

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書
【提出先】 関東財務局長殿
【提出日】 2020年1月15日提出
【計算期間】 第3期(自 2018年10月13日 至 2019年10月15日)
【ファンド名】 たわらノーロード T O P I X
【発行者名】 アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】 取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】 酒井 隆
【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【電話番号】 03-6774-5100
【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

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

<ファンドの特色>

1 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。

- 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドへの投資を通じて、主として国内の金融商品取引所に上場している株式に実質的に投資します。

※東証株価指数(TOPIX) (配当込み)への連動性を高めるため、有価証券先物取引等を活用する場合があります。

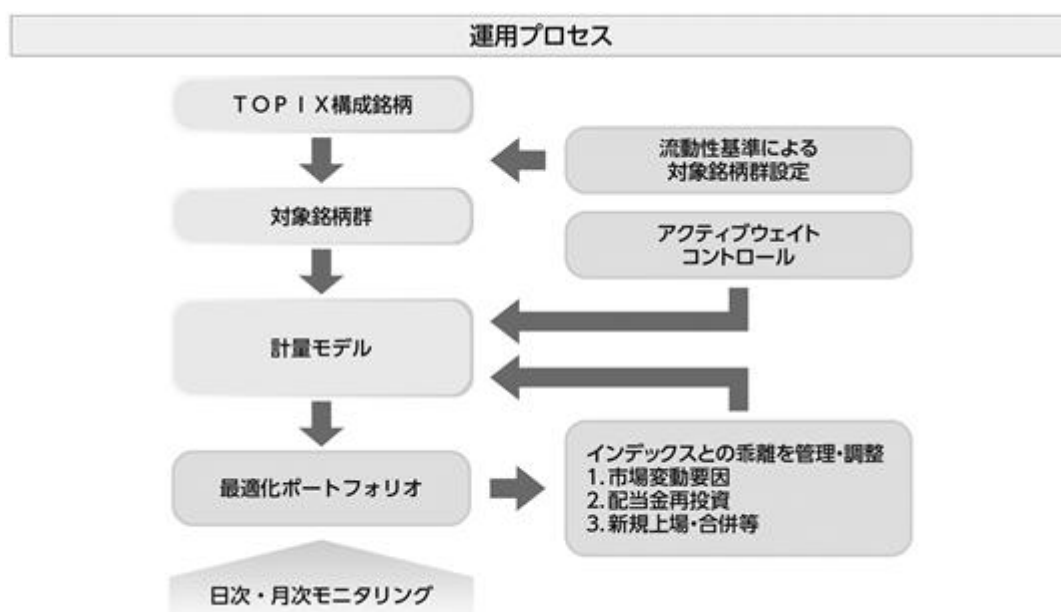
※マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

2 ご購入時およびご換金時に手数料がかからないファンドです。

- ご購入時に購入時手数料がかからないノーロードタイプです。
- ご換金時に換金手数料がかからず、信託財産留保額もありません。

3 年1回決算を行います。

- 毎年10月12日(休業日の場合は翌営業日。)に決算を行い、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。



※上記はマザーファンドの運用プロセスです。

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

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

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

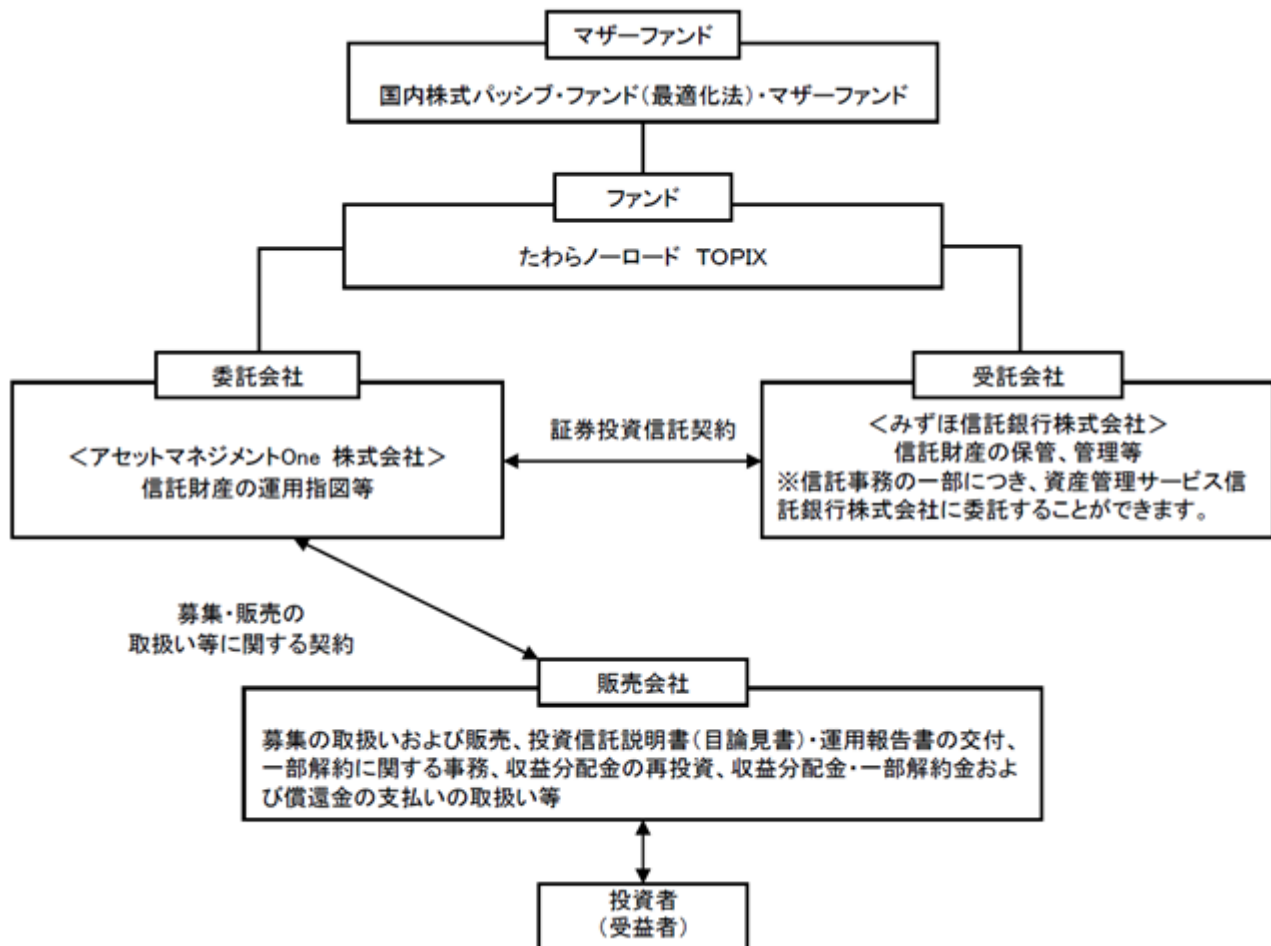
その他資産 (投資信託証券 (株式))	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として株式へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。 (注) 商品分類表の投資対象資産は株式に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産(投資信託証券(株式))に分類されます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
日本	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズに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

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

(2) 【ファンドの沿革】

2017年3月21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、当ファンドにかかる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、当ファンドの運用の基本方針、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（2019年10月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2019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>

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、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内の株式に実質的に投資します。

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)への連動性を高めるため、有価証券先物取引等を活用する場合があります。

マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

ファンドの資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

当ファンドが対象指数の変動を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16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

1.次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項に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かかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限りません。)

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

委託会社は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された証券投資信託である国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド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。なお、社債券のうちで、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、ならびに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総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)

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。)、新株予約権証券および新投資口予約権証券
 13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記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、有価証券にかかるものに限ります。)
 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上記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.および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.までの証券ならびに13.および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。

運用の指図範囲等(約款第17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の指図を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上記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	東京証券取引所第一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	<p>主として東京証券取引所第一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。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。</p> <p>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。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。</p> <p>非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"><p>東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。</p><p>株東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p><p>株東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（TOPIX）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p><p>株東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p><p>当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。</p><p>株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p><p>株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数（TOPIX）の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p><p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p></div>
------	---

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

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2019年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】

1 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、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

- (1) 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益(マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。))を含みます。)および売買益(評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額)等の全額とします。
- (2) 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。
- (3) 留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

2 収益分配方式

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

- 1) 信託財産に属する配当等収益(配当金、利子、貸付有価証券にかか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かか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かか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、監査費用および当該監査費用にかか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かかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

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

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

3 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委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)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、収益分配金は税引き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】

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)

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)

外貨建資産への投資は行いません。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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、価格変動および金利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。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

非株式(株式以外の資産)への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(2)投資態度)

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)

投資する株式等の範囲(約款第20条)

1) 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、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当に

より取得する株式、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。

- 2)上記1)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、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または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

信用取引の指図範囲(約款第21条)

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- 2)上記1)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(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)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の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(上記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

先物取引等の運用指図(約款第22条)

- 1)委託会社は、信託財産に属する資産の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。)、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。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)
- 2)委託会社は、信託財産に属する資産の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金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の運用指図(約款第23条)

- 1)委託会社は、信託財産に属する資産の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。
- 2)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 4)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引の運用指図(約款第24条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、金利先渡し取引を行うことの指図をすることができます。
- 2) 金利先渡し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。
- 3) 金利先渡し取引の評価は、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、
- 4) 委託会社は、金利先渡し取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとし、

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第25条)

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第26条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.~2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 上記1)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ます。
- 3) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとし、

資金の借入れ(約款第32条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- 2) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

同一法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律 第9条)

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式の議決権(株主総会において決議をするこ

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

3【投資リスク】

<基準価額の主な変動要因>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドは実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。

流動性リスク

投資資産の市場規模が小さいことなどで希望する価格で売買できない場合は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドにおいて有価証券等を実質的に売却または取得する際に、市場規模、取引量、取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。

信用リスク

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

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。

有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

収益分配は、計算期間中に発生した運用収益(経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。))を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。

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

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に連動する投資成果をめざして運用を行いますが、当該インデックス採用全銘柄を組入れない場合があること、資金流出入から組入銘柄の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と当該インデックスが乖離する場合があります。

当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、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。

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、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、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発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了(繰上償還)する場合があります。

・注意事項

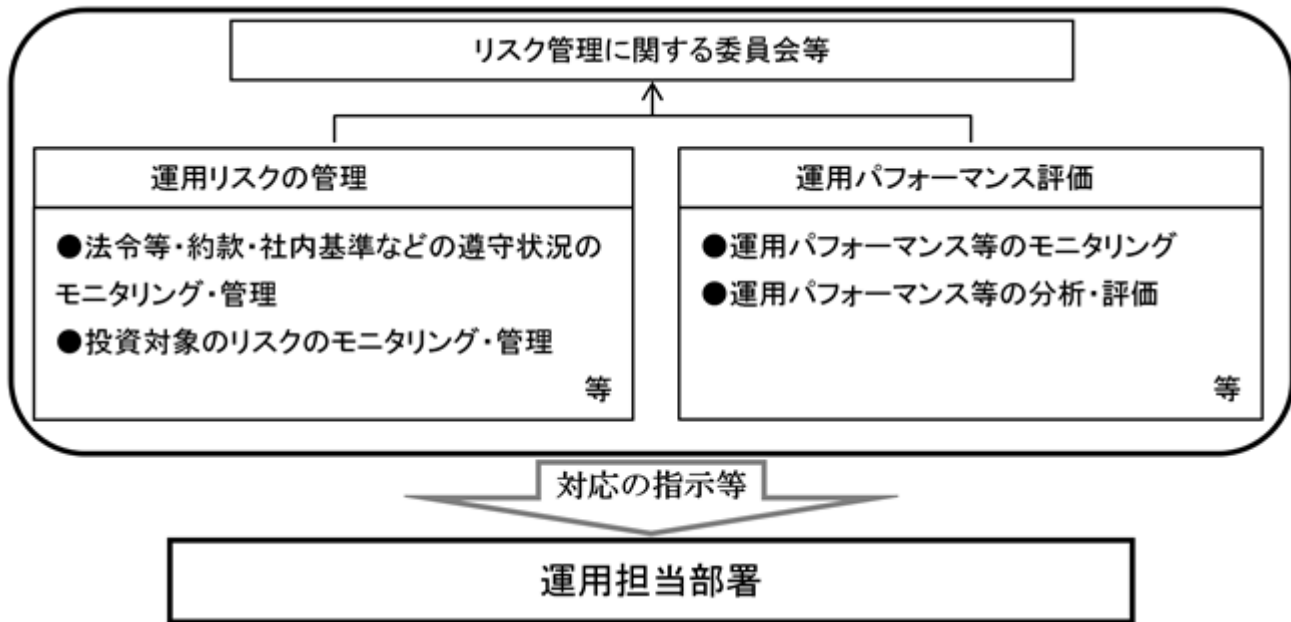
- イ.当ファンドは、実質的に株式などの値動きのある有価証券に投資しますので、基準価額は変動します。
- ロ.投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ハ.投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ニ.投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<リスク管理体制>

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

- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。

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



リスク管理体制は2019年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。

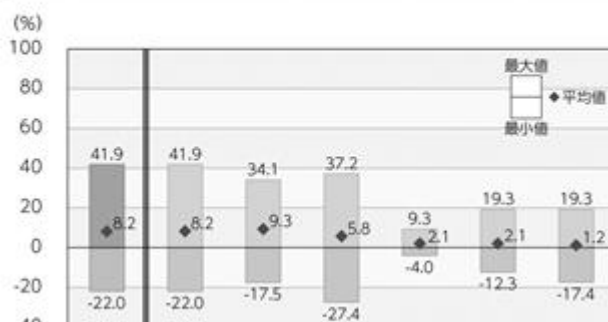
<参考情報>

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



2014年11月 2015年11月 2016年11月 2017年11月 2018年11月 2019年10月

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2014年11月~2019年10月(2014年11月~2018年2月は対象インデックスのデータ)

代表的な資産クラス:2014年11月~2019年10月

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

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

*ファンドの年間騰落率がない期間については、連動する投資成果を目指す対象インデックスの年間騰落率を表示しており、ファンドの実績ではありません。

*ファンドの対象インデックスは東証株価指数(TOPIX)(配当込み)です。

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

*ファンドの年間騰落率がない期間については、ファンドの年間騰落率に代えて対象インデックスの年間騰落率を用いて算出・表示していますので、ファンドの実績ではありません。

*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.187%（税抜0.17%）以内

2020年1月15日現在は、年率0.187%（税抜0.17%）になります。配分は以下の通りです。

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.075%	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0.075%	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0.020%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の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】

信託財産留保額

ありません。

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（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（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（配当控除の適用あり）のいずれかを選択することもできます。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

公募株式投資信託は税法上、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）」の適用対象です。また、販売会社によっては非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「愛称：つみたてNISA（つみたてニーサ）」の適用対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

NISAまたはつみたてNISA（いずれかの選択）、およびジュニアNISAをご利用の場合、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。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

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

上記は、2019年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「分配金自動引き落とし投資コース」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】

令和1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	1,379,106,417	99.99
内 日本	1,379,106,417	99.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	84,115	0.01
純資産総額	1,379,190,532	100.00

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

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

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和1年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	247,820,784,090	97.34
内 日本	247,820,784,090	97.34
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,769,099,904	2.66
純資産総額	254,589,883,994	100.00

その他資産の投資状況

令和1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）	6,573,890,000	2.58
内 日本	6,573,890,000	2.58

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

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

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

令和1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	523,399,908	2.5606 1,340,268,604	2.6349 1,379,106,417	- -	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年10月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和1年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	1,173,000	6,639.86 7,788,564,937	7,542.00 8,846,766,000	- -	3.47
2	ソニー 日本	株式 電気機器	665,200	4,863.34 3,235,097,633	6,625.00 4,406,950,000	- -	1.73
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	7,146,400	572.59 4,092,027,061	569.80 4,072,018,720	- -	1.60
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	690,300	4,693.29 3,239,784,118	5,376.00 3,711,052,800	- -	1.46
5	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	875,800	4,393.66 3,847,967,879	3,928.00 3,440,142,400	- -	1.35
6	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	819,500	4,931.78 4,041,599,290	4,190.00 3,433,705,000	- -	1.35
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	47,700	62,506.00 2,981,536,239	68,820.00 3,282,714,000	- -	1.29
8	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	718,000	3,898.83 2,799,362,582	3,880.00 2,785,840,000	- -	1.09
9	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	720,500	2,972.56 2,141,732,333	3,611.00 2,601,725,500	- -	1.02
10	任天堂 日本	株式 その他製品	64,500	31,139.43 2,008,493,402	38,620.00 2,490,990,000	- -	0.98
11	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	828,700	2,975.36 2,465,685,092	2,942.00 2,438,035,400	- -	0.96
12	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	14,107,000	171.93 2,425,486,772	168.80 2,381,261,600	- -	0.94

13	KDDI 日本	株式 情報・通 信業	769,700	2,682.75 2,064,918,233	2,999.00 2,308,330,300	- -	0.91
14	NTTドコモ 日本	株式 情報・通 信業	763,000	2,625.99 2,003,631,248	2,975.00 2,269,925,000	- -	0.89
15	信越化学工業 日本	株式 化学	181,700	9,473.49 1,721,334,200	12,160.00 2,209,472,000	- -	0.87
16	花王 日本	株式 化学	252,000	8,060.26 2,031,187,765	8,744.00 2,203,488,000	- -	0.87
17	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	371,200	5,373.60 1,994,681,124	5,868.00 2,178,201,600	- -	0.86
18	ファナック 日本	株式 電気機器	100,000	18,888.85 1,888,885,422	21,600.00 2,160,000,000	- -	0.85
19	第一三共 日本	株式 医薬品	301,200	3,974.46 1,197,107,382	7,140.00 2,150,568,000	- -	0.84
20	日立製作所 日本	株式 電気機器	505,800	3,602.48 1,822,136,610	4,069.00 2,058,100,200	- -	0.81
21	ダイキン工業 日本	株式 機械	134,100	11,994.60 1,608,475,928	15,230.00 2,042,343,000	- -	0.80
22	日本電産 日本	株式 電気機器	126,700	13,302.34 1,685,407,090	16,085.00 2,037,969,500	- -	0.80
23	HOYA 日本	株式 精密機器	211,900	6,863.85 1,454,450,446	9,603.00 2,034,875,700	- -	0.80
24	三菱商事 日本	株式 卸売業	727,500	3,103.28 2,257,642,234	2,764.00 2,010,810,000	- -	0.79
25	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	87,500	23,465.01 2,053,189,183	22,295.00 1,950,812,500	- -	0.77
26	資生堂 日本	株式 化学	209,200	7,368.31 1,541,452,491	8,968.00 1,876,105,600	- -	0.74
27	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	185,300	10,163.13 1,883,228,938	9,849.00 1,825,019,700	- -	0.72
28	村田製作所 日本	株式 電気機器	309,200	5,719.39 1,768,436,250	5,863.00 1,812,839,600	- -	0.71
29	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	925,900	1,653.16 1,530,669,869	1,858.50 1,720,785,150	- -	0.68
30	三井物産 日本	株式 卸売業	911,200	1,750.51 1,595,072,673	1,867.50 1,701,666,000	- -	0.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年10月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	97.34
合計	97.34

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

令和1年10月31日現在

業種	国内 / 外国	投資比率 (%)
電気機器	国内	13.59
情報・通信業		8.20
輸送用機器		7.78
化学		7.21
銀行業		5.71
医薬品		5.66
機械		5.03
サービス業		4.94
卸売業		4.84
小売業		4.57
陸運業		4.40
食料品		3.87
建設業		2.81
不動産業		2.42
保険業		2.24
その他製品		2.18
精密機器		2.18
電気・ガス業		1.57
その他金融業		1.11
ガラス・土石製品		0.82
ゴム製品		0.78
証券、商品先物取引業		0.76
非鉄金属		0.76
鉄鋼		0.75
繊維製品		0.60
金属製品		0.59
石油・石炭製品		0.52
空運業		0.51
鉱業		0.26
パルプ・紙		0.23
倉庫・運輸関連業		0.18
海運業		0.17
水産・農林業		0.10
合計		97.34

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和1年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 0112月	買建	394	6,372,551,846	6,573,890,000	2.58

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（令和1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29年10月12日)	210	210	1.1069	1.1069
第2計算期間末 (平成30年10月12日)	749	749	1.1302	1.1302
第3計算期間末 (令和1年10月15日)	1,373	1,373	1.1012	1.1012
平成30年10月末日	860	-	1.0929	-
11月末日	881	-	1.1072	-
12月末日	871	-	0.9936	-
平成31年1月末日	944	-	1.0423	-
2月末日	1,002	-	1.0693	-
3月末日	1,045	-	1.0700	-
4月末日	1,067	-	1.0876	-
令和1年5月末日	1,072	-	1.0167	-
6月末日	1,156	-	1.0443	-
7月末日	1,213	-	1.0537	-
8月末日	1,246	-	1.0180	-
9月末日	1,316	-	1.0793	-
10月末日	1,379	-	1.1331	-

【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

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	10.7
第2計算期間	2.1
第3計算期間	2.6

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	326,646,539	136,230,280
第2計算期間	987,333,224	514,719,996
第3計算期間	980,070,140	396,096,990

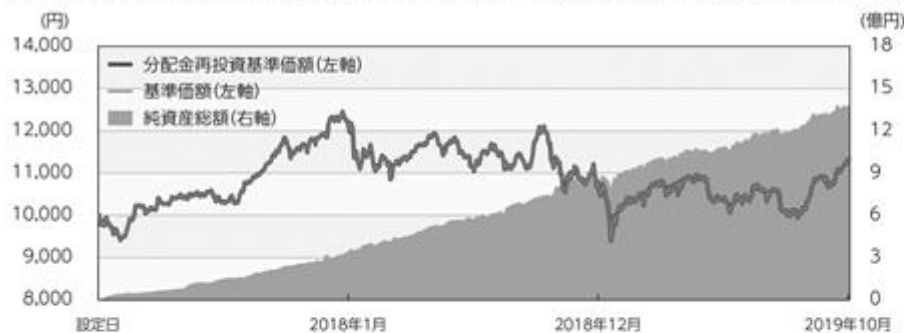
(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2019年10月31日

基準価額・純資産の推移 (2017年3月21日~2019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:2017年3月21日)

分配の推移(税引前)

2017年10月	0円
2018年10月	0円
2019年10月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	99.99

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	97.34
内 日本	97.34
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.66
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)	2.58

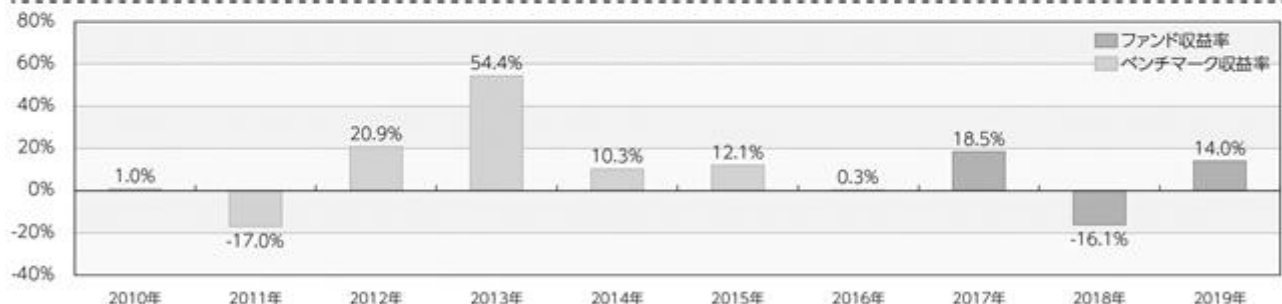
株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	13.59
2	情報・通信業	8.20
3	輸送用機器	7.78
4	化学	7.21
5	銀行業	5.71

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	3.47
2	ソニー	株式	日本	電気機器	1.73
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.60
4	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.46
5	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.35
6	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.35
7	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.29
8	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.09
9	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.02
10	任天堂	株式	日本	その他製品	0.98

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2017年は設定日から年末までの収益率、および2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※2016年以前は、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。

確定拠出年金制度のご利用によるお申込みの場合には、確定拠出年金制度にかかる手続きが必要となります。この場合、「分配金自動けいぞく投資コース」でのお申込みとなります。

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

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3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委託会社または販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

なお、委託会社または販売会社は、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、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。

・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」により収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」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、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）

- ・ お申込手数料
ありません。

- ・ 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。
確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。
当初元本は1口当たり1円です。

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

2【換金（解約）手続等】

- ・ 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。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。
解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付に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。なお、受益者が解約の請求をするときは、委託会社また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、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5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】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、2017年3月21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、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ.償還規定

- a.委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- 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、書面決議の日および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、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發します。
- 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。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.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、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にも適用しません。
- f.委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、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、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、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、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合（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、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、
- b. 委託会社は、上記a. の事項（上記a. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a. の併合事項にあっては、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、約款にかかる知れ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發します。
- 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、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れ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、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、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、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a. からg. の規定にしたがい約款を変更します。
- 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委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。)に、原則として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、委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。)に、原則として償還日(休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

(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3期計算期間(平成30年10月13日から令和1年10月15日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【たわらノーロード TOPIX】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 平成30年10月12日現在	第3期 令和1年10月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,108,524	3,887,031
親投資信託受益証券	748,809,835	1,373,163,099
流動資産合計	756,918,359	1,377,050,130
資産合計	756,918,359	1,377,050,130
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,012,076	2,711,597
未払受託者報酬	65,115	129,783
未払委託者報酬	488,618	973,666
その他未払費用	5,100	9,788
流動負債合計	7,570,909	3,824,834
負債合計	7,570,909	3,824,834
純資産の部		
元本等		
元本	663,029,487	1,247,002,637
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	86,317,963	126,222,659
(分配準備積立金)	13,128,840	35,173,188
元本等合計	749,347,450	1,373,225,296
純資産合計	749,347,450	1,373,225,296
負債純資産合計	756,918,359	1,377,050,130

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期		第3期	
	自	平成29年10月13日 平成30年10月12日	自	平成30年10月13日 令和1年10月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		4,139,392		13,608,264
営業収益合計		4,139,392		13,608,264
営業費用				
支払利息		5,529		4,355
受託者報酬		99,577		228,493
委託者報酬		753,006		1,714,266
その他費用		7,778		17,212
営業費用合計		865,890		1,964,326
営業利益又は営業損失()		5,005,282		11,643,938
経常利益又は経常損失()		5,005,282		11,643,938
当期純利益又は当期純損失()		5,005,282		11,643,938
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()		9,512,707		14,328,246
期首剰余金又は期首欠損金()		20,356,945		86,317,963
剰余金増加額又は欠損金減少額		155,397,822		53,074,137
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		155,397,822		53,074,137
剰余金減少額又は欠損金増加額		74,918,815		39,141,625
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		74,918,815		39,141,625
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		86,317,963		126,222,659

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第3期	
	自 平成30年10月13日	至 令和1年10月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年10月12日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を令和1年10月15日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期
	平成30年10月12日現在	令和1年10月15日現在
1. 期首元本額	190,416,259円	663,029,487円
期中追加設定元本額	987,333,224円	980,070,140円
期中一部解約元本額	514,719,996円	396,096,990円
2. 受益権の総数	663,029,487口	1,247,002,637口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 平成29年10月13日 至 平成30年10月12日	自 平成30年10月13日 至 令和1年10月15日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(10,749,833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(73,189,123円)及び分配準備積立金(2,379,007円)より分配対象収益は86,317,963円(1万口当たり1,301.87円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(26,412,285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(91,049,471円)及び分配準備積立金(8,760,903円)より分配対象収益は126,222,659円(1万口当たり1,012.20円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第2期	第3期
	自 平成29年10月13日 至 平成30年10月12日	自 平成30年10月13日 至 令和1年10月15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。	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
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。	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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期	第3期
	平成30年10月12日現在	令和1年10月15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。	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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。	(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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価には、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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第2期	第3期
	平成30年10月12日現在	令和1年10月15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	9,899,768	18,045,312
合計	9,899,768	18,045,312

(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2期 平成30年10月12日現在	第3期 令和1年10月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1302円 (11,302円)	1.1012円 (11,012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

令和1年10月15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	536,287,092	1,373,163,099	
親投資信託受益証券	合計	536,287,092	1,373,163,099	
合計			1,373,163,099	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

令和1年10月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	14,814,671,498
株式	235,064,669,820
派生商品評価勘定	113,365,540
未収入金	4,054,920
未収配当金	2,438,444,181
流動資産合計	252,435,205,959
資産合計	252,435,205,959
負債の部	
流動負債	
前受金	18,629,400
未払解約金	10,498,804,000
流動負債合計	10,517,433,400
負債合計	10,517,433,400
純資産の部	
元本等	
元本	94,478,900,732
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	147,438,871,827
元本等合計	241,917,772,559
純資産合計	241,917,772,559
負債純資産合計	252,435,205,959

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 平成30年10月13日 至 令和1年10月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和1年10月15日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	108,086,790,523円
同期中追加設定元本額	39,613,416,016円
同期中一部解約元本額	53,221,305,807円
元本の内訳 ファンド名 One DC 国内株式インデックスファンド	13,557,054,991円

D I A M国内株式パッシブ・ファンド	2,907,412,024円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,923,070円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	7,011,566円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	11,662,546円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	30,491,294円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	22,803,267円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	14,711,100円
たわらノーロード T O P I X	536,287,092円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	242,802,844円
たわらノーロード バランス(堅実型)	7,131,642円
たわらノーロード バランス(標準型)	47,951,095円
たわらノーロード バランス(積極型)	76,722,563円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	439,655円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	39,615,536円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	98,667,253円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	71,981,755円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	141,514,902円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	306,468円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,069,329円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,189,432円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,269,841円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	3,404,163円
D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>	37,459,396,713円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	1,035,937,400円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	3,333,230,470円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	3,397,377,148円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	367,277,786円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,238,641,595円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	1,147,484,958円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	40,899,436円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,127,773,245円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	26,814,455円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	316,883,519円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	229,450,582円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	392,389,471円
投資のソムリエ	2,253,192,354円
クルーズコントロール	979,705,117円
投資のソムリエ<DC年金>	236,319,307円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	260,845,688円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	306,098,519円
クルーズコントロール<DC年金>	849,520円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	9,655,650円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	26,050,727円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	119,510,094円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,377,177,309円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	4,395,592円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	3,433,623円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	867,180円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	6,304,861円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	26,583,305円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	898,053,980円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	195,612,909円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	615,596円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	555,722円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	550,785円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	121,536円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	65,596,476円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	821,382,965円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	99,656,550円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	220,980,887円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	13,564,100円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	55,327,507円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	16,130,522円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	13,693,734円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	30,592,543円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	60,237,525円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	928,321,228円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	907,917,604円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,565,608,873円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	181,937,751円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	50,670,052円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	500,896,885円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	163,896,231円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	3,305,256円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	39,525,205円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	555,009,537円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	48,941,236円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	163,534,372円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	374,027,228円
DIAMバランス30VA(適格機関投資家限定)	1,274,638円
DIAMバランス50VA(適格機関投資家限定)	120,337円
DIAMバランス70VA(適格機関投資家限定)	194,614円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	8,236,052,727円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	62,527,230円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	25,254,604円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	25,841,335円
DIAMバランス40VA(適格機関投資家限定)	108,794円
DIAMバランス60VA(適格機関投資家限定)	122,869円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	426,124,037円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,335,152,689円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,766,916,070円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	72,976,941円
計	94,478,900,732円

2. 受益権の総数

94,478,900,732口

3. 差入代用有価証券 株式	3,692,500,000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30年10月13日 至 令和1年10月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年10月15日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和1年10月15日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	7,855,235,314
合計	7,855,235,314

(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31年2月8日から令和1年10月15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	令和1年10月15日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超	時価(円)	
市場取引 先物取引 買建	6,380,698,600	-	6,494,195,000	113,496,400
合計	6,380,698,600	-	6,494,195,000	113,496,400

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

令和1年10月15日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5605円 (25,605円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

令和1年10月15日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	4,500	2,902.00	13,059,000	
日本水産	137,700	622.00	85,649,400	
マルハニチロ	19,900	2,788.00	55,481,200	
ハウスイ	900	859.00	773,100	
カネコ種苗	4,300	1,309.00	5,628,700	
サカタのタネ	16,400	3,525.00	57,810,000	
ホクト	11,500	1,933.00	22,229,500	
ホクリヨウ	1,900	676.00	1,284,400	
ヒノキヤグループ	3,400	2,055.00	6,987,000	
ショーボンドホールディングス	19,700	4,080.00	80,376,000	
ミライト・ホールディングス	38,700	1,643.00	63,584,100	
タマホーム	6,700	1,509.00	10,110,300	
サンヨーホームズ	2,200	650.00	1,430,000	
日本アクア	4,000	672.00	2,688,000	
ファーストコーポレーション	4,500	639.00	2,875,500	
ベステラ	2,700	1,219.00	3,291,300	
TATERU	18,900	192.00	3,628,800	
スペースバリューホールディングス	17,000	528.00	8,976,000	
住石ホールディングス	31,300	134.00	4,194,200	
日鉄鉱業	3,200	4,230.00	13,536,000	
三井松島ホールディングス	5,900	1,222.00	7,209,800	
国際石油開発帝石	552,300	961.00	530,760,300	
石油資源開発	19,800	2,642.00	52,311,600	
K&Oエナジーグループ	6,700	1,541.00	10,324,700	
ダイセキ環境ソリューション	3,000	793.00	2,379,000	
第一カッター興業	1,800	1,768.00	3,182,400	
安藤・間	88,300	813.00	71,787,900	
東急建設	40,300	842.00	33,932,600	
コムシスホールディングス	48,800	3,095.00	151,036,000	
ミサワホーム	10,800	1,140.00	12,312,000	

ビーアールホールディングス	12,800	425.00	5,440,000
高松コンストラクショングループ	8,600	2,528.00	21,740,800
東建コーポレーション	4,200	6,780.00	28,476,000
ソネック	1,700	848.00	1,441,600
ヤマウラ	5,500	905.00	4,977,500
大成建設	113,100	4,160.00	470,496,000
大林組	340,400	1,076.00	366,270,400
清水建設	347,400	1,008.00	350,179,200
飛島建設	9,800	1,282.00	12,563,600
長谷工コーポレーション	142,000	1,307.00	185,594,000
松井建設	12,500	795.00	9,937,500
銭高組	1,400	3,920.00	5,488,000
鹿島建設	266,100	1,450.00	385,845,000
不動テトラ	7,900	1,436.00	11,344,400
大末建設	4,100	950.00	3,895,000
鉄建建設	6,900	2,864.00	19,761,600
西松建設	24,500	2,108.00	51,646,000
三井住友建設	82,100	585.00	48,028,500
大豊建設	7,700	3,015.00	23,215,500
前田建設工業	79,600	979.00	77,928,400
佐田建設	7,500	429.00	3,217,500
ナカノフドー建設	8,800	488.00	4,294,400
奥村組	18,700	2,982.00	55,763,400
東鉄工業	13,600	3,290.00	44,744,000
イチケン	2,100	1,693.00	3,555,300
富士ピー・エス	4,200	520.00	2,184,000
浅沼組	3,800	3,895.00	14,801,000
戸田建設	131,800	651.00	85,801,800
熊谷組	16,200	3,115.00	50,463,000
北野建設	2,400	2,667.00	6,400,800
植木組	1,400	2,595.00	3,633,000
矢作建設工業	15,400	732.00	11,272,800
ピーエス三菱	12,100	759.00	9,183,900
日本ハウスホールディングス	21,800	515.00	11,227,000
大東建託	40,500	13,945.00	564,772,500
新日本建設	13,700	818.00	11,206,600
N I P P O	30,000	2,167.00	65,010,000
東亜道路工業	2,100	3,410.00	7,161,000
前田道路	33,600	2,400.00	80,640,000
日本道路	3,100	6,740.00	20,894,000
東亜建設工業	10,000	1,393.00	13,930,000
日本国土開発	18,600	584.00	10,862,400
若築建設	5,800	1,604.00	9,303,200
東洋建設	41,600	476.00	19,801,600
五洋建設	135,100	618.00	83,491,800
世紀東急工業	16,600	744.00	12,350,400
福田組	3,700	4,390.00	16,243,000
日本ドライケミカル	2,800	1,140.00	3,192,000
住友林業	80,400	1,509.00	121,323,600
日本基礎技術	11,800	403.00	4,755,400

巴コーポレーション	14,300	430.00	6,149,000	
大和ハウス工業	314,500	3,573.00	1,123,708,500	
ライト工業	21,800	1,525.00	33,245,000	
積水ハウス	347,700	2,284.50	794,320,650	
日特建設	9,700	697.00	6,760,900	
北陸電気工事	5,600	915.00	5,124,000	
ユアテック	18,000	685.00	12,330,000	
四電工	1,700	2,787.00	4,737,900	
中電工	14,500	2,445.00	35,452,500	
関電工	51,500	1,022.00	52,633,000	
きんでん	75,300	1,618.00	121,835,400	
東京エネシス	11,600	948.00	10,996,800	
トーエネック	3,200	3,455.00	11,056,000	
住友電設	7,800	2,167.00	16,902,600	
日本電設工業	19,300	2,314.00	44,660,200	
協和エクシオ	44,500	2,637.00	117,346,500	
新日本空調	9,200	1,995.00	18,354,000	
日本工営	6,500	3,225.00	20,962,500	
九電工	22,300	3,545.00	79,053,500	
三機工業	24,800	1,305.00	32,364,000	
日揮ホールディングス	97,900	1,467.00	143,619,300	
中外炉工業	3,200	1,548.00	4,953,600	
ヤマト	10,300	738.00	7,601,400	
太平電業	7,700	2,575.00	19,827,500	
高砂熱学工業	27,500	1,838.00	50,545,000	
三晃金属工業	1,400	2,498.00	3,497,200	
NEC ネットエスアイ	11,000	3,110.00	34,210,000	
朝日工業社	2,400	3,080.00	7,392,000	
明星工業	20,500	799.00	16,379,500	
大気社	15,400	3,350.00	51,590,000	
ダイダン	7,600	2,293.00	17,426,800	
日比谷総合設備	10,200	1,921.00	19,594,200	
東芝プラントシステム	24,500	1,974.00	48,363,000	
日本製粉	32,000	1,739.00	55,648,000	
日清製粉グループ本社	115,000	2,060.00	236,900,000	
日東富士製粉	700	6,450.00	4,515,000	
昭和産業	9,300	3,140.00	29,202,000	
鳥越製粉	9,100	902.00	8,208,200	
中部飼料	12,400	1,188.00	14,731,200	
フィード・ワン	68,800	164.00	11,283,200	
東洋精糖	1,700	1,079.00	1,834,300	
日本甜菜製糖	5,800	1,995.00	11,571,000	
三井製糖	8,000	2,294.00	18,352,000	
塩水港精糖	11,300	209.00	2,361,700	
日新製糖	4,700	1,960.00	9,212,000	
LIFULL	34,000	682.00	23,188,000	
ジェイエイシーリクルートメント	6,600	2,002.00	13,213,200	
日本M&Aセンター	73,200	3,000.00	219,600,000	
メンバーズ	3,400	1,824.00	6,201,600	
中広	1,100	557.00	612,700	

タケエイ	10,200	1,089.00	11,107,800
E・Jホールディングス	1,300	1,400.00	1,820,000
トラスト・テック	10,700	1,276.00	13,653,200
コシダカホールディングス	23,400	1,537.00	35,965,800
アルトナー	2,000	736.00	1,472,000
パソナグループ	11,900	1,436.00	17,088,400
CDS	2,500	1,346.00	3,365,000
リンクアンドモチベーション	19,800	553.00	10,949,400
GCA	10,900	815.00	8,883,500
エス・エム・エス	35,700	2,776.00	99,103,200
パーソルホールディングス	96,900	1,996.00	193,412,400
リニカル	5,600	982.00	5,499,200
クックパッド	34,000	303.00	10,302,000
エスクリ	2,800	859.00	2,405,200
アイ・ケイ・ケイ	4,700	689.00	3,238,300
森永製菓	25,600	5,360.00	137,216,000
中村屋	2,700	4,585.00	12,379,500
江崎グリコ	30,200	4,715.00	142,393,000
名糖産業	4,900	1,247.00	6,110,300
井村屋グループ	4,300	2,014.00	8,660,200
不二家	5,600	2,096.00	11,737,600
山崎製パン	76,300	1,947.00	148,556,100
第一屋製パン	1,800	976.00	1,756,800
モロゾフ	1,800	5,020.00	9,036,000
亀田製菓	6,300	4,860.00	30,618,000
寿スピリッツ	10,800	7,370.00	79,596,000
カルビー	46,400	3,410.00	158,224,000
森永乳業	20,400	4,345.00	88,638,000
六甲バター	6,800	1,805.00	12,274,000
ヤクルト本社	75,400	6,040.00	455,416,000
明治ホールディングス	72,100	7,860.00	566,706,000
雪印メグミルク	24,500	2,632.00	64,484,000
プリマハム	14,300	2,489.00	35,592,700
日本ハム	42,100	4,680.00	197,028,000
林兼産業	3,600	609.00	2,192,400
丸大食品	10,800	2,319.00	25,045,200
S Foods	9,100	3,030.00	27,573,000
伊藤ハム米久ホールディングス	65,300	688.00	44,926,400
学情	3,500	1,441.00	5,043,500
スタジオアリス	4,900	1,863.00	9,128,700
クロスキャット	2,700	996.00	2,689,200
シミックホールディングス	5,400	1,736.00	9,374,400
システナ	35,500	1,577.00	55,983,500
NJS	2,300	1,668.00	3,836,400
デジタルアーツ	5,400	6,720.00	36,288,000
日鉄ソリューションズ	14,900	3,625.00	54,012,500
総合警備保障	38,500	5,640.00	217,140,000
キューブシステム	5,500	774.00	4,257,000
いちご	127,200	444.00	56,476,800
エイジア	2,100	1,222.00	2,566,200

日本駐車場開発	110,400	159.00	17,553,600	
コア	4,300	1,343.00	5,774,900	
カカクコム	72,600	2,428.00	176,272,800	
アイロムグループ	3,900	1,588.00	6,193,200	
セントケア・ホールディング	6,000	503.00	3,018,000	
サイネックス	1,800	645.00	1,161,000	
ルネサンス	5,400	1,645.00	8,883,000	
ディップ	15,700	2,654.00	41,667,800	
SBSホールディングス	8,800	1,762.00	15,505,600	
オプトホールディング	5,400	1,536.00	8,294,400	
新日本科学	13,300	632.00	8,405,600	
ツクイ	23,000	425.00	9,775,000	
キャリアデザインセンター	2,600	1,325.00	3,445,000	
ベネフィット・ワン	26,600	2,096.00	55,753,600	
エムスリー	204,100	2,617.00	534,129,700	
ツカダ・グローバルホールディング	5,900	600.00	3,540,000	
プラス	800	648.00	518,400	
アウトソーシング	55,500	1,074.00	59,607,000	
ウェルネット	9,500	709.00	6,735,500	
ワールドホールディングス	3,100	1,662.00	5,152,200	
ディー・エヌ・エー	52,300	1,916.00	100,206,800	
博報堂DYホールディングス	134,700	1,564.00	210,670,800	
ぐるなび	13,900	715.00	9,938,500	
タカミヤ	10,500	658.00	6,909,000	
ジャパンベストレスキューシステム	6,700	1,079.00	7,229,300	
ファンコミュニケーションズ	26,900	517.00	13,907,300	
ライク	3,900	1,644.00	6,411,600	
ビジネス・ブレークスルー	4,700	360.00	1,692,000	
エスプール	18,800	559.00	10,509,200	
WDBホールディングス	4,500	2,826.00	12,717,000	
ティア	5,200	598.00	3,109,600	
CDG	1,000	1,365.00	1,365,000	
パリュコマース	5,500	1,582.00	8,701,000	
インフォマート	53,100	1,573.00	83,526,300	
サッポロホールディングス	34,700	2,793.00	96,917,100	
アサヒグループホールディングス	213,100	5,490.00	1,169,919,000	
麒麟ホールディングス	431,500	2,304.00	994,176,000	
宝ホールディングス	76,200	1,110.00	84,582,000	
オエノンホールディングス	26,900	386.00	10,383,400	
養命酒製造	3,100	1,934.00	5,995,400	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	71,400	2,518.00	179,785,200	
サントリー食品インターナショナル	68,100	4,740.00	322,794,000	
ダイドーグループホールディングス	5,700	4,500.00	25,650,000	
伊藤園	30,900	5,270.00	162,843,000	
キーコーヒー	10,000	2,227.00	22,270,000	
ユニカフェ	2,700	1,010.00	2,727,000	
ジャパンフーズ	1,500	1,199.00	1,798,500	
日清オイリオグループ	13,100	3,605.00	47,225,500	
不二製油グループ本社	24,800	3,245.00	80,476,000	

かどや製油	1,100	3,665.00	4,031,500
J-オイルミルズ	5,200	4,290.00	22,308,000
ローソン	25,300	5,920.00	149,776,000
サンエー	7,600	5,190.00	39,444,000
カワチ薬品	7,700	2,154.00	16,585,800
エービーシー・マート	15,600	7,490.00	116,844,000
ハードオフコーポレーション	4,200	784.00	3,292,800
高千穂交易	3,900	1,118.00	4,360,200
アスクル	10,500	2,843.00	29,851,500
ゲオホールディングス	15,200	1,314.00	19,972,800
アダストリア	13,900	2,573.00	35,764,700
ジーフット	5,900	616.00	3,634,400
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,500	678.00	1,017,000
伊藤忠食品	2,400	4,630.00	11,112,000
くら寿司	5,200	4,500.00	23,400,000
キャンドウ	4,800	1,627.00	7,809,600
エレマテック	9,300	1,045.00	9,718,500
パルグループホールディングス	5,100	3,560.00	18,156,000
JALUX	2,900	2,432.00	7,052,800
エディオン	42,200	1,048.00	44,225,600
あらた	7,400	4,005.00	29,637,000
サーラコーポレーション	20,100	619.00	12,441,900
ワッツ	3,900	614.00	2,394,600
トーメンデバイス	1,500	2,347.00	3,520,500
ハローズ	3,800	2,369.00	9,002,200
J Pホールディングス	28,000	283.00	7,924,000
フジオフードシステム	4,200	3,025.00	12,705,000
あみやき亭	2,100	3,415.00	7,171,500
東京エレクトロン デバイス	3,600	2,043.00	7,354,800
ひらまつ	20,100	322.00	6,472,200
フィールズ	8,800	518.00	4,558,400
双日	550,900	335.00	184,551,500
アルフレッサ ホールディングス	110,900	2,409.00	267,158,100
大黒天物産	2,400	3,445.00	8,268,000
ハニーズホールディングス	8,800	1,360.00	11,968,000
ファーマライズホールディングス	2,300	627.00	1,442,100
キッコーマン	67,100	5,190.00	348,249,000
味の素	224,700	2,049.00	460,410,300
キュービー	56,600	2,450.00	138,670,000
ハウス食品グループ本社	38,000	4,120.00	156,560,000
カゴメ	38,600	2,840.00	109,624,000
焼津水産化学工業	5,000	1,044.00	5,220,000
アリアケジャパン	9,300	8,550.00	79,515,000
ピエトロ	1,400	1,608.00	2,251,200
エバラ食品工業	2,500	2,137.00	5,342,500
ニチレイ	52,900	2,507.00	132,620,300
横浜冷凍	27,900	1,075.00	29,992,500
東洋水産	52,300	4,465.00	233,519,500
イートアンド	3,600	1,739.00	6,260,400
大冷	1,200	1,994.00	2,392,800

ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,900	956.00	2,772,400	
日清食品ホールディングス	43,200	8,270.00	357,264,000	
永谷園ホールディングス	5,400	2,094.00	11,307,600	
一正蒲鉾	4,000	1,056.00	4,224,000	
フジッコ	11,000	1,993.00	21,923,000	
ロック・フィールド	11,000	1,497.00	16,467,000	
日本たばこ産業	587,300	2,395.50	1,406,877,150	
ケンコーマヨネーズ	5,700	2,499.00	14,244,300	
わらべや日洋ホールディングス	6,700	1,917.00	12,843,900	
なとり	5,700	1,644.00	9,370,800	
イフジ産業	2,000	735.00	1,470,000	
ピククルスコーポレーション	2,500	2,705.00	6,762,500	
北の達人コーポレーション	40,100	781.00	31,318,100	
ユーグレナ	43,500	859.00	37,366,500	
スター・マイカ・ホールディングス	4,800	1,907.00	9,153,600	
片倉工業	14,500	1,374.00	19,923,000	
グンゼ	6,700	4,660.00	31,222,000	
ヒューリック	213,600	1,143.00	244,144,800	
神栄	1,500	742.00	1,113,000	
ラサ商事	5,500	848.00	4,664,000	
アルペン	7,600	1,727.00	13,125,200	
ハブ	3,300	1,114.00	3,676,200	
ラクーンホールディングス	5,100	705.00	3,595,500	
クオールホールディングス	14,700	1,469.00	21,594,300	
アルコニックス	10,700	1,317.00	14,091,900	
神戸物産	17,300	5,780.00	99,994,000	
ソリトンシステムズ	4,400	952.00	4,188,800	
ジinzホールディングス	5,300	6,440.00	34,132,000	
ビックカメラ	59,200	1,180.00	69,856,000	
DCMホールディングス	53,600	1,075.00	57,620,000	
ペッパーフードサービス	8,000	1,646.00	13,168,000	
Monotaro	71,000	2,935.00	208,385,000	
東京一番フーズ	2,600	610.00	1,586,000	
DDホールディングス	4,500	1,540.00	6,930,000	
あいホールディングス	14,300	1,843.00	26,354,900	
ディービーエックス	4,000	865.00	3,460,000	
きちりホールディングス	2,800	786.00	2,200,800	
アークランドサービスホールディングス	7,300	1,914.00	13,972,200	
J.フロントリテイリング	127,600	1,350.00	172,260,000	
ドトール・日レスホールディングス	17,500	2,124.00	37,170,000	
マツモトキヨシホールディングス	41,300	3,940.00	162,722,000	
ブロンコビリー	5,300	2,437.00	12,916,100	
ZOZO	108,000	2,517.00	271,836,000	
トレジャー・ファクトリー	3,100	1,169.00	3,623,900	
物語コーポレーション	2,500	9,900.00	24,750,000	
ココカラファイン	11,200	6,070.00	67,984,000	
三越伊勢丹ホールディングス	186,800	878.00	164,010,400	
東洋紡	42,000	1,426.00	59,892,000	
ユニチカ	29,700	335.00	9,949,500	

富士紡ホールディングス	5,200	3,140.00	16,328,000
日清紡ホールディングス	67,300	878.00	59,089,400
倉敷紡績	9,400	2,413.00	22,682,200
ダイワボウホールディングス	9,100	4,515.00	41,086,500
シキボウ	5,100	932.00	4,753,200
日東紡績	15,100	3,240.00	48,924,000
トヨタ紡織	35,400	1,536.00	54,374,400
マクニカ・富士エレホールディングス	27,700	1,500.00	41,550,000
H a m e e	3,200	1,153.00	3,689,600
ラクト・ジャパン	3,700	3,685.00	13,634,500
ウエルシアホールディングス	26,400	6,200.00	163,680,000
クリエイトSDホールディングス	14,700	2,685.00	39,469,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,600	1,061.00	19,734,600
八洲電機	7,900	850.00	6,715,000
メディアスホールディングス	5,800	750.00	4,350,000
レスターホールディングス	11,000	1,800.00	19,800,000
ジューテックホールディングス	2,300	1,001.00	2,302,300
丸善CHIホールディングス	11,200	372.00	4,166,400
大光	3,100	665.00	2,061,500
OCHIホールディングス	3,000	1,312.00	3,936,000
TOKAIホールディングス	52,700	1,059.00	55,809,300
黒谷	1,900	448.00	851,200
ミサワ	2,100	738.00	1,549,800
ティーライフ	1,500	835.00	1,252,500
C o m i n i x	1,900	844.00	1,603,600
エー・ピーカンパニー	2,100	545.00	1,144,500
三洋貿易	5,100	2,120.00	10,812,000
チムニー	3,000	2,378.00	7,134,000
シュッピン	6,900	1,024.00	7,065,600
ビューティガレージ	1,700	1,693.00	2,878,100
ウイン・パートナーズ	6,500	1,203.00	7,819,500
ネクステージ	14,300	1,071.00	15,315,300
ジョイフル本田	29,300	1,412.00	41,371,600
鳥貴族	3,300	2,197.00	7,250,100
キリン堂ホールディングス	4,000	2,121.00	8,484,000
ホットランド	5,700	1,178.00	6,714,600
すかいらくホールディングス	111,900	1,910.00	213,729,000
SFPホールディングス	4,300	2,143.00	9,214,900
綿半ホールディングス	3,800	2,044.00	7,767,200
日本毛織	32,500	1,077.00	35,002,500
ダイトウボウ	18,600	81.00	1,506,600
トーア紡コーポレーション	4,100	539.00	2,209,900
ダイドーリミテッド	12,200	276.00	3,367,200
ヨシックス	1,600	3,030.00	4,848,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	28,900	948.00	27,397,200
三栄建築設計	4,100	1,518.00	6,223,800
野村不動産ホールディングス	66,700	2,484.00	165,682,800
三重交通グループホールディングス	20,200	574.00	11,594,800

サムティ	14,200	1,987.00	28,215,400
ディア・ライフ	13,200	498.00	6,573,600
コーセーアールイー	3,200	726.00	2,323,200
エー・ディー・ワークス	180,500	31.00	5,595,500
日本商業開発	6,500	1,487.00	9,665,500
プレサンスコーポレーション	16,000	1,749.00	27,984,000
ユニゾホールディングス	15,100	4,700.00	70,970,000
THEグローバル社	5,300	469.00	2,485,700
日本管理センター	6,700	1,481.00	9,922,700
サンセイランディック	3,200	858.00	2,745,600
エストラスト	1,500	787.00	1,180,500
フージャースホールディングス	21,900	649.00	14,213,100
オープンハウス	29,100	2,812.00	81,829,200
東急不動産ホールディングス	269,100	727.00	195,635,700
飯田グループホールディングス	83,300	1,744.00	145,275,200
イーグランド	1,500	719.00	1,078,500
ムゲンエステート	7,200	660.00	4,752,000
帝国繊維	11,200	1,904.00	21,324,800
日本コークス工業	85,500	82.00	7,011,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,500	662.00	2,979,000
ミタチ産業	3,000	715.00	2,145,000
B E E N O S	2,800	1,209.00	3,385,200
あさひ	8,300	1,182.00	9,810,600
日本調剤	3,500	3,875.00	13,562,500
コスモス薬品	4,400	22,440.00	98,736,000
シップヘルスケアホールディングス	20,800	4,660.00	96,928,000
トーエル	5,000	790.00	3,950,000
ソフトクリエイイトホールディングス	4,400	1,643.00	7,229,200
オンリー	1,900	799.00	1,518,100
セブン&アイ・ホールディングス	418,400	4,391.00	1,837,194,400
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	26,900	1,941.00	52,212,900
明治電機工業	3,200	1,371.00	4,387,200
ツルハホールディングス	21,700	12,140.00	263,438,000
デリカフーズホールディングス	3,700	714.00	2,641,800
スターティアホールディングス	2,100	570.00	1,197,000
サンマルクホールディングス	7,900	2,457.00	19,410,300
フェリシモ	2,300	1,020.00	2,346,000
トリドールホールディングス	12,400	2,417.00	29,970,800
帝人	80,800	2,129.00	172,023,200
東レ	770,100	832.60	641,185,260
クラレ	156,300	1,350.00	211,005,000
旭化成	706,200	1,152.00	813,542,400
サカイオーベックス	2,500	1,826.00	4,565,000
T O K Y O B A S E	9,100	768.00	6,988,800
稲葉製作所	5,600	1,436.00	8,041,600
宮地エンジニアリンググループ	3,100	1,756.00	5,443,600
トーカロ	26,000	953.00	24,778,000
アルファ	3,600	1,222.00	4,399,200
S U M C O	120,100	1,697.00	203,809,700

川田テクノロジーズ	2,200	6,950.00	15,290,000
RS Technologies	2,300	4,015.00	9,234,500
信和	5,500	966.00	5,313,000
ビーロット	1,800	1,865.00	3,357,000
ファーストブラザーズ	2,400	1,171.00	2,810,400
ハウズドゥ	4,400	1,867.00	8,214,800
シーアールイー	2,600	1,053.00	2,737,800
プロパティエージェント	1,100	1,018.00	1,119,800
ケイアイスター不動産	2,800	1,908.00	5,342,400
アグレ都市デザイン	1,500	444.00	666,000
グッドコムアセット	1,900	1,855.00	3,524,500
ジェイ・エス・ビー	1,100	4,645.00	5,109,500
住江織物	2,900	2,850.00	8,265,000
日本フェルト	5,700	478.00	2,724,600
イチカワ	1,500	1,497.00	2,245,500
エコナックホールディングス	19,200	126.00	2,419,200
日東製網	1,300	1,601.00	2,081,300
芦森工業	2,100	1,437.00	3,017,700
アツギ	8,100	822.00	6,658,200
ウイルプラスホールディングス	1,100	761.00	837,100
ジャパンミート	5,100	2,218.00	11,311,800
コメダホールディングス	23,200	2,075.00	48,140,000
サツドラホールディングス	1,500	1,745.00	2,617,500
デファクトスタンダード	700	328.00	229,600
アレンザホールディングス	5,400	802.00	4,330,800
串カツ田中ホールディングス	1,600	2,220.00	3,552,000
バロックジャパンリミテッド	8,100	944.00	7,646,400
クスリのアオキホールディングス	9,900	7,790.00	77,121,000
ダイニック	3,900	744.00	2,901,600
共和レザー	6,200	725.00	4,495,000
力の源ホールディングス	3,300	822.00	2,712,600
スシローグローバルホールディングス	11,000	7,560.00	83,160,000
LIXILピバ	8,500	1,701.00	14,458,500
セーレン	24,400	1,264.00	30,841,600
ソトー	3,800	975.00	3,705,000
東海染工	1,400	1,147.00	1,605,800
小松マテーレ	16,200	825.00	13,365,000
ワコールホールディングス	28,000	2,822.00	79,016,000
ホギメディカル	12,300	3,165.00	38,929,500
レナウン	30,900	115.00	3,553,500
クラウドシアホールディングス	2,800	488.00	1,366,400
TSIホールディングス	36,500	594.00	21,681,000
マツオカコーポレーション	3,200	2,013.00	6,441,600
ワールド	13,000	2,398.00	31,174,000
TIS	33,200	6,680.00	221,776,000
ネオス	4,100	752.00	3,083,200
電算システム	3,800	3,005.00	11,419,000
グリー	69,000	496.00	34,224,000
コーエーテクモホールディングス	20,300	2,386.00	48,435,800
三菱総合研究所	4,300	3,745.00	16,103,500

ボルテージ	2,000	529.00	1,058,000
電算	1,200	2,078.00	2,493,600
A G S	5,800	699.00	4,054,200
ファインデックス	8,500	946.00	8,041,000
ブレインパッド	1,900	6,200.00	11,780,000
K L a b	19,200	999.00	19,180,800
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	13,300	1,030.00	13,699,000
イーブックイニシアティブジャパン	1,700	1,741.00	2,959,700
ネクソン	282,500	1,263.00	356,797,500
アイスタイル	25,700	753.00	19,352,100
エムアップ	3,500	1,960.00	6,860,000
エイチーム	6,900	1,073.00	7,403,700
エニグモ	7,100	945.00	6,709,500
テクノスジャパン	8,900	530.00	4,717,000
e n i s h	4,100	881.00	3,612,100
コロプラ	32,600	1,488.00	48,508,800
オルトプラス	6,700	710.00	4,757,000
ブロードリーフ	49,500	598.00	29,601,000
クロス・マーケティンググループ	3,400	352.00	1,196,800
デジタルハーツホールディングス	4,700	907.00	4,262,900
システム情報	5,200	961.00	4,997,200
メディアドゥホールディングス	3,500	3,630.00	12,705,000
じげん	12,000	558.00	6,696,000
バイキューブ	5,900	414.00	2,442,600
サイバーリンクス	1,700	1,128.00	1,917,600
ディー・エル・イー	7,300	174.00	1,270,200
フィックスターズ	10,600	1,480.00	15,688,000
C A R T A H O L D I N G S	4,900	1,006.00	4,929,400
オブティム	4,400	2,790.00	12,276,000
セレス	3,400	1,263.00	4,294,200
特種東海製紙	6,300	3,885.00	24,475,500
ティーガイア	7,100	2,236.00	15,875,600
セック	1,700	2,935.00	4,989,500
日本アジアグループ	10,800	345.00	3,726,000
豆蔵ホールディングス	6,900	1,749.00	12,068,100
テクマトリックス	7,100	2,255.00	16,010,500
プロシップ	3,000	1,269.00	3,807,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	24,000	2,310.00	55,440,000
G M O ペイメントゲートウェイ	16,400	7,720.00	126,608,000
ザッパラス	5,700	382.00	2,177,400
システムリサーチ	2,700	1,798.00	4,854,600
インターネットイニシアティブ	16,200	2,479.00	40,159,800
さくらインターネット	12,200	622.00	7,588,400
ヴィンクス	2,800	1,149.00	3,217,200
G M O クラウド	1,900	2,570.00	4,883,000
S R A ホールディングス	5,300	2,469.00	13,085,700
M I N O R I ソリューションズ	2,000	1,873.00	3,746,000
システムインテグレータ	3,000	772.00	2,316,000

朝日ネット	8,500	677.00	5,754,500
e B A S E	6,100	1,121.00	6,838,100
アバント	3,300	2,094.00	6,910,200
アドソル日進	3,600	2,305.00	8,298,000
フリービット	6,000	912.00	5,472,000
コムチュア	11,200	1,932.00	21,638,400
サイバーコム	1,800	1,770.00	3,186,000
アステリア	5,600	660.00	3,696,000
アイル	1,800	2,549.00	4,588,200
王子ホールディングス	446,800	546.00	243,952,800
日本製紙	47,500	1,833.00	87,067,500
三菱製紙	16,200	480.00	7,776,000
北越コーポレーション	65,600	553.00	36,276,800
中越パルプ工業	4,200	1,535.00	6,447,000
巴川製紙所	3,400	926.00	3,148,400
大王製紙	48,400	1,437.00	69,550,800
阿波製紙	3,100	408.00	1,264,800
マークライNZ	5,000	1,923.00	9,615,000
メディカル・データ・ビジョン	7,600	1,165.00	8,854,000
g u m i	12,900	683.00	8,810,700
ショーケース	2,600	749.00	1,947,400
モバイルファクトリー	2,300	1,666.00	3,831,800
テラスカイ	1,400	1,926.00	2,696,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,500	1,702.00	7,659,000
P C Iホールディングス	1,900	2,003.00	3,805,700
パイプドHD	1,600	1,855.00	2,968,000
アイビーシー	1,900	1,110.00	2,109,000
ネオジャパン	2,000	983.00	1,966,000
P R T I M E S	700	2,677.00	1,873,900
ランドコンピュータ	1,300	1,053.00	1,368,900
ダブルスタンダード	700	5,140.00	3,598,000
オープンドア	5,000	2,057.00	10,285,000
マイネット	3,400	538.00	1,829,200
アカツキ	3,500	6,450.00	22,575,000
ベネフィットジャパン	600	1,630.00	978,000
U b i c o mホールディングス	1,900	1,468.00	2,789,200
L I N E	22,800	3,910.00	89,148,000
カナミックネットワーク	5,100	584.00	2,978,400
ノムラシステムコーポレーション	1,800	630.00	1,134,000
レンゴー	102,300	784.00	80,203,200
トーモク	6,100	1,575.00	9,607,500
ザ・バック	7,500	3,855.00	28,912,500
チェンジ	1,500	2,002.00	3,003,000
シンクロ・フード	4,500	490.00	2,205,000
オークネット	5,700	1,376.00	7,843,200
A O I T Y O H O L D I N G S	10,200	632.00	6,446,400
マクロミル	18,000	882.00	15,876,000
ビーグリー	2,100	971.00	2,039,100
オロ	2,600	2,627.00	6,830,200

サインポスト	1,600	2,092.00	3,347,200	
昭和電工	70,700	2,922.00	206,585,400	
住友化学	780,800	508.00	396,646,400	
住友精化	4,800	3,230.00	15,504,000	
日産化学	60,100	4,275.00	256,927,500	
ラサ工業	3,600	1,366.00	4,917,600	
クレハ	9,200	6,620.00	60,904,000	
多木化学	2,900	4,400.00	12,760,000	
テイカ	8,100	2,055.00	16,645,500	
石原産業	19,100	1,044.00	19,940,400	
片倉コープアグリ	2,900	1,151.00	3,337,900	
日本曹達	15,600	2,749.00	42,884,400	
東ソー	153,400	1,490.00	228,566,000	
トクヤマ	28,600	2,715.00	77,649,000	
セントラル硝子	21,600	2,441.00	52,725,600	
東亜合成	62,300	1,213.00	75,569,900	
大阪ソーダ	10,900	2,837.00	30,923,300	
関東電化工業	23,700	878.00	20,808,600	
デンカ	39,000	3,075.00	119,925,000	
イビデン	62,100	2,346.00	145,686,600	
信越化学工業	174,900	12,000.00	2,098,800,000	
日本カーバイド工業	3,400	1,286.00	4,372,400	
堺化学工業	6,600	2,641.00	17,430,600	
第一稀元素化学工業	10,800	818.00	8,834,400	
エア・ウォーター	81,200	1,998.00	162,237,600	
大陽日酸	81,800	2,431.00	198,855,800	
日本化学工業	3,400	2,973.00	10,108,200	
東邦アセチレン	1,500	1,329.00	1,993,500	
日本パーカライジング	54,100	1,213.00	65,623,300	
高圧ガス工業	15,700	829.00	13,015,300	
チタン工業	1,300	2,446.00	3,179,800	
四国化成工業	16,700	1,175.00	19,622,500	
戸田工業	2,100	2,129.00	4,470,900	
ステラ ケミファ	5,900	2,694.00	15,894,600	
保土谷化学工業	3,500	3,480.00	12,180,000	
日本触媒	16,700	6,540.00	109,218,000	
大日精化工業	8,200	3,240.00	26,568,000	
カネカ	25,700	3,470.00	89,179,000	
協和キリン	102,000	2,005.00	204,510,000	
三菱瓦斯化学	100,900	1,505.00	151,854,500	
三井化学	90,000	2,551.00	229,590,000	
J S R	99,600	1,797.00	178,981,200	
東京応化工業	17,000	4,285.00	72,845,000	
大阪有機化学工業	9,200	1,084.00	9,972,800	
三菱ケミカルホールディングス	663,300	821.70	545,033,610	
K Hネオケム	17,500	2,464.00	43,120,000	
ダイセル	146,200	937.00	136,989,400	
住友ベークライト	17,200	4,375.00	75,250,000	
積水化学工業	213,300	1,748.00	372,848,400	
日本ゼオン	89,500	1,355.00	121,272,500	

アイカ工業	29,800	3,400.00	101,320,000
宇部興産	50,100	2,263.00	113,376,300
積水樹脂	16,300	2,113.00	34,441,900
タキロンシーアイ	21,400	635.00	13,589,000
旭有機材	6,900	1,341.00	9,252,900
日立化成	45,900	3,530.00	162,027,000
ニチパン	5,300	1,732.00	9,179,600
リケンテクノス	27,000	488.00	13,176,000
大倉工業	4,700	1,761.00	8,276,700
積水化成成品工業	14,800	766.00	11,336,800
群栄化学工業	2,600	2,413.00	6,273,800
タイガースポリマー	5,600	623.00	3,488,800
ミライアル	3,000	1,397.00	4,191,000
ダイキアクシス	3,700	877.00	3,244,900
ダイキョーニシカワ	21,000	820.00	17,220,000
竹本容器	3,700	965.00	3,570,500
森六ホールディングス	5,300	2,399.00	12,714,700
日本化薬	61,400	1,322.00	81,170,800
カーリットホールディングス	10,700	616.00	6,591,200
E P Sホールディングス	14,700	1,284.00	18,874,800
ソルクシーズ	4,300	957.00	4,115,100
レグス	2,500	1,721.00	4,302,500
プレステージ・インターナショナル	36,400	883.00	32,141,200
フェイス	4,100	806.00	3,304,600
プロトコーポレーション	9,000	1,188.00	10,692,000
ハイマックス	1,300	1,829.00	2,377,700
アミューズ	5,900	2,827.00	16,679,300
野村総合研究所	189,800	2,296.00	435,780,800
ドリームインキュベータ	3,000	1,550.00	4,650,000
サイバネットシステム	7,400	704.00	5,209,600
クイック	6,200	1,418.00	8,791,600
T A C	5,800	199.00	1,154,200
C Eホールディングス	6,100	420.00	2,562,000
ケネディクス	92,400	570.00	52,668,000
日本システム技術	1,700	1,227.00	2,085,900
電通	99,900	3,690.00	368,631,000
インテージホールディングス	12,600	932.00	11,743,200
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,800	1,203.00	4,571,400
東邦システムサイエンス	3,100	1,015.00	3,146,500
ぴあ	2,800	4,610.00	12,908,000
イオンファンタジー	3,100	3,360.00	10,416,000
ソースネクスト	38,800	493.00	19,128,400
シーティーエス	11,100	760.00	8,436,000
ネクシィーズグループ	3,300	1,970.00	6,501,000
インフォコム	10,900	2,402.00	26,181,800
メディカルシステムネットワーク	10,700	521.00	5,574,700
日本精化	8,000	1,233.00	9,864,000
扶桑化学工業	10,100	2,537.00	25,623,700
トリケミカル研究所	2,200	6,180.00	13,596,000
ラクスル	5,300	3,490.00	18,497,000

FIG	10,000	320.00	3,200,000	
ADEKA	48,900	1,458.00	71,296,200	
日油	37,400	3,595.00	134,453,000	
ミヨシ油脂	4,000	1,182.00	4,728,000	
新日本理化	18,200	200.00	3,640,000	
ハリマ化成グループ	8,200	1,262.00	10,348,400	
アルテリア・ネットワークス	11,100	1,457.00	16,172,700	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,300	1,730.00	3,979,000	
花王	242,700	8,324.00	2,020,234,800	
第一工業製薬	3,700	3,185.00	11,784,500	
石原ケミカル	2,500	1,623.00	4,057,500	
日華化学	3,500	892.00	3,122,000	
ニイタカ	1,600	1,575.00	2,520,000	
三洋化成工業	6,700	5,060.00	33,902,000	
武田薬品工業	884,900	3,786.00	3,350,231,400	
アステラス製薬	891,600	1,638.00	1,460,440,800	
大日本住友製薬	75,200	1,813.00	136,337,600	
塩野義製薬	129,600	5,867.00	760,363,200	
田辺三菱製薬	105,900	1,264.00	133,857,600	
わかもと製薬	12,900	257.00	3,315,300	
あすか製薬	12,600	1,108.00	13,960,800	
日本新薬	26,500	9,530.00	252,545,000	
ピオフェルミン製薬	1,700	2,176.00	3,699,200	
中外製薬	105,700	8,230.00	869,911,000	
科研製薬	17,300	5,020.00	86,846,000	
エーザイ	121,300	5,488.00	665,694,400	
理研ビタミン	4,800	3,585.00	17,208,000	
ロート製薬	52,000	3,080.00	160,160,000	
小野薬品工業	239,400	1,951.50	467,189,100	
久光製薬	29,900	5,100.00	152,490,000	
有機合成薬品工業	8,000	235.00	1,880,000	
持田製薬	15,300	4,155.00	63,571,500	
参天製薬	188,800	1,867.00	352,489,600	
扶桑薬品工業	3,600	1,992.00	7,171,200	
日本ケミファ	1,400	2,792.00	3,908,800	
ツムラ	31,400	2,966.00	93,132,400	
日医工	26,600	1,233.00	32,797,800	
テルモ	286,800	3,427.00	982,863,600	
みらかホールディングス	27,100	2,536.00	68,725,600	
キッセイ薬品工業	17,900	2,732.00	48,902,800	
生化学工業	19,700	1,191.00	23,462,700	
栄研化学	17,900	1,595.00	28,550,500	
日水製薬	4,200	1,210.00	5,082,000	
鳥居薬品	6,400	2,772.00	17,740,800	
JCRファーマ	7,200	8,190.00	58,968,000	
東和薬品	14,600	2,502.00	36,529,200	
富士製薬工業	6,900	1,339.00	9,239,100	
沢井製薬	20,800	5,550.00	115,440,000	
ゼリア新薬工業	20,000	1,930.00	38,600,000	

第一三共	290,100	6,939.00	2,013,003,900	
キョーリン製薬ホールディングス	22,300	1,810.00	40,363,000	
大幸薬品	4,600	2,684.00	12,346,400	
ダイト	5,900	2,965.00	17,493,500	
大塚ホールディングス	193,100	4,373.00	844,426,300	
大正製薬ホールディングス	21,400	7,930.00	169,702,000	
ペプチドリーム	51,300	4,910.00	251,883,000	
大日本塗料	11,200	1,098.00	12,297,600	
日本ペイントホールディングス	81,900	6,090.00	498,771,000	
関西ペイント	111,600	2,594.00	289,490,400	
神東塗料	8,700	188.00	1,635,600	
中国塗料	32,700	950.00	31,065,000	
日本特殊塗料	7,500	1,117.00	8,377,500	
藤倉化成	13,300	539.00	7,168,700	
太陽ホールディングス	8,200	3,765.00	30,873,000	
D I C	41,800	3,110.00	129,998,000	
サカタインクス	21,700	1,169.00	25,367,300	
東洋インキS Cホールディングス	20,900	2,568.00	53,671,200	
T & K T O K A	7,600	990.00	7,524,000	
アルプス技研	8,700	1,516.00	13,189,200	
サニックス	17,200	407.00	7,000,400	
ダイオーズ	2,300	1,393.00	3,203,900	
日本空調サービス	11,200	696.00	7,795,200	
オリエンタルランド	114,500	16,635.00	1,904,707,500	
フォーカスシステムズ	6,900	862.00	5,947,800	
ダスキン	24,800	2,861.00	70,952,800	
パーク24	53,700	2,586.00	138,868,200	
明光ネットワークジャパン	11,500	960.00	11,040,000	
ファルコホールディングス	5,400	1,634.00	8,823,600	
クレスコ	3,000	3,180.00	9,540,000	
フジ・メディア・ホールディングス	103,100	1,415.00	145,886,500	
秀英予備校	2,300	434.00	998,200	
田谷	2,000	602.00	1,204,000	
ラウンドワン	30,100	1,402.00	42,200,200	
リゾートトラスト	41,000	1,767.00	72,447,000	
オービック	34,500	12,370.00	426,765,000	
ジャストシステム	14,200	4,300.00	61,060,000	
T D C ソフト	8,900	839.00	7,467,100	
Zホールディングス	649,400	333.00	216,250,200	
ビー・エム・エル	12,500	3,030.00	37,875,000	
ワタベウェディング	1,700	561.00	953,700	
トレンドマイクロ	44,200	5,320.00	235,144,000	
りらいあコミュニケーションズ	17,600	1,368.00	24,076,800	
I Dホールディングス	3,400	1,264.00	4,297,600	
リソー教育	49,300	423.00	20,853,900	
日本オラクル	20,200	9,290.00	187,658,000	
早稲田アカデミー	2,900	888.00	2,575,200	
アルファシステムズ	3,100	2,800.00	8,680,000	
フューチャー	12,000	1,912.00	22,944,000	
C A C H o l d i n g s	6,500	1,306.00	8,489,000	

S Bテクノロジー	4,300	1,957.00	8,415,100
トーセ	2,800	834.00	2,335,200
ユー・エス・エス	118,400	2,037.00	241,180,800
オービックビジネスコンサルタント	10,200	4,270.00	43,554,000
伊藤忠テクノソリューションズ	45,400	2,947.00	133,793,800
アイティフォー	12,200	869.00	10,601,800
東京個別指導学院	3,500	893.00	3,125,500
東計電算	1,500	3,220.00	4,830,000
サイバーエージェント	55,800	4,040.00	225,432,000
楽天	451,700	1,007.00	454,861,900
エックスネット	2,000	975.00	1,950,000
クリーク・アンド・リバー社	5,800	1,140.00	6,612,000
テー・オー・ダブリュー	8,800	760.00	6,688,000
大塚商会	53,800	4,105.00	220,849,000
サイボウズ	11,700	1,029.00	12,039,300
ソフトブレーン	6,100	690.00	4,209,000
山田コンサルティンググループ	4,800	1,783.00	8,558,400
セントラルスポーツ	3,600	3,255.00	11,718,000
バラカ	2,600	1,997.00	5,192,200
電通国際情報サービス	6,200	3,480.00	21,576,000
デジタルガレージ	19,400	3,445.00	66,833,000
イーエムシステムズ	8,100	1,877.00	15,203,700
ウェザーニューズ	3,400	3,350.00	11,390,000
C I J	7,600	832.00	6,323,200
ビジネスエンジニアリング	1,100	2,927.00	3,219,700
日本エンタープライズ	11,600	234.00	2,714,400
WOWOW	4,700	2,586.00	12,154,200
スカラ	7,200	947.00	6,818,400
インテリジェント ウェイブ	3,900	772.00	3,010,800
フルキャストホールディングス	9,800	2,198.00	21,540,400
エン・ジャパン	14,100	4,075.00	57,457,500
富士フイルムホールディングス	210,500	4,719.00	993,349,500
コニカミノルタ	221,400	764.00	169,149,600
資生堂	201,400	8,707.00	1,753,589,800
ライオン	131,800	2,174.00	286,533,200
高砂香料工業	7,000	2,612.00	18,284,000
マンダム	22,800	2,714.00	61,879,200
ミルボン	13,600	5,650.00	76,840,000
ファンケル	45,200	2,844.00	128,548,800
コーセー	17,200	18,880.00	324,736,000
コタ	5,400	1,269.00	6,852,600
シーボン	1,200	2,423.00	2,907,600
ポーラ・オルビスホールディングス	43,300	2,537.00	109,852,100
ノエビアホールディングス	9,700	5,600.00	54,320,000
アジュバンコスメジャパン	2,300	945.00	2,173,500
エステー	7,200	1,549.00	11,152,800
アグロ カネショウ	3,200	1,539.00	4,924,800
コニシ	17,900	1,526.00	27,315,400
長谷川香料	13,400	1,982.00	26,558,800
星光PMC	5,900	800.00	4,720,000

小林製薬	28,400	8,680.00	246,512,000
荒川化学工業	9,100	1,581.00	14,387,100
メック	7,000	1,664.00	11,648,000
日本高純度化学	2,800	2,460.00	6,888,000
タカラバイオ	26,600	2,158.00	57,402,800
J C U	13,200	2,408.00	31,785,600
新田ゼラチン	6,600	680.00	4,488,000
O A T アグリオ	1,500	1,628.00	2,442,000
デクセリアルズ	26,200	831.00	21,772,200
アース製薬	7,600	5,540.00	42,104,000
北興化学工業	10,500	524.00	5,502,000
大成ラミック	3,300	2,851.00	9,408,300
クミアイ化学工業	42,000	1,005.00	42,210,000
日本農薬	18,300	522.00	9,552,600
富士興産	4,000	677.00	2,708,000
ニチレキ	13,000	1,155.00	15,015,000
ユシロ化学工業	5,300	1,351.00	7,160,300
ビーピー・カストロール	3,600	1,435.00	5,166,000
富士石油	24,700	249.00	6,150,300
M O R E S C O	3,700	1,306.00	4,832,200
出光興産	117,000	3,100.00	362,700,000
J X T G ホールディングス	1,676,500	491.50	823,999,750
コスモエネルギーホールディングス	29,400	2,237.00	65,767,800
横浜ゴム	58,600	2,261.00	132,494,600
T O Y O T I R E	58,300	1,364.00	79,521,200
ブリヂストン	311,500	4,294.00	1,337,581,000
住友ゴム工業	90,900	1,343.00	122,078,700
藤倉コンポジット	9,200	429.00	3,946,800
オカモト	6,800	4,065.00	27,642,000
アキレス	7,000	1,796.00	12,572,000
フコク	4,500	707.00	3,181,500
ニッタ	11,400	2,918.00	33,265,200
クリエートメディック	3,400	977.00	3,321,800
住友理工	19,600	915.00	17,934,000
三ツ星ベルト	13,400	1,921.00	25,741,400
バンドー化学	19,300	861.00	16,617,300
A G C	100,200	3,445.00	345,189,000
日本板硝子	48,500	669.00	32,446,500
石塚硝子	1,500	2,094.00	3,141,000
有沢製作所	16,000	1,054.00	16,864,000
日本山村硝子	4,300	1,268.00	5,452,400
日本電気硝子	40,700	2,423.00	98,616,100
オハラ	4,100	1,553.00	6,367,300
住友大阪セメント	20,500	4,755.00	97,477,500
太平洋セメント	64,000	2,909.00	186,176,000
リソルホールディングス	1,000	3,970.00	3,970,000
日本ヒューム	10,300	803.00	8,270,900
日本コンクリート工業	22,300	314.00	7,002,200
三谷セキサン	4,700	3,335.00	15,674,500
アジアパイルホールディングス	14,600	538.00	7,854,800

東海カーボン	106,300	1,104.00	117,355,200
日本カーボン	5,200	3,975.00	20,670,000
東洋炭素	6,000	2,419.00	14,514,000
ノリタケカンパニーリミテド	6,100	4,160.00	25,376,000
TOTO	78,000	4,145.00	323,310,000
日本碍子	123,600	1,549.00	191,456,400
日本特殊陶業	85,500	2,086.00	178,353,000
ダントーホールディングス	9,200	115.00	1,058,000
MARUWA	3,500	7,450.00	26,075,000
品川リフラクトリーズ	2,700	2,756.00	7,441,200
黒崎播磨	2,000	5,900.00	11,800,000
ヨータイ	9,000	665.00	5,985,000
イソライト工業	5,400	462.00	2,494,800
東京窯業	13,300	300.00	3,990,000
ニッカトー	4,800	741.00	3,556,800
フジインコーポレーテッド	9,000	2,593.00	23,337,000
クニミネ工業	4,000	947.00	3,788,000
エーアンドエーマテリアル	2,000	1,066.00	2,132,000
ニチアス	27,800	1,983.00	55,127,400
日本製鉄	465,400	1,521.50	708,106,100
神戸製鋼所	183,300	573.00	105,030,900
中山製鋼所	13,800	460.00	6,348,000
合同製鐵	4,900	2,252.00	11,034,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	270,600	1,332.00	360,439,200
東京製鐵	53,800	856.00	46,052,800
共英製鋼	11,300	1,971.00	22,272,300
大和工業	21,300	2,775.00	59,107,500
東京鐵鋼	4,200	1,366.00	5,737,200
大阪製鐵	6,600	1,349.00	8,903,400
淀川製鋼所	13,500	2,090.00	28,215,000
丸一鋼管	35,500	2,843.00	100,926,500
モリ工業	3,100	2,133.00	6,612,300
大同特殊鋼	16,400	4,650.00	76,260,000
日本高周波鋼業	3,600	411.00	1,479,600
日本冶金工業	8,300	2,347.00	19,480,100
山陽特殊製鋼	12,600	1,474.00	18,572,400
愛知製鋼	5,600	3,420.00	19,152,000
日立金属	107,900	1,227.00	132,393,300
日本金属	2,400	839.00	2,013,600
大平洋金属	6,800	2,363.00	16,068,400
新日本電工	65,000	181.00	11,765,000
栗本鐵工所	5,000	1,609.00	8,045,000
虹 技	1,600	1,402.00	2,243,200
日本鑄鉄管	1,100	1,100.00	1,210,000
日本製鋼所	30,400	2,208.00	67,123,200
三菱製鋼	7,400	1,148.00	8,495,200
日亜鋼業	15,100	321.00	4,847,100
日本精線	1,500	2,424.00	3,636,000
エンピプロ・ホールディングス	2,600	639.00	1,661,400

大紀アルミニウム工業所	16,500	719.00	11,863,500	
日本軽金属ホールディングス	272,800	204.00	55,651,200	
三井金属鉱業	27,100	2,713.00	73,522,300	
東邦亜鉛	5,600	2,120.00	11,872,000	
三菱マテリアル	66,100	2,975.00	196,647,500	
住友金属鉱山	137,300	3,435.00	471,625,500	
DOWAホールディングス	23,400	3,750.00	87,750,000	
古河機械金属	16,500	1,491.00	24,601,500	
エス・サイエンス	47,600	53.00	2,522,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,600	1,683.00	19,522,800	
東邦チタニウム	18,000	857.00	15,426,000	
UACJ	15,200	1,889.00	28,712,800	
CKサンエツ	1,900	2,838.00	5,392,200	
古河電気工業	28,900	2,794.00	80,746,600	
住友電気工業	374,400	1,415.50	529,963,200	
フジクラ	121,100	444.00	53,768,400	
昭和電線ホールディングス	11,700	921.00	10,775,700	
東京特殊電線	1,300	2,119.00	2,754,700	
タツタ電線	20,000	493.00	9,860,000	
カナレ電気	1,700	1,897.00	3,224,900	
平河ヒューテック	4,200	1,085.00	4,557,000	
リョービ	12,300	1,847.00	22,718,100	
アーレスティ	12,300	562.00	6,912,600	
アサヒホールディングス	18,800	2,256.00	42,412,800	
東洋製罐グループホールディングス	63,900	1,734.00	110,802,600	
ホッカンホールディングス	5,100	1,631.00	8,318,100	
コロナ	5,500	1,061.00	5,835,500	
横河ブリッジホールディングス	18,700	1,744.00	32,612,800	
OSJBホールディングス	50,700	256.00	12,979,200	
駒井ハルテック	1,900	1,713.00	3,254,700	
高田機工	900	2,586.00	2,327,400	
三和ホールディングス	103,500	1,262.00	130,617,000	
文化シャッター	29,500	939.00	27,700,500	
三協立山	13,900	1,197.00	16,638,300	
アルインコ	8,100	1,105.00	8,950,500	
東洋シャッター	2,500	724.00	1,810,000	
LIXILグループ	147,900	1,944.00	287,517,600	
日本フィルコン	7,800	500.00	3,900,000	
ノーリツ	20,700	1,313.00	27,179,100	
長府製作所	10,100	2,498.00	25,229,800	
リンナイ	17,900	7,510.00	134,429,000	
ユニプレス	19,600	1,724.00	33,790,400	
ダイニチ工業	5,400	685.00	3,699,000	
日東精工	14,000	576.00	8,064,000	
三洋工業	1,400	1,945.00	2,723,000	
岡部	20,200	885.00	17,877,000	
ジーテクト	11,000	1,745.00	19,195,000	
中国工業	1,700	489.00	831,300	
東プレ	18,700	1,785.00	33,379,500	
高周波熱錬	19,300	911.00	17,582,300	

東京製綱	6,200	1,047.00	6,491,400
サンコール	5,700	461.00	2,627,700
モリテックスチール	8,000	341.00	2,728,000
パイオラックス	16,000	1,937.00	30,992,000
エイチワン	9,900	666.00	6,593,400
日本発条	99,800	847.00	84,530,600
中央発條	1,200	2,782.00	3,338,400
アドバネクス	1,300	1,708.00	2,220,400
三浦工業	43,400	3,170.00	137,578,000
タクマ	36,500	1,252.00	45,698,000
テクノプロ・ホールディングス	19,400	6,560.00	127,264,000
アトラ	2,300	376.00	864,800
インターワークス	2,300	504.00	1,159,200
アイ・アールジャパンホールディングス	3,500	3,700.00	12,950,000
Keep er 技研	3,700	1,513.00	5,598,100
ファーストロジック	2,300	620.00	1,426,000
三機サービス	1,900	922.00	1,751,800
Gunosy	6,800	1,475.00	10,030,000
デザインワン・ジャパン	2,300	312.00	717,600
イー・ガーディアン	5,100	1,682.00	8,578,200
リブセンス	6,000	263.00	1,578,000
ジャパンマテリアル	26,600	1,472.00	39,155,200
ベクトル	12,300	856.00	10,528,800
ウチヤマホールディングス	5,100	490.00	2,499,000
チャーム・ケア・コーポレーション	3,200	2,449.00	7,836,800
ライクキッズ	2,400	893.00	2,143,200
キャリアリンク	4,000	601.00	2,404,000
IBJ	6,700	1,005.00	6,733,500
アサンテ	4,000	2,030.00	8,120,000
N・フィールド	6,900	613.00	4,229,700
バリューHR	1,900	3,330.00	6,327,000
M&Aキャピタルパートナーズ	3,500	6,810.00	23,835,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,100	1,443.00	5,916,300
ERIホールディングス	2,900	787.00	2,282,300
アビスト	1,600	2,620.00	4,192,000
シグマクシス	4,700	1,450.00	6,815,000
ウィルグループ	6,500	981.00	6,376,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,000	219.00	3,066,000
リクルートホールディングス	693,900	3,465.00	2,404,363,500
エラン	5,800	1,723.00	9,993,400
ツガミ	22,700	930.00	21,111,000
オークマ	12,800	6,150.00	78,720,000
東芝機械	11,300	2,302.00	26,012,600
アマダホールディングス	150,400	1,181.00	177,622,400
アイダエンジニアリング	27,000	880.00	23,760,000
滝澤鉄工所	3,100	1,283.00	3,977,300
FUJI	40,000	1,704.00	68,160,000
牧野フライス製作所	11,700	4,845.00	56,686,500

オーエスジー	46,300	2,142.00	99,174,600
ダイジェット工業	1,200	1,535.00	1,842,000
旭ダイヤモンド工業	26,300	640.00	16,832,000
D M G 森精機	63,400	1,577.00	99,981,800
ソディック	23,600	817.00	19,281,200
ディスコ	13,600	21,800.00	296,480,000
日東工器	5,500	2,241.00	12,325,500
日進工具	3,000	2,006.00	6,018,000
パンチ工業	7,100	483.00	3,429,300
富士ダイス	4,600	628.00	2,888,800
土木管理総合試験所	4,500	465.00	2,092,500
日本郵政	793,600	994.00	788,838,400
ベルシステム24ホールディングス	16,300	1,737.00	28,313,100
鎌倉新書	7,300	1,433.00	10,460,900
一蔵	1,300	641.00	833,300
L I T A L I C O	2,300	2,104.00	4,839,200
グローバルキッズCOMPANY	1,400	853.00	1,194,200
エポラブルアジア	4,400	1,954.00	8,597,600
アトラエ	2,500	3,085.00	7,712,500
ストライク	3,700	3,370.00	12,469,000
ソラスト	23,800	1,205.00	28,679,000
セラク	2,600	712.00	1,851,200
インソース	4,500	2,659.00	11,965,500
豊田自動織機	82,000	6,230.00	510,860,000
豊和工業	5,600	753.00	4,216,800
O K K	4,100	714.00	2,927,400
石川製作所	2,500	1,358.00	3,395,000
東洋機械金属	7,200	579.00	4,168,800
津田駒工業	2,000	1,242.00	2,484,000
エンシュウ	2,700	1,120.00	3,024,000
島精機製作所	13,800	2,605.00	35,949,000
オプトラン	11,200	3,205.00	35,896,000
N C ホールディングス	3,600	496.00	1,785,600
イワキ	4,300	973.00	4,183,900
フリー	8,100	938.00	7,597,800
ヤマシンフィルタ	17,600	883.00	15,540,800
日阪製作所	12,300	895.00	11,008,500
やまびこ	19,500	1,186.00	23,127,000
平田機工	4,800	7,430.00	35,664,000
ペガサスミシン製造	9,500	509.00	4,835,500
マルマエ	3,300	968.00	3,194,400
タツモ	3,700	1,187.00	4,391,900
ナブテスコ	59,100	3,375.00	199,462,500
三井海洋開発	10,700	2,724.00	29,146,800
レオン自動機	9,900	1,548.00	15,325,200
S M C	29,700	46,560.00	1,382,832,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	7,800	494.00	3,853,200
ホソカワミクロン	3,500	3,680.00	12,880,000
ユニオンツール	3,700	3,435.00	12,709,500

オイレス工業	14,100	1,613.00	22,743,300
日精エー・エス・ビー機械	3,400	3,725.00	12,665,000
サトーホールディングス	12,100	2,906.00	35,162,600
技研製作所	8,800	3,645.00	32,076,000
日本エアテック	3,300	604.00	1,993,200
カワタ	2,300	963.00	2,214,900
日精樹脂工業	8,400	1,028.00	8,635,200
オカダアイヨン	3,600	1,223.00	4,402,800
ワイエイシーホールディングス	4,300	689.00	2,962,700
小松製作所	458,900	2,480.00	1,138,072,000
住友重機械工業	58,000	3,285.00	190,530,000
日立建機	40,600	2,596.00	105,397,600
日工	14,000	631.00	8,834,000
巴工業	4,300	2,367.00	10,178,100
井関農機	10,100	1,534.00	15,493,400
TOWA	8,900	923.00	8,214,700
丸山製作所	2,200	1,203.00	2,646,600
北川鉄工所	4,500	1,985.00	8,932,500
シンニッタン	15,800	434.00	6,857,200
ローツェ	4,500	3,280.00	14,760,000
タカキタ	3,700	555.00	2,053,500
クボタ	542,900	1,644.50	892,799,050
荏原実業	2,600	2,128.00	5,532,800
東洋エンジニアリング	13,500	721.00	9,733,500
三菱化工機	3,500	1,817.00	6,359,500
月島機械	20,100	1,554.00	31,235,400
帝国電機製作所	7,100	1,221.00	8,669,100
東京機械製作所	4,200	373.00	1,566,600
新東工業	23,900	997.00	23,828,300
澁谷工業	8,900	2,910.00	25,899,000
アイチコーポレーション	17,500	711.00	12,442,500
小森コーポレーション	25,500	1,193.00	30,421,500
鶴見製作所	7,900	2,078.00	16,416,200
住友精密工業	1,700	3,145.00	5,346,500
酒井重工業	1,900	2,875.00	5,462,500
荏原製作所	44,900	2,903.00	130,344,700
石井鐵工所	1,600	2,295.00	3,672,000
西島製作所	10,300	1,000.00	10,300,000
北越工業	10,400	1,229.00	12,781,600
ダイキン工業	138,400	14,440.00	1,998,496,000
オルガノ	3,700	5,070.00	18,759,000
トーヨーカネツ	3,900	1,966.00	7,667,400
栗田工業	54,800	2,860.00	156,728,000
椿本チエイン	13,200	3,545.00	46,794,000
大同工業	4,700	813.00	3,821,100
日機装	30,400	1,139.00	34,625,600
木村化工機	8,500	396.00	3,366,000
レイズネクスト	20,400	1,100.00	22,440,000
アネスト岩田	15,800	1,028.00	16,242,400
ダイフク	55,800	5,750.00	320,850,000

サムコ	3,000	950.00	2,850,000
加藤製作所	5,200	1,961.00	10,197,200
油研工業	1,700	1,645.00	2,796,500
タダノ	48,900	1,051.00	51,393,900
フジテック	36,800	1,412.00	51,961,600
C K D	28,300	1,427.00	40,384,100
キトー	7,700	1,610.00	12,397,000
平和	28,200	2,189.00	61,729,800
理想科学工業	8,900	1,715.00	15,263,500
S A N K Y O	25,300	3,775.00	95,507,500
日本金銭機械	11,200	946.00	10,595,200
マースグループホールディングス	6,400	2,015.00	12,896,000
福島工業	6,300	3,245.00	20,443,500
オーイズミ	4,500	534.00	2,403,000
ダイコク電機	4,700	1,477.00	6,941,900
竹内製作所	17,000	1,794.00	30,498,000
アマノ	28,900	3,180.00	91,902,000
J U K I	14,100	929.00	13,098,900
サンデンホールディングス	12,700	653.00	8,293,100
蛇の目ミシン工業	9,000	406.00	3,654,000
ブラザー工業	132,000	2,004.00	264,528,000
マックス	15,400	1,874.00	28,859,600
モリタホールディングス	17,700	1,805.00	31,948,500
グローリー	28,000	3,045.00	85,260,000
新晃工業	9,500	1,802.00	17,119,000
大和冷機工業	14,700	1,200.00	17,640,000
セガサミーホールディングス	100,500	1,564.00	157,182,000
日本ピストンリング	3,700	1,296.00	4,795,200
リケン	4,700	3,905.00	18,353,500
T P R	13,600	1,791.00	24,357,600
ツバキ・ナカシマ	20,700	1,665.00	34,465,500
ホシザキ	29,600	8,640.00	255,744,000
大豊工業	8,500	775.00	6,587,500
日本精工	208,200	974.00	202,786,800
N T N	217,600	328.00	71,372,800
ジェイテクト	97,100	1,283.00	124,579,300
不二越	9,400	4,980.00	46,812,000
ミネベアミツミ	188,200	1,877.00	353,251,400
日本トムソン	30,300	465.00	14,089,500
T H K	59,000	2,843.00	167,737,000
ユーシン精機	7,900	941.00	7,433,900
前澤給装工業	4,000	2,046.00	8,184,000
イーグル工業	12,400	1,030.00	12,772,000
前澤工業	6,700	374.00	2,505,800
日本ピラー工業	10,400	1,341.00	13,946,400
キッツ	41,200	709.00	29,210,800
日立製作所	456,300	4,109.00	1,874,936,700
三菱電機	1,013,500	1,478.50	1,498,459,750
富士電機	65,800	3,375.00	222,075,000
東洋電機製造	4,000	1,611.00	6,444,000

安川電機	117,500	3,940.00	462,950,000
シンフォニアテクノロジー	14,100	1,275.00	17,977,500
明電舎	20,100	1,922.00	38,632,200
オリジン	2,800	1,396.00	3,908,800
山洋電気	4,900	4,970.00	24,353,000
デンヨー	9,400	1,726.00	16,224,400
ベイカレント・コンサルティング	6,900	4,930.00	34,017,000
Orchestra Holdings	2,000	1,058.00	2,116,000
アイモバイル	2,800	526.00	1,472,800
キャリアインデックス	3,600	403.00	1,450,800
MS-Japan	4,000	1,266.00	5,064,000
船場	1,700	950.00	1,615,000
グレイステクノロジー	3,100	2,995.00	9,284,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,700	2,677.00	20,612,900
フルテック	1,200	1,288.00	1,545,600
グリーンズ	2,700	1,303.00	3,518,100
ツナググループ・ホールディングス	1,000	595.00	595,000
ソウルドアウト	1,100	1,308.00	1,438,800
日総工業	5,300	1,214.00	6,434,200
キュービーネットホールディングス	6,000	2,241.00	13,446,000
RPAホールディングス	4,100	1,264.00	5,182,400
三櫻工業	13,000	881.00	11,453,000
マキタ	123,400	3,245.00	400,433,000
東芝テック	12,700	3,565.00	45,275,500
芝浦メカトロニクス	1,800	3,030.00	5,454,000
マブチモーター	28,000	4,010.00	112,280,000
日本電産	122,000	14,620.00	1,783,640,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,600	492.00	2,755,200
トレックス・セミコンダクター	4,000	1,375.00	5,500,000
東光高岳	5,100	1,197.00	6,104,700
ダブル・スコープ	13,900	565.00	7,853,500
宮越ホールディングス	3,800	1,030.00	3,914,000
ダイヘン	11,100	3,295.00	36,574,500
ヤーマン	14,800	705.00	10,434,000
JVCケンウッド	77,700	317.00	24,630,900
ミマキエンジニアリング	9,200	525.00	4,830,000
第一精工	3,700	2,552.00	9,442,400
日新電機	23,800	1,366.00	32,510,800
大崎電気工業	20,300	707.00	14,352,100
オムロン	107,700	6,020.00	648,354,000
日東工業	16,300	2,115.00	34,474,500
I D E C	13,600	2,057.00	27,975,200
不二電機工業	1,200	1,236.00	1,483,200
ジーエス・ユアサコーポレーション	36,400	1,895.00	68,978,000
サクサホールディングス	2,500	1,838.00	4,595,000
メルコホールディングス	4,200	2,765.00	11,613,000
テクノメディカ	2,300	2,091.00	4,809,300

ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	1,500	1,054.00	1,581,000	
日本電気	131,200	4,575.00	600,240,000	
富士通	97,700	8,781.00	857,903,700	
沖電気工業	43,800	1,457.00	63,816,600	
岩崎通信機	4,800	814.00	3,907,200	
電気興業	5,300	3,455.00	18,311,500	
サンケン電気	11,900	2,402.00	28,583,800	
ナカヨ	1,900	1,579.00	3,000,100	
アイホン	5,800	1,671.00	9,691,800	
ルネサスエレクトロニクス	483,200	735.00	355,152,000	
セイコーエプソン	125,600	1,487.00	186,767,200	
ワコム	73,600	365.00	26,864,000	
アルバック	20,200	4,715.00	95,243,000	
アクセル	4,400	607.00	2,670,800	
E I Z O	9,300	3,830.00	35,619,000	
ジャパンディスプレイ	240,600	58.00	13,954,800	
日本信号	25,900	1,220.00	31,598,000	
京三製作所	22,000	404.00	8,888,000	
能美防災	13,400	2,056.00	27,550,400	
ホーチキ	6,500	1,444.00	9,386,000	
星和電機	4,100	537.00	2,201,700	
エレコム	9,600	4,010.00	38,496,000	
パナソニック	1,157,700	896.90	1,038,341,130	
シャープ	100,600	1,232.00	123,939,200	
アンリツ	65,300	2,114.00	138,044,200	
富士通ゼネラル	30,900	1,802.00	55,681,800	
ソニー	680,400	6,311.00	4,294,004,400	
T D K	53,000	10,280.00	544,840,000	
帝国通信工業	4,500	1,190.00	5,355,000	
タムラ製作所	39,100	618.00	24,163,800	
アルプスアルパイン	105,500	2,102.00	221,761,000	
池上通信機	3,200	1,110.00	3,552,000	
日本電波工業	9,300	483.00	4,491,900	
鈴木	5,400	638.00	3,445,200	
日本トリム	1,900	4,680.00	8,892,000	
ローランド ディー・ジー	5,500	2,085.00	11,467,500	
フォスター電機	11,400	2,034.00	23,187,600	
S M K	2,800	2,794.00	7,823,200	
ヨコオ	7,200	3,100.00	22,320,000	
ティアック	8,400	200.00	1,680,000	
ホシデン	29,900	1,066.00	31,873,400	
ヒロセ電機	14,500	13,530.00	196,185,000	
日本航空電子工業	23,200	1,696.00	39,347,200	
T O A	10,900	1,229.00	13,396,100	
マクセルホールディングス	21,800	1,547.00	33,724,600	
古野電気	13,100	1,039.00	13,610,900	
ユニデンホールディングス	3,000	2,009.00	6,027,000	
スミダコーポレーション	7,800	1,083.00	8,447,400	
アイコム	5,600	2,362.00	13,227,200	

リオン	4,700	2,624.00	12,332,800
本多通信工業	8,800	503.00	4,426,400
船井電機	10,300	587.00	6,046,100
横河電機	101,400	1,896.00	192,254,400
新電元工業	3,600	3,600.00	12,960,000
アズビル	64,000	2,923.00	187,072,000
東亜ディーケーケー	5,100	853.00	4,350,300
日本光電工業	44,700	3,100.00	138,570,000
チノー	3,500	1,416.00	4,956,000
共和電業	10,600	424.00	4,494,400
日本電子材料	4,200	582.00	2,444,400
堀場製作所	20,100	6,670.00	134,067,000
アドバンテスト	69,100	5,110.00	353,101,000
小野測器	4,200	514.00	2,158,800
エスベック	9,000	1,894.00	17,046,000
キーエンス	49,700	65,510.00	3,255,847,000
日置電機	5,300	3,540.00	18,762,000
シスメックス	79,000	6,999.00	552,921,000
日本マイクロニクス	17,800	936.00	16,660,800
メガチップス	8,000	1,773.00	14,184,000
OBARA GROUP	5,300	3,855.00	20,431,500
IMAGICA GROUP	8,500	541.00	4,598,500
澤藤電機	1,300	1,803.00	2,343,900
デンソー	223,200	4,861.00	1,084,975,200
原田工業	3,700	855.00	3,163,500
コーセル	12,400	1,120.00	13,888,000
イリソ電子工業	9,300	5,090.00	47,337,000
オブテックスグループ	16,700	1,678.00	28,022,600
千代田インテグレ	4,500	2,258.00	10,161,000
アイ・オー・データ機器	3,800	881.00	3,347,800
レーザーテック	20,800	7,800.00	162,240,000
スタンレー電気	71,500	2,961.00	211,711,500
岩崎電気	4,000	1,357.00	5,428,000
ウシオ電機	58,800	1,523.00	89,552,400
岡谷電機産業	7,400	375.00	2,775,000
ヘリオス テクノ ホールディング	9,500	590.00	5,605,000
エノモト	2,500	1,048.00	2,620,000
日本セラミック	10,200	2,749.00	28,039,800
遠藤照明	5,200	676.00	3,515,200
古河電池	7,400	627.00	4,639,800
双信電機	5,200	426.00	2,215,200
山一電機	7,400	1,332.00	9,856,800
図研	6,600	1,872.00	12,355,200
日本電子	20,000	2,696.00	53,920,000
カシオ計算機	89,700	1,691.00	151,682,700
ファナック	96,300	20,025.00	1,928,407,500
日本シイエムケイ	25,900	639.00	16,550,100
エンプラス	4,600	3,555.00	16,353,000
大真空	3,800	1,054.00	4,005,200
ローム	48,500	8,880.00	430,680,000

浜松ホトニクス	72,700	4,110.00	298,797,000	
三井ハイテック	11,200	1,839.00	20,596,800	
新光電気工業	34,100	1,013.00	34,543,300	
京セラ	154,500	6,836.00	1,056,162,000	
協栄産業	1,200	1,346.00	1,615,200	
太陽誘電	45,100	2,727.00	122,987,700	
村田製作所	319,000	5,794.00	1,848,286,000	
双葉電子工業	15,900	1,355.00	21,544,500	
日東電工	69,900	5,479.00	382,982,100	
北陸電気工業	3,800	1,127.00	4,282,600	
東海理化電機製作所	26,600	1,900.00	50,540,000	
ニチコン	31,900	1,047.00	33,399,300	
日本ケミコン	7,200	1,685.00	12,132,000	
K O A	15,300	1,399.00	21,404,700	
三井E & Sホールディングス	36,700	1,012.00	37,140,400	
日立造船	80,300	355.00	28,506,500	
三菱重工業	169,800	4,318.00	733,196,400	
川崎重工業	78,800	2,499.00	196,921,200	
I H I	77,900	2,503.00	194,983,700	
名村造船所	30,700	302.00	9,271,400	
サノヤスホールディングス	13,800	192.00	2,649,600	
スプリックス	3,200	1,433.00	4,585,600	
日本車輛製造	3,700	2,600.00	9,620,000	
三菱ロジスネクスト	16,800	1,026.00	17,236,800	
近畿車輛	1,700	1,444.00	2,454,800	
F P G	31,500	1,080.00	34,020,000	
島根銀行	2,400	677.00	1,624,800	
じもとホールディングス	69,100	99.00	6,840,900	
全国保証	28,200	4,125.00	116,325,000	
めぶきフィナンシャルグループ	518,500	268.00	138,958,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,500	1,388.00	18,738,000	
九州フィナンシャルグループ	163,700	444.00	72,682,800	
かんぽ生命保険	35,400	1,668.00	59,047,200	
ゆうちょ銀行	282,700	1,047.00	295,986,900	
富山第一銀行	24,200	311.00	7,526,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	627,100	419.00	262,754,900	
ジェイリース	2,700	315.00	850,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	62,900	780.00	49,062,000	
マーキュリアインベストメント	4,500	735.00	3,307,500	
イントラスト	3,000	717.00	2,151,000	
日本モーゲージサービス	1,500	1,215.00	1,822,500	
C A S A	4,000	1,208.00	4,832,000	
アルヒ	9,100	2,184.00	19,874,400	
プレミアグループ	5,800	1,851.00	10,735,800	
日産自動車	1,195,000	680.50	813,197,500	
いすゞ自動車	320,500	1,223.00	391,971,500	
トヨタ自動車	1,129,500	7,385.00	8,341,357,500	代用有価証券 500,000株

日野自動車	126,600	926.00	117,231,600
三菱自動車工業	375,300	484.00	181,645,200
エフテック	7,200	697.00	5,018,400
レシップホールディングス	4,000	706.00	2,824,000
GMB	2,200	797.00	1,753,400
ファルテック	1,900	775.00	1,472,500
武蔵精密工業	24,700	1,411.00	34,851,700
日産車体	19,800	922.00	18,255,600
新明和工業	42,400	1,280.00	54,272,000
極東開発工業	20,200	1,385.00	27,977,000
日信工業	18,500	1,549.00	28,656,500
トピー工業	8,400	2,059.00	17,295,600
ティラド	3,700	1,970.00	7,289,000
曙ブレーキ工業	56,100	231.00	12,959,100
タチエス	16,700	1,355.00	22,628,500
NOK	54,300	1,674.00	90,898,200
フタバ産業	28,300	753.00	21,309,900
KYB	10,500	3,260.00	34,230,000
市光工業	15,200	812.00	12,342,400
大同メタル工業	16,500	655.00	10,807,500
プレス工業	50,200	472.00	23,694,400
ミクニ	13,200	318.00	4,197,600
太平洋工業	21,200	1,578.00	33,453,600
ケーヒン	23,300	1,713.00	39,912,900
河西工業	12,400	852.00	10,564,800
アイシン精機	83,400	3,615.00	301,491,000
マツダ	317,900	980.40	311,669,160
今仙電機製作所	9,400	871.00	8,187,400
本田技研工業	855,000	2,899.50	2,479,072,500
スズキ	185,500	4,750.00	881,125,000
SUBARU	314,700	3,056.00	961,723,200
安永	5,000	1,267.00	6,335,000
ヤマハ発動機	132,200	2,081.00	275,108,200
ショーワ	24,000	1,667.00	40,008,000
小糸製作所	60,700	5,420.00	328,994,000
TBK	12,000	425.00	5,100,000
エクセディ	13,700	2,161.00	29,605,700
ミツバ	18,700	658.00	12,304,600
豊田合成	32,700	2,214.00	72,397,800
愛三工業	15,900	932.00	14,818,800
盟和産業	1,600	1,104.00	1,766,400
日本プラスト	7,900	708.00	5,593,200
ヨロズ	9,500	1,379.00	13,100,500
エフ・シー・シー	18,200	2,145.00	39,039,000
新家工業	2,300	1,519.00	3,493,700
シマノ	37,900	15,900.00	602,610,000
テイ・エス テック	23,500	3,395.00	79,782,500
関西みらいフィナンシャルグループ	46,900	680.00	31,892,000
三十三フィナンシャルグループ	8,700	1,611.00	14,015,700
第四北越フィナンシャルグループ	17,300	2,738.00	47,367,400

ジャムコ	5,100	1,502.00	7,660,200
小野建	8,900	1,374.00	12,228,600
はるやまホールディングス	4,500	811.00	3,649,500
南陽	2,100	1,625.00	3,412,500
ノジマ	17,800	1,867.00	33,232,600
佐島電機	7,400	825.00	6,105,000
カッパ・クリエイト	14,000	1,398.00	19,572,000
エコートレーディング	2,300	528.00	1,214,400
伯東	6,800	1,194.00	8,119,200
コンドーテック	7,800	965.00	7,527,000
中山福	5,700	534.00	3,043,800
ライトオン	7,600	603.00	4,582,800
ナガイレーベン	14,400	2,436.00	35,078,400
ジーンズメイト	3,400	318.00	1,081,200
三菱食品	10,800	2,795.00	30,186,000
良品計画	141,400	2,276.00	321,826,400
三城ホールディングス	12,600	282.00	3,553,200
松田産業	7,300	1,446.00	10,555,800
第一興商	14,800	5,090.00	75,332,000
メディカルホールディングス	107,600	2,414.00	259,746,400
アドヴァン	15,200	1,136.00	17,267,200
S P K	2,300	2,568.00	5,906,400
萩原電気ホールディングス	3,700	2,764.00	10,226,800
アルピス	3,800	2,390.00	9,082,000
アズワン	7,200	8,870.00	63,864,000
スズデン	3,500	1,337.00	4,679,500
尾家産業	3,300	1,298.00	4,283,400
シモジマ	6,100	1,167.00	7,118,700
ドウシシャ	9,400	1,725.00	16,215,000
小津産業	2,200	1,859.00	4,089,800
コナカ	11,600	408.00	4,732,800
高速	5,900	1,337.00	7,888,300
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,658.00	2,155,400
G - 7ホールディングス	3,000	3,645.00	10,935,000
たけびし	3,500	1,395.00	4,882,500
イオン北海道	9,700	772.00	7,488,400
コジマ	16,700	442.00	7,381,400
ヒマラヤ	3,500	823.00	2,880,500
コーナン商事	13,000	2,502.00	32,526,000
ネットワークシステムズ	35,200	2,919.00	102,748,800
エコス	3,700	1,756.00	6,497,200
ワタミ	13,200	1,412.00	18,638,400
マルシェ	2,800	774.00	2,167,200
リックス	2,300	1,560.00	3,588,000
システムソフト	27,400	108.00	2,959,200
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	239,300	1,742.00	416,860,600
丸文	8,900	582.00	5,179,800
西松屋チェーン	21,900	949.00	20,783,100
ゼンショーホールディングス	48,500	2,370.00	114,945,000

ハビネット	8,300	1,345.00	11,163,500
幸楽苑ホールディングス	6,400	2,175.00	13,920,000
ハークスレイ	2,000	1,019.00	2,038,000
橋本総業ホールディングス	2,100	1,625.00	3,412,500
日本ライフライン	29,600	1,719.00	50,882,400
サイゼリヤ	16,500	2,603.00	42,949,500
タカショー	5,000	470.00	2,350,000
エクセル	3,800	1,204.00	4,575,200
V Tホールディングス	45,200	456.00	20,611,200
マルカ	3,600	2,158.00	7,768,800
アルゴグラフィックス	8,500	2,578.00	21,913,000
魚力	2,800	1,503.00	4,208,400
I D O M	33,900	471.00	15,966,900
日本エム・ディ・エム	5,900	1,868.00	11,021,200
ポブラ	2,900	502.00	1,455,800
フジ・コーポレーション	2,300	2,101.00	4,832,300
ユナイテッドアローズ	11,400	3,230.00	36,822,000
進和	5,900	2,276.00	13,428,400
エスケイジャパン	2,600	435.00	1,131,000
ダイトロン	4,300	1,379.00	5,929,700
ハイデイ日高	14,400	2,114.00	30,441,600
シークス	12,700	1,586.00	20,142,200
京都きもの友禅	6,900	373.00	2,573,700
コロワイド	33,200	2,121.00	70,417,200
ピーシーデポコーポレーション	13,400	488.00	6,539,200
田中商事	3,500	651.00	2,278,500
オーハシテクニカ	5,700	1,422.00	8,105,400
壱番屋	7,000	5,240.00	36,680,000
白銅	3,300	1,317.00	4,346,100
トップカルチャー	4,200	356.00	1,495,200
P L A N T	2,700	704.00	1,900,800
スギホールディングス	21,900	6,050.00	132,495,000
薬王堂ホールディングス	4,400	2,605.00	11,462,000
島津製作所	130,400	2,695.00	351,428,000
J M S	9,400	650.00	6,110,000
クボテック	2,400	419.00	1,005,600
長野計器	8,000	689.00	5,512,000
ブイ・テクノロジー	4,800	5,710.00	27,408,000
スター精密	15,900	1,621.00	25,773,900
東京計器	6,400	902.00	5,772,800
愛知時計電機	1,300	4,030.00	5,239,000
インターアクション	5,300	1,946.00	10,313,800
オーバル	10,200	242.00	2,468,400
東京精密	18,400	3,330.00	61,272,000
マニー	40,400	2,600.00	105,040,000
ニコン	176,600	1,378.00	243,354,800
トプコン	54,400	1,402.00	76,268,800
オリンパス	604,000	1,482.00	895,128,000
理研計器	8,900	2,120.00	18,868,000
S C R E E Nホールディングス	17,600	7,000.00	123,200,000

キヤノン電子	10,500	1,853.00	19,456,500
タムロン	8,200	2,352.00	19,286,400
HOYA	204,100	9,000.00	1,836,900,000
シード	4,400	842.00	3,704,800
ノーリツ鋼機	8,000	1,539.00	12,312,000
エー・アンド・デイ	9,300	774.00	7,198,200
朝日インテック	86,100	2,850.00	245,385,000
キヤノン	545,500	2,908.50	1,586,586,750
リコー	304,600	977.00	297,594,200
シチズン時計	110,700	553.00	61,217,100
リズム時計工業	3,600	1,029.00	3,704,400
大研医器	8,300	510.00	4,233,000
メニコン	13,900	3,815.00	53,028,500
シンシア	1,200	625.00	750,000
中本パックス	2,900	1,450.00	4,205,000
スノーピーク	4,400	1,215.00	5,346,000
パラマウントベッドホールディングス	11,600	4,010.00	46,516,000
トランザクション	6,100	912.00	5,563,200
SHOBI	3,100	385.00	1,193,500
ニホンフラッシュ	4,400	2,686.00	11,818,400
前田工織	11,200	1,688.00	18,905,600
永大産業	13,300	337.00	4,482,100
アートネイチャー	10,700	657.00	7,029,900
パンダイナムコホールディングス	104,800	6,830.00	715,784,000
アイフィスジャパン	2,800	802.00	2,245,600
共立印刷	18,200	159.00	2,893,800
SHOEI	4,900	4,665.00	22,858,500
フランスベッドホールディングス	14,200	1,011.00	14,356,200
マーベラス	15,100	795.00	12,004,500
パイロットコーポレーション	17,700	4,130.00	73,101,000
萩原工業	5,700	1,625.00	9,262,500
エイベックス	17,000	1,287.00	21,879,000
トッパン・フォームズ	21,700	1,031.00	22,372,700
フジシールインターナショナル	22,800	2,661.00	60,670,800
タカラトミー	42,500	1,187.00	50,447,500
廣濟堂	9,500	719.00	6,830,500
エステールホールディングス	2,700	648.00	1,749,600
アーク	39,100	94.00	3,675,400
レック	10,900	1,002.00	10,921,800
タカノ	4,000	805.00	3,220,000
三光合成	9,300	359.00	3,338,700
プロネクサス	8,800	1,137.00	10,005,600
ホクシン	7,500	171.00	1,282,500
ウッドワン	3,500	1,124.00	3,934,000
大建工業	7,700	1,935.00	14,899,500
きもと	17,800	174.00	3,097,200
凸版印刷	150,600	1,952.00	293,971,200
大日本印刷	142,900	2,790.00	398,691,000
共同印刷	3,100	2,639.00	8,180,900
NISSHA	20,900	1,155.00	24,139,500

光村印刷	900	1,730.00	1,557,000	
藤森工業	9,100	3,400.00	30,940,000	
ヴィア・ホールディングス	12,300	649.00	7,982,700	
宝印刷	5,000	1,694.00	8,470,000	
前澤化成工業	6,900	1,124.00	7,755,600	
未来工業	5,500	2,097.00	11,533,500	
アシックス	83,700	1,773.00	148,400,100	
ツツミ	3,200	1,938.00	6,201,600	
ウェーブロックホールディングス	2,500	801.00	2,002,500	
J S P	5,900	1,863.00	10,991,700	
ニチハ	14,100	3,000.00	42,300,000	
エフピコ	11,100	6,540.00	72,594,000	
小松ウオール工業	3,100	2,014.00	6,243,400	
ヤマハ	60,300	4,910.00	296,073,000	
河合楽器製作所	3,100	2,976.00	9,225,600	
クリナップ	9,400	564.00	5,301,600	
ピジョン	61,300	4,765.00	292,094,500	
天馬	6,700	1,987.00	13,312,900	
兼松サステック	700	1,752.00	1,226,400	
キングジム	8,300	862.00	7,154,600	
象印マホービン	29,700	1,502.00	44,609,400	
リンテック	24,100	2,242.00	54,032,200	
信越ポリマー	18,100	796.00	14,407,600	
東リ	25,200	258.00	6,501,600	
イトーキ	20,100	467.00	9,386,700	
任天堂	58,000	40,150.00	2,328,700,000	
三菱鉛筆	16,600	1,758.00	29,182,800	
松風	5,000	1,475.00	7,375,000	
タカラスタンダード	20,800	1,869.00	38,875,200	
コクヨ	48,500	1,547.00	75,029,500	
ナカバヤシ	9,900	529.00	5,237,100	
ニフコ	40,600	2,636.00	107,021,600	
立川ブラインド工業	4,400	1,370.00	6,028,000	
グローブライド	4,900	2,653.00	12,999,700	
オカムラ	35,300	1,058.00	37,347,400	
バルカー	8,300	2,215.00	18,384,500	
M U T O Hホールディングス	1,400	1,701.00	2,381,400	
伊藤忠商事	698,300	2,264.50	1,581,300,350	
丸紅	984,300	746.10	734,386,230	
スクロール	15,600	333.00	5,194,800	
高島	1,600	1,681.00	2,689,600	
ヨンドシーホールディングス	11,000	2,635.00	28,985,000	
三陽商会	5,200	1,441.00	7,493,200	
長瀬産業	55,900	1,572.00	87,874,800	
ナイガイ	4,000	486.00	1,944,000	
蝶理	6,300	1,682.00	10,596,600	
豊田通商	111,400	3,530.00	393,242,000	
オンワードホールディングス	59,400	602.00	35,758,800	
三共生興	16,900	520.00	8,788,000	
兼松	39,800	1,249.00	49,710,200	

美津濃	10,000	2,876.00	28,760,000
ツカモトコーポレーション	1,800	1,056.00	1,900,800
ファミリーマート	111,700	2,761.00	308,403,700
ルックホールディングス	3,400	1,103.00	3,750,200
三井物産	822,500	1,774.50	1,459,526,250
日本紙パルプ商事	5,600	3,840.00	21,504,000
東京エレクトロン	67,600	21,805.00	1,474,018,000
日立ハイテクノロジーズ	30,300	6,400.00	193,920,000
カメイ	12,900	1,133.00	14,615,700
東都水産	1,400	2,632.00	3,684,800
OUGホールディングス	1,600	2,761.00	4,417,600
スターゼン	3,700	4,560.00	16,872,000
セイコーホールディングス	15,600	2,450.00	38,220,000
山善	38,900	949.00	36,916,100
椿本興業	2,300	3,920.00	9,016,000
住友商事	590,300	1,696.50	1,001,443,950
日本ユニシス	31,100	3,560.00	110,716,000
内田洋行	4,300	4,180.00	17,974,000
三菱商事	700,600	2,694.50	1,887,766,700
第一実業	4,600	3,235.00	14,881,000
キヤノンマーケティングジャパン	28,500	2,293.00	65,350,500
西華産業	5,600	1,353.00	7,576,800
佐藤商事	8,900	831.00	7,395,900
菱洋エレクトロ	10,100	1,901.00	19,200,100
東京産業	10,100	507.00	5,120,700
ユアサ商事	10,200	3,225.00	32,895,000
神鋼商事	2,200	2,380.00	5,236,000
小林産業	6,700	325.00	2,177,500
阪和興業	17,300	3,040.00	52,592,000
正栄食品工業	6,500	3,305.00	21,482,500
カナデン	9,000	1,255.00	11,295,000
菱電商事	7,900	1,519.00	12,000,100
ニプロ	70,000	1,236.00	86,520,000
フルサト工業	5,500	1,577.00	8,673,500
岩谷産業	22,100	3,695.00	81,659,500
すてきナイスグループ	4,400	832.00	3,660,800
昭光通商	3,600	637.00	2,293,200
ニチモウ	1,600	1,864.00	2,982,400
極東貿易	3,100	1,822.00	5,648,200
イワキ	13,300	478.00	6,357,400
兼松エレクトロニクス	5,400	3,160.00	17,064,000
三愛石油	26,700	1,072.00	28,622,400
稲畑産業	23,900	1,351.00	32,288,900
G S I クレオス	2,700	1,068.00	2,883,600
明和産業	9,400	514.00	4,831,600
キムラタン	52,700	35.00	1,844,500
ゴールドウイン	18,000	8,390.00	151,020,000
ユニ・チャーム	195,400	3,500.00	683,900,000
デサント	24,200	1,366.00	33,057,200
キング	5,400	546.00	2,948,400

ワキタ	21,200	1,076.00	22,811,200
ヤマトインターナショナル	6,000	392.00	2,352,000
東邦ホールディングス	29,500	2,534.00	74,753,000
サンゲツ	29,300	2,030.00	59,479,000
ミツウロコグループホールディングス	13,300	1,089.00	14,483,700
シナネンホールディングス	4,100	1,858.00	7,617,800
伊藤忠エネクス	21,700	830.00	18,011,000
サンリオ	30,800	2,127.00	65,511,600
サンワテクノス	6,200	906.00	5,617,200
リョーサン	11,000	2,808.00	30,888,000
新光商事	18,700	913.00	17,073,100
トーホー	4,500	1,692.00	7,614,000
三信電気	6,800	1,517.00	10,315,600
東陽テクニカ	11,400	1,040.00	11,856,000
モスフードサービス	13,100	2,686.00	35,186,600
加賀電子	10,000	2,046.00	20,460,000
三益半導体工業	9,000	1,936.00	17,424,000
ソーダニッカ	10,500	593.00	6,226,500
立花エレテック	7,300	1,735.00	12,665,500
木曽路	12,200	2,750.00	33,550,000
SRSホールディングス	11,700	1,030.00	12,051,000
千趣会	18,300	279.00	5,105,700
タカキュー	8,200	182.00	1,492,400
ケーヨー	18,300	513.00	9,387,900
上新電機	11,800	2,233.00	26,349,400
日本瓦斯	15,800	3,295.00	52,061,000
ロイヤルホールディングス	17,400	2,743.00	47,728,200
東天紅	800	1,239.00	991,200
いなげや	11,100	1,511.00	16,772,100
島忠	21,100	2,900.00	61,190,000
チヨダ	10,400	1,591.00	16,546,400
ライフコーポレーション	7,500	2,596.00	19,470,000
リンガーハット	12,300	2,487.00	30,590,100
MrMaxHD	13,800	471.00	6,499,800
テンアライド	9,600	433.00	4,156,800
AOKIホールディングス	19,800	1,095.00	21,681,000
オークワ	14,200	1,337.00	18,985,400
コメリ	15,400	2,281.00	35,127,400
青山商事	17,300	1,920.00	33,216,000
しまむら	11,600	9,320.00	108,112,000
はせがわ	5,300	402.00	2,130,600
高島屋	78,300	1,228.00	96,152,400
松屋	20,200	888.00	17,937,600
エイチ・ツー・オーリテイリング	51,100	1,236.00	63,159,600
近鉄百貨店	3,800	3,220.00	12,236,000
パルコ	9,500	1,291.00	12,264,500
丸井グループ	84,500	2,339.00	197,645,500
クレディセゾン	70,100	1,484.00	104,028,400
アクシアルリテイリング	8,300	4,235.00	35,150,500
井筒屋	5,700	259.00	1,476,300

イオン	384,100	2,209.50	848,668,950
イズミ	20,300	4,260.00	86,478,000
フォーバル	4,400	993.00	4,369,200
平和堂	20,200	2,083.00	42,076,600
フジ	12,000	1,957.00	23,484,000
ヤオコー	11,300	4,995.00	56,443,500
ゼビオホールディングス	12,000	1,211.00	14,532,000
ケーズホールディングス	103,800	1,211.00	125,701,800
PALTAC	18,000	5,350.00	96,300,000
三谷産業	11,900	303.00	3,605,700
Olympicグループ	5,900	602.00	3,551,800
日産東京販売ホールディングス	14,800	299.00	4,425,200
新生銀行	73,500	1,608.00	118,188,000
あおぞら銀行	55,900	2,643.00	147,743,700
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,881,600	543.20	3,738,085,120
りそなホールディングス	1,097,300	456.10	500,478,530
三井住友トラスト・ホールディングス	196,500	3,797.00	746,110,500
三井住友フィナンシャルグループ	704,500	3,721.00	2,621,444,500
千葉銀行	343,800	557.00	191,496,600
群馬銀行	199,800	358.00	71,528,400
武蔵野銀行	14,800	1,862.00	27,557,600
千葉興業銀行	27,800	302.00	8,395,600
筑波銀行	42,400	191.00	8,098,400
七十七銀行	31,400	1,637.00	51,401,800
青森銀行	7,700	2,747.00	21,151,900
秋田銀行	6,400	2,096.00	13,414,400
山形銀行	11,200	1,436.00	16,083,200
岩手銀行	7,000	2,485.00	17,395,000
東邦銀行	89,000	252.00	22,428,000
東北銀行	5,300	1,003.00	5,315,900
みちのく銀行	6,400	1,618.00	10,355,200
ふくおかフィナンシャルグループ	88,100	2,022.00	178,138,200
静岡銀行	247,500	804.00	198,990,000
十六銀行	13,400	2,406.00	32,240,400
スルガ銀行	102,500	436.00	44,690,000
八十二銀行	241,100	459.00	110,664,900
山梨中央銀行	12,100	1,045.00	12,644,500
大垣共立銀行	21,000	2,506.00	52,626,000
福井銀行	8,600	1,421.00	12,220,600
北國銀行	10,300	2,948.00	30,364,400
清水銀行	4,100	1,879.00	7,703,900
富山銀行	2,000	2,493.00	4,986,000
滋賀銀行	20,000	2,547.00	50,940,000
南都銀行	15,600	2,565.00	40,014,000
百五銀行	89,800	346.00	31,070,800
京都銀行	35,800	4,130.00	147,854,000
紀陽銀行	35,400	1,719.00	60,852,600
ほくほくフィナンシャルグループ	66,300	1,062.00	70,410,600
広島銀行	147,300	547.00	80,573,100
山陰合同銀行	59,200	664.00	39,308,800

中国銀行	85,900	1,049.00	90,109,100
鳥取銀行	3,500	1,414.00	4,949,000
伊予銀行	132,100	568.00	75,032,800
百十四銀行	10,600	2,144.00	22,726,400
四国銀行	14,200	976.00	13,859,200
阿波銀行	15,300	2,518.00	38,525,400
大分銀行	6,100	2,842.00	17,336,200
宮崎銀行	6,600	2,554.00	16,856,400
佐賀銀行	6,100	1,517.00	9,253,700
沖縄銀行	9,100	3,515.00	31,986,500
琉球銀行	23,100	1,153.00	26,634,300
セブン銀行	334,100	305.00	101,900,500
みずほフィナンシャルグループ	13,582,600	164.40	2,232,979,440
高知銀行	3,800	797.00	3,028,600
山口フィナンシャルグループ	124,800	753.00	93,974,400
芙蓉総合リース	11,400	6,680.00	76,152,000
みずほリース	18,800	3,005.00	56,494,000
東京センチュリー	20,100	5,010.00	100,701,000
SBIホールディングス	119,100	2,292.00	272,977,200
日本証券金融	44,000	511.00	22,484,000
アイフル	153,500	247.00	37,914,500
日本アジア投資	9,600	292.00	2,803,200
長野銀行	3,300	1,631.00	5,382,300
名古屋銀行	8,000	3,175.00	25,400,000
北洋銀行	150,800	233.00	35,136,400
愛知銀行	3,600	3,530.00	12,708,000
中京銀行	4,000	2,128.00	8,512,000
大光銀行	3,500	1,616.00	5,656,000
愛媛銀行	13,900	1,089.00	15,137,100
トマト銀行	3,900	1,048.00	4,087,200
京葉銀行	42,500	659.00	28,007,500
栃木銀行	52,600	198.00	10,414,800
北日本銀行	3,200	1,774.00	5,676,800
東和銀行	17,600	841.00	14,801,600
福島銀行	9,800	218.00	2,136,400
大東銀行	4,900	580.00	2,842,000
リコーリース	7,800	3,455.00	26,949,000
イオンフィナンシャルサービス	63,800	1,605.00	102,399,000
アコム	201,100	434.00	87,277,400
ジャックス	11,000	2,291.00	25,201,000
オリエン트コーポレーション	270,800	147.00	39,807,600
日立キャピタル	23,500	2,387.00	56,094,500
アプラスフィナンシャル	49,300	77.00	3,796,100
オリックス	666,900	1,660.00	1,107,054,000
三菱UFJリース	225,200	656.00	147,731,200
ジャフコ	16,400	4,240.00	69,536,000
九州リースサービス	5,000	598.00	2,990,000
トモニホールディングス	77,300	360.00	27,828,000
大和証券グループ本社	801,400	496.60	397,975,240
野村ホールディングス	1,759,200	489.00	860,248,800

岡三証券グループ	84,600	386.00	32,655,600
丸三証券	29,800	498.00	14,840,400
東洋証券	37,400	176.00	6,582,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	114,800	311.00	35,702,800
光世証券	2,700	663.00	1,790,100
水戸証券	29,700	257.00	7,632,900
いちよし証券	20,000	679.00	13,580,000
松井証券	48,800	888.00	43,334,400
SOMPOホールディングス	176,200	4,240.00	747,088,000
だいがく証券ビジネス	4,100	557.00	2,283,700
日本取引所グループ	270,100	1,780.00	480,778,000
マネックスグループ	92,400	264.00	24,393,600
極東証券	13,400	882.00	11,818,800
岩井コスモホールディングス	10,100	1,124.00	11,352,400
藍澤証券	17,900	717.00	12,834,300
フィデアホールディングス	97,500	119.00	11,602,500
池田泉州ホールディングス	106,600	188.00	20,040,800
アニコムホールディングス	8,300	4,000.00	33,200,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	261,300	3,429.00	895,997,700
ソニーフィナンシャルホールディングス	82,100	2,257.00	185,299,700
マネーパートナーズグループ	11,900	253.00	3,010,700
スパークス・グループ	39,900	255.00	10,174,500
小林洋行	3,100	245.00	759,500
第一生命ホールディングス	565,600	1,718.50	971,983,600
東京海上ホールディングス	357,500	5,676.00	2,029,170,000
アドバンテッジリスクマネジメント	4,100	833.00	3,415,300
イー・ギャランティ	9,400	1,413.00	13,282,200
アサックス	4,200	605.00	2,541,000
NECキャピタルソリューション	4,000	2,172.00	8,688,000
T&Dホールディングス	309,200	1,195.50	369,648,600
アドバンスクリエイト	2,400	1,760.00	4,224,000
三井不動産	530,500	2,738.50	1,452,774,250
三菱地所	700,500	2,110.50	1,478,405,250
平和不動産	18,400	2,682.00	49,348,800
東京建物	109,400	1,520.00	166,288,000
ダイビル	29,500	1,194.00	35,223,000
京阪神ビルディング	17,600	1,303.00	22,932,800
住友不動産	224,800	3,973.00	893,130,400
太平洋興発	4,100	785.00	3,218,500
テーオーシー	23,000	821.00	18,883,000
東京楽天地	1,400	5,880.00	8,232,000
レオパレス21	123,500	273.00	33,715,500
スターツコーポレーション	13,600	2,748.00	37,372,800
フジ住宅	12,900	672.00	8,668,800
空港施設	11,600	535.00	6,206,000
明和地所	5,900	549.00	3,239,100
ゴールドクレスト	7,900	2,190.00	17,301,000

リログループ	53,000	2,610.00	138,330,000
エスリード	4,000	1,693.00	6,772,000
日神不動産	14,900	481.00	7,166,900
日本エスコン	18,200	915.00	16,653,000
タカラレーベン	46,000	423.00	19,458,000
サンヨーハウジング名古屋	5,800	932.00	5,405,600
イオンモール	50,200	1,783.00	89,506,600
ファースト住建	4,200	1,355.00	5,691,000
ランド	423,900	8.00	3,391,200
カチタス	11,200	4,290.00	48,048,000
東祥	6,100	2,204.00	13,444,400
トーセイ	13,800	1,383.00	19,085,400
穴吹興産	1,100	2,835.00	3,118,500
サンフロンティア不動産	14,000	1,333.00	18,662,000
エフ・ジェー・ネクスト	8,900	1,078.00	9,594,200
インテリックス	3,000	750.00	2,250,000
ランドビジネス	4,300	759.00	3,263,700
日本社宅サービス	2,700	1,058.00	2,856,600
グランディハウス	9,100	482.00	4,386,200
東武鉄道	106,800	3,625.00	387,150,000
相鉄ホールディングス	34,700	2,915.00	101,150,500
東急	275,300	2,091.00	575,652,300
京浜急行電鉄	138,900	2,166.00	300,857,400
小田急電鉄	162,400	2,638.00	428,411,200
京王電鉄	56,600	6,840.00	387,144,000
京成電鉄	76,000	4,540.00	345,040,000
富士急行	13,800	4,570.00	63,066,000
新京成電鉄	2,600	2,126.00	5,527,600
東日本旅客鉄道	178,400	10,485.00	1,870,524,000
西日本旅客鉄道	90,300	9,213.00	831,933,900
東海旅客鉄道	90,800	22,810.00	2,071,148,000
西武ホールディングス	125,500	1,931.00	242,340,500
鴻池運輸	16,100	1,651.00	26,581,100
西日本鉄道	28,000	2,442.00	68,376,000
ハマキョウレックス	7,800	3,530.00	27,534,000
サカイ引越センター	5,300	6,530.00	34,609,000
近鉄グループホールディングス	96,000	5,830.00	559,680,000
阪急阪神ホールディングス	128,000	4,325.00	553,600,000
南海電気鉄道	42,800	2,814.00	120,439,200
京阪ホールディングス	42,800	4,970.00	212,716,000
神戸電鉄	2,500	3,950.00	9,875,000
名古屋鉄道	78,900	3,370.00	265,893,000
山陽電気鉄道	7,400	2,183.00	16,154,200
トランコム	2,700	6,170.00	16,659,000
日本通運	37,000	5,670.00	209,790,000
ヤマトホールディングス	168,300	1,712.50	288,213,750
山九	26,700	5,880.00	156,996,000
日新	8,300	1,594.00	13,230,200
丸運	5,900	264.00	1,557,600
丸全昭和運輸	7,800	3,010.00	23,478,000

センコーグループホールディングス	52,800	858.00	45,302,400	
トナミホールディングス	2,300	4,615.00	10,614,500	
ニッコンホールディングス	36,400	2,563.00	93,293,200	
日本石油輸送	1,200	2,818.00	3,381,600	
福山通運	12,300	3,875.00	47,662,500	
セイノーホールディングス	71,800	1,385.00	99,443,000	
エスライン	3,000	906.00	2,718,000	
神奈川中央交通	2,400	3,865.00	9,276,000	
日立物流	21,100	3,245.00	68,469,500	
丸和運輸機関	10,100	2,799.00	28,269,900	
C & F ロジホールディングス	9,700	1,261.00	12,231,700	
日本郵船	80,200	1,900.00	152,380,000	
商船三井	56,900	2,985.00	169,846,500	
川崎汽船	29,600	1,522.00	45,051,200	
NSユナイテッド海運	5,300	2,394.00	12,688,200	
明治海運	10,200	323.00	3,294,600	
飯野海運	45,200	356.00	16,091,200	
共栄タンカー	800	1,464.00	1,171,200	
九州旅客鉄道	80,600	3,515.00	283,309,000	
SGホールディングス	90,700	2,672.00	242,350,400	
日本航空	175,700	3,342.00	587,189,400	
ANAホールディングス	175,500	3,721.00	653,035,500	
パスコ	2,000	995.00	1,990,000	
西本Wismettacホールディングス	1,800	3,730.00	6,714,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,339.00	1,205,100	
Genky DrugStores	4,500	2,379.00	10,705,500	
国際紙パルプ商事	19,700	312.00	6,146,400	
総合メディカルホールディングス	8,700	1,680.00	14,616,000	
ブックオフグループホールディングス	5,300	1,132.00	5,999,600	
三菱倉庫	33,200	2,744.00	91,100,800	
三井倉庫ホールディングス	11,800	1,715.00	20,237,000	
住友倉庫	35,200	1,490.00	52,448,000	
澁澤倉庫	5,300	1,994.00	10,568,200	
ヤマタネ	5,000	1,393.00	6,965,000	
東陽倉庫	17,700	329.00	5,823,300	
乾汽船	8,700	1,156.00	10,057,200	
日本トランスシティ	21,200	514.00	10,896,800	
ケイヒン	1,800	1,269.00	2,284,200	
中央倉庫	5,900	1,143.00	6,743,700	
川西倉庫	2,000	1,115.00	2,230,000	
安田倉庫	7,900	960.00	7,584,000	
東洋埠頭	3,000	1,360.00	4,080,000	
宇徳	8,300	517.00	4,291,100	
上組	59,100	2,465.00	145,681,500	
サンリツ	2,300	664.00	1,527,200	
キムラユニティー	2,600	1,017.00	2,644,200	
キューソー流通システム	2,400	1,834.00	4,401,600	
近鉄エクスプレス	18,100	1,617.00	29,267,700	
東海運	6,000	291.00	1,746,000	

エーアイティー	6,400	971.00	6,214,400
内外トランスライン	3,500	1,343.00	4,700,500
日本コンセプト	3,100	1,425.00	4,417,500
東京放送ホールディングス	66,000	1,762.00	116,292,000
日本テレビホールディングス	91,200	1,411.00	128,683,200
朝日放送グループホールディングス	9,600	722.00	6,931,200
テレビ朝日ホールディングス	27,200	1,701.00	46,267,200
スカパーJ S A Tホールディングス	65,000	447.00	29,055,000
テレビ東京ホールディングス	8,200	2,234.00	18,318,800
日本BS放送	3,500	1,079.00	3,776,500
ビジョン	9,400	1,629.00	15,312,600
スマートバリュー	3,200	750.00	2,400,000
USEN-NEXT HOLDINGS	3,800	966.00	3,670,800
ワイヤレスゲート	5,000	699.00	3,495,000
コネクシオ	7,000	1,408.00	9,856,000
日本通信	87,400	191.00	16,693,400
クロップス	2,000	625.00	1,250,000
日本電信電話	680,300	5,418.00	3,685,865,400
KDDI	815,400	2,970.00	2,421,738,000
ソフトバンク	1,054,600	1,507.50	1,589,809,500
光通信	11,700	23,240.00	271,908,000
NTTドコモ	629,700	2,865.50	1,804,405,350
エムティーアイ	9,800	723.00	7,085,400
GMOインターネット	39,300	1,772.00	69,639,600
ファイバーゲート	1,900	1,463.00	2,779,700
アйдママーケティングコミュニケーション	2,600	600.00	1,560,000
KADOKAWA	29,100	1,504.00	43,766,400
学研ホールディングス	3,300	5,550.00	18,315,000
ゼンリン	19,900	1,795.00	35,720,500
昭文社	5,200	396.00	2,059,200
インプレスホールディングス	9,500	147.00	1,396,500
東京電力ホールディングス	809,200	540.00	436,968,000
中部電力	310,100	1,634.00	506,703,400
関西電力	413,600	1,266.00	523,617,600
中国電力	140,100	1,446.00	202,584,600
北陸電力	99,400	748.00	74,351,200
東北電力	237,300	1,104.00	261,979,200
四国電力	91,300	1,056.00	96,412,800
九州電力	208,900	1,079.00	225,403,100
北海道電力	94,900	580.00	55,042,000
沖縄電力	18,800	1,787.00	33,595,600
電源開発	80,600	2,578.00	207,786,800
エフオン	5,100	721.00	3,677,100
イーレックス	17,700	1,302.00	23,045,400
レノバ	16,800	931.00	15,640,800
東京瓦斯	194,900	2,797.00	545,135,300
大阪瓦斯	196,600	2,097.00	412,270,200
東邦瓦斯	50,200	4,295.00	215,609,000

北海道瓦斯	5,400	1,576.00	8,510,400
広島ガス	20,500	345.00	7,072,500
西部瓦斯	11,400	2,408.00	27,451,200
静岡ガス	28,800	933.00	26,870,400
メタウォーター	4,900	3,680.00	18,032,000
アイネット	5,700	1,412.00	8,048,400
松竹	6,600	14,600.00	96,360,000
東宝	65,400	4,665.00	305,091,000
エイチ・アイ・エス	15,100	2,709.00	40,905,900
東映	4,200	15,200.00	63,840,000
ラックランド	2,000	2,325.00	4,650,000
エヌ・ティ・ティ・データ	264,900	1,433.00	379,601,700
共立メンテナンス	14,800	4,525.00	66,970,000
イチネンホールディングス	10,300	1,270.00	13,081,000
建設技術研究所	6,800	1,698.00	11,546,400
スペース	6,200	1,267.00	7,855,400
長 大	3,700	1,004.00	3,714,800
アインホールディングス	13,400	6,120.00	82,008,000
燦ホールディングス	4,300	1,090.00	4,687,000
ピー・シー・エー	1,300	3,835.00	4,985,500
スバル興業	700	7,070.00	4,949,000
東京テアトル	3,900	1,387.00	5,409,300
タナベ経営	2,000	1,253.00	2,506,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	2,637.00	4,482,900
ナガワ	2,700	6,070.00	16,389,000
よみうりランド	2,100	4,525.00	9,502,500
東京都競馬	6,300	3,445.00	21,703,500
常磐興産	3,900	1,686.00	6,575,400
カナモト	15,900	2,871.00	45,648,900
東京ドーム	36,300	986.00	35,791,800
D T S	22,300	2,290.00	51,067,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	46,300	5,060.00	234,278,000
シーイーシー	10,700	2,058.00	22,020,600
カブコン	42,700	2,819.00	120,371,300
西尾レントオール	9,800	2,878.00	28,204,400
アイ・エス・ピー	2,000	1,604.00	3,208,000
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	61,300	33.00	2,022,900
日本空港ビルデング	31,900	5,140.00	163,966,000
トランス・コスモス	10,800	2,675.00	28,890,000
乃村工藝社	45,400	1,345.00	61,063,000
ジャステック	6,200	1,105.00	6,851,000
S C S K	26,200	5,200.00	136,240,000
藤田観光	4,200	2,827.00	11,873,400
K N T - C Tホールディングス	5,200	1,599.00	8,314,800
日本管財	10,400	1,896.00	19,718,400
トーカイ	9,400	2,328.00	21,883,200
白洋舎	1,100	2,901.00	3,191,100
セコム	102,800	9,834.00	1,010,935,200

日本システムウエア	3,300	2,390.00	7,887,000
セントラル警備保障	4,700	6,080.00	28,576,000
アイネス	12,700	1,165.00	14,795,500
丹青社	18,300	1,168.00	21,374,400
メイテック	12,000	5,380.00	64,560,000
T K C	8,400	4,580.00	38,472,000
富士ソフト	12,800	4,605.00	58,944,000
応用地質	10,400	1,193.00	12,407,200
船井総研ホールディングス	20,100	2,515.00	50,551,500
N S D	16,400	3,165.00	51,906,000
進学会ホールディングス	4,800	501.00	2,404,800
丸紅建材リース	1,100	1,734.00	1,907,400
オオバ	7,900	708.00	5,593,200
コナミホールディングス	40,600	5,000.00	203,000,000
いであ	2,000	1,387.00	2,774,000
学究社	3,300	1,257.00	4,148,100
ベネッセホールディングス	35,500	2,880.00	102,240,000
イオンディライト	12,000	3,605.00	43,260,000
ナック	6,200	982.00	6,088,400
福井コンピュータホールディングス	3,300	2,502.00	8,256,600
ニチイ学館	13,800	1,797.00	24,798,600
ダイセキ	16,300	2,834.00	46,194,200
ステップ	3,600	1,420.00	5,112,000
日鉄物産	7,100	4,445.00	31,559,500
泉州電業	3,100	2,806.00	8,698,600
元気寿司	2,800	2,711.00	7,590,800
トラスコ中山	20,800	2,618.00	54,454,400
ヤマダ電機	303,900	509.00	154,685,100
オートバックスセブン	39,600	1,776.00	70,329,600
モリト	7,200	790.00	5,688,000
アークランドサカモト	16,900	1,246.00	21,057,400
ニトリホールディングス	43,200	15,880.00	686,016,000
グルメ杵屋	7,100	1,176.00	8,349,600
愛眼	8,200	245.00	2,009,000
ケーユーホールディングス	5,200	850.00	4,420,000
吉野家ホールディングス	34,900	2,670.00	93,183,000
加藤産業	15,600	3,450.00	53,820,000
北恵	2,000	1,027.00	2,054,000
イノテック	6,000	909.00	5,454,000
イエローハット	18,900	1,618.00	30,580,200
松屋フーズホールディングス	4,800	4,035.00	19,368,000
J B C Cホールディングス	7,900	1,521.00	12,015,900
J Kホールディングス	9,100	543.00	4,941,300
サガミホールディングス	13,300	1,361.00	18,101,300
日伝	8,300	2,066.00	17,147,800
関西スーパーマーケット	7,500	1,089.00	8,167,500
ミロク情報サービス	9,900	2,915.00	28,858,500
北沢産業	7,700	274.00	2,109,800
杉本商事	5,400	1,977.00	10,675,800
因幡電機産業	14,200	4,845.00	68,799,000

王将フードサービス	7,300	6,750.00	49,275,000	
プレナス	11,000	1,840.00	20,240,000	
ミニストップ	7,300	1,480.00	10,804,000	
アークス	18,600	2,344.00	43,598,400	
パローホールディングス	21,500	1,859.00	39,968,500	
東テク	3,300	2,123.00	7,005,900	
ミスミグループ本社	125,100	2,451.00	306,620,100	
藤久	900	755.00	679,500	
アルテック	8,500	231.00	1,963,500	
ベルク	4,900	5,090.00	24,941,000	
大 庄	5,300	1,624.00	8,607,200	
タキヒヨー	3,000	1,854.00	5,562,000	
ファーストリテイリング	13,400	65,450.00	877,030,000	
ソフトバンクグループ	789,200	4,258.00	3,360,413,600	
蔵王産業	1,600	1,404.00	2,246,400	
スズケン	45,500	5,900.00	268,450,000	
サンドラッグ	37,600	3,475.00	130,660,000	
サックスパー ホールディングス	8,500	897.00	7,624,500	
ジェコス	6,800	913.00	6,208,400	
ヤマザワ	2,000	1,705.00	3,410,000	
やまや	1,700	2,198.00	3,736,600	
グローセル	9,300	421.00	3,915,300	
ベルーナ	24,600	704.00	17,318,400	
合計	119,931,500		235,064,669,820	

(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】

令和1年10月31日現在

資産総額	1,394,306,752円
負債総額	15,116,220円
純資産総額(-)	1,379,190,532円
発行済数量	1,217,158,599口
1口当たり純資産額(/)	1.1331円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

令和1年10月31日現在

資産総額	260,267,237,608円
負債総額	5,677,353,614円
純資産総額(-)	254,589,883,994円
発行済数量	96,622,221,425口
1口当たり純資産額(/)	2.6349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。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2019年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(2019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。

2019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	26	1,198,457,447,167
追加型株式投資信託	865	13,922,418,811,581
単位型公社債投資信託	39	108,717,437,174
単位型株式投資信託	171	1,273,596,816,603
合計	1,101	16,503,190,512,525

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34期事業年度(自2018年4月1日至2019年3月31日)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受け、第35期中間会計期間(自2019年4月1日至2019年9月30日)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,003,550	2,183,889
未払金	5,081,728	5,697,942
未払収益分配金	1,031	1,053
未払償還金	57,275	48,968
未払手数料	4,629,133	4,883,723
その他未払金	394,288	764,196
未払費用	7,711,038	6,724,986
未払法人税等	5,153,972	3,341,238
未払消費税等	1,660,259	576,632
賞与引当金	1,393,911	1,344,466
役員賞与引当金	49,986	48,609
本社移転費用引当金	156,587	-
流動負債計	22,211,034	19,917,766
固定負債		
退職給付引当金	1,637,133	1,895,158
時効後支払損引当金	199,026	177,851
固定負債計	1,836,160	2,073,009
負債合計	24,047,195	21,990,776
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	44,349,855	45,949,372
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	44,226,562	45,826,079
別途積立金	24,580,000	31,680,000
研究開発積立金	300,000	-
運用責任準備積立金	200,000	-
繰越利益剰余金	19,146,562	14,146,079
株主資本計	65,902,812	67,502,329
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	795,002	846,755
評価・換算差額等計	795,002	846,755
純資産合計	66,697,815	68,349,085
負債・純資産合計	90,745,010	90,339,861

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

	第33期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		1,430		1,749
受取配当金		74,278		73,517
時効成立分配金・償還金		256		8,582
為替差益		8,530		-
投資信託解約益		236,398		-
投資信託償還益		93,177		-
受取負担金		-		177,066
雑収入		10,306		24,919
時効後支払損引当金戻入額		17,429		19,797
営業外収益計		441,807		305,633
営業外費用				
為替差損		-		17,542
投資信託解約損		4,138		-
投資信託償還損		17,065		-
金銭の信託運用損		99,303		175,164
雑損失		-		5,659
営業外費用計		120,507		198,365
経常利益		21,045,676		20,100,019
特別利益				
固定資産売却益		1		-
投資有価証券売却益		479,323		353,644
関係会社株式売却益	1	1,492,680	1	-
本社移転費用引当金戻入額		138,294		-
その他特別利益		350		-
特別利益計		2,110,649		353,644
特別損失				
固定資産除却損	2	36,992	2	19,121
固定資産売却損		134		-
退職給付制度終了損		690,899		-
システム移行損失		76,007		-
その他特別損失		50		-
特別損失計		804,083		19,121
税引前当期純利益		22,352,243		20,434,543
法人税、住民税及び事業税		6,951,863		6,386,793
法人税等調整額		249,832		71,767
法人税等合計		6,702,031		6,315,026
当期純利益		15,650,211		14,119,516

(3)【株主資本等変動計算書】

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:千円)

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

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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

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

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

重要な会計方針

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

表示方法の変更

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 関係会社に対する事項

(千円)

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

2. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2017年6月21日 定時株主総会	普通株式	3,200,000	80,000	2017年3月31日	2017年6月22日
	A種種類株式				

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

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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

2019年6月20日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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33期(2018年3月31日現在)

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

第34期(2019年3月31日現在)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第33期(2018年3月31日現在)

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

第34期(2019年3月31日現在)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第33期の貸借対照表計上額3,229,196千円、第34期の貸借対照表計上額4,499,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

第33期(2018年3月31日現在)

(千円)

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

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

第34期(2019年3月31日現在)

(千円)

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

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額276,674千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第33期(自2017年4月1日至2018年3月31日)

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

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

第34期(自2018年4月1日至2019年3月31日)

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

なお、当社は2017年10月1日付で、確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行するとともに、退職一時金制度を改定しました。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第33期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,718,372	2,154,607
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
数理計算上の差異の発生額	61,792	10,147
退職給付の支払額	111,758	158,018
確定拠出制度への移行に伴う減少額	1,316,796	-
退職一時金制度改定に伴う増加額	526,345	-
その他	-	438
退職給付債務の期末残高	2,154,607	2,289,044

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第33期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)
年金資産の期首残高	1,363,437	-
期待運用収益	17,042	-
事業主からの拠出額	36,672	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	1,417,152	-
年金資産の期末残高	-	-

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

(千円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
期待運用収益	17,042	-
数理計算上の差異の費用処理額	88,417	43,920
過去勤務費用の費用処理額	39,611	69,519
退職一時金制度改定に伴う費用処理額	70,560	-
その他	1,620	3,640
確定給付制度に係る退職給付費用	456,577	411,963
制度移行に伴う損失(注)	690,899	-

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	1.00% ~ 4.42%

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	300,927	-
退職給付費用	53,156	-
制度への拠出額	35,640	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	391,600	-
退職一時金制度改定に伴う振替額	108,189	-
退職給付引当金の期末残高	-	-

(2) 退職給付費用

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

4. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度86,141千円、当事業年度104,720千円であります。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率(議決権比率)

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

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

(2) 損益計算書項目

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

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,470,802	未払 手数料	894,336
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	9,079,083	未払 手数料	1,549,208

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	1,667,445円37銭	1,708,727円13銭
1株当たり当期純利益金額	391,255円29銭	352,987円92銭

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

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

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

	第35期中間会計期間末 (2019年9月30日現在)	
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		37,156,171
金銭の信託		18,742,684
有価証券		997
未収委託者報酬		11,945,046
未収運用受託報酬		3,120,602
未収投資助言報酬		332,118
未収収益		58,808
前払費用		781,218
その他		2,233,840
	流動資産計	74,371,488
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	1,051,855
器具備品	1	311,144
無形固定資産		
ソフトウェア		3,323,996
ソフトウェア仮勘定		213,219
電話加入権		3,931
電信電話専用施設利用権		6
投資その他の資産		
投資有価証券		958,309
関係会社株式		4,499,196
長期差入保証金		1,307,197
繰延税金資産		2,036,732
その他		95,551
	固定資産計	13,801,139
	資産合計	88,172,628

(単位:千円)

	第35期中間会計期間末 (2019年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	5,192,317
未払金	5,043,713
未払収益分配金	1,047
未払償還金	48,441
未払手数料	4,707,236
その他未払金	286,987
未払費用	6,512,990
未払法人税等	3,526,134
未払消費税等	516,610
前受収益	40,684
賞与引当金	1,281,617
役員賞与引当金	34,112
流動負債計	22,148,179
固定負債	
退職給付引当金	1,993,829
時効後支払損引当金	169,869
固定負債計	2,163,698
負債合計	24,311,878
(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	41,866,681
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	41,743,387
別途積立金	31,680,000
繰越利益剰余金	10,063,387
株主資本計	63,419,638
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	441,111
評価・換算差額等計	441,111
純資産合計	63,860,750
負債・純資産合計	88,172,628

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	42,425,693	
運用受託報酬	7,240,514	
投資助言報酬	601,626	
その他営業収益	57,443	
	営業収益計	50,325,278
営業費用		
支払手数料	17,730,384	
広告宣伝費	125,471	
公告費	125	
調査費	12,182,415	
調査費	4,742,559	
委託調査費	7,439,855	
委託計算費	421,559	
営業雑経費	538,430	
通信費	22,517	
印刷費	410,573	
協会費	34,596	
諸会費	16,711	
支払販売手数料	54,031	
	営業費用計	30,998,386
一般管理費		
給料	4,829,571	
役員報酬	87,372	
給料・手当	4,615,868	
賞与	126,330	
交際費	17,168	
寄付金	6,499	
旅費交通費	165,035	
租税公課	291,415	
不動産賃借料	749,406	
退職給付費用	254,598	
固定資産減価償却費	1 345,421	
福利厚生費	21,538	
修繕費	1,263	
賞与引当金繰入額	1,281,617	
役員賞与引当金繰入額	34,112	
機器リース料	138	
事務委託費	1,700,671	
事務用消耗品費	50,852	
器具備品費	490	
諸経費	100,495	
	一般管理費計	9,850,295
営業利益		9,476,595

(単位:千円)

	第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	1,075	
受取配当金	11,185	
時効成立分配金・償還金	608	
時効後支払損引当金戻入額	7,743	
投資信託償還益	2,466	
受取負担金	287,268	
雑収入	2,670	
	営業外収益計	313,018
営業外費用		
為替差損	9,702	
投資信託償還損	1	
金銭の信託運用損	18,907	
雑損失	104	
	営業外費用計	28,716
経常利益		9,760,897
特別利益		
投資有価証券売却益	634,060	
	特別利益計	634,060
特別損失		
固定資産除却損	7,444	
	特別損失計	7,444
税引前中間純利益		10,387,514
法人税、住民税及び事業税		3,299,452
法人税等調整額		109,246
法人税等合計		3,190,205
中間純利益		7,197,308

(3) 中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	14,146,079
当中間期変動額							
剰余金の配当							11,280,000
中間純利益							7,197,308
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	-	-	-	-	-	-	4,082,691
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	10,063,387

	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	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,280,000	11,280,000			11,280,000
中間純利益	7,197,308	7,197,308			7,197,308
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)			405,643	405,643	405,643
当中間期変動額 合計	4,082,691	4,082,691	405,643	405,643	4,488,335
当中間期末残高	41,866,681	63,419,638	441,111	441,111	63,860,750

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 …… 6～18年 器具備品 …… 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の日翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 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。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第35期中間会計期間末 （2019年9月30日現在）	
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	274,959千円
	器具備品	965,214千円

（中間損益計算書関係）

項目	第35期中間会計期間 （自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）	
1.減価償却実施額	有形固定資産	97,348千円
	無形固定資産	248,073千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第35期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019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
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21日
	A種種類 株式				

（2）基準日が当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35期中間会計期間末(2019年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

2019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	37,156,171	37,156,171	-
(2) 金銭の信託	18,742,684	18,742,684	-
(3) 未収委託者報酬	11,945,046	11,945,046	-
(4) 未収運用受託報酬	3,120,602	3,120,602	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	699,937	699,937	-
資産計	71,664,441	71,664,441	-
(1) 未払手数料	4,707,236	4,707,236	-
負債計	4,707,236	4,707,236	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

これ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	259,369
関係会社株式	4,499,196

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

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

(有価証券関係)

第35期中間会計期間末

(2019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4,499,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

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	691,010	58,146	632,863
投資信託	5,937	3,000	2,937
小計	696,947	61,146	635,800
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	2,990	3,000	9
小計	2,990	3,000	9
合計	699,937	64,146	635,791

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2019年4月1日から2019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 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	99,557,407千円
資産合計	99,557,407千円
流動負債	- 千円
固定負債	9,515,195千円
負債合計	9,515,195千円
純資産	90,042,211千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額64,791,112千円及び顧客関連資産の金額37,384,808千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	4,477,219千円
経常利益	4,477,219千円
税引前中間純利益	4,551,164千円
中間純利益	3,763,741千円
1株当たり中間純利益	94,093円53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2,574,777千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35期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019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35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,596,518円75銭
1株当たり中間純利益金額	179,932円71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いません。

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35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
中間純利益金額	7,197,308千円
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	7,197,308千円
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) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a.名称

みずほ信託銀行株式会社

b.資本金の額

2019年3月末日現在 247,369百万円

c.事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでおります。

(2)販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社七十七銀行	24,658	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社千葉興業銀行	62,120	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北陸銀行	140,409	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社筑邦銀行	8,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社福島銀行	18,127	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社栃木銀行	27,408	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社福邦銀行	7,300	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社第三銀行	37,461	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社沖縄海邦銀行	4,537	日本において銀行業務を営んでおります。
信金中央金庫	(1) 690,998	日本において全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の受給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
藍澤証券株式会社	8,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
a u カブコム証券株式会社	7,196	「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。
株式会社S B I証券	48,323	「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。
岡三オンライン証券株式会社	2,500	「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。
長野証券株式会社	600	「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。
ちばぎん証券株式会社	4,374	「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。
楽天証券株式会社	7,495	「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。
東武証券株式会社	420	「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。
西村証券株式会社	500	「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。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

日産証券株式会社	1,500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
松井証券株式会社	11,945	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
三津井証券株式会社	558	「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。
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。
損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2019年3月末日現在

(注) 確定拠出年金向けの取扱販売会社を含みます。

(1) 出資の総額

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

委託会社は、三津井証券株式会社の株式を5.7%保有しています。

持株比率5%以上を記載します。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

書類名	提出年月日
有価証券報告書	2019年1月11日
有価証券届出書	2019年1月11日、2019年7月12日
半期報告書	2019年7月12日

独立監査人の監査報告書

2019年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第34期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

令和1年11月21日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード TOPIXの平成30年10月13日から令和1年10月15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、たわらノーロード TOPIXの令和1年10月15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。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年11月28日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

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

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2019年4月1日から2020年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間(2019年4月1日から2019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2019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(2019年4月1日から2019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) XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。