00	218,086,000
キューブシステム	6,500	781.00	5,076,500
いちご	159,800	437.00	69,832,600
エイジア	1,700	1,379.00	2,344,300
日本駐車場開発	135,100	179.00	24,182,900
コア	4,700	1,280.00	6,016,000
カクコム	83,300	1,699.00	141,526,700
アイロムグループ	3,700	1,776.00	6,571,200
セントケア・ホールディング	4,600	719.00	3,307,400
サイネックス	1,600	893.00	1,428,800
ルネサンス	5,300	1,753.00	9,290,900
ディップ	15,300	3,200.00	48,960,000
SBSホールディングス	11,200	1,070.00	11,984,000
オプトホールディング	7,600	1,322.00	10,047,200
新日本科学	13,200	521.00	6,877,200
ツクイ	25,500	852.00	21,726,000
キャリアデザインセンター	2,500	2,194.00	5,485,000
エムスリー	114,000	3,865.00	440,610,000

ツカダ・グローバルホールディング	8,700	617.00	5,367,900
プラス	600	990.00	594,000
アウトソーシング	32,300	1,889.00	61,014,700
ウェルネット	11,000	1,113.00	12,243,000
ワールドホールディングス	3,600	3,345.00	12,042,000
ディー・エヌ・エー	58,400	2,208.00	128,947,200
博報堂DYホールディングス	150,600	1,603.00	241,411,800
ぐるなび	17,200	1,395.00	23,994,000
エスアールジータカミヤ	12,800	648.00	8,294,400
ジャパンベストレスキューシステム	13,500	739.00	9,976,500
ファンコミュニケーションズ	30,200	794.00	23,978,800
ライク	4,300	1,926.00	8,281,800
ビジネス・ブレイクスルー	5,200	460.00	2,392,000
WDBホールディングス	5,000	3,350.00	16,750,000
ティア	5,700	1,087.00	6,195,900
CDG	1,000	1,797.00	1,797,000
バリューコマース	9,700	1,113.00	10,796,100
インフォマート	54,800	784.00	42,963,200
サッポロホールディングス	41,600	3,110.00	129,376,000
アサヒグループホールディングス	238,400	5,300.00	1,263,520,000
キリンホールディングス	547,000	2,563.50	1,402,234,500
宝ホールディングス	85,200	1,252.00	106,670,400
オエノンホールディングス	32,500	405.00	13,162,500
養命酒製造	3,500	2,370.00	8,295,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	79,900	3,685.00	294,431,500
サントリー食品インターナショナル	87,000	5,000.00	435,000,000
ダイドーグループホールディングス	5,800	6,440.00	37,352,000
伊藤園	37,700	4,450.00	167,765,000
キーコーヒー	11,200	2,106.00	23,587,200
ユニカフェ	3,500	1,127.00	3,944,500
ジャパンフーズ	1,600	1,480.00	2,368,000
日清オイリオグループ	13,400	3,100.00	41,540,000
不二製油グループ本社	30,800	3,035.00	93,478,000
かどや製油	1,200	7,080.00	8,496,000
J-オイルミルズ	5,900	3,735.00	22,036,500
ローソン	28,300	7,350.00	208,005,000
サンエー	8,400	5,410.00	45,444,000
カワチ薬品	8,700	2,570.00	22,359,000
エービーシー・マート	20,300	6,970.00	141,491,000
ハードオフコーポレーション	4,900	1,189.00	5,826,100
高千穂交易	4,300	1,107.00	4,760,100
アスクル	9,700	3,495.00	33,901,500
ゲオホールディングス	20,400	2,179.00	44,451,600
アダストリア	17,200	2,164.00	37,220,800
ジーフット	6,700	776.00	5,199,200
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,500	717.00	1,075,500
伊藤忠食品	2,700	6,310.00	17,037,000
くらコーポレーション	6,600	6,280.00	41,448,000
キャンドウ	5,300	1,722.00	9,126,600

エレマテック	5,200	2,312.00	12,022,400
バルグループホールディングス	5,700	2,985.00	17,014,500
JALUX	3,200	2,965.00	9,488,000
エディオン	43,400	1,301.00	56,463,400
あらた	5,500	4,740.00	26,070,000
サーラコーポレーション	19,200	670.00	12,864,000
ワッツ	4,500	1,054.00	4,743,000
トーメンデバイス	1,700	2,880.00	4,896,000
ハローズ	4,200	2,438.00	10,239,600
J Pホールディングス	34,100	293.00	9,991,300
あみやき亭	2,400	5,040.00	12,096,000
東京エレクトロン デバイス	4,000	2,226.00	8,904,000
ひらまつ	15,400	561.00	8,639,400
フィールズ	8,500	1,197.00	10,174,500
双日	660,700	341.00	225,298,700
アルフレッサ ホールディングス	124,100	2,386.00	296,102,600
大黒天物産	2,700	4,975.00	13,432,500
ハニーズホールディングス	10,800	1,033.00	11,156,400
ファーマライズホールディングス	2,600	608.00	1,580,800
キッコーマン	88,900	4,205.00	373,824,500
味の素	261,700	1,966.50	514,633,050
キューピー	63,400	2,966.00	188,044,400
ハウス食品グループ本社	43,400	3,505.00	152,117,000
カゴメ	45,600	3,625.00	165,300,000
焼津水産化学工業	5,500	1,193.00	6,561,500
アリアケジャパン	10,400	8,670.00	90,168,000
ピエトロ	1,500	1,664.00	2,496,000
エバラ食品工業	2,500	2,108.00	5,270,000
ニチレイ	54,200	2,577.00	139,673,400
横浜冷凍	27,000	1,066.00	28,782,000
東洋水産	62,400	4,205.00	262,392,000
イトアアンド	3,200	2,115.00	6,768,000
大冷	1,300	2,157.00	2,804,100
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,700	1,727.00	2,935,900
日清食品ホールディングス	49,600	7,570.00	375,472,000
永谷園ホールディングス	12,000	1,428.00	17,136,000
一正蒲鉾	4,400	1,176.00	5,174,400
フジッコ	12,300	2,297.00	28,253,100
ロック・フィールド	12,300	2,054.00	25,264,200
日本たばこ産業	704,100	3,301.00	2,324,234,100
ケンコーマヨネーズ	7,500	3,840.00	28,800,000
わらべや日洋ホールディングス	7,500	2,635.00	19,762,500
なとり	6,400	1,961.00	12,550,400
イフジ産業	2,000	762.00	1,524,000
ピックルスコーポレーション	1,700	1,745.00	2,966,500
北の達人コーポレーション	10,900	2,572.00	28,034,800
ユーグレナ	43,900	1,031.00	45,260,900
片倉工業	13,700	1,346.00	18,440,200
グンゼ	8,900	6,000.00	53,400,000
ヒューリック	233,500	1,263.00	294,910,500

神栄	1,500	1,442.00	2,163,000
ラサ商事	5,000	909.00	4,545,000
アルペン	8,600	2,489.00	21,405,400
ハブ	2,100	1,239.00	2,601,900
ラクーン	6,600	694.00	4,580,400
クオール	12,300	2,202.00	27,084,600
アルコニックス	11,800	2,302.00	27,163,600
神戸物産	7,200	3,945.00	28,404,000
ソリトンシステムズ	3,700	1,410.00	5,217,000
ジーンズ	7,600	5,080.00	38,608,000
ビックカメラ	64,700	1,594.00	103,131,800
D C Mホールディングス	60,200	1,058.00	63,691,600
ペッパーフードサービス	6,000	4,330.00	25,980,000
M o n o t a R O	39,700	3,380.00	134,186,000
東京一番フーズ	2,400	695.00	1,668,000
D Dホールディングス	2,500	3,560.00	8,900,000
あい ホールディングス	17,900	2,703.00	48,383,700
ディー・ブイエックス	4,000	1,236.00	4,944,000
きちり	3,100	709.00	2,197,900
アークランドサービスホールディングス	9,300	2,313.00	21,510,900
J . フロント リテイリング	133,400	1,931.00	257,595,400
ドトール・日レスホールディングス	19,600	2,528.00	49,548,800
マツモトキヨシホールディングス	46,200	4,330.00	200,046,000
ブロンコビリー	5,800	3,375.00	19,575,000
スタートトゥデイ	109,700	3,115.00	341,715,500
トレジャー・ファクトリー	3,300	859.00	2,834,700
物語コーポレーション	3,200	9,500.00	30,400,000
ココカラファイン	11,700	6,930.00	81,081,000
三越伊勢丹ホールディングス	208,800	1,264.00	263,923,200
東洋紡	43,900	1,982.00	87,009,800
ユニチカ	34,600	727.00	25,154,200
富士紡ホールディングス	6,600	4,170.00	27,522,000
日清紡ホールディングス	69,300	1,439.00	99,722,700
倉敷紡績	120,000	335.00	40,200,000
ダイワボウホールディングス	9,500	4,315.00	40,992,500
シキボウ	6,000	1,285.00	7,710,000
日東紡績	16,900	2,600.00	43,940,000
トヨタ紡織	33,000	2,395.00	79,035,000
マクニカ・富士エレホールディングス	20,700	3,035.00	62,824,500
H a m e e	2,800	1,796.00	5,028,800
ラクト・ジャパン	1,600	3,805.00	6,088,000
ウエルシアホールディングス	29,500	4,455.00	131,422,500
クリエイティブSDホールディングス	16,500	2,576.00	42,504,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,000	983.00	20,643,000
八洲電機	8,700	894.00	7,777,800
メディアスホールディングス	1,800	2,480.00	4,464,000
U K Cホールディングス	7,200	2,193.00	15,789,600
ジュテックホールディングス	2,600	1,285.00	3,341,000

丸善CHIホールディングス	13,000	338.00	4,394,000
大光	2,600	918.00	2,386,800
OCHIホールディングス	3,200	1,393.00	4,457,600
TOKAIホールディングス	59,000	1,023.00	60,357,000
ミサワ	1,800	439.00	790,200
ティーライフ	1,500	1,219.00	1,828,500
大阪工機	1,700	1,055.00	1,793,500
エー・ピーカンパニー	2,200	788.00	1,733,600
三洋貿易	6,100	2,484.00	15,152,400
チムニー	3,400	2,848.00	9,683,200
シュッピン	6,800	1,146.00	7,792,800
ビューティガレージ	1,500	1,898.00	2,847,000
ウイン・パートナーズ	8,100	1,548.00	12,538,800
ネクステージ	11,400	1,006.00	11,468,400
ジョイフル本田	16,400	3,520.00	57,728,000
鳥貴族	4,100	3,080.00	12,628,000
キリン堂ホールディングス	3,900	1,782.00	6,949,800
ホットランド	6,500	1,361.00	8,846,500
すかいらーく	69,300	1,562.00	108,246,600
綿半ホールディングス	4,200	4,185.00	17,577,000
日本毛織	33,400	1,119.00	37,374,600
ダイトウボウ	18,800	106.00	1,992,800
トーア紡コーポレーション	5,100	577.00	2,942,700
ダイドーリミテッド	13,500	453.00	6,115,500
ヨシックス	1,800	3,300.00	5,940,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	37,100	1,096.00	40,661,600
三栄建築設計	4,500	2,086.00	9,387,000
スター・マイカ	4,100	1,767.00	7,244,700
野村不動産ホールディングス	74,400	2,442.00	181,684,800
三重交通グループホールディングス	22,700	478.00	10,850,600
サムティ	9,500	1,807.00	17,166,500
ディア・ライフ	11,300	602.00	6,802,600
コーセーアールイー	1,900	1,064.00	2,021,600
エー・ディー・ワークス	150,000	41.00	6,150,000
日本商業開発	6,300	1,745.00	10,993,500
プレサンスコーポレーション	15,300	1,504.00	23,011,200
ユニゾホールディングス	13,100	2,831.00	37,086,100
THEグローバル社	5,300	924.00	4,897,200
日本管理センター	7,400	1,517.00	11,225,800
サンセイランディック	3,300	1,248.00	4,118,400
エストラスト	1,600	1,006.00	1,609,600
フージャースホールディングス	27,200	703.00	19,121,600
オープンハウス	18,200	5,870.00	106,834,000
東急不動産ホールディングス	270,800	790.00	213,932,000
飯田グループホールディングス	93,300	2,069.00	193,037,700
ムゲンエステート	6,900	1,060.00	7,314,000
帝国繊維	12,400	2,098.00	26,015,200
ブックオフコーポレーション	6,400	833.00	5,331,200
日本コークス工業	96,100	111.00	10,667,100

ゴルフダイジェスト・オンライン	4,500	1,092.00	4,914,000
ミタチ産業	2,600	1,591.00	4,136,600
B E E N O S	1,500	1,485.00	2,227,500
あさひ	8,300	1,338.00	11,105,400
日本調剤	3,900	3,685.00	14,371,500
コスモス薬品	5,600	18,950.00	106,120,000
シップヘルスケアホールディングス	23,300	3,645.00	84,928,500
トーエル	5,500	974.00	5,357,000
一六堂	2,500	441.00	1,102,500
ソフトクリエイイトホールディングス	5,400	1,571.00	8,483,400
オンリー	1,700	895.00	1,521,500
セブン&アイ・ホールディングス	468,100	4,455.00	2,085,385,500
薬王堂	4,900	3,485.00	17,076,500
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	30,000	1,174.00	35,220,000
明治電機工業	3,800	1,886.00	7,166,800
ツルハホールディングス	24,200	14,800.00	358,160,000
デリカフーズホールディングス	2,200	1,401.00	3,082,200
スターティア	2,500	986.00	2,465,000
サンマルクホールディングス	8,000	3,015.00	24,120,000
フェリシモ	2,900	1,262.00	3,659,800
トリドールホールディングス	13,800	3,600.00	49,680,000
帝人	97,000	2,214.00	214,758,000
東レ	861,500	1,009.00	869,253,500
クラレ	199,900	1,884.00	376,611,600
旭化成	740,700	1,331.00	985,871,700
サカイオーベックス	3,100	2,385.00	7,393,500
T O K Y O B A S E	2,200	3,775.00	8,305,000
稲葉製作所	6,300	1,348.00	8,492,400
宮地エンジニアリンググループ	3,200	2,420.00	7,744,000
トーカロ	7,800	5,570.00	43,446,000
アルファ	4,000	1,952.00	7,808,000
S U M C O	103,300	2,838.00	293,165,400
川田テクノロジーズ	2,300	5,650.00	12,995,000
R S T e c h n o l o g i e s	1,600	6,440.00	10,304,000
ファーストブラザーズ	3,100	1,431.00	4,436,100
ハウスドゥ	1,800	2,392.00	4,305,600
シーアールイー	1,800	1,597.00	2,874,600
ケイアイスター不動産	4,000	2,825.00	11,300,000
住江織物	3,000	2,935.00	8,805,000
日本フェルト	6,400	518.00	3,315,200
イチカワ	8,000	370.00	2,960,000
エコナックホールディングス	21,700	120.00	2,604,000
日東製網	1,300	1,755.00	2,281,500
芦森工業	2,400	2,609.00	6,261,600
アツギ	7,900	1,204.00	9,511,600
コメダホールディングス	20,600	2,083.00	42,909,800
サツドラホールディングス	1,500	1,921.00	2,881,500
ダイユー・リックホールディングス	5,200	1,359.00	7,066,800
パロックジャパンリミテッド	8,900	911.00	8,107,900

クスリのアオキホールディングス	8,900	5,740.00	51,086,000
ダイニック	4,600	1,056.00	4,857,600
共和レザー	6,900	958.00	6,610,200
スシローグローバルホールディングス	10,700	4,265.00	45,635,500
L I X I L ビバ	10,600	2,033.00	21,549,800
セーレン	27,300	2,051.00	55,992,300
ソトー	4,400	1,108.00	4,875,200
東海染工	1,700	1,535.00	2,609,500
小松精練	18,200	878.00	15,979,600
ワコールホールディングス	32,800	3,145.00	103,156,000
ホギメディカル	7,500	7,970.00	59,775,000
レナウン	32,300	172.00	5,555,600
クラウディアホールディングス	2,900	558.00	1,618,200
T S I ホールディングス	44,800	750.00	33,600,000
マツオカコーポレーション	2,100	4,380.00	9,198,000
T I S	37,100	3,765.00	139,681,500
ネオス	3,400	421.00	1,431,400
電算システム	3,900	1,900.00	7,410,000
グリー	59,600	679.00	40,468,400
コーエーテックモホールディングス	18,900	2,251.00	42,543,900
三菱総合研究所	4,800	3,390.00	16,272,000
ボルテージ	2,100	925.00	1,942,500
電算	1,300	2,508.00	3,260,400
A G S	6,300	833.00	5,247,900
ファインデックス	9,300	748.00	6,956,400
ヒト・コミュニケーションズ	2,500	1,825.00	4,562,500
ブレインパッド	2,400	1,932.00	4,636,800
K L a b	21,600	1,657.00	35,791,200
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,100	2,109.00	17,082,900
イーブックイニシアティブジャパン	1,800	1,005.00	1,809,000
ネクソン	124,000	3,380.00	419,120,000
アイスタイル	27,900	1,482.00	41,347,800
エムアップ	3,700	1,066.00	3,944,200
エイチーム	7,600	2,475.00	18,810,000
テクノスジャパン	10,100	887.00	8,958,700
e n i s h	3,300	1,017.00	3,356,100
コロブラ	36,100	891.00	32,165,100
モバイルクリエイト	8,600	331.00	2,846,600
オルトプラス	5,400	878.00	4,741,200
ブロードリーフ	27,600	1,037.00	28,621,200
ハーツユナイテッドグループ	5,900	1,740.00	10,266,000
メディアドゥホールディングス	3,600	1,900.00	6,840,000
バイキューブ	6,900	497.00	3,429,300
サイバーリンクス	1,800	1,215.00	2,187,000
ディー・エル・イー	5,100	431.00	2,198,100
フィックスターズ	1,900	6,230.00	11,837,000
VOYAGE GROUP	5,700	1,180.00	6,726,000
オブティム	1,900	2,276.00	4,324,400
セレス	3,400	1,627.00	5,531,800

特種東海製紙	6,500	4,115.00	26,747,500
ベリサーブ	1,400	3,220.00	4,508,000
ティーガイア	11,100	2,526.00	28,038,600
セック	1,100	2,894.00	3,183,400
日本アジアグループ	11,700	475.00	5,557,500
豆蔵ホールディングス	8,300	1,238.00	10,275,400
テクマトリックス	6,100	1,741.00	10,620,100
プロシップ	1,600	2,056.00	3,289,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	301,700	303.00	91,415,100
GMOペイメントゲートウェイ	7,800	8,570.00	66,846,000
ザッパラス	5,500	386.00	2,123,000
システムリサーチ	1,100	2,175.00	2,392,500
インターネットイニシアティブ	18,100	2,234.00	40,435,400
さくらインターネット	13,300	753.00	10,014,900
GMOクラウド	2,500	2,002.00	5,005,000
SRAホールディングス	5,900	3,685.00	21,741,500
MINORIソリューションズ	2,200	1,556.00	3,423,200
システムインテグレータ	1,600	962.00	1,539,200
朝日ネット	10,200	518.00	5,283,600
eBASE	2,200	1,085.00	2,387,000
アドソル日進	4,300	1,285.00	5,525,500
フリービット	7,400	926.00	6,852,400
コムチュア	5,700	3,460.00	19,722,000
サイバーコム	2,000	1,332.00	2,664,000
王子ホールディングス	500,000	702.00	351,000,000
日本製紙	53,200	2,101.00	111,773,200
三菱製紙	16,900	681.00	11,508,900
北越紀州製紙	66,300	664.00	44,023,200
中越バルブ工業	4,700	1,862.00	8,751,400
巴川製紙所	18,000	294.00	5,292,000
大王製紙	47,300	1,441.00	68,159,300
阿波製紙	2,900	658.00	1,908,200
メディカル・データ・ビジョン	4,200	2,143.00	9,000,600
gumi	12,800	1,005.00	12,864,000
ショーケース・ティービー	2,200	1,271.00	2,796,200
モバイルファクトリー	2,100	1,210.00	2,541,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,700	2,960.00	5,032,000
PCIホールディングス	1,900	3,035.00	5,766,500
パイブドHD	1,800	1,276.00	2,296,800
アイビーシー	1,200	1,405.00	1,686,000
オープンドア	4,400	2,345.00	10,318,000
マイネット	2,200	1,450.00	3,190,000
アカツキ	2,200	6,130.00	13,486,000
LINE	33,600	4,480.00	150,528,000
レンゴー	114,500	903.00	103,393,500
トーモク	6,800	2,140.00	14,552,000
ザ・バック	8,400	3,485.00	29,274,000
シンクロ・フード	900	2,923.00	2,630,700

オークネット	3,500	1,551.00	5,428,500
AOI TYO HOLDINGS	9,100	1,241.00	11,293,100
マクロミル	10,400	2,585.00	26,884,000
昭和電工	79,100	4,640.00	367,024,000
住友化学	874,000	697.00	609,178,000
住友精化	4,900	5,370.00	26,313,000
日産化学工業	69,100	4,045.00	279,509,500
ラサ工業	4,200	2,316.00	9,727,200
クレハ	10,300	7,050.00	72,615,000
多木化学	1,600	5,320.00	8,512,000
テイカ	9,100	2,890.00	26,299,000
石原産業	21,300	1,865.00	39,724,500
片倉コープアグリ	2,900	1,322.00	3,833,800
日東エフシー	6,900	784.00	5,409,600
日本曹達	82,000	634.00	51,988,000
東ソー	171,700	2,271.00	389,930,700
トクヤマ	34,500	3,010.00	103,845,000
セントラル硝子	24,200	2,355.00	56,991,000
東亜合成	69,700	1,305.00	90,958,500
大阪ソーダ	10,700	2,702.00	28,911,400
関東電化工業	28,400	1,182.00	33,568,800
デンカ	43,600	3,995.00	174,182,000
イビデン	69,400	1,666.00	115,620,400
信越化学工業	197,800	11,540.00	2,282,612,000
日本カーバイド工業	3,800	1,875.00	7,125,000
堺化学工業	8,100	2,738.00	22,177,800
エア・ウォーター	97,900	2,138.00	209,310,200
大陽日酸	91,500	1,563.00	143,014,500
日本化学工業	4,400	2,382.00	10,480,800
東邦アセチレン	1,700	1,503.00	2,555,100
日本パーカライジング	60,700	1,941.00	117,818,700
高圧ガス工業	17,600	862.00	15,171,200
チタン工業	1,300	2,808.00	3,650,400
四国化成工業	17,100	1,599.00	27,342,900
戸田工業	2,400	4,060.00	9,744,000
ステラ ケミファ	6,100	3,360.00	20,496,000
保土谷化学工業	3,900	4,975.00	19,402,500
日本触媒	18,700	7,290.00	136,323,000
大日精化工業	9,200	4,695.00	43,194,000
カネカ	160,000	934.00	149,440,000
協和発酵キリン	142,100	2,018.00	286,757,800
三菱瓦斯化学	97,900	2,765.00	270,693,500
三井化学	108,000	3,130.00	338,040,000
J S R	119,400	2,398.00	286,321,200
東京応化工業	20,600	4,585.00	94,451,000
大阪有機化学工業	7,700	1,553.00	11,958,100
三菱ケミカルホールディングス	795,400	1,088.00	865,395,200
K Hネオケム	18,200	2,990.00	54,418,000
ダイセル	160,200	1,222.00	195,764,400
住友ベークライト	96,000	862.00	82,752,000

積水化学工業	246,700	1,938.00	478,104,600
日本ゼオン	100,200	1,555.00	155,811,000
アイカ工業	33,300	3,945.00	131,368,500
宇部興産	59,800	3,370.00	201,526,000
積水樹脂	18,300	2,399.00	43,901,700
タキロンシーアイ	24,000	728.00	17,472,000
旭有機材	7,000	2,027.00	14,189,000
日立化成	58,700	2,468.00	144,871,600
ニチバン	5,800	2,894.00	16,785,200
リケンテクノス	25,600	522.00	13,363,200
大倉工業	28,000	587.00	16,436,000
積水化成品工業	14,900	1,121.00	16,702,900
群栄化学工業	2,800	3,550.00	9,940,000
タイガースポリマー	5,900	796.00	4,696,400
ミライアル	3,900	1,908.00	7,441,200
ダイキアクシス	4,000	1,407.00	5,628,000
ダイキョーニシカワ	23,400	1,644.00	38,469,600
竹本容器	1,300	2,318.00	3,013,400
森六ホールディングス	4,500	2,936.00	13,212,000
日本化薬	77,100	1,406.00	108,402,600
カーリットホールディングス	11,000	1,102.00	12,122,000
E P Sホールディングス	16,300	2,246.00	36,609,800
ソルクシーズ	4,300	1,113.00	4,785,900
レグス	2,700	789.00	2,130,300
プレステージ・インターナショナル	22,500	1,336.00	30,060,000
フェイス	3,900	1,203.00	4,691,700
ハイマックス	1,500	1,678.00	2,517,000
アミューズ	7,200	3,230.00	23,256,000
野村総合研究所	74,400	4,665.00	347,076,000
ドリームインキュベータ	3,600	2,475.00	8,910,000
サイバネットシステム	9,200	681.00	6,265,200
クイック	6,700	1,801.00	12,066,700
T A C	6,700	307.00	2,056,900
C Eホールディングス	3,200	838.00	2,681,600
ケネディクス	143,500	663.00	95,140,500
日本システム技術	1,400	1,321.00	1,849,400
電通	132,000	4,575.00	603,900,000
インテージホールディングス	12,800	1,286.00	16,460,800
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,100	1,028.00	5,242,800
東邦システムサイエンス	3,800	814.00	3,093,200
びあ	3,600	6,630.00	23,868,000
イオンファンタジー	3,500	5,030.00	17,605,000
ソースネクスト	15,700	646.00	10,142,200
シーティーエス	11,100	737.00	8,180,700
ネクシィーズグループ	4,300	1,697.00	7,297,100
メディカルシステムネットワーク	12,700	597.00	7,581,900
日本精化	9,900	1,151.00	11,394,900
扶桑化学工業	8,400	2,877.00	24,166,800
A D E K A	51,100	1,868.00	95,454,800
日油	45,900	2,850.00	130,815,000

ミヨシ油脂	4,400	1,396.00	6,142,400
新日本理化	18,900	250.00	4,725,000
ハリマ化成グループ	9,200	873.00	8,031,600
花王	278,800	7,683.00	2,142,020,400
第一工業製薬	23,000	832.00	19,136,000
日華化学	3,800	1,106.00	4,202,800
ニイタカ	1,700	1,691.00	2,874,700
三洋化成工業	7,500	5,390.00	40,425,000
武田薬品工業	417,700	6,028.00	2,517,895,600
アステラス製薬	1,165,400	1,465.00	1,707,311,000
大日本住友製薬	84,100	1,503.00	126,402,300
塩野義製薬	162,200	5,614.00	910,590,800
田辺三菱製薬	138,400	2,217.00	306,832,800
わかもと製薬	14,000	271.00	3,794,000
あすか製薬	12,900	2,046.00	26,393,400
日本新薬	29,700	6,690.00	198,693,000
ビオフェルミン製薬	1,900	2,821.00	5,359,900
中外製薬	118,200	5,260.00	621,732,000
科研製薬	20,500	5,590.00	114,595,000
エーザイ	135,700	6,095.00	827,091,500
理研ビタミン	4,300	4,085.00	17,565,500
ロート製薬	62,300	2,774.00	172,820,200
小野薬品工業	267,800	2,822.00	755,731,600
久光製薬	33,500	7,360.00	246,560,000
有機合成薬品工業	8,000	291.00	2,328,000
持田製薬	7,900	7,920.00	62,568,000
参天製薬	214,700	1,686.00	361,984,200
扶桑薬品工業	4,000	2,719.00	10,876,000
日本ケミファ	1,500	4,560.00	6,840,000
ツムラ	40,500	3,570.00	144,585,000
日医工	29,900	1,683.00	50,321,700
テルモ	173,800	5,010.00	870,738,000
みらかホールディングス	32,300	4,305.00	139,051,500
キッセイ薬品工業	21,000	2,870.00	60,270,000
生化学工業	22,000	1,666.00	36,652,000
栄研化学	9,200	4,840.00	44,528,000
日水製薬	4,800	1,385.00	6,648,000
鳥居薬品	7,100	2,681.00	19,035,100
JCRファーマ	8,000	5,150.00	41,200,000
東和薬品	5,400	6,340.00	34,236,000
富士製薬工業	3,900	3,815.00	14,878,500
沢井製薬	22,800	4,750.00	108,300,000
ゼリア新薬工業	24,300	2,141.00	52,026,300
第一三共	324,500	4,032.00	1,308,384,000
キョーリン製薬ホールディングス	31,700	2,094.00	66,379,800
大幸薬品	6,000	2,321.00	13,926,000
ダイト	6,600	3,620.00	23,892,000
大塚ホールディングス	235,700	4,595.00	1,083,041,500
大正製薬ホールディングス	25,400	9,360.00	237,744,000
ペプチドリーム	50,800	4,240.00	215,392,000

大日本塗料	13,600	1,605.00	21,828,000
日本ペイントホールディングス	91,700	3,620.00	331,954,000
関西ペイント	124,800	2,532.00	315,993,600
神東塗料	9,000	255.00	2,295,000
中国塗料	34,100	914.00	31,167,400
日本特殊塗料	7,500	2,042.00	15,315,000
藤倉化成	15,000	666.00	9,990,000
太陽ホールディングス	9,100	4,955.00	45,090,500
D I C	46,900	3,965.00	185,958,500
サカティンクス	24,200	1,791.00	43,342,200
東洋インキS Cホールディングス	117,000	625.00	73,125,000
T & K T O K A	7,900	1,400.00	11,060,000
アルプス技研	9,500	2,072.00	19,684,000
サニックス	17,400	219.00	3,810,600
ダイオーズ	2,200	1,320.00	2,904,000
日本空調サービス	11,400	737.00	8,401,800
オリエンタルランド	128,000	10,095.00	1,292,160,000
フォーカスシステムズ	6,300	791.00	4,983,300
ダスキン	29,100	2,679.00	77,958,900
パーク24	62,000	2,589.00	160,518,000
明光ネットワークジャパン	13,700	1,269.00	17,385,300
ファルコホールディングス	5,600	1,710.00	9,576,000
クレスコ	2,500	3,700.00	9,250,000
フジ・メディア・ホールディングス	116,500	1,933.00	225,194,500
秀英予備校	2,400	480.00	1,152,000
田谷	2,000	670.00	1,340,000
ラウンドワン	33,600	1,846.00	62,025,600
リゾートトラスト	45,900	2,473.00	113,510,700
オービック	35,100	8,200.00	287,820,000
ジャストシステム	18,100	2,114.00	38,263,400
T D Cソフト	4,900	1,188.00	5,821,200
ヤフー	802,300	499.00	400,347,700
ビー・エム・エル	13,900	2,882.00	40,059,800
ワタベウェディング	1,800	636.00	1,144,800
トレンドマイクロ	54,300	5,430.00	294,849,000
りらいあコミュニケーションズ	17,100	1,378.00	23,563,800
インフォメーション・ディベロプメント	3,500	1,332.00	4,662,000
リソー教育	18,400	792.00	14,572,800
日本オラクル	18,000	8,340.00	150,120,000
早稲田アカデミー	1,600	1,689.00	2,702,400
アルファシステムズ	3,700	2,218.00	8,206,600
フューチャー	15,100	1,087.00	16,413,700
C A C Holdings	8,400	1,000.00	8,400,000
ソフトバンク・テクノロジー	4,700	1,895.00	8,906,500
トーセ	3,000	1,763.00	5,289,000
ユー・エス・エス	132,300	2,249.00	297,542,700
オービックビジネスコンサルタント	5,700	5,870.00	33,459,000
伊藤忠テクノソリューションズ	25,300	4,260.00	107,778,000
アイティフォー	13,600	728.00	9,900,800

東京個別指導学院	3,800	1,208.00	4,590,400
東計電算	2,000	3,110.00	6,220,000
サイバーエージェント	71,200	4,190.00	298,328,000
楽天	555,600	939.50	521,986,200
エクスネット	1,800	890.00	1,602,000
クリーク・アンド・リバー社	5,600	1,002.00	5,611,200
テー・オー・ダブリュー	9,700	911.00	8,836,700
大塚商会	33,400	9,140.00	305,276,000
総合メディカル	4,900	6,070.00	29,743,000
サイボウズ	14,900	517.00	7,703,300
ソフトブレイン	8,900	409.00	3,640,100
セントラルスポーツ	4,000	3,925.00	15,700,000
バラカ	3,600	2,423.00	8,722,800
電通国際情報サービス	6,900	2,558.00	17,650,200
デジタルガレージ	20,000	3,045.00	60,900,000
イーエムシステムズ	3,900	2,336.00	9,110,400
ウェザーニューズ	3,800	3,240.00	12,312,000
C I J	8,800	679.00	5,975,200
東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	1,751.00	1,926,100
日本エンタープライズ	11,700	220.00	2,574,000
WOWOW	5,300	3,295.00	17,463,500
スカラ	7,800	759.00	5,920,200
フルキャストホールディングス	9,500	2,255.00	21,422,500
富士フイルムホールディングス	235,500	4,547.00	1,070,818,500
コニカミノルタ	265,400	978.00	259,561,200
資生堂	211,200	5,488.00	1,159,065,600
ライオン	158,000	1,993.00	314,894,000
高砂香料工業	7,100	3,195.00	22,684,500
マンダム	22,100	3,715.00	82,101,500
ミルボン	15,200	3,460.00	52,592,000
ファンケル	27,500	3,300.00	90,750,000
コーセー	19,200	18,980.00	364,416,000
コタ	4,900	1,875.00	9,187,500
シーズ・ホールディングス	15,400	5,520.00	85,008,000
シーボン	1,400	3,325.00	4,655,000
ポーラ・オルビスホールディングス	48,400	4,135.00	200,134,000
ノエビアホールディングス	7,200	7,860.00	56,592,000
アジュバンコスメジャパン	2,600	1,038.00	2,698,800
エステー	8,100	2,222.00	17,998,200
アグロ カネショウ	4,600	2,142.00	9,853,200
コニシ	18,600	1,852.00	34,447,200
長谷川香料	15,000	2,200.00	33,000,000
星光PMC	6,500	1,102.00	7,163,000
小林製薬	31,800	6,880.00	218,784,000
荒川化学工業	10,200	1,947.00	19,859,400
メック	7,800	2,042.00	15,927,600
日本高純度化学	3,100	2,539.00	7,870,900
タカラバイオ	29,700	1,730.00	51,381,000
JCU	7,000	4,690.00	32,830,000
新田ゼラチン	7,800	785.00	6,123,000

O A Tアグリオ	1,600	2,573.00	4,116,800
デクセリアルズ	29,000	1,366.00	39,614,000
アース製薬	8,500	5,450.00	46,325,000
北興化学工業	11,700	686.00	8,026,200
大成ラミック	3,500	3,115.00	10,902,500
クミアイ化学工業	51,600	653.00	33,694,800
日本農薬	29,600	600.00	17,760,000
昭和シェル石油	106,100	1,505.00	159,680,500
富士興産	4,100	652.00	2,673,200
ニチレキ	14,500	1,346.00	19,517,000
ユシロ化学工業	6,400	1,630.00	10,432,000
ビービー・カストロール	4,900	1,820.00	8,918,000
富士石油	27,600	498.00	13,744,800
M O R E S C O	4,100	1,961.00	8,040,100
出光興産	95,200	3,905.00	371,756,000
J X T Gホールディングス	1,809,700	686.90	1,243,082,930
コスモエネルギーホールディングス	32,800	4,090.00	134,152,000
横浜ゴム	65,600	2,602.00	170,691,200
東洋ゴム工業	67,200	2,167.00	145,622,400
ブリヂストン	400,800	4,936.00	1,978,348,800
住友ゴム工業	116,700	2,035.00	237,484,500
藤倉ゴム工業	9,900	809.00	8,009,100
オカモト	39,000	1,136.00	44,304,000
アキレス	8,600	2,225.00	19,135,000
フコク	5,000	1,046.00	5,230,000
ニッタ	11,700	4,135.00	48,379,500
クリエートメディック	3,800	1,203.00	4,571,400
住友理工	22,000	1,071.00	23,562,000
三ツ星ベルト	28,000	1,331.00	37,268,000
バンドー化学	21,600	1,189.00	25,682,400
旭硝子	115,900	4,375.00	507,062,500
日本板硝子	57,300	838.00	48,017,400
石塚硝子	1,500	2,592.00	3,888,000
有沢製作所	19,000	1,033.00	19,627,000
日本山村硝子	47,000	180.00	8,460,000
日本電気硝子	49,000	3,580.00	175,420,000
オハラ	4,500	3,125.00	14,062,500
住友大阪セメント	220,000	500.00	110,000,000
太平洋セメント	71,600	4,235.00	303,226,000
リソルホールディングス	1,200	4,010.00	4,812,000
日本ヒューム	11,400	804.00	9,165,600
日本コンクリート工業	24,500	457.00	11,196,500
三谷セキサン	5,900	2,251.00	13,280,900
アジアパイルホールディングス	14,700	641.00	9,422,700
東海カーボン	103,000	1,463.00	150,689,000
日本カーボン	5,800	4,690.00	27,202,000
東洋炭素	7,400	3,385.00	25,049,000
ノリタケカンパニーリミテド	6,700	5,480.00	36,716,000
T O T O	87,200	5,360.00	467,392,000
日本碍子	138,400	2,012.00	278,460,800

日本特殊陶業	97,300	2,682.00	260,958,600
ダントーホールディングス	9,000	139.00	1,251,000
MARUWA	3,900	9,270.00	36,153,000
品川リフラクトリーズ	3,000	3,185.00	9,555,000
黒崎播磨	2,200	5,380.00	11,836,000
ヨータイ	6,800	576.00	3,916,800
イソライト工業	5,800	1,130.00	6,554,000
東京窯業	14,500	402.00	5,829,000
ニッカトー	3,900	921.00	3,591,900
フジミインコーポレーテッド	10,100	2,591.00	26,169,100
エーアンドエーマテリアル	2,500	1,272.00	3,180,000
ニチアス	62,000	1,293.00	80,166,000
新日鐵住金	501,800	2,648.50	1,329,017,300
神戸製鋼所	205,300	1,108.00	227,472,400
中山製鋼所	15,500	727.00	11,268,500
合同製鐵	6,100	2,014.00	12,285,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	302,800	2,520.00	763,056,000
日新製鋼	30,900	1,556.00	48,080,400
東京製鐵	60,100	900.00	54,090,000
共英製鋼	12,600	2,021.00	25,464,600
大和工業	23,800	3,075.00	73,185,000
東京鐵鋼	4,600	1,723.00	7,925,800
大阪製鐵	7,400	2,002.00	14,814,800
淀川製鋼所	16,400	3,120.00	51,168,000
東洋鋼鋳	28,400	626.00	17,778,400
丸一鋼管	39,700	3,250.00	129,025,000
モリ工業	3,700	3,780.00	13,986,000
大同特殊鋼	19,900	5,900.00	117,410,000
日本高周波鋼業	4,200	816.00	3,427,200
日本冶金工業	92,800	328.00	30,438,400
山陽特殊製鋼	12,900	2,510.00	32,379,000
愛知製鋼	6,300	4,730.00	29,799,000
日立金属	120,800	1,432.00	172,985,600
日本金属	2,800	2,911.00	8,150,800
大平洋金属	6,900	3,445.00	23,770,500
新日本電工	67,200	473.00	31,785,600
栗本鐵工所	5,700	2,221.00	12,659,700
虹 技	1,700	2,051.00	3,486,700
日本鑄鉄管	12,000	168.00	2,016,000
日本製鋼所	36,600	3,150.00	115,290,000
三菱製鋼	8,300	2,652.00	22,011,600
日亜鋼業	16,500	349.00	5,758,500
日本精線	1,800	4,730.00	8,514,000
大紀アルミニウム工業所	18,500	797.00	14,744,500
日本輕金属ホールディングス	327,400	294.00	96,255,600
三井金属鉱業	30,300	5,670.00	171,801,000
東邦亜鉛	6,200	6,130.00	38,006,000
三菱マテリアル	74,100	3,755.00	278,245,500
住友金属鉱山	143,300	4,797.00	687,410,100

DOWAホールディングス	28,400	4,250.00	120,700,000
古河機械金属	18,500	2,270.00	41,995,000
エス・サイエンス	53,400	78.00	4,165,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,700	2,795.00	32,701,500
東邦チタニウム	20,100	1,578.00	31,717,800
UACJ	17,000	2,581.00	43,877,000
古河電気工業	37,300	5,580.00	208,134,000
住友電気工業	419,200	1,698.50	712,011,200
フジクラ	135,400	840.00	113,736,000
昭和電線ホールディングス	14,100	960.00	13,536,000
東京特殊電線	1,400	3,020.00	4,228,000
タツタ電線	22,300	736.00	16,412,800
カナレ電気	1,900	2,315.00	4,398,500
平河ヒューテック	5,600	1,139.00	6,378,400
リョービ	13,800	2,917.00	40,254,600
アーレスティ	13,800	841.00	11,605,800
アサヒホールディングス	18,800	2,000.00	37,600,000
東洋製罐グループホールディングス	76,600	1,624.00	124,398,400
ホッカンホールディングス	28,000	423.00	11,844,000
コロナ	6,200	1,337.00	8,289,400
横河ブリッジホールディングス	20,900	2,483.00	51,894,700
OSJBホールディングス	56,300	301.00	16,946,300
駒井ハルテック	2,500	2,511.00	6,277,500
高田機工	1,000	3,980.00	3,980,000
三和ホールディングス	107,500	1,434.00	154,155,000
文化シャッター	33,000	1,030.00	33,990,000
三協立山	15,500	1,499.00	23,234,500
アルインコ	8,200	1,182.00	9,692,400
東洋シャッター	2,900	605.00	1,754,500
LIXILグループ	165,300	2,635.00	435,565,500
日本ファイルコン	8,700	639.00	5,559,300
ノーリツ	25,000	2,052.00	51,300,000
長府製作所	12,600	2,460.00	30,996,000
リンナイ	20,000	9,830.00	196,600,000
ユニプレス	21,900	2,660.00	58,254,000
ダイニチ工業	6,000	849.00	5,094,000
日東精工	15,500	590.00	9,145,000
三洋工業	1,400	2,058.00	2,881,200
岡部	22,700	1,067.00	24,220,900
ジーテクト	12,400	2,086.00	25,866,400
中国工業	1,700	801.00	1,361,700
東プレ	20,900	3,135.00	65,521,500
高周波熱錬	21,600	1,071.00	23,133,600
東京製綱	8,100	1,774.00	14,369,400
サンコール	6,300	756.00	4,762,800
モリテックスチール	6,600	948.00	6,256,800
パイオラックス	16,600	3,035.00	50,381,000
エイチワン	8,300	1,395.00	11,578,500
日本発条	111,700	1,077.00	120,300,900
中央発条	1,300	3,615.00	4,699,500

アドバネクス	1,800	3,950.00	7,110,000
三浦工業	48,500	2,939.00	142,541,500
タクマ	38,000	1,364.00	51,832,000
テクノプロ・ホールディングス	19,300	5,990.00	115,607,000
アトラ	1,900	830.00	1,577,000
インターワークス	2,400	1,083.00	2,599,200
Keeper 技研	3,500	1,254.00	4,389,000
ファーストロジック	1,700	878.00	1,492,600
三機サービス	1,200	1,787.00	2,144,400
Gunosy	4,900	2,569.00	12,588,100
デザインワン・ジャパン	2,100	1,244.00	2,612,400
イー・ガーディアン	5,500	3,055.00	16,802,500
リブセンス	7,100	506.00	3,592,600
ジャパンマテリアル	9,900	4,100.00	40,590,000
ベクトル	13,000	2,293.00	29,809,000
ウチヤマホールディングス	5,400	548.00	2,959,200
ライクキッズネクスト	1,100	1,902.00	2,092,200
キャリアリンク	3,100	560.00	1,736,000
I B J	8,600	961.00	8,264,600
アサンテ	3,900	1,789.00	6,977,100
N・フィールド	6,100	1,531.00	9,339,100
バリューHR	2,500	2,132.00	5,330,000
M&Aキャピタルパートナーズ	2,200	7,910.00	17,402,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,400	1,035.00	4,554,000
E R Iホールディングス	3,100	925.00	2,867,500
アビスト	1,500	4,795.00	7,192,500
シグマクシス	4,300	1,623.00	6,978,900
ウィルグループ	4,700	1,863.00	8,756,100
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,900	442.00	6,585,800
日本ビューホテル	2,400	1,466.00	3,518,400
リクルートホールディングス	835,900	2,473.00	2,067,180,700
エラン	2,700	1,428.00	3,855,600
ツガミ	30,000	1,554.00	46,620,000
オークマ	13,100	6,780.00	88,818,000
東芝機械	63,000	804.00	50,652,000
アマダホールディングス	173,000	1,491.00	257,943,000
アイダエンジニアリング	28,500	1,444.00	41,154,000
滝澤鉄工所	3,500	2,162.00	7,567,000
富士機械製造	33,600	2,103.00	70,660,800
牧野フライス製作所	56,000	1,118.00	62,608,000
オーエスジー	51,700	2,469.00	127,647,300
ダイジェット工業	1,400	2,100.00	2,940,000
旭ダイヤモンド工業	33,300	1,183.00	39,393,900
D M G森精機	62,100	2,214.00	137,489,400
ソディック	24,400	1,376.00	33,574,400
ディスコ	15,200	23,170.00	352,184,000
日東工器	6,900	2,874.00	19,830,600
日進工具	3,000	3,480.00	10,440,000
パンチ工業	9,400	1,262.00	11,862,800

富士ダイス	4,300	1,086.00	4,669,800
土木管理総合試験所	3,300	596.00	1,966,800
日本郵政	614,800	1,280.00	786,944,000
ベルシステム24ホールディングス	18,200	1,515.00	27,573,000
鎌倉新書	1,500	2,261.00	3,391,500
一蔵	1,400	1,063.00	1,488,200
LITALICO	1,900	2,101.00	3,991,900
グローバルグループ	1,200	1,486.00	1,783,200
エポラブルアジア	2,200	2,160.00	4,752,000
ストライク	1,000	5,800.00	5,800,000
ソラスト	6,500	2,811.00	18,271,500
セラク	1,900	712.00	1,352,800
インソース	1,300	3,290.00	4,277,000
豊田自動織機	91,800	6,930.00	636,174,000
豊和工業	6,200	1,481.00	9,182,200
OKK	4,300	1,180.00	5,074,000
石川製作所	2,900	2,865.00	8,308,500
東洋機械金属	8,800	960.00	8,448,000
津田駒工業	27,000	262.00	7,074,000
エンシュウ	29,000	188.00	5,452,000
島精機製作所	14,200	6,620.00	94,004,000
オプトラ	8,200	3,440.00	28,208,000
NCホールディングス	3,600	766.00	2,757,600
フリー	8,000	1,051.00	8,408,000
ヤマシンフィルタ	15,300	1,186.00	18,145,800
日阪製作所	16,100	1,074.00	17,291,400
やまびこ	21,700	1,640.00	35,588,000
平田機工	3,100	10,530.00	32,643,000
ペガサスマシン製造	10,500	705.00	7,402,500
ナブテスコ	61,700	4,715.00	290,915,500
三井海洋開発	11,900	2,848.00	33,891,200
レオン自動機	10,000	2,028.00	20,280,000
SMC	35,600	49,650.00	1,767,540,000
新川	9,200	1,305.00	12,006,000
ホソカワミクロン	4,200	7,210.00	30,282,000
ユニオンツール	5,100	3,910.00	19,941,000
オイレス工業	14,500	2,148.00	31,146,000
日精エー・エス・ビー機械	3,800	6,480.00	24,624,000
サトーホールディングス	14,800	3,400.00	50,320,000
技研製作所	5,700	2,789.00	15,897,300
日本エアーテック	3,900	935.00	3,646,500
日精樹脂工業	9,400	1,590.00	14,946,000
オカダアイヨン	3,300	1,894.00	6,250,200
ワイエイシイホールディングス	3,800	996.00	3,784,800
小松製作所	547,500	4,057.00	2,221,207,500
住友重機械工業	64,900	4,520.00	293,348,000
日立建機	53,000	4,450.00	235,850,000
日工	3,100	2,388.00	7,402,800
巴工業	4,800	1,942.00	9,321,600
井関農機	11,300	2,530.00	28,589,000

TOWA	8,800	2,008.00	17,670,400
丸山製作所	2,500	1,928.00	4,820,000
北川鉄工所	5,400	2,848.00	15,379,200
シンニッタン	8,700	816.00	7,099,200
ローツェ	5,600	2,400.00	13,440,000
タカキタ	3,600	840.00	3,024,000
クボタ	608,200	2,052.00	1,248,026,400
荏原実業	3,300	1,884.00	6,217,200
東洋エンジニアリング	15,000	1,223.00	18,345,000
三菱化工機	3,900	2,234.00	8,712,600
月島機械	22,500	1,272.00	28,620,000
帝国電機製作所	7,900	1,361.00	10,751,900
東京機械製作所	4,500	552.00	2,484,000
新東工業	26,900	1,276.00	34,324,400
澁谷工業	9,900	4,170.00	41,283,000
アイチコーポレーション	19,600	701.00	13,739,600
小森コーポレーション	28,500	1,400.00	39,900,000
鶴見製作所	9,500	1,871.00	17,774,500
住友精密工業	19,000	392.00	7,448,000
酒井重工業	2,100	4,445.00	9,334,500
荏原製作所	46,600	4,030.00	187,798,000
石井鐵工所	1,800	1,913.00	3,443,400
西島製作所	11,600	1,037.00	12,029,200
北越工業	12,800	1,190.00	15,232,000
千代田化工建設	82,500	954.00	78,705,000
ダイキン工業	154,800	12,220.00	1,891,656,000
オルガノ	4,100	3,370.00	13,817,000
トーヨーカネツ	4,800	3,965.00	19,032,000
栗田工業	61,400	3,245.00	199,243,000
椿本チエイン	67,000	859.00	57,553,000
大同工業	4,300	1,526.00	6,561,800
日機装	39,200	1,184.00	46,412,800
木村化工機	9,600	498.00	4,780,800
新興ブランテック	24,500	993.00	24,328,500
アネスト岩田	19,100	1,172.00	22,385,200
ダイフク	57,700	6,650.00	383,705,000
サムコ	3,100	1,221.00	3,785,100
加藤製作所	5,400	3,180.00	17,172,000
油研工業	2,200	2,758.00	6,067,600
タダノ	54,700	1,738.00	95,068,600
フジテック	36,300	1,406.00	51,037,800
CKD	31,500	2,534.00	79,821,000
キトー	8,600	1,636.00	14,069,600
平和	35,100	2,087.00	73,253,700
理想科学工業	11,200	1,943.00	21,761,600
SANKYO	28,400	3,470.00	98,548,000
日本金銭機械	10,500	1,082.00	11,361,000
マースエンジニアリング	7,200	2,362.00	17,006,400
福島工業	7,000	4,570.00	31,990,000
オーイズミ	4,800	505.00	2,424,000

ダイコク電機	5,200	1,700.00	8,840,000
竹内製作所	19,000	2,584.00	49,096,000
アマノ	35,100	2,772.00	97,297,200
J U K I	16,800	1,731.00	29,080,800
サンデンホールディングス	13,800	2,240.00	30,912,000
蛇の目マシン工業	10,300	766.00	7,889,800
ブラザー工業	138,500	2,571.00	356,083,500
マックス	17,400	1,462.00	25,438,800
モリタホールディングス	18,200	1,982.00	36,072,400
グローリー	33,800	4,110.00	138,918,000
新晃工業	11,500	1,940.00	22,310,000
大和冷機工業	18,200	1,328.00	24,169,600
セガサミーホールディングス	112,500	1,479.00	166,387,500
日本ピストンリング	4,100	2,180.00	8,938,000
リケン	5,200	5,990.00	31,148,000
T P R	12,700	3,290.00	41,783,000
ツバキ・ナカシマ	11,400	2,915.00	33,231,000
ホシザキ	35,700	9,880.00	352,716,000
大豊工業	9,200	1,548.00	14,241,600
日本精工	232,900	1,643.00	382,654,700
N T N	262,400	492.00	129,100,800
ジェイテクト	120,800	1,740.00	210,192,000
不二越	105,000	690.00	72,450,000
ミネベアミツミ	210,500	2,290.00	482,045,000
日本トムソン	36,300	769.00	27,914,700
T H K	70,700	4,185.00	295,879,500
ユーシン精機	5,000	3,615.00	18,075,000
前澤給装工業	4,400	1,806.00	7,946,400
イーグル工業	14,000	1,981.00	27,734,000
前澤工業	7,800	404.00	3,151,200
日本ピラー工業	11,500	1,875.00	21,562,500
キッツ	50,500	861.00	43,480,500
日立製作所	2,723,000	812.50	2,212,437,500
三菱電機	1,133,900	1,865.00	2,114,723,500
富士電機	342,000	805.00	275,310,000
東洋電機製造	4,500	1,670.00	7,515,000
安川電機	131,400	5,040.00	662,256,000
シンフォニアテクノロジー	73,000	367.00	26,791,000
明電舎	96,000	401.00	38,496,000
オリジン電気	3,300	1,614.00	5,326,200
山洋電気	5,500	7,870.00	43,285,000
デンヨー	10,500	1,678.00	17,619,000
キャリアインデックス	1,100	1,966.00	2,162,600
M S - J a p a n	800	6,040.00	4,832,000
三櫻工業	14,400	793.00	11,419,200
マキタ	147,900	5,010.00	740,979,000
東芝テック	81,000	627.00	50,787,000
芝浦メカトロニクス	17,000	416.00	7,072,000
マブチモーター	31,600	5,870.00	185,492,000
日本電産	136,500	16,215.00	2,213,347,500

ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4,100	2,893.00	11,861,300
東光高岳	5,700	1,602.00	9,131,400
ダブル・スコープ	16,500	1,910.00	31,515,000
宮越ホールディングス	4,300	640.00	2,752,000
ダイヘン	62,000	836.00	51,832,000
田淵電機	15,800	286.00	4,518,800
ヤーマン	16,400	1,613.00	26,453,200
JVCケンウッド	83,300	356.00	29,654,800
ミマキエンジニアリング	10,200	1,010.00	10,302,000
第一精工	5,300	2,734.00	14,490,200
日新電機	26,600	1,075.00	28,595,000
大崎電気工業	24,300	825.00	20,047,500
オムロン	120,500	6,430.00	774,815,000
日東工業	18,200	1,821.00	33,142,200
I D E C	14,000	2,809.00	39,326,000
不二電機工業	1,300	1,320.00	1,716,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	204,000	571.00	116,484,000
サクサホールディングス	2,900	1,923.00	5,576,700
メルコホールディングス	5,500	3,550.00	19,525,000
テクノメディカ	2,700	1,900.00	5,130,000
日本電気	146,700	3,175.00	465,772,500
富士通	1,166,000	644.60	751,603,600
沖電気工業	46,000	1,461.00	67,206,000
岩崎通信機	5,000	807.00	4,035,000
電気興業	6,400	2,760.00	17,664,000
サンケン電気	66,000	848.00	55,968,000
ナカヨ	2,200	2,099.00	4,617,800
アイホン	6,400	1,731.00	11,078,400
ルネサスエレクトロニクス	58,700	1,198.00	70,322,600
セイコーエプソン	168,800	2,186.00	368,996,800
ワコム	88,000	535.00	47,080,000
アルバック	26,100	6,450.00	168,345,000
アクセル	4,700	803.00	3,774,100
E I Z O	10,400	4,990.00	51,896,000
ジャパンディスプレイ	233,000	217.00	50,561,000
日本信号	31,300	1,075.00	33,647,500
京三製作所	27,000	672.00	18,144,000
能美防災	15,000	2,207.00	33,105,000
ホーチキ	8,200	2,095.00	17,179,000
エレコム	9,800	2,302.00	22,559,600
パナソニック	1,295,400	1,599.50	2,071,992,300
シャープ	79,000	3,630.00	286,770,000
アンリツ	82,700	1,244.00	102,878,800
富士通ゼネラル	34,600	2,079.00	71,933,400
ソニー	757,500	5,417.00	4,103,377,500
T D K	59,300	9,260.00	549,118,000
帝国通信工業	5,000	1,318.00	6,590,000
タムラ製作所	43,700	791.00	34,566,700
アルプス電気	97,700	2,844.00	277,858,800
池上通信機	36,000	161.00	5,796,000

パイオニア	189,000	220.00	41,580,000
日本電波工業	10,300	697.00	7,179,100
鈴木	4,500	1,063.00	4,783,500
日本トリム	2,400	5,680.00	13,632,000
ローランド ディー.ジー.	5,800	2,879.00	16,698,200
フォスター電機	13,300	2,911.00	38,716,300
クラリオン	60,000	356.00	21,360,000
SMK	29,000	454.00	13,166,000
ヨコオ	7,400	1,914.00	14,163,600
ティアック	84,000	45.00	3,780,000
ホシデン	28,600	1,505.00	43,043,000
ヒロセ電機	18,300	15,350.00	280,905,000
日本航空電子工業	29,000	1,628.00	47,212,000
TOA	12,200	1,525.00	18,605,000
マクセルホールディングス	22,500	2,147.00	48,307,500
古野電気	13,500	744.00	10,044,000
ユニデンホールディングス	31,000	303.00	9,393,000
アルパイン	27,000	2,257.00	60,939,000
スミダコーポレーション	11,600	1,803.00	20,914,800
アイコム	6,300	2,562.00	16,140,600
リオン	4,800	2,721.00	13,060,800
本多通信工業	8,800	1,172.00	10,313,600
船井電機	11,500	796.00	9,154,000
横河電機	113,500	2,173.00	246,635,500
新電元工業	4,000	8,950.00	35,800,000
アズビル	34,000	4,655.00	158,270,000
東亜ディーケーケー	5,600	1,074.00	6,014,400
日本光電工業	47,400	2,906.00	137,744,400
チノー	3,900	1,526.00	5,951,400
共和電業	13,000	415.00	5,395,000
日本電子材料	4,500	568.00	2,556,000
堀場製作所	22,500	6,770.00	152,325,000
アドバンテスト	63,200	2,123.00	134,173,600
小野測器	4,800	790.00	3,792,000
エスベック	10,100	2,572.00	25,977,200
キーエンス	55,700	64,080.00	3,569,256,000
日置電機	5,900	3,375.00	19,912,500
シスメックス	88,200	8,410.00	741,762,000
日本マイクロニクス	19,700	1,155.00	22,753,500
メガチップス	8,900	3,530.00	31,417,000
OBARA GROUP	6,600	6,840.00	45,144,000
イマジカ・ロボットホールディングス	9,400	1,209.00	11,364,600
澤藤電機	1,200	2,088.00	2,505,600
デンソー	251,600	6,461.00	1,625,587,600
コーセル	15,700	1,639.00	25,732,300
イリソ電子工業	9,500	6,730.00	63,935,000
新日本無線	6,900	839.00	5,789,100
オブテックスグループ	9,200	6,470.00	59,524,000
千代田インテグレ	5,500	2,329.00	12,809,500

アイ・オー・データ機器	4,700	1,026.00	4,822,200
レーザーテック	23,200	3,790.00	87,928,000
スタンレー電気	86,700	4,115.00	356,770,500
岩崎電気	4,400	1,610.00	7,084,000
ウシオ電機	68,800	1,487.00	102,305,600
岡谷電機産業	6,100	642.00	3,916,200
ヘリオス テクノ ホールディング	9,700	967.00	9,379,900
日本セラミック	11,500	2,847.00	32,740,500
遠藤照明	5,800	1,094.00	6,345,200
古河電池	8,100	1,043.00	8,448,300
双信電機	5,000	657.00	3,285,000
山一電機	8,200	1,859.00	15,243,800
図研	7,400	1,774.00	13,127,600
日本電子	41,000	625.00	25,625,000
カシオ計算機	91,200	1,488.00	135,705,600
ファナック	107,800	27,150.00	2,926,770,000
日本シイエムケイ	20,000	972.00	19,440,000
エンプラス	5,100	3,745.00	19,099,500
大真空	4,200	1,527.00	6,413,400
ローム	50,900	10,950.00	557,355,000
浜松ホトニクス	82,600	4,135.00	341,551,000
三井ハイテック	15,000	1,885.00	28,275,000
新光電気工業	42,800	859.00	36,765,200
京セラ	186,100	6,293.00	1,171,127,300
協栄産業	1,400	1,970.00	2,758,000
太陽誘電	50,900	1,742.00	88,667,800
村田製作所	119,000	15,225.00	1,811,775,000
ユーシン	17,100	698.00	11,935,800
双葉電子工業	18,500	2,259.00	41,791,500
日東電工	85,600	8,645.00	740,012,000
北陸電気工業	4,600	1,700.00	7,820,000
東海理化電機製作所	29,800	2,257.00	67,258,600
ニチコン	35,700	1,330.00	47,481,000
日本ケミコン	9,200	2,901.00	26,689,200
K O A	15,700	2,371.00	37,224,700
三井造船	41,000	1,818.00	74,538,000
日立造船	89,900	553.00	49,714,700
三菱重工業	190,000	4,159.00	790,210,000
川崎重工業	88,200	4,150.00	366,030,000
I H I	87,100	3,565.00	310,511,500
名村造船所	34,000	626.00	21,284,000
サノヤスホールディングス	13,800	249.00	3,436,200
日本車輛製造	41,000	294.00	12,054,000
三菱ロジスネクスト	13,500	914.00	12,339,000
近畿車輛	1,700	2,847.00	4,839,900
F P G	39,100	1,358.00	53,097,800
島根銀行	2,400	1,388.00	3,331,200
じもとホールディングス	75,700	181.00	13,701,700
全国保証	31,500	4,690.00	147,735,000
めぶきフィナンシャルグループ	581,100	470.00	273,117,000

東京ＴＹフィナンシャルグループ	15,100	2,817.00	42,536,700	
九州フィナンシャルグループ	183,400	624.00	114,441,600	
かんぽ生命保険	42,200	2,799.00	118,117,800	
ゆうちょ銀行	316,800	1,450.00	459,360,000	
富山第一銀行	28,500	506.00	14,421,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	680,000	630.00	428,400,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	75,800	1,363.00	103,315,400	
マーキュリアインベストメント	2,300	1,239.00	2,849,700	
アルヒ	9,600	1,333.00	12,796,800	
日産自動車	1,337,300	1,152.00	1,540,569,600	
いすゞ自動車	328,600	1,764.00	579,650,400	
トヨタ自動車	1,378,500	7,372.00	10,162,302,000	*
日野自動車	161,800	1,469.00	237,684,200	
三菱自動車工業	419,700	838.00	351,708,600	
エフテック	7,300	1,477.00	10,782,100	
レシップホールディングス	4,100	887.00	3,636,700	
GMB	1,900	1,783.00	3,387,700	
ファルテック	2,000	1,430.00	2,860,000	
武蔵精密工業	12,100	3,405.00	41,200,500	
日産車体	44,300	1,113.00	49,305,900	
新明和工業	49,300	897.00	44,222,100	
極東開発工業	21,100	1,716.00	36,207,600	
日信工業	23,000	1,969.00	45,287,000	
トピー工業	9,300	3,430.00	31,899,000	
ティラド	4,100	4,040.00	16,564,000	
曙ブレーキ工業	52,700	311.00	16,389,700	
タチエス	19,200	1,860.00	35,712,000	
NOK	60,900	2,323.00	141,470,700	
フタバ産業	34,700	1,006.00	34,908,200	
KYB	11,800	5,880.00	69,384,000	
市光工業	17,000	949.00	16,133,000	
大同メタル工業	14,300	1,086.00	15,529,800	
プレス工業	60,200	664.00	39,972,800	
ミクニ	14,400	700.00	10,080,000	
太平洋工業	23,700	1,491.00	35,336,700	
ケーヒン	26,000	2,343.00	60,918,000	
河西工業	13,900	1,475.00	20,502,500	
アイシン精機	93,400	6,310.00	589,354,000	
マツダ	355,900	1,514.50	539,010,550	
今仙電機製作所	10,500	1,222.00	12,831,000	
本田技研工業	1,020,400	3,840.00	3,918,336,000	
スズキ	224,700	6,024.00	1,353,592,800	
SUBARU	352,000	3,615.00	1,272,480,000	
安永	5,500	2,455.00	13,502,500	
ヤマハ発動機	160,100	3,455.00	553,145,500	
ショーワ	29,400	1,475.00	43,365,000	
小糸製作所	67,900	7,480.00	507,892,000	
TBK	13,500	525.00	7,087,500	

エクセディ	13,700	3,460.00	47,402,000
ミツバ	20,900	1,378.00	28,800,200
豊田合成	41,200	2,525.00	104,030,000
愛三工業	19,900	1,355.00	26,964,500
盟和産業	1,700	1,350.00	2,295,000
日本プラスト	4,600	933.00	4,291,800
ヨロズ	11,500	2,215.00	25,472,500
エフ・シー・シー	18,500	3,015.00	55,777,500
新家工業	2,600	2,502.00	6,505,200
シマノ	45,700	15,580.00	712,006,000
テイ・エス テック	26,300	4,210.00	110,723,000
ジャムコ	5,700	2,314.00	13,189,800
小野建	9,700	2,002.00	19,419,400
はるやまホールディングス	5,200	1,066.00	5,543,200
ノジマ	19,600	2,565.00	50,274,000
佐島電機	8,200	1,036.00	8,495,200
カッパ・クリエイト	13,900	1,238.00	17,208,200
エコートレーディング	2,500	749.00	1,872,500
伯東	6,800	1,709.00	11,621,200
コンドーテック	8,900	972.00	8,650,800
中山福	6,400	756.00	4,838,400
ライトオン	9,400	905.00	8,507,000
ナガイレーベン	14,800	2,813.00	41,632,400
ジーンズメイト	3,400	889.00	3,022,600
三菱食品	12,300	3,140.00	38,622,000
良品計画	14,800	34,150.00	505,420,000
三城ホールディングス	13,800	538.00	7,424,400
松田産業	8,100	1,843.00	14,928,300
第一興商	16,600	5,700.00	94,620,000
メディバルホールディングス	111,900	2,049.00	229,283,100
アドヴァン	11,400	1,035.00	11,799,000
S P K	2,400	2,978.00	7,147,200
萩原電気	3,800	3,445.00	13,091,000
アルビス	2,500	3,460.00	8,650,000
アズワン	8,700	6,800.00	59,160,000
スズデン	3,900	1,684.00	6,567,600
尾家産業	3,300	1,263.00	4,167,900
シモジマ	6,800	1,119.00	7,609,200
ドウシシャ	11,800	2,488.00	29,358,400
小津産業	2,500	2,158.00	5,395,000
コナカ	14,300	597.00	8,537,100
高速	6,600	1,203.00	7,939,800
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,761.00	2,465,400
G - 7ホールディングス	3,300	2,419.00	7,982,700
たけびし	3,900	1,785.00	6,961,500
イオン北海道	11,200	821.00	9,195,200
コジマ	19,300	332.00	6,407,600
ヒマラヤ	3,100	1,186.00	3,676,600
コーナン商事	15,900	2,611.00	41,514,900
ネットワンシステムズ	45,400	1,658.00	75,273,200

エコス	4,500	1,251.00	5,629,500
ワタミ	13,200	1,594.00	21,040,800
マルシェ	3,000	804.00	2,412,000
リックス	2,500	1,790.00	4,475,000
システムソフト	26,500	137.00	3,630,500
ドンキホーテホールディングス	72,400	5,670.00	410,508,000
丸文	9,900	1,080.00	10,692,000
西松屋チェーン	24,500	1,253.00	30,698,500
ゼンショーホールディングス	57,900	1,945.00	112,615,500
ハピネット	7,600	1,788.00	13,588,800
幸楽苑ホールディングス	7,100	1,805.00	12,815,500
ハークスレイ	2,700	1,114.00	3,007,800
橋本総業ホールディングス	2,300	1,812.00	4,167,600
日本ライフライン	31,800	3,110.00	98,898,000
サイゼリヤ	16,600	3,135.00	52,041,000
エクセル	4,500	2,432.00	10,944,000
V Tホールディングス	37,800	553.00	20,903,400
マルカキカイ	3,600	2,180.00	7,848,000
アルゴグラフィックス	5,100	3,325.00	16,957,500
魚力	3,100	1,163.00	3,605,300
I D O M	33,900	695.00	23,560,500
日本エム・ディ・エム	7,500	964.00	7,230,000
ポプラ	3,000	855.00	2,565,000
フジ・コーポレーション	1,900	2,458.00	4,670,200
ユナイテッドアローズ	13,800	4,210.00	58,098,000
進和	6,600	2,356.00	15,549,600
エスケイジャパン	2,400	593.00	1,423,200
ダイトロン	5,100	2,133.00	10,878,300
ハイデイ日高	12,200	3,325.00	40,565,000
シークス	7,100	4,575.00	32,482,500
京都きもの友禅	7,300	760.00	5,548,000
コロワイド	37,100	2,122.00	78,726,200
ピーシーデポコーポレーション	16,700	728.00	12,157,600
田中商事	3,500	813.00	2,845,500
オーハシテクニカ	6,300	1,768.00	11,138,400
壱番屋	7,900	4,430.00	34,997,000
白銅	4,000	2,392.00	9,568,000
トップカルチャー	4,100	481.00	1,972,100
P L A N T	2,600	1,297.00	3,372,200
スギホールディングス	24,500	5,670.00	138,915,000
島津製作所	135,500	2,688.00	364,224,000
J M S	10,500	594.00	6,237,000
クボテック	2,500	556.00	1,390,000
長野計器	8,900	1,144.00	10,181,600
ブイ・テクノロジー	2,700	19,760.00	53,352,000
スター精密	18,200	2,105.00	38,311,000
東京計器	7,200	1,262.00	9,086,400
愛知時計電機	1,500	4,380.00	6,570,000
インターアクション	4,400	896.00	3,942,400
オーバル	11,200	285.00	3,192,000

東京精密	20,500	4,310.00	88,355,000
マニー	13,800	3,735.00	51,543,000
ニコン	197,600	2,009.00	396,978,400
トプコン	60,900	2,393.00	145,733,700
オリンパス	168,900	4,085.00	689,956,500
理研計器	10,800	2,167.00	23,403,600
S C R E E Nホールディングス	21,500	8,400.00	180,600,000
キヤノン電子	10,400	2,667.00	27,736,800
タムロン	9,100	2,241.00	20,393,100
H O Y A	230,900	5,420.00	1,251,478,000
シード	1,200	5,640.00	6,768,000
ノーリツ鋼機	11,500	2,429.00	27,933,500
エー・アンド・デイ	10,400	719.00	7,477,600
キヤノン	610,400	4,058.00	2,477,003,200
リコー	340,900	1,096.00	373,626,400
シチズン時計	135,300	766.00	103,639,800
リズム時計工業	4,300	2,170.00	9,331,000
大研医器	10,100	744.00	7,514,400
メニコン	15,600	3,045.00	47,502,000
中本ボックス	1,100	4,445.00	4,889,500
スノーピーク	3,500	1,412.00	4,942,000
パラマウントベッドホールディングス	12,000	5,180.00	62,160,000
トランザクション	5,100	998.00	5,089,800
S H O B I	3,900	406.00	1,583,400
ニホンフラッシュ	5,300	2,310.00	12,243,000
前田工織	11,400	1,962.00	22,366,800
永大産業	15,000	539.00	8,085,000
アートネイチャー	12,100	732.00	8,857,200
バンダイナムコホールディングス	117,200	3,335.00	390,862,000
アイフィスジャパン	2,400	642.00	1,540,800
共立印刷	18,900	360.00	6,804,000
S H O E I	5,100	4,435.00	22,618,500
フランスベッドホールディングス	13,400	1,006.00	13,480,400
マーベラス	18,900	915.00	17,293,500
パイロットコーポレーション	19,800	5,060.00	100,188,000
萩原工業	6,300	1,825.00	11,497,500
エイベックス	20,600	1,550.00	31,930,000
トッパン・フォームズ	24,300	1,213.00	29,475,900
フジシールインターナショナル	25,400	3,640.00	92,456,000
タカラトミー	47,500	1,506.00	71,535,000
廣済堂	10,600	446.00	4,727,600
A s - m e エステール	3,400	861.00	2,927,400
アーク	47,900	121.00	5,795,900
レック	6,700	3,040.00	20,368,000
タカノ	5,000	962.00	4,810,000
プロネクサス	10,600	1,343.00	14,235,800
ホクシン	8,200	191.00	1,566,200
ウッドワン	3,800	1,543.00	5,863,400
大建工業	8,800	2,664.00	23,443,200
きもと	19,400	399.00	7,740,600

凸版印刷	320,000	953.00	304,960,000
大日本印刷	148,400	2,284.00	338,945,600
図書印刷	7,600	919.00	6,984,400
共同印刷	3,500	3,230.00	11,305,000
N I S S H A	23,300	2,636.00	61,418,800
光村印刷	1,000	2,342.00	2,342,000
藤森工業	9,500	3,780.00	35,910,000
ヴィア・ホールディングス	9,800	709.00	6,948,200
宝印刷	5,900	1,732.00	10,218,800
前澤化成工業	7,800	1,170.00	9,126,000
アシックス	112,600	1,728.00	194,572,800
ツツミ	3,500	2,033.00	7,115,500
J S P	6,600	3,145.00	20,757,000
ニチハ	17,100	4,030.00	68,913,000
エフピコ	9,300	5,970.00	55,521,000
小松ウオール工業	3,800	2,334.00	8,869,200
ヤマハ	76,400	4,280.00	326,992,000
河合楽器製作所	3,800	3,120.00	11,856,000
クリナップ	10,500	849.00	8,914,500
ピジョン	68,500	4,190.00	287,015,000
天馬	8,800	2,204.00	19,395,200
兼松サステック	900	2,031.00	1,827,900
キングジム	9,400	975.00	9,165,000
リンテック	26,900	2,964.00	79,731,600
信越ポリマー	23,300	1,248.00	29,078,400
東リ	28,200	378.00	10,659,600
イトーキ	23,900	714.00	17,064,600
任天堂	69,800	44,910.00	3,134,718,000
三菱鉛筆	18,700	2,273.00	42,505,100
松風	5,600	1,378.00	7,716,800
タカラスタндарт	23,400	1,771.00	41,441,400
コクヨ	54,400	1,894.00	103,033,600
ナカバヤシ	11,100	670.00	7,437,000
ニフコ	20,800	7,500.00	156,000,000
立川ブラインド工業	5,000	1,328.00	6,640,000
グローブライド	5,100	2,260.00	11,526,000
岡村製作所	39,600	1,376.00	54,489,600
日本バルカー工業	9,200	3,085.00	28,382,000
M U T O Hホールディングス	1,600	2,371.00	3,793,600
伊藤忠商事	819,600	2,070.00	1,696,572,000
丸紅	917,800	785.40	720,840,120
スクロール	17,400	415.00	7,221,000
高島	1,900	2,238.00	4,252,200
ヨンドシーホールディングス	11,400	2,802.00	31,942,800
三陽商会	6,200	2,036.00	12,623,200
長瀬産業	67,300	1,880.00	126,524,000
ナイガイ	4,400	539.00	2,371,600
蝶理	7,100	1,889.00	13,411,900
豊田通商	124,600	4,120.00	513,352,000
オンワードホールディングス	70,900	937.00	66,433,300

三共生興	18,900	486.00	9,185,400
兼松	47,600	1,384.00	65,878,400
美津濃	11,200	3,080.00	34,496,000
ツカモトコーポレーション	2,000	1,251.00	2,502,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	35,700	7,180.00	256,326,000
ルックホールディングス	20,000	353.00	7,060,000
三井物産	948,700	1,904.00	1,806,324,800
日本紙パルプ商事	5,800	4,310.00	24,998,000
東京エレクトロン	75,600	18,760.00	1,418,256,000
日立ハイテクノロジーズ	38,800	4,815.00	186,822,000
カメイ	14,500	1,668.00	24,186,000
東都水産	1,700	1,924.00	3,270,800
OUGホールディングス	1,800	2,568.00	4,622,400
スターゼン	4,400	4,940.00	21,736,000
セイコーホールディングス	17,500	2,946.00	51,555,000
山善	43,600	1,238.00	53,976,800
椿本興業	2,500	3,120.00	7,800,000
住友商事	704,400	1,802.50	1,269,681,000
日本ユニシス	30,900	2,155.00	66,589,500
内田洋行	5,100	3,345.00	17,059,500
三菱商事	783,700	2,960.00	2,319,752,000
第一実業	5,100	3,255.00	16,600,500
キヤノンマーケティングジャパン	31,900	2,828.00	90,213,200
西華産業	6,900	2,723.00	18,788,700
佐藤商事	10,000	1,131.00	11,310,000
菱洋エレクトロ	10,400	1,749.00	18,189,600
東京産業	11,100	590.00	6,549,000
ユアサ商事	10,600	3,685.00	39,061,000
神鋼商事	2,500	3,675.00	9,187,500
小林産業	7,600	350.00	2,660,000
阪和興業	20,900	5,000.00	104,500,000
正栄食品工業	6,200	3,880.00	24,056,000
カナデン	10,700	1,341.00	14,348,700
菱電商事	8,000	1,810.00	14,480,000
ニプロ	78,500	1,566.00	122,931,000
フルサト工業	6,100	1,740.00	10,614,000
岩谷産業	24,800	3,695.00	91,636,000
すてきナイスグループ	4,800	1,449.00	6,955,200
昭光通商	40,000	123.00	4,920,000
ニチモウ	1,700	1,897.00	3,224,900
極東貿易	16,000	479.00	7,664,000
イワキ	16,000	417.00	6,672,000
兼松エレクトロニクス	7,100	3,040.00	21,584,000
三愛石油	30,000	1,529.00	45,870,000
稲畑産業	26,800	1,571.00	42,102,800
G S Iクレオス	3,000	1,779.00	5,337,000
明和産業	10,400	487.00	5,064,800
キムラタン	55,500	45.00	2,497,500
ゴールドウイン	3,400	12,540.00	42,636,000

ユニ・チャーム	240,400	2,873.50	690,789,400
デサント	27,100	1,614.00	43,739,400
キング	5,800	664.00	3,851,200
ワキタ	23,800	1,279.00	30,440,200
ヤマトインターナショナル	8,100	463.00	3,750,300
東邦ホールディングス	33,100	2,441.00	80,797,100
サンゲツ	37,700	2,188.00	82,487,600
ミツウロコグループホールディングス	16,200	763.00	12,360,600
シナネンホールディングス	5,300	2,531.00	13,414,300
伊藤忠エネクス	24,700	1,004.00	24,798,800
サンリオ	31,400	1,822.00	57,210,800
サンワテクノス	6,600	2,143.00	14,143,800
リョーサン	14,000	3,965.00	55,510,000
新光商事	12,300	1,909.00	23,480,700
トーヨー	5,000	2,417.00	12,085,000
三信電気	10,300	1,869.00	19,250,700
東陽テクニカ	12,900	952.00	12,280,800
モスフードサービス	14,600	3,290.00	48,034,000
加賀電子	10,100	2,774.00	28,017,400
三益半導体工業	8,700	2,009.00	17,478,300
ソーダニッカ	11,600	613.00	7,110,800
立花エレテック	7,600	2,086.00	15,853,600
木曽路	13,700	2,696.00	36,935,200
S R Sホールディングス	13,200	945.00	12,474,000
千趣会	20,200	595.00	12,019,000
タカキュー	9,000	221.00	1,989,000
ケーヨー	20,700	633.00	13,103,100
上新電機	13,200	3,140.00	41,448,000
日本瓦斯	20,500	4,405.00	90,302,500
ロイヤルホールディングス	19,800	2,917.00	57,756,600
東天紅	800	1,949.00	1,559,200
いなげや	12,400	1,777.00	22,034,800
島忠	27,000	3,425.00	92,475,000
チヨダ	13,200	2,690.00	35,508,000
ライフコーポレーション	8,500	2,769.00	23,536,500
リンガーハット	13,800	2,368.00	32,678,400
さが美グループホールディングス	10,000	116.00	1,160,000
MrMaxHD	14,000	710.00	9,940,000
テンアライド	10,600	460.00	4,876,000
AOKIホールディングス	22,300	1,678.00	37,419,400
オークワ	16,000	1,079.00	17,264,000
コメリ	17,200	3,030.00	52,116,000
青山商事	21,400	4,205.00	89,987,000
しまむら	13,000	12,320.00	160,160,000
はせがわ	5,900	498.00	2,938,200
高島屋	175,000	1,106.00	193,550,000
松屋	22,500	1,498.00	33,705,000
エイチ・ツー・オーリテイリング	52,900	2,088.00	110,455,200
近鉄百貨店	4,300	3,850.00	16,555,000
パルコ	10,700	1,497.00	16,017,900

丸井グループ	107,000	1,912.00	204,584,000
クレディセゾン	84,900	1,847.00	156,810,300
アクシアル リテイリング	9,300	4,095.00	38,083,500
井筒屋	6,300	401.00	2,526,300
イオン	429,700	1,822.50	783,128,250
イズミ	20,200	6,940.00	140,188,000
東武ストア	1,300	3,030.00	3,939,000
フォーバル	4,900	880.00	4,312,000
平和堂	22,700	2,317.00	52,595,900
フジ	13,100	2,202.00	28,846,200
ヤオコー	12,700	5,100.00	64,770,000
ゼビオホールディングス	15,200	2,251.00	34,215,200
ケーズホールディングス	47,300	2,991.00	141,474,300
PALTA C	15,700	5,190.00	81,483,000
三谷産業	12,100	438.00	5,299,800
Olympicグループ	6,600	599.00	3,953,400
日産東京販売ホールディングス	16,400	393.00	6,445,200
新生銀行	96,800	1,694.00	163,979,200
あおぞら銀行	66,600	4,400.00	293,040,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,901,700	792.00	6,258,146,400
りそなホールディングス	1,227,400	630.90	774,366,660
三井住友トラスト・ホールディングス	219,900	4,453.00	979,214,700
三井住友フィナンシャルグループ	846,500	4,802.00	4,064,893,000
第四銀行	13,700	5,050.00	69,185,000
北越銀行	11,200	2,459.00	27,540,800
千葉銀行	401,000	904.00	362,504,000
群馬銀行	227,100	661.00	150,113,100
武蔵野銀行	17,800	3,635.00	64,703,000
千葉興業銀行	30,800	507.00	15,615,600
筑波銀行	46,600	385.00	17,941,000
七十七銀行	35,100	2,792.00	97,999,200
青森銀行	8,700	3,505.00	30,493,500
秋田銀行	7,200	2,975.00	21,420,000
山形銀行	12,600	2,383.00	30,025,800
岩手銀行	7,800	4,330.00	33,774,000
東邦銀行	99,900	389.00	38,861,100
東北銀行	5,800	1,461.00	8,473,800
みちのく銀行	7,200	1,812.00	13,046,400
ふくおかフィナンシャルグループ	454,000	600.00	272,400,000
静岡銀行	295,000	1,124.00	331,580,000
十六銀行	15,000	3,010.00	45,150,000
スルガ銀行	114,400	2,156.00	246,646,400
八十二銀行	202,400	641.00	129,738,400
山梨中央銀行	69,000	446.00	30,774,000
大垣共立銀行	17,700	2,698.00	47,754,600
福井銀行	9,600	2,571.00	24,681,600
北國銀行	12,700	4,395.00	55,816,500
清水銀行	3,800	3,045.00	11,571,000
富山銀行	2,200	3,910.00	8,602,000
滋賀銀行	105,000	568.00	59,640,000

南都銀行	13,100	3,010.00	39,431,000
百五銀行	107,300	542.00	58,156,600
京都銀行	42,700	6,070.00	259,189,000
紀陽銀行	42,000	1,755.00	73,710,000
三重銀行	5,000	2,394.00	11,970,000
ほくほくフィナンシャルグループ	74,400	1,595.00	118,668,000
広島銀行	165,100	874.00	144,297,400
山陰合同銀行	66,300	1,042.00	69,084,600
中国銀行	77,300	1,368.00	105,746,400
鳥取銀行	3,600	1,770.00	6,372,000
伊予銀行	159,600	879.00	140,288,400
百十四銀行	119,000	365.00	43,435,000
四国銀行	17,100	1,578.00	26,983,800
阿波銀行	90,000	678.00	61,020,000
大分銀行	6,400	4,195.00	26,848,000
宮崎銀行	7,400	3,425.00	25,345,000
佐賀銀行	6,800	2,509.00	17,061,200
十八銀行	69,000	290.00	20,010,000
沖縄銀行	10,900	4,455.00	48,559,500
琉球銀行	21,700	1,667.00	36,173,900
セブン銀行	419,500	377.00	158,151,500
みずほフィナンシャルグループ	15,195,200	199.70	3,034,481,440
高知銀行	4,100	1,356.00	5,559,600
山口フィナンシャルグループ	105,000	1,279.00	134,295,000
アクリーティブ	6,300	343.00	2,160,900
芙蓉総合リース	12,800	7,270.00	93,056,000
興銀リース	21,000	2,814.00	59,094,000
東京センチュリー	22,500	5,880.00	132,300,000
SBIホールディングス	126,500	2,180.00	275,770,000
日本証券金融	45,800	646.00	29,586,800
アイフル	187,800	380.00	71,364,000
日本アジア投資	10,100	370.00	3,737,000
長野銀行	3,700	1,894.00	7,007,800
名古屋銀行	9,000	4,060.00	36,540,000
北洋銀行	168,600	379.00	63,899,400
愛知銀行	3,800	5,370.00	20,406,000
第三銀行	6,300	1,706.00	10,747,800
中京銀行	4,600	2,310.00	10,626,000
大光銀行	3,800	2,381.00	9,047,800
愛媛銀行	15,600	1,347.00	21,013,200
トマト銀行	4,300	1,529.00	6,574,700
みなと銀行	10,100	2,068.00	20,886,800
京葉銀行	99,000	511.00	50,589,000
関西アーバン銀行	15,600	1,411.00	22,011,600
栃木銀行	57,900	433.00	25,070,700
北日本銀行	3,500	3,040.00	10,640,000
東和銀行	19,600	1,386.00	27,165,600
福島銀行	10,600	824.00	8,734,400
大東銀行	5,400	1,521.00	8,213,400
リコーリース	8,800	3,675.00	32,340,000

イオンフィナンシャルサービス	79,400	2,603.00	206,678,200
アコム	224,900	455.00	102,329,500
ジャックス	13,600	2,520.00	34,272,000
オリエントコーポレーション	242,100	172.00	41,641,200
日立キャピタル	30,800	2,894.00	89,135,200
アプラスフィナンシャル	54,400	104.00	5,657,600
オリックス	746,000	1,908.00	1,423,368,000
三菱UFJリース	283,900	683.00	193,903,700
ジャフコ	16,100	5,510.00	88,711,000
九州リースサービス	4,800	871.00	4,180,800
トモニホールディングス	92,200	521.00	48,036,200
大和証券グループ本社	957,000	741.70	709,806,900
野村ホールディングス	1,924,000	657.00	1,264,068,000
岡三証券グループ	95,000	684.00	64,980,000
丸三証券	35,600	1,006.00	35,813,600
東洋証券	40,000	313.00	12,520,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	123,800	784.00	97,059,200
光世証券	2,700	1,413.00	3,815,100
水戸証券	34,700	395.00	13,706,500
いちよし証券	23,500	1,317.00	30,949,500
松井証券	54,700	1,013.00	55,411,100
SOMPOホールディングス	219,300	4,152.00	910,533,600
だいこう証券ビジネス	5,500	652.00	3,586,000
日本取引所グループ	328,600	1,855.00	609,553,000
マネックスグループ	118,700	352.00	41,782,400
カブドットコム証券	71,600	375.00	26,850,000
極東証券	15,000	1,577.00	23,655,000
岩井コスモホールディングス	11,400	1,367.00	15,583,800
藍澤證券	20,900	740.00	15,466,000
フィデアホールディングス	108,600	190.00	20,634,000
池田泉州ホールディングス	118,600	414.00	49,100,400
アニコムホールディングス	7,600	3,220.00	24,472,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	292,400	3,540.00	1,035,096,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	91,900	2,019.00	185,546,100
マネーパートナーズグループ	14,300	367.00	5,248,100
小林洋行	3,300	280.00	924,000
第一生命ホールディングス	632,700	2,224.50	1,407,441,150
東京海上ホールディングス	421,300	4,966.00	2,092,175,800
アドバンテッジリスクマネジメント	2,700	1,148.00	3,099,600
イー・ギャランティ	3,000	3,710.00	11,130,000
アサックス	1,600	1,877.00	3,003,200
NECキャピタルソリューション	4,600	2,130.00	9,798,000
T&Dホールディングス	345,900	1,898.00	656,518,200
アドバンスクリエイト	2,600	1,920.00	4,992,000
三井不動産	558,500	2,602.50	1,453,496,250
三菱地所	832,500	1,930.00	1,606,725,000
平和不動産	19,800	1,968.00	38,966,400

東京建物	122,200	1,688.00	206,273,600
ダイビル	28,800	1,346.00	38,764,800
京阪神ビルディング	18,600	865.00	16,089,000
住友不動産	268,000	3,869.00	1,036,892,000
太平洋興発	4,700	1,017.00	4,779,900
大京	17,800	2,122.00	37,771,600
テーオーシー	38,600	864.00	33,350,400
東京楽天地	1,800	5,280.00	9,504,000
レオパレス21	133,500	842.00	112,407,000
スターツコーポレーション	15,200	2,826.00	42,955,200
フジ住宅	14,300	815.00	11,654,500
空港施設	11,700	618.00	7,230,600
明和地所	6,200	828.00	5,133,600
ゴールドクレスト	8,800	2,140.00	18,832,000
リログループ	59,300	2,962.00	175,646,600
日本エスリード	4,400	2,130.00	9,372,000
日神不動産	14,900	801.00	11,934,900
日本エスコン	20,100	661.00	13,286,100
タカラレーベン	52,400	462.00	24,208,800
サンヨーハウジング名古屋	5,800	1,203.00	6,977,400
イオンモール	72,100	2,242.00	161,648,200
ファースト住建	4,200	1,666.00	6,997,200
ランド	241,400	16.00	3,862,400
カチタス	11,400	3,060.00	34,884,000
東祥	6,700	3,615.00	24,220,500
トーセイ	13,600	1,292.00	17,571,200
穴吹興産	1,200	3,130.00	3,756,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	69,500	1,265.00	87,917,500
サンフロンティア不動産	12,600	1,173.00	14,779,800
エフ・ジェー・ネクスト	8,600	873.00	7,507,800
インテリックス	3,200	1,105.00	3,536,000
ランドビジネス	6,900	330.00	2,277,000
グランディハウス	9,900	448.00	4,435,200
東武鉄道	121,200	3,460.00	419,352,000
相鉄ホールディングス	36,300	2,933.00	106,467,900
東京急行電鉄	308,000	1,773.00	546,084,000
京浜急行電鉄	155,300	1,993.00	309,512,900
小田急電鉄	168,600	2,284.00	385,082,400
京王電鉄	63,400	4,805.00	304,637,000
京成電鉄	78,900	3,450.00	272,205,000
富士急行	15,500	3,060.00	47,430,000
新京成電鉄	2,900	2,191.00	6,353,900
東日本旅客鉄道	203,700	10,460.00	2,130,702,000
西日本旅客鉄道	102,300	8,000.00	818,400,000
東海旅客鉄道	101,500	20,230.00	2,053,345,000
西武ホールディングス	144,500	2,081.00	300,704,500
鴻池運輸	16,000	1,889.00	30,224,000
西日本鉄道	31,400	2,885.00	90,589,000
ハマキョウレックス	8,000	3,695.00	29,560,000
サカイ引越センター	6,000	4,915.00	29,490,000

近鉄グループホールディングス	107,400	4,185.00	449,469,000
阪急阪神ホールディングス	143,200	4,100.00	587,120,000
南海電気鉄道	50,900	2,771.00	141,043,900
京阪ホールディングス	47,800	3,250.00	155,350,000
神戸電鉄	2,600	3,910.00	10,166,000
名古屋鉄道	83,300	2,747.00	228,825,100
山陽電気鉄道	8,300	2,714.00	22,526,200
トランコム	3,000	7,350.00	22,050,000
日本通運	42,200	7,290.00	307,638,000
ヤマトホールディングス	188,300	2,784.00	524,227,200
山九	27,600	5,140.00	141,864,000
日新	9,300	2,541.00	23,631,300
丸運	6,000	322.00	1,932,000
丸全昭和運輸	38,000	495.00	18,810,000
センコーグループホールディングス	64,600	772.00	49,871,200
トナミホールディングス	2,600	5,130.00	13,338,000
ニッコンホールディングス	40,800	2,806.00	114,484,800
日本石油輸送	1,300	3,160.00	4,108,000
福山通運	15,700	3,995.00	62,721,500
セイノーホールディングス	80,400	1,758.00	141,343,200
神奈川中央交通	2,700	3,640.00	9,828,000
日立物流	23,600	2,705.00	63,838,000
丸和運輸機関	5,700	4,000.00	22,800,000
C & F ロジホールディングス	11,800	1,415.00	16,697,000
日本郵船	89,800	2,489.00	223,512,200
商船三井	67,900	3,575.00	242,742,500
川崎汽船	49,600	2,702.00	134,019,200
N S ユナイテッド海運	5,100	2,309.00	11,775,900
明治海運	11,400	426.00	4,856,400
飯野海運	54,700	556.00	30,413,200
共栄タンカー	800	1,986.00	1,588,800
九州旅客鉄道	90,100	3,300.00	297,330,000
S G ホールディングス	76,100	2,272.00	172,899,200
日本航空	199,200	3,975.00	791,820,000
A N A ホールディングス	210,500	4,215.00	887,257,500
パスコ	10,000	318.00	3,180,000
西本W i s m e t t a c ホールディングス	2,300	4,165.00	9,579,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,519.00	1,367,100
Genky Drug Stores	4,400	3,575.00	15,730,000
三菱倉庫	37,100	2,595.00	96,274,500
三井倉庫ホールディングス	61,000	344.00	20,984,000
住友倉庫	74,000	737.00	54,538,000
澁澤倉庫	5,900	1,823.00	10,755,700
ヤマタネ	5,600	1,945.00	10,892,000
東陽倉庫	19,500	338.00	6,591,000
乾汽船	8,300	816.00	6,772,800
日本トランスシティ	26,000	428.00	11,128,000
ケイヒン	2,100	1,750.00	3,675,000
中央倉庫	6,600	1,068.00	7,048,800

川西倉庫	2,200	1,922.00	4,228,400
安田倉庫	9,700	910.00	8,827,000
東洋埠頭	3,200	1,754.00	5,612,800
宇徳	9,400	481.00	4,521,400
上組	67,600	2,333.00	157,710,800
サンリツ	2,800	819.00	2,293,200
キムラユニティー	2,900	1,142.00	3,311,800
キューソー流通システム	3,100	2,583.00	8,007,300
近鉄エクスプレス	20,300	2,232.00	45,309,600
東海運	6,100	420.00	2,562,000
エーアイティー	7,700	1,205.00	9,278,500
内外トランスライン	3,800	1,742.00	6,619,600
日本コンセプト	2,100	1,439.00	3,021,900
東京放送ホールディングス	67,000	2,542.00	170,314,000
日本テレビホールディングス	102,200	2,029.00	207,363,800
朝日放送	11,000	891.00	9,801,000
テレビ朝日ホールディングス	30,500	2,438.00	74,359,000
スカパーJ S A Tホールディングス	84,900	502.00	42,619,800
テレビ東京ホールディングス	9,100	2,726.00	24,806,600
日本BS放送	3,800	1,371.00	5,209,800
ビジョン	2,900	2,849.00	8,262,100
USEN-NEXT HOLDINGS	2,900	1,085.00	3,146,500
ワイヤレスゲート	5,200	1,266.00	6,583,200
コネクシオ	7,900	2,232.00	17,632,800
日本通信	100,800	111.00	11,188,800
クロップス	2,400	921.00	2,210,400
日本電信電話	798,500	4,991.00	3,985,313,500
KDDI	1,001,900	2,670.50	2,675,573,950
光通信	13,400	15,010.00	201,134,000
NTTドコモ	823,700	2,664.50	2,194,748,650
エムティーアイ	15,000	664.00	9,960,000
GMOインターネット	40,500	1,678.00	67,959,000
アйдママーケティングコミュニケーション	1,800	690.00	1,242,000
カドカワ	32,400	1,317.00	42,670,800
学研ホールディングス	3,700	5,680.00	21,016,000
ゼンリン	13,500	3,395.00	45,832,500
昭文社	5,100	731.00	3,728,100
インプレスホールディングス	9,500	186.00	1,767,000
東京電力ホールディングス	905,100	416.00	376,521,600
中部電力	346,900	1,370.50	475,426,450
関西電力	462,700	1,320.00	610,764,000
中国電力	156,700	1,210.00	189,607,000
北陸電力	111,100	844.00	93,768,400
東北電力	265,500	1,378.00	365,859,000
四国電力	102,100	1,193.00	121,805,300
九州電力	250,400	1,170.00	292,968,000
北海道電力	113,700	665.00	75,610,500
沖縄電力	18,300	2,788.00	51,020,400

電源開発	90,200	2,843.00	256,438,600
エフオン	5,700	1,135.00	6,469,500
イーレックス	17,800	797.00	14,186,600
東京瓦斯	241,900	2,645.50	639,946,450
大阪瓦斯	220,000	2,150.50	473,110,000
東邦瓦斯	56,200	3,200.00	179,840,000
北海道瓦斯	31,000	294.00	9,114,000
広島ガス	23,400	366.00	8,564,400
西部瓦斯	13,800	2,771.00	38,239,800
静岡ガス	32,200	929.00	29,913,800
メタウォーター	6,400	2,923.00	18,707,200
アイネット	6,300	1,599.00	10,073,700
松竹	7,400	15,400.00	113,960,000
東宝	73,200	3,490.00	255,468,000
エイチ・アイ・エス	16,900	3,795.00	64,135,500
東映	4,200	10,610.00	44,562,000
ラックランド	2,100	2,098.00	4,405,800
エヌ・ティ・ティ・データ	345,600	1,164.00	402,278,400
共立メンテナンス	19,300	4,310.00	83,183,000
イチネンホールディングス	12,100	1,523.00	18,428,300
建設技術研究所	7,500	1,177.00	8,827,500
スペース	7,000	1,473.00	10,311,000
長 大	3,300	791.00	2,610,300
アインホールディングス	15,000	6,730.00	100,950,000
燦ホールディングス	2,600	2,759.00	7,173,400
ビー・シー・エー	1,700	1,782.00	3,029,400
スバル興業	800	6,470.00	5,176,000
東京テアトル	4,500	1,435.00	6,457,500
タナベ経営	2,100	1,841.00	3,866,100
ビジネスブレイン太田昭和	1,900	1,749.00	3,323,100
ナガワ	2,200	4,480.00	9,856,000
よみうりランド	2,400	4,725.00	11,340,000
東京都競馬	8,100	4,020.00	32,562,000
常磐興産	4,400	1,830.00	8,052,000
カナモト	16,500	3,285.00	54,202,500
東京ドーム	43,900	991.00	43,504,900
D T S	11,600	3,660.00	42,456,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	51,700	4,375.00	226,187,500
シーイーシー	6,600	3,180.00	20,988,000
カプコン	23,800	3,920.00	93,296,000
西尾レントオール	9,500	3,875.00	36,812,500
アイ・エス・ビー	2,200	1,259.00	2,769,800
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	62,000	37.00	2,294,000
日本空港ビルデング	32,700	4,035.00	131,944,500
トランス・コスモス	12,000	2,735.00	32,820,000
乃村工藝社	25,300	2,257.00	57,102,100
ジャステック	6,500	1,221.00	7,936,500
S C S K	25,700	4,395.00	112,951,500

藤田観光	4,300	3,260.00	14,018,000
KNT-CTホールディングス	6,700	1,649.00	11,048,300
日本管財	11,600	2,067.00	23,977,200
トーカイ	10,500	2,481.00	26,050,500
白洋舎	1,200	3,815.00	4,578,000
セコム	115,000	8,030.00	923,450,000
日本システムウエア	3,700	2,841.00	10,511,700
セントラル警備保障	5,200	2,439.00	12,682,800
アイネス	14,100	1,075.00	15,157,500
丹青社	22,200	1,098.00	24,375,600
メイテック	12,700	6,020.00	76,454,000
TKC	10,400	3,770.00	39,208,000
富士ソフト	15,400	3,650.00	56,210,000
応用地質	12,200	1,346.00	16,421,200
船井総研ホールディングス	22,500	2,247.00	50,557,500
NSD	18,300	2,160.00	39,528,000
進学会ホールディングス	5,000	627.00	3,135,000
丸紅建材リース	11,000	229.00	2,519,000
オオバ	8,600	523.00	4,497,800
コナミホールディングス	45,500	5,490.00	249,795,000
いであ	2,200	1,116.00	2,455,200
学究社	3,000	1,631.00	4,893,000
ベネッセホールディングス	39,700	3,835.00	152,249,500
イオンディライト	13,400	3,735.00	50,049,000
ナック	7,300	1,019.00	7,438,700
福井コンピュータホールディングス	3,200	2,877.00	9,206,400
ニチイ学館	20,600	1,332.00	27,439,200
ダイセキ	18,200	3,140.00	57,148,000
ステップ	4,000	1,787.00	7,148,000
日鉄住金物産	8,700	6,170.00	53,679,000
泉州電業	3,700	2,881.00	10,659,700
元気寿司	2,800	2,839.00	7,949,200
トラスコ中山	23,200	3,045.00	70,644,000
ヤマダ電機	374,300	642.00	240,300,600
オートバックスセブン	44,400	2,047.00	90,886,800
モリト	8,900	934.00	8,312,600
アークランドサカモト	18,900	1,842.00	34,813,800
ニトリホールディングス	44,300	17,010.00	753,543,000
グルメ杵屋	8,000	1,143.00	9,144,000
愛眼	9,100	494.00	4,495,400
ケーユーホールディングス	5,800	1,091.00	6,327,800
吉野家ホールディングス	36,700	1,959.00	71,895,300
加藤産業	17,400	3,655.00	63,597,000
イノテック	9,700	970.00	9,409,000
イエローハット	10,500	3,275.00	34,387,500
松屋フーズ	5,400	3,845.00	20,763,000
JBCホールディングス	8,800	1,069.00	9,407,200
JKホールディングス	11,200	856.00	9,587,200
サガミチェーン	14,900	1,388.00	20,681,200
日伝	9,300	2,265.00	21,064,500

関西スーパーマーケット	8,400	1,159.00	9,735,600
ミロク情報サービス	9,800	3,115.00	30,527,000
北沢産業	9,500	261.00	2,479,500
杉本商事	6,000	1,812.00	10,872,000
因幡電機産業	14,700	4,935.00	72,544,500
王将フードサービス	8,200	4,970.00	40,754,000
プレナス	12,500	2,110.00	26,375,000
ミニストップ	8,300	2,174.00	18,044,200
アークス	20,900	2,577.00	53,859,300
パローホールディングス	26,000	2,783.00	72,358,000
バイテックホールディングス	5,100	1,761.00	8,981,100
東テク	3,700	2,443.00	9,039,100
ミスミグループ本社	129,600	3,125.00	405,000,000
藤久	900	1,695.00	1,525,500
アルテック	9,600	313.00	3,004,800
ベルク	5,000	6,050.00	30,250,000
大 庄	6,000	1,715.00	10,290,000
タキヒヨー	3,700	2,290.00	8,473,000
ファーストリテイリング	18,700	43,380.00	811,206,000
ソフトバンクグループ	503,700	8,688.00	4,376,145,600
蔵王産業	1,800	1,903.00	3,425,400
スズケン	50,900	4,315.00	219,633,500
サンドラッグ	47,300	4,535.00	214,505,500
サックスパー ホールディングス	10,500	1,145.00	12,022,500
ジェコス	7,700	1,192.00	9,178,400
ヤマザワ	2,300	1,732.00	3,983,600
やまや	2,300	2,940.00	6,762,000
ルネサスイーストン	10,200	748.00	7,629,600
ペルーナ	27,400	1,231.00	33,729,400
合計	137,421,800		283,752,429,300

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株式数
トヨタ自動車	500,000

(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、当中間計算期間(平成30年2月8日から平成30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。

【中間財務諸表】

【DIAM 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11期 平成30年2月7日現在	第12期中間計算期間末 平成30年8月7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	156,083,110	104,369,632
親投資信託受益証券	22,539,666,965	28,326,172,937
未収入金	156,000,000	9,000,000
流動資産合計	22,851,750,075	28,439,542,569
資産合計	22,851,750,075	28,439,542,569
負債の部		
流動負債		
未払解約金	290,114,752	76,335,561
未払受託者報酬	3,092,734	3,870,854
未払委託者報酬	14,027,947	17,557,304
その他未払費用	220,822	196,198
流動負債合計	307,456,255	97,959,917
負債合計	307,456,255	97,959,917
純資産の部		
元本等		
元本	1 17,252,295,483	1 21,505,691,661
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	5,291,998,337	6,835,890,991
（分配準備積立金）	2,959,723,412	2,557,950,248
元本等合計	22,544,293,820	28,341,582,652
純資産合計	22,544,293,820	28,341,582,652
負債純資産合計	22,851,750,075	28,439,542,569

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第11期中間計算期間 自 平成29年2月8日 至 平成29年8月7日	第12期中間計算期間 自 平成30年2月8日 至 平成30年8月7日
営業収益		
受取利息	39	-
有価証券売買等損益	1,418,630,584	248,946,972
営業収益合計	1,418,630,623	248,946,972
営業費用		
支払利息	33,840	40,697
受託者報酬	2,332,787	3,870,854
委託者報酬	10,581,007	17,557,304
その他費用	166,537	196,274
営業費用合計	13,114,171	21,665,129
営業利益又は営業損失()	1,405,516,452	227,281,843
経常利益又は経常損失()	1,405,516,452	227,281,843
中間純利益又は中間純損失()	1,405,516,452	227,281,843
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()	135,981,428	21,944,206
期首剰余金又は期首欠損金()	1,392,180,841	5,291,998,337
剰余金増加額又は欠損金減少額	792,609,578	2,214,836,777
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	792,609,578	2,214,836,777
剰余金減少額又は欠損金増加額	367,406,051	876,281,760
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	367,406,051	876,281,760
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	3,086,919,392	6,835,890,991

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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11期 平成30年2月7日現在	第12期中間計算期間末 平成30年8月7日現在
1. 1 期首元本額	12,576,158,544円	17,252,295,483円
期中追加設定元本額	11,590,956,335円	7,109,387,715円
期中一部解約元本額	6,914,819,396円	2,855,991,537円
2. 受益権の総数	17,252,295,483口	21,505,691,661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11期 平成30年2月7日現在	第12期中間計算期間末 平成30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	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。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第11期 平成30年2月7日現在	第12期中間計算期間末 平成30年8月7日現在
1口当たり純資産額	1,3067円	1,3179円
（1万口当たり純資産額）	（13,067円）	（13,179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」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成30年2月7日現在	平成30年8月7日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		5,221,962,696	13,362,234,273
株式	2	283,752,429,300	289,245,838,030
派生商品評価勘定		-	122,386,248
未収入金		3,207,349,100	-
未収配当金		408,873,079	379,070,469
前払金		129,630,000	21,275,000
流動資産合計		292,720,244,175	303,130,804,020
資産合計		292,720,244,175	303,130,804,020
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		107,685,500	34,383,880
未払金		1,215,648	3,607,776
未払解約金		3,372,773,000	1,093,188,000
流動負債合計		3,481,674,148	1,131,179,656
負債合計		3,481,674,148	1,131,179,656
純資産の部			
元本等			
元本	1	109,428,148,369	113,198,012,011
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		179,810,421,658	188,801,612,353
元本等合計		289,238,570,027	301,999,624,364
純資産合計		289,238,570,027	301,999,624,364
負債純資産合計		292,720,244,175	303,130,804,020

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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	平成30年2月7日現在	平成30年8月7日現在
1 . 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	126,730,528,618円	109,428,148,369円
同期中追加設定元本額	21,919,995,643円	15,776,708,159円
同期中一部解約元本額	39,222,375,892円	12,006,844,517円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	8,527,416,376円	10,617,404,302円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,876,669,491円	1,754,172,516円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	4,058,956円	3,112,637円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	9,163,587円	7,313,560円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	17,247,960円	11,646,115円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	19,644,822円	20,927,536円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	15,103,701円	17,492,757円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	11,638,894円	13,986,682円
たわらノーロード TOPIX	133,947,908円	236,385,597円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	11,761,649円	42,538,425円
たわらノーロード バランス（堅実型）	125,101円	1,112,081円
たわらノーロード バランス（標準型）	1,076,337円	7,410,719円

たわらノーロード バランス (積極型)	3,879,083円	20,675,353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)	14,597円	100,723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)	186,393円	4,205,189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)	349,317円	12,378,852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)	441,025円	10,446,378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)	944,055円	24,485,918円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	37,778円	38,150円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	33,023円	60,121円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	299,108円	515,799円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	326,987円	523,634円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	954,131円	1,556,839円
D I A M国内株式インデックス ファンド< D C年金>	36,179,079,727円	37,516,479,581円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	740,060,350円	814,342,843円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,660,351,109円	2,804,659,856円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	2,764,797,796円	2,952,167,838円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	323,312,556円	340,043,581円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,119,268,669円	1,137,824,023円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	1,049,315,773円	1,073,847,180円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	47,106,085円	42,726,996円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,171,577,546円	1,084,829,283円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	24,024,004円	25,558,900円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	38,663,041円	265,421,853円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	96,018,721円	165,877,449円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	187,463,022円	295,582,075円
投資のソムリエ	1,425,039,544円	3,556,391,799円
クルーズコントロール	742,851,962円	1,146,011,485円
投資のソムリエ< D C年金>	98,587,223円	305,804,281円

DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	146,987,989円	180,304,280円
DIAM DC バランス・F(成長型)	200,841,570円	237,998,176円
クルーズコントロール<DC年金>	280,295円	576,067円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	4,871,101円	8,150,195円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	14,849,802円	24,048,625円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	31,638,887円	72,175,775円
ダイナミック・ナビゲーション	2,035,658円	1,352,404円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	480,182,820円	1,339,880,299円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	563,249円	887,763円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	625,990円	573,786円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	150,120円	354,658円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,043,053円	1,269,920円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	10,494,187円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	-円	212,744,125円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	18,666円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	70,701,371円	66,533,470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)	-円	49,226,969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)	134,139,818円	121,616,412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)	293,336,654円	286,390,890円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	16,233,373円	15,658,176円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	70,316,222円	64,258,293円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	19,820,211円	16,556,137円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	24,744,260円	16,604,468円

D I A M世界バランスファンド 4 0 V A (適格機関投資家限 定)	31,638,558円	30,147,733円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限 定)	58,546,806円	53,104,673円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	1,078,582,552円	1,027,493,940円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限 定)	1,021,293,696円	969,459,446円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2,792,304,258円	2,698,111,052円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	202,887,062円	196,880,549円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	98,032,612円	60,168,768円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	599,115,283円	561,097,827円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	1,746,402,985円	712,969,323円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド (適格機関投資家向け)	10,313,671円	10,313,671円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限 定)	39,787,583円	8,077,282円
D I A M世界バランスファンド 3 5 V A (適格機関投資家限 定)	1,187,470,230円	165,035,115円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	15,107,175,247円	13,105,034,655円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A (適格機関投 資家限定)	541,990,149円	527,708,433円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	1,727,888,538円	1,715,806,978円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	9,861,006,706円	9,837,844,322円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	519,843円	3,168,817円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	9,093,798円	3,009,532円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	3,718,064円	3,771,978円

	D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	8,771,394,616円	8,773,859,817円
	D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	70,413,424円	68,298,766円
	D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	27,752,854円	27,670,484円
	D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	18,240,489円	25,126,872円
	D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	15,682,249円	99,008円
	D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	109,957円	112,661円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定)	426,902,115円	426,902,115円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定)	1,323,021,834円	1,311,785,878円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定)	1,764,382,103円	1,737,262,933円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定)	76,281,237円	73,956,736円
	計	109,428,148,369円	113,198,012,011円
2 .	受益権の総数	109,428,148,369口	113,198,012,011口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,686,000,000円	株式 3,573,000,000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	平成30年2月7日現在	平成30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。	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 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	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。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。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	平成30年2月7日 現在				平成30年8月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	2,293,270,000	-	2,185,625,000	107,645,000	12,437,275,000	-	12,525,510,000	88,235,000
合計	2,293,270,000	-	2,185,625,000	107,645,000	12,437,275,000	-	12,525,510,000	88,235,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年2月7日現在	平成30年8月7日現在
1口当たり純資産額	2.6432円	2.6679円
(1万口当たり純資産額)	(26,432円)	(26,679円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成30年8月31日現在

資産総額	28,957,413,543円
負債総額	155,093,006円
純資産総額(-)	28,802,320,537円
発行済数量	21,986,161,333口
1口当たり純資産額(/)	1.3100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

平成30年8月31日現在

資産総額	300,485,016,869円
負債総額	628,486,156円
純資産総額(-)	299,856,530,713円
発行済数量	113,057,134,012口
1口当たり純資産額(/)	2.6523円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2018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(2018年8月31日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

取締役は株主総会で選任されます。取締役(監査等委員である取締役を除く。)の任期は、その選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した取締役(監査等委員である取締役を除く。)の補欠として選任された取締役(監査等委員である取締役を除く。)の任期は、現任取締役(監査等委員である取締役を除く。)の任期の満了の時までとします。

また、監査等委員である取締役の任期は、その選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、決議によって代表取締役を選定します。代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、原則として取締役社長が招集します。取締役会の議長は、原則として取締役社長があたります。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、議決に加わることができる取締役の過半数が出席し、出席取締役の過半数をもって行います。

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2018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	38	1,207,316,840,603
追加型株式投資信託	853	13,043,312,848,128
単位型公社債投資信託	48	194,109,113,884
単位型株式投資信託	146	978,340,252,718
合計	1,085	15,423,079,055,333

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、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第33期事業年度(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	27,972,477	49,071,217
金銭の信託	12,366,219	12,083,824
有価証券	297,560	-
未収委託者報酬	10,164,041	11,769,015
未収運用受託報酬	7,250,239	4,574,225
未収投資助言報酬	316,414	341,689
未収収益	52,278	59,526
前払費用	533,411	569,431
繰延税金資産	678,104	842,996
その他	445,717	427,238
流動資産計	60,076,462	79,739,165
固定資産		
有形固定資産	1,900,343	1,643,826
建物	1 1,243,812	1 1,156,953
器具備品	1 656,235	1 476,504
建設仮勘定	295	10,368
無形固定資産	1,614,084	1,934,700
商標権	5	-
ソフトウェア	1,511,558	1,026,319
ソフトウェア仮勘定	98,483	904,389
電話加入権	3,934	3,931
電信電話専用施設利用権	103	60
投資その他の資産	10,055,336	7,427,316
投資有価証券	3,265,786	1,721,433
関係会社株式	3,306,296	3,229,196
長期差入保証金	1,800,827	1,518,725
前払年金費用	686,322	-
繰延税金資産	893,887	856,537
その他	102,215	101,425
固定資産計	13,569,764	11,005,844
資産合計	73,646,227	90,745,010

（単位：千円）

	第32期 （平成29年3月31日現在）	第33期 （平成30年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	1,169,128	1,003,550
未払金	4,745,195	5,081,728
未払収益分配金	1,027	1,031
未払償還金	57,332	57,275
未払手数料	4,062,695	4,629,133
その他未払金	624,140	394,288
未払費用	7,030,589	7,711,038
未払法人税等	1,915,556	5,153,972
未払消費税等	891,476	1,660,259
賞与引当金	1,432,264	1,393,911
役員賞与引当金	27,495	49,986
本社移転費用引当金	-	156,587
流動負債計	17,211,706	22,211,034
固定負債		
退職給付引当金	1,305,273	1,637,133
時効後支払損引当金	216,466	199,026
本社移転費用引当金	942,315	-
固定負債計	2,464,055	1,836,160
負債合計	19,675,761	24,047,195
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	31,899,643	44,349,855
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	31,776,350	44,226,562
別途積立金	24,580,000	24,580,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	6,696,350	19,146,562
株主資本計	53,452,601	65,902,812
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	517,864	795,002
評価・換算差額等計	517,864	795,002
純資産合計	53,970,465	66,697,815
負債・純資産合計	73,646,227	90,745,010

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	56,355,754		84,705,447	
運用受託報酬	12,834,241		19,124,427	
投資助言報酬	1,002,482		1,217,672	
その他営業収益	378,715		117,586	
営業収益計		70,571,194		105,165,133
営業費用				
支払手数料	24,957,038		37,242,284	
広告宣伝費	838,356		379,873	
公告費	991		1,485	
調査費	15,105,578		23,944,438	
調査費	7,780,474		10,677,166	
委託調査費	7,325,104		13,267,272	
委託計算費	891,379		1,073,938	
営業雑経費	1,102,921		1,215,963	
通信費	51,523		48,704	
印刷費	926,453		947,411	
協会費	37,471		64,331	
諸会費	74		22,412	
支払販売手数料	87,399		133,104	
営業費用計		42,896,265		63,857,984
一般管理費				
給料	8,517,089		11,304,873	
役員報酬	220,145		189,022	
給料・手当	7,485,027		9,565,921	
賞与	811,916		1,549,929	
交際費	66,813		58,863	
寄付金	13,467		5,150	
旅費交通費	297,237		395,605	
租税公課	430,779		625,498	
不動産賃借料	1,961,686		1,534,255	
退職給付費用	358,960		595,876	
固定資産減価償却費	825,593		1,226,472	
福利厚生費	39,792		49,797	
修繕費	27,435		4,620	
賞与引当金繰入額	1,432,264		1,393,911	
役員賞与引当金繰入額	27,495		49,986	
役員退職慰労金	63,072		-	
機器リース料	210		148	
事務委託費	1,530,113		3,037,804	
事務用消耗品費	127,265		144,804	
器具備品費	271,658		5,253	
諸経費	129,981		149,850	
一般管理費計		16,120,918		20,582,772
営業利益		11,554,010		20,724,376

（単位：千円）

	第32期 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）		第33期 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）	
営業外収益				
受取利息		537		1,430
受取配当金		51,036		74,278
時効成立分配金・償還金		103		256
為替差益		7,025		8,530
投資信託解約益		2		236,398
投資信託償還益		-		93,177
雑収入	1	18,213	1	10,306
時効後支払損引当金戻入額		-		17,429
営業外収益計		76,918		441,807
営業外費用				
投資信託解約損		31,945		4,138
投資信託償還損		47,201		17,065
金銭の信託運用損		552,635		99,303
時効成立後支払分配金・償還金		39		-
時効後支払損引当金繰入額		209,210		-
営業外費用計		841,031		120,507
経常利益		10,789,897		21,045,676
特別利益				
固定資産売却益	2	2,348	2	1
投資有価証券売却益		-		479,323
関係会社株式売却益	1	-	1	1,492,680
貸倒引当金戻入益		8,883		-
訴訟損失引当金戻入益		21,677		-
本社移転費用引当金戻入額		-		138,294
その他特別利益		746		350
特別利益計		33,655		2,110,649
特別損失				
固定資産除却損	3	23,600	3	36,992
固定資産売却損	4	10,323	4	134
投資有価証券評価損		12,085		-
ゴルフ会員権評価損		4,832		-
訴訟和解金		30,000		-
本社移転費用	5	1,511,622	5	-
退職給付制度終了損		-		690,899
システム移行損失		-		76,007
その他特別損失		-		50
特別損失計		1,592,463		804,083
税引前当期純利益		9,231,089		22,352,243
法人税、住民税及び事業税		2,965,061		6,951,863
法人税等調整額		177,275		249,832
法人税等合計		2,787,786		6,702,031
当期純利益		6,443,302		15,650,211

（３）【株主資本等変動計算書】

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	-	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047
当期変動額									
剰余金の配当									2,544,000
別途積立金の 積立						2,550,000			2,550,000
当期純利益									6,443,302
合併による 増加			17,124,479	17,124,479					
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	17,124,479	17,124,479	-	2,550,000	-	-	1,349,302
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775
当期変動額					
剰余金の配当	2,544,000	2,544,000			2,544,000
別途積立金の 積立	-	-			-
当期純利益	6,443,302	6,443,302			6,443,302
合併による 増加		17,124,479			17,124,479
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)		-	363,907	363,907	363,907
当期変動額合計	3,899,302	21,023,782	363,907	363,907	21,387,689
当期末残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465

第33期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350
当期変動額									
剰余金の配当									3,200,000
当期純利益									15,650,211
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	-	12,450,211
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465
当期変動額					
剰余金の配当	3,200,000	3,200,000			3,200,000
当期純利益	15,650,211	15,650,211			15,650,211
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)		-	277,137	277,137	277,137
当期変動額合計	12,450,211	12,450,211	277,137	277,137	12,727,349
当期末残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815

重要な会計方針

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

会計上の見積りの変更

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

当社は、当事業年度においてシステム統合計画を決定したことに伴い、利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。

これにより、従来の方法と比べて、当事業年度末の減価償却費が413,260千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ同額減少しております。

追加情報

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

当社は、平成29年10月1日付で確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行したことにより、「退職給付制度間の移行等に関する会計処理」(企業会計基準適用指針第1号 平成28年12月16日)及び「退職給付制度間の移行等の会計処理に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第2号 平成19年2月7日)を適用し、確定給付年金制度の終了の処理を行いました。

本移行に伴う影響額は、特別損失に退職給付制度終了損として690,899千円を計上しております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
建物	53,098	140,580
器具備品	734,064	847,466

(損益計算書関係)

1. 関係会社に対する事項

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
雑収入	8,183	-
関係会社株式売却益	-	1,492,680

2. 固定資産売却益の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	546	-
車両運搬具	696	-
器具備品	1,104	1

3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	-	298
器具備品	4,727	8,217
ソフトウェア	2,821	28,472
電話加入権	16,052	3

4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	543	-
器具備品	9,779	134

5. 本社移転費用の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
本社移転費用引当金繰入額	942,315	-
旧日本社不動産賃借料	418,583	-
賃貸借契約解約損	150,723	-

(株主資本等変動計算書関係)

第32期(自平成28年4月1日 至平成29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	24,000	490	-	24,490
A種種類株式	-	15,510	-	15,510
合計	24,000	16,000	-	40,000

(注) 普通株式及びA種種類株式の発行済株式総数の増加は、当社統合に伴う新株の発行による増加であります。

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成29年6月21日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	3,200,000	80,000	平成29年3月31日	平成29年6月22日
	A種種類株式					

第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成29年6月21日 定時株主総会	普通株式	3,200,000	80,000	平成29年3月31日	平成29年6月22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
平成30年6月20日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成30年6月20日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	12,520,000	313,000	平成30年3月31日	平成30年6月21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（為替予約取引及び株価指数先物取引）を利用して一部リスクを低減しております。

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第32期（平成29年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	27,972,477	27,972,477	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	12,366,219	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	10,164,041	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	7,250,239	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	3,225,878	3,225,878	-
資産計	60,978,855	60,978,855	-
(1) 未払手数料	4,062,695	4,062,695	-
負債計	4,062,695	4,062,695	-

第33期(平成30年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	49,071,217	49,071,217	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	12,083,824	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	11,769,015	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	4,574,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	1,448,968	1,448,968	-
資産計	78,947,251	78,947,251	-
(1) 未払手数料	4,629,133	4,629,133	-
負債計	4,629,133	4,629,133	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
非上場株式	337,468	272,464
関係会社株式	3,306,296	3,229,196

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第32期(平成29年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	27,972,477	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	297,560	320,736	888,110	12,660

第33期(平成30年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	49,071,217	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	-	3,995	-	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第32期の貸借対照表計上額3,306,296千円、第33期の貸借対照表計上額3,229,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

第32期(平成29年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	609,710	146,101	463,608
投資信託	2,384,278	2,091,387	292,891
小計	2,993,988	2,237,489	756,499
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	231,889	241,951	10,061
小計	231,889	241,951	10,061
合計	3,225,878	2,479,440	746,438

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額337,468千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第33期(平成30年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	1,267,157	146,101	1,121,055
投資信託	177,815	153,000	24,815
小計	1,444,972	299,101	1,145,870
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,995	4,000	4
小計	3,995	4,000	4
合計	1,448,968	303,101	1,145,866

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額272,464千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
投資信託	717,905	2	79,146

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	544,326	479,323	-
投資信託	2,480,288	329,576	21,204

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

4. 減損処理を行った有価証券

第32期において、有価証券について12,085千円(その他有価証券)減損処理を行っております。

第33期において、該当事項はありません。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30~50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について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。

なお、当社は平成29年10月1日付で、確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行するとともに、退職一時金制度を改定しました。

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

	第32期	第33期
	（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）	（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）
退職給付債務の期首残高	1,086,550	2,718,372
勤務費用	189,127	269,128
利息費用	10,905	7,523
数理計算上の差異の発生額	89,303	61,792
退職給付の支払額	144,062	111,758
合併による増加	1,486,547	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	-	1,316,796
退職一時金制度改定に伴う増加額	-	526,345
退職給付債務の期末残高	2,718,372	2,154,607

（2）年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

	第32期	第33期
	（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）	（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）
年金資産の期首残高	-	1,363,437
期待運用収益	16,033	17,042
数理計算上の差異の発生額	1,894	-
事業主からの拠出額	37,402	36,672
退職給付の支払額	28,876	-
合併による増加	1,336,984	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	-	1,417,152
年金資産の期末残高	1,363,437	-

（3）退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

（千円）

	第32期	第33期
	（平成29年3月31日現在）	（平成30年3月31日現在）
積立型制度の退職給付債務	1,275,346	-
年金資産	1,363,437	-
	88,090	-
非積立型制度の退職給付債務	1,443,026	2,154,607
未積立退職給付債務	1,354,935	2,154,607
未認識数理計算上の差異	430,203	204,636
未認識過去勤務費用	4,852	312,836
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	919,879	1,637,133
退職給付引当金	1,245,019	1,637,133
前払年金費用	325,140	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	919,879	1,637,133

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
勤務費用	189,127	269,128
利息費用	10,905	7,523
期待運用収益	16,033	17,042
数理計算上の差異の費用処理額	78,229	88,417
過去勤務費用の費用処理額	4,852	39,611
退職一時金制度改定に伴う費用処理額	-	70,560
その他	7,498	1,620
確定給付制度に係る退職給付費用	274,580	456,577
制度移行に伴う損失(注)	-	690,899

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
株式	31.5%	-
債券	29.0%	-
共同運用資産	24.1%	-
生命保険一般勘定	10.5%	-
現金及び預金	4.6%	-
合計	100.0%	-

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
割引率	0.02% ~ 1.09%	0.09%
長期期待運用収益率	2.50%	-
予想昇給率	1.00% ~ 8.73%	1.00% ~ 4.42%

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	-	300,927
退職給付費用	22,562	53,156
退職給付の支払額	-	-
制度への拠出額	36,177	35,640
合併による増加	287,313	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	-	391,600
退職一時金制度改定に伴う振替額	-	108,189
退職給付引当金の期末残高	300,927	-

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	789,261	-
年金資産	1,150,443	-
	361,181	-
非積立型制度の退職給付債務	60,254	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	300,927	-
退職給付引当金	60,254	-
前払年金費用	361,181	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	300,927	-

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度 22,562千円 当事業年度53,156千円

4. 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61,817千円、当事業年度86,141千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	124,081	290,493
未払事業所税	11,054	11,683
賞与引当金	441,996	426,815
未払法定福利費	84,152	81,186
資産除去債務	86,421	90,524
減価償却超過額(一括償却資産)	10,666	11,331
減価償却超過額	116,920	176,791
繰延資産償却超過額(税法上)	32,949	34,977
退職給付引当金	399,808	501,290
時効後支払損引当金	66,282	60,941
ゴルフ会員権評価損	14,295	13,173
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	69,683	28,976
未払給与	12,344	9,186
本社移転費用引当金	289,865	47,947
その他	14,309	29,193
繰延税金資産小計	1,941,573	1,981,254
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,941,573	1,981,254
繰延税金負債		
前払年金費用	210,151	-
その他有価証券評価差額金	159,429	281,720
繰延税金負債合計	369,581	281,720

繰延税金資産の純額

1,571,992

1,699,533

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

(企業結合等関係)

当社(以下「AMOne」という)は、平成28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、平成28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

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率(議決権比率)

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率	50.00%
MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率	20.00%
MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率	70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成30年3月31日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	114,270,495千円
資産合計	114,270,495千円
流動負債	- 千円
固定負債	13,059,836千円
負債合計	13,059,836千円
純資産	101,210,659千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額70,507,975千円及び顧客関連資産の金額45,200,838千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	9,012,128千円
経常利益	9,012,128千円
税引前当期純利益	9,012,128千円
当期純利益	7,419,617千円
1株当たり当期純利益	185,490円43銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額3,811,241千円及び顧客関連資産の償却額5,233,360千円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

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32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）及び第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30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32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	4,530,351	未払 手数料	767,732
	資産管理サービス信託銀行株式会社	東京都中央区	500 億円	資産管理 等	-	-	当社信託財産の運用	信託元本の 払戻(純額) 信託報酬の 支払	100,000 7,080	金銭の 信託	12,366,219
	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	5,061,766	未払 手数料	1,166,212
	みずほ信託銀行株式会社	東京都中央区	2,473 億円	信託銀行 業	-	-	投資一任契約の締結	運用受託報 酬の受取	2,520,431	未収運 用受託 報酬	2,722,066

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,470,802	未払 手数料	894,336
	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	9,079,083	未払 手数料	1,549,208

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) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。
- (注3) 運用受託報酬は、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4) 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32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	1,349,261円64銭	1,667,445円37銭
1株当たり当期純利益金額	201,491円22銭	391,255円29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32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
当期純利益金額	6,443,302千円	15,650,211千円
普通株主及び普通株主と同等の 株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の 株式に係る当期純利益金額	6,443,302千円	15,650,211千円
普通株式及び普通株式と同等の 株式の期中平均株式数	31,978株	40,000株
(うち普通株式)	(24,244株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(7,734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) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2018年6月20日付で、総則の「目的」に関する事項の定款の変更を行いました。

- (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。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

2018年3月末日現在 247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の「販売会社一覧表」の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社武蔵野銀行	45,743	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社京葉銀行	49,759	日本において銀行業務を営んでおります。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
松井証券株式会社	11,944	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2018年3月末日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2) 信託財産の計算
- (3) 信託財産に関する報告書の作成
- (4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集販売の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する一部解約金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付
- (7) その他上記に付帯する業務

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

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

- ・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
- ・委託会社の金融商品取引業者登録番号
- ・詳細情報の入手方法
委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など
請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
- ・目論見書の使用開始日
- ・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
- ・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
- ・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

(2)有価証券届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」に記載の内容について、投資家の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関する箇所に記載することがあります。また、第二部「ファンド情報」第1「ファンドの状況」5「運用状況」について、有価証券届出書提出後の随時入手可能な直近の情報および同情報についての表での表示に加えて、グラフで表示した情報を目論見書に記載することがあります。

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

(4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。

(6)投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成30年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 湯原 尚 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山野 浩 印

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株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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株式会社の平成30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すべ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。

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成30年3月22日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴 司 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 鶴 田 光 夫 印
業務執行社員

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DIAM DC 国内株式インデックスファンドの平成29年2月8日から平成30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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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、DIAM DC 国内株式インデックスファンドの平成30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すべ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。

利害関係

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

以 上

- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年9月28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

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印
業務執行社員

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DIAMDC国内株式インデックスファンドの平成30年2月8日から平成30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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

中間監査意見

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、DIAMDC国内株式インデックスファンドの平成30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（平成30年2月8日から平成30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。

その他の事項

ファンドの平成30年2月7日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して平成29年9月20日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して平成30年3月22日付けで無限定適正意見を表明している。

利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

