

【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】	2019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】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	One DC 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】

One DC 国内株式インデックスファンド

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下、「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関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：2019年11月8日から2020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經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。

指数の著作権等

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。

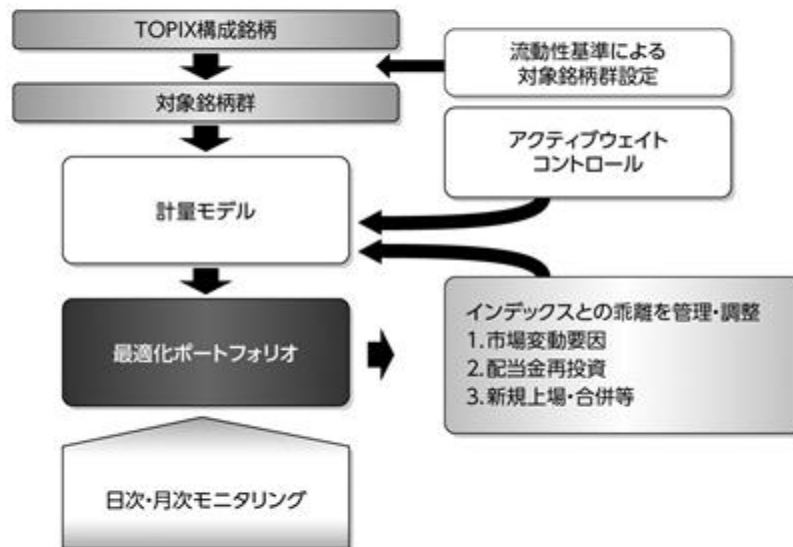
当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

(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。

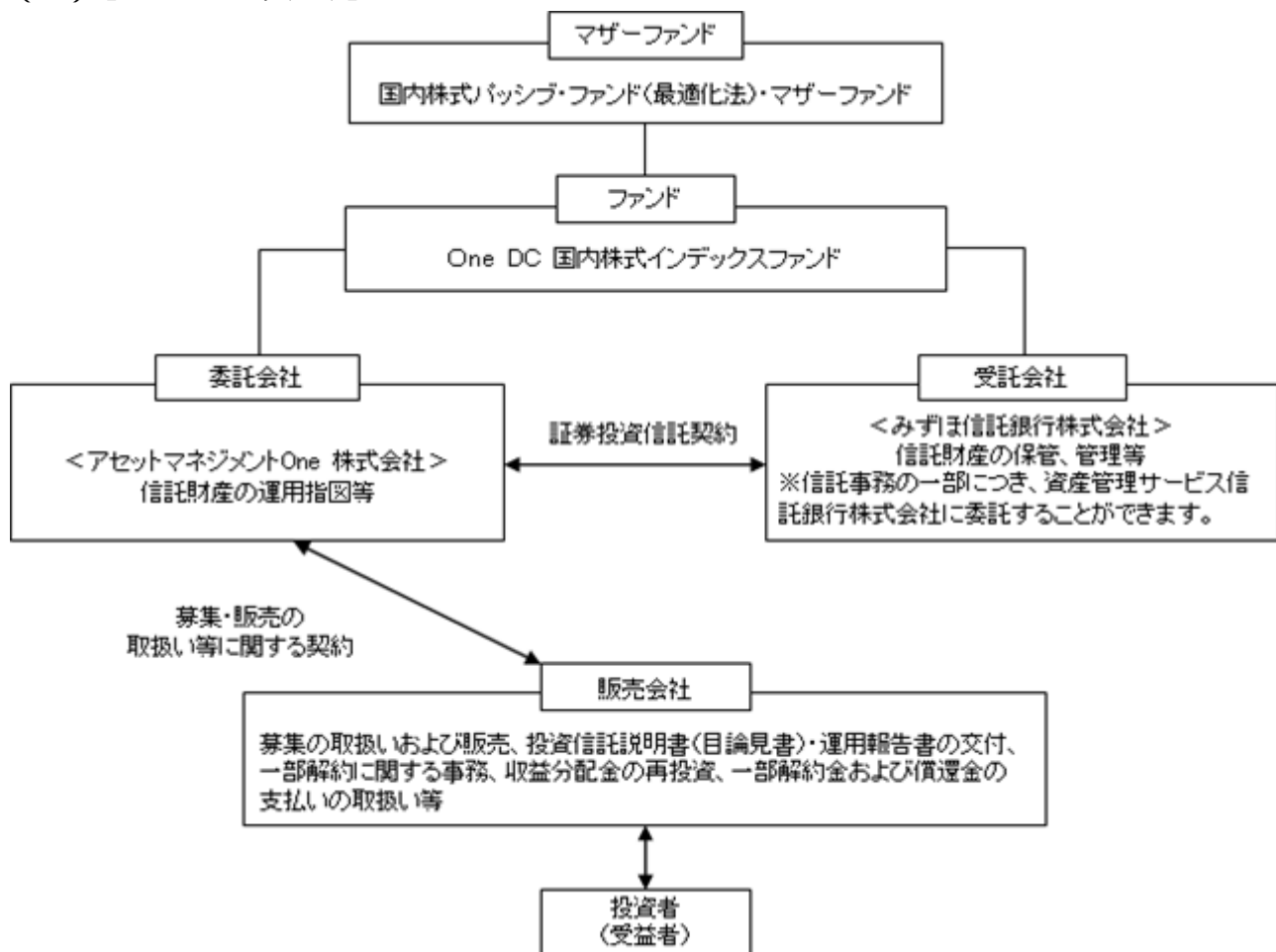
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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（<https://www.toushin.or.jp/>）でご覧いただけます。

（２）【ファンドの沿革】

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

（３）【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

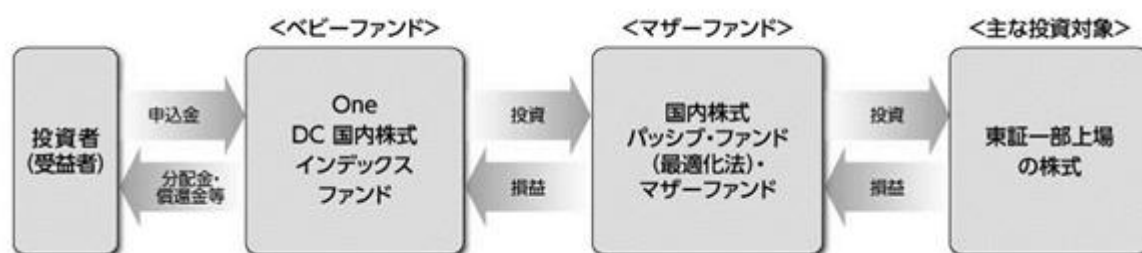
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2019年8月30日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

(2019年8月30日現在)

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

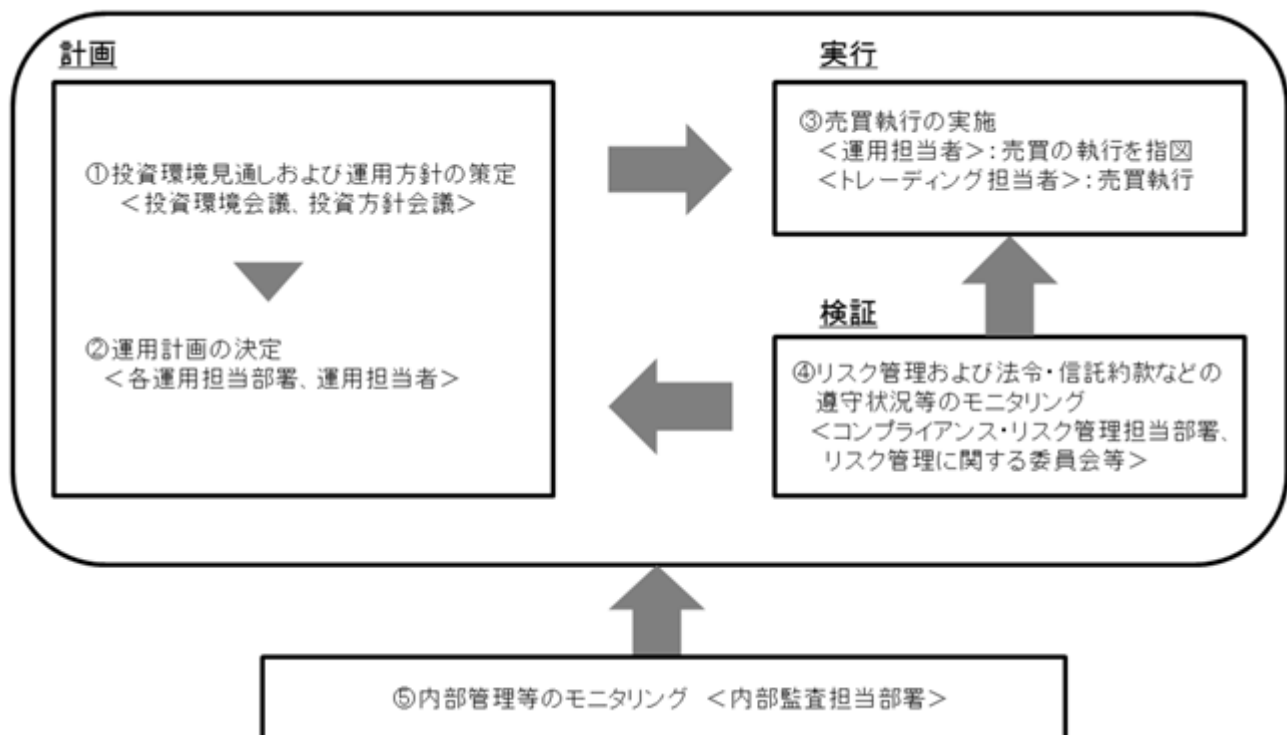
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小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

<p>主な投資制限</p>	<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2019年8月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時(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

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

信用リスク

投資する有価証券の発行者の財政難・経営不安・倒産等の発生は、基準価額の下落要因となります。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

(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も信託を終了(繰上償還)する場合があります。

注意事項

イ. 当ファンドは、実質的に株式など値動きのある有価証券(外貨建資産へ投資する場合には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。

ロ. 投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

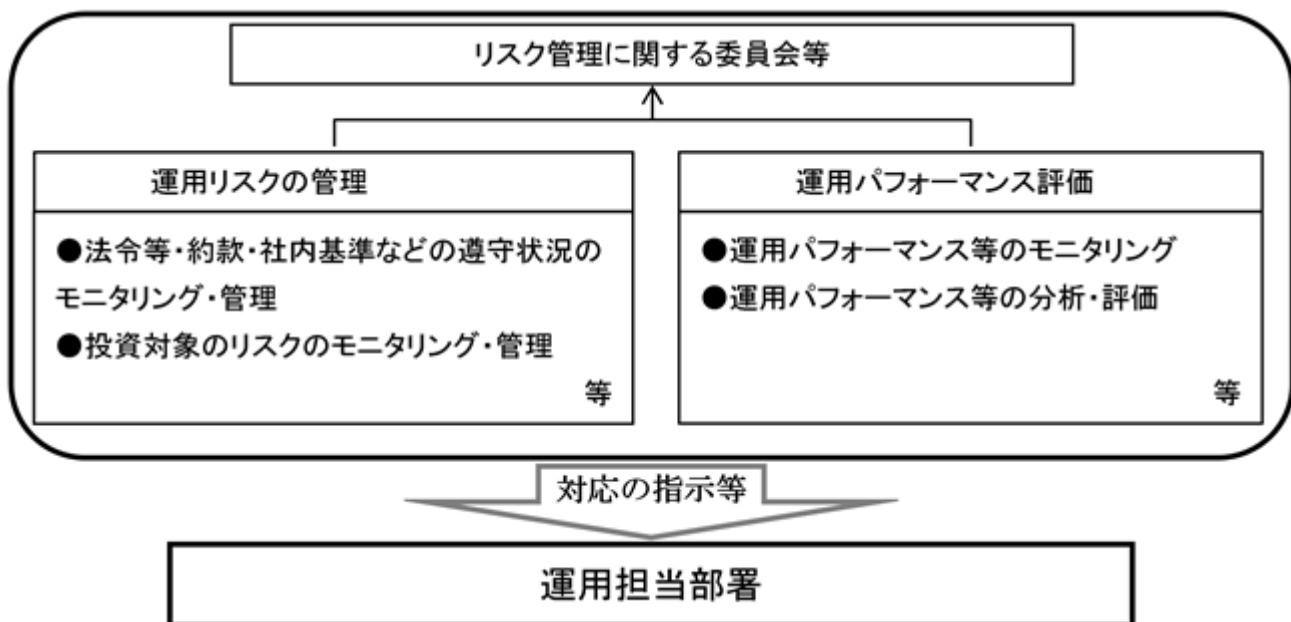
ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

ニ. 投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、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。



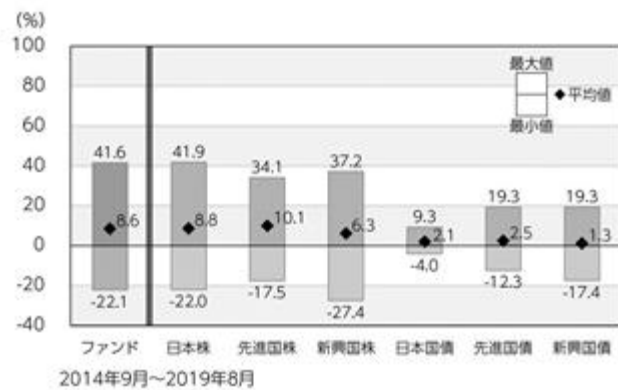
リスク管理体制は2019年8月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.154%（税抜0.14%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.06%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.06%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.02%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

イ. 信託財産留保額

ありません。

ロ. その他の費用

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

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（ファンドの基準価額に反映）され、毎年8月7日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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。

2020年1月1日以降の分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

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

上記は、2019年8月末現在のものであります。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

令和1年8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	32,376,289,857	99.99
内 日本	32,376,289,857	99.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,662,804	0.01
純資産総額	32,377,952,661	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

令和1年8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	236,059,131,195	97.95
内 日本	236,059,131,195	97.95
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,942,369,119	2.05
純資産総額	241,001,500,314	100.00

その他資産の投資状況

令和1年8月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	4,243,100,000	1.76
内 日本	4,243,100,000	1.76

（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】

令和1年8月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	13,681,664,071	2.4238 33,162,306,487	2.3664 32,376,289,857	- -	99.99%

(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

令和1年8月30日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.99%
合計	99.99%

(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

令和1年8月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,215,400	6,580.15 7,997,525,696	6,960.00 8,459,184,000	- -	3.51%
2	ソニー 日本	株式 電気機器	732,000	4,754.22 3,480,094,600	6,042.00 4,422,744,000	- -	1.84%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	849,200	4,981.63 4,230,403,397	4,824.00 4,096,540,800	- -	1.70%
4	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	7,404,800	575.08 4,258,383,497	510.40 3,779,409,920	- -	1.57%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	731,900	4,651.53 3,404,455,347	5,096.00 3,729,762,400	- -	1.55%
6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	952,200	4,438.15 4,226,012,397	3,590.00 3,418,398,000	- -	1.42%
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	53,500	62,271.38 3,331,519,125	62,900.00 3,365,150,000	- -	1.40%
8	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	758,100	3,915.88 2,968,629,215	3,484.00 2,641,220,400	- -	1.10%
9	任天堂 日本	株式 その他製品	62,400	29,763.26 1,857,227,988	40,290.00 2,514,096,000	- -	1.04%

10	KDDI 日本	株式 情報・通信業	877,400	2,665.30 2,338,536,130	2,835.00 2,487,429,000	- -	1.03%
11	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	746,700	2,934.54 2,191,223,618	3,219.00 2,403,627,300	- -	1.00%
12	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	920,000	2,984.96 2,746,168,794	2,523.50 2,321,620,000	- -	0.96%
13	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	14,615,200	172.59 2,522,483,522	154.70 2,260,971,440	- -	0.94%
14	第一三共 日本	株式 医薬品	312,100	3,714.01 1,159,145,164	7,018.00 2,190,317,800	- -	0.91%
15	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	384,700	5,347.20 2,057,069,000	5,472.00 2,105,078,400	- -	0.87%
16	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	97,700	23,550.92 2,300,925,287	21,015.00 2,053,165,500	- -	0.85%
17	信越化学工業 日本	株式 化学	188,200	9,272.82 1,745,145,311	10,715.00 2,016,563,000	- -	0.84%
18	花王 日本	株式 化学	261,100	8,053.02 2,102,645,096	7,674.00 2,003,681,400	- -	0.83%
19	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	193,900	10,162.98 1,970,602,830	10,115.00 1,961,298,500	- -	0.81%
20	ダイキン工業 日本	株式 機械	148,900	11,823.08 1,760,457,928	13,155.00 1,958,779,500	- -	0.81%
21	三菱商事 日本	株式 卸売業	753,900	3,137.29 2,365,208,050	2,585.00 1,948,831,500	- -	0.81%
22	ファナック 日本	株式 電気機器	103,600	18,783.93 1,946,015,672	18,455.00 1,911,938,000	- -	0.79%
23	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	123,100	11,722.06 1,442,985,700	15,470.00 1,904,357,000	- -	0.79%
24	HOYA 日本	株式 精密機器	219,600	6,656.03 1,461,665,380	8,649.00 1,899,320,400	- -	0.79%
25	資生堂 日本	株式 化学	216,700	7,246.76 1,570,374,236	8,690.00 1,883,123,000	- -	0.78%
26	日本電産 日本	株式 電気機器	131,300	13,173.98 1,729,744,275	13,855.00 1,819,161,500	- -	0.75%
27	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	677,600	2,556.23 1,732,103,730	2,682.00 1,817,323,200	- -	0.75%
28	日立製作所 日本	株式 電気機器	491,000	3,509.48 1,723,158,760	3,629.00 1,781,839,000	- -	0.74%
29	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	1,134,900	1,318.34 1,496,190,744	1,490.50 1,691,568,450	- -	0.70%
30	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	450,200	4,723.41 2,126,479,854	3,757.00 1,691,401,400	- -	0.70%

(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

令和1年8月30日現在

種類	投資比率
株式	97.95%
合計	97.95%

（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

令和1年8月30日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	13.43%
情報・通信業		8.89%
輸送用機器		7.62%
化学		7.11%
医薬品		5.60%
銀行業		5.60%
サービス業		5.16%
卸売業		4.79%
機械		4.78%
陸運業		4.71%
小売業		4.70%
食料品		4.00%
建設業		2.78%
不動産業		2.50%
保険業		2.24%
その他製品		2.21%
精密機器		2.14%
電気・ガス業		1.68%
その他金融業		1.10%
ガラス・土石製品		0.78%
鉄鋼		0.76%
証券、商品先物取引業		0.76%
ゴム製品		0.75%
非鉄金属		0.69%
繊維製品		0.62%
空運業		0.55%
金属製品		0.54%
石油・石炭製品		0.52%
鋳業		0.26%
パルプ・紙		0.25%
倉庫・運輸関連業		0.19%
海運業	0.15%	
水産・農林業	0.11%	
合計	97.95%	

（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

令和1年8月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0109月	買建	281	4,214,845,944	4,243,100,000	1.76%

(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(令和1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
第12計算期間末 (平成31年2月7日)	30,214	30,214	1.1958	1.1958
平成30年8月末日	28,802	-	1.3100	-
9月末日	30,407	-	1.3828	-
10月末日	29,378	-	1.2525	-
11月末日	30,752	-	1.2690	-
12月末日	27,976	-	1.1388	-
平成31年1月末日	30,166	-	1.1946	-
2月末日	31,095	-	1.2255	-
3月末日	31,381	-	1.2264	-
4月末日	31,820	-	1.2466	-
令和1年5月末日	30,704	-	1.1654	-
6月末日	32,049	-	1.1971	-
7月末日	32,773	-	1.2078	-
8月末日	32,377	-	1.1669	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
平成31年2月8日～ 令和1年8月7日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第12計算期間	8.5
平成31年2月8日～ 令和1年8月7日	3.2

(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
第12計算期間	14,073,136,483	6,058,109,779
平成31年2月8日～ 令和1年8月7日	5,078,001,825	3,175,620,586

(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:2019年8月30日

基準価額・純資産の推移 (2009年8月31日～2019年8月30日)

分配の推移(税引前)



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
第12期(2019.02.07)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たりです。

※基準価額は1万円当たり・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。

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	99.99

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	97.95
内 日本	97.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.05
合計(純資産総額)	100.00

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.51
2	ソニー	株式	日本	電気機器	1.84
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.70
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.57
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.55
6	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.42
7	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.40
8	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.10
9	任天堂	株式	日本	その他製品	1.04
10	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.03

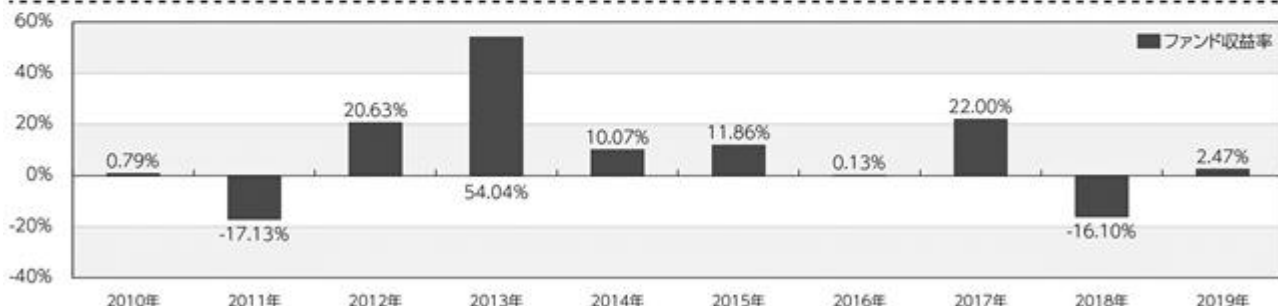
その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1.76

株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	13.43
2	情報・通信業	8.89
3	輸送用機器	7.62
4	化学	7.11
5	医薬品	5.60

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。

※2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みの方法

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。
当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。
- ・当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」に従って分配金累積投資に関する契約を締結します。
なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。
- ・当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、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12期計算期間(平成30年2月8日から平成31年2月7日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

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11期 平成30年2月7日現在	第12期 平成31年2月7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	156,083,110	101,021,815
親投資信託受益証券	22,539,666,965	30,212,716,248
未収入金	156,000,000	-
流動資産合計	22,851,750,075	30,313,738,063
資産合計	22,851,750,075	30,313,738,063
負債の部		
流動負債		
未払解約金	290,114,752	74,515,445
未払受託者報酬	3,092,734	4,438,160
未払委託者報酬	14,027,947	20,130,322
その他未払費用	220,822	206,116
流動負債合計	307,456,255	99,290,043
負債合計	307,456,255	99,290,043
純資産の部		
元本等		
元本	1 17,252,295,483	1 25,267,322,187
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	5,291,998,337	4,947,125,833
(分配準備積立金)	2,959,723,412	2,758,828,545
元本等合計	22,544,293,820	30,214,448,020
純資産合計	22,544,293,820	30,214,448,020
負債純資産合計	22,851,750,075	30,313,738,063

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期		第12期	
	自	平成29年2月8日 平成30年2月7日	自	平成30年2月8日 平成31年2月7日
営業収益				
受取利息		42		-
有価証券売買等損益		2,713,380,321		2,504,450,717
営業収益合計		2,713,380,363		2,504,450,717
営業費用				
支払利息		70,202		87,307
受託者報酬		5,425,521		8,309,014
委託者報酬		24,608,954		37,687,626
その他費用		387,359		402,390
営業費用合計		30,492,036		46,486,337
営業利益又は営業損失（ ）		2,682,888,327		2,550,937,054
経常利益又は経常損失（ ）		2,682,888,327		2,550,937,054
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,682,888,327		2,550,937,054
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（ ）		691,574,750		99,006,059
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		2,834,360,246		3,959,345,683
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		3,959,345,683
剰余金減少額又は欠損金増加額		925,856,327		1,852,287,192
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		1,852,287,192
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,291,998,337		4,947,125,833

(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11期 平成30年2月7日現在	第12期 平成31年2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	14,073,136,483円
期中一部解約元本額	6,914,819,396円	6,058,109,779円
2. 受益権の総数	17,252,295,483口	25,267,322,187口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期 自 平成29年2月8日 至 平成30年2月7日	第12期 自 平成30年2月8日 至 平成31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(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(532,913,967円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(11,923,231,636円)及び分配準備積立金(2,225,914,578円)より分配対象収益は14,682,060,181円(1万口当たり5,810.69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11期	第12期
	自 平成29年2月8日 至 平成30年2月7日	自 平成30年2月8日 至 平成31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11期 平成30年2月7日現在	第12期 平成31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11期 平成30年2月7日現在	第12期 平成31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	2,537,460,553	2,493,596,576
合計	2,537,460,553	2,493,596,576

(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11期 平成30年2月7日現在	第12期 平成31年2月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3067円 (13,067円)	1.1958円 (11,958円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成31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	12,470,165,201	30,212,716,248	
親投資信託受益証券	合計	12,470,165,201	30,212,716,248	
合計		12,470,165,201	30,212,716,248	

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30年2月7日現在	平成31年2月7日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		5,221,962,696	4,125,464,360
株式	2	283,752,429,300	275,040,369,410
派生商品評価勘定		-	91,224,648
未収入金		3,207,349,100	-
未収配当金		408,873,079	424,228,839
前払金		129,630,000	-
流動資産合計		292,720,244,175	279,681,287,257
資産合計		292,720,244,175	279,681,287,257
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		107,685,500	2,179,860
前受金		-	118,060,000
未払金		1,215,648	-
未払解約金		3,372,773,000	376,733,000
流動負債合計		3,481,674,148	496,972,860
負債合計		3,481,674,148	496,972,860
純資産の部			
元本等			
元本	1	109,428,148,369	115,232,523,115
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		179,810,421,658	163,951,791,282
元本等合計		289,238,570,027	279,184,314,397
純資産合計		289,238,570,027	279,184,314,397
負債純資産合計		292,720,244,175	279,681,287,257

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31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	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	39,063,771,527円
	同期中一部解約元本額	39,222,375,892円	33,259,396,781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	12,470,165,201円
	DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,876,669,491円	2,422,782,745円
	MITO ラップ型ファンド(安定型)	4,058,956円	3,584,623円
	MITO ラップ型ファンド(中立型)	9,163,587円	7,945,181円
	MITO ラップ型ファンド(積極型)	17,247,960円	13,986,982円
	グローバル8資産ラップファンド(安定型)	19,644,822円	29,918,491円
	グローバル8資産ラップファンド(中立型)	15,103,701円	21,960,170円
	グローバル8資産ラップファンド(積極型)	11,638,894円	16,943,092円
	たわらノーロード TOPIX	133,947,908円	392,245,080円
	たわらノーロード バランス(8資産均等型)	11,761,649円	110,161,759円
	たわらノーロード バランス(堅実型)	125,101円	2,948,338円
	たわらノーロード バランス(標準型)	1,076,337円	20,703,269円
	たわらノーロード バランス(積極型)	3,879,083円	40,994,687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	224,069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	11,759,993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	36,734,333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	27,744,281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	74,154,128円
	たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	37,778円	66,600円
	たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	33,023円	177,452円
	たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	299,108円	1,070,868円

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	326,987円	690,488円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	954,131円	2,408,866円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	36,179,079,727円	38,649,342,706円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	740,060,350円	937,399,472円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	2,660,351,109円	3,139,647,393円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	2,764,797,796円	3,204,466,039円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	323,312,556円	360,910,846円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,119,268,669円	1,178,711,664円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,049,315,773円	1,114,346,617円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	47,106,085円	40,917,509円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,171,577,546円	1,087,561,549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	25,501,335円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	38,663,041円	297,908,998円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	96,018,721円	199,184,916円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	187,463,022円	344,970,555円
投資のソムリエ	1,425,039,544円	4,315,294,876円
クルーズコントロール	742,851,962円	1,257,278,344円
投資のソムリエ<DC年金>	98,587,223円	401,357,411円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	146,987,989円	222,726,425円
DIAM DC バランス・F(成長型)	200,841,570円	277,618,478円
クルーズコントロール<DC年金>	280,295円	891,895円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	4,871,101円	12,880,608円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	14,849,802円	33,987,494円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	31,638,887円	55,644,561円
ダイナミック・ナビゲーション	2,035,658円	534,098円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	480,182,820円	935,961,743円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	563,249円	2,300,413円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	625,990円	1,690,960円

リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	150,120円	363,286円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	1,043,053円	3,177,605円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	-円	15,276,644円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	-円	133,194,060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25 VA(適格機関投資家限定)	70,701,371円	70,041,061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	14,119,938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	116,779,397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	280,053,245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	15,178,664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	64,049,107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	16,881,660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	13,764,104円
DIAM世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	31,638,558円	26,737,416円
DIAM世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	58,546,806円	55,134,608円
DIAMバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	1,078,582,552円	1,036,891,666円
DIAMバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	1,021,293,696円	979,267,957円
DIAMバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	2,792,304,258円	2,714,393,012円
DIAMグローバル・アセッ ト・バランスVA(適格機関投 資家限定)	202,887,062円	197,056,346円
DIAMグローバル・アセッ ト・バランスVA2(適格機関 投資家限定)	98,032,612円	52,699,951円

D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	599,115,283円	565,823,049円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家 向け)	1,746,402,985円	356,264,357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	10,473,598円
D I A M世界バランスファンド 55VA(適格機関投資家限 定)	39,787,583円	7,863,061円
D I A M世界バランスファンド 35VA(適格機関投資家限 定)	1,187,470,230円	51,727,826円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資 家限定)	15,107,175,247円	9,107,706,646円
D I A M世界アセットバランス ファンド40VA(適格機関投 資家限定)	541,990,149円	163,483,865円
D I A M世界アセットバランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	1,727,888,538円	1,823,334,497円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資 家限定)	9,861,006,706円	10,421,255,147円
D I A Mバランス30VA(適 格機関投資家限定)	519,843円	4,948,207円
D I A Mバランス50VA(適 格機関投資家限定)	9,093,798円	296,109円
D I A Mバランス70VA(適 格機関投資家限定)	3,718,064円	3,683,923円
D I A M世界アセットバランス ファンド4VA(適格機関投資 家限定)	8,771,394,616円	9,276,101,711円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	70,413,424円	66,616,336円
D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	27,752,854円	28,932,320円
D I A Mバランス20VA(適 格機関投資家限定)	18,240,489円	26,843,008円
D I A Mバランス40VA(適 格機関投資家限定)	15,682,249円	107,564円
D I A Mバランス60VA(適 格機関投資家限定)	109,957円	120,467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)	426,902,115円	426,124,037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)	1,323,021,834円	1,366,625,210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		1,837,729,242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		72,976,941円
	計	109,428,148,369円		115,232,523,115円
2 .	受益権の総数	109,428,148,369口		115,232,523,115口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,686,000,000円	株式	3,287,500,000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29年2月8日 至 平成30年2月7日	自 平成30年2月8日 至 平成31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30年2月7日現在	平成31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30年2月7日現在	平成31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	37,076,096,022	27,518,079,131
合計	37,076,096,022	27,518,079,131

（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31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	2,293,270,000	-	2,185,625,000	107,645,000	4,032,080,000	-	4,121,210,000	89,130,000
合計	2,293,270,000	-	2,185,625,000	107,645,000	4,032,080,000	-	4,121,210,000	89,130,000

（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。

（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30年2月7日現在	平成31年2月7日現在
1口当たり純資産額	2.6432円	2.4228円
（1万口当たり純資産額）	(26,432円)	(24,228円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成31年2月7日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,400	2,816.00	15,206,400	
日本水産	166,500	737.00	122,710,500	
マルハニチロ	24,100	3,615.00	87,121,500	
ハウスイ	900	872.00	784,800	
カネコ種苗	4,600	1,312.00	6,035,200	
サカタのタネ	20,200	3,615.00	73,023,000	
ホクト	14,000	1,958.00	27,412,000	
ホクリヨウ	2,300	611.00	1,405,300	
ヒノキヤグループ	3,500	2,035.00	7,122,500	
ショーボンドホールディングス	11,900	7,850.00	93,415,000	
ミライト・ホールディングス	46,900	1,620.00	75,978,000	
タマホーム	10,300	1,182.00	12,174,600	
サンヨーホームズ	2,500	837.00	2,092,500	
日本アクア	4,100	431.00	1,767,100	
ファーストコーポレーション	4,600	759.00	3,491,400	
ベステラ	3,200	1,335.00	4,272,000	
TATERU	20,200	295.00	5,959,000	
スペースバリューホールディングス	20,300	952.00	19,325,600	
住石ホールディングス	35,900	100.00	3,590,000	
日鉄鉱業	3,900	4,685.00	18,271,500	
三井松島ホールディングス	6,900	1,405.00	9,694,500	
国際石油開発帝石	668,600	1,015.00	678,629,000	
石油資源開発	24,000	2,072.00	49,728,000	
K&Oエナジーグループ	8,000	1,458.00	11,664,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,200	641.00	2,051,200	
第一カッター興業	1,900	1,875.00	3,562,500	
安藤・間	106,400	759.00	80,757,600	
東急建設	48,800	979.00	47,775,200	
コムシスホールディングス	59,100	2,798.00	165,361,800	
ミサワホーム	13,100	732.00	9,589,200	
ビーアールホールディングス	13,800	355.00	4,899,000	
高松コンストラクショングループ	10,300	2,781.00	28,644,300	
東建コーポレーション	5,100	6,450.00	32,895,000	
ソネック	1,800	699.00	1,258,200	
ヤマウラ	6,500	970.00	6,305,000	
大成建設	136,800	4,850.00	663,480,000	
大林組	412,300	1,017.00	419,309,100	
清水建設	420,500	925.00	388,962,500	
飛島建設	11,800	1,452.00	17,133,600	
長谷工コーポレーション	171,900	1,202.00	206,623,800	
松井建設	15,200	725.00	11,020,000	
銭高組	1,800	5,330.00	9,594,000	
鹿島建設	322,200	1,536.00	494,899,200	

不動テトラ	9,400	1,683.00	15,820,200
大末建設	4,900	945.00	4,630,500
鉄建建設	8,300	2,665.00	22,119,500
西松建設	29,600	2,562.00	75,835,200
三井住友建設	99,100	690.00	68,379,000
大豊建設	9,300	3,515.00	32,689,500
前田建設工業	98,100	1,088.00	106,732,800
佐田建設	8,800	382.00	3,361,600
ナカノフドー建設	10,500	522.00	5,481,000
奥村組	22,600	3,410.00	77,066,000
東鉄工業	16,500	2,951.00	48,691,500
イチケン	2,600	1,987.00	5,166,200
富士ビー・エス	4,300	515.00	2,214,500
浅沼組	4,900	2,964.00	14,523,600
戸田建設	159,800	704.00	112,499,200
熊谷組	19,600	3,440.00	67,424,000
青木あすなる建設	6,800	997.00	6,779,600
北野建設	2,900	3,170.00	9,193,000
植木組	1,800	2,256.00	4,060,800
矢作建設工業	18,800	731.00	13,742,800
ピーエス三菱	14,500	576.00	8,352,000
日本ハウスホールディングス	26,200	435.00	11,397,000
大東建託	49,000	15,220.00	745,780,000
新日本建設	16,400	1,094.00	17,941,600
N I P P O	36,400	2,090.00	76,076,000
東亜道路工業	2,600	3,080.00	8,008,000
前田道路	43,100	2,160.00	93,096,000
日本道路	3,800	6,370.00	24,206,000
東亜建設工業	12,100	1,432.00	17,327,200
若築建設	6,900	1,463.00	10,094,700
東洋建設	50,300	412.00	20,723,600
五洋建設	163,300	628.00	102,552,400
世紀東急工業	20,100	614.00	12,341,400
福田組	4,500	4,340.00	19,530,000
日本ドライケミカル	3,400	1,163.00	3,954,200
住友林業	97,500	1,404.00	136,890,000
日本基礎技術	14,400	338.00	4,867,200
巴コーポレーション	17,100	398.00	6,805,800
大和ハウス工業	380,800	3,381.00	1,287,484,800
ライト工業	26,400	1,360.00	35,904,000
積水ハウス	420,800	1,614.50	679,381,600
日特建設	11,800	624.00	7,363,200
北陸電気工事	6,700	901.00	6,036,700
ユアテック	22,100	902.00	19,934,200
四電工	2,000	2,667.00	5,334,000
中電工	17,600	2,283.00	40,180,800
関電工	62,600	994.00	62,224,400
きんでん	91,500	1,763.00	161,314,500
東京エネシス	14,200	1,021.00	14,498,200
トーエネック	3,800	3,245.00	12,331,000

住友電設	9,500	1,795.00	17,052,500
日本電設工業	23,500	2,268.00	53,298,000
協和エクシオ	53,800	2,706.00	145,582,800
新日本空調	11,700	1,817.00	21,258,900
日本工営	7,800	2,516.00	19,624,800
九電工	27,000	3,935.00	106,245,000
三機工業	31,600	1,129.00	35,676,400
日揮	118,400	1,620.00	191,808,000
中外炉工業	3,900	2,093.00	8,162,700
ヤマト	12,400	464.00	5,753,600
太平電業	9,300	2,463.00	22,905,900
高砂熱学工業	34,600	1,682.00	58,197,200
三晃金属工業	1,500	2,919.00	4,378,500
NECネットエスアイ	13,400	2,505.00	33,567,000
朝日工業社	2,700	3,060.00	8,262,000
明星工業	24,900	680.00	16,932,000
大気社	18,800	2,845.00	53,486,000
ダイダン	9,200	2,462.00	22,650,400
日比谷総合設備	13,100	1,821.00	23,855,100
東芝プラントシステム	29,700	1,970.00	58,509,000
日本製粉	40,900	1,852.00	75,746,800
日清製粉グループ本社	139,100	2,229.00	310,053,900
日東富士製粉	800	6,140.00	4,912,000
昭和産業	11,400	2,966.00	33,812,400
鳥越製粉	11,100	788.00	8,746,800
中部飼料	15,000	1,128.00	16,920,000
フィード・ワン	83,000	174.00	14,442,000
東洋精糖	2,100	1,038.00	2,179,800
日本甜菜製糖	7,000	1,763.00	12,341,000
三井製糖	9,700	2,886.00	27,994,200
塩水港精糖	14,400	221.00	3,182,400
日新製糖	5,800	2,037.00	11,814,600
LIFULL	40,700	683.00	27,798,100
ジェイエイシーリクルートメント	9,400	2,265.00	21,291,000
日本M&Aセンター	87,300	2,833.00	247,320,900
メンバーズ	4,000	1,397.00	5,588,000
中広	1,100	557.00	612,700
タケエイ	12,200	743.00	9,064,600
E・Jホールディングス	1,500	1,047.00	1,570,500
トラスト・テック	5,600	3,295.00	18,452,000
コシダカホールディングス	31,300	1,599.00	50,048,700
アルトナー	2,200	898.00	1,975,600
パソナグループ	14,300	1,393.00	19,919,900
CDS	2,900	1,125.00	3,262,500
リンクアンドモチベーション	21,600	905.00	19,548,000
GCA	12,000	784.00	9,408,000
エス・エム・エス	43,100	1,849.00	79,691,900
パーソルホールディングス	117,300	1,945.00	228,148,500
リニカル	6,600	1,408.00	9,292,800
クックパッド	36,700	300.00	11,010,000

エスクリ	3,200	598.00	1,913,600
アイ・ケイ・ケイ	5,800	719.00	4,170,200
森永製菓	31,000	4,545.00	140,895,000
中村屋	3,000	4,260.00	12,780,000
江崎グリコ	36,900	5,560.00	205,164,000
名糖産業	5,900	1,427.00	8,419,300
井村屋グループ	5,200	2,442.00	12,698,400
不二家	6,900	2,266.00	15,635,400
山崎製パン	100,800	2,144.00	216,115,200
第一屋製パン	2,100	1,018.00	2,137,800
モロゾフ	2,000	4,900.00	9,800,000
亀田製菓	7,600	5,150.00	39,140,000
寿スピリッツ	13,000	4,265.00	55,445,000
カルビー	56,100	3,135.00	175,873,500
森永乳業	24,600	3,150.00	77,490,000
六甲バター	9,000	1,986.00	17,874,000
ヤクルト本社	91,300	7,100.00	648,230,000
明治ホールディングス	87,200	8,270.00	721,144,000
雪印メグミルク	29,600	2,628.00	77,788,800
プリマハム	17,300	2,004.00	34,669,200
日本ハム	53,200	4,340.00	230,888,000
林兼産業	4,300	580.00	2,494,000
丸大食品	13,300	1,828.00	24,312,400
S Foods	11,100	3,940.00	43,734,000
伊藤ハム米久ホールディングス	79,300	630.00	49,959,000
学情	4,700	1,309.00	6,152,300
スタジオアリス	5,800	2,394.00	13,885,200
シミックホールディングス	6,500	1,544.00	10,036,000
システナ	43,000	1,088.00	46,784,000
NJS	2,600	1,500.00	3,900,000
デジタルアーツ	6,500	8,030.00	52,195,000
新日鉄住金ソリューションズ	18,000	2,932.00	52,776,000
総合警備保障	46,600	4,780.00	222,748,000
キューブシステム	6,400	833.00	5,331,200
いちご	153,900	375.00	57,712,500
エイジア	2,400	1,161.00	2,786,400
日本駐車場開発	145,800	160.00	23,328,000
コア	5,100	1,320.00	6,732,000
カカクコム	88,300	2,008.00	177,306,400
アイロムグループ	4,500	1,552.00	6,984,000
セントケア・ホールディング	6,400	554.00	3,545,600
サイネックス	1,800	730.00	1,314,000
ルネサンス	6,500	1,955.00	12,707,500
ディップ	18,900	1,974.00	37,308,600
SBSホールディングス	12,200	1,646.00	20,081,200
オプトホールディング	7,100	1,603.00	11,381,300
新日本科学	15,900	723.00	11,495,700
ツクイ	27,600	798.00	22,024,800
キャリアデザインセンター	3,000	1,198.00	3,594,000
ベネフィット・ワン	16,200	3,815.00	61,803,000

エムスリー	246,900	1,550.00	382,695,000
ツカダ・グローバルホールディング	7,500	615.00	4,612,500
プラス	800	586.00	468,800
アウトソーシング	61,800	1,314.00	81,205,200
ウェルネット	11,900	1,041.00	12,387,900
ワールドホールディングス	3,200	2,736.00	8,755,200
ディー・エヌ・エー	63,200	1,728.00	109,209,600
博報堂DYホールディングス	163,000	1,643.00	267,809,000
ぐるなび	16,600	686.00	11,387,600
エスアールジータカミヤ	12,200	687.00	8,381,400
ジャパンベストレスキューシステム	9,300	1,239.00	11,522,700
ファンコミュニケーションズ	32,200	573.00	18,450,600
ライク	4,600	1,001.00	4,604,600
ビジネス・ブレークスルー	4,900	333.00	1,631,700
WDBホールディングス	5,300	2,623.00	13,901,900
ティア	5,400	620.00	3,348,000
CDG	1,000	1,324.00	1,324,000
バリューコマース	7,800	1,928.00	15,038,400
インフォマート	64,300	1,190.00	76,517,000
サッポロホールディングス	45,100	2,482.00	111,938,200
アサヒグループホールディングス	257,900	4,732.00	1,220,382,800
麒麟ホールディングス	557,200	2,647.00	1,474,908,400
宝ホールディングス	92,200	1,212.00	111,746,400
オエノンホールディングス	35,200	360.00	12,672,000
養命酒製造	3,900	2,060.00	8,034,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	94,300	3,425.00	322,977,500
サントリー食品インターナショナル	82,400	4,875.00	401,700,000
ダイドーグループホールディングス	6,900	5,280.00	36,432,000
伊藤園	37,400	5,040.00	188,496,000
キーコーヒー	12,200	2,022.00	24,668,400
ユニカフェ	3,900	1,000.00	3,900,000
ジャパンフーズ	1,800	1,212.00	2,181,600
日清オイリオグループ	15,900	3,180.00	50,562,000
不二製油グループ本社	30,100	3,610.00	108,661,000
かどや製油	1,300	5,020.00	6,526,000
J・オイルミルズ	6,400	4,015.00	25,696,000
ローソン	30,600	6,670.00	204,102,000
サンエー	9,200	4,380.00	40,296,000
カワチ薬品	9,400	2,050.00	19,270,000
エービーシー・マート	18,900	6,250.00	118,125,000
ハードオフコーポレーション	4,800	818.00	3,926,400
高千穂交易	4,700	993.00	4,667,100
アスクル	12,700	2,114.00	26,847,800
ゲオホールディングス	18,400	1,614.00	29,697,600
アダストリア	16,700	1,914.00	31,963,800
ジーフット	7,400	672.00	4,972,800
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,500	755.00	1,132,500
伊藤忠食品	2,900	4,780.00	13,862,000
くらコーポレーション	7,100	5,540.00	39,334,000

キャンドウ	5,700	1,540.00	8,778,000
エレマテック	5,600	1,829.00	10,242,400
パルグループホールディングス	6,200	3,035.00	18,817,000
JALUX	3,400	2,490.00	8,466,000
エディオン	51,100	980.00	50,078,000
あらた	6,700	4,345.00	29,111,500
サーラコーポレーション	24,500	571.00	13,989,500
ワッツ	4,100	728.00	2,984,800
トーメンデバイス	1,900	2,391.00	4,542,900
ハローズ	4,600	2,279.00	10,483,400
J Pホールディングス	33,500	296.00	9,916,000
あみやき亭	2,700	3,560.00	9,612,000
東京エレクトロン デバイス	4,400	1,836.00	8,078,400
ひらまつ	24,100	340.00	8,194,000
フィールズ	10,500	639.00	6,709,500
双日	667,400	412.00	274,968,800
アルフレッサ ホールディングス	134,300	2,969.00	398,736,700
大黒天物産	2,800	3,990.00	11,172,000
ハニーズホールディングス	11,800	947.00	11,174,600
ファーマライズホールディングス	2,700	561.00	1,514,700
キッコーマン	81,300	5,150.00	418,695,000
味の素	271,900	1,652.50	449,314,750
キューピー	68,600	2,487.00	170,608,200
ハウス食品グループ本社	47,000	3,985.00	187,295,000
カゴメ	49,400	2,822.00	139,406,800
焼津水産化学工業	6,100	1,079.00	6,581,900
アリアケジャパン	11,300	7,010.00	79,213,000
ピエトロ	1,600	1,635.00	2,616,000
エバラ食品工業	2,600	2,183.00	5,675,800
ニチレイ	64,000	2,672.00	171,008,000
横浜冷凍	31,700	932.00	29,544,400
東洋水産	63,300	4,080.00	258,264,000
イートアンド	4,300	1,635.00	7,030,500
大冷	1,500	1,737.00	2,605,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,300	660.00	2,178,000
日清食品ホールディングス	52,400	7,310.00	383,044,000
永谷園ホールディングス	6,600	2,412.00	15,919,200
一正蒲鉾	4,900	1,037.00	5,081,300
フジッコ	13,400	2,274.00	30,471,600
ロック・フィールド	13,400	1,537.00	20,595,800
日本たばこ産業	711,100	2,726.50	1,938,814,150
ケンコーマヨネーズ	6,900	2,108.00	14,545,200
わらべや日洋ホールディングス	8,000	1,874.00	14,992,000
なとり	6,900	1,625.00	11,212,500
イフジ産業	2,100	660.00	1,386,000
ピクルスコーポレーション	3,000	2,026.00	6,078,000
北の達人コーポレーション	48,400	407.00	19,698,800
ユーグレナ	48,900	595.00	29,095,500
片倉工業	14,800	1,162.00	17,197,600
グンゼ	8,000	5,180.00	41,440,000

ヒューリック	252,600	1,000.00	252,600,000
神栄	1,600	756.00	1,209,600
ラサ商事	6,500	843.00	5,479,500
アルペン	9,300	1,650.00	15,345,000
ハブ	3,900	942.00	3,673,800
ラクーンホールディングス	7,100	665.00	4,721,500
クオールホールディングス	17,700	1,427.00	25,257,900
アルコニックス	12,800	1,134.00	14,515,200
神戸物産	18,300	3,505.00	64,141,500
ソリトンシステムズ	6,800	837.00	5,691,600
ジンズ	8,100	5,240.00	42,444,000
ビックカメラ	64,500	1,236.00	79,722,000
DCMホールディングス	65,100	1,114.00	72,521,400
ペッパーフードサービス	9,500	2,572.00	24,434,000
MonotaRO	76,300	2,394.00	182,662,200
東京一番フーズ	2,500	595.00	1,487,500
DDホールディングス	2,700	2,055.00	5,548,500
あいホールディングス	17,200	1,972.00	33,918,400
ディービーエックス	4,200	1,115.00	4,683,000
きちりホールディングス	3,100	696.00	2,157,600
アークランドサービスホールディングス	8,900	2,050.00	18,245,000
J.フロントリテイリング	154,500	1,210.00	186,945,000
ドトール・日レスホールディングス	21,200	2,103.00	44,583,600
マツモトキヨシホールディングス	50,000	3,345.00	167,250,000
ブロンコビリー	6,300	2,590.00	16,317,000
ZOZO	130,600	1,795.00	234,427,000
トレジャー・ファクトリー	3,700	781.00	2,889,700
物語コーポレーション	3,400	9,460.00	32,164,000
ココカラファイン	13,600	4,840.00	65,824,000
三越伊勢丹ホールディングス	225,900	1,068.00	241,261,200
東洋紡	50,800	1,630.00	82,804,000
ユニチカ	35,200	491.00	17,283,200
富士紡ホールディングス	6,300	2,805.00	17,671,500
日清紡ホールディングス	68,100	927.00	63,128,700
倉敷紡績	11,500	2,359.00	27,128,500
ダイワボウホールディングス	11,000	5,990.00	65,890,000
シキボウ	6,300	1,040.00	6,552,000
日東紡績	18,300	1,925.00	35,227,500
トヨタ紡織	42,900	1,768.00	75,847,200
マクニカ・富士エレホールディングス	33,500	1,539.00	51,556,500
Hamee	3,100	814.00	2,523,400
ラクト・ジャパン	2,700	8,470.00	22,869,000
ウエルシアホールディングス	32,000	4,070.00	130,240,000
クリエイトSDホールディングス	17,700	2,758.00	48,816,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,900	1,086.00	24,869,400
八洲電機	9,500	826.00	7,847,000
メディアスホールディングス	6,700	679.00	4,549,300
UKCホールディングス	7,700	2,003.00	15,423,100

ジュテックホールディングス	2,700	1,006.00	2,716,200
丸善CHIホールディングス	14,500	323.00	4,683,500
大光	3,000	606.00	1,818,000
OCHIホールディングス	3,400	1,139.00	3,872,600
TOKAIホールディングス	63,900	887.00	56,679,300
黒谷	2,000	490.00	980,000
ミサワ	2,400	405.00	972,000
ティーライフ	1,600	892.00	1,427,200
Cominix	1,900	824.00	1,565,600
エー・ピーカンパニー	2,300	458.00	1,053,400
三洋貿易	6,100	1,800.00	10,980,000
チムニー	3,800	2,524.00	9,591,200
シュッピン	8,100	729.00	5,904,900
ビューティガレージ	1,800	1,585.00	2,853,000
ウイン・パートナーズ	7,800	1,083.00	8,447,400
ネクステージ	18,600	929.00	17,279,400
ジョイフル本田	35,400	1,372.00	48,568,800
鳥貴族	4,000	1,756.00	7,024,000
キリン堂ホールディングス	4,800	1,437.00	6,897,600
ホットランド	6,300	1,260.00	7,938,000
すかいらーくホールディングス	112,600	1,814.00	204,256,400
綿半ホールディングス	4,500	2,023.00	9,103,500
日本毛織	39,400	861.00	33,923,400
ダイトウボウ	19,000	86.00	1,634,000
トーア紡コーポレーション	5,000	453.00	2,265,000
ダイドーリミテッド	15,000	345.00	5,175,000
ヨシックス	2,000	3,030.00	6,060,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	35,200	1,175.00	41,360,000
三栄建築設計	4,900	1,674.00	8,202,600
スター・マイカ	5,500	1,458.00	8,019,000
野村不動産ホールディングス	80,600	2,146.00	172,967,600
三重交通グループホールディングス	24,600	612.00	15,055,200
サムティ	16,700	1,494.00	24,949,800
ディア・ライフ	15,400	451.00	6,945,400
コーセーアールイー	3,700	755.00	2,793,500
エー・ディー・ワークス	171,500	34.00	5,831,000
日本商業開発	7,500	1,519.00	11,392,500
プレサンスコーポレーション	19,100	1,532.00	29,261,200
ユニゾホールディングス	18,300	2,176.00	39,820,800
THEグローバル社	5,500	490.00	2,695,000
日本管理センター	7,900	862.00	6,809,800
サンセイランディック	3,200	785.00	2,512,000
エストラスト	1,600	768.00	1,228,800
フージャースホールディングス	27,000	672.00	18,144,000
オープンハウス	19,700	4,540.00	89,438,000
東急不動産ホールディングス	325,400	606.00	197,192,400
飯田グループホールディングス	101,000	2,008.00	202,808,000
イーグランド	1,800	681.00	1,225,800
ムゲンエステート	8,500	590.00	5,015,000

帝国繊維	13,500	2,490.00	33,615,000
日本コークス工業	104,200	100.00	10,420,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,900	680.00	3,332,000
ミタチ産業	2,900	729.00	2,114,100
B E E N O S	2,800	1,082.00	3,029,600
あさひ	10,000	1,508.00	15,080,000
日本調剤	4,300	3,910.00	16,813,000
コスモス薬品	5,300	20,720.00	109,816,000
シップヘルスケアホールディングス	25,100	4,115.00	103,286,500
トーエル	5,800	691.00	4,007,800
ソフトクリエイイトホールディングス	5,200	1,491.00	7,753,200
オンリー	2,200	1,008.00	2,217,600
セブン&アイ・ホールディングス	506,600	4,768.00	2,415,468,800
薬王堂	5,200	2,523.00	13,119,600
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	32,600	1,240.00	40,424,000
明治電機工業	3,900	1,785.00	6,961,500
ツルハホールディングス	26,200	9,900.00	259,380,000
デリカフーズホールディングス	2,200	1,355.00	2,981,000
スターティアホールディングス	2,400	596.00	1,430,400
サンマルクホールディングス	9,500	2,492.00	23,674,000
フェリシモ	2,700	1,084.00	2,926,800
トリドールホールディングス	14,900	1,969.00	29,338,100
帝人	98,000	1,821.00	178,458,000
東レ	932,200	796.90	742,870,180
クラレ	202,900	1,636.00	331,944,400
旭化成	855,000	1,153.50	986,242,500
サカイオーベックス	3,000	1,963.00	5,889,000
T O K Y O B A S E	10,700	862.00	9,223,400
稲葉製作所	6,900	1,226.00	8,459,400
宮地エンジニアリンググループ	3,800	2,009.00	7,634,200
トーカロ	31,300	929.00	29,077,700
アルファ	4,300	1,283.00	5,516,900
S U M C O	134,100	1,571.00	210,671,100
川田テクノロジーズ	2,700	6,810.00	18,387,000
R S T e c h n o l o g i e s	2,500	2,994.00	7,485,000
ビーロッド	2,000	1,277.00	2,554,000
ファーストブラザーズ	3,300	1,067.00	3,521,100
ハウスドゥ	4,500	1,678.00	7,551,000
シーアールイー	4,000	903.00	3,612,000
プロパティエージェント	1,100	1,182.00	1,300,200
ケイアイスター不動産	3,200	1,904.00	6,092,800
アグレ都市デザイン	1,500	610.00	915,000
グッドコムアセット	2,200	1,545.00	3,399,000
ジェイ・エス・ビー	400	3,925.00	1,570,000
住江織物	3,200	2,506.00	8,019,200
日本フェルト	6,600	446.00	2,943,600
イチカワ	1,800	1,372.00	2,469,600
エコナックホールディングス	22,200	121.00	2,686,200
日東製網	1,400	1,280.00	1,792,000

芦森工業	2,600	1,488.00	3,868,800
アツギ	10,000	952.00	9,520,000
ウイルプラスホールディングス	1,100	767.00	843,700
ジャパンミート	4,600	1,693.00	7,787,800
コメダホールディングス	27,700	2,108.00	58,391,600
サツドラホールディングス	2,000	1,833.00	3,666,000
デファクトスタンダード	700	396.00	277,200
ダイユー・リックホールディングス	6,500	981.00	6,376,500
パロックジャパンリミテッド	9,700	905.00	8,778,500
クスリのアオキホールディングス	12,000	7,210.00	86,520,000
ダイニック	4,700	738.00	3,468,600
共和レザー	7,500	729.00	5,467,500
力の源ホールディングス	3,400	780.00	2,652,000
スシローグローバルホールディングス	13,300	6,500.00	86,450,000
L I X I L ビバ	10,200	1,469.00	14,983,800
セーレン	29,500	1,880.00	55,460,000
ソトー	4,600	934.00	4,296,400
東海染工	1,800	995.00	1,791,000
小松マテーレ	19,700	765.00	15,070,500
ワコールホールディングス	35,000	2,738.00	95,830,000
ホギメディカル	14,900	3,720.00	55,428,000
レナウン	35,000	99.00	3,465,000
クラウディアホールディングス	2,900	474.00	1,374,600
T S Iホールディングス	44,300	694.00	30,744,200
マツオカコーポレーション	3,900	2,621.00	10,221,900
ワールド	12,400	1,943.00	24,093,200
T I S	40,100	4,985.00	199,898,500
ネオス	4,100	1,034.00	4,239,400
電算システム	4,600	2,394.00	11,012,400
グリー	83,100	458.00	38,059,800
コーエーテクモホールディングス	24,600	1,818.00	44,722,800
三菱総合研究所	4,700	3,265.00	15,345,500
ボルテージ	2,400	567.00	1,360,800
電算	1,300	2,152.00	2,797,600
A G S	6,800	669.00	4,549,200
ファインデックス	10,100	672.00	6,787,200
ヒト・コミュニケーションズ	2,800	1,568.00	4,390,400
ブレインパッド	2,600	5,150.00	13,390,000
K L a b	21,400	853.00	18,254,200
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	16,000	867.00	13,872,000
イーブックイニシアティブジャパン	2,000	1,527.00	3,054,000
ネクソン	306,600	1,670.00	512,022,000
アイスタイル	30,600	824.00	25,214,400
エムアップ	4,200	1,784.00	7,492,800
エイチーム	7,500	1,808.00	13,560,000
テクノスジャパン	10,100	771.00	7,787,100
e n i s h	4,200	486.00	2,041,200
コロブラ	34,300	706.00	24,215,800
オルトプラス	7,300	319.00	2,328,700

ブロードリーフ	59,700	566.00	33,790,200
クロス・マーケティンググループ	3,300	360.00	1,188,000
デジタルハーツホールディングス	5,400	1,413.00	7,630,200
メディアドゥホールディングス	3,500	2,315.00	8,102,500
じげん	12,800	574.00	7,347,200
ビキューブ	6,300	366.00	2,305,800
サイバーリンクス	1,900	1,022.00	1,941,800
ディー・エル・イー	7,500	148.00	1,110,000
フィックスターズ	11,500	1,405.00	16,157,500
CARTA HOLDINGS	6,400	1,055.00	6,752,000
オプティム	2,700	4,560.00	12,312,000
セレス	4,000	1,510.00	6,040,000
特種東海製紙	7,600	4,005.00	30,438,000
ベリサーブ	1,100	6,680.00	7,348,000
ティーガイア	12,100	1,986.00	24,030,600
セック	2,000	3,720.00	7,440,000
日本アジアグループ	12,800	359.00	4,595,200
豆蔵ホールディングス	8,100	1,040.00	8,424,000
テクマトリックス	8,600	1,959.00	16,847,400
プロシップ	3,600	1,310.00	4,716,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	290,200	315.00	91,413,000
GMOペイメントゲートウェイ	19,800	5,590.00	110,682,000
ザッパラス	5,900	372.00	2,194,800
システムリサーチ	1,600	3,050.00	4,880,000
インターネットイニシアティブ	19,600	2,686.00	52,645,600
さくらインターネット	14,400	470.00	6,768,000
ヴィンクス	4,100	1,262.00	5,174,200
GMOクラウド	2,700	3,520.00	9,504,000
SRAホールディングス	6,400	2,616.00	16,742,400
MINORIソリューションズ	2,400	1,650.00	3,960,000
システムインテグレータ	3,400	756.00	2,570,400
朝日ネット	10,100	514.00	5,191,400
eBASE	3,700	1,724.00	6,378,800
アバント	3,200	1,333.00	4,265,600
アドソル日進	4,300	1,691.00	7,271,300
フリービット	7,900	936.00	7,394,400
コムチュア	6,700	2,969.00	19,892,300
サイバーコム	2,200	2,342.00	5,152,400
アステリア	5,900	844.00	4,979,600
王子ホールディングス	541,000	610.00	330,010,000
日本製紙	57,500	2,055.00	118,162,500
三菱製紙	19,700	529.00	10,421,300
北越コーポレーション	79,700	596.00	47,501,200
中越バルブ工業	5,100	1,338.00	6,823,800
巴川製紙所	4,100	1,025.00	4,202,500
大王製紙	58,500	1,415.00	82,777,500
阿波製紙	3,000	472.00	1,416,000
マークライنز	4,200	1,453.00	6,102,600
メディカル・データ・ビジョン	10,600	967.00	10,250,200

g u m i	13,900	640.00	8,896,000
ショーケース・ティービー	2,600	685.00	1,781,000
モバイルファクトリー	3,300	1,633.00	5,388,900
テラスカイ	700	4,090.00	2,863,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,300	1,307.00	6,927,100
P C Iホールディングス	2,200	2,329.00	5,123,800
パイブドHD	2,000	890.00	1,780,000
アイビーシー	2,000	1,287.00	2,574,000
ネオジャパン	2,300	957.00	2,201,100
P R T I M E S	700	2,322.00	1,625,400
ランドコンピュータ	1,400	1,024.00	1,433,600
ダブルスタンダード	700	3,710.00	2,597,000
オープンドア	5,900	2,831.00	16,702,900
マイネット	3,900	1,709.00	6,665,100
アカツキ	4,300	5,920.00	25,456,000
ベネフィットジャパン	600	846.00	507,600
U b i c o mホールディングス	2,200	1,287.00	2,831,400
L I N E	36,600	4,050.00	148,230,000
カナミックネットワーク	1,900	1,827.00	3,471,300
ノムラシステムコーポレーション	900	748.00	673,200
レンゴー	124,000	926.00	114,824,000
トーモク	7,400	1,590.00	11,766,000
ザ・バック	9,100	3,075.00	27,982,500
チェンジ	1,500	4,170.00	6,255,000
シンクロ・フード	5,100	660.00	3,366,000
オークネット	6,300	955.00	6,016,500
A O I T Y O H O L D I N G S	13,100	825.00	10,807,500
マクロミル	21,300	1,544.00	32,887,200
ビーグリー	2,300	900.00	2,070,000
オロ	1,100	4,730.00	5,203,000
昭和電工	79,800	3,580.00	285,684,000
住友化学	946,000	548.00	518,408,000
住友精化	5,800	4,270.00	24,766,000
日産化学	73,800	5,540.00	408,852,000
ラサ工業	4,300	1,377.00	5,921,100
クレハ	11,100	6,680.00	74,148,000
多木化学	3,400	5,410.00	18,394,000
テイカ	9,800	2,005.00	19,649,000
石原産業	23,200	1,095.00	25,404,000
片倉コープアグリ	3,000	1,169.00	3,507,000
日東エフシー	7,700	764.00	5,882,800
日本曹達	19,000	2,972.00	56,468,000
東ソー	185,700	1,571.00	291,734,700
トクヤマ	34,600	2,832.00	97,987,200
セントラル硝子	26,200	2,511.00	65,788,200
東亜合成	75,400	1,268.00	95,607,200
大阪ソーダ	12,900	2,534.00	32,688,600
関東電化工業	28,500	897.00	25,564,500
デンカ	47,200	3,330.00	157,176,000

イビデン	75,100	1,453.00	109,120,300
信越化学工業	211,800	9,244.00	1,957,879,200
日本カーバイド工業	4,100	1,739.00	7,129,900
堺化学工業	7,900	2,312.00	18,264,800
第一稀元素化学工業	9,800	902.00	8,839,600
エア・ウォーター	98,500	1,825.00	179,762,500
大陽日酸	99,000	1,584.00	156,816,000
日本化学工業	4,100	2,615.00	10,721,500
東邦アセチレン	1,900	1,358.00	2,580,200
日本パーカライズン	65,600	1,373.00	90,068,800
高圧ガス工業	19,200	762.00	14,630,400
チタン工業	1,500	2,513.00	3,769,500
四国化成工業	20,200	1,281.00	25,876,200
戸田工業	2,600	2,242.00	5,829,200
ステラ ケミファ	7,000	2,966.00	20,762,000
保土谷化学工業	4,200	2,796.00	11,743,200
日本触媒	20,200	7,450.00	150,490,000
大日精化工業	9,900	2,958.00	29,284,200
カネカ	32,000	4,310.00	137,920,000
協和発酵キリン	153,700	2,158.00	331,684,600
三菱瓦斯化学	123,700	1,759.00	217,588,300
三井化学	109,000	2,756.00	300,404,000
J S R	120,600	1,807.00	217,924,200
東京応化工業	20,600	3,175.00	65,405,000
大阪有機化学工業	11,100	1,148.00	12,742,800
三菱ケミカルホールディングス	803,400	846.50	680,078,100
K Hネオケム	18,300	2,628.00	48,092,400
ダイセル	186,700	1,067.00	199,208,900
住友ベークライト	20,800	4,095.00	85,176,000
積水化学工業	262,600	1,693.00	444,581,800
日本ゼオン	108,400	1,127.00	122,166,800
アイカ工業	36,000	3,795.00	136,620,000
宇部興産	60,600	2,511.00	152,166,600
積水樹脂	19,800	2,057.00	40,728,600
タキロンシーアイ	26,000	613.00	15,938,000
旭有機材	8,300	1,626.00	13,495,800
日立化成	55,500	1,922.00	106,671,000
ニチバン	6,300	2,045.00	12,883,500
リケンテクノス	32,900	451.00	14,837,900
大倉工業	6,200	1,853.00	11,488,600
積水化成品工業	17,800	951.00	16,927,800
群栄化学工業	2,900	2,668.00	7,737,200
タイガースポリマー	6,500	575.00	3,737,500
ミライアル	3,500	1,141.00	3,993,500
ダイキアクシス	4,300	964.00	4,145,200
ダイキョーニシカワ	25,400	1,170.00	29,718,000
竹本容器	4,300	1,408.00	6,054,400
森六ホールディングス	6,500	2,545.00	16,542,500
日本化薬	76,400	1,284.00	98,097,600
カーリットホールディングス	12,800	812.00	10,393,600

E P Sホールディングス	17,600	1,739.00	30,606,400
ソルクシーズ	5,100	665.00	3,391,500
レグス	2,900	960.00	2,784,000
プレステージ・インターナショナル	22,000	1,317.00	28,974,000
フェイス	4,200	861.00	3,616,200
ハイマックス	1,500	1,792.00	2,688,000
アミューズ	7,100	2,533.00	17,984,300
野村総合研究所	76,500	4,165.00	318,622,500
ドリームインキュベータ	3,500	1,473.00	5,155,500
サイバネットシステム	9,900	640.00	6,336,000
クイック	7,200	1,605.00	11,556,000
T A C	6,800	234.00	1,591,200
C Eホールディングス	3,200	710.00	2,272,000
ケネディクス	103,000	597.00	61,491,000
日本システム技術	2,000	1,506.00	3,012,000
電通	142,900	5,030.00	718,787,000
インテージホールディングス	15,400	882.00	13,582,800
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,500	1,974.00	8,883,000
東邦システムサイエンス	3,700	910.00	3,367,000
ぴあ	3,300	3,925.00	12,952,500
イオンファンタジー	3,800	2,625.00	9,975,000
ソースネクスト	46,400	561.00	26,030,400
シーティーエス	13,300	653.00	8,684,900
ネクシィーズグループ	3,700	1,697.00	6,278,900
インフォコム	4,900	3,900.00	19,110,000
メディカルシステムネットワーク	12,900	452.00	5,830,800
日本精化	9,700	1,120.00	10,864,000
扶桑化学工業	12,200	2,061.00	25,144,200
トリケミカル研究所	2,700	4,770.00	12,879,000
F I G	10,600	337.00	3,572,200
A D E K A	59,300	1,696.00	100,572,800
日油	46,200	3,585.00	165,627,000
ミヨシ油脂	5,000	1,048.00	5,240,000
新日本理化	21,900	191.00	4,182,900
ハリマ化成グループ	10,000	1,096.00	10,960,000
アルテリア・ネットワークス	9,900	1,241.00	12,285,900
花王	297,900	8,049.00	2,397,797,100
第一工業製薬	4,500	2,803.00	12,613,500
石原ケミカル	3,100	1,774.00	5,499,400
日華化学	4,000	949.00	3,796,000
ニイタカ	1,900	1,498.00	2,846,200
三洋化成工業	8,000	5,090.00	40,720,000
武田薬品工業	777,500	4,457.00	3,465,317,500
アステラス製薬	1,131,400	1,661.00	1,879,255,400
大日本住友製薬	91,000	2,593.00	235,963,000
塩野義製薬	160,600	6,631.00	1,064,938,600
田辺三菱製薬	128,300	1,611.00	206,691,300
わかもと製薬	14,300	271.00	3,875,300
あすか製薬	15,100	1,227.00	18,527,700
日本新薬	32,100	7,200.00	231,120,000

Bioフェルミン製薬	2,000	2,390.00	4,780,000
中外製薬	127,900	6,910.00	883,789,000
科研製薬	22,200	5,400.00	119,880,000
エーザイ	146,800	8,611.00	1,264,094,800
理研ビタミン	5,800	3,490.00	20,242,000
ロート製薬	62,900	2,956.00	185,932,400
小野薬品工業	289,900	2,264.00	656,333,600
久光製薬	36,200	5,460.00	197,652,000
有機合成薬品工業	8,300	208.00	1,726,400
持田製薬	9,300	9,980.00	92,814,000
参天製薬	232,600	1,487.00	345,876,200
扶桑薬品工業	4,200	2,527.00	10,613,400
日本ケミファ	1,600	3,020.00	4,832,000
ツムラ	38,100	3,225.00	122,872,500
日医工	30,100	1,627.00	48,972,700
テルモ	173,600	6,130.00	1,064,168,000
みらかホールディングス	32,900	2,878.00	94,686,200
キッセイ薬品工業	21,800	2,878.00	62,740,400
生化学工業	23,800	1,276.00	30,368,800
栄研化学	21,600	2,461.00	53,157,600
日水製薬	5,200	1,168.00	6,073,600
鳥居薬品	6,600	2,155.00	14,223,000
JCRファーマ	8,700	5,800.00	50,460,000
東和薬品	5,800	7,750.00	44,950,000
富士製薬工業	8,300	1,819.00	15,097,700
沢井製薬	25,100	5,460.00	137,046,000
ゼリア新薬工業	24,300	1,906.00	46,315,800
第一三共	351,100	3,604.00	1,265,364,400
キョーリン製薬ホールディングス	27,000	2,249.00	60,723,000
大幸薬品	5,400	1,744.00	9,417,600
ダイト	7,100	2,810.00	19,951,000
大塚ホールディングス	233,700	4,424.00	1,033,888,800
大正製薬ホールディングス	27,400	10,920.00	299,208,000
ペプチドリーム	61,200	4,745.00	290,394,000
大日本塗料	13,700	1,050.00	14,385,000
日本ペイントホールディングス	99,100	3,710.00	367,661,000
関西ペイント	135,000	1,907.00	257,445,000
神東塗料	9,400	172.00	1,616,800
中国塗料	39,400	955.00	37,627,000
日本特殊塗料	9,000	1,275.00	11,475,000
藤倉化成	16,400	565.00	9,266,000
太陽ホールディングス	9,900	3,490.00	34,551,000
DIC	54,400	3,470.00	188,768,000
サカタインクス	26,200	1,230.00	32,226,000
東洋インキS Cホールディングス	25,400	2,419.00	61,442,600
T & K TOKA	9,400	991.00	9,315,400
アルプス技研	10,200	1,813.00	18,492,600
サニックス	20,500	206.00	4,223,000
ダイオーズ	2,800	1,296.00	3,628,800
日本空調サービス	13,400	646.00	8,656,400

オリエンタルランド	138,600	11,605.00	1,608,453,000
フォーカスシステムズ	8,000	1,041.00	8,328,000
ダスキン	31,600	2,517.00	79,537,200
パーク24	70,600	2,608.00	184,124,800
明光ネットワークジャパン	14,800	917.00	13,571,600
ファルコホールディングス	6,500	1,434.00	9,321,000
クレスコ	3,700	3,530.00	13,061,000
フジ・メディア・ホールディングス	124,900	1,599.00	199,715,100
秀英予備校	2,500	486.00	1,215,000
田谷	2,100	627.00	1,316,700
ラウンドワン	36,300	1,294.00	46,972,200
リゾートトラスト	49,600	1,571.00	77,921,600
オービック	41,800	10,220.00	427,196,000
ジャストシステム	17,100	2,323.00	39,723,300
TDCソフト	10,500	873.00	9,166,500
ヤフー	785,100	311.00	244,166,100
ビー・エム・エル	15,100	3,105.00	46,885,500
ワタベウェディング	1,900	666.00	1,265,400
トレンドマイクロ	64,200	5,650.00	362,730,000
りらいあコミュニケーションズ	21,200	915.00	19,398,000
インフォメーション・ディベロプメント	3,400	1,486.00	5,052,400
リソー教育	59,500	464.00	27,608,000
日本オラクル	24,400	8,070.00	196,908,000
早稲田アカデミー	1,600	1,808.00	2,892,800
アルファシステムズ	4,000	2,602.00	10,408,000
フューチャー	16,300	1,758.00	28,655,400
CAC Holdings	9,100	961.00	8,745,100
ソフトバンク・テクノロジー	5,100	2,134.00	10,883,400
トーセ	3,300	824.00	2,719,200
ユー・エス・エス	143,300	1,929.00	276,425,700
オービックビジネスコンサルタント	12,400	4,005.00	49,662,000
伊藤忠テクノソリューションズ	54,900	2,515.00	138,073,500
アイティフォー	14,600	826.00	12,059,600
東京個別指導学院	4,200	1,331.00	5,590,200
東計電算	1,800	3,020.00	5,436,000
サイバーエージェント	72,300	3,135.00	226,660,500
楽天	546,600	809.00	442,199,400
エクスネット	2,300	846.00	1,945,800
クリーク・アンド・リバー社	6,800	1,145.00	7,786,000
テー・オー・ダブリュー	11,200	727.00	8,142,400
大塚商会	65,100	4,025.00	262,027,500
サイボウズ	14,100	634.00	8,939,400
ソフトブレーン	9,500	511.00	4,854,500
セントラルスポーツ	4,400	3,375.00	14,850,000
バラカ	3,100	1,699.00	5,266,900
電通国際情報サービス	7,400	3,200.00	23,680,000
デジタルガレージ	23,500	2,846.00	66,881,000
イーエムシステムズ	9,700	1,125.00	10,912,500
ウェザーニューズ	4,100	2,916.00	11,955,600

C I J	9,500	807.00	7,666,500
東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	1,915.00	2,106,500
日本エンタープライズ	12,700	181.00	2,298,700
WOWOW	5,700	2,887.00	16,455,900
スカラ	9,700	743.00	7,207,100
フルキャストホールディングス	11,800	1,963.00	23,163,400
エン・ジャパン	12,800	4,285.00	54,848,000
富士フイルムホールディングス	254,800	4,664.00	1,188,387,200
コニカミノルタ	268,100	1,069.00	286,598,900
資生堂	243,800	7,200.00	1,755,360,000
ライオン	171,000	2,373.00	405,783,000
高砂香料工業	8,500	3,515.00	29,877,500
マンダム	27,600	2,645.00	73,002,000
ミルボン	15,100	4,540.00	68,554,000
ファンケル	54,600	2,388.00	130,384,800
コーセー	20,800	17,080.00	355,264,000
コタ	5,800	1,455.00	8,439,000
シーボン	1,400	2,661.00	3,725,400
ポーラ・オルビスホールディングス	52,400	3,305.00	173,182,000
ノエビアホールディングス	7,700	5,140.00	39,578,000
アジュバンコスメジャパン	2,800	954.00	2,671,200
エステー	8,800	1,820.00	16,016,000
アグロ カネショウ	5,000	2,154.00	10,770,000
コニシ	21,800	1,793.00	39,087,400
長谷川香料	14,600	1,610.00	23,506,000
星光PMC	8,100	769.00	6,228,900
小林製薬	34,400	8,250.00	283,800,000
荒川化学工業	11,100	1,304.00	14,474,400
メック	8,500	1,114.00	9,469,000
日本高純度化学	3,200	2,230.00	7,136,000
タカラバイオ	32,100	2,335.00	74,953,500
J C U	15,900	1,768.00	28,111,200
新田ゼラチン	7,700	691.00	5,320,700
O A T アグリオ	1,800	2,109.00	3,796,200
デクセリアルズ	31,600	790.00	24,964,000
アース製薬	9,300	5,170.00	48,081,000
北興化学工業	12,800	527.00	6,745,600
大成ラミック	3,700	2,824.00	10,448,800
クミアイ化学工業	50,700	667.00	33,816,900
日本農薬	29,400	484.00	14,229,600
昭和シェル石油	113,500	1,573.00	178,535,500
富士興産	4,600	642.00	2,953,200
ニチレキ	15,800	1,050.00	16,590,000
ユシロ化学工業	6,400	1,229.00	7,865,600
ビービー・カストロール	4,400	1,341.00	5,900,400
富士石油	29,700	301.00	8,939,700
M O R E S C O	4,500	1,621.00	7,294,500
出光興産	95,100	3,705.00	352,345,500
J X T Gホールディングス	2,063,900	571.00	1,178,486,900
コスモエネルギーホールディングス	35,500	2,384.00	84,632,000

横浜ゴム	71,200	2,294.00	163,332,800
TOYO TIRE	63,000	1,496.00	94,248,000
ブリヂストン	377,100	4,172.00	1,573,261,200
住友ゴム工業	110,200	1,512.00	166,622,400
藤倉ゴム工業	10,900	455.00	4,959,500
オカモト	8,600	5,730.00	49,278,000
アキレス	9,000	2,047.00	18,423,000
フコク	5,500	861.00	4,735,500
ニッタ	13,900	3,750.00	52,125,000
クリエートメディック	4,200	960.00	4,032,000
住友理工	23,900	1,017.00	24,306,300
三ツ星ベルト	16,200	2,077.00	33,647,400
バンドー化学	23,500	1,132.00	26,602,000
A G C	121,400	3,865.00	469,211,000
日本板硝子	58,600	934.00	54,732,400
石塚硝子	1,600	1,828.00	2,924,800
有沢製作所	19,300	833.00	16,076,900
日本山村硝子	5,200	1,496.00	7,779,200
日本電気硝子	53,100	2,875.00	152,662,500
オハラ	4,800	1,649.00	7,915,200
住友大阪セメント	24,700	4,810.00	118,807,000
太平洋セメント	77,400	3,730.00	288,702,000
リソルホールディングス	1,300	4,180.00	5,434,000
日本ヒューム	12,400	785.00	9,734,000
日本コンクリート工業	26,600	274.00	7,288,400
三谷セキサン	5,700	2,625.00	14,962,500
アジアパイルホールディングス	17,300	645.00	11,158,500
東海カーボン	111,400	1,477.00	164,537,800
日本カーボン	5,800	4,190.00	24,302,000
東洋炭素	7,200	2,389.00	17,200,800
ノリタケカンパニーリミテド	7,300	5,130.00	37,449,000
TOTO	94,400	4,335.00	409,224,000
日本碍子	149,700	1,617.00	242,064,900
日本特殊陶業	103,500	2,222.00	229,977,000
ダントーホールディングス	9,400	118.00	1,109,200
MARUWA	4,300	5,930.00	25,499,000
品川リフラクトリーズ	3,200	3,655.00	11,696,000
黒崎播磨	2,500	5,440.00	13,600,000
ヨータイ	10,700	700.00	7,490,000
イソライト工業	6,300	640.00	4,032,000
東京窯業	15,700	381.00	5,981,700
ニッカトー	5,500	948.00	5,214,000
フジミインコーポレーテッド	11,000	2,301.00	25,311,000
クニミネ工業	4,200	813.00	3,414,600
エーアンドエーマテリアル	2,600	1,014.00	2,636,400
ニチアス	33,600	1,991.00	66,897,600
新日鐵住金	563,900	2,037.50	1,148,946,250
神戸製鋼所	222,000	875.00	194,250,000
中山製鋼所	16,800	470.00	7,896,000
合同製鐵	5,800	1,746.00	10,126,800

ジェイ エフ イー ホールディングス	327,700	1,919.00	628,856,300
東京製鐵	64,900	909.00	58,994,100
共英製鋼	13,700	1,603.00	21,961,100
大和工業	25,800	2,927.00	75,516,600
東京鐵鋼	5,000	1,185.00	5,925,000
大阪製鐵	8,000	1,912.00	15,296,000
淀川製鋼所	16,400	2,166.00	35,522,400
丸一鋼管	43,000	3,465.00	148,995,000
モリ工業	3,700	2,404.00	8,894,800
大同特殊鋼	19,800	4,375.00	86,625,000
日本高周波鋼業	4,600	545.00	2,507,000
日本冶金工業	100,300	242.00	24,272,600
山陽特殊製鋼	15,200	2,353.00	35,765,600
愛知製鋼	6,800	3,435.00	23,358,000
日立金属	130,800	1,097.00	143,487,600
日本金属	2,800	1,185.00	3,318,000
大平洋金属	8,100	2,961.00	23,984,100
新日本電工	72,600	228.00	16,552,800
栗本鐵工所	6,200	1,420.00	8,804,000
虹 技	1,800	1,358.00	2,444,400
日本鑄鉄管	1,300	942.00	1,224,600
日本製鋼所	36,700	2,038.00	74,794,600
三菱製鋼	9,100	1,590.00	14,469,000
日亜鋼業	17,200	291.00	5,005,200
日本精線	1,800	3,375.00	6,075,000
エンビプロ・ホールディングス	2,500	501.00	1,252,500
大紀アルミニウム工業所	19,900	593.00	11,800,700
日本軽金属ホールディングス	330,600	239.00	79,013,400
三井金属鉱業	32,800	2,580.00	84,624,000
東邦亜鉛	6,700	3,570.00	23,919,000
三菱マテリアル	80,100	3,040.00	243,504,000
住友金属鉱山	166,100	3,175.00	527,367,500
DOWAホールディングス	28,400	3,440.00	97,696,000
古河機械金属	20,000	1,346.00	26,920,000
エス・サイエンス	53,700	64.00	3,436,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,100	1,664.00	23,462,400
東邦チタニウム	21,800	955.00	20,819,000
UACJ	18,500	2,180.00	40,330,000
CKサンエツ	2,300	2,421.00	5,568,300
古河電気工業	35,000	3,435.00	120,225,000
住友電気工業	453,600	1,520.00	689,472,000
フジクラ	146,400	488.00	71,443,200
昭和電線ホールディングス	14,100	681.00	9,602,100
東京特殊電線	1,600	1,965.00	3,144,000
タツタ電線	24,100	500.00	12,050,000
カナレ電気	2,000	1,829.00	3,658,000
平河ヒューテック	5,000	1,485.00	7,425,000
リョービ	14,900	2,859.00	42,599,100
アーレスティ	14,900	644.00	9,595,600

アサヒホールディングス	22,900	2,109.00	48,296,100
東洋製罐グループホールディングス	77,200	2,456.00	189,603,200
ホッカンホールディングス	6,200	1,733.00	10,744,600
コロナ	6,800	1,023.00	6,956,400
横河ブリッジホールディングス	22,600	1,922.00	43,437,200
OSJBホールディングス	60,800	298.00	18,118,400
駒井ハルテック	2,400	1,891.00	4,538,400
高田機工	1,000	2,756.00	2,756,000
三和ホールディングス	125,300	1,302.00	163,140,600
文化シャッター	35,800	794.00	28,425,200
三協立山	16,800	1,376.00	23,116,800
アルインコ	9,700	976.00	9,467,200
東洋シャッター	3,000	701.00	2,103,000
LIXILグループ	179,100	1,608.00	287,992,800
日本ファイルコン	9,400	518.00	4,869,200
ノーリツ	27,000	1,541.00	41,607,000
長府製作所	12,400	2,054.00	25,469,600
リンナイ	21,700	7,280.00	157,976,000
ユニプレス	23,800	2,092.00	49,789,600
ダイニチ工業	6,400	717.00	4,588,800
日東精工	16,700	531.00	8,867,700
三洋工業	1,500	1,918.00	2,877,000
岡部	24,600	860.00	21,156,000
ジーテクト	13,500	1,561.00	21,073,500
中国工業	1,900	569.00	1,081,100
東プレ	22,600	2,381.00	53,810,600
高周波熱錬	23,500	896.00	21,056,000
東京製綱	7,400	978.00	7,237,200
サンコール	6,900	637.00	4,395,300
モリテックスチール	9,500	417.00	3,961,500
パイオラックス	19,400	2,207.00	42,815,800
エイチワン	12,000	1,105.00	13,260,000
日本発条	120,900	1,030.00	124,527,000
中央発條	1,400	2,892.00	4,048,800
アドバネクス	1,600	1,543.00	2,468,800
三浦工業	52,600	2,391.00	125,766,600
タクマ	44,200	1,391.00	61,482,200
テクノプロ・ホールディングス	23,600	6,020.00	142,072,000
アトラ	2,300	405.00	931,500
インターワークス	2,300	748.00	1,720,400
アイ・アールジャパンホールディングス	3,800	1,274.00	4,841,200
Keeper 技研	3,900	944.00	3,681,600
ファーストロジック	2,300	692.00	1,591,600
三機サービス	1,900	1,419.00	2,696,100
Gunosy	7,200	2,527.00	18,194,400
デザインワン・ジャパン	2,300	317.00	729,100
イー・ガーディアン	5,500	2,184.00	12,012,000
リブセンス	6,300	288.00	1,814,400
ジャパンマテリアル	32,100	1,329.00	42,660,900

ベクトル	14,300	1,394.00	19,934,200
ウチヤマホールディングス	5,900	459.00	2,708,100
ライクキッズネクスト	2,500	868.00	2,170,000
キャリアリンク	4,300	354.00	1,522,200
I B J	7,800	829.00	6,466,200
アサンテ	4,700	2,188.00	10,283,600
N・フィールド	7,500	896.00	6,720,000
バリューHR	2,500	1,824.00	4,560,000
M&Aキャピタルパートナーズ	3,000	5,690.00	17,070,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,800	1,283.00	6,158,400
E R Iホールディングス	3,300	763.00	2,517,900
アビスト	1,900	3,135.00	5,956,500
シグマクシス	5,500	821.00	4,515,500
ウィルグループ	7,500	931.00	6,982,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	16,100	250.00	4,025,000
日本ビューホテル	3,800	1,104.00	4,195,200
リクルートホールディングス	839,900	2,916.00	2,449,148,400
エラン	8,000	1,271.00	10,168,000
ツガミ	27,100	711.00	19,268,100
オークマ	15,400	5,830.00	89,782,000
東芝機械	13,700	2,187.00	29,961,900
アマダホールディングス	187,200	1,076.00	201,427,200
アイダエンジニアリング	33,700	791.00	26,656,700
滝澤鉄工所	3,900	1,681.00	6,555,900
F U J I	36,300	1,441.00	52,308,300
牧野フライス製作所	14,200	4,270.00	60,634,000
オーエスジー	59,700	2,268.00	135,399,600
ダイジェット工業	1,400	1,603.00	2,244,200
旭ダイヤモンド工業	31,800	737.00	23,436,600
D M G 森精機	76,700	1,496.00	114,743,200
ソディック	26,400	820.00	21,648,000
ディスコ	16,400	16,570.00	271,748,000
日東工器	6,600	2,253.00	14,869,800
日進工具	3,700	2,463.00	9,113,100
パンチ工業	8,500	529.00	4,496,500
富士ダイス	5,400	649.00	3,504,600
土木管理総合試験所	5,100	540.00	2,754,000
日本郵政	961,100	1,322.00	1,270,574,200
ベルシステム24ホールディングス	19,600	1,422.00	27,871,200
鎌倉新書	8,600	1,546.00	13,295,600
一蔵	1,500	622.00	933,000
L I T A L I C O	2,700	2,026.00	5,470,200
グローバルグループ	1,400	952.00	1,332,800
エポラブルアジア	3,300	2,319.00	7,652,700
アトラエ	2,300	2,146.00	4,935,800
ストライク	3,000	2,143.00	6,429,000
ソラスト	28,500	1,085.00	30,922,500
セラク	2,600	596.00	1,549,600
インソース	3,900	2,198.00	8,572,200

豊田自動織機	99,300	5,490.00	545,157,000
豊和工業	6,700	853.00	5,715,100
OKK	5,000	847.00	4,235,000
石川製作所	2,900	1,184.00	3,433,600
東洋機械金属	8,800	584.00	5,139,200
津田駒工業	2,600	1,874.00	4,872,400
エンシュウ	3,200	1,114.00	3,564,800
島精機製作所	16,700	3,570.00	59,619,000
オプトラ	11,900	1,920.00	22,848,000
NCホールディングス	3,800	483.00	1,835,400
フリー	9,700	1,026.00	9,952,200
ヤマシンフィルタ	21,100	643.00	13,567,300
日阪製作所	15,000	856.00	12,840,000
やまびこ	23,600	1,105.00	26,078,000
平田機工	5,700	6,510.00	37,107,000
ペガサスミシン製造	11,400	646.00	7,364,400
マルマエ	3,300	725.00	2,392,500
タツモ	3,900	904.00	3,525,600
ナプテスコ	66,700	2,838.00	189,294,600
三井海洋開発	12,900	3,130.00	40,377,000
レオン自動機	12,000	1,395.00	16,740,000
SMC	35,900	38,620.00	1,386,458,000
新川	9,200	395.00	3,634,000
ホソカワミクロン	4,300	4,540.00	19,522,000
ユニオンツール	5,200	3,075.00	15,990,000
オイレス工業	16,900	1,903.00	32,160,700
日精エー・エス・ビー機械	3,500	3,885.00	13,597,500
サトーホールディングス	14,600	2,600.00	37,960,000
技研製作所	8,500	3,190.00	27,115,000
日本エアテック	3,800	566.00	2,150,800
カワタ	2,500	1,277.00	3,192,500
日精樹脂工業	10,200	943.00	9,618,600
オカダアイオン	4,200	1,479.00	6,211,800
ワイエイシイホールディングス	4,900	663.00	3,248,700
小松製作所	555,500	2,674.50	1,485,684,750
住友重機械工業	70,200	3,715.00	260,793,000
日立建機	49,100	2,773.00	136,154,300
日工	3,400	2,287.00	7,775,800
巴工業	5,200	2,500.00	13,000,000
井関農機	12,300	1,658.00	20,393,400
TOWA	10,400	673.00	6,999,200
丸山製作所	2,600	1,364.00	3,546,400
北川鉄工所	5,500	2,274.00	12,507,000
シンニッタン	19,000	325.00	6,175,000
ローツェ	5,300	1,680.00	8,904,000
タカキタ	4,400	604.00	2,657,600
クボタ	658,200	1,701.50	1,119,927,300
荏原実業	3,500	2,070.00	7,245,000
東洋エンジニアリング	16,200	759.00	12,295,800
三菱化工機	4,300	1,539.00	6,617,700

月島機械	24,300	1,384.00	33,631,200
帝国電機製作所	8,600	1,197.00	10,294,200
東京機械製作所	4,700	383.00	1,800,100
新東工業	29,100	961.00	27,965,100
澁谷工業	10,700	3,780.00	40,446,000
アイチコーポレーション	21,200	703.00	14,903,600
小森コーポレーション	33,200	1,135.00	37,682,000
鶴見製作所	9,600	1,794.00	17,222,400
住友精密工業	2,000	2,918.00	5,836,000
酒井重工業	2,300	2,360.00	5,428,000
荏原製作所	54,400	3,055.00	166,192,000
石井鐵工所	1,900	1,825.00	3,467,500
西島製作所	12,600	943.00	11,881,800
北越工業	12,700	1,200.00	15,240,000
千代田化工建設	99,100	336.00	33,297,600
ダイキン工業	167,500	11,755.00	1,968,962,500
オルガノ	4,500	2,788.00	12,546,000
トーヨーカネツ	4,600	2,357.00	10,842,200
栗田工業	66,400	2,802.00	186,052,800
椿本チエイン	16,000	4,085.00	65,360,000
大同工業	5,800	887.00	5,144,600
日機装	39,700	960.00	38,112,000
木村化工機	10,200	381.00	3,886,200
新興ブランテック	24,700	1,256.00	31,023,200
アネスト岩田	19,100	953.00	18,202,300
ダイフク	67,400	5,580.00	376,092,000
サムコ	3,400	986.00	3,352,400
加藤製作所	6,300	2,726.00	17,173,800
油研工業	2,200	1,969.00	4,331,800
タダノ	59,200	1,192.00	70,566,400
フジテック	44,600	1,177.00	52,494,200
C K D	34,100	1,084.00	36,964,400
キトー	9,300	1,695.00	15,763,500
平和	34,200	2,260.00	77,292,000
理想科学工業	10,900	1,726.00	18,813,400
SANKYO	30,700	4,110.00	126,177,000
日本金銭機械	13,600	971.00	13,205,600
マースグループホールディングス	7,700	2,125.00	16,362,500
福島工業	7,500	3,865.00	28,987,500
オーイズミ	5,000	350.00	1,750,000
ダイコク電機	5,600	1,457.00	8,159,200
竹内製作所	20,500	1,988.00	40,754,000
アマノ	35,100	2,363.00	82,941,300
JUKI	17,000	1,155.00	19,635,000
サンデンホールディングス	14,900	809.00	12,054,100
蛇の目ミシン工業	11,200	471.00	5,275,200
ブラザー工業	159,900	2,032.00	324,916,800
マックス	18,900	1,438.00	27,178,200
モリタホールディングス	21,400	1,747.00	37,385,800
グローリー	34,000	2,534.00	86,156,000

新晃工業	11,400	1,517.00	17,293,800
大和冷機工業	17,600	1,160.00	20,416,000
セガサミーホールディングス	121,800	1,297.00	157,974,600
日本ピストンリング	4,500	1,788.00	8,046,000
リケン	5,600	5,040.00	28,224,000
T P R	16,500	2,307.00	38,065,500
ツバキ・ナカシマ	18,500	1,701.00	31,468,500
ホシザキ	35,800	7,700.00	275,660,000
大豊工業	10,000	1,029.00	10,290,000
日本精工	252,000	1,067.00	268,884,000
N T N	263,700	343.00	90,449,100
ジェイテクト	117,700	1,364.00	160,542,800
不二越	11,400	4,305.00	49,077,000
ミネベアミツミ	227,800	1,839.00	418,924,200
日本トムソン	36,400	576.00	20,966,400
T H K	76,500	2,693.00	206,014,500
ユーシン精機	9,500	905.00	8,597,500
前澤給装工業	4,800	1,814.00	8,707,200
イーグル工業	15,100	1,316.00	19,871,600
前澤工業	9,100	354.00	3,221,400
日本ビラー工業	12,400	1,339.00	16,603,600
キッツ	49,700	906.00	45,028,200
日立製作所	552,400	3,503.00	1,935,057,200
三菱電機	1,227,000	1,390.50	1,706,143,500
富士電機	79,600	3,250.00	258,700,000
東洋電機製造	4,800	1,303.00	6,254,400
安川電機	142,200	3,120.00	443,664,000
シンフォニアテクノロジー	17,000	1,367.00	23,239,000
明電舎	24,300	1,617.00	39,293,100
オリジン電気	3,300	1,898.00	6,263,400
山洋電気	5,900	3,985.00	23,511,500
デンヨー	11,300	1,417.00	16,012,100
ベイカレント・コンサルティング	6,200	3,115.00	19,313,000
アイモバイル	2,800	717.00	2,007,600
キャリアインデックス	4,000	1,279.00	5,116,000
M S - J a p a n	4,700	1,800.00	8,460,000
船場	2,100	858.00	1,801,800
グレイステクノロジー	3,200	2,225.00	7,120,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,900	1,734.00	11,964,600
フルテック	1,300	1,103.00	1,433,900
グリーンズ	2,600	1,443.00	3,751,800
ツナグ・ソリューションズ	1,000	648.00	648,000
日総工産	2,900	2,125.00	6,162,500
キュービーネットホールディングス	5,900	1,953.00	11,522,700
三櫻工業	15,500	580.00	8,990,000
マキタ	149,300	3,900.00	582,270,000
東芝テック	15,300	2,697.00	41,264,100
芝浦メカトロニクス	2,200	3,570.00	7,854,000
マブチモーター	33,900	3,875.00	131,362,500

日本電産	147,700	13,145.00	1,941,516,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,600	1,706.00	11,259,600
トレックス・セミコンダクター	4,200	1,277.00	5,363,400
東光高岳	6,200	1,437.00	8,909,400
ダブル・スコープ	17,800	1,155.00	20,559,000
宮越ホールディングス	4,600	987.00	4,540,200
ダイヘン	13,500	2,750.00	37,125,000
田淵電機	16,500	123.00	2,029,500
ヤーマン	17,700	1,376.00	24,355,200
JVCケンウッド	89,900	272.00	24,452,800
ミマキエンジニアリング	11,000	810.00	8,910,000
第一精工	5,100	1,227.00	6,257,700
日新電機	28,800	977.00	28,137,600
大崎電気工業	24,400	716.00	17,470,400
オムロン	130,300	4,835.00	630,000,500
日東工業	19,600	2,179.00	42,708,400
I D E C	16,400	2,056.00	33,718,400
不二電機工業	1,300	1,296.00	1,684,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	44,100	2,263.00	99,798,300
サクサホールディングス	3,000	1,789.00	5,367,000
メルコホールディングス	5,100	3,980.00	20,298,000
テクノメディカ	2,800	2,075.00	5,810,000
日本電気	158,800	3,745.00	594,706,000
富士通	118,300	7,563.00	894,702,900
沖電気工業	53,200	1,246.00	66,287,200
岩崎通信機	5,800	803.00	4,657,400
電気興業	6,400	2,681.00	17,158,400
サンケン電気	14,300	2,187.00	31,274,100
ナカヨ	2,300	1,415.00	3,254,500
アイホン	7,000	1,698.00	11,886,000
ルネサスエレクトロニクス	127,000	649.00	82,423,000
セイコーエプソン	152,200	1,650.00	251,130,000
ワコム	88,900	479.00	42,583,100
アルバック	24,500	3,615.00	88,567,500
アクセル	5,000	516.00	2,580,000
E I Z O	11,300	4,645.00	52,488,500
ジャパンディスプレイ	290,100	73.00	21,177,300
日本信号	31,200	966.00	30,139,200
京三製作所	26,300	417.00	10,967,100
能美防災	16,200	1,841.00	29,824,200
ホーチキ	7,700	1,110.00	8,547,000
星和電機	4,100	459.00	1,881,900
エレコム	11,100	3,220.00	35,742,000
パナソニック	1,401,800	1,031.50	1,445,956,700
シャープ	121,800	1,220.00	148,596,000
アンリツ	79,000	2,201.00	173,879,000
富士通ゼネラル	37,400	1,482.00	55,426,800
ソニー	822,600	4,713.00	3,876,913,800
T D K	64,200	8,590.00	551,478,000
帝国通信工業	5,400	1,199.00	6,474,600

タムラ製作所	47,200	630.00	29,736,000
アルプスアルパイン	127,700	2,308.00	294,731,600
池上通信機	3,900	1,250.00	4,875,000
パイオニア	204,500	65.00	13,292,500
日本電波工業	11,200	368.00	4,121,600
鈴木	6,100	643.00	3,922,300
日本トリム	2,400	5,420.00	13,008,000
ローランド ディー・ジー	6,300	2,245.00	14,143,500
フォスター電機	14,400	1,610.00	23,184,000
クラリオン	10,700	2,497.00	26,717,900
SMK	3,400	2,609.00	8,870,600
ヨコオ	8,800	1,506.00	13,252,800
ティアック	8,600	208.00	1,788,800
ホシデン	36,100	804.00	29,024,400
ヒロセ電機	17,500	11,930.00	208,775,000
日本航空電子工業	28,200	1,449.00	40,861,800
TOA	13,300	1,079.00	14,350,700
マクセルホールディングス	26,400	1,624.00	42,873,600
古野電気	15,800	937.00	14,804,600
ユニデンホールディングス	3,700	2,151.00	7,958,700
スミダコーポレーション	10,400	1,242.00	12,916,800
アイコム	6,800	2,177.00	14,803,600
リオン	5,600	1,767.00	9,895,200
本多通信工業	10,500	548.00	5,754,000
船井電機	12,500	590.00	7,375,000
横河電機	122,800	2,056.00	252,476,800
新電元工業	4,400	4,355.00	19,162,000
アズビル	79,200	2,422.00	191,822,400
東亜ディーケーケー	6,100	796.00	4,855,600
日本光電工業	54,100	3,295.00	178,259,500
チノー	4,300	1,288.00	5,538,400
共和電業	13,000	367.00	4,771,000
日本電子材料	4,700	766.00	3,600,200
堀場製作所	24,300	5,610.00	136,323,000
アドバンテスト	83,600	2,526.00	211,173,600
小野測器	5,700	604.00	3,442,800
エスベック	10,900	2,009.00	21,898,100
キーエンス	60,200	62,260.00	3,748,052,000
日置電機	6,400	4,480.00	28,672,000
シスメックス	95,600	6,176.00	590,425,600
日本マイクロニクス	19,800	896.00	17,740,800
メガチップス	9,700	2,095.00	20,321,500
OBARA GROUP	7,100	3,615.00	25,666,500
IMAGICA GROUP	10,200	524.00	5,344,800
澤藤電機	1,500	1,675.00	2,512,500
デンソー	270,200	4,649.00	1,256,159,800
原田工業	3,800	913.00	3,469,400
コーセル	17,000	1,160.00	19,720,000
イリソ電子工業	11,200	4,850.00	54,320,000
オプテックスグループ	21,600	2,006.00	43,329,600

千代田インテグレ	5,100	1,898.00	9,679,800
アイ・オー・データ機器	5,100	1,253.00	6,390,300
レーザーテック	25,100	4,325.00	108,557,500
スタンレー電気	86,900	3,210.00	278,949,000
岩崎電気	4,800	1,358.00	6,518,400
ウシオ電機	74,500	1,245.00	92,752,500
岡谷電機産業	8,800	391.00	3,440,800
ヘリオス テクノ ホールディング	11,300	696.00	7,864,800
エノモト	2,600	847.00	2,202,200
日本セラミック	12,500	2,611.00	32,637,500
遠藤照明	6,300	722.00	4,548,600
古河電池	8,800	732.00	6,441,600
双信電機	5,900	346.00	2,041,400
山一電機	8,900	1,312.00	11,676,800
図研	7,900	1,646.00	13,003,400
日本電子	24,200	1,919.00	46,439,800
カシオ計算機	108,500	1,497.00	162,424,500
ファナック	116,600	18,795.00	2,191,497,000
日本シイエムケイ	31,200	706.00	22,027,200
エンブラス	5,500	2,977.00	16,373,500
大真空	4,500	960.00	4,320,000
ローム	59,300	7,960.00	472,028,000
浜松ホトニクス	88,100	3,945.00	347,554,500
三井ハイテック	13,600	955.00	12,988,000
新光電気工業	41,100	757.00	31,112,700
京セラ	187,100	5,980.00	1,118,858,000
協栄産業	1,400	1,510.00	2,114,000
太陽誘電	54,600	2,051.00	111,984,600
村田製作所	128,800	17,390.00	2,239,832,000
ユーシン	19,400	984.00	19,089,600
双葉電子工業	20,000	1,746.00	34,920,000
日東電工	92,700	6,055.00	561,298,500
北陸電気工業	4,600	972.00	4,471,200
東海理化電機製作所	32,300	1,912.00	61,757,600
ニチコン	38,600	880.00	33,968,000
日本ケミコン	8,800	2,111.00	18,576,800
K O A	18,600	1,588.00	29,536,800
三井E & Sホールディングス	44,300	1,277.00	56,571,100
日立造船	97,100	363.00	35,247,300
三菱重工業	205,600	4,244.00	872,566,400
川崎重工業	95,500	2,828.00	270,074,000
I H I	94,300	3,405.00	321,091,500
名村造船所	36,800	429.00	15,787,200
サノヤスホールディングス	16,300	179.00	2,917,700
スプリックス	3,300	2,379.00	7,850,700
日本車輛製造	4,500	2,491.00	11,209,500
三菱ロジスネクスト	14,600	1,381.00	20,162,600
近畿車輛	1,900	1,980.00	3,762,000
F P G	38,700	1,032.00	39,938,400
島根銀行	2,700	693.00	1,871,100

じもとホールディングス	82,100	120.00	9,852,000	
全国保証	34,100	3,910.00	133,331,000	
めぶきフィナンシャルグループ	628,600	294.00	184,808,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	16,300	1,553.00	25,313,900	
九州フィナンシャルグループ	198,500	441.00	87,538,500	
かんぽ生命保険	45,700	2,478.00	113,244,600	
ゆうちょ銀行	343,100	1,254.00	430,247,400	
富山第一銀行	29,200	377.00	11,008,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	770,700	441.00	339,878,700	
ジェイリース	2,600	365.00	949,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	77,400	960.00	74,304,000	
マーキュリアインベストメント	4,700	730.00	3,431,000	
イントラスト	3,400	437.00	1,485,800	
日本モーゲージサービス	1,600	1,324.00	2,118,400	
CASA	4,100	1,156.00	4,739,600	
アルヒ	11,000	2,300.00	25,300,000	
プレミアグループ	2,500	3,190.00	7,975,000	
日産自動車	1,447,300	928.10	1,343,239,130	
いすゞ自動車	387,900	1,539.00	596,978,100	
トヨタ自動車	1,367,500	6,575.00	8,991,312,500	*
日野自動車	153,200	1,036.00	158,715,200	
三菱自動車工業	454,200	654.00	297,046,800	
エフテック	8,700	903.00	7,856,100	
レシップホールディングス	4,500	705.00	3,172,500	
GMB	2,500	934.00	2,335,000	
ファルテック	2,100	772.00	1,621,200	
武蔵精密工業	28,900	1,447.00	41,818,300	
日産車体	24,000	989.00	23,736,000	
新明和工業	57,100	1,480.00	84,508,000	
極東開発工業	24,400	1,548.00	37,771,200	
日信工業	22,400	1,543.00	34,563,200	
トピー工業	10,100	2,378.00	24,017,800	
ティラド	4,500	2,293.00	10,318,500	
曙ブレーキ工業	67,300	168.00	11,306,400	
タチエス	20,800	1,505.00	31,304,000	
NOK	65,900	1,806.00	119,015,400	
フタバ産業	34,100	601.00	20,494,100	
KYB	12,800	2,981.00	38,156,800	
市光工業	18,400	603.00	11,095,200	
大同メタル工業	19,900	789.00	15,701,100	
プレス工業	60,800	622.00	37,817,600	
ミクニ	15,500	480.00	7,440,000	
太平洋工業	25,700	1,687.00	43,355,900	
ケーヒン	28,200	1,956.00	55,159,200	
河西工業	15,000	896.00	13,440,000	
アイシン精機	101,100	4,185.00	423,103,500	
マツダ	385,100	1,300.00	500,630,000	
今仙電機製作所	11,400	1,023.00	11,662,200	

本田技研工業	1,035,200	3,002.00	3,107,670,400
スズキ	224,500	5,351.00	1,201,299,500
S U B A R U	381,000	2,697.50	1,027,747,500
安永	5,900	1,384.00	8,165,600
ヤマハ発動機	173,200	2,340.00	405,288,000
ショーワ	29,000	1,531.00	44,399,000
小糸製作所	73,600	6,270.00	461,472,000
T B K	14,800	403.00	5,964,400
エクセディ	16,600	2,710.00	44,986,000
ミツバ	22,600	658.00	14,870,800
豊田合成	39,700	2,362.00	93,771,400
愛三工業	19,200	729.00	13,996,800
盟和産業	1,900	1,060.00	2,014,000
日本プラスト	9,600	753.00	7,228,800
ヨロズ	11,500	1,526.00	17,549,000
エフ・シー・シー	22,100	2,486.00	54,940,600
新家工業	2,700	1,606.00	4,336,200
シマノ	49,500	15,490.00	766,755,000
テイ・エス テック	28,500	3,295.00	93,907,500
関西みらいフィナンシャルグループ	56,800	798.00	45,326,400
三十三フィナンシャルグループ	10,400	1,601.00	16,650,400
第四北越フィナンシャルグループ	21,000	2,998.00	62,958,000
ジャムコ	6,200	2,699.00	16,733,800
小野建	10,600	1,679.00	17,797,400
はるやまホールディングス	5,500	823.00	4,526,500
南陽	2,500	2,239.00	5,597,500
ノジマ	21,600	1,949.00	42,098,400
佐島電機	9,000	931.00	8,379,000
カッパ・クリエイト	16,900	1,366.00	23,085,400
エコートレーディング	2,600	602.00	1,565,200
伯東	8,300	1,185.00	9,835,500
コンドーテック	9,400	968.00	9,099,200
中山福	6,600	522.00	3,445,200
ライトオン	10,200	812.00	8,282,400
ナガイレーベン	17,400	2,205.00	38,367,000
ジーンズメイト	3,700	389.00	1,439,300
三菱食品	13,400	2,919.00	39,114,600
良品計画	17,100	26,820.00	458,622,000
三城ホールディングス	15,100	408.00	6,160,800
松田産業	8,900	1,439.00	12,807,100
第一興商	18,000	5,220.00	93,960,000
メディカルホールディングス	130,500	2,522.00	329,121,000
アドヴァン	18,600	991.00	18,432,600
S P K	2,500	2,276.00	5,690,000
萩原電気ホールディングス	4,500	2,797.00	12,586,500
アルピス	4,600	2,375.00	10,925,000
アズワン	8,700	7,900.00	68,730,000
スズデン	4,300	1,581.00	6,798,300
尾家産業	3,400	1,159.00	3,940,600
シモジマ	7,400	1,141.00	8,443,400

ドウシシャ	11,400	1,628.00	18,559,200
小津産業	2,600	1,860.00	4,836,000
コナカ	15,700	441.00	6,923,700
高速	7,300	1,060.00	7,738,000
ハウス オブ ローゼ	1,500	1,837.00	2,755,500
G - 7ホールディングス	3,500	2,289.00	8,011,500
たけびし	4,300	1,391.00	5,981,300
イオン北海道	12,300	788.00	9,692,400
コジマ	17,700	587.00	10,389,900
ヒマラヤ	3,900	1,000.00	3,900,000
コーナン商事	15,900	2,728.00	43,375,200
ネットワンシステムズ	42,700	2,511.00	107,219,700
エコス	4,500	1,674.00	7,533,000
ワタミ	15,900	1,407.00	22,371,300
マルシェ	3,300	775.00	2,557,500
リックス	2,700	1,521.00	4,106,700
システムソフト	29,100	99.00	2,880,900
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	72,500	6,560.00	475,600,000
丸文	10,700	707.00	7,564,900
西松屋チェーン	26,500	894.00	23,691,000
ゼンショーホールディングス	57,000	2,344.00	133,608,000
ハピネット	10,100	1,569.00	15,846,900
幸楽苑ホールディングス	7,600	2,256.00	17,145,600
ハークスレイ	2,700	1,117.00	3,015,900
橋本総業ホールディングス	2,400	1,421.00	3,410,400
日本ライフライン	37,900	1,556.00	58,972,400
サイゼリヤ	19,900	2,048.00	40,755,200
タカショー	6,100	433.00	2,641,300
エクセル	4,500	2,123.00	9,553,500
V Tホールディングス	41,000	415.00	17,015,000
マルカキカイ	4,000	1,959.00	7,836,000
アルゴグラフィックス	5,100	4,655.00	23,740,500
魚力	3,400	1,427.00	4,851,800
I D O M	40,700	403.00	16,402,100
日本エム・ディ・エム	7,000	1,068.00	7,476,000
ポプラ	3,100	587.00	1,819,700
フジ・コーポレーション	2,500	2,048.00	5,120,000
ユナイテッドアローズ	13,900	3,765.00	52,333,500
進和	7,100	2,108.00	14,966,800
エスケイジャパン	2,900	636.00	1,844,400
ダイترون	5,500	1,399.00	7,694,500
ハイデイ日高	15,900	2,186.00	34,757,400
シークス	15,300	1,533.00	23,454,900
京都きもの友禅	7,700	419.00	3,226,300
コロワイド	40,200	2,362.00	94,952,400
ピーシーデポコーポレーション	16,000	435.00	6,960,000
田中商事	3,700	596.00	2,205,200
オーハシテクニカ	6,800	1,400.00	9,520,000
壱番屋	8,600	4,565.00	39,259,000

白銅	4,000	1,681.00	6,724,000
トップカルチャー	4,600	289.00	1,329,400
P L A N T	2,900	1,006.00	2,917,400
スギホールディングス	26,500	4,585.00	121,502,500
島津製作所	157,900	2,734.00	431,698,600
J M S	11,100	595.00	6,604,500
クボテック	2,600	380.00	988,000
長野計器	9,600	846.00	8,121,600
ブイ・テクノロジー	2,900	16,090.00	46,661,000
スター精密	21,100	1,586.00	33,464,600
東京計器	7,700	931.00	7,168,700
愛知時計電機	1,600	3,775.00	6,040,000
インターアクション	6,500	2,201.00	14,306,500
オーバル	11,700	241.00	2,819,700
東京精密	22,200	3,210.00	71,262,000
マニー	14,900	4,785.00	71,296,500
ニコン	213,800	1,842.00	393,819,600
トプコン	65,800	1,489.00	97,976,200
オリンパス	182,800	4,640.00	848,192,000
理研計器	10,900	2,030.00	22,127,000
S C R E E Nホールディングス	21,300	5,000.00	106,500,000
キヤノン電子	11,300	1,824.00	20,611,200
タムロン	10,900	1,756.00	19,140,400
H O Y A	247,100	6,590.00	1,628,389,000
シード	5,200	1,297.00	6,744,400
ノーリツ鋼機	9,700	1,884.00	18,274,800
エー・アンド・デイ	11,200	703.00	7,873,600
朝日インテック	52,000	4,890.00	254,280,000
キヤノン	660,600	3,185.00	2,104,011,000
リコー	369,000	1,155.00	426,195,000
シチズン時計	134,200	578.00	77,567,600
リズム時計工業	4,100	1,727.00	7,080,700
大研医器	9,800	599.00	5,870,200
メニコン	16,800	2,713.00	45,578,400
シンシア	1,900	492.00	934,800
中本パックス	3,400	1,627.00	5,531,800
スノーピーク	4,500	1,244.00	5,598,000
パラマウントベッドホールディングス	14,100	4,615.00	65,071,500
トランザクション	6,700	719.00	4,817,300
S H O B I	3,500	349.00	1,221,500
ニホンフラッシュ	5,200	2,042.00	10,618,400
前田工織	13,600	2,783.00	37,848,800
永大産業	16,400	446.00	7,314,400
アートネイチャー	13,100	612.00	8,017,200
バンダイナムコホールディングス	126,800	4,505.00	571,234,000
アイフィスジャパン	2,700	614.00	1,657,800
共立印刷	20,800	233.00	4,846,400
S H O E I	5,800	3,935.00	22,823,000
フランスベッドホールディングス	17,400	866.00	15,068,400
マーベラス	18,400	922.00	16,964,800

パイロットコーポレーション	21,400	5,320.00	113,848,000
萩原工業	6,800	1,653.00	11,240,400
エイベックス	20,700	1,470.00	30,429,000
トッパン・フォームズ	26,300	895.00	23,538,500
フジシールインターナショナル	27,400	4,020.00	110,148,000
タカラトミー	51,400	1,201.00	61,731,400
廣済堂	11,400	775.00	8,835,000
エステールホールディングス	3,500	660.00	2,310,000
アーク	46,700	97.00	4,529,900
レック	13,100	1,691.00	22,152,100
タカノ	4,900	844.00	4,135,600
三光合成	9,500	367.00	3,486,500
プロネクサス	10,500	1,162.00	12,201,000
ホクシン	7,700	137.00	1,054,900
ウッドワン	4,000	1,037.00	4,148,000
大建工業	9,300	1,902.00	17,688,600
きもと	20,900	192.00	4,012,800
凸版印刷	173,200	1,786.00	309,335,200
大日本印刷	172,900	2,518.00	435,362,200
図書印刷	11,500	965.00	11,097,500
共同印刷	3,900	2,340.00	9,126,000
N I S S H A	25,100	1,456.00	36,545,600
光村印刷	1,000	1,964.00	1,964,000
藤森工業	11,000	2,891.00	31,801,000
ヴィア・ホールディングス	14,800	657.00	9,723,600
宝印刷	6,400	1,595.00	10,208,000
前澤化成工業	8,600	1,060.00	9,116,000
未来工業	6,600	2,349.00	15,503,400
アシックス	121,900	1,648.00	200,891,200
ツツミ	3,900	1,941.00	7,569,900
ウェーブロックホールディングス	2,600	778.00	2,022,800
J S P	7,100	2,477.00	17,586,700
ニチハ	17,000	3,060.00	52,020,000
エフピコ	10,100	6,090.00	61,509,000
小松ウオール工業	3,800	1,865.00	7,087,000
ヤマハ	73,000	5,240.00	382,520,000
河合楽器製作所	3,800	3,345.00	12,711,000
クリナップ	11,500	620.00	7,130,000
ビジョン	74,200	4,390.00	325,738,000
天馬	8,600	1,804.00	15,514,400
兼松サステック	800	1,550.00	1,240,000
キングジム	10,200	789.00	8,047,800
象印マホービン	22,900	1,187.00	27,182,300
リンテック	29,200	2,443.00	71,335,600
信越ポリマー	22,100	813.00	17,967,300
東リ	30,700	251.00	7,705,700
イトーキ	22,600	563.00	12,723,800
任天堂	75,500	29,315.00	2,213,282,500
三菱鉛筆	20,200	2,300.00	46,460,000
松風	6,200	1,214.00	7,526,800

タカスタンダード	25,400	1,707.00	43,357,800
コクヨ	58,900	1,603.00	94,416,700
ナカバヤシ	12,300	543.00	6,678,900
ニフコ	49,100	2,717.00	133,404,700
立川ブラインド工業	5,400	984.00	5,313,600
グロープライド	5,900	2,547.00	15,027,300
オカムラ	42,900	1,270.00	54,483,000
バルカー	9,900	2,250.00	22,275,000
MUTOHホールディングス	1,600	1,864.00	2,982,400
伊藤忠商事	845,400	2,030.50	1,716,584,700
丸紅	1,191,900	832.00	991,660,800
スクロール	18,600	389.00	7,235,400
高島	2,000	1,802.00	3,604,000
ヨンドシーホールディングス	13,500	2,151.00	29,038,500
三陽商会	7,200	1,750.00	12,600,000
長瀬産業	68,000	1,649.00	112,132,000
ナイガイ	4,600	528.00	2,428,800
蝶理	7,700	1,522.00	11,719,400
豊田通商	134,900	3,340.00	450,566,000
オンワードホールディングス	72,300	638.00	46,127,400
三共生興	20,700	411.00	8,507,700
兼松	48,300	1,269.00	61,292,700
美津濃	12,200	2,564.00	31,280,800
ツカモトコーポレーション	2,200	1,003.00	2,206,600
ユニー・ファミリーマートホールディングス	33,800	12,600.00	425,880,000
ルックホールディングス	4,400	1,093.00	4,809,200
三井物産	995,700	1,745.00	1,737,496,500
日本紙パルプ商事	6,900	4,140.00	28,566,000
東京エレクトロン	81,900	15,860.00	1,298,934,000
日立ハイテクノロジーズ	36,700	4,245.00	155,791,500
カメイ	15,800	1,164.00	18,391,200
東都水産	1,800	2,482.00	4,467,600
OUGホールディングス	2,100	2,436.00	5,115,600
スターゼン	4,500	4,020.00	18,090,000
セイコーホールディングス	19,000	2,336.00	44,384,000
山善	47,200	1,101.00	51,967,200
椿本興業	2,700	3,665.00	9,895,500
住友商事	714,700	1,622.50	1,159,600,750
日本ユニシス	37,600	2,901.00	109,077,600
内田洋行	5,500	2,237.00	12,303,500
三菱商事	848,000	3,156.00	2,676,288,000
第一実業	5,500	3,475.00	19,112,500
キヤノンマーケティングジャパン	34,500	2,035.00	70,207,500
西華産業	6,800	1,519.00	10,329,200
佐藤商事	10,900	889.00	9,690,100
菱洋エレクトロ	12,300	1,502.00	18,474,600
東京産業	12,100	533.00	6,449,300
ユアサ商事	12,400	3,310.00	41,044,000
神鋼商事	2,700	2,524.00	6,814,800

小林産業	7,000	279.00	1,953,000
阪和興業	21,000	2,931.00	61,551,000
正栄食品工業	6,400	2,834.00	18,137,600
カナデン	11,700	1,248.00	14,601,600
菱電商事	9,600	1,388.00	13,324,800
ニプロ	84,900	1,397.00	118,605,300
フルサト工業	6,700	1,624.00	10,880,800
岩谷産業	26,700	3,680.00	98,256,000
すてきナイスグループ	5,000	863.00	4,315,000
昭光通商	4,400	637.00	2,802,800
ニチモウ	1,900	1,910.00	3,629,000
極東貿易	3,800	1,620.00	6,156,000
イワキ	14,500	395.00	5,727,500
兼松エレクトロニクス	6,500	3,195.00	20,767,500
三愛石油	32,400	928.00	30,067,200
稲畑産業	29,000	1,553.00	45,037,000
G S Iクレオス	3,200	1,210.00	3,872,000
明和産業	11,400	417.00	4,753,800
キムラタン	57,100	23.00	1,313,300
ゴールドウイン	10,900	10,760.00	117,284,000
ユニ・チャーム	260,200	3,482.00	906,016,400
デサント	29,300	2,638.00	77,293,400
キング	6,200	563.00	3,490,600
ワキタ	25,800	1,151.00	29,695,800
ヤマトインターナショナル	7,900	409.00	3,231,100
東邦ホールディングス	35,800	2,600.00	93,080,000
サンゲツ	36,500	2,046.00	74,679,000
ミツウロコグループホールディングス	17,500	800.00	14,000,000
シナネンホールディングス	5,000	2,207.00	11,035,000
伊藤忠エネクス	26,600	912.00	24,259,200
サンリオ	37,300	2,212.00	82,507,600
サンワテクノス	7,300	944.00	6,891,200
リョーサン	13,400	3,065.00	41,071,000
新光商事	11,400	1,858.00	21,181,200
トーヨー	5,500	2,054.00	11,297,000
三信電気	10,000	1,809.00	18,090,000
東陽テクニカ	14,000	869.00	12,166,000
モスフードサービス	15,900	2,721.00	43,263,900
加賀電子	12,100	2,034.00	24,611,400
三益半導体工業	9,500	1,436.00	13,642,000
ソーダニッカ	12,700	543.00	6,896,100
立花エレテック	9,000	1,554.00	13,986,000
木曽路	14,800	2,471.00	36,570,800
S R Sホールディングス	14,300	998.00	14,271,400
千趣会	21,900	230.00	5,037,000
タカキュー	9,200	184.00	1,692,800
ケーヨー	22,400	525.00	11,760,000
上新電機	14,300	2,319.00	33,161,700
日本瓦斯	19,600	4,135.00	81,046,000
ロイヤルホールディングス	21,400	2,642.00	56,538,800

東天紅	800	1,298.00	1,038,400
いなげや	13,600	1,389.00	18,890,400
島忠	27,300	3,070.00	83,811,000
チヨダ	12,700	1,857.00	23,583,900
ライフコーポレーション	9,200	2,447.00	22,512,400
リンガーハット	14,900	2,348.00	34,985,200
MrMaxHD	16,600	501.00	8,316,600
テンアライド	11,500	394.00	4,531,000
AOKIホールディングス	24,200	1,255.00	30,371,000
オークワ	17,200	1,041.00	17,905,200
コメリ	18,700	2,758.00	51,574,600
青山商事	21,100	2,714.00	57,265,400
しまむら	14,100	9,500.00	133,950,000
はせがわ	6,100	394.00	2,403,400
高島屋	94,700	1,432.00	135,610,400
松屋	24,300	1,055.00	25,636,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	62,100	1,534.00	95,261,400
近鉄百貨店	4,700	3,390.00	15,933,000
パルコ	11,700	1,055.00	12,343,500
丸井グループ	102,300	2,015.00	206,134,500
クレディセゾン	84,700	1,402.00	118,749,400
アクシアル リテイリング	10,000	3,435.00	34,350,000
井筒屋	6,400	198.00	1,267,200
イオン	465,100	2,236.50	1,040,196,150
イズミ	24,500	5,340.00	130,830,000
フォーバル	5,300	845.00	4,478,500
平和堂	24,500	2,495.00	61,127,500
フジ	14,600	1,848.00	26,980,800
ヤオコー	13,800	5,830.00	80,454,000
ゼビオホールディングス	14,600	1,284.00	18,746,400
ケーズホールディングス	125,500	979.00	122,864,500
PALTAC	21,800	5,310.00	115,758,000
三谷産業	14,400	272.00	3,916,800
Olympicグループ	7,100	658.00	4,671,800
日産東京販売ホールディングス	18,200	315.00	5,733,000
新生銀行	88,800	1,448.00	128,582,400
あおぞら銀行	67,500	3,120.00	210,600,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,428,800	578.10	4,872,689,280
りそなホールディングス	1,328,000	517.70	687,505,600
三井住友トラスト・ホールディングス	237,900	4,082.00	971,107,800
三井住友フィナンシャルグループ	853,000	3,928.00	3,350,584,000
千葉銀行	428,700	674.00	288,943,800
群馬銀行	242,000	463.00	112,046,000
武蔵野銀行	18,000	2,399.00	43,182,000
千葉興業銀行	33,300	340.00	11,322,000
筑波銀行	50,400	213.00	10,735,200
七十七銀行	37,900	1,799.00	68,182,100
青森銀行	9,400	2,654.00	24,947,600
秋田銀行	7,700	2,115.00	16,285,500
山形銀行	13,700	1,905.00	26,098,500

岩手銀行	8,500	3,235.00	27,497,500
東邦銀行	108,200	302.00	32,676,400
東北銀行	6,300	1,057.00	6,659,100
みちのく銀行	7,700	1,615.00	12,435,500
ふくおかフィナンシャルグループ	98,300	2,332.00	229,235,600
静岡銀行	304,500	864.00	263,088,000
十六銀行	16,200	2,265.00	36,693,000
スルガ銀行	123,700	456.00	56,407,200
八十二銀行	218,900	449.00	98,286,100
山梨中央銀行	15,000	1,332.00	19,980,000
大垣共立銀行	19,100	2,239.00	42,764,900
福井銀行	10,300	1,539.00	15,851,700
北國銀行	12,900	3,270.00	42,183,000
清水銀行	5,000	1,615.00	8,075,000
富山銀行	2,300	3,045.00	7,003,500
滋賀銀行	24,200	2,460.00	59,532,000
南都銀行	14,200	2,184.00	31,012,800
百五銀行	108,800	370.00	40,256,000
京都銀行	43,400	4,485.00	194,649,000
紀陽銀行	42,900	1,521.00	65,250,900
ほくほくフィナンシャルグループ	80,600	1,207.00	97,284,200
広島銀行	178,500	603.00	107,635,500
山陰合同銀行	71,800	754.00	54,137,200
中国銀行	78,100	1,003.00	78,334,300
鳥取銀行	4,300	1,344.00	5,779,200
伊予銀行	160,300	594.00	95,218,200
百十四銀行	12,900	2,422.00	31,243,800
四国銀行	17,300	1,023.00	17,697,900
阿波銀行	19,400	3,040.00	58,976,000
大分銀行	7,400	3,270.00	24,198,000
宮崎銀行	8,000	2,640.00	21,120,000
佐賀銀行	7,300	1,723.00	12,577,900
十八銀行	7,400	2,589.00	19,158,600
沖縄銀行	11,100	3,135.00	34,798,500
琉球銀行	27,900	1,064.00	29,685,600
セブン銀行	408,800	341.00	139,400,800
みずほフィナンシャルグループ	16,445,700	173.40	2,851,684,380
高知銀行	4,500	736.00	3,312,000
山口フィナンシャルグループ	151,100	1,093.00	165,152,300
芙蓉総合リース	13,900	5,420.00	75,338,000
興銀リース	22,700	2,516.00	57,113,200
東京センチュリー	24,400	5,040.00	122,976,000
SBIホールディングス	144,200	2,201.00	317,384,200
日本証券金融	53,300	607.00	32,353,100
アイフル	184,400	278.00	51,263,200
日本アジア投資	10,500	199.00	2,089,500
長野銀行	4,100	1,501.00	6,154,100
名古屋銀行	9,800	3,220.00	31,556,000
北洋銀行	182,300	284.00	51,773,200
愛知銀行	4,400	3,400.00	14,960,000

中京銀行	5,000	2,132.00	10,660,000
大光銀行	4,000	1,641.00	6,564,000
愛媛銀行	16,900	1,035.00	17,491,500
トマト銀行	4,800	1,046.00	5,020,800
京葉銀行	53,400	655.00	34,977,000
栃木銀行	62,700	228.00	14,295,600
北日本銀行	3,900	2,041.00	7,959,900
東和銀行	21,200	680.00	14,416,000
福島銀行	10,500	383.00	4,021,500
大東銀行	5,800	607.00	3,520,600
リコーリース	9,500	3,405.00	32,347,500
イオンフィナンシャルサービス	77,200	2,102.00	162,274,400
アコム	243,200	365.00	88,768,000
ジャックス	13,400	1,887.00	25,285,800
オリエントコーポレーション	327,100	122.00	39,906,200
日立キャピタル	28,600	2,450.00	70,070,000
アプラスフィナンシャル	58,700	82.00	4,813,400
オリックス	807,500	1,645.00	1,328,337,500
三菱UFJリース	273,100	561.00	153,209,100
ジャフコ	19,800	3,770.00	74,646,000
九州リースサービス	5,900	692.00	4,082,800
トモニホールディングス	93,500	394.00	36,839,000
大和証券グループ本社	971,100	557.90	541,776,690
野村ホールディングス	2,129,400	434.50	925,224,300
岡三証券グループ	103,100	473.00	48,766,300
丸三証券	35,900	799.00	28,684,100
東洋証券	43,400	162.00	7,030,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	144,300	469.00	67,676,700
光世証券	2,900	727.00	2,108,300
水戸証券	35,100	260.00	9,126,000
いちよし証券	25,400	858.00	21,793,200
松井証券	59,300	1,160.00	68,788,000
SOMP Oホールディングス	213,300	4,003.00	853,839,900
だいこう証券ビジネス	5,000	399.00	1,995,000
日本取引所グループ	326,800	1,884.00	615,691,200
マネックスグループ	113,000	376.00	42,488,000
カブドットコム証券	90,400	525.00	47,460,000
極東証券	16,200	1,142.00	18,500,400
岩井コスモホールディングス	12,400	1,201.00	14,892,400
藍澤証券	22,700	652.00	14,800,400
フィデアホールディングス	117,800	135.00	15,903,000
池田泉州ホールディングス	128,500	297.00	38,164,500
アニコムホールディングス	9,400	2,943.00	27,664,200
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	316,500	3,222.00	1,019,763,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	99,400	2,094.00	208,143,600
マネーパートナーズグループ	14,200	292.00	4,146,400
小林洋行	3,400	261.00	887,400

第一生命ホールディングス	684,700	1,745.50	1,195,143,850
東京海上ホールディングス	438,800	5,341.00	2,343,630,800
アドバンテッジリスクマネジメント	4,600	980.00	4,508,000
イー・ギャランティ	11,300	1,068.00	12,068,400
アサックス	4,900	537.00	2,631,300
NECキャピタルソリューション	5,000	1,604.00	8,020,000
T&Dホールディングス	374,200	1,352.50	506,105,500
アドバンスクリエイト	2,800	1,771.00	4,958,800
三井不動産	642,200	2,651.50	1,702,793,300
三菱地所	847,900	1,908.00	1,617,793,200
平和不動産	23,000	2,068.00	47,564,000
東京建物	132,200	1,338.00	176,883,600
ダイビル	35,600	1,070.00	38,092,000
京阪神ビルディング	21,700	892.00	19,356,400
住友不動産	272,000	4,120.00	1,120,640,000
太平洋興発	4,900	729.00	3,572,100
テーオーシー	27,700	828.00	22,935,600
東京楽天地	1,900	4,625.00	8,787,500
レオパレス21	149,300	515.00	76,889,500
スターツコーポレーション	16,400	2,470.00	40,508,000
フジ住宅	15,400	855.00	13,167,000
空港施設	14,400	542.00	7,804,800
明和地所	6,700	610.00	4,087,000
ゴールドクレスト	9,500	1,614.00	15,333,000
リログループ	64,100	2,907.00	186,338,700
日本エスリード	4,700	1,583.00	7,440,100
日神不動産	17,800	446.00	7,938,800
日本エスコン	21,900	821.00	17,979,900
タカラレーベン	56,600	349.00	19,753,400
サンヨーハウジング名古屋	6,800	923.00	6,276,400
イオンモール	60,600	1,848.00	111,988,800
ファースト住建	4,600	1,162.00	5,345,200
ランド	492,600	9.00	4,433,400
カチタス	13,500	3,515.00	47,452,500
東祥	7,200	3,340.00	24,048,000
トーセイ	16,600	1,081.00	17,944,600
穴吹興産	1,300	2,771.00	3,602,300
サンフロンティア不動産	16,700	1,255.00	20,958,500
エフ・ジェー・ネクスト	10,500	868.00	9,114,000
インテリックス	3,500	649.00	2,271,500
ランドビジネス	6,200	777.00	4,817,400
グランディハウス	10,600	427.00	4,526,200
東武鉄道	129,400	3,015.00	390,141,000
相鉄ホールディングス	42,200	3,220.00	135,884,000
東京急行電鉄	333,300	1,828.00	609,272,400
京浜急行電鉄	168,100	1,788.00	300,562,800
小田急電鉄	196,600	2,422.00	476,165,200
京王電鉄	68,600	6,130.00	420,518,000
京成電鉄	92,000	3,530.00	324,760,000
富士急行	16,700	3,540.00	59,118,000

新京成電鉄	3,100	2,078.00	6,441,800
東日本旅客鉄道	218,200	10,160.00	2,216,912,000
西日本旅客鉄道	110,000	7,859.00	864,490,000
東海旅客鉄道	109,900	23,625.00	2,596,387,500
西武ホールディングス	156,300	1,934.00	302,284,200
鴻池運輸	19,600	1,663.00	32,594,800
西日本鉄道	34,000	2,687.00	91,358,000
ハマキョウレックス	9,400	3,800.00	35,720,000
サカイ引越センター	6,500	6,210.00	40,365,000
近鉄グループホールディングス	116,100	4,770.00	553,797,000
阪急阪神ホールディングス	155,000	3,870.00	599,850,000
南海電気鉄道	51,900	2,915.00	151,288,500
京阪ホールディングス	51,800	4,490.00	232,582,000
神戸電鉄	3,000	3,895.00	11,685,000
名古屋鉄道	93,100	2,893.00	269,338,300
山陽電気鉄道	9,000	2,108.00	18,972,000
トランコム	3,300	6,640.00	21,912,000
日本通運	45,600	6,550.00	298,680,000
ヤマトホールディングス	203,700	2,811.00	572,600,700
山九	32,300	5,150.00	166,345,000
日新	10,000	1,905.00	19,050,000
丸運	6,200	298.00	1,847,600
丸全昭和運輸	9,400	2,742.00	25,774,800
センコーグループホールディングス	64,100	857.00	54,933,700
トナミホールディングス	2,800	5,920.00	16,576,000
ニッコンホールディングス	44,200	2,715.00	120,003,000
日本石油輸送	1,400	2,841.00	3,977,400
福山通運	14,900	4,250.00	63,325,000
セイノーホールディングス	87,000	1,503.00	130,761,000
エスライン	3,100	1,119.00	3,468,900
神奈川中央交通	2,900	3,685.00	10,686,500
日立物流	25,600	3,025.00	77,440,000
丸和運輸機関	6,100	3,415.00	20,831,500
C & F ロジホールディングス	11,900	1,181.00	14,053,900
日本郵船	97,100	1,812.00	175,945,200
商船三井	69,000	2,648.00	182,712,000
川崎汽船	35,800	1,556.00	55,704,800
NSユナイテッド海運	6,400	2,630.00	16,832,000
明治海運	12,100	353.00	4,271,300
飯野海運	55,000	397.00	21,835,000
共栄タンカー	800	1,520.00	1,216,000
九州旅客鉄道	97,600	3,575.00	348,920,000
SGホールディングス	109,800	2,982.00	327,423,600
日本航空	212,800	4,026.00	856,732,800
ANAホールディングス	212,500	4,057.00	862,112,500
パスコ	2,300	847.00	1,948,100
西本Wismettacホールディングス	2,800	4,735.00	13,258,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,350.00	1,215,000
Genky DrugStores	4,700	2,652.00	12,464,400

国際紙パルプ商事	21,200	269.00	5,702,800
総合メディカルホールディングス	10,500	1,911.00	20,065,500
ブックオフグループホールディングス	6,400	762.00	4,876,800
三菱倉庫	40,200	2,652.00	106,610,400
三井倉庫ホールディングス	14,300	1,999.00	28,585,700
住友倉庫	43,700	1,453.00	63,496,100
澁澤倉庫	6,500	1,568.00	10,192,000
ヤマタネ	6,100	1,695.00	10,339,500
東陽倉庫	20,500	297.00	6,088,500
乾汽船	10,400	713.00	7,415,200
日本トランスシティ	25,700	438.00	11,256,600
ケイヒン	2,200	1,284.00	2,824,800
中央倉庫	6,900	1,001.00	6,906,900
川西倉庫	2,300	1,181.00	2,716,300
安田倉庫	9,700	878.00	8,516,600
東洋埠頭	3,300	1,430.00	4,719,000
宇徳	10,100	546.00	5,514,600
上組	71,800	2,431.00	174,545,800
サンリツ	2,900	694.00	2,012,600
キムラユニティー	3,200	1,089.00	3,484,800
キューソー流通システム	3,000	2,057.00	6,171,000
近鉄エクスプレス	22,000	1,665.00	36,630,000
東海運	6,300	280.00	1,764,000
エーアイティー	7,500	1,017.00	7,627,500
内外トランスライン	3,800	1,434.00	5,449,200
日本コンセプト	3,200	1,002.00	3,206,400
東京放送ホールディングス	79,800	1,893.00	151,061,400
日本テレビホールディングス	110,500	1,703.00	188,181,500
朝日放送グループホールディングス	12,100	709.00	8,578,900
テレビ朝日ホールディングス	33,100	1,957.00	64,776,700
スカパーJ S A Tホールディングス	92,000	473.00	43,516,000
テレビ東京ホールディングス	9,900	2,627.00	26,007,300
日本BS放送	4,200	1,055.00	4,431,000
ビジョン	3,800	4,245.00	16,131,000
USEN-NEXT HOLDINGS	4,600	926.00	4,259,600
ワイヤレスゲート	5,300	529.00	2,803,700
コネクシオ	8,600	1,414.00	12,160,400
日本通信	102,600	127.00	13,030,200
クロップス	2,300	678.00	1,559,400
日本電信電話	823,500	4,636.00	3,817,746,000
KDDI	1,061,100	2,658.50	2,820,934,350
ソフトバンク	957,300	1,306.00	1,250,233,800
光通信	14,200	17,730.00	251,766,000
NTTドコモ	864,600	2,554.50	2,208,620,700
エムティーアイ	14,100	609.00	8,586,900
GMOインターネット	43,800	1,571.00	68,809,800
アイドママーケティングコミュニケーション	2,500	498.00	1,245,000
カドカワ	35,100	1,189.00	41,733,900

学研ホールディングス	4,100	4,100.00	16,810,000
ゼンリン	24,000	2,802.00	67,248,000
昭文社	5,400	450.00	2,430,000
インプレスホールディングス	9,700	150.00	1,455,000
東京電力ホールディングス	979,500	672.00	658,224,000
中部電力	375,400	1,671.50	627,481,100
関西電力	500,700	1,582.00	792,107,400
中国電力	169,600	1,471.00	249,481,600
北陸電力	120,100	881.00	105,808,100
東北電力	287,400	1,420.00	408,108,000
四国電力	110,500	1,421.00	157,020,500
九州電力	252,900	1,324.00	334,839,600
北海道電力	114,800	780.00	89,544,000
沖縄電力	22,700	2,058.00	46,716,600
電源開発	97,700	2,757.00	269,358,900
エフオン	7,300	909.00	6,635,700
イーレックス	21,300	661.00	14,079,300
レノバ	12,700	1,093.00	13,881,100
東京瓦斯	240,700	2,907.50	699,835,250
大阪瓦斯	238,000	2,161.00	514,318,000
東邦瓦斯	60,700	4,600.00	279,220,000
北海道瓦斯	6,600	1,438.00	9,490,800
広島ガス	25,500	343.00	8,746,500
西部瓦斯	13,900	2,489.00	34,597,100
静岡ガス	37,700	892.00	33,628,400
メタウォーター	5,900	3,110.00	18,349,000
アイネット	6,800	1,353.00	9,200,400
松竹	7,900	10,900.00	86,110,000
東宝	79,200	3,940.00	312,048,000
エイチ・アイ・エス	20,900	4,240.00	88,616,000
東映	5,100	13,980.00	71,298,000
ラックランド	2,300	1,940.00	4,462,000
エヌ・ティ・ティ・データ	320,700	1,184.00	379,708,800
共立メンテナンス	17,800	4,965.00	88,377,000
イチネンホールディングス	12,300	1,232.00	15,153,600
建設技術研究所	8,000	1,399.00	11,192,000
スペース	7,600	1,247.00	9,477,200
長 大	4,700	799.00	3,755,300
アインホールディングス	16,200	7,760.00	125,712,000
燦ホールディングス	2,600	2,497.00	6,492,200
ビー・シー・エー	1,600	2,007.00	3,211,200
スバル興業	700	5,550.00	3,885,000
東京テアトル	4,600	1,262.00	5,805,200
タナベ経営	2,300	1,282.00	2,948,600
ビジネスブレイン太田昭和	2,100	1,958.00	4,111,800
ナガワ	3,300	5,460.00	18,018,000
よみうりランド	2,600	4,050.00	10,530,000
東京都競馬	7,600	3,055.00	23,218,000
常磐興産	4,800	1,584.00	7,603,200
カナモト	17,400	2,965.00	51,591,000

東京ドーム	43,800	966.00	42,310,800
D T S	13,500	4,175.00	56,362,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	56,000	3,335.00	186,760,000
シーイーシー	12,900	2,125.00	27,412,500
カブコン	51,600	2,268.00	117,028,800
西尾レントオール	12,000	3,275.00	39,300,000
アイ・エス・ビー	2,400	1,907.00	4,576,800
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	63,000	29.00	1,827,000
日本空港ビルデング	38,600	4,275.00	165,015,000
トランス・コスモス	13,000	2,083.00	27,079,000
乃村工藝社	27,300	2,990.00	81,627,000
ジャステック	7,000	933.00	6,531,000
S C S K	31,800	4,625.00	147,075,000
藤田観光	4,700	2,693.00	12,657,100
K N T - C Tホールディングス	6,300	1,218.00	7,673,400
日本管財	12,600	1,907.00	24,028,200
トーカイ	11,300	2,781.00	31,425,300
白洋舎	1,300	2,762.00	3,590,600
セコム	124,400	9,042.00	1,124,824,800
日本システムウエア	4,000	2,005.00	8,020,000
セントラル警備保障	5,600	4,280.00	23,968,000
アイネス	15,200	1,307.00	19,866,400
丹青社	22,200	1,166.00	25,885,200
メイテック	14,800	4,805.00	71,114,000
T K C	10,100	3,910.00	39,491,000
富士ソフト	18,000	4,485.00	80,730,000
応用地質	12,600	1,183.00	14,905,800
船井総研ホールディングス	24,300	2,272.00	55,209,600
N S D	19,700	2,389.00	47,063,300
進学会ホールディングス	5,200	592.00	3,078,400
丸紅建材リース	1,100	1,895.00	2,084,500
オオバ	9,300	606.00	5,635,800
コナミホールディングス	49,300	4,410.00	217,413,000
いであ	2,300	986.00	2,267,800
学究社	4,000	1,375.00	5,500,000
ベネッセホールディングス	43,000	2,924.00	125,732,000
イオンディライト	14,400	4,045.00	58,248,000
ナック	7,400	1,043.00	7,718,200
福井コンピュータホールディングス	4,000	1,814.00	7,256,000
ニチイ学館	16,700	1,299.00	21,693,300
ダイセキ	19,600	2,577.00	50,509,200
ステップ	4,400	1,423.00	6,261,200
日鉄住金物産	8,700	4,620.00	40,194,000
泉州電業	4,100	2,555.00	10,475,500
元気寿司	3,400	3,800.00	12,920,000
トラスコ中山	25,100	3,160.00	79,316,000
ヤマダ電機	368,000	526.00	193,568,000
オートバックスセブン	48,000	1,856.00	89,088,000

モリト	8,900	722.00	6,425,800
アークランドサカモト	20,500	1,417.00	29,048,500
ニトリホールディングス	52,400	14,110.00	739,364,000
グルメ杵屋	8,800	1,133.00	9,970,400
愛眼	9,700	301.00	2,919,700
ケーユーホールディングス	6,200	782.00	4,848,400
吉野家ホールディングス	42,300	1,765.00	74,659,500
加藤産業	18,900	3,265.00	61,708,500
北恵	2,300	943.00	2,168,900
イノテック	8,300	1,033.00	8,573,900
イエローハット	11,400	2,733.00	31,156,200
松屋フーズホールディングス	5,800	3,550.00	20,590,000
JBCホールディングス	9,500	1,707.00	16,216,500
JKホールディングス	11,100	566.00	6,282,600
サガミホールディングス	16,200	1,324.00	21,448,800
日伝	10,000	1,563.00	15,630,000
関西スーパーマーケット	9,200	988.00	9,089,600
ミロク情報サービス	12,000	2,556.00	30,672,000
北沢産業	9,200	290.00	2,668,000
杉本商事	6,600	1,731.00	11,424,600
因幡電機産業	17,100	4,600.00	78,660,000
王将フードサービス	8,900	7,170.00	63,813,000
ブレナス	13,600	1,823.00	24,792,800
ミニストップ	9,000	1,931.00	17,379,000
アークス	22,700	2,437.00	55,319,900
パローホールディングス	26,100	2,714.00	70,835,400
バイテックホールディングス	5,400	2,035.00	10,989,000
東テク	4,100	2,279.00	9,343,900
ミスミグループ本社	151,300	2,607.00	394,439,100
藤久	900	749.00	674,100
アルテック	8,700	222.00	1,931,400
ベルク	5,900	4,860.00	28,674,000
大庄	6,500	1,527.00	9,925,500
タキヒヨー	3,800	1,792.00	6,809,600
ファーストリテイリング	16,200	48,020.00	777,924,000
ソフトバンクグループ	503,200	9,962.00	5,012,878,400
蔵王産業	2,100	1,276.00	2,679,600
スズケン	55,100	5,580.00	307,458,000
サンドラッグ	45,400	3,460.00	157,084,000
サックスパーホールディングス	10,200	1,083.00	11,046,600
ジェコス	8,500	1,045.00	8,882,500
ヤマザワ	2,400	1,775.00	4,260,000
やまや	2,100	2,258.00	4,741,800
ルネサスイーストン	11,200	430.00	4,816,000
ベルーナ	29,600	866.00	25,633,600
合計	142,571,800		275,040,369,410

*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31年2月8日から令和1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12期 平成31年2月7日現在	第13期中間計算期間末 令和1年8月7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	101,021,815	96,802,434
親投資信託受益証券	30,212,716,248	31,444,506,440
流動資産合計	30,313,738,063	31,541,308,874
資産合計	30,313,738,063	31,541,308,874
負債の部		
流動負債		
未払解約金	74,515,445	69,690,449
未払受託者報酬	4,438,160	4,112,723
未払委託者報酬	20,130,322	21,449,452
その他未払費用	206,116	209,680
流動負債合計	99,290,043	95,462,304
負債合計	99,290,043	95,462,304
純資産の部		
元本等		
元本	1 25,267,322,187	1 27,169,703,426
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	4,947,125,833	4,276,143,144
(分配準備積立金)	2,758,828,545	2,440,779,553
元本等合計	30,214,448,020	31,445,846,570
純資産合計	30,214,448,020	31,445,846,570
負債純資産合計	30,313,738,063	31,541,308,874

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	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	第13期中間計算期間 自 平成31年2月8日 至 令和1年8月7日
営業収益		
有価証券売買等損益	248,946,972	1,034,109,808
営業収益合計	248,946,972	1,034,109,808
営業費用		
支払利息	40,697	39,156
受託者報酬	3,870,854	4,112,723
委託者報酬	17,557,304	21,449,452
その他費用	196,274	209,680
営業費用合計	21,665,129	25,811,011
営業利益又は営業損失()	227,281,843	1,059,920,819
経常利益又は経常損失()	227,281,843	1,059,920,819
中間純利益又は中間純損失()	227,281,843	1,059,920,819
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()	21,944,206	58,238,281
期首剰余金又は期首欠損金()	5,291,998,337	4,947,125,833
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,214,836,777	1,074,933,548
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,214,836,777	1,074,933,548
剰余金減少額又は欠損金増加額	876,281,760	627,757,137
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	876,281,760	627,757,137
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	6,835,890,991	4,276,143,144

(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12期 平成31年2月7日現在	第13期中間計算期間末 令和1年8月7日現在
1. 1 期首元本額	17,252,295,483円	25,267,322,187円
期中追加設定元本額	14,073,136,483円	5,078,001,825円
期中一部解約元本額	6,058,109,779円	3,175,620,586円
2. 受益権の総数	25,267,322,187口	27,169,703,426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12期 平成31年2月7日現在	第13期中間計算期間末 令和1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12期 平成31年2月7日現在	第13期中間計算期間末 令和1年8月7日現在
1口当たり純資産額	1,1958円	1,1574円
（1万口当たり純資産額）	（11,958円）	（11,574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31年2月7日現在	令和1年8月7日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		4,125,464,360	6,136,491,254
株式	2	275,040,369,410	232,994,230,830
派生商品評価勘定		91,224,648	-
未収入金		-	6,169,145,340
未収配当金		424,228,839	390,241,955
前払金		-	117,659,500
流動資産合計		279,681,287,257	245,807,768,879
資産合計		279,681,287,257	245,807,768,879
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,179,860	115,768,188
前受金		118,060,000	-
未払解約金		376,733,000	3,387,936,000
流動負債合計		496,972,860	3,503,704,188
負債合計		496,972,860	3,503,704,188
純資産の部			
元本等			
元本	1	115,232,523,115	103,244,090,268
剰余金			
剰余金又は欠損金()		163,951,791,282	139,059,974,423
元本等合計		279,184,314,397	242,304,064,691
純資産合計		279,184,314,397	242,304,064,691
負債純資産合計		279,681,287,257	245,807,768,879

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31年2月7日現在	令和1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	109,428,148,369円	115,232,523,115円
同期中追加設定元本額	39,063,771,527円	11,802,282,397円
同期中一部解約元本額	33,259,396,781円	23,790,715,244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	12,470,165,201円	13,398,315,412円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	2,422,782,745円	2,820,262,809円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	3,584,623円	3,118,301円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	7,945,181円	7,099,171円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	13,986,982円	12,144,548円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	29,918,491円	30,481,114円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	21,960,170円	20,669,067円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	16,943,092円	15,178,531円
たわらノーロード TOPIX	392,245,080円	505,276,461円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	110,161,759円	203,833,493円
たわらノーロード バランス（堅実型）	2,948,338円	5,814,194円
たわらノーロード バランス（標準型）	20,703,269円	39,502,121円

たわらノーロード バランス (積極型)	40,994,687円	65,669,162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)	224,069円	404,864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)	11,759,993円	27,349,490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)	36,734,333円	79,599,001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)	27,744,281円	60,117,131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)	74,154,128円	133,383,937円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	66,600円	235,126円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	177,452円	652,935円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	1,070,868円	1,756,121円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	690,488円	1,154,298円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	2,408,866円	3,493,885円
D I A M国内株式インデックス ファンド< D C年金>	38,649,342,706円	37,717,348,370円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	937,399,472円	1,001,949,258円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	3,139,647,393円	3,299,156,775円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,204,466,039円	3,415,393,192円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	360,910,846円	374,061,185円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,178,711,664円	1,239,060,287円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	1,114,346,617円	1,158,941,433円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	40,917,509円	41,773,096円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,087,561,549円	1,122,667,639円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	25,501,335円	26,814,455円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	297,908,998円	317,323,721円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	199,184,916円	224,892,572円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	344,970,555円	391,071,442円
投資のソムリエ	4,315,294,876円	3,067,368,782円
クルーズコントロール	1,257,278,344円	183,258,980円
投資のソムリエ< D C年金>	401,357,411円	325,757,796円

D I A M 8 資産バランスファンドN<DC年金>	222,726,425円	254,940,650円
4 資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	277,618,478円	305,244,352円
クルーズコントロール<DC年金>	891,895円	258,045円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	12,880,608円	1,881,574円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	33,987,494円	6,139,573円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	55,644,561円	116,683,528円
ダイナミック・ナビゲーション	534,098円	546,021円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	935,961,743円	1,482,356,100円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	2,300,413円	2,586,290円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	1,690,960円	2,094,616円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	363,286円	815,973円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	3,177,605円	3,784,227円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	15,276,644円	24,233,331円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	133,194,060円	216,984,154円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	18,666円	42,224,151円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	-円	431,106円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	-円	431,106円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	-円	431,106円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	-円	125,361円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	70,041,061円	68,468,108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)	14,119,938円	624,894,864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)	116,779,397円	106,895,079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)	280,053,245円	267,967,419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)	15,178,664円	14,521,793円

D I A M国際分散バランスファン ド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	64,049,107円	57,162,861円
D I A M国内重視バランスファン ド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	16,881,660円	16,493,638円
D I A M国内重視バランスファン ド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	13,764,104円	13,932,728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)	26,737,416円	31,859,334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)	55,134,608円	62,365,483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)	1,036,891,666円	970,910,522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)	979,267,957円	945,824,730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)	2,714,393,012円	2,652,515,026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)	197,056,346円	190,496,368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)	52,699,951円	52,328,524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)	565,823,049円	525,971,880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)	356,264,357円	256,752,419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)	10,473,598円	10,473,598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)	7,863,061円	3,381,105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)	51,727,826円	43,060,055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)	9,107,706,646円	3,701,219,037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)	163,483,865円	58,012,606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)	1,823,334,497円	704,031,889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)	10,421,255,147円	5,028,217,910円
	D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	4,948,207円	3,502,941円
	D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	296,109円	1,801,715円
	D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	3,683,923円	200,404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)	9,276,101,711円	9,308,174,985円
	D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	66,616,336円	63,765,253円
	D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	28,932,320円	26,111,618円
	D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	26,843,008円	26,829,172円
	D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	107,564円	110,564円
	D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	120,467円	125,484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)	426,124,037円	426,124,037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)	1,366,625,210円	1,335,152,689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)	1,837,729,242円	1,766,916,070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)	72,976,941円	72,976,941円
	計	115,232,523,115円	103,244,090,268円
2 .	受益権の総数	115,232,523,115口	103,244,090,268口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,287,500,000円	株式 3,395,500,000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31年2月7日現在	令和1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	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	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31年2月7日 現在				令和1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	4,032,080,000	-	4,121,210,000	89,130,000	3,284,039,500	-	3,168,340,000	115,699,500
合計	4,032,080,000	-	4,121,210,000	89,130,000	3,284,039,500	-	3,168,340,000	115,699,500

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成31年2月7日現在	令和1年8月7日現在
1口当たり純資産額	2.4228円	2.3469円
(1万口当たり純資産額)	(24,228円)	(23,469円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

令和1年8月30日現在

資産総額	32,457,379,948円
負債総額	79,427,287円
純資産総額(-)	32,377,952,661円
発行済数量	27,747,412,146口
1口当たり純資産額(/)	1.1669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

令和1年8月30日現在

資産総額	246,771,079,433円
負債総額	5,769,579,119円
純資産総額(-)	241,001,500,314円
発行済数量	101,842,862,652口
1口当たり純資産額(/)	2.3664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(2019年8月30日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2019年8月30日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年8月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,154,407,417,273
追加型株式投資信託	873	13,507,385,911,626
単位型公社債投資信託	41	118,024,810,741
単位型株式投資信託	167	1,260,959,327,482
合計	1,107	16,040,777,467,122

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34期事業年度（自2018年4月1日至2019年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	49,071,217	41,087,475
金銭の信託	12,083,824	18,773,228
有価証券	-	153,518
未収委託者報酬	11,769,015	12,438,085
未収運用受託報酬	4,574,225	3,295,109
未収投資助言報酬	341,689	327,064
未収収益	59,526	56,925
前払費用	569,431	573,874
その他	427,238	491,914
流動資産計	78,896,169	77,197,195
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 1,156,953	1 1,096,916
器具備品	1 476,504	1 364,399
建設仮勘定	10,368	-
無形固定資産		
ソフトウェア	1,026,319	885,545
ソフトウェア仮勘定	904,389	1,522,040
電話加入権	3,931	3,931
電信電話専用施設利用権	60	23
投資その他の資産		
投資有価証券	1,721,433	1,611,931
関係会社株式	3,229,196	4,499,196
長期差入保証金	1,518,725	1,312,328
繰延税金資産	1,699,533	1,748,459
その他	101,425	97,892
固定資産計	11,848,840	13,142,665
資産合計	90,745,010	90,339,861

（単位：千円）

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,003,550	2,183,889
未払金	5,081,728	5,697,942
未払収益分配金	1,031	1,053
未払償還金	57,275	48,968
未払手数料	4,629,133	4,883,723
その他未払金	394,288	764,196
未払費用	7,711,038	6,724,986
未払法人税等	5,153,972	3,341,238
未払消費税等	1,660,259	576,632
賞与引当金	1,393,911	1,344,466
役員賞与引当金	49,986	48,609
本社移転費用引当金	156,587	-
流動負債計	22,211,034	19,917,766
固定負債		
退職給付引当金	1,637,133	1,895,158
時効後支払損引当金	199,026	177,851
固定負債計	1,836,160	2,073,009
負債合計	24,047,195	21,990,776
(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	44,349,855	45,949,372
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	44,226,562	45,826,079
別途積立金	24,580,000	31,680,000
研究開発積立金	300,000	-
運用責任準備積立金	200,000	-
繰越利益剰余金	19,146,562	14,146,079
株主資本計	65,902,812	67,502,329
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	795,002	846,755
評価・換算差額等計	795,002	846,755
純資産合計	66,697,815	68,349,085
負債・純資産合計	90,745,010	90,339,861

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第33期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	84,705,447		84,812,585	
運用受託報酬	19,124,427		16,483,356	
投資助言報酬	1,217,672		1,235,553	
その他営業収益	117,586		113,622	
営業収益計		105,165,133		102,645,117
営業費用				
支払手数料	37,242,284		36,100,556	
広告宣伝費	379,873		387,028	
公告費	1,485		375	
調査費	23,944,438		24,389,003	
調査費	10,677,166		9,956,757	
委託調査費	13,267,272		14,432,246	
委託計算費	1,073,938		936,075	
営業雑経費	1,215,963		1,254,114	
通信費	48,704		47,007	
印刷費	947,411		978,185	
協会費	64,331		63,558	
諸会費	22,412		22,877	
支払販売手数料	133,104		142,485	
営業費用計		63,857,984		63,067,153
一般管理費				
給料	11,304,873		10,859,354	
役員報酬	189,022		189,198	
給料・手当	9,565,921		9,098,957	
賞与	1,549,929		1,571,197	
交際費	58,863		60,115	
寄付金	5,150		7,255	
旅費交通費	395,605		361,479	
租税公課	625,498		588,172	
不動産賃借料	1,534,255		1,511,876	
退職給付費用	595,876		521,184	
固定資産減価償却費	1,226,472		590,667	
福利厚生費	49,797		45,292	
修繕費	4,620		16,247	
賞与引当金繰入額	1,393,911		1,344,466	
役員賞与引当金繰入額	49,986		48,609	
機器リース料	148		130	
事務委託費	3,037,804		3,302,806	
事務用消耗品費	144,804		131,074	
器具備品費	5,253		8,112	
諸経費	149,850		188,367	
一般管理費計		20,582,772		19,585,212
営業利益		20,724,376		19,992,752

(単位:千円)

	第33期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		1,430		1,749
受取配当金		74,278		73,517
時効成立分配金・償還金		256		8,582
為替差益		8,530		-
投資信託解約益		236,398		-
投資信託償還益		93,177		-
受取負担金		-		177,066
雑収入		10,306		24,919
時効後支払損引当金戻入額		17,429		19,797
営業外収益計		441,807		305,633
営業外費用				
為替差損		-		17,542
投資信託解約損		4,138		-
投資信託償還損		17,065		-
金銭の信託運用損		99,303		175,164
雑損失		-		5,659
営業外費用計		120,507		198,365
経常利益		21,045,676		20,100,019
特別利益				
固定資産売却益		1		-
投資有価証券売却益		479,323		353,644
関係会社株式売却益	1	1,492,680	1	-
本社移転費用引当金戻入額		138,294		-
その他特別利益		350		-
特別利益計		2,110,649		353,644
特別損失				
固定資産除却損	2	36,992	2	19,121
固定資産売却損		134		-
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		804,083		19,121
税引前当期純利益		22,352,243		20,434,543
法人税、住民税及び事業税		6,951,863		6,386,793
法人税等調整額		249,832		71,767
法人税等合計		6,702,031		6,315,026
当期純利益		15,650,211		14,119,516

(3)【株主資本等変動計算書】

第33期(自 2017年4月1日 至 2018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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

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

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

注記事項

重要な会計方針

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

表示方法の変更

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当事業年度から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」842,996千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,699,533千円に含めて表示しております。

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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
建物	140,580	229,897
器具備品	847,466	927,688

(損益計算書関係)

1. 関係会社に対する事項

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
関係会社株式売却益	1,492,680	-

2. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
建物	298	1,550
器具備品	8,217	439
ソフトウェア	28,472	17,130
電話加入権	3	-

(株主資本等変動計算書関係)

第33期(自 2017年4月1日 至 2018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
2017年6月21日 定時株主総会	普通株式	3,200,000	80,000	2017年3月31日	2017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

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
2018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	2018年3月31日	2018年6月21日
	A種種類株式					

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

2019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
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21日
	A種種類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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あります。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33期(2018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	-

第34期(2019年3月31日現在)

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

(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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
非上場株式	272,464	276,764
関係会社株式	3,229,196	4,499,196

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第33期(2018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	-	-

第34期(2019年3月31日現在)

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

(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33期の貸借対照表計上額3,229,196千円、第34期の貸借対照表計上額4,499,196千円)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33期（2018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。

第34期（2019年3月31日現在）

（千円）

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

（注）非上場株式（貸借対照表計上額276,674千円）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33期（自 2017年4月1日 至 2018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。

第34期(自2018年4月1日至2019年3月31日)

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

(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2017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33期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,718,372	2,154,607
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
数理計算上の差異の発生額	61,792	10,147
退職給付の支払額	111,758	158,018
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	-
その他	-	438
退職給付債務の期末残高	2,154,607	2,289,044

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第33期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)
年金資産の期首残高	1,363,437	-
期待運用収益	17,042	-
事業主からの拠出額	36,672	-
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	-	-

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

(千円)

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,154,607	2,289,044
未積立退職給付債務	2,154,607	2,289,044
未認識数理計算上の差異	204,636	150,568
未認識過去勤務費用	312,836	243,317
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,637,133	1,895,158
退職給付引当金	1,637,133	1,895,158
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,637,133	1,895,158

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
期待運用収益	17,042	-
数理計算上の差異の費用処理額	88,417	43,920
過去勤務費用の費用処理額	39,611	69,519
退職一時金制度改定に伴う費用処理額	70,560	-
その他	1,620	3,640
確定給付制度に係る退職給付費用	456,577	411,963
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) 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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	1.00% ~ 4.42%

3. 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33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019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	53,156	-
制度への拠出額	35,640	-
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	-	-

(2) 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 53,156千円 当事業年度 - 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86,141千円、当事業年度104,720千円であります。

(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33期	第34期
	(2018年3月31日現在)	(2019年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	290,493	173,805
未払事業所税	11,683	10,915
賞与引当金	426,815	411,675
未払法定福利費	81,186	80,253
未払給与	9,186	7,961
受取負担金	-	138,994
運用受託報酬	-	102,490
資産除去債務	90,524	10,152
減価償却超過額(一括償却資産)	11,331	4,569
減価償却超過額	176,791	125,839
繰延資産償却超過額(税法上)	34,977	135,542
退職給付引当金	501,290	580,297
時効後支払損引当金	60,941	54,458
ゴルフ会員権評価損	13,173	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
本社移転費用引当金	47,947	-
その他	29,193	29,494
繰延税金資産小計	1,981,254	2,069,527
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,981,254	2,069,527
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	281,720	321,067
繰延税金負債合計	281,720	321,067
繰延税金資産の純額	1,699,533	1,748,459

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

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	114,270,495千円	104,326,078千円
資産合計	114,270,495千円	104,326,078千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	13,059,836千円	10,571,428千円
負債合計	13,059,836千円	10,571,428千円
純資産	101,210,659千円	93,754,650千円

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

のれん	70,507,975千円	66,696,733千円
顧客関連資産	45,200,838千円	39,959,586千円

(2) 損益計算書項目

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	9,012,128千円	9,043,138千円
経常利益	9,012,128千円	9,043,138千円
税引前当期純利益	9,012,128千円	9,091,728千円
当期純利益	7,419,617千円	7,489,721千円
1株当たり当期純利益	185,490円43銭	187,243円04銭

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

のれんの償却額	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,233,360千円	5,241,252千円

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)及び第34期(自 2018年4月1日 至 2019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33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 子会社株式の取得は、独立した第三者機関により算定された価格を基礎として協議の上、合理的に決定しております。
- (注3) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	1,667,445円37銭	1,708,727円13銭
1株当たり当期純利益金額	391,255円29銭	352,987円92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33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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。

委託会社は、株式会社みずほ銀行から、みずほグローバルオルタナティブインベストメンツ株式会社（以下「MGAI」といいます。）の発行済株式の全てについて2018年11月1日付で譲り受け、MGAIを100%子会社（新商号：アセットマネジメントOneオルタナティブインベストメンツ株式会社）としました。

- (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

2019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。
信金中央金庫	() 690,998	日本において全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の受給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
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	11,945	「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。
損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2019年3月末日現在

() 出資の総額

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

2019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

EY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2018年4月1日から2019年3月31日までの第34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2019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31年3月15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31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、DIAMDC国内株式インデックスファンドの平成31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。

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財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、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) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

令和1年9月20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 丘本 正彦 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31年2月8日から令和1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令和1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31年2月8日から令和1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。

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) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。