

【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】	平成30年1月12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 西 惠正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	三木谷 正直
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	D I A M国内株式パッシブ・ファンド
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【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】

D I A M国内株式パッシブ・ファンド

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

ファンドの受益権は、「社債、株式等の振替に関する法律」（以下、「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（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】

5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の基準価額 とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金の再投資を行う場合は、各計算期間終了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。）

<基準価額の照会方法等>

基準価額は、当ファンドの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）

- ・計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

（５）【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：平成30年1月13日から平成30年7月12日まで

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

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）

(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。

(10) 【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

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）

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

- ・株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けい

ぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合には、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再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。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。

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2時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続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、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かかる口数の増加の記載または記録が行われます。

なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。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かか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、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。

当ファンドの信託金の限度額は、5,000億円とします。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>

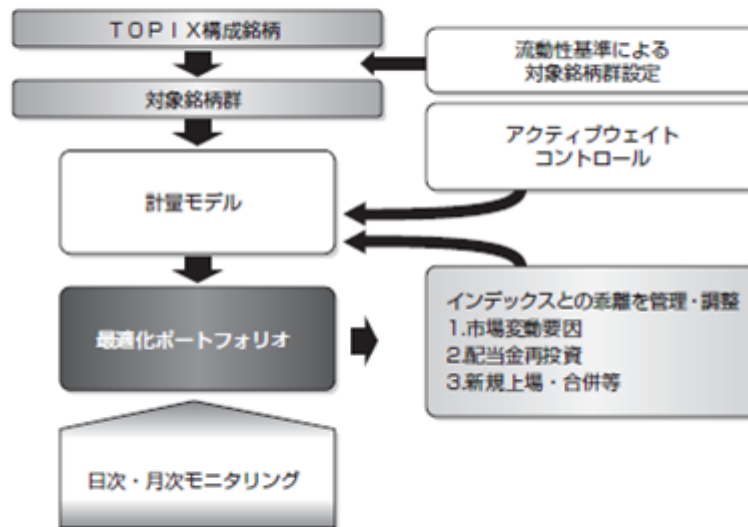
① 主に「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」に投資を行い、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

東証株価指数（TOPIX）とは、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、東京証券取引所が公表する株式指数で、東京証券取引所第1部に上場されている全ての株式の時価総額で加重平均し、指数化したものです。

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及び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、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若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、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの引用に関して得られる結果について、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、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。D I A M国内株式パッシブ・ファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用していますが、D I A M国内株式パッシブ・ファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。D I A M国内株式パッシブ・ファンド及び国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。株東京証券取引所は、D I A M国内株式パッシブ・ファンド及び国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、D I A M国内株式パッシブ・ファンド及び国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド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、当社又はD I A M国内株式パッシブ・ファンド及び国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。以上の項目に限らず、株東京証券取引所はD I A M国内株式パッシブ・ファンド及び国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドに投資するファンドの発行又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群を設定し、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 原則として、マザーファンドの組入比率は高位を維持します。

分配方針

年1回の決算時(毎年10月12日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の利子配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

- ・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ・分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

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

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

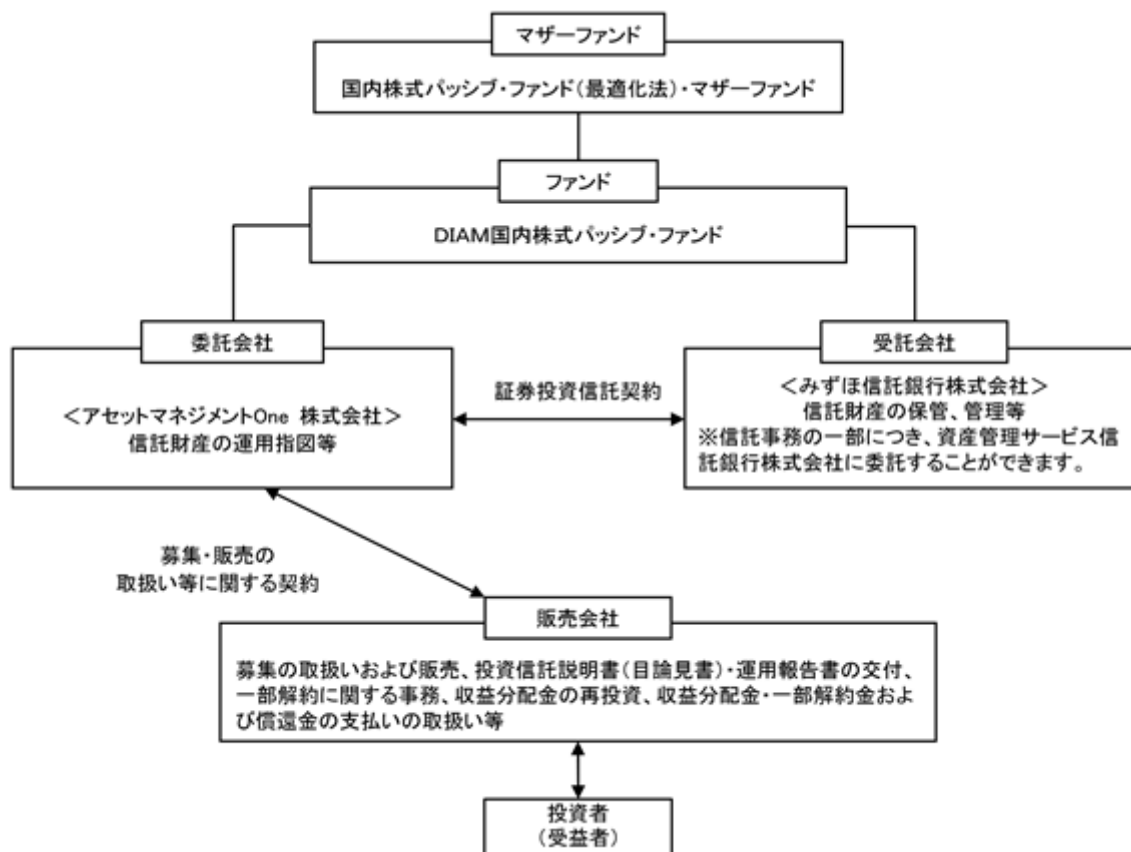
その他資産 (投資信託証券 (株式))	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として株式へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。 (注)商品分類表の投資対象資産は株式に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産(投資信託証券(株式))に分類されます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
日本	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリー ファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズ)にのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。

上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。
上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ
(<http://www.toushin.or.jp/>)でご覧いただけます。

(2) 【ファンドの沿革】

平成21年1月30日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

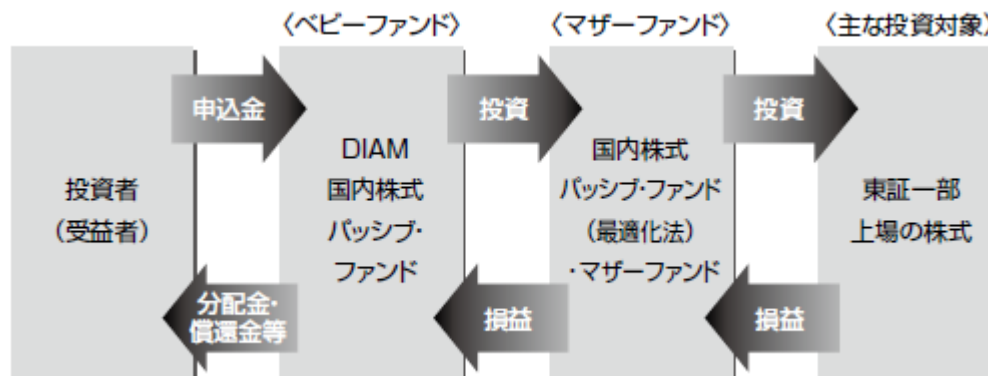
委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

・「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、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金・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の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う仕組みです。



委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（平成29年10月31日現在）

委託会社の沿革

昭和60年7月1日 会社設立

平成10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

平成10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

平成11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。

平成20年1月1日 「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更

平成28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

(平成29年10月31日現在)

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

1：A種種類株式(15,510株)を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

<投資対象>

この投資信託は、「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ます。

<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)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持します。

ただし、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

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】

投資の対象とする資産の種類(約款第15条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1.次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)

イ.有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条および第23条に定めるものに限ります。)

八．金銭債権

二．約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

有価証券の指図範囲(約款第16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．株券または新株引受権証券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 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．資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(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．投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。)
- 8．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。)
- 9．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(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。)
- 10．資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(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。)
- 11．コマーシャル・ペーパー
- 12．新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
- 13．外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.~12.の証券または証書の性質を有するもの
- 14．投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。)
- 15．投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 16．外国貸付債権信託受益証券(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。)
- 17．オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 18．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。)
- 19．外国法人が発行する譲渡性預金証書

20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
21. 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。)
22. 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
23. 外国の者に対する権利で22.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、13.ならびに18.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7.までの証券および13.ならびに18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

委託会社は、信託金を、上記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

(参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

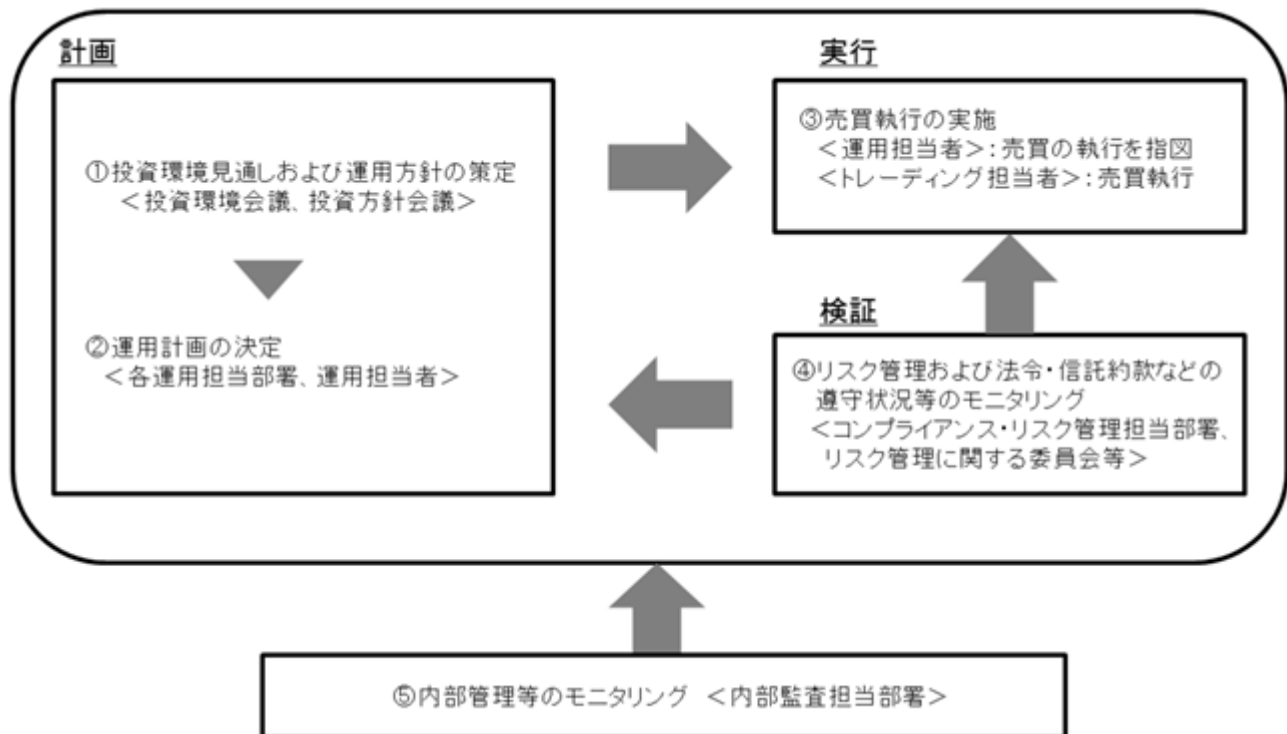
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 3. 株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。

主な投資制限	<p>1. 株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>2. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</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。

運用体制は平成29年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時(原則として毎年10月12日。休業日の場合は翌営業日。)に、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場合があります。

3) 留保益の運用方針

留保益の運用については、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

a. 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理するものとします。

- 1) 信託財産に属する配当等収益(配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料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、監査費用および当該監査費用に係る消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額、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、監査報酬および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、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、次期以降の分配金にあてるため、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係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。
- b. 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。

収益分配金の支払い

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、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

「分配金自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は税引後無手数料で再投資されますが、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) マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。(約款「運用の基本方針」 2. 運用方法 (3) 投資制限)
- 2) 株式への実質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)
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。(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19条)
 - a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずるものとして市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただ

し、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

- b. 上記a.の規定にかかわらず、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場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20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、当該売付けの決済については、株券の引渡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.~6.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.~6.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および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。))の新株予約権に限ります。))の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(5.に定めるものを除きます。))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21条)

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、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。)、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。))および外国の取引所におけるわが国の有価証券にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(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ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

8) スワップ取引の運用指図(約款第22条)

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。))を行うことの指図をすることができます。

- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、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. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとし、
 - d. 委託会社は、スワップ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、
- 9) 金利先渡取引の運用指図(約款第23条)
- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことと指図をすることができます。
 - b. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとし、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、
 - d. 委託会社は、金利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、
- 10) 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、
- 11) 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、
 - 2) 公社債の貸付けは、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、
 - b. 上記a. 1)~2)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとし、
 - c. 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとし、
- 12) 資金の借入れ(約款第30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に資するため一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとし、
 - 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、資金借入れ額は借入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。

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

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

(1) 株価変動リスク

株式の価格は、国内外の政治・経済情勢、発行会社の業績・財務状況、または市場の需給や流動性等の影響を受けます。当ファンドは実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。

(2) 信用リスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

< 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。

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、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・解約等があった場合、資金変動等が起こり、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、当該インデックス構成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。

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、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ます。

当ファンドは、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、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、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。

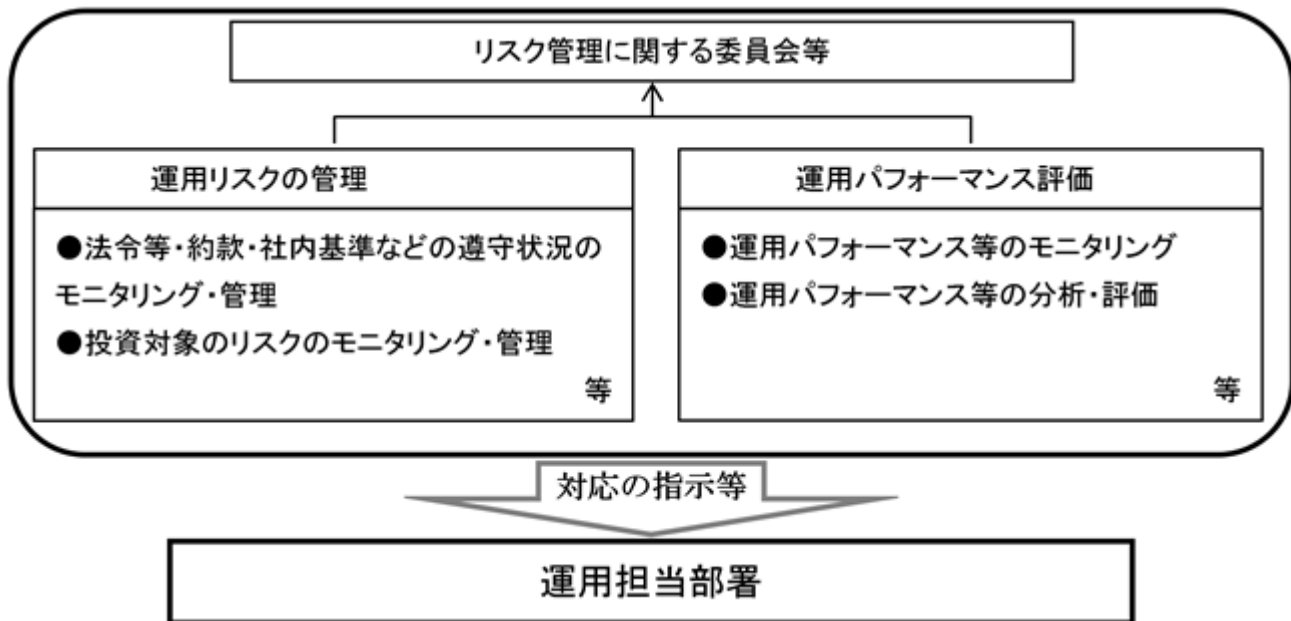
注意事項

- イ．当ファンドは、実質的に株式等の値動きのある有価証券に投資しますので、基準価額は変動します。
- ロ．投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ハ．投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ニ．投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<リスク管理体制>

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

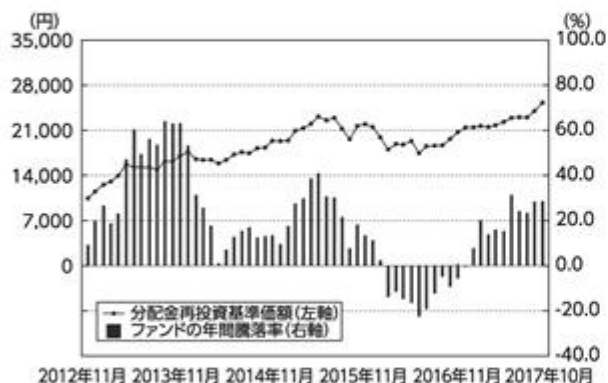
- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



上記体制は平成29年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

＜参考情報＞

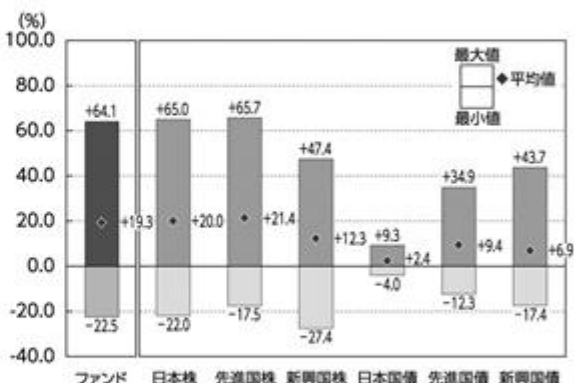
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



*ファンド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。

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



2012年11月～2017年10月

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

*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

- 日 本 株…東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
 - 先進国株…MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)
 - 新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)
 - 日本国債…NOMURA-BPI国債
 - 先進国債…シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
 - 新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド (円ベース)
- (注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

●[東証株価指数 (TOPIX)]は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所 (兼東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株式会社東京証券取引所が有しています。

●[MSCIコクサイ・インデックス]は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

●[MSCIエマージング・マーケット・インデックス]は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

●[NOMURA-BPI国債]は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

●[シティ世界国債インデックス (除く日本)]は、シティグループ・インデックスLLCが開発した債券指数で、日本を除く世界主要国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シティグループ・インデックスLLCに帰属します。

●[JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド]は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.486%（税抜0.45%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.40%	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0.02%	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0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（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】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. 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て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（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かかる手数料・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かかる手数料・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要する費用は、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。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

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。

上記は、平成29年10月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成29年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	5,674,815,523	100.02
内 日本	5,674,815,523	100.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	920,070	0.02
純資産総額	5,673,895,453	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成29年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	301,528,839,650	96.95
内 日本	301,528,839,650	96.95
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	9,493,458,352	3.05
純資産総額	311,022,298,002	100.00

その他資産の投資状況

平成29年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	9,061,820,000	2.91
内 日本	9,061,820,000	2.91

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成29年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	2,130,505,903	2.5641 5,462,885,537	2.6636 5,674,815,523	- -	100.02%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年10月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	100.02%
合計	100.02%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成29年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,453,700	6,359.91 9,245,411,000	6,990.00 10,161,363,000	- -	3.27%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	8,332,800	751.20 6,259,599,360	762.50 6,353,760,000	- -	2.04%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	531,200	8,697.30 4,620,006,800	9,947.00 5,283,846,400	- -	1.70%
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	842,100	4,874.00 4,104,395,400	5,473.00 4,608,813,300	- -	1.48%
5	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	892,700	4,479.00 3,998,403,300	4,517.00 4,032,325,900	- -	1.30%
6	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,076,000	3,541.01 3,810,136,500	3,523.00 3,790,748,000	- -	1.22%
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	58,700	45,657.42 2,680,091,000	62,830.00 3,688,121,000	- -	1.19%
8	ソニー 日本	株式 電気機器	798,200	3,599.00 2,872,721,800	4,413.00 3,522,456,600	- -	1.13%
9	みずほフィナンシャルグル ープ 日本	株式 銀行業	16,024,600	208.49 3,340,976,500	204.90 3,283,440,540	- -	1.06%

10	任天堂 日本	株式 その他製品	73,600	23,603.85 1,737,243,600	43,800.00 3,223,680,000	- -	1.04%
11	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,056,600	2,947.00 3,113,800,200	3,024.00 3,195,158,400	- -	1.03%
12	ファナック 日本	株式 電気機器	113,600	21,565.00 2,449,784,000	26,370.00 2,995,632,000	- -	0.96%
13	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	440,400	5,021.00 2,211,248,400	6,395.00 2,816,358,000	- -	0.91%
14	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	742,500	3,634.65 2,698,734,000	3,747.00 2,782,147,500	- -	0.89%
15	キヤノン 日本	株式 電気機器	643,700	3,270.93 2,105,501,600	4,243.00 2,731,219,100	- -	0.88%
16	日立製作所 日本	株式 電気機器	2,871,000	676.62 1,942,586,800	897.00 2,575,287,000	- -	0.83%
17	信越化学工業 日本	株式 化学	208,600	9,505.00 1,982,743,000	11,910.00 2,484,426,000	- -	0.80%
18	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	881,500	1,796.98 1,584,041,581	2,776.00 2,447,044,000	- -	0.79%
19	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	868,700	2,691.22 2,337,865,400	2,741.00 2,381,106,700	- -	0.77%
20	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	214,800	9,995.00 2,146,926,000	10,970.00 2,356,356,000	- -	0.76%
21	パナソニック 日本	株式 電気機器	1,366,100	1,182.93 1,616,013,376	1,700.50 2,323,053,050	- -	0.75%
22	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,195,800	1,608.50 1,923,444,300	1,931.50 2,309,687,700	- -	0.74%
23	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	422,600	4,081.44 1,724,820,400	5,390.00 2,277,814,000	- -	0.73%
24	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	493,700	4,430.29 2,187,235,200	4,572.00 2,257,196,400	- -	0.73%
25	村田製作所 日本	株式 電気機器	125,500	15,424.98 1,935,835,900	17,690.00 2,220,095,000	- -	0.71%
26	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	107,100	18,230.38 1,952,474,100	20,570.00 2,203,047,000	- -	0.71%
27	三菱商事 日本	株式 卸売業	826,500	2,541.00 2,100,136,500	2,648.50 2,188,985,250	- -	0.70%
28	日本電産 日本	株式 電気機器	143,900	10,405.00 1,497,279,500	14,995.00 2,157,780,500	- -	0.69%
29	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	444,300	4,705.00 2,090,431,500	4,855.00 2,157,076,500	- -	0.69%
30	小松製作所 日本	株式 機械	577,400	2,790.18 1,611,055,200	3,697.00 2,134,647,800	- -	0.69%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年10月31日現在

種類	投資比率
株式	96.95%
合計	96.95%

（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

平成29年10月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	13.41%
輸送用機器		8.55%
情報・通信業		7.42%
銀行業		7.21%
化学		6.93%
機械		5.38%
小売業		4.36%
食料品		4.34%
医薬品		4.34%
卸売業		4.29%
サービス業		4.08%
陸運業		3.86%
建設業		3.25%
不動産業		2.25%
保険業		2.18%
その他製品		2.12%
電気・ガス業		1.59%
精密機器		1.55%
その他金融業		1.20%
鉄鋼		1.12%
ゴム製品		1.00%
非鉄金属		0.99%
ガラス・土石製品		0.97%
証券、商品先物取引業		0.95%
繊維製品		0.70%
金属製品		0.69%
空運業		0.57%
石油・石炭製品		0.57%
鉱業		0.29%
パルプ・紙		0.26%
海運業		0.22%
倉庫・運輸関連業	0.20%	
水産・農林業	0.10%	
合計	96.95%	

（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

平成29年10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 2912月	買建	514	8,816,670,536	9,061,820,000	2.91%

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(平成29年10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1計算期間末 (平成21年10月13日)	408	408	1.1504	1.1504
第2計算期間末 (平成22年10月12日)	974	974	1.0661	1.0661
第3計算期間末 (平成23年10月12日)	1,130	1,130	0.9904	0.9904
第4計算期間末 (平成24年10月12日)	1,188	1,188	0.9615	0.9615
第5計算期間末 (平成25年10月15日)	1,832	1,832	1.6235	1.6235
第6計算期間末 (平成26年10月14日)	2,347	2,347	1.6680	1.6680
第7計算期間末 (平成27年10月13日)	3,717	3,717	2.0908	2.0908
第8計算期間末 (平成28年10月12日)	3,124	3,124	1.8950	1.8950
第9計算期間末 (平成29年10月12日)	5,490	5,490	2.4352	2.4352
平成28年10月末日	3,563	-	1.9660	-
11月末日	4,132	-	2.0733	-
12月末日	4,264	-	2.1440	-
平成29年1月末日	3,667	-	2.1472	-
2月末日	3,784	-	2.1667	-
3月末日	3,902	-	2.1524	-
4月末日	3,988	-	2.1790	-
5月末日	4,162	-	2.2311	-
6月末日	4,359	-	2.2944	-
7月末日	4,451	-	2.3028	-
8月末日	4,539	-	2.3005	-
9月末日	5,313	-	2.3994	-
10月末日	5,673	-	2.5289	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	15.0
第2計算期間	7.3
第3計算期間	7.1
第4計算期間	2.9
第5計算期間	68.9
第6計算期間	2.7
第7計算期間	25.3
第8計算期間	9.4
第9計算期間	28.5

(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。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。

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1計算期間	360,818,552	5,842,198
第2計算期間	1,096,784,678	537,244,271
第3計算期間	530,173,605	303,610,533
第4計算期間	330,350,174	235,209,696
第5計算期間	548,351,616	655,828,394
第6計算期間	796,957,698	518,389,663
第7計算期間	1,112,887,322	742,283,812
第8計算期間	1,141,968,717	1,270,849,953
第9計算期間	1,114,201,443	508,681,373

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2017年10月31日

基準価額・純資産の推移

(2009年1月30日～2017年10月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日：2009年1月30日)

※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移(税引前)

第5期(2013.10.15)	0円
第6期(2014.10.14)	0円
第7期(2015.10.13)	0円
第8期(2016.10.12)	0円
第9期(2017.10.12)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	100.02%

■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	96.95
内 日本	96.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.05
合計(純資産総額)	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.91

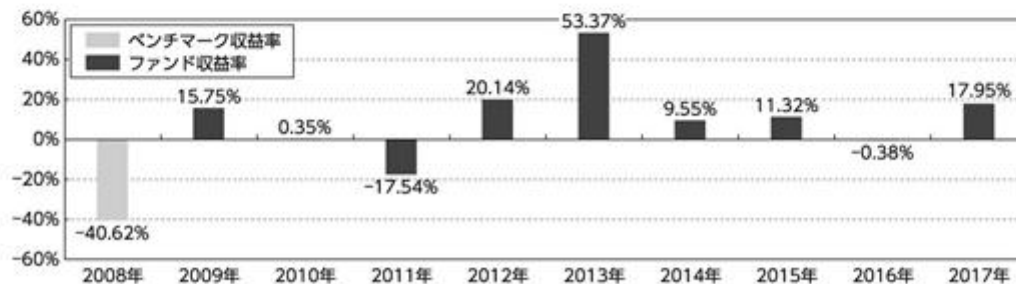
株式組入上位5業種

順位	業種	比率
1	電気機器	13.41%
2	輸送用機器	8.55%
3	情報・通信業	7.42%
4	銀行業	7.21%
5	化学	6.93%

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	3.27%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.04%
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.70%
4	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.48%
5	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.30%
6	本田技研工業	株式	日本	輸送用機器	1.22%
7	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.19%
8	ソニー	株式	日本	電気機器	1.13%
9	みずほフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.06%
10	任天堂	株式	日本	その他製品	1.04%

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。

※2009年は設定日から年末までの収益率、および2017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。

※2008年は、ベンチマークの収益率を表示しています。当ファンドのベンチマークは「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」です。

○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。

○ベンチマークの情報はあくまでも参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

○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、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合には、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再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。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入（積立）をすることができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。

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2時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日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、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かかる口数の増加の記載または記録が行われます。

なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。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

お申込日の基準価額 とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金の再投資を行う場合は、各計算期間終了日の基準価額となります。

「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。）

< 基準価額の照会方法等 >

基準価額は、当ファンドの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

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。

お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合は1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

・ 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）に払い込まれます。

2【換金（解約）手続等】

- ・ 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し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2時までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

なお、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かかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、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）

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・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4営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

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

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）

(2)【保管】

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、受益証券を発行しませんので、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、平成21年1月30日から原則として無期限です。ただし、下記「(5)その他 イ.償還規定」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10月13日から翌年10月12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ます。

(5)【その他】

イ.償還規定

- a. 委託会社は、受益権総口数が10億口を下回ることとなった場合、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合、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場合には、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出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、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.からd.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。
- 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継ぐことを命じたときは、下

記「ロ．信託約款の変更等b．」の書面決議が否決された場合を除き、その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違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を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．信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ．信託約款の変更等

- 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またはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、この信託約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、上記a.の事項(上記a.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

- g. 上記a.からf.の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁より信託約款の変更の命令を受けたときは、上記a.からg.の規定にしたがい信託約款を変更します。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

八. 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10月12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】

(1)収益分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。

受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、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。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

なお、「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

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

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
- なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(平成28年10月13日から平成29年10月12日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

D I A M国内株式パッシブ・ファンド

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 平成28年10月12日現在	第9期 平成29年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	13,463,761	17,584,130
親投資信託受益証券	3,123,498,488	5,489,396,384
未収入金	1,000,000	-
流動資産合計	3,137,962,249	5,506,980,514
資産合計	3,137,962,249	5,506,980,514
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,745,181	2,065,188
未払受託者報酬	509,858	725,836
未払委託者報酬	9,687,897	13,791,686
その他未払費用	33,898	48,298
流動負債合計	12,976,834	16,631,008
負債合計	12,976,834	16,631,008
純資産の部		
元本等		
元本	1,649,033,842	1,254,553,912
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,475,951,573	3,235,795,594
（分配準備積立金）	358,174,396	1,054,419,256
元本等合計	3,124,985,415	5,490,349,506
純資産合計	3,124,985,415	5,490,349,506
負債純資産合計	3,137,962,249	5,506,980,514

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期		第9期	
	自	平成27年10月14日 平成28年10月12日	自	平成28年10月13日 平成29年10月12日
営業収益				
受取利息		1,449		1
有価証券売買等損益		309,354,909		1,076,557,896
営業収益合計		309,353,460		1,076,557,897
営業費用				
支払利息		7,745		3,851
受託者報酬		1,051,679		1,355,347
委託者報酬		19,983,496		25,753,342
その他費用		116,238		90,182
営業費用合計		21,159,158		27,202,722
営業利益又は営業損失（ ）		330,512,618		1,049,355,175
経常利益又は経常損失（ ）		330,512,618		1,049,355,175
当期純利益又は当期純損失（ ）		330,512,618		1,049,355,175
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（ ）		186,264,626		122,747,686
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,939,291,389		1,475,951,573
剰余金増加額又は欠損金減少額		994,713,748		1,305,677,887
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		994,713,748		1,305,677,887
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,313,805,572		472,441,355
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,313,805,572		472,441,355
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,475,951,573		3,235,795,594

(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8期 平成28年10月12日現在	第9期 平成29年10月12日現在
1. 1 期首元本額	1,777,915,078円	1,649,033,842円
期中追加設定元本額	1,141,968,717円	1,114,201,443円
期中一部解約元本額	1,270,849,953円	508,681,373円
2. 受益権の総数	1,649,033,842口	2,254,553,912口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第8期 自 平成27年10月14日 至 平成28年10月12日	第9期 自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12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(46,381,649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(1,117,777,177円)及び分配準備積立金(311,792,747円)より分配対象収益は1,475,951,573円(1万口当たり8,950.40円)であります。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(90,657,822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(690,527,565円)、信託約款に規定される収益調整金(2,181,376,338円)及び分配準備積立金(273,233,869円)より分配対象収益は3,235,795,594円(1万口当たり14,352.27円)であります。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8期	第9期
	自 平成27年10月14日 至 平成28年10月12日	自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12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8期 平成28年10月12日現在	第9期 平成29年10月12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8期 平成28年10月12日現在	第9期 平成29年10月12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	141,003,731	959,302,547
合計	141,003,731	959,302,547

(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8期 平成28年10月12日現在	第9期 平成29年10月12日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8950円 (18,950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29年10月12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	2,140,866,731	5,489,396,384	
親投資信託受益証券	合計	2,140,866,731	5,489,396,384	
合計		2,140,866,731	5,489,396,384	

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28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		5,889,323,978	6,062,166,668
株式	2	274,144,773,250	297,566,000,230
派生商品評価勘定		90,428,948	214,479,680
未収入金		4,319,728	11,015,998
未収配当金		2,350,262,725	2,352,048,167
流動資産合計		282,479,108,629	306,205,710,743
資産合計		282,479,108,629	306,205,710,743
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		182,916	-
前受金		136,187,200	210,324,000
未払解約金		828,535,000	918,005,000
流動負債合計		964,905,116	1,128,329,000
負債合計		964,905,116	1,128,329,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	141,984,682,751	118,980,682,522
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		139,529,520,762	186,096,699,221
元本等合計		281,514,203,513	305,077,381,743
純資産合計		281,514,203,513	305,077,381,743
負債純資産合計		282,479,108,629	306,205,710,743

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28年10月12日現在	平成29年10月12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	145,322,675,861円	141,984,682,751円
同期中追加設定元本額	41,084,076,109円	20,961,822,659円
同期中一部解約元本額	44,422,069,219円	43,965,822,888円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	6,549,280,589円	7,381,462,783円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,575,376,249円	2,140,866,731円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	5,822,033円	5,252,599円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	12,618,708円	13,038,380円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	25,144,181円	23,681,430円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	13,903,705円	13,228,825円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	11,101,393円	13,420,191円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	12,262,597円	15,993,845円
たわらノーロード TOPIX	- 円	82,133,781円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	- 円	5,443,582円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	39,026,844,057円	35,814,315,681円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	892,175,848円	797,265,541円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	3,085,053,451円	2,772,479,361円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	3,110,638,487円	2,863,257,582円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	406,578,514円	352,045,452円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,299,706,406円	1,179,965,536円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,135,404,057円	1,081,878,743円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	63,391,188円	50,599,626円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,361,434,988円	1,191,234,103円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	29,855,862円	25,856,596円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）	34,618,530円	40,016,978円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）	70,908,730円	92,537,042円

D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国30)	134,667,581円	173,340,139円
投資のソムリエ	1,532,512,647円	3,598,167,045円
クルーズコントロール	1,361,224,064円	1,385,033,156円
投資のソムリエ<DC年金>	42,045,295円	197,160,817円
D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	111,572,421円	146,751,099円
D I A M D C バランス・F (成長型)	107,729,591円	171,592,462円
クルーズコントロール<DC年金 >	435,072円	461,778円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	16,553,351円	7,645,471円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	41,655,765円	23,808,944円
投資のソムリエ<DC年金>リス ク抑制型	13,516,086円	62,307,274円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バランス ファンド	2,259,439円	1,486,477円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2045)	-円	592,766円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	-円	592,766円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	-円	238,256円
D I A Mアクティブアロケーショ ン私募ファンド(適格機関投資家 限定)	249,214,122円	-円
D I A Mワールドバランス25V A(適格機関投資家限定)	108,351,515円	76,811,419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)	256,516,116円	156,029,386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)	448,843,778円	334,296,917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)	32,496,190円	19,939,130円
D I A M国際分散バランスファン ド50VA(適格機関投資家限 定)	138,048,923円	96,956,097円
D I A M国内重視バランスファン ド30VA(適格機関投資家限 定)	35,339,487円	21,537,117円
D I A M国内重視バランスファン ド50VA(適格機関投資家限 定)	44,104,951円	27,179,602円
D I A M世界バランスファンド4 0VA(適格機関投資家限定)	2,613,101,420円	40,415,290円
D I A M世界バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	921,644,988円	67,149,356円

D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,759,630,851円	1,227,769,114円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,488,934,009円	1,159,373,010円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	3,941,172,402円	3,132,500,067円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	332,873,979円	230,378,853円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	731,561,485円	155,354,227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)	937,888,973円	676,430,709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)	3,833,571,575円	2,674,063,219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)	51,147,517円	10,313,671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)	1,360,969,610円	178,653,922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)	5,436,117,474円	2,129,542,429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)	21,190,612,731円	16,798,495,071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)	778,556,088円	603,397,247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)	2,431,224,796円	1,915,844,419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)	13,422,317,174円	10,822,212,577円
D I A Mバランス30VA (適格機関投資家限定)	7,865,270円	3,553,157円
D I A Mバランス50VA (適格機関投資家限定)	3,381,053円	4,968,662円
D I A Mバランス70VA (適格機関投資家限定)	1,215,517円	4,468,394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)	12,044,427,017円	9,646,791,837円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	109,073,229円	77,974,896円
D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	38,767,272円	30,029,445円
D I A Mバランス20VA (適格機関投資家限定)	43,596,204円	30,306,394円
D I A Mバランス40VA (適格機関投資家限定)	81,496円	69,877円

	D I A Mバランス60VA(適格 機関投資家限定)	128,550円	114,762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)	693,705,071円	547,756,483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)	1,859,845,103円	1,500,552,498円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1306)(適 格機関投資家限定)	2,451,073,369円	1,976,540,138円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1309)(適 格機関投資家限定)	100,992,561円	85,350,145円
	計	141,984,682,751円	118,980,682,522円
2.	受益権の総数	141,984,682,751口	118,980,682,522口
3.	2 差入代用有価証券	株式 2,978,500,000円	株式 3,462,500,000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27年10月14日 至 平成28年10月12日	自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12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28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、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28年10月12日現在	平成29年10月12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	6,416,796,421	32,174,357,497
合計	6,416,796,421	32,174,357,497

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年2月9日から平成28年10月12日まで及び平成29年2月8日から平成29年10月12日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	平成28年10月12日 現在				平成29年10月12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	7,070,301,600	-	7,160,720,000	90,418,400	7,099,681,000	-	7,314,300,000	214,619,000
合計	7,070,301,600	-	7,160,720,000	90,418,400	7,099,681,000	-	7,314,300,000	214,619,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1口当たり純資産額	1.9827円	2.5641円
(1万口当たり純資産額)	(19,827円)	(25,641円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成29年10月12日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,500	3,585.00	19,717,500	
日本水産	175,200	649.00	113,704,800	
マルハニチロ	25,600	3,460.00	88,576,000	
ハウスイ	1,200	1,233.00	1,479,600	
カネコ種苗	4,800	1,572.00	7,545,600	
サカタのタネ	19,900	3,560.00	70,844,000	
ホクト	13,700	1,941.00	26,591,700	
ホクリヨウ	1,600	1,145.00	1,832,000	
ショーボンドホールディングス	13,000	6,340.00	82,420,000	
ミライト・ホールディングス	41,400	1,374.00	56,883,600	
タマホーム	10,700	752.00	8,046,400	
サンヨーホームズ	3,200	820.00	2,624,000	
ファーストコーポレーション	3,100	1,124.00	3,484,400	
インベスターズクラウド	2,300	6,770.00	15,571,000	
住石ホールディングス	39,800	162.00	6,447,600	
日鉄鉱業	3,700	7,860.00	29,082,000	
三井松島産業	8,000	1,382.00	11,056,000	
国際石油開発帝石	709,500	1,159.00	822,310,500	
日本海洋掘削	4,800	2,137.00	10,257,600	
石油資源開発	21,300	2,310.00	49,203,000	
K&Oエナジーグループ	7,900	1,862.00	14,709,800	
ダイセキ環境ソリューション	3,900	1,391.00	5,424,900	
安藤・間	97,000	852.00	82,644,000	
東急建設	47,900	932.00	44,642,800	
コムシスホールディングス	52,700	2,719.00	143,291,300	
ミサワホーム	16,000	956.00	15,296,000	
ピーアールホールディングス	13,200	398.00	5,253,600	
高松コンストラクショングループ	10,100	3,120.00	31,512,000	
東建コーポレーション	5,000	13,210.00	66,050,000	
ヤマウラ	6,900	951.00	6,561,900	
大成建設	137,000	6,200.00	849,400,000	
大林組	404,000	1,394.00	563,176,000	
清水建設	412,200	1,279.00	527,203,800	
飛島建設	131,700	163.00	21,467,100	
長谷工コーポレーション	157,200	1,546.00	243,031,200	
松井建設	15,000	989.00	14,835,000	
銭高組	1,900	5,530.00	10,507,000	
鹿島建設	592,000	1,154.00	683,168,000	
不動テトラ	109,200	190.00	20,748,000	
大末建設	5,000	997.00	4,985,000	
鉄建建設	8,200	3,590.00	29,438,000	
西松建設	31,000	3,300.00	102,300,000	
三井住友建設	102,800	715.00	73,502,000	

大豊建設	49,000	543.00	26,607,000
前田建設工業	89,000	1,356.00	120,684,000
佐田建設	9,300	474.00	4,408,200
ナカノフドー建設	10,600	632.00	6,699,200
奥村組	22,000	4,275.00	94,050,000
東鉄工業	16,200	3,545.00	57,429,000
イチケン	2,600	2,704.00	7,030,400
浅沼組	45,000	351.00	15,795,000
戸田建設	157,000	867.00	136,119,000
熊谷組	21,200	3,500.00	74,200,000
青木あすなる建設	8,500	1,027.00	8,729,500
北野建設	27,000	495.00	13,365,000
植木組	1,700	2,703.00	4,595,100
三井ホーム	17,000	718.00	12,206,000
矢作建設工業	18,500	994.00	18,389,000
ピーエス三菱	14,500	675.00	9,787,500
日本ハウスホールディングス	25,700	664.00	17,064,800
大東建託	48,800	21,030.00	1,026,264,000
新日本建設	16,200	902.00	14,612,400
NIPPO	31,000	2,266.00	70,246,000
東亜道路工業	2,500	4,380.00	10,950,000
前田道路	42,000	2,407.00	101,094,000
日本道路	4,000	6,420.00	25,680,000
東亜建設工業	11,000	2,149.00	23,639,000
若築建設	7,900	1,924.00	15,199,600
東洋建設	39,100	511.00	19,980,100
五洋建設	149,700	704.00	105,388,800
世紀東急工業	20,000	660.00	13,200,000
福田組	4,400	6,640.00	29,216,000
日本ドライケミカル	1,700	2,409.00	4,095,300
住友林業	92,500	1,833.00	169,552,500
日本基礎技術	15,600	393.00	6,130,800
日成ビルド工業	20,000	1,239.00	24,780,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	74,000	89.00	6,586,000
巴コーポレーション	16,800	426.00	7,156,800
大和ハウス工業	397,800	4,065.00	1,617,057,000
ライト工業	25,900	1,112.00	28,800,800
積水ハウス	412,100	1,959.50	807,509,950
日特建設	11,800	599.00	7,068,200
北陸電気工事	6,600	1,039.00	6,857,400
ユアテック	21,000	860.00	18,060,000
西部電気工業	2,200	2,483.00	5,462,600
四電工	1,200	3,060.00	3,672,000
中電工	15,000	3,210.00	48,150,000
関電工	54,000	1,135.00	61,290,000
きんでん	89,400	1,812.00	161,992,800
東京エネシス	13,900	1,195.00	16,610,500
トーエネック	3,800	3,375.00	12,825,000
住友電設	9,300	2,134.00	19,846,200
日本電設工業	20,600	2,367.00	48,760,200

協和エクシオ	52,700	2,378.00	125,320,600
新日本空調	10,400	1,622.00	16,868,800
日本工営	8,500	4,175.00	35,487,500
N D S	2,000	3,610.00	7,220,000
九電工	26,500	4,375.00	115,937,500
三機工業	28,600	1,260.00	36,036,000
日揮	125,700	1,861.00	233,927,700
中外炉工業	4,200	2,215.00	9,303,000
ヤマト	12,300	702.00	8,634,600
太平電業	9,100	2,762.00	25,134,200
高砂熱学工業	37,100	1,883.00	69,859,300
三晃金属工業	1,200	3,715.00	4,458,000
N E C ネットエスアイ	12,900	2,599.00	33,527,100
朝日工業社	3,100	3,525.00	10,927,500
明星工業	24,500	739.00	18,105,500
大気社	17,900	3,155.00	56,474,500
ダイダン	9,100	2,701.00	24,579,100
日比谷総合設備	15,000	2,363.00	35,445,000
東芝プラントシステム	21,800	1,910.00	41,638,000
日本製粉	40,000	1,749.00	69,960,000
日清製粉グループ本社	147,700	1,965.00	290,230,500
日東富士製粉	800	4,045.00	3,236,000
昭和産業	11,000	2,916.00	32,076,000
鳥越製粉	11,000	890.00	9,790,000
中部飼料	14,800	2,099.00	31,065,200
フィード・ワン	82,400	299.00	24,637,600
東洋精糖	2,300	1,204.00	2,769,200
日本甜菜製糖	6,900	2,354.00	16,242,600
三井製糖	9,500	3,980.00	37,810,000
塩水港精糖	16,300	262.00	4,270,600
日新製糖	5,600	2,007.00	11,239,200
L I F U L L	31,400	975.00	30,615,000
ジェイエイシーリクルートメント	8,000	1,867.00	14,936,000
日本M & Aセンター	36,800	5,580.00	205,344,000
メンバーズ	3,300	669.00	2,207,700
中広	1,400	734.00	1,027,600
タケエイ	11,300	1,199.00	13,548,700
トラスト・テック	5,200	3,325.00	17,290,000
コシダカホールディングス	6,000	3,920.00	23,520,000
パソナグループ	9,600	1,464.00	14,054,400
C D S	3,200	1,319.00	4,220,800
リンクアンドモチベーション	21,500	712.00	15,308,000
G C A	11,600	996.00	11,553,600
エス・エム・エス	17,900	3,630.00	64,977,000
パーソルホールディングス	97,400	2,683.00	261,324,200
リニカル	7,600	1,506.00	11,445,600
クックパッド	36,500	763.00	27,849,500
エスクリ	4,700	872.00	4,098,400
アイ・ケイ・ケイ	6,000	897.00	5,382,000
森永製菓	26,400	6,380.00	168,432,000

中村屋	3,200	5,120.00	16,384,000
江崎グリコ	33,800	6,270.00	211,926,000
名糖産業	6,200	1,485.00	9,207,000
不二家	7,800	2,549.00	19,882,200
山崎製パン	98,700	2,108.00	208,059,600
第一屋製パン	2,300	1,214.00	2,792,200
モロゾフ	2,100	7,210.00	15,141,000
亀田製菓	7,500	5,140.00	38,550,000
寿スピリッツ	12,800	4,380.00	56,064,000
カルビー	55,100	4,080.00	224,808,000
森永乳業	24,200	4,555.00	110,231,000
六甲バター	6,100	2,449.00	14,938,900
ヤクルト本社	72,300	8,630.00	623,949,000
明治ホールディングス	79,800	9,060.00	722,988,000
雪印メグミルク	29,100	3,225.00	93,847,500
プリマハム	85,000	801.00	68,085,000
日本ハム	96,000	3,315.00	318,240,000
林兼産業	4,600	984.00	4,526,400
丸大食品	65,000	552.00	35,880,000
S Foods	7,300	4,615.00	33,689,500
伊藤ハム米久ホールディングス	77,800	1,041.00	80,989,800
学情	5,500	1,372.00	7,546,000
スタジオアリス	5,300	2,664.00	14,119,200
シミックホールディングス	6,500	1,564.00	10,166,000
システナ	9,600	2,877.00	27,619,200
N J S	3,000	1,399.00	4,197,000
デジタルアーツ	5,300	4,725.00	25,042,500
新日鉄住金ソリューションズ	18,600	2,425.00	45,105,000
総合警備保障	45,800	5,170.00	236,786,000
キューブシステム	5,600	845.00	4,732,000
いちご	113,400	405.00	45,927,000
日本駐車場開発	144,900	167.00	24,198,300
コア	5,100	1,806.00	9,210,600
カカクコム	88,600	1,596.00	141,405,600
アイロムグループ	3,900	1,741.00	6,789,900
ルネサンス	6,800	1,644.00	11,179,200
ディップ	16,400	2,666.00	43,722,400
S B Sホールディングス	12,000	910.00	10,920,000
オプトホールディング	8,400	1,184.00	9,945,600
新日本科学	13,900	537.00	7,464,300
ツクイ	30,400	778.00	23,651,200
キャリアデザインセンター	2,800	1,620.00	4,536,000
エムスリー	109,000	3,305.00	360,245,000
ツカダ・グローバルホールディング	9,600	576.00	5,529,600
アウトソーシング	34,500	1,537.00	53,026,500
ウェルネット	9,700	1,197.00	11,610,900
ワールドホールディングス	3,000	3,325.00	9,975,000
ディー・エヌ・エー	56,400	2,537.00	143,086,800
博報堂D Yホールディングス	174,300	1,566.00	272,953,800
ぐるなび	18,300	1,722.00	31,512,600

エスアールジータカミヤ	14,100	660.00	9,306,000
ジャパンベストレスキューシステム	15,500	477.00	7,393,500
ファンコミュニケーションズ	32,300	1,240.00	40,052,000
ライク	4,700	2,151.00	10,109,700
WDBホールディングス	4,700	2,702.00	12,699,400
ティア	6,500	873.00	5,674,500
バリューコマース	11,100	904.00	10,034,400
インフォマート	54,500	816.00	44,472,000
サッポロホールディングス	44,300	3,425.00	151,727,500
アサヒグループホールディングス	252,800	4,913.00	1,242,006,400
キリンホールディングス	580,200	2,729.50	1,583,655,900
宝ホールディングス	97,700	1,050.00	102,585,000
オエノンホールディングス	36,500	331.00	12,081,500
養命酒製造	4,200	2,188.00	9,189,600
コカ・コーラボトラーズジャパン	84,800	3,855.00	326,904,000
サントリー食品インターナショナル	92,400	5,100.00	471,240,000
ダイドーグループホールディングス	6,200	5,410.00	33,542,000
伊藤園	40,100	3,875.00	155,387,500
キーコーヒー	12,000	2,222.00	26,664,000
ユニカフェ	4,000	1,049.00	4,196,000
ジャパンフーズ	2,100	1,407.00	2,954,700
日清オイリオグループ	15,600	3,845.00	59,982,000
不二製油グループ本社	36,100	3,035.00	109,563,500
J・オイルミルズ	6,300	4,145.00	26,113,500
ローソン	37,400	7,390.00	276,386,000
サンエー	9,000	5,140.00	46,260,000
カワチ薬品	9,200	2,703.00	24,867,600
エービーシー・マート	21,600	5,830.00	125,928,000
ハードオフコーポレーション	5,500	1,130.00	6,215,000
高千穂交易	4,800	1,185.00	5,688,000
アスクル	12,400	3,090.00	38,316,000
ゲオホールディングス	20,000	1,635.00	32,700,000
アダストリア	18,300	2,534.00	46,372,200
ジーフット	7,000	744.00	5,208,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,900	714.00	1,356,600
伊藤忠食品	2,900	5,040.00	14,616,000
くらコーポレーション	7,000	5,280.00	36,960,000
キャンドウ	5,800	1,857.00	10,770,600
エレマテック	4,700	2,210.00	10,387,000
パルグループホールディングス	6,100	3,225.00	19,672,500
JALUX	3,900	2,607.00	10,167,300
エディオン	45,900	1,070.00	49,113,000
あらた	5,500	4,995.00	27,472,500
サーラコーポレーション	20,500	848.00	17,384,000
ワッツ	5,000	1,250.00	6,250,000
トーマンデバイス	1,900	2,953.00	5,610,700
ハローズ	3,900	2,531.00	9,870,900
J Pホールディングス	37,000	415.00	15,355,000
あみやき亭	2,400	5,020.00	12,048,000
東京エレクトロン デバイス	4,200	2,142.00	8,996,400

ひらまつ	17,100	616.00	10,533,600
フィールズ	9,000	1,116.00	10,044,000
双日	698,900	312.00	218,056,800
ゲンキー	4,800	4,320.00	20,736,000
アルフレッサ ホールディングス	140,200	2,108.00	295,541,600
大黒天物産	2,800	5,420.00	15,176,000
ハニーズホールディングス	10,900	1,193.00	13,003,700
ファーマライズホールディングス	3,100	629.00	1,949,900
キッコーマン	94,400	3,610.00	340,784,000
味の素	277,700	2,267.50	629,684,750
キュービー	68,600	2,804.00	192,354,400
ハウス食品グループ本社	50,000	3,455.00	172,750,000
カゴメ	48,500	3,695.00	179,207,500
焼津水産化学工業	6,800	1,189.00	8,085,200
アリアケジャパン	11,100	8,270.00	91,797,000
ピエトロ	1,700	1,631.00	2,772,700
エバラ食品工業	3,300	2,104.00	6,943,200
ニチレイ	62,700	2,913.00	182,645,100
横浜冷凍	28,200	1,064.00	30,004,800
東洋水産	66,300	4,290.00	284,427,000
イトアアンド	1,700	2,477.00	4,210,900
日清食品ホールディングス	52,700	7,090.00	373,643,000
永谷園ホールディングス	7,000	1,316.00	9,212,000
一正蒲鉾	5,000	1,322.00	6,610,000
フジッコ	13,100	2,651.00	34,728,100
ロック・フィールド	13,200	1,991.00	26,281,200
日本たばこ産業	746,600	3,693.00	2,757,193,800
ケンコーマヨネーズ	7,400	2,873.00	21,260,200
わらべや日洋ホールディングス	8,000	2,840.00	22,720,000
なとり	6,900	2,056.00	14,186,400
北の達人コーポレーション	6,000	1,343.00	8,058,000
ユーグレナ	46,800	1,174.00	54,943,200
片倉工業	14,500	1,395.00	20,227,500
グンゼ	9,400	5,090.00	47,846,000
ヒューリック	247,800	1,151.00	285,217,800
神栄	1,800	1,710.00	3,078,000
山下医科器械	1,100	1,706.00	1,876,600
ラサ商事	5,600	1,049.00	5,874,400
アルペン	9,000	2,273.00	20,457,000
ラクーン	5,600	621.00	3,477,600
クオール	13,500	1,935.00	26,122,500
アルコニックス	13,700	1,858.00	25,454,600
神戸物産	7,700	5,090.00	39,193,000
ジンズ	8,100	6,690.00	54,189,000
ビックカメラ	68,200	1,287.00	87,773,400
DCMホールディングス	71,900	1,014.00	72,906,600
ペッパーフードサービス	6,300	5,380.00	33,894,000
MonotaRO	42,200	3,115.00	131,453,000
東京一番フーズ	2,400	599.00	1,437,600
DDホールディングス	2,800	2,826.00	7,912,800

あい ホールディングス	17,000	2,773.00	47,141,000
ディーブイエックス	4,500	1,404.00	6,318,000
きちり	3,600	713.00	2,566,800
アークランドサービスホールディングス	10,000	2,340.00	23,400,000
J.フロント リテイリング	150,200	1,635.00	245,577,000
ドトール・日レスホールディングス	20,700	2,449.00	50,694,300
マツモトキヨシホールディングス	22,500	7,820.00	175,950,000
ブロンコビリー	6,300	2,735.00	17,230,500
スタートトゥデイ	104,800	3,375.00	353,700,000
トレジャー・ファクトリー	3,700	868.00	3,211,600
物語コーポレーション	3,300	7,250.00	23,925,000
ココカラファイン	12,400	6,370.00	78,988,000
三越伊勢丹ホールディングス	236,200	1,256.00	296,667,200
東洋紡	49,900	2,135.00	106,536,500
ユニチカ	34,800	995.00	34,626,000
富士紡ホールディングス	6,200	3,860.00	23,932,000
日清紡ホールディングス	76,500	1,331.00	101,821,500
倉敷紡績	126,000	324.00	40,824,000
ダイワボウホールディングス	10,100	4,705.00	47,520,500
シキボウ	7,100	1,596.00	11,331,600
日東紡績	20,300	3,465.00	70,339,500
トヨタ紡織	42,000	2,407.00	101,094,000
マクニカ・富士エレホールディングス	21,900	2,167.00	47,457,300
H a m e e	1,900	1,617.00	3,072,300
ウエルシアホールディングス	31,400	4,260.00	133,764,000
クリエイトSDホールディングス	17,500	2,782.00	48,685,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,100	931.00	20,575,100
八洲電機	9,500	932.00	8,854,000
メディアスホールディングス	1,900	2,731.00	5,188,900
U K Cホールディングス	7,700	1,957.00	15,068,900
丸善C H Iホールディングス	14,100	350.00	4,935,000
O C H Iホールディングス	3,300	1,407.00	4,643,100
T O K A Iホールディングス	52,200	875.00	45,675,000
ミサワ	1,800	466.00	838,800
ティーライフ	1,700	1,395.00	2,371,500
エー・ピーカンパニー	2,300	737.00	1,695,100
三洋貿易	6,600	2,665.00	17,589,000
チムニー	3,400	2,856.00	9,710,400
シュッピン	4,600	2,775.00	12,765,000
ビューティガレージ	1,100	1,806.00	1,986,600
ウイン・パートナーズ	8,600	1,473.00	12,667,800
ネクステージ	4,000	2,777.00	11,108,000
ジョイフル本田	19,300	2,979.00	57,494,700
鳥貴族	4,400	3,060.00	13,464,000
キリン堂ホールディングス	3,900	1,490.00	5,811,000
ホットランド	4,900	1,501.00	7,354,900
すかいらーく	73,300	1,685.00	123,510,500
綿半ホールディングス	4,900	2,477.00	12,137,300

日本毛織	35,000	1,012.00	35,420,000
ダイトウボウ	20,000	113.00	2,260,000
トーア紡コーポレーション	5,500	602.00	3,311,000
ダイドーリミテッド	14,400	439.00	6,321,600
ヨシックス	1,500	2,303.00	3,454,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	39,100	1,071.00	41,876,100
三栄建築設計	4,800	2,196.00	10,540,800
スター・マイカ	4,600	1,632.00	7,507,200
野村不動産ホールディングス	79,100	2,410.00	190,631,000
三重交通グループホールディングス	21,000	468.00	9,828,000
サムティ	10,000	1,552.00	15,520,000
ディア・ライフ	8,800	449.00	3,951,200
エー・ディー・ワークス	220,700	40.00	8,828,000
日本商業開発	6,900	1,691.00	11,667,900
プレサンスコーポレーション	18,600	1,512.00	28,123,200
ユニゾホールディングス	10,000	2,742.00	27,420,000
THEグローバル社	4,900	799.00	3,915,100
日本管理センター	8,000	1,546.00	12,368,000
サンセイラディック	2,700	934.00	2,521,800
エストラスト	2,400	799.00	1,917,600
フージャースホールディングス	15,700	1,106.00	17,364,200
オープンハウス	19,400	4,105.00	79,637,000
東急不動産ホールディングス	287,100	691.00	198,386,100
飯田グループホールディングス	99,000	2,047.00	202,653,000
ムゲンエステート	4,000	1,146.00	4,584,000
帝国繊維	13,200	2,270.00	29,964,000
ブックオフコーポレーション	7,100	817.00	5,800,700
日本コークス工業	104,500	130.00	13,585,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,900	993.00	3,872,700
ミタチ産業	3,100	1,431.00	4,436,100
B E E N O S	1,500	1,215.00	1,822,500
あさひ	9,000	1,367.00	12,303,000
日本調剤	4,200	3,600.00	15,120,000
コスモス薬品	6,000	25,090.00	150,540,000
シップヘルスケアホールディングス	22,800	3,540.00	80,712,000
トーエル	6,000	938.00	5,628,000
一六堂	3,300	414.00	1,366,200
ソフトクリエイトホールディングス	5,900	1,505.00	8,879,500
セブン&アイ・ホールディングス	496,600	4,427.00	2,198,448,200
薬王堂	6,000	3,340.00	20,040,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	32,100	1,176.00	37,749,600
明治電機工業	4,300	1,828.00	7,860,400
ツルハホールディングス	23,800	13,760.00	327,488,000
デリカフーズホールディングス	2,900	1,526.00	4,425,400
スターティア	2,600	628.00	1,632,800
サンマルクホールディングス	7,700	3,245.00	24,986,500
フェリシモ	3,600	1,346.00	4,845,600
トリドールホールディングス	14,600	3,655.00	53,363,000

帝人	102,800	2,249.00	231,197,200
東レ	913,400	1,080.00	986,472,000
クラレ	211,900	2,148.00	455,161,200
旭化成	785,000	1,368.50	1,074,272,500
サカイオーベックス	3,100	2,309.00	7,157,900
TOKYO BASE	1,500	5,280.00	7,920,000
稲葉製作所	6,800	1,427.00	9,703,600
宮地エンジニアリンググループ	3,700	3,030.00	11,211,000
トーカロ	8,300	4,255.00	35,316,500
アルファ	4,300	2,329.00	10,014,700
SUMCO	109,600	1,754.00	192,238,400
川田テクノロジーズ	2,400	6,270.00	15,048,000
RS Technologies	1,200	3,980.00	4,776,000
ファーストブラザーズ	2,600	1,113.00	2,893,800
ハウスドゥ	2,000	1,819.00	3,638,000
シーアールイー	1,800	1,561.00	2,809,800
ケイアイスター不動産	3,300	1,983.00	6,543,900
住江織物	33,000	362.00	11,946,000
日本フェルト	7,800	503.00	3,923,400
イチカワ	9,000	344.00	3,096,000
エコナックホールディングス	22,000	138.00	3,036,000
日東製網	1,500	1,890.00	2,835,000
芦森工業	2,800	3,300.00	9,240,000
アツギ	10,600	1,257.00	13,324,200
コメダホールディングス	21,900	1,839.00	40,274,100
サツドラホールディングス	1,700	2,047.00	3,479,900
ダイユー・リックホールディングス	4,200	949.00	3,985,800
パロックジャパンリミテッド	9,500	983.00	9,338,500
クスリのアオキホールディングス	9,400	6,370.00	59,878,000
ダイニック	5,200	1,163.00	6,047,600
共和レザー	7,300	961.00	7,015,300
スシローグローバルホールディングス	10,800	3,600.00	38,880,000
LIXILピバ	11,300	1,832.00	20,701,600
セーレン	31,400	1,981.00	62,203,400
ソトー	4,500	1,149.00	5,170,500
東海染工	1,800	1,562.00	2,811,600
小松精練	17,900	890.00	15,931,000
ワコールホールディングス	37,300	3,280.00	122,344,000
ホギメディカル	7,900	8,000.00	63,200,000
レナウン	35,700	209.00	7,461,300
クラウディアホールディングス	3,400	574.00	1,951,600
T S Iホールディングス	51,800	956.00	49,520,800
T I S	39,400	3,235.00	127,459,000
ネオス	3,900	469.00	1,829,100
電算システム	4,300	2,176.00	9,356,800
グリー	72,800	807.00	58,749,600
コーエーテクモホールディングス	28,100	2,333.00	65,557,300
三菱総合研究所	4,800	3,275.00	15,720,000
ボルテージ	2,500	1,126.00	2,815,000
電算	1,500	2,346.00	3,519,000

A G S	2,600	1,880.00	4,888,000
ファインデックス	9,100	815.00	7,416,500
ヒト・コミュニケーションズ	2,800	1,820.00	5,096,000
ブレインパッド	1,900	1,206.00	2,291,400
K L a b	22,800	1,727.00	39,375,600
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,800	1,550.00	13,640,000
イーブックイニシアティブジャパン	2,100	1,091.00	2,291,100
ネクソン	131,300	3,025.00	397,182,500
アイスタイル	26,100	722.00	18,844,200
エムアップ	3,500	1,346.00	4,711,000
エイチーム	8,200	2,871.00	23,542,200
テクノスジャパン	9,400	1,061.00	9,973,400
e n i s h	3,600	2,566.00	9,237,600
コロブラ	38,200	1,197.00	45,725,400
モバイルクリエイト	8,600	371.00	3,190,600
オルトプラス	5,000	854.00	4,270,000
ブロードリーフ	29,500	928.00	27,376,000
ハーツユナイテッドグループ	6,500	1,525.00	9,912,500
メディアドゥホールディングス	2,700	2,710.00	7,317,000
ブイキューブ	6,900	649.00	4,478,100
サイバーリンクス	2,000	1,550.00	3,100,000
ディー・エル・イー	3,800	440.00	1,672,000
フィックスターズ	1,800	4,125.00	7,425,000
VOYAGE GROUP	6,100	1,521.00	9,278,100
オプティム	2,200	2,701.00	5,942,200
セレス	2,200	1,312.00	2,886,400
特種東海製紙	7,300	4,455.00	32,521,500
ベリサーブ	1,500	3,405.00	5,107,500
ティーガイア	11,800	2,148.00	25,346,400
日本アジアグループ	14,100	443.00	6,246,300
豆蔵ホールディングス	9,200	1,233.00	11,343,600
テクマトリックス	7,600	1,599.00	12,152,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	320,300	302.00	96,730,600
GMOペイメントゲートウェイ	8,400	7,560.00	63,504,000
ザッパラス	7,500	412.00	3,090,000
インターネットイニシアティブ	17,600	2,176.00	38,297,600
さくらインターネット	8,800	876.00	7,708,800
GMOクラウド	2,700	3,025.00	8,167,500
S R Aホールディングス	6,300	3,025.00	19,057,500
M I N O R Iソリューションズ	2,700	1,328.00	3,585,600
システムインテグレータ	2,000	815.00	1,630,000
朝日ネット	11,700	541.00	6,329,700
アドソル日進	2,500	1,141.00	2,852,500
フリービット	6,900	965.00	6,658,500
コムチュア	6,300	1,997.00	12,581,100
サイバーコム	1,600	1,017.00	1,627,200
王子ホールディングス	492,000	602.00	296,184,000
日本製紙	56,300	2,138.00	120,369,400

三菱製紙	18,600	754.00	14,024,400
北越紀州製紙	70,500	721.00	50,830,500
中越パルプ工業	5,000	2,147.00	10,735,000
巴川製紙所	21,000	308.00	6,468,000
大王製紙	50,400	1,375.00	69,300,000
メディカル・データ・ビジョン	4,200	2,200.00	9,240,000
gumi	12,800	1,132.00	14,489,600
モバイルファクトリー	2,200	1,455.00	3,201,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,800	2,025.00	3,645,000
PCIホールディングス	1,500	3,280.00	4,920,000
パイブドHD	1,800	1,135.00	2,043,000
オープンドア	1,200	4,380.00	5,256,000
LINE	33,000	4,110.00	135,630,000
レンゴー	121,500	673.00	81,769,500
トーモク	7,800	1,953.00	15,233,400
ザ・バック	9,000	3,915.00	35,235,000
オークネット	3,800	1,433.00	5,445,400
AOI TYO HOLDINGS	10,000	1,191.00	11,910,000
マクロミル	15,400	2,970.00	45,738,000
昭和電工	83,900	3,590.00	301,201,000
住友化学	927,000	698.00	647,046,000
住友精化	5,200	5,670.00	29,484,000
日産化学工業	68,100	4,025.00	274,102,500
ラサ工業	5,000	2,066.00	10,330,000
クレハ	9,500	6,170.00	58,615,000
多木化学	1,600	4,965.00	7,944,000
テイカ	9,700	2,432.00	23,590,400
石原産業	22,700	1,617.00	36,705,900
片倉コープアグリ	3,400	1,317.00	4,477,800
日東エフシー	7,300	859.00	6,270,700
日本曹達	75,000	688.00	51,600,000
東ソー	182,100	2,437.00	443,777,700
トクヤマ	39,200	2,607.00	102,194,400
セントラル硝子	25,600	2,450.00	62,720,000
東亜合成	73,600	1,481.00	109,001,600
大阪ソーダ	10,900	2,888.00	31,479,200
関東電化工業	25,900	1,165.00	30,173,500
デンカ	49,600	3,755.00	186,248,000
イビデン	84,100	1,832.00	154,071,200
信越化学工業	225,800	10,055.00	2,270,419,000
日本カーバイド工業	4,400	2,320.00	10,208,000
堺化学工業	9,400	2,757.00	25,915,800
エア・ウォーター	103,700	2,070.00	214,659,000
大陽日酸	96,900	1,335.00	129,361,500
日本化学工業	4,800	2,642.00	12,681,600
東邦アセチレン	1,900	1,667.00	3,167,300
日本パーカライジング	64,200	1,738.00	111,579,600
高圧ガス工業	18,500	836.00	15,466,000
チタン工業	1,600	3,245.00	5,192,000

四国化成工業	18,000	1,705.00	30,690,000
戸田工業	2,600	4,675.00	12,155,000
ステラ ケミファ	6,200	4,445.00	27,559,000
保土谷化学工業	4,400	7,490.00	32,956,000
日本触媒	19,800	8,240.00	163,152,000
大日精化工業	10,400	5,060.00	52,624,000
カネカ	170,000	861.00	146,370,000
協和発酵キリン	150,700	1,966.00	296,276,200
三菱瓦斯化学	117,300	2,579.00	302,516,700
三井化学	114,400	3,325.00	380,380,000
J S R	126,500	2,052.00	259,578,000
東京応化工業	23,600	4,030.00	95,108,000
大阪有機化学工業	8,300	1,296.00	10,756,800
三菱ケミカルホールディングス	848,200	1,113.00	944,046,600
K Hネオケム	19,300	2,654.00	51,222,200
ダイセル	169,800	1,345.00	228,381,000
住友ベークライト	111,000	873.00	96,903,000
積水化学工業	280,100	2,228.00	624,062,800
日本ゼオン	106,000	1,416.00	150,096,000
アイカ工業	40,300	3,705.00	149,311,500
宇部興産	63,400	3,240.00	205,416,000
積水樹脂	19,200	2,151.00	41,299,200
タキロンシーアイ	26,000	698.00	18,148,000
旭有機材	8,100	1,438.00	11,647,800
日立化成	69,900	2,975.00	207,952,500
ニチバン	6,300	2,445.00	15,403,500
リケンテクノス	27,400	687.00	18,823,800
大倉工業	30,000	785.00	23,550,000
積水化成成品工業	17,500	1,389.00	24,307,500
群栄化学工業	3,000	3,840.00	11,520,000
タイガースポリマー	6,300	790.00	4,977,000
ミライアル	4,800	1,620.00	7,776,000
ダイキアクシス	4,400	1,254.00	5,517,600
ダイキョーニシカワ	22,100	1,829.00	40,420,900
竹本容器	1,400	1,890.00	2,646,000
日本化薬	82,000	1,709.00	140,138,000
カーリットホールディングス	12,000	753.00	9,036,000
E P Sホールディングス	16,300	2,105.00	34,311,500
ソルクシーズ	4,700	845.00	3,971,500
レグス	3,000	849.00	2,547,000
プレステージ・インターナショナル	24,200	1,129.00	27,321,800
フェイス	5,700	1,278.00	7,284,600
アミューズ	7,000	2,805.00	19,635,000
野村総合研究所	88,700	4,310.00	382,297,000
ドリームインキュベータ	4,000	2,248.00	8,992,000
サイバネットシステム	9,900	761.00	7,533,900
クイック	6,700	1,868.00	12,515,600
T A C	7,700	278.00	2,140,600
C Eホールディングス	3,600	605.00	2,178,000
ケネディクス	159,400	670.00	106,798,000

日本システム技術	1,400	1,415.00	1,981,000
電通	140,100	5,080.00	711,708,000
インテージホールディングス	13,800	1,363.00	18,809,400
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,100	840.00	5,124,000
東邦システムサイエンス	4,300	842.00	3,620,600
びあ	3,900	5,220.00	20,358,000
イオンファンタジー	3,700	4,115.00	15,225,500
ソースネクスト	6,800	573.00	3,896,400
シーティーエス	13,800	755.00	10,419,000
ネクシィーズグループ	4,600	2,119.00	9,747,400
メディカルシステムネットワーク	14,000	514.00	7,196,000
日本精化	10,600	948.00	10,048,800
扶桑化学工業	9,000	3,505.00	31,545,000
A D E K A	54,000	1,962.00	105,948,000
日油	48,600	3,240.00	157,464,000
ミヨシ油脂	4,800	1,463.00	7,022,400
新日本理化	21,200	277.00	5,872,400
ハリマ化成グループ	11,000	995.00	10,945,000
花王	295,700	6,668.00	1,971,727,600
第一工業製薬	28,000	676.00	18,928,000
日華化学	4,100	1,147.00	4,702,700
三洋化成工業	7,900	6,540.00	51,666,000
武田薬品工業	472,300	6,145.00	2,902,283,500
アステラス製薬	1,235,700	1,475.50	1,823,275,350
大日本住友製薬	89,200	1,538.00	137,189,600
塩野義製薬	159,700	6,066.00	968,740,200
田辺三菱製薬	146,600	2,563.00	375,735,800
わかもと製薬	7,000	284.00	1,988,000
あすか製薬	13,700	1,870.00	25,619,000
日本新薬	28,900	7,920.00	228,888,000
ピオフェルミン製薬	2,000	2,983.00	5,966,000
中外製薬	125,400	5,030.00	630,762,000
科研製薬	23,500	5,700.00	133,950,000
エーザイ	155,000	5,943.00	921,165,000
理研ビタミン	4,000	4,320.00	17,280,000
ロート製薬	61,800	2,623.00	162,101,400
小野薬品工業	286,100	2,608.50	746,291,850
久光製薬	35,500	5,640.00	200,220,000
有機合成薬品工業	9,400	301.00	2,829,400
持田製薬	8,400	8,390.00	70,476,000
参天製薬	227,600	1,758.00	400,120,800
扶桑薬品工業	4,300	2,826.00	12,151,800
日本ケミファ	1,800	5,110.00	9,198,000
ツムラ	42,300	4,240.00	179,352,000
日医工	29,500	1,756.00	51,802,000
テルモ	184,300	4,620.00	851,466,000
みらかホールディングス	32,100	5,110.00	164,031,000
キッセイ薬品工業	22,300	2,973.00	66,297,900
生化学工業	23,300	2,025.00	47,182,500
栄研化学	10,600	4,405.00	46,693,000

日水製薬	5,200	1,431.00	7,441,200
鳥居薬品	7,600	3,190.00	24,244,000
JCRファーマ	9,800	3,565.00	34,937,000
東和薬品	5,800	5,750.00	33,350,000
富士製薬工業	4,200	3,770.00	15,834,000
沢井製薬	21,400	6,540.00	139,956,000
ゼリア新薬工業	25,800	2,017.00	52,038,600
第一三共	370,600	2,471.00	915,752,600
キョーリン製薬ホールディングス	30,700	2,301.00	70,640,700
大幸薬品	6,500	2,328.00	15,132,000
ダイト	7,400	2,732.00	20,216,800
大塚ホールディングス	249,900	4,533.00	1,132,796,700
大正製薬ホールディングス	26,900	8,730.00	234,837,000
ペプチドリーム	49,200	3,545.00	174,414,000
大日本塗料	14,500	1,679.00	24,345,500
日本ペイントホールディングス	97,200	3,695.00	359,154,000
関西ペイント	132,400	2,669.00	353,375,600
神東塗料	10,000	223.00	2,230,000
中国塗料	36,100	964.00	34,800,400
日本特殊塗料	8,900	1,943.00	17,292,700
藤倉化成	17,200	674.00	11,592,800
太陽ホールディングス	10,300	5,210.00	53,663,000
DIC	49,700	4,090.00	203,273,000
サカタインクス	25,800	2,079.00	53,638,200
東洋インキSCホールディングス	123,000	631.00	77,613,000
T&K TOKA	9,000	1,286.00	11,574,000
アルプス技研	5,100	3,830.00	19,533,000
サニックス	21,000	306.00	6,426,000
ダイオーズ	2,600	1,394.00	3,624,400
日本空調サービス	12,700	717.00	9,105,900
オリエンタルランド	135,800	9,235.00	1,254,113,000
フォーカスシステムズ	5,100	938.00	4,783,800
ダスキン	30,900	3,085.00	95,326,500
パーク24	65,800	2,645.00	174,041,000
明光ネットワークジャパン	14,700	1,533.00	22,535,100
ファルコホールディングス	6,300	1,695.00	10,678,500
クレスコ	2,800	4,055.00	11,354,000
フジ・メディア・ホールディングス	123,400	1,629.00	201,018,600
秀英予備校	2,800	473.00	1,324,400
田谷	2,600	669.00	1,739,400
ラウンドワン	39,300	1,449.00	56,945,700
リゾートトラスト	48,700	2,193.00	106,799,100
オービック	40,900	6,950.00	284,255,000
ジャストシステム	19,300	2,421.00	46,725,300
TDCソフト	5,500	1,135.00	6,242,500
ヤフー	852,400	521.00	444,100,400
ビー・エム・エル	16,500	2,485.00	41,002,500
ワタベウェディング	2,100	867.00	1,820,700
トレンドマイクロ	57,600	5,780.00	332,928,000
りらいあコミュニケーションズ	21,000	1,285.00	26,985,000

インフォメーション・ディベロプメント	3,700	1,500.00	5,550,000	
リソー教育	21,700	874.00	18,965,800	
日本オラクル	19,100	8,940.00	170,754,000	
早稲田アカデミー	1,900	1,726.00	3,279,400	
アルファシステムズ	4,000	2,353.00	9,412,000	
フューチャー	16,400	1,002.00	16,432,800	
CAC Holdings	9,000	1,084.00	9,756,000	
ソフトバンク・テクノロジー	5,900	1,854.00	10,938,600	
トーセ	3,300	2,678.00	8,837,400	
ユー・エス・エス	152,100	2,291.00	348,461,100	
オービックビジネスコンサルタント	6,000	5,780.00	34,680,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	26,900	4,140.00	111,366,000	
アイティフォー	16,300	632.00	10,301,600	
東京個別指導学院	4,300	979.00	4,209,700	
東計電算	2,200	3,270.00	7,194,000	
サイバーエージェント	75,700	3,415.00	258,515,500	
楽天	589,300	1,243.00	732,499,900	
エクスネット	2,600	920.00	2,392,000	
クリーク・アンド・リバー社	4,700	1,125.00	5,287,500	
テー・オー・ダブリュー	10,600	860.00	9,116,000	
大塚商会	35,500	7,330.00	260,215,000	
総合メディカル	5,800	4,920.00	28,536,000	
サイボウズ	16,700	515.00	8,600,500	
ソフトブレーン	9,700	434.00	4,209,800	
セントラルスポーツ	4,400	3,930.00	17,292,000	
バラカ	3,600	2,373.00	8,542,800	
電通国際情報サービス	7,400	2,583.00	19,114,200	
デジタルガレージ	23,200	2,403.00	55,749,600	
イーエムシステムズ	4,200	2,117.00	8,891,400	
ウェザーニューズ	4,100	3,560.00	14,596,000	
C I J	11,400	672.00	7,660,800	
東洋ビジネスエンジニアリング	1,400	1,751.00	2,451,400	
日本エンタープライズ	13,400	255.00	3,417,000	
WOWOW	5,800	3,600.00	20,880,000	
スカラ	7,800	790.00	6,162,000	
フルキャストホールディングス	10,200	2,128.00	21,705,600	
富士フイルムホールディングス	249,700	4,438.00	1,108,168,600	
コニカミノルタ	281,400	948.00	266,767,200	
資生堂	224,100	4,623.00	1,036,014,300	
ライオン	167,600	2,108.00	353,300,800	
高砂香料工業	8,300	3,885.00	32,245,500	
マンダム	25,200	3,120.00	78,624,000	
ミルボン	8,100	6,820.00	55,242,000	
ファンケル	26,900	2,530.00	68,057,000	
コーセー	20,400	13,570.00	276,828,000	
コタ	5,400	1,318.00	7,117,200	
シーズ・ホールディングス	16,400	4,130.00	67,732,000	
シーボン	1,600	2,612.00	4,179,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	51,400	3,580.00	184,012,000	

ノエビアホールディングス	7,900	6,350.00	50,165,000
アジュバンコスメジャパン	2,800	1,005.00	2,814,000
エステー	8,700	2,667.00	23,202,900
アグロ カネショウ	5,100	1,905.00	9,715,500
コニシ	19,700	1,956.00	38,533,200
長谷川香料	15,900	2,194.00	34,884,600
星光PMC	7,000	1,198.00	8,386,000
小林製薬	33,700	6,330.00	213,321,000
荒川化学工業	10,800	2,537.00	27,399,600
メック	9,900	1,746.00	17,285,400
日本高純度化学	3,800	2,792.00	10,609,600
タカラバイオ	36,100	1,497.00	54,041,700
JCU	7,900	4,655.00	36,774,500
新田ゼラチン	8,200	781.00	6,404,200
OATアグリオ	1,600	2,076.00	3,321,600
デクセリアルズ	33,200	1,350.00	44,820,000
アース製薬	9,100	5,140.00	46,774,000
北興化学工業	12,800	704.00	9,011,200
大成ラミック	3,800	3,080.00	11,704,000
クミアイ化学工業	54,500	821.00	44,744,500
日本農薬	30,000	645.00	19,350,000
昭和シェル石油	112,400	1,271.00	142,860,400
富士興産	4,300	601.00	2,584,300
ニチレキ	15,400	1,444.00	22,237,600
ユシロ化学工業	6,900	1,683.00	11,612,700
ビービー・カストロール	5,200	1,998.00	10,389,600
富士石油	29,700	429.00	12,741,300
MORESCO	4,500	2,168.00	9,756,000
出光興産	77,700	3,155.00	245,143,500
JXTGホールディングス	1,918,700	557.00	1,068,715,900
コスモエネルギーホールディングス	38,000	2,520.00	95,760,000
横浜ゴム	69,600	2,407.00	167,527,200
東洋ゴム工業	71,300	2,547.00	181,601,100
ブリヂストン	424,900	5,248.00	2,229,875,200
住友ゴム工業	117,800	2,083.00	245,377,400
藤倉ゴム工業	10,800	923.00	9,968,400
オカモト	38,000	1,181.00	44,878,000
アキレス	10,100	2,286.00	23,088,600
フコク	5,200	1,156.00	6,011,200
ニッタ	11,300	4,335.00	48,985,500
クリエートメディック	4,100	1,067.00	4,374,700
住友理工	23,100	1,178.00	27,211,800
三ツ星ベルト	29,000	1,380.00	40,020,000
バンドー化学	22,700	1,169.00	26,536,300
旭硝子	122,900	4,215.00	518,023,500
日本板硝子	57,300	879.00	50,366,700
石塚硝子	1,800	2,452.00	4,413,600
有沢製作所	21,500	1,024.00	22,016,000
日本山村硝子	50,000	197.00	9,850,000
日本電気硝子	52,000	4,395.00	228,540,000

オハラ	4,800	2,062.00	9,897,600
住友大阪セメント	234,000	499.00	116,766,000
太平洋セメント	75,900	4,360.00	330,924,000
リソルホールディングス	1,300	3,990.00	5,187,000
日本ヒューム	12,400	698.00	8,655,200
日本コンクリート工業	28,300	459.00	12,989,700
三谷セキサン	6,300	2,650.00	16,695,000
アジアパイルホールディングス	15,900	623.00	9,905,700
東海カーボン	109,300	1,138.00	124,383,400
日本カーボン	6,200	4,815.00	29,853,000
東洋炭素	7,100	2,641.00	18,751,100
ノリタケカンパニーリミテド	7,100	5,470.00	38,837,000
TOTO	92,500	4,835.00	447,237,500
日本碍子	158,900	2,162.00	343,541,800
日本特殊陶業	103,000	2,445.00	251,835,000
ダントーホールディングス	11,000	179.00	1,969,000
MARUWA	4,700	6,160.00	28,952,000
品川リフラクトリーズ	3,200	3,755.00	12,016,000
黒崎播磨	2,700	5,340.00	14,418,000
ヨータイ	7,000	455.00	3,185,000
イソライト工業	6,500	825.00	5,362,500
東京窯業	16,000	379.00	6,064,000
ニッカトー	4,600	618.00	2,842,800
フジインコーポレーテッド	10,700	2,571.00	27,509,700
エーアンドエーマテリアル	2,800	1,322.00	3,701,600
ニチアス	66,000	1,357.00	89,562,000
新日鐵住金	567,500	2,547.00	1,445,422,500
神戸製鋼所	217,700	882.00	192,011,400
中山製鋼所	14,000	724.00	10,136,000
合同製鐵	7,100	2,199.00	15,612,900
ジェイ エフ イー ホールディングス	344,100	2,200.00	757,020,000
日新製鋼	41,000	1,459.00	59,819,000
東京製鐵	63,800	917.00	58,504,600
共英製鋼	13,500	1,700.00	22,950,000
大和工業	25,200	2,920.00	73,584,000
東京鐵鋼	5,400	2,199.00	11,874,600
大阪製鐵	7,800	2,454.00	19,141,200
淀川製鋼所	17,300	3,065.00	53,024,500
東洋鋼鈑	30,300	508.00	15,392,400
丸一鋼管	42,000	3,225.00	135,450,000
モリ工業	3,900	2,622.00	10,225,800
大同特殊鋼	21,100	6,710.00	141,581,000
日本高周波鋼業	4,600	1,030.00	4,738,000
日本冶金工業	105,100	231.00	24,278,100
山陽特殊製鋼	15,000	2,841.00	42,615,000
愛知製鋼	7,300	4,340.00	31,682,000
日立金属	128,100	1,568.00	200,860,800
日本金属	3,100	3,010.00	9,331,000
大平洋金属	8,200	3,155.00	25,871,000

新日本電工	71,800	453.00	32,525,400
栗本鐵工所	6,000	2,297.00	13,782,000
虹 技	1,900	2,219.00	4,216,100
日本鑄鉄管	14,000	183.00	2,562,000
日本製鋼所	41,700	2,702.00	112,673,400
三菱製鋼	8,700	2,883.00	25,082,100
日亜鋼業	18,100	315.00	5,701,500
日本精線	1,800	4,750.00	8,550,000
大紀アルミニウム工業所	21,000	827.00	17,367,000
日本軽金属ホールディングス	323,900	340.00	110,126,000
三井金属鉱業	34,300	5,750.00	197,225,000
東邦亜鉛	7,100	5,160.00	36,636,000
三菱マテリアル	78,500	3,945.00	309,682,500
住友金属鉱山	162,900	3,923.00	639,056,700
DOWAホールディングス	27,800	4,340.00	120,652,000
古河機械金属	19,600	1,944.00	38,102,400
エス・サイエンス	58,300	78.00	4,547,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,900	1,627.00	22,615,300
東邦チタニウム	21,500	875.00	18,812,500
U A C J	16,700	3,245.00	54,191,500
古河電気工業	42,300	6,690.00	282,987,000
住友電気工業	474,000	1,849.50	876,663,000
フジクラ	165,700	914.00	151,449,800
昭和電線ホールディングス	15,100	1,031.00	15,568,100
東京特殊電線	1,900	2,418.00	4,594,200
タツタ電線	23,800	825.00	19,635,000
沖電線	1,400	3,235.00	4,529,000
カナレ電気	1,900	2,498.00	4,746,200
平河ヒューテック	6,000	1,501.00	9,006,000
リョービ	14,600	3,045.00	44,457,000
アーレスティ	14,800	963.00	14,252,400
アサヒホールディングス	19,100	2,369.00	45,247,900
東洋製罐グループホールディングス	89,200	1,939.00	172,958,800
ホッカンホールディングス	32,000	425.00	13,600,000
コロナ	6,100	1,175.00	7,167,500
横河ブリッジホールディングス	22,200	2,138.00	47,463,600
OSJBホールディングス	42,400	336.00	14,246,400
駒井ハルテック	2,500	2,440.00	6,100,000
高田機工	1,200	3,145.00	3,774,000
三和ホールディングス	125,000	1,287.00	160,875,000
文化シャッター	35,300	872.00	30,781,600
三協立山	16,500	1,595.00	26,317,500
アルインコ	8,600	1,311.00	11,274,600
東洋シャッター	3,300	647.00	2,135,100
L I X I Lグループ	175,300	3,035.00	532,035,500
日本ファイルコン	9,800	920.00	9,016,000
ノーリツ	26,500	2,018.00	53,477,000
長府製作所	13,300	2,750.00	36,575,000
リンナイ	21,400	9,740.00	208,436,000
ユニプレス	23,200	3,175.00	73,660,000

ダイニチ工業	6,500	810.00	5,265,000
日東精工	16,900	631.00	10,663,900
三洋工業	1,700	2,213.00	3,762,100
岡部	24,100	1,061.00	25,570,100
ジーテクト	13,100	2,282.00	29,894,200
中国工業	2,300	779.00	1,791,700
東プレ	24,200	3,410.00	82,522,000
高周波熱錬	22,800	1,123.00	25,604,400
東京製綱	8,600	1,670.00	14,362,000
サンコール	6,800	703.00	4,780,400
モリテックスチール	7,200	556.00	4,003,200
パイオラックス	19,100	3,120.00	59,592,000
エイチワン	9,700	1,261.00	12,231,700
日本発条	118,100	1,245.00	147,034,500
中央発條	1,400	3,650.00	5,110,000
アドバネクス	2,300	2,980.00	6,854,000
三浦工業	51,400	2,564.00	131,789,600
タクマ	40,300	1,360.00	54,808,000
テクノプロ・ホールディングス	20,500	5,100.00	104,550,000
インターワークス	2,600	1,126.00	2,927,600
K e e P e r 技研	3,000	1,338.00	4,014,000
ファーストロジック	700	2,576.00	1,803,200
デザインワン・ジャパン	2,300	1,322.00	3,040,600
イー・ガーディアン	6,000	2,236.00	13,416,000
リブセンス	8,400	537.00	4,510,800
ジャパンマテリアル	9,200	2,791.00	25,677,200
ベクトル	10,500	1,586.00	16,653,000
ウチヤマホールディングス	6,300	532.00	3,351,600
ライクキッズネクスト	1,100	2,297.00	2,526,700
キャリアリンク	3,100	562.00	1,742,200
I B J	8,900	828.00	7,369,200
アサンテ	4,900	1,968.00	9,643,200
N・フィールド	6,200	1,843.00	11,426,600
バリューHR	1,300	4,345.00	5,648,500
M&Aキャピタルパートナーズ	2,200	5,740.00	12,628,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,100	993.00	3,078,300
E R Iホールディングス	3,700	930.00	3,441,000
アピスト	1,700	4,320.00	7,344,000
ウィルグループ	5,400	1,338.00	7,225,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,900	2,768.00	8,027,200
日本ビューホテル	1,900	1,417.00	2,692,300
リクルートホールディングス	823,500	2,769.00	2,280,271,500
エラン	3,000	1,616.00	4,848,000
ツガミ	34,000	1,004.00	34,136,000
オークマ	16,400	6,520.00	106,928,000
東芝機械	67,000	656.00	43,952,000
アマダホールディングス	168,900	1,256.00	212,138,400
アイダエンジニアリング	35,700	1,306.00	46,624,200
滝澤鉄工所	3,900	1,918.00	7,480,200

富士機械製造	38,300	2,087.00	79,932,100
牧野フライス製作所	63,000	1,013.00	63,819,000
オーエスジー	53,600	2,398.00	128,532,800
ダイジェット工業	1,600	1,920.00	3,072,000
旭ダイヤモンド工業	35,500	1,047.00	37,168,500
D M G 森精機	65,800	2,142.00	140,943,600
ソディック	31,900	1,494.00	47,658,600
ディスコ	14,700	23,680.00	348,096,000
日東工器	7,300	2,795.00	20,403,500
パンチ工業	4,700	1,953.00	9,179,100
富士ダイス	4,700	857.00	4,027,900
日本郵政	668,200	1,300.00	868,660,000
ベルシステム24ホールディングス	19,300	1,264.00	24,395,200
エボラブルアジア	2,400	2,296.00	5,510,400
ストライク	1,100	4,705.00	5,175,500
ソラスト	8,200	2,062.00	16,908,400
豊田自動織機	109,500	6,490.00	710,655,000
豊和工業	7,400	1,957.00	14,481,800
OKK	4,800	1,258.00	6,038,400
石川製作所	3,200	3,940.00	12,608,000
東洋機械金属	8,800	864.00	7,603,200
津田駒工業	30,000	200.00	6,000,000
エンシュウ	34,000	151.00	5,134,000
島精機製作所	16,400	6,040.00	99,056,000
NCホールディングス	4,400	887.00	3,902,800
フリー	7,600	1,137.00	8,641,200
ヤマシンフィルタ	2,600	3,770.00	9,802,000
日阪製作所	16,900	1,002.00	16,933,800
やまびこ	23,100	1,490.00	34,419,000
平田機工	4,200	11,510.00	48,342,000
ペガサスミシン製造	12,400	773.00	9,585,200
ナブテスコ	65,400	4,150.00	271,410,000
三井海洋開発	12,700	2,667.00	33,870,900
レオン自動機	10,700	1,679.00	17,965,300
S M C	37,700	40,650.00	1,532,505,000
新川	10,900	807.00	8,796,300
ホソカワミクロン	4,400	6,150.00	27,060,000
ユニオンツール	5,400	3,525.00	19,035,000
オイレス工業	15,300	2,082.00	31,854,600
日精エー・エス・ビー機械	4,100	4,415.00	18,101,500
サトーホールディングス	15,700	2,681.00	42,091,700
技研製作所	6,000	3,305.00	19,830,000
日本エアーテック	4,400	861.00	3,788,400
日精樹脂工業	10,100	1,504.00	15,190,400
オカダアイオン	2,800	1,826.00	5,112,800
ワイエイシイホールディングス	4,900	1,113.00	5,453,700
小松製作所	580,500	3,455.00	2,005,627,500
住友重機械工業	73,400	4,500.00	330,300,000
日立建機	56,200	3,505.00	196,981,000
日工	3,800	2,203.00	8,371,400

巴工業	5,300	2,230.00	11,819,000
井関農機	12,000	2,453.00	29,436,000
TOWA	10,400	1,796.00	18,678,400
丸山製作所	2,800	1,875.00	5,250,000
北川鉄工所	5,800	2,818.00	16,344,400
シンニッタン	10,400	726.00	7,550,400
ローツェ	6,000	2,845.00	17,070,000
タカキタ	3,600	627.00	2,257,200
クボタ	648,600	1,988.50	1,289,741,100
荏原実業	3,700	1,734.00	6,415,800
東洋エンジニアリング	16,000	1,353.00	21,648,000
三菱化工機	4,200	2,436.00	10,231,200
月島機械	23,700	1,367.00	32,397,900
帝国電機製作所	9,200	1,176.00	10,819,200
東京機械製作所	5,000	615.00	3,075,000
新東工業	28,400	1,274.00	36,181,600
澁谷工業	10,500	3,590.00	37,695,000
アイチコーポレーション	17,900	794.00	14,212,600
小森コーポレーション	30,000	1,394.00	41,820,000
鶴見製作所	9,300	1,982.00	18,432,600
住友精密工業	20,000	365.00	7,300,000
酒井重工業	2,500	3,430.00	8,575,000
荏原製作所	57,000	3,815.00	217,455,000
石井鐵工所	1,900	1,757.00	3,338,300
西島製作所	12,400	1,171.00	14,520,400
北越工業	13,700	1,104.00	15,124,800
千代田化工建設	98,000	628.00	61,544,000
ダイキン工業	164,100	11,835.00	1,942,123,500
オルガノ	4,700	2,691.00	12,647,700
トーヨーカネツ	5,500	4,040.00	22,220,000
栗田工業	69,200	3,280.00	226,976,000
椿本チエイン	71,000	900.00	63,900,000
大同工業	5,000	1,612.00	8,060,000
日機装	41,700	1,039.00	43,326,300
木村化工機	11,300	460.00	5,198,000
新興ブランテック	27,400	941.00	25,783,400
アネスト岩田	21,700	1,124.00	24,390,800
ダイフク	60,000	5,590.00	335,400,000
サムコ	3,300	1,007.00	3,323,100
加藤製作所	6,600	3,230.00	21,318,000
油研工業	2,300	2,633.00	6,055,900
タダノ	62,900	1,322.00	83,153,800
フジテック	34,900	1,549.00	54,060,100
CKD	36,100	2,340.00	84,474,000
キトー	15,300	1,425.00	21,802,500
平和	37,300	2,232.00	83,253,600
理想科学工業	11,900	2,063.00	24,549,700
SANKYO	33,300	3,705.00	123,376,500
日本金銭機械	11,300	1,155.00	13,051,500
マースエンジニアリング	6,800	2,367.00	16,095,600

福島工業	7,500	4,225.00	31,687,500
オーイズミ	5,300	551.00	2,920,300
ダイコク電機	5,000	1,770.00	8,850,000
竹内製作所	22,000	2,250.00	49,500,000
アマノ	37,200	2,677.00	99,584,400
JUKI	17,900	1,645.00	29,445,500
サンデンホールディングス	14,800	2,232.00	33,033,600
蛇の目ミシン工業	11,800	777.00	9,168,600
ブラザー工業	146,800	2,663.00	390,928,400
マックス	18,000	1,559.00	28,062,000
モリタホールディングス	21,000	1,819.00	38,199,000
グローリー	38,400	4,110.00	157,824,000
新晃工業	11,300	1,806.00	20,407,800
大和冷機工業	19,400	1,178.00	22,853,200
セガサミーホールディングス	119,300	1,640.00	195,652,000
日本ピストンリング	4,800	2,431.00	11,668,800
リケン	5,600	5,890.00	32,984,000
T P R	13,500	3,770.00	50,895,000
ツバキ・ナカシマ	12,100	2,413.00	29,197,300
ホシザキ	37,900	10,210.00	386,959,000
大豊工業	9,800	1,697.00	16,630,600
日本精工	247,100	1,512.00	373,615,200
N T N	278,000	492.00	136,776,000
ジェイテクト	127,900	1,609.00	205,791,100
不二越	112,000	649.00	72,688,000
ミネベアミツミ	219,000	1,856.00	406,464,000
日本トムソン	38,800	650.00	25,220,000
T H K	85,000	3,955.00	336,175,000
ユーシン精機	5,400	3,035.00	16,389,000
前澤給装工業	4,400	1,865.00	8,206,000
イーグル工業	13,000	2,063.00	26,819,000
前澤工業	8,600	455.00	3,913,000
日本ビラー工業	12,300	1,642.00	20,196,600
キッツ	57,800	902.00	52,135,600
日立製作所	2,886,000	818.40	2,361,902,400
三菱電機	1,282,400	1,802.00	2,310,884,800
富士電機	362,000	661.00	239,282,000
東洋電機製造	5,000	2,366.00	11,830,000
安川電機	139,400	3,705.00	516,477,000
シンフォニアテクノロジー	78,000	456.00	35,568,000
明電舎	111,000	441.00	48,951,000
オリジン電気	3,600	2,041.00	7,347,600
山洋電気	6,300	6,150.00	38,745,000
デンヨー	11,100	1,934.00	21,467,400
三櫻工業	15,300	950.00	14,535,000
マキタ	156,700	4,470.00	700,449,000
東芝テック	75,000	624.00	46,800,000
芝浦メカトロニクス	20,000	415.00	8,300,000
マブチモーター	33,600	5,540.00	186,144,000
日本電産	155,800	13,990.00	2,179,642,000

ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3,000	2,244.00	6,732,000
東光高岳	6,200	1,940.00	12,028,000
ダブル・スコープ	17,500	2,152.00	37,660,000
宮越ホールディングス	4,500	524.00	2,358,000
ダイヘン	66,000	1,009.00	66,594,000
田淵電機	19,100	299.00	5,710,900
ヤーマン	1,500	12,310.00	18,465,000
JVCケンウッド	88,700	322.00	28,561,400
ミマキエンジニアリング	11,000	865.00	9,515,000
第一精工	5,700	2,648.00	15,093,600
日新電機	24,200	1,429.00	34,581,800
大崎電気工業	24,100	878.00	21,159,800
オムロン	127,800	5,920.00	756,576,000
日東工業	17,600	1,951.00	34,337,600
I D E C	14,200	2,365.00	33,583,000
不二電機工業	1,400	1,376.00	1,926,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	232,000	591.00	137,112,000
サクサホールディングス	3,100	2,039.00	6,320,900
メルコホールディングス	6,600	3,530.00	23,298,000
テクノメディカ	2,800	1,943.00	5,440,400
日本電気	165,200	3,060.00	505,512,000
富士通	1,159,000	887.10	1,028,148,900
沖電気工業	52,000	1,512.00	78,624,000
岩崎通信機	5,500	854.00	4,697,000
電気興業	6,800	3,020.00	20,536,000
サンケン電気	71,000	601.00	42,671,000
ナカヨ	2,500	1,907.00	4,767,500
アイホン	6,800	1,862.00	12,661,600
ルネサスエレクトロニクス	62,500	1,236.00	77,250,000
セイコーエプソン	179,000	2,701.00	483,479,000
ワコム	93,700	500.00	46,850,000
アルバック	20,300	7,300.00	148,190,000
アクセル	5,200	806.00	4,191,200
E I Z O	11,900	4,460.00	53,074,000
ジャパンディスプレイ	225,400	241.00	54,321,400
日本信号	33,200	1,220.00	40,504,000
京三製作所	29,000	617.00	17,893,000
能美防災	13,700	1,789.00	24,509,300
ホーチキ	8,800	2,175.00	19,140,000
エレコム	10,400	2,230.00	23,192,000
パナソニック	1,380,800	1,620.00	2,236,896,000
アンリツ	87,700	941.00	82,525,700
富士通ゼネラル	40,900	2,261.00	92,474,900
日立国際電気	31,500	3,020.00	95,130,000
ソニー	849,600	4,062.00	3,451,075,200
T D K	67,700	7,630.00	516,551,000
帝国通信工業	5,200	1,138.00	5,917,600
タムラ製作所	47,000	678.00	31,866,000
アルプス電気	111,000	3,040.00	337,440,000
池上通信機	40,000	165.00	6,600,000

パイオニア	181,000	212.00	38,372,000
日本電波工業	11,800	827.00	9,758,600
鈴木	4,900	990.00	4,851,000
日本トリム	2,900	4,800.00	13,920,000
ローランド ディー . ジー .	6,200	2,960.00	18,352,000
フォスター電機	14,100	2,353.00	33,177,300
クラリオン	64,000	446.00	28,544,000
SMK	31,000	532.00	16,492,000
ヨコオ	8,800	1,405.00	12,364,000
ティアック	92,000	48.00	4,416,000
ホシデン	35,500	1,839.00	65,284,500
ヒロセ電機	19,400	16,110.00	312,534,000
日本航空電子工業	34,000	1,797.00	61,098,000
TOA	14,200	1,192.00	16,926,400
マクセルホールディングス	17,900	2,579.00	46,164,100
古野電気	15,500	742.00	11,501,000
ユニデンホールディングス	37,000	303.00	11,211,000
アルパイン	28,700	2,092.00	60,040,400
スミダコーポレーション	12,400	2,071.00	25,680,400
アイコム	6,700	2,595.00	17,386,500
リオン	4,800	2,324.00	11,155,200
本多通信工業	3,600	1,738.00	6,256,800
船井電機	13,600	889.00	12,090,400
横河電機	130,300	2,044.00	266,333,200
新電元工業	4,700	7,200.00	33,840,000
アズビル	36,000	4,775.00	171,900,000
東亜ディーケーケー	6,200	806.00	4,997,200
日本光電工業	50,200	2,604.00	130,720,800
チノー	4,400	1,305.00	5,742,000
共和電業	14,400	452.00	6,508,800
日本電子材料	5,000	679.00	3,395,000
堀場製作所	23,800	6,520.00	155,176,000
アドバンテスト	82,100	2,307.00	189,404,700
小野測器	5,000	747.00	3,735,000
エスベック	10,700	2,301.00	24,620,700
キーエンス	54,500	60,000.00	3,270,000,000
日置電機	6,300	2,415.00	15,214,500
シスメックス	93,500	7,210.00	674,135,000
日本マイクロニクス	21,100	1,107.00	23,357,700
メガチップス	11,200	3,750.00	42,000,000
OBARA GROUP	7,000	6,560.00	45,920,000
イマジカ・ロボットホールディングス	10,100	890.00	8,989,000
澤藤電機	1,500	2,816.00	4,224,000
デンソー	296,400	5,686.00	1,685,330,400
コーセル	16,800	1,501.00	25,216,800
イリソ電子工業	10,100	5,840.00	58,984,000
新日本無線	9,900	853.00	8,444,700
オブテックスグループ	9,400	4,405.00	41,407,000
千代田インテグレ	5,800	2,702.00	15,671,600

アイ・オー・データ機器	4,000	1,112.00	4,448,000
レーザーテック	26,500	2,361.00	62,566,500
スタンレー電気	85,500	4,005.00	342,427,500
岩崎電気	4,500	1,935.00	8,707,500
ウシオ電機	72,900	1,552.00	113,140,800
岡谷電機産業	7,000	504.00	3,528,000
ヘリオス テクノ ホールディング	11,700	737.00	8,622,900
日本セラミック	12,200	3,185.00	38,857,000
遠藤照明	6,200	1,311.00	8,128,200
古河電池	9,000	1,211.00	10,899,000
双信電機	6,500	630.00	4,095,000
山一電機	11,400	2,027.00	23,107,800
図研	7,900	1,902.00	15,025,800
日本電子	44,000	566.00	24,904,000
カシオ計算機	96,700	1,628.00	157,427,600
ファナック	121,900	24,525.00	2,989,597,500
日本シイエムケイ	26,000	1,210.00	31,460,000
エンプラス	5,500	4,985.00	27,417,500
大真空	4,600	1,892.00	8,703,200
ローム	58,100	9,670.00	561,827,000
浜松ホトニクス	87,400	3,575.00	312,455,000
三井ハイテック	15,900	2,259.00	35,918,100
新光電気工業	45,400	783.00	35,548,200
京セラ	197,300	7,272.00	1,434,765,600
協栄産業	1,500	2,477.00	3,715,500
太陽誘電	58,500	1,778.00	104,013,000
村田製作所	126,100	16,620.00	2,095,782,000
ユーシン	16,800	781.00	13,120,800
双葉電子工業	19,500	2,096.00	40,872,000
日東電工	90,800	9,453.00	858,332,400
北陸電気工業	5,000	1,537.00	7,685,000
東海理化電機製作所	31,600	2,307.00	72,901,200
ニチコン	37,900	1,386.00	52,529,400
日本ケミコン	10,400	3,840.00	39,936,000
K O A	16,700	2,243.00	37,458,100
三井造船	43,400	1,478.00	64,145,200
日立造船	95,400	589.00	56,190,600
三菱重工業	201,500	4,457.00	898,085,500
川崎重工業	93,500	3,810.00	356,235,000
I H I	92,400	3,910.00	361,284,000
名村造船所	36,200	665.00	24,073,000
サノヤスホールディングス	15,000	303.00	4,545,000
日本車輛製造	44,000	298.00	13,112,000
三菱ロジスネクスト	14,500	866.00	12,557,000
近畿車輛	1,900	2,647.00	5,029,300
F P G	42,600	1,227.00	52,270,200
島根銀行	2,800	1,343.00	3,760,400
じもとホールディングス	86,600	209.00	18,099,400
全国保証	33,500	4,580.00	153,430,000
めぶきフィナンシャルグループ	572,200	442.00	252,912,400

東京ＴＹフィナンシャルグループ	17,200	2,939.00	50,550,800	
九州フィナンシャルグループ	194,400	681.00	132,386,400	
かんぽ生命保険	44,700	2,419.00	108,129,300	
ゆうちょ銀行	335,500	1,383.00	463,996,500	
富山第一銀行	30,200	543.00	16,398,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	769,500	579.20	445,694,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	80,600	1,251.00	100,830,600	
日産自動車	1,417,600	1,089.50	1,544,475,200	
いすゞ自動車	348,500	1,506.50	525,015,250	
トヨタ自動車	1,461,600	6,925.00	10,121,580,000	*
日野自動車	171,700	1,432.00	245,874,400	
三菱自動車工業	440,800	911.00	401,568,800	
エフテック	6,700	1,795.00	12,026,500	
レシップホールディングス	4,300	923.00	3,968,900	
GMB	2,100	1,460.00	3,066,000	
ファルテック	2,200	1,392.00	3,062,400	
武蔵精密工業	14,000	3,590.00	50,260,000	
日産車体	52,900	1,231.00	65,119,900	
新明和工業	48,500	1,027.00	49,809,500	
極東開発工業	24,000	1,861.00	44,664,000	
日信工業	26,800	2,003.00	53,680,400	
トピー工業	9,900	3,730.00	36,927,000	
ティラド	4,700	4,195.00	19,716,500	
曙ブレーキ工業	56,300	373.00	20,999,900	
タチエス	20,500	2,017.00	41,348,500	
NOK	58,100	2,584.00	150,130,400	
フタバ産業	36,800	1,217.00	44,785,600	
KYB	13,500	6,890.00	93,015,000	
市光工業	25,000	823.00	20,575,000	
大同メタル工業	15,200	1,001.00	15,215,200	
プレス工業	63,700	596.00	37,965,200	
ミクニ	15,500	580.00	8,990,000	
太平洋工業	27,200	1,452.00	39,494,400	
ケーヒン	27,600	1,970.00	54,372,000	
河西工業	16,300	1,643.00	26,780,900	
アイシン精機	110,000	5,990.00	658,900,000	
富士機工	12,100	737.00	8,917,700	
マツダ	380,700	1,657.50	631,010,250	
今仙電機製作所	11,200	1,420.00	15,904,000	
本田技研工業	1,081,800	3,407.00	3,685,692,600	
スズキ	238,300	5,851.00	1,394,293,300	
SUBARU	373,300	3,952.00	1,475,281,600	
安永	4,300	3,465.00	14,899,500	
ヤマハ発動機	169,900	3,315.00	563,218,500	
ショーワ	31,300	1,399.00	43,788,700	
小糸製作所	72,100	7,110.00	512,631,000	
TBK	15,700	508.00	7,975,600	
エクセディ	16,200	3,355.00	54,351,000	

ミツバ	22,200	1,775.00	39,405,000
豊田合成	38,700	2,831.00	109,559,700
愛三工業	21,000	1,073.00	22,533,000
盟和産業	1,800	1,274.00	2,293,200
ヨロズ	11,200	2,339.00	26,196,800
エフ・シー・シー	19,700	2,506.00	49,368,200
新家工業	2,800	2,146.00	6,008,800
シマノ	48,500	14,860.00	720,710,000
テイ・エス テック	27,900	3,810.00	106,299,000
ジャムコ	7,100	2,331.00	16,550,100
小野建	10,300	1,872.00	19,281,600
はるやまホールディングス	5,400	1,001.00	5,405,400
ノジマ	18,600	2,380.00	44,268,000
佐島電機	8,800	1,006.00	8,852,800
カッパ・クリエイト	16,800	1,278.00	21,470,400
エコートレーディング	3,000	705.00	2,115,000
伯東	8,100	1,720.00	13,932,000
コンドーテック	9,600	1,177.00	11,299,200
中山福	7,300	783.00	5,715,900
ライトオン	9,300	955.00	8,881,500
ナガイレーベン	15,700	2,823.00	44,321,100
ジーンズメイト	4,000	731.00	2,924,000
三菱食品	13,000	3,340.00	43,420,000
良品計画	15,700	33,050.00	518,885,000
三城ホールディングス	13,700	475.00	6,507,500
松田産業	8,600	1,584.00	13,622,400
第一興商	19,300	5,300.00	102,290,000
メディバルホールディングス	118,600	2,038.00	241,706,800
アドヴァン	12,300	1,031.00	12,681,300
S P K	2,800	3,160.00	8,848,000
萩原電気	4,100	3,405.00	13,960,500
アルビス	3,200	4,225.00	13,520,000
アズワン	9,300	6,160.00	57,288,000
スズデン	4,300	1,436.00	6,174,800
尾家産業	4,400	1,287.00	5,662,800
シモジマ	7,200	1,167.00	8,402,400
ドウシシャ	14,000	2,442.00	34,188,000
小津産業	2,800	2,192.00	6,137,600
コナカ	15,400	588.00	9,055,200
高速	7,100	1,195.00	8,484,500
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,569.00	2,667,300
G - 7ホールディングス	3,600	2,244.00	8,078,400
たけびし	4,000	1,563.00	6,252,000
イオン北海道	10,400	643.00	6,687,200
コジマ	18,400	382.00	7,028,800
ヒマラヤ	3,300	983.00	3,243,900
コーナン商事	16,800	2,245.00	37,716,000
黒田電気	16,100	2,008.00	32,328,800
ネットワンシステムズ	51,500	1,207.00	62,160,500
エコス	4,800	1,240.00	5,952,000

ワタミ	14,100	1,511.00	21,305,100
マルシェ	3,100	828.00	2,566,800
リックス	2,800	1,790.00	5,012,000
システムソフト	22,800	142.00	3,237,600
ドンキホーテホールディングス	76,800	4,490.00	344,832,000
丸文	10,300	1,013.00	10,433,900
西松屋チェーン	21,000	1,233.00	25,893,000
ゼンショーホールディングス	61,400	2,086.00	128,080,400
ハピネット	10,000	1,914.00	19,140,000
幸楽苑ホールディングス	7,900	1,729.00	13,659,100
ハークスレイ	3,000	1,152.00	3,456,000
橋本総業ホールディングス	2,500	1,707.00	4,267,500
日本ライフライン	13,500	5,690.00	76,815,000
サイゼリヤ	17,600	3,485.00	61,336,000
エクセル	5,200	2,268.00	11,793,600
V Tホールディングス	40,300	633.00	25,509,900
マルカキカイ	3,900	2,042.00	7,963,800
アルゴグラフィックス	5,500	3,490.00	19,195,000
魚力	3,900	1,185.00	4,621,500
I D O M	32,300	682.00	22,028,600
日本エム・ディ・エム	9,200	1,107.00	10,184,400
ポプラ	3,500	605.00	2,117,500
フジ・コーポレーション	1,900	2,178.00	4,138,200
ユナイテッドアローズ	15,800	4,175.00	65,965,000
進和	7,000	2,370.00	16,590,000
エスケイジャパン	2,400	308.00	739,200
ダイトロン	5,600	2,041.00	11,429,600
ハイデイ日高	13,000	3,205.00	41,665,000
シークス	7,500	4,765.00	35,737,500
京都きもの友禅	8,100	937.00	7,589,700
コロワイド	39,500	2,100.00	82,950,000
ピーシーデポコーポレーション	15,900	857.00	13,626,300
田中商事	3,900	772.00	3,010,800
オーハシテクニカ	6,700	1,647.00	11,034,900
壱番屋	8,400	4,455.00	37,422,000
白銅	3,100	2,132.00	6,609,200
トップカルチャー	5,000	530.00	2,650,000
P L A N T	2,800	1,331.00	3,726,800
スギホールディングス	26,000	5,830.00	151,580,000
島津製作所	154,700	2,260.00	349,622,000
J M S	11,100	692.00	7,681,200
クボテック	2,800	586.00	1,640,800
長野計器	8,500	1,184.00	10,064,000
ブイ・テクノロジー	2,500	19,680.00	49,200,000
スター精密	21,100	1,974.00	41,651,400
東京計器	8,500	1,604.00	13,634,000
愛知時計電機	1,600	3,940.00	6,304,000
インターアクション	4,700	767.00	3,604,900
オーバル	11,800	294.00	3,469,200
東京精密	23,200	4,005.00	92,916,000

マニー	14,700	3,145.00	46,231,500
ニコン	209,500	1,964.00	411,458,000
トプコン	60,600	2,261.00	137,016,600
オリンパス	191,900	3,950.00	758,005,000
理研計器	10,600	2,413.00	25,577,800
S C R E E Nホールディングス	24,700	8,030.00	198,341,000
キヤノン電子	11,000	2,315.00	25,465,000
タムロン	9,700	2,166.00	21,010,200
H O Y A	247,300	6,178.00	1,527,819,400
シード	1,600	3,990.00	6,384,000
ノーリツ鋼機	12,300	1,456.00	17,908,800
エー・アンド・デイ	11,400	530.00	6,042,000
キヤノン	647,000	3,970.00	2,568,590,000
リコー	361,400	1,154.00	417,055,600
シチズン時計	131,200	797.00	104,566,400
リズム時計工業	4,800	2,389.00	11,467,200
大研医器	10,600	778.00	8,246,800
メニコン	8,300	4,790.00	39,757,000
スノーピーク	1,600	2,924.00	4,678,400
パラマウントベッドホールディングス	11,500	4,965.00	57,097,500
トランザクション	5,600	1,060.00	5,936,000
S H O B I	5,000	461.00	2,305,000
ニホンフラッシュ	5,300	1,714.00	9,084,200
前田工織	12,200	1,891.00	23,070,200
永大産業	15,000	558.00	8,370,000
アートネイチャー	13,000	713.00	9,269,000
ダンロップスポーツ	7,700	1,622.00	12,489,400
バンダイナムコホールディングス	132,600	3,835.00	508,521,000
アイフィスジャパン	2,400	553.00	1,327,200
共立印刷	21,600	348.00	7,516,800
S H O E I	5,500	3,350.00	18,425,000
フランスベッドホールディングス	13,800	1,035.00	14,283,000
マーベラス	20,300	955.00	19,386,500
パイロットコーポレーション	21,000	5,440.00	114,240,000
萩原工業	3,400	3,875.00	13,175,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	21,900	1,548.00	33,901,200
トッパン・フォームズ	21,600	1,223.00	26,416,800
フジシールインターナショナル	27,000	3,420.00	92,340,000
タカラトミー	46,800	1,716.00	80,308,800
廣済堂	12,700	453.00	5,753,100
アーク	53,400	111.00	5,927,400
レック	7,900	2,806.00	22,167,400
タカノ	5,700	1,288.00	7,341,600
プロネクサス	11,400	1,333.00	15,196,200
ホクシン	9,700	218.00	2,114,600
ウッドワン	4,200	1,850.00	7,770,000
大建工業	8,500	2,793.00	23,740,500
きもと	23,400	261.00	6,107,400
凸版印刷	339,000	1,115.00	377,985,000

大日本印刷	169,300	2,674.00	452,708,200
図書印刷	8,200	1,079.00	8,847,800
共同印刷	3,700	3,710.00	13,727,000
N I S S H A	21,100	3,340.00	70,474,000
光村印刷	300	2,419.00	725,700
藤森工業	9,400	3,715.00	34,921,000
ヴィア・ホールディングス	9,400	827.00	7,773,800
宝印刷	6,200	1,717.00	10,645,400
前澤化成工業	8,300	1,249.00	10,366,700
アシックス	119,500	1,709.00	204,225,500
ツツミ	4,500	2,038.00	9,171,000
J S P	5,900	3,765.00	22,213,500
ニチハ	16,700	4,345.00	72,561,500
エフピコ	11,200	5,840.00	65,408,000
小松ウオール工業	4,000	1,976.00	7,904,000
ヤマハ	81,000	4,340.00	351,540,000
河合楽器製作所	4,800	2,343.00	11,246,400
クリナップ	12,500	892.00	11,150,000
ビジョン	72,700	3,845.00	279,531,500
天馬	8,300	2,310.00	19,173,000
兼松サステック	1,400	2,388.00	3,343,200
キングジム	10,200	1,029.00	10,495,800
リンテック	28,500	2,974.00	84,759,000
信越ポリマー	24,700	1,044.00	25,786,800
東リ	30,000	396.00	11,880,000
イトーキ	25,500	935.00	23,842,500
任天堂	74,100	43,700.00	3,238,170,000
三菱鉛筆	19,800	2,799.00	55,420,200
松風	6,300	1,320.00	8,316,000
タカラスタンダード	24,700	1,947.00	48,090,900
コクヨ	57,600	1,910.00	110,016,000
ナカバヤシ	11,000	687.00	7,557,000
ニフコ	22,100	6,780.00	149,838,000
立川ブラインド工業	5,400	1,258.00	6,793,200
グロープライド	5,900	1,948.00	11,493,200
岡村製作所	42,000	1,240.00	52,080,000
日本バルカー工業	9,800	2,742.00	26,871,600
M U T O Hホールディングス	1,600	2,569.00	4,110,400
伊藤忠商事	869,100	1,864.00	1,620,002,400
丸紅	1,167,700	735.20	858,493,040
スクロール	18,300	392.00	7,173,600
高島	2,100	2,254.00	4,733,400
ヨンドシーホールディングス	12,000	3,020.00	36,240,000
三陽商会	6,800	1,783.00	12,124,400
長瀬産業	71,000	1,887.00	133,977,000
ナイガイ	4,900	588.00	2,881,200
蝶理	7,500	2,093.00	15,697,500
豊田通商	132,200	3,795.00	501,699,000
オンワードホールディングス	81,000	919.00	74,439,000
三共生興	17,000	441.00	7,497,000

兼松	50,600	1,397.00	70,688,200
美津濃	12,900	3,240.00	41,796,000
ツカモトコーポレーション	2,300	1,250.00	2,875,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	52,000	6,140.00	319,280,000
ルック	22,000	412.00	9,064,000
三井物産	1,072,500	1,628.00	1,746,030,000
日本紙パルプ商事	6,200	4,645.00	28,799,000
東京エレクトロン	80,200	17,700.00	1,419,540,000
日立ハイテクノロジーズ	41,100	4,345.00	178,579,500
カメイ	15,400	1,782.00	27,442,800
東都水産	1,900	1,968.00	3,739,200
OUGホールディングス	2,000	2,714.00	5,428,000
スターゼン	5,000	5,540.00	27,700,000
セイコーホールディングス	16,900	2,505.00	42,334,500
山善	45,500	1,198.00	54,509,000
椿本興業	2,800	2,847.00	7,971,600
住友商事	746,600	1,578.50	1,178,508,100
日本ユニシス	32,800	1,743.00	57,170,400
内田洋行	5,500	3,765.00	20,707,500
三菱商事	890,300	2,552.00	2,272,045,600
第一実業	5,400	3,190.00	17,226,000
キヤノンマーケティングジャパン	33,800	2,606.00	88,082,800
西華産業	7,400	2,927.00	21,659,800
佐藤商事	10,500	1,133.00	11,896,500
菱洋エレクトロ	10,900	2,058.00	22,432,200
東京産業	11,700	512.00	5,990,400
ユアサ商事	11,200	3,995.00	44,744,000
神鋼商事	3,100	2,985.00	9,253,500
小林産業	8,900	426.00	3,791,400
阪和興業	23,700	4,035.00	95,629,500
正栄食品工業	6,600	4,715.00	31,119,000
カナデン	11,600	1,237.00	14,349,200
菱電商事	9,300	1,717.00	15,968,100
ニプロ	83,200	1,633.00	135,865,600
フルサト工業	6,400	1,780.00	11,392,000
岩谷産業	26,100	3,400.00	88,740,000
すてきなイスグループ	5,300	1,561.00	8,273,300
昭光通商	46,000	115.00	5,290,000
ニチモウ	1,800	1,998.00	3,596,400
極東貿易	19,000	387.00	7,353,000
イワキ	18,000	552.00	9,936,000
兼松エレクトロニクス	7,500	3,245.00	24,337,500
三愛石油	31,600	1,326.00	41,901,600
稲畑産業	28,300	1,548.00	43,808,400
G S Iクレオス	3,100	1,734.00	5,375,400
明和産業	11,300	476.00	5,378,800
キムラタン	56,600	62.00	3,509,200
ゴールドウイン	5,400	8,540.00	46,116,000
ユニ・チャーム	255,000	2,673.50	681,742,500

デサント	28,700	1,539.00	44,169,300
キング	5,800	491.00	2,847,800
ワキタ	25,300	1,341.00	33,927,300
ヤマトインターナショナル	8,300	458.00	3,801,400
東邦ホールディングス	37,900	2,101.00	79,627,900
サンゲツ	40,000	1,976.00	79,040,000
ミツウロコグループホールディングス	19,200	837.00	16,070,400
シナネンホールディングス	5,000	2,412.00	12,060,000
伊藤忠エネクス	26,000	1,235.00	32,110,000
サンリオ	36,600	1,908.00	69,832,800
サンワテクノス	7,100	2,220.00	15,762,000
リョーサン	15,900	4,415.00	70,198,500
新光商事	13,000	2,062.00	26,806,000
トーヨー	5,500	2,690.00	14,795,000
三信電気	13,100	1,720.00	22,532,000
東陽テクニカ	13,700	1,056.00	14,467,200
モスフードサービス	15,500	3,500.00	54,250,000
加賀電子	10,700	3,630.00	38,841,000
三益半導体工業	9,700	1,794.00	17,401,800
ソーダニッカ	12,600	579.00	7,295,400
立花エレテック	7,900	1,860.00	14,694,000
木曽路	14,600	2,730.00	39,858,000
SRSホールディングス	14,700	937.00	13,773,900
千趣会	21,300	688.00	14,654,400
タカキュー	10,700	209.00	2,236,300
ケーヨー	20,400	757.00	15,442,800
上新電機	14,000	3,810.00	53,340,000
日本瓦斯	21,800	3,635.00	79,243,000
ロイヤルホールディングス	19,800	2,976.00	58,924,800
東天紅	1,000	2,342.00	2,342,000
いなげや	13,200	1,834.00	24,208,800
島忠	30,600	2,934.00	89,780,400
チヨダ	13,900	2,968.00	41,255,200
ライフコーポレーション	8,900	2,932.00	26,094,800
リンガーハット	13,100	2,457.00	32,186,700
さが美	11,000	121.00	1,331,000
MrMaxHD	15,100	586.00	8,848,600
テンアライド	12,500	422.00	5,275,000
AOKIホールディングス	23,500	1,493.00	35,085,500
オークワ	17,000	1,125.00	19,125,000
コメリ	18,200	3,345.00	60,879,000
青山商事	24,700	4,060.00	100,282,000
しまむら	13,800	12,790.00	176,502,000
はせがわ	4,800	501.00	2,404,800
高島屋	199,000	1,037.00	206,363,000
松屋	26,100	1,027.00	26,804,700
エイチ・ツー・オーリテイリング	60,700	2,062.00	125,163,400
近鉄百貨店	4,500	3,635.00	16,357,500
パルコ	11,300	1,497.00	16,916,100
丸井グループ	124,900	1,691.00	211,205,900

クレディセゾン	90,300	2,365.00	213,559,500
アクシアル リテイリング	9,100	4,450.00	40,495,000
井筒屋	7,000	494.00	3,458,000
イオン	488,000	1,712.50	835,700,000
イズミ	21,400	5,850.00	125,190,000
東武ストア	1,500	3,095.00	4,642,500
フォーバル	5,400	738.00	3,985,200
平和堂	24,000	2,410.00	57,840,000
フジ	13,200	3,050.00	40,260,000
ヤオコー	13,500	5,340.00	72,090,000
ゼビオホールディングス	16,000	2,181.00	34,896,000
ケーズホールディングス	50,100	2,536.00	127,053,600
PALTAC	19,000	4,575.00	86,925,000
三谷産業	12,900	414.00	5,340,600
Olympicグループ	7,300	593.00	4,328,900
日産東京販売ホールディングス	17,700	414.00	7,327,800
新生銀行	113,200	1,824.00	206,476,800
あおぞら銀行	75,100	4,285.00	321,803,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,903,200	720.90	6,418,316,880
りそなホールディングス	1,388,800	566.10	786,199,680
三井住友トラスト・ホールディングス	247,700	4,126.00	1,022,010,200
三井住友フィナンシャルグループ	950,200	4,307.00	4,092,511,400
第四銀行	14,500	5,310.00	76,995,000
北越銀行	12,900	2,568.00	33,127,200
千葉銀行	458,000	813.00	372,354,000
群馬銀行	258,000	698.00	180,084,000
武蔵野銀行	18,900	3,420.00	64,638,000
千葉興業銀行	33,400	602.00	20,106,800
筑波銀行	50,600	378.00	19,126,800
七十七銀行	37,300	2,783.00	103,805,900
青森銀行	9,200	3,740.00	34,408,000
秋田銀行	7,600	3,375.00	25,650,000
山形銀行	13,300	2,580.00	34,314,000
岩手銀行	7,700	4,530.00	34,881,000
東邦銀行	106,000	422.00	44,732,000
東北銀行	6,500	1,485.00	9,652,500
みちのく銀行	6,300	1,925.00	12,127,500
ふくおかフィナンシャルグループ	482,000	531.00	255,942,000
静岡銀行	313,000	1,033.00	323,329,000
十六銀行	15,900	3,700.00	58,830,000
スルガ銀行	121,500	2,507.00	304,600,500
八十二銀行	228,900	697.00	159,543,300
山梨中央銀行	74,000	474.00	35,076,000
大垣共立銀行	16,500	3,125.00	51,562,500
福井銀行	10,200	2,880.00	29,376,000
北國銀行	12,600	4,905.00	61,803,000
清水銀行	4,100	3,600.00	14,760,000
富山銀行	2,400	4,170.00	10,008,000
滋賀銀行	112,000	618.00	69,216,000
南都銀行	12,000	3,125.00	37,500,000

百五銀行	106,800	498.00	53,186,400
京都銀行	42,500	5,860.00	249,050,000
紀陽銀行	44,600	1,864.00	83,134,400
三重銀行	5,400	2,640.00	14,256,000
ほくほくフィナンシャルグループ	78,900	1,794.00	141,546,600
広島銀行	175,300	893.00	156,542,900
山陰合同銀行	70,300	976.00	68,612,800
中国銀行	82,100	1,559.00	127,993,900
鳥取銀行	4,000	1,754.00	7,016,000
伊予銀行	169,300	912.00	154,401,600
百十四銀行	125,000	390.00	48,750,000
四国銀行	18,200	1,678.00	30,539,600
阿波銀行	101,000	716.00	72,316,000
大分銀行	6,800	4,525.00	30,770,000
宮崎銀行	7,900	3,815.00	30,138,500
佐賀銀行	7,200	2,676.00	19,267,200
十八銀行	74,000	282.00	20,868,000
沖縄銀行	11,500	4,455.00	51,232,500
琉球銀行	24,600	1,683.00	41,401,800
セブン銀行	445,400	405.00	180,387,000
みずほフィナンシャルグループ	16,112,300	197.50	3,182,179,250
高知銀行	4,700	1,291.00	6,067,700
山口フィナンシャルグループ	111,000	1,315.00	145,965,000
アクリーティブ	10,500	399.00	4,189,500
芙蓉総合リース	13,600	7,490.00	101,864,000
興銀リース	22,200	3,065.00	68,043,000
東京センチュリー	23,800	5,080.00	120,904,000
SBIホールディングス	134,100	1,738.00	233,065,800
日本証券金融	52,000	613.00	31,876,000
アイフル	200,300	396.00	79,318,800
日本アジア投資	11,900	406.00	4,831,400
ポケットカード	9,200	1,070.00	9,844,000
長野銀行	4,100	1,980.00	8,118,000
名古屋銀行	9,500	4,285.00	40,707,500
北洋銀行	194,000	344.00	66,736,000
愛知銀行	4,000	6,790.00	27,160,000
第三銀行	7,000	1,857.00	12,999,000
中京銀行	4,800	2,362.00	11,337,600
大光銀行	4,100	2,430.00	9,963,000
愛媛銀行	14,700	1,406.00	20,668,200
トマト銀行	4,900	1,560.00	7,644,000
みなと銀行	10,800	2,088.00	22,550,400
京葉銀行	96,000	530.00	50,880,000
関西アーバン銀行	16,600	1,414.00	23,472,400
栃木銀行	65,700	491.00	32,258,700
北日本銀行	3,800	3,225.00	12,255,000
東和銀行	22,500	1,150.00	25,875,000
福島銀行	13,600	904.00	12,294,400
大東銀行	6,400	1,684.00	10,777,600
リコーリース	9,300	4,355.00	40,501,500

イオンフィナンシャルサービス	75,800	2,436.00	184,648,800
アコム	239,300	473.00	113,188,900
ジャックス	13,200	2,892.00	38,174,400
オリエントコーポレーション	256,000	186.00	47,616,000
日立キャピタル	27,900	2,792.00	77,896,800
アプラスフィナンシャル	60,100	111.00	6,671,100
オリックス	840,200	1,867.00	1,568,653,400
三菱UFJリース	300,600	610.00	183,366,000
ジャフコ	19,900	5,490.00	109,251,000
トモニホールディングス	97,800	513.00	50,171,400
大和証券グループ本社	1,078,000	646.00	696,388,000
野村ホールディングス	2,425,800	643.60	1,561,244,880
岡三証券グループ	100,000	656.00	65,600,000
丸三証券	37,800	974.00	36,817,200
東洋証券	44,000	272.00	11,968,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	135,500	689.00	93,359,500
光世証券	3,000	1,709.00	5,127,000
水戸証券	37,900	353.00	13,378,700
いちよし証券	26,800	1,112.00	29,801,600
松井証券	67,400	881.00	59,379,400
SOMPOホールディングス	248,100	4,270.00	1,059,387,000
だいこう証券ビジネス	6,100	719.00	4,385,900
日本取引所グループ	369,000	2,063.00	761,247,000
マネックスグループ	126,600	307.00	38,866,200
カブドットコム証券	88,800	344.00	30,547,200
極東証券	15,900	1,543.00	24,533,700
岩井コスモホールディングス	11,400	1,343.00	15,310,200
藍澤證券	22,300	810.00	18,063,000
フィデアホールディングス	117,600	202.00	23,755,200
池田泉州ホールディングス	126,200	432.00	54,518,400
アニコムホールディングス	8,100	2,828.00	22,906,800
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	332,100	3,586.00	1,190,910,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	113,700	1,807.00	205,455,900
マネーパートナーズグループ	15,600	471.00	7,347,600
小林洋行	4,300	291.00	1,251,300
第一生命ホールディングス	715,700	2,045.00	1,463,606,500
東京海上ホールディングス	477,900	4,468.00	2,135,257,200
イー・ギャランティ	3,700	3,105.00	11,488,500
アサックス	2,300	1,765.00	4,059,500
NECキャピタルソリューション	4,800	2,341.00	11,236,800
T&Dホールディングス	415,000	1,642.00	681,430,000
アドバンスクリエイト	3,000	1,899.00	5,697,000
三井不動産	629,400	2,549.50	1,604,655,300
三菱地所	883,000	2,009.00	1,773,947,000
平和不動産	22,600	2,005.00	45,313,000
東京建物	129,700	1,489.00	193,123,300
ダイビル	30,600	1,295.00	39,627,000

京阪神ビルディング	19,800	771.00	15,265,800
住友不動産	285,000	3,562.00	1,015,170,000
太平洋興発	5,300	1,009.00	5,347,700
大京	22,000	2,256.00	49,632,000
テーオーシー	46,000	1,001.00	46,046,000
東京楽天地	2,000	5,760.00	11,520,000
レオパレス21	147,500	831.00	122,572,500
スターツコーポレーション	16,100	2,915.00	46,931,500
フジ住宅	15,600	878.00	13,696,800
空港施設	14,300	629.00	8,994,700
明和地所	6,800	923.00	6,276,400
ゴールドクレスト	10,800	2,714.00	29,311,200
リログループ	63,000	2,677.00	168,651,000
日本エスリード	4,800	2,129.00	10,219,200
日神不動産	14,300	773.00	11,053,900
日本エスコン	16,700	504.00	8,416,800
タカラレーベン	51,400	549.00	28,218,600
サンヨーハウジング名古屋	6,400	1,164.00	7,449,600
イオンモール	76,500	2,002.00	153,153,000
ファースト住建	4,500	1,846.00	8,307,000
ランド	64,400	18.00	1,159,200
東祥	7,300	2,846.00	20,775,800
トーセイ	15,100	1,092.00	16,489,200
穴吹興産	1,400	3,020.00	4,228,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	74,000	1,178.00	87,172,000
サンフロンティア不動産	13,000	1,321.00	17,173,000
エフ・ジェー・ネクスト	10,700	984.00	10,528,800
インテリックス	3,800	986.00	3,746,800
ランドビジネス	8,000	307.00	2,456,000
グランディハウス	11,100	456.00	5,061,600
東武鉄道	128,500	3,155.00	405,417,500
相鉄ホールディングス	38,400	2,784.00	106,905,600
東京急行電鉄	326,500	1,670.00	545,255,000
京浜急行電鉄	164,800	2,347.00	386,785,600
小田急電鉄	192,600	2,166.00	417,171,600
京王電鉄	67,200	4,715.00	316,848,000
京成電鉄	90,200	3,195.00	288,189,000
富士急行	16,500	2,502.00	41,283,000
新京成電鉄	3,000	2,123.00	6,369,000
東日本旅客鉄道	230,300	10,485.00	2,414,695,500
西日本旅客鉄道	115,700	7,831.00	906,046,700
東海旅客鉄道	100,000	20,090.00	2,009,000,000
西武ホールディングス	166,100	1,952.00	324,227,200
鴻池運輸	17,000	1,676.00	28,492,000
西日本鉄道	28,800	2,761.00	79,516,800
ハマキョウレックス	7,900	3,385.00	26,741,500
サカイ引越センター	5,600	6,520.00	36,512,000
近鉄グループホールディングス	121,100	4,245.00	514,069,500
阪急阪神ホールディングス	151,900	4,260.00	647,094,000
南海電気鉄道	50,900	2,852.00	145,166,800

京阪ホールディングス	53,800	3,395.00	182,651,000
神戸電鉄	3,100	3,915.00	12,136,500
名古屋鉄道	87,500	2,468.00	215,950,000
山陽電気鉄道	8,800	2,790.00	24,552,000
トランコム	3,500	6,150.00	21,525,000
日本通運	44,700	7,240.00	323,628,000
ヤマトホールディングス	215,100	2,235.50	480,856,050
山九	31,700	4,575.00	145,027,500
日新	9,900	2,912.00	28,828,800
丸運	6,400	321.00	2,054,400
丸全昭和運輸	40,000	525.00	21,000,000
センコーグループホールディングス	56,400	814.00	45,909,600
トナミホールディングス	2,500	5,450.00	13,625,000
ニッコンホールディングス	40,600	2,791.00	113,314,600
日本石油輸送	1,400	3,465.00	4,851,000
福山通運	14,500	3,600.00	52,200,000
セイノーホールディングス	85,000	1,628.00	138,380,000
神奈川中央交通	2,800	3,665.00	10,262,000
日立物流	25,100	2,855.00	71,660,500
丸和運輸機関	6,100	2,403.00	14,658,300
C & F ロジホールディングス	12,500	1,470.00	18,375,000
日本郵船	101,700	2,339.00	237,876,300
商船三井	63,000	3,360.00	211,680,000
川崎汽船	45,600	3,000.00	136,800,000
NSユナイテッド海運	5,400	2,370.00	12,798,000
明治海運	11,400	442.00	5,038,800
飯野海運	62,300	526.00	32,769,800
共栄タンカー	1,100	2,168.00	2,384,800
九州旅客鉄道	119,500	3,400.00	406,300,000
日本航空	211,200	3,808.00	804,249,600
ANAホールディングス	223,200	4,272.00	953,510,400
パスコ	12,000	354.00	4,248,000
三菱倉庫	39,400	2,883.00	113,590,200
三井倉庫ホールディングス	71,000	346.00	24,566,000
住友倉庫	81,000	779.00	63,099,000
澁澤倉庫	6,200	2,014.00	12,486,800
ヤマタネ	6,200	1,908.00	11,829,600
東陽倉庫	22,200	320.00	7,104,000
乾汽船	9,200	813.00	7,479,600
日本トランスシティ	28,000	477.00	13,356,000
ケイヒン	2,300	1,670.00	3,841,000
中央倉庫	7,300	1,195.00	8,723,500
川西倉庫	2,300	2,359.00	5,425,700
安田倉庫	8,800	895.00	7,876,000
東洋埠頭	3,700	1,916.00	7,089,200
宇徳	9,800	508.00	4,978,400
上組	71,700	2,542.00	182,261,400
サンリツ	1,700	786.00	1,336,200
キムラユニティー	3,200	1,198.00	3,833,600
キューソー流通システム	3,400	3,135.00	10,659,000

郵船ロジスティクス	11,200	1,062.00	11,894,400
近鉄エクスプレス	21,600	1,867.00	40,327,200
東海運	7,100	414.00	2,939,400
エーアイティー	7,700	1,251.00	9,632,700
内外トランスライン	3,800	1,701.00	6,463,800
東京放送ホールディングス	78,300	2,177.00	170,459,100
日本テレビホールディングス	108,500	1,998.00	216,783,000
朝日放送	11,600	895.00	10,382,000
テレビ朝日ホールディングス	32,500	2,266.00	73,645,000
スカパーJ S A Tホールディングス	77,500	510.00	39,525,000
テレビ東京ホールディングス	9,800	2,325.00	22,785,000
日本BS放送	2,800	1,235.00	3,458,000
ビジョン	2,800	2,567.00	7,187,600
U - N E X T	3,300	1,031.00	3,402,300
ワイヤレスゲート	4,100	1,308.00	5,362,800
コネクシオ	8,500	1,999.00	16,991,500
日本通信	102,900	139.00	14,303,100
クロップス	1,400	1,409.00	1,972,600
日本電信電話	952,600	5,220.00	4,972,572,000
K D D I	1,159,100	2,960.50	3,431,515,550
光通信	14,300	13,780.00	197,054,000
N T T ドコモ	873,400	2,601.50	2,272,150,100
エムティーアイ	16,300	664.00	10,823,200
G M O インターネット	43,600	1,465.00	63,874,000
カドカワ	34,600	1,336.00	46,225,600
学研ホールディングス	4,100	3,250.00	13,325,000
ゼンリン	15,800	3,380.00	53,404,000
昭文社	6,900	726.00	5,009,400
インプレスホールディングス	11,100	158.00	1,753,800
東京電力ホールディングス	1,020,100	466.00	475,366,600
中部電力	396,100	1,408.50	557,906,850
関西電力	490,700	1,535.00	753,224,500
中国電力	165,600	1,226.00	203,025,600
北陸電力	118,000	964.00	113,752,000
東北電力	300,300	1,489.00	447,146,700
四国電力	108,400	1,370.00	148,508,000
九州電力	265,500	1,249.00	331,609,500
北海道電力	112,700	831.00	93,653,700
沖縄電力	19,500	2,528.00	49,296,000
電源開発	95,600	2,884.00	275,710,400
エフオン	5,300	1,562.00	8,278,600
イーレックス	15,300	1,104.00	16,891,200
東京瓦斯	256,500	2,876.50	737,822,250
大阪瓦斯	233,200	2,180.00	508,376,000
東邦瓦斯	60,000	3,315.00	198,900,000
北海道瓦斯	31,000	285.00	8,835,000
広島ガス	25,300	357.00	9,032,100
西部瓦斯	13,600	2,852.00	38,787,200
静岡ガス	34,000	900.00	30,600,000
メタウォーター	6,800	3,085.00	20,978,000

アイネット	7,000	1,539.00	10,773,000
松竹	7,800	16,240.00	126,672,000
東宝	77,700	3,980.00	309,246,000
エイチ・アイ・エス	18,000	3,620.00	65,160,000
東映	4,400	12,770.00	56,188,000
ラックランド	2,200	2,127.00	4,679,400
エヌ・ティ・ティ・データ	366,700	1,226.00	449,574,200
共立メンテナンス	20,500	3,340.00	68,470,000
イチネンホールディングス	13,000	1,544.00	20,072,000
建設技術研究所	8,400	1,031.00	8,660,400
スペース	6,700	1,705.00	11,423,500
アインホールディングス	16,900	7,430.00	125,567,000
燦ホールディングス	2,600	2,851.00	7,412,600
ピー・シー・エー	1,800	1,670.00	3,006,000
スバル興業	1,000	7,330.00	7,330,000
東京テアトル	5,200	1,475.00	7,670,000
タナベ経営	2,700	1,395.00	3,766,500
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	1,429.00	2,429,300
ナガワ	2,300	4,405.00	10,131,500
よみうりランド	2,500	4,755.00	11,887,500
東京都競馬	8,700	3,490.00	30,363,000
常盤興産	4,900	1,861.00	9,118,900
カナモト	17,600	3,535.00	62,216,000
東京ドーム	50,400	1,046.00	52,718,400
D T S	12,400	3,080.00	38,192,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	45,700	4,345.00	198,566,500
シーイーシー	7,100	2,537.00	18,012,700
カプコン	27,900	2,886.00	80,519,400
西尾レントオール	10,100	3,860.00	38,986,000
アイ・エス・ビー	2,300	1,391.00	3,199,300
アゴラ・ホスピタリティ・グループ	72,000	36.00	2,592,000
日本空港ビルデング	37,900	4,120.00	156,148,000
トランス・コスモス	14,700	2,574.00	37,837,800
乃村工藝社	27,000	2,321.00	62,667,000
ジャステック	7,100	1,343.00	9,535,300
S C S K	32,300	4,855.00	156,816,500
藤田観光	4,200	3,525.00	14,805,000
K N T - C Tホールディングス	7,200	2,002.00	14,414,400
日本管財	10,900	2,052.00	22,366,800
トーカイ	5,600	5,050.00	28,280,000
白洋舎	500	3,385.00	1,692,500
セコム	130,700	8,525.00	1,114,217,500
日本システムウエア	4,100	2,189.00	8,974,900
セントラル警備保障	5,700	2,044.00	11,650,800
アイネス	15,300	1,086.00	16,615,800
丹青社	21,900	1,353.00	29,630,700
メイテック	14,600	5,490.00	80,154,000
T K C	11,000	3,460.00	38,060,000

アサツー ディ・ケイ	21,900	3,800.00	83,220,000
富士ソフト	16,300	3,265.00	53,219,500
応用地質	12,200	1,727.00	21,069,400
船井総研ホールディングス	16,000	3,890.00	62,240,000
N S D	24,700	2,036.00	50,289,200
進学会ホールディングス	5,500	657.00	3,613,500
丸紅建材リース	12,000	239.00	2,868,000
オオバ	9,700	520.00	5,044,000
コナミホールディングス	53,600	5,320.00	285,152,000
学究社	3,500	1,554.00	5,439,000
ベネッセホールディングス	42,100	3,990.00	167,979,000
イオンディライト	14,200	4,225.00	59,995,000
ナック	8,000	984.00	7,872,000
福井コンピュータホールディングス	3,500	2,888.00	10,108,000
ニチイ学館	22,000	1,138.00	25,036,000
ダイセキ	22,000	2,757.00	60,654,000
ステップ	4,400	1,516.00	6,670,400
日鉄住金物産	10,300	5,850.00	60,255,000
元気寿司	3,100	2,727.00	8,453,700
トラスコ中山	24,700	2,739.00	67,653,300
ヤマダ電機	407,300	607.00	247,231,100
オートバックスセブン	43,700	1,919.00	83,860,300
モリト	9,500	1,089.00	10,345,500
アークランドサカモト	20,200	1,727.00	34,885,400
ニトリホールディングス	51,300	16,140.00	827,982,000
グルメ杵屋	9,000	1,139.00	10,251,000
愛眼	9,700	278.00	2,696,600
ケーユーホールディングス	6,200	950.00	5,890,000
吉野家ホールディングス	41,400	1,872.00	77,500,800
加藤産業	18,600	3,440.00	63,984,000
イノテック	10,500	928.00	9,744,000
イエローハット	11,200	3,230.00	36,176,000
松屋フーズ	5,700	4,255.00	24,253,500
J B C Cホールディングス	10,400	1,072.00	11,148,800
J Kホールディングス	11,900	891.00	10,602,900
サガミチェーン	15,200	1,361.00	20,687,200
日伝	9,800	2,373.00	23,255,400
関西スーパーマーケット	9,700	1,414.00	13,715,800
ミロク情報サービス	11,800	2,575.00	30,385,000
北沢産業	11,000	229.00	2,519,000
杉本商事	6,800	1,685.00	11,458,000
因幡電機産業	16,500	4,720.00	77,880,000
王将フードサービス	8,600	4,485.00	38,571,000
ブレナス	13,200	2,326.00	30,703,200
ミニストップ	8,800	2,280.00	20,064,000
アークス	22,100	2,545.00	56,244,500
パローホールディングス	25,500	2,518.00	64,209,000
バイテックホールディングス	4,900	1,824.00	8,937,600
ミスミグループ本社	136,900	2,861.00	391,670,900
アルテック	10,800	305.00	3,294,000

ベルク	5,300	6,050.00	32,065,000	
大 庄	6,600	1,736.00	11,457,600	
タキヒヨー	3,600	2,334.00	8,402,400	
ファーストリテイリング	19,800	34,850.00	690,030,000	
ソフトバンクグループ	534,300	9,840.00	5,257,512,000	
蔵王産業	2,000	1,623.00	3,246,000	
スズケン	54,000	3,950.00	213,300,000	
サンドラッグ	45,200	4,835.00	218,542,000	
サクスパー ホールディングス	11,300	1,352.00	15,277,600	
ジェコス	8,200	1,201.00	9,848,200	
ヤマザワ	2,400	1,735.00	4,164,000	
やまや	2,500	1,693.00	4,232,500	
ルネサスイーストン	10,900	684.00	7,455,600	
ペルーナ	25,600	1,209.00	30,950,400	
合計	148,175,700		297,566,000,230	

*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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成29年10月31日現在

資産総額	5,676,918,058円
負債総額	3,022,605円
純資産総額(-)	5,673,895,453円
発行済数量	2,243,653,624口
1口当たり純資産額(/)	2.5289円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成29年10月31日現在

資産総額	317,760,984,194円
負債総額	6,738,686,192円
純資産総額(-)	311,022,298,002円
発行済数量	116,769,352,239口
1口当たり純資産額(/)	2.6636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（平成29年10月31日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（平成29年10月31日現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成29年10月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	1,223,417,202,703
追加型株式投資信託	852	12,174,841,867,596
単位型公社債投資信託	56	293,054,001,411
単位型株式投資信託	131	894,157,810,122
合計	1,077	14,585,470,881,832

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第32期事業年度（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,951,736	27,972,477
金銭の信託	13,094,914	12,366,219
有価証券	-	297,560
未収委託者報酬	4,460,404	10,164,041
未収運用受託報酬	1,859,778	7,250,239
未収投資助言報酬	277,603	316,414
未収収益	205,097	52,278
前払費用	44,951	533,411
繰延税金資産	341,078	678,104
その他	40,689	445,717
流動資産計	33,276,255	60,076,462
固定資産		
有形固定資産	658,607	1,900,343
建物	1 29,219	1 1,243,812
車両運搬具	1 549	1 -
器具備品	1 184,683	1 656,235
建設仮勘定	444,155	295
無形固定資産	1,706,201	1,614,084
商標権	7	5
ソフトウェア	1,645,861	1,511,558
ソフトウェア仮勘定	53,036	98,483
電話加入権	7,148	3,934
電信電話専用施設利用権	146	103
投資その他の資産	6,497,772	10,055,336
投資有価証券	458,701	3,265,786
関係会社株式	3,229,196	3,306,296
長期差入保証金	2,040,945	1,800,827
前払年金費用	-	686,322
繰延税金資産	679,092	893,887
その他	89,835	102,215
固定資産計	8,862,580	13,569,764
資産合計	42,138,836	73,646,227

（単位：千円）

	第31期 （平成28年3月31日現在）	第32期 （平成29年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	966,681	1,169,128
未払金	2,055,332	4,745,195
未払収益分配金	-	1,027
未払償還金	49,873	57,332
未払手数料	1,744,274	4,062,695
その他未払金	261,185	624,140
未払費用	3,076,566	7,030,589
未払法人税等	1,223,957	1,915,556
未払消費税等	352,820	891,476
賞与引当金	728,769	1,432,264
役員賞与引当金	-	27,495
流動負債計	8,404,128	17,211,706
固定負債		
退職給付引当金	997,396	1,305,273
役員退職慰労引当金	154,535	-
時効後支払損引当金	-	216,466
本社移転費用引当金	-	942,315
固定負債計	1,151,932	2,464,055
負債合計	9,556,060	19,675,761
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	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
利益剰余金	28,000,340	31,899,643
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	27,877,047	31,776,350
別途積立金	22,030,000	24,580,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	5,347,047	6,696,350
株主資本計	32,428,818	53,452,601
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	153,956	517,864
評価・換算差額等計	153,956	517,864
純資産合計	32,582,775	53,970,465
負債・純資産合計	42,138,836	73,646,227

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	30,188,445		56,355,754	
運用受託報酬	7,595,678		12,834,241	
投資助言報酬	993,027		1,002,482	
その他営業収益	724,211		378,715	
営業収益計		39,501,363		70,571,194
営業費用				
支払手数料	12,946,176		24,957,038	
広告宣伝費	468,931		838,356	
公告費	258		991	
調査費	7,616,390		15,105,578	
調査費	4,969,812		7,780,474	
委託調査費	2,646,578		7,325,104	
委託計算費	412,257		891,379	
営業雑経費	548,183		1,102,921	
通信費	34,855		51,523	
印刷費	436,756		926,453	
協会費	23,698		37,471	
諸会費	40		74	
支払販売手数料	52,833		87,399	
営業費用計		21,992,198		42,896,265
一般管理費				
給料	5,382,757		8,517,089	
役員報酬	242,446		220,145	
給料・手当	4,431,015		7,485,027	
賞与	709,295		811,916	
交際費	43,975		66,813	
寄付金	2,628		13,467	
旅費交通費	254,276		297,237	
租税公課	180,892		430,779	
不動産賃借料	1,128,367		1,961,686	
退職給付費用	226,460		358,960	
固定資産減価償却費	902,248		825,593	
福利厚生費	36,173		39,792	
修繕費	31,617		27,435	
賞与引当金繰入額	728,769		1,432,264	
役員賞与引当金繰入額	-		27,495	
役員退職慰労引当金繰入額	49,320		-	
役員退職慰労金	5,250		63,072	
機器リース料	140		210	
事務委託費	251,913		1,530,113	
事務用消耗品費	70,839		127,265	
器具備品費	14,182		271,658	
諸経費	214,532		129,981	
一般管理費計		9,524,346		16,120,918
営業利益		7,984,819		11,554,010

(単位:千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		2,079		537
受取配当金		25,274		51,036
時効成立分配金・償還金		-		103
為替差益		3,996		7,025
投資信託解約益		-		2
雑収入	1	6,693	1	18,213
営業外収益計		38,044		76,918
営業外費用				
投資信託解約損		-		31,945
投資信託償還損		-		47,201
金銭の信託運用損		305,368		552,635
時効成立後支払分配金・償還金		-		39
時効後支払損引当金繰入額		-		209,210
営業外費用計		305,368		841,031
経常利益		7,717,494		10,789,897
特別利益				
固定資産売却益	2	-	2	2,348
投資有価証券売却益		3,377		-
貸倒引当金戻入益		-		8,883
訴訟損失引当金戻入益		-		21,677
その他特別利益		-		746
特別利益計		3,377		33,655
特別損失				
固定資産除却損	3	624	3	23,600
固定資産売却損	4	2,653	4	10,323
投資有価証券評価損		-		12,085
ゴルフ会員権評価損		6,307		4,832
訴訟和解金		-		30,000
本社移転費用	5	-	5	1,511,622
特別損失計		9,584		1,592,463
税引前当期純利益		7,711,286		9,231,089
法人税、住民税及び事業税		2,557,305		2,965,061
法人税等調整額		27,424		177,275
法人税等合計		2,584,730		2,787,786
当期純利益		5,126,556		6,443,302

（３）【株主資本等変動計算書】

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
					別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	2,428,478	-	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491
当期変動額									
剰余金の配当									2,544,000
別途積立金の 積立						2,550,000			2,550,000
当期純利益									5,126,556
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,550,000	-	-	32,556
当期末残高	2,000,000	2,428,478	-	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047

	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	25,417,784	29,846,262	252,905	252,905	30,099,168
当期変動額					
剰余金の配当	2,544,000	2,544,000			2,544,000
別途積立金の 積立	-	-			-
当期純利益	5,126,556	5,126,556			5,126,556
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)			98,949	98,949	98,949
当期変動額合計	2,582,556	2,582,556	98,949	98,949	2,483,607
当期末残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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 定率法によっております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、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、退職一時金制度及び確定給付型企业年金制度（キャッシュバランス型）について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当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。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 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。 なお、一部の確定給付企業年金制度については、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p> <p>(5) 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>(6) 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。 なお、本社移転費用引当金繰入額は、本社移転費用に含めて表示しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

会計方針の変更

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ42,532千円増加しております。

追加情報

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

1. 「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当事業年度から適用しております。

2. 当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当事業年度末日までに217,608千円を支給し、役員退職慰労引当金全額を取り崩しております。

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31期 （平成28年3月31日現在）	第32期 （平成29年3月31日現在）
建物	767,802	53,098
車両運搬具	4,374	-
器具備品	562,853	734,064

（損益計算書関係）

1. 関係会社項目

各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

（千円）

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
雑収入	4,715	8,183

2. 固定資産売却益の内訳

（千円）

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
建物	-	546
車両運搬具	-	696
器具備品	-	1,104

3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
器具備品	182	4,727
ソフトウェア	442	2,821
電話加入権	-	16,052

4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
建物	-	543
器具備品	2,653	9,779

5. 本社移転費用の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
本社移転費用引当金繰入額	-	942,315
旧本社不動産賃借料	-	418,583
賃貸借契約解約損	-	150,723

(株主資本等変動計算書関係)

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総 額(千円)	1株当たり配当 額(円)	基準日	効力発生日
平成27年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
平成28年6月29日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度 増加株式数（株）	当事業年度 減少株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
普通株式	24,000	490	-	24,490
A種種類株式	-	15,510	-	15,510
合計	24,000	16,000	-	40,000

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
平成29年6月21日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

(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、主に其他有価証券（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おります。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第31期（平成28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	12,951,736	12,951,736	-
(2) 金銭の信託	13,094,914	13,094,914	-
(3) 未収委託者報酬	4,460,404	4,460,404	-
(4) 未収運用受託報酬	1,859,778	1,859,778	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	381,005	381,005	-
資産計	32,747,840	32,747,840	-
(1) 未払手数料	1,744,274	1,744,274	-
負債計	1,744,274	1,744,274	-

第32期（平成29年3月31日現在）

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

(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31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
非上場株式	77,696	337,468
関係会社株式	3,229,196	3,306,296

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31期(平成28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	12,951,736	-	-	-
(2) 金銭の信託	13,094,914	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	4,460,404	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	1,859,778	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	-	-	-	-

第32期(平成29年3月31日現在)

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

(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31期の貸借対照表計上額3,229,196千円、第32期の貸借対照表計上額3,306,296千円)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31期(平成28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	365,683	146,101	219,581
投資信託	15,322	13,000	2,322
小計	381,005	159,101	221,903
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	-	-	-
小計	-	-	-
合計	381,005	159,101	221,903

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額77,696千円)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32期(平成29年3月31日現在)

(千円)

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

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第31期(自平成27年4月1日 至平成28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	5,927	3,377	-

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

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

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

なお、当社が有する確定給付企業年金制度の一部は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 確定給付制度(複数事業主制度を含む)

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期	第32期
	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	973,035	1,086,550
勤務費用	134,944	189,127
利息費用	8,660	10,905
数理計算上の差異の発生額	21,441	89,303
退職給付の支払額	51,531	144,062
過去勤務費用の発生額	-	-
合併による増加	-	1,486,547
退職給付債務の期末残高	1,086,550	2,718,372

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期	第32期
	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
年金資産の期首残高	-	-
期待運用収益	-	16,033
数理計算上の差異の発生額	-	1,894
事業主からの拠出額	-	37,402
退職給付の支払額	-	28,876
合併による増加	-	1,336,984
年金資産の期末残高	-	1,363,437

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

(千円)

	第31期	第32期
	(平成28年3月31日現在)	(平成29年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	-	1,275,346
年金資産	-	1,363,437
	-	88,090
非積立型制度の退職給付債務	1,086,550	1,443,026
未積立退職給付債務	1,086,550	1,354,935
未認識数理計算上の差異	79,449	430,203
未認識過去勤務費用	9,704	4,852
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	997,396	919,879
退職給付引当金	997,396	1,245,019
前払年金費用	-	325,140
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	997,396	919,879

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
勤務費用	134,944	189,127
利息費用	8,660	10,905
期待運用収益	-	16,033
数理計算上の差異の費用処理額	31,542	78,229
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
その他	2,268	7,498
確定給付制度に係る退職給付費用	182,267	274,580

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

(千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
株式	-	31.5%
債券	-	29.0%
共同運用資産	-	24.1%
生命保険一般勘定	-	10.5%
現金及び預金	-	4.6%
合計	-	100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
割引率	0.89%	0.02% ~ 1.09%
長期期待運用収益率	-	2.50%
予想昇給率	1.00% ~ 8.73%	1.00% ~ 8.73%

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31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	-	-
退職給付費用	-	22,562
退職給付の支払額	-	-
制度への拠出額	-	36,177
合併による増加	-	287,313
退職給付引当金の期末残高	-	300,927

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

	(千円)	
	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	-	789,261
年金資産	-	1,150,443
	-	361,181
非積立型制度の退職給付債務	-	60,254
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	-	300,927
退職給付引当金	-	60,254
前払年金費用	-	361,181
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	-	300,927

(3) 退職給付費用

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

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44,193千円、当事業年度61,817千円であります。

(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31期	第32期
	(平成28年3月31日現在)	(平成29年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	79,702	124,081
未払事業所税	5,581	11,054
賞与引当金	224,898	441,996
未払法定福利費	28,395	80,909
資産除去債務	13,244	86,421
減価償却超過額(一括償却資産)	3,389	10,666
減価償却超過額	136,503	116,920
繰延資産償却超過額(税法上)	1,339	32,949
退職給付引当金	305,591	399,808
役員退職慰労引当金	47,318	-
時効後支払損引当金	-	66,282
ゴルフ会員権評価損	3,768	14,295
関係会社株式評価損	166,740	191,166
未払給与	-	12,344
本社移転費用引当金	-	289,865
その他有価証券評価差額金	1,196	-
その他	2,500	17,552
繰延税金資産小計	1,020,171	1,896,316
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,020,171	1,896,316
繰延税金負債		
前払年金費用	-	210,151
その他有価証券評価差額金	-	114,171
繰延税金負債合計	-	324,323
繰延税金資産の純額	1,020,171	1,571,992

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

（企業結合等関係）

当社（以下「AMOne」という）は、平成28年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社（以下「DIAM」という）、みずほ投信投資顧問株式会社（以下「MHAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及び新光投信株式会社（以下「新光投信」という）（以下総称して「統合4社」という）間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成28年10月1日から平成29年3月31日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451,657千円

うち現金・預金 11,605,537千円

うち金銭の信託 11,792,364千円

b. 負債の額 負債合計 9,256,209千円

うち未払手数料及び未払費用 4,539,592千円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030,000千円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030,000千円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	123,277,747千円
資産合計	123,277,747千円
流動負債	- 千円
固定負債	14,647,470千円
負債合計	14,647,470千円
純資産	108,630,277千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん金額74,319,216千円及び顧客関連資産の金額50,434,199千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,483,082千円
経常利益	4,483,082千円
税引前当期純利益	4,483,082千円
当期純利益	3,693,863千円
1株当たり当期純利益	115,512円36銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,595,800千円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)及び第32期(自平成28年4月1日 至平成29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31期(自平成27年4月1日 至平成28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				
その他の関係会社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	3,431億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	795,405	未収投資助言報酬	207,235

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

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

(2) 子会社及び関連会社等

第31期(自平成27年4月1日 至平成28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				
子会社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	9,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払 増資の引受	800,617	未払費用	308,974
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000千USD	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	912,600	-	-
									473,948	未払費用	157,130

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 当社預り資産の運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額及び期末残高には免税取引のため、消費税等は含まれておりません。

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3) 兄弟会社等

第31期(自平成27年4月1日 至平成28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				
その他の 関係会社 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	-	兼務 1名	当社設定投 資信託の販 売	投資信託の 販売代行手 数料	3,023,040	未払手 数料	372,837
	みずほ第 一ファイ ナンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言 金融技術の 開発業務委 託	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	557,013 8,540	未払費 用 未払金	292,861 7,581
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 払戻(純 額) 信託報酬の 支払	700,000 8,336	金銭の 信託	13,094,914

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投 資信託の販 売	投資信託の 販売代行手 数料	4,530,351	未払 手数料	767,732
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 払戻(純 額) 信託報酬の 支払	100,000 7,080	金銭の 信託	12,366,219
	みずほ証 券株式 会社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定投 資信託の販 売	投資信託の 販売代行手 数料	5,061,766	未払 手数料	1,166,212
	みずほ信 託銀行株 式会社	東京都 中央区	2,473 億円	信託銀 行業	-	-	投資一任契 約の締結	運用受託報 酬の受取	2,520,431	未収運 用受託 報酬	2,722,066

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) 当社預り資産の助言の顧問料は、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3) 業務委託料は、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4) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。
- (注5) 運用受託報酬は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注6) 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せん。

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

当事業年度において、重要な関連会社は株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティングであり、その要約財務諸表は以下のとおりであります。

(単位：千円)

株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティング		
	前事業年度	当事業年度
流動資産合計	-	7,449,532
固定資産合計	-	124,292
流動負債合計	-	1,665,547
固定負債合計	-	114,110
純資産合計	-	5,794,167
営業収益	-	1,093,658
税引前当期純利益	-	5,546,153
当期純利益	-	3,891,816

(1株当たり情報)

	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	1,357,615円66銭	1,349,261円64銭
1株当たり当期純利益金額	213,606円51銭	201,491円22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31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
当期純利益金額	5,126,556千円	6,443,302千円
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	5,126,556千円	6,443,302千円
普通株式及び普通株式と同等の 株式の期中平均株式数	24,000株	31,978株
(うち普通株式)	(24,000株)	(24,244株)
(うちA種種類株式)	(-)	(7,734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。

(重要な後発事象)

当社は、株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティング(以下、同社といいます。)の株式のうち当社が保有している全株式について、同社が実施する自己株式取得に伴い、平成29年4月1日付で同社へ譲渡いたしました。

これにより、関係会社株式売却益として1,492百万円の特別利益を計上する予定であります。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第33期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		38,311,736
金銭の信託		12,187,115
有価証券		10,007
未収委託者報酬		10,291,857
未収運用受託報酬		4,862,664
未収投資助言報酬		324,278
未収収益		55,950
前払費用		764,943
繰延税金資産		727,622
その他		498,289
	流動資産計	68,034,465
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	1,200,157
器具備品	1	573,952
建設仮勘定		7,907
無形固定資産		
ソフトウェア		1,050,789
ソフトウェア仮勘定		502,759
電話加入権		3,934
電信電話専用施設利用権		81
投資その他の資産		
投資有価証券		1,939,084
関係会社株式		3,229,196
長期差入保証金		1,566,055
繰延税金資産		906,695
その他		101,155
	固定資産計	11,081,771
資産合計		79,116,236

(単位:千円)

	第33期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	970,622
未払金	4,511,170
未払収益分配金	1,016
未払償還金	57,332
未払手数料	4,075,374
その他未払金	377,447
未払費用	7,061,067
未払法人税等	3,136,528
未払消費税等	1,025,584
前受収益	66,578
賞与引当金	1,376,046
役員賞与引当金	24,993
本社移転費用引当金	347,010
流動負債計	18,519,601
固定負債	
退職給付引当金	1,423,210
時効後支払損引当金	199,012
固定負債計	1,622,222
負債合計	20,141,823
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	19,552,957
資本準備金	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479
利益剰余金	36,673,439
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	36,550,146
別途積立金	24,580,000
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	11,470,146
株主資本計	58,226,396
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	748,016
評価・換算差額等計	748,016
純資産合計	58,974,413
負債・純資産合計	79,116,236

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日至平成29年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	42,132,996	
運用受託報酬	9,310,831	
投資助言報酬	593,439	
その他営業収益	57,716	
	営業収益計	52,094,984
営業費用		
支払手数料	18,688,374	
広告宣伝費	177,047	
公告費	860	
調査費	11,809,998	
調査費	5,371,951	
委託調査費	6,438,046	
委託計算費	550,197	
営業雑経費	555,637	
通信費	24,831	
印刷費	438,120	
協会費	27,130	
諸会費	29	
支払販売手数料	65,526	
	営業費用計	31,782,116
一般管理費		
給料	5,014,947	
役員報酬	93,260	
給料・手当	4,921,687	
交際費	22,147	
寄付金	4,057	
旅費交通費	181,947	
租税公課	331,327	
不動産賃借料	773,059	
退職給付費用	260,989	
固定資産減価償却費	1 720,970	
福利厚生費	22,315	
修繕費	1,799	
賞与引当金繰入額	1,376,046	
役員賞与引当金繰入額	24,993	
機器リース料	104	
事務委託費	1,549,368	
事務用消耗品費	75,575	
器具備品費	3,469	
諸経費	90,183	
	一般管理費計	10,453,305
営業利益		9,859,563

（単位：千円）

	第33期中間会計期間 （自平成29年4月1日至平成29年9月30日）	
営業外収益		
受取利息	593	
受取配当金	46,072	
時効成立分配金・償還金	85	
投資信託解約益	217,088	
投資信託償還益	93,060	
時効後支払損引当金戻入額	17,443	
雑収入	3,498	
	営業外収益計	377,842
営業外費用		
為替差損	8,306	
投資信託解約損	1,365	
投資信託償還損	17,053	
金銭の信託運用損	31,660	
	営業外費用計	58,386
経常利益		10,179,019
特別利益		
投資有価証券売却益	132,762	
関係会社株式売却益	1,492,680	
本社移転費用引当金戻入額	122,238	
その他特別利益	0	
	特別利益計	1,747,681
特別損失		
固定資産除却損	18,065	
固定資産売却損	134	
退職給付制度終了損	690,899	
その他特別損失	50	
	特別損失計	709,149
税引前中間純利益		11,217,551
法人税、住民税及び事業税		3,407,636
法人税等調整額		163,880
法人税等合計		3,243,755
中間純利益		7,973,795

(3) 中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30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
当中間期変動額									
剰余金の配当									3,200,000
中間純利益									7,973,795
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額(純 額)									
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	-	-	4,773,795
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	11,470,146

	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
当中間期変動額					
剰余金の配当	3,200,000	3,200,000			3,200,000
中間純利益	7,973,795	7,973,795			7,973,795
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額(純 額)			230,151	230,151	230,151
当中間期変動額 合計	4,773,795	4,773,795	230,151	230,151	5,003,947
当中間期末残高	36,673,439	58,226,396	748,016	748,016	58,974,413

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>						
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法						
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <table border="0" data-bbox="564 689 922 763"> <tr> <td>建物</td> <td>...</td> <td>6～18年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>...</td> <td>2～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>	建物	...	6～18年	器具備品	...	2～20年
建物	...	6～18年					
器具備品	...	2～20年					
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。						

5 . 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度及び確定給付型企业年金制度（キャッシュバランス型）について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</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中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>なお、一部の確定給付企業年金制度については、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</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。

会計上の見積りの変更

<p>第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)</p>
<p>当社は、当中間会計期間においてシステム統合計画を決定したことに伴い、利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。</p> <p>これにより、従来の方法と比べて、当中間会計期間の減価償却費が286,788千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ同額減少しております。</p>

追加情報

<p>第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)</p>
--

当社は、平成29年10月1日付で確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行したことにより、「退職給付制度間の移行等に関する会計処理」(企業会計基準適用指針第1号 平成28年12月16日)及び「退職給付制度間の移行等の会計処理に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第2号 平成19年2月7日)を適用し、確定給付年金制度の終了の処理を行いました。
本移行に伴う影響額は、特別損失に退職給付制度終了損として690,899千円を計上しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第33期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物 ... 97,109千円 器具備品 ... 774,035千円

（中間損益計算書関係）

項目	第33期中間会計期間 （自平成29年4月1日 至平成29年9月30日）	
	1. 減価償却実施額	有形固定資産 ...
	無形固定資産 ...	578,697千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日 至平成29年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

（2）基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第33期中間会計期間末（平成29年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成29年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	38,311,736	38,311,736	-
(2) 金銭の信託	12,187,115	12,187,115	-
(3) 未収委託者報酬	10,291,857	10,291,857	-
(4) 未収運用受託報酬	4,862,664	4,862,664	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	1,641,123	1,641,123	-
資産計	67,294,496	67,294,496	-
(1) 未払手数料	4,075,374	4,075,374	-
負債計	4,075,374	4,075,374	-

（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

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	307,968
関係会社株式	3,229,196

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

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

(有価証券関係)

第33期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)			
1. 子会社株式			
関係会社株式(中間貸借対照表計上額3,229,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。			
2. その他有価証券			
区分	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	1,189,247	146,101	1,043,145
投資信託	423,152	385,910	37,242
小計	1,612,400	532,011	1,080,388
中間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	28,723	30,967	2,244
小計	28,723	30,967	2,244
合計	1,641,123	562,979	1,078,144
(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額307,968千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。			

(企業結合等関係)

当社(以下「AMOne」という)は、平成28年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」という)、みずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」という)、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」という)及び新光投信株式会社(以下「新光投信」という)(以下総称して「統合4社」という)間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成29年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	118,742,638千円
資産合計	118,742,638千円
流動負債	- 千円
固定負債	13,822,169千円
負債合計	13,822,169千円
純資産	104,920,468千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん

72,413,595千円及び顧客関連資産の金額47,817,519千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,506,064千円
経常利益	4,506,064千円
税引前中間純利益	4,506,064千円
中間純利益	3,709,808千円
1株当たり中間純利益	92,745円22銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,616,680千円が含まれております。

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日 至平成29年9月30日）

1．セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2．関連情報

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（1株当たり情報）

第33期中間会計期間 （自平成29年4月1日 至平成29年9月30日）	
1株当たり純資産額	1,474,360円32銭
1株当たり中間純利益金額	199,344円89銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)
中間純利益金額	7,973,795千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	7,973,795千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成29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
水戸証券株式会社	12,272	「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) 資本金の額は平成29年3月末日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集販売の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する一部解約金、収益分配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・マークや図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載することがあります。また目論見書には「目論見書の使用開始日」、「委託会社の金融商品取引業者登録番号」、「金融商品取引法の規定に基づく目論見書である旨」、「投資信託の取引はクーリングオフ適用外である旨」、「請求目論見書の内容やその照会先と請求方法」、「信託財産の管理方法」、「投資信託運用による損益は全て投資家に帰属する旨」、「投資信託の元本は保証されていない旨」等を記載することがあります。
- (2) 目論見書には有価証券届出書の第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の主要内容を要約し記載することがあります。第二部「ファンド情報」第1 ファンドの状況 5 運用状況には、参考情報として 基準価額・純資産の推移 分配の推移 主要な資産の状況 年間収益率の推移等（ベンチマークを含む）を記載することがあります。（表示されるデータは適宜更新されます。）
- (3) 請求目論見書の巻末に用語説明を掲載する場合があります。
なお、請求目論見書の巻末に信託約款を掲載し参照することで、有価証券届出書の内容の記載とすることがあります。
- (4) ファンドの特色やリスク等について投資者に開示すべき情報のあるファンドは、交付目論見書に「追加的記載事項」と明記して当該情報の内容等を有価証券届出書の記載に従い記載することがあります。
- (5) 交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。
基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。
もしくは、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

独立監査人の監査報告書

平成29年6月7日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の平成29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29年11月29日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M国内株式パッシブ・ファンドの平成28年10月13日から平成29年10月12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、D I A M国内株式パッシブ・ファンドの平成29年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成29年11月24日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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、アセットマネジメントOne株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。