

【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10月8日提出
【計算期間】 第10期(自 2020年1月9日 至 2020年7月8日)
【ファンド名】 One ETF トピックス
【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】 株式会社東京証券取引所
(東京都中央区日本橋兜町2番1号)

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）（以下、「対象指数」という場合があります。）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

信託財産の1口当たりの純資産額の変動率をTOPIXの変動率に一致させることを目的として、TOPIXに採用されている銘柄（採用予定の銘柄を含む。）の株式に対する投資として運用を行います。

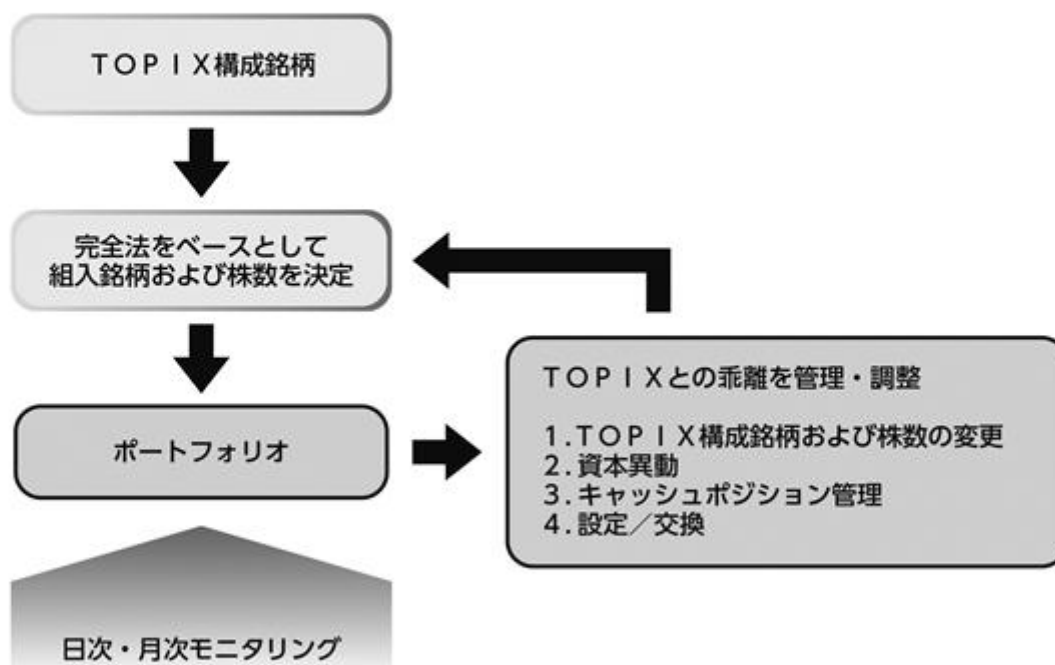
信託財産中に占める個別銘柄の株数の比率は、TOPIXにおける個別銘柄の時価総額構成比率から算出される株数の比率程度を維持することを原則とします。

当ファンドの信託の限度額は、10兆円相当額とします。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) (以下、「対象指数」という場合があります。)に連動する投資成果をめざして運用を行います。

- 信託財産の1口当たりの純資産額の変動率をTOPIXの変動率に一致させることを目的として、TOPIXに採用されている銘柄(採用予定の銘柄を含む。)の株式に対する投資として運用を行います。
- 信託財産中に占める個別銘柄の株数の比率は、TOPIXにおける個別銘柄の時価総額構成比率から算出される株数の比率程度を維持することを原則とします。



- 対象指数から除外された銘柄は、市場動向等を勘案し速やかに売却することを基本としますが、当該銘柄の流動性等によっては、速やかに売却できない場合があります。
- 対象指数に連動する投資成果を目指すため、信託財産の構成を調整するための指図を行うこと、および補完的に有価証券指数等先物取引等を行うことができます。

2 当ファンドは投資信託及び投資法人に関する法律により定められる投資信託ですが、通常の投資信託とは異なる仕組みを有しています。

- 当ファンドの受益権は東京証券取引所に上場され、市場価格で売買することができます。
 - 売買単位は10口単位です。
 - 取引方法は原則として株式と同様です。
 - 売買手数料等詳しくは第一種金融商品取引業者にお問い合わせください。
- 取得申込み(追加設定)は株式によって行われます。
 - 委託会社は、あらかじめ取得申込みに必要な株式の銘柄およびそれぞれの株数を指定します。取得申込者はこれらの株式を提供することで、引換えに受益権を取得することができます。
 - 所定の条件に該当する場合を除き、金銭による取得申込みを行うことはできません。
- 受益権を株式と交換することができます。
 - 一定口数以上の受益権を保有する受益者は、それに相当する信託財産中の株式と交換することができます。
 - 通常の投資信託における換金手続きの「解約請求」は、当ファンドでは行うことができません。

東証株価指数(TOPIX)について

- ①TOPIX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。
- ②株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、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。
- ③株東京証券取引所は、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。
- ④株東京証券取引所は、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、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤当ファンドは、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。
- ⑥株東京証券取引所は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。
- ⑦株東京証券取引所は、委託会社または当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- ⑧以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当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。

■ 分配方針

年2回の決算時(毎年1月、7月の8日)に収益分配を行います。

分配金額は、経費控除後の配当等収益の全額を原則とします。

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
国内	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
株式	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
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	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	TOPIX
不動産投信	日々	中南米	
その他資産 ()	その他 ()	アフリカ 中近東 (中東)	その他 ()
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング	

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

株式・一般	大型株、中小型株の属性にあてはまらない全てのものをいいます。
年2回	目論見書または投資信託約款において、年2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。

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】

2015年9月4日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

2015年9月7日 ファンドの受益権を東京証券取引所へ上場

2017年4月5日 ファンドの名称を「DIAM ETF トピックス」から「One ETF トピックス」に変更

(3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドにかかる証券投資信託契約を締結します。

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。

・「指定参加者契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、指定参加者契約を締結します。

募集の取扱いおよび販売、交換請求の受付、受益権の買取りに関する事務、信託終了時の取扱いにかかる事務の内容等が定められています。

委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2020年7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

（2020年7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】

委託会社は、信託財産の運用にあたっては、以下に掲げる運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

- この信託は、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象指数の変動率に一致させることを目的として、対象指数に採用されている銘柄（採用予定の銘柄を含みます。）の株式に対する投資として運用を行います。
- 信託財産中に占める個別銘柄の株数の比率は、対象指数における個別銘柄の時価総額構成比率から算出される株数の比率程度を維持することを原則とします。なお、対象指数から除外された銘柄は、市場動向等を勘案し速やかに売却することを基本としますが、当該銘柄の流動性等によっては、速やかに売却できない場合があります。
- 3.1.の方針に沿うよう、信託財産の構成を調整するための指図を行うこと、および補完的に有価証券指数等先物取引等を行うことができます。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。

4. 市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
5. 株式への投資割合には、制限を設けません。
6. 外貨建資産への投資は、行いません。
7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。

当ファンドが対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、前記ファンド情報 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 <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18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。)とします。

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24条に定めるものに限ります。)

ハ. 金銭債権

運用の指図範囲等(約款第19条第1項)

委託会社は信託財産を主として株式に投資することを指図します。

運用の指図範囲等(約款第19条第2項)

上記の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託財産を、上記に掲げる株式のほか、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ができます。

1. 預金

2. コール・ローン

(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2020年7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。

（４）【分配方針】

1 収益分配方針

毎決算時（毎年1月、7月の8日。）に、以下の方針に基づき収益分配を行います。

経費控除後の配当等収益（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。）の全額を分配することを原則とします。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

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

2 収益分配方式

(1)信託財産から生じる配当等収益と前期から繰り越した分配準備積立金は、諸費用および監査費用等ならびに当該諸費用および監査費用等にかかる消費税および地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等相当額を控除し、前期から繰り越した負数の分配準備積立金があるときはその全額を補てんした後、その残額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。また、収益分配金額の調整のためその一部または全部を信託財産内に留保したときは分配準備積立金として積み立て、次期以降の分配にあてることができます。なお、諸費用および監査費用等ならびに当該諸費用および監査費用等にかかる消費税等相当額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等相当額を控除しきれないときは、その差額を負数の分配準備積立金として次期に繰り越します。

(2)毎計算期末に信託財産から生じた1.に掲げる利益の合計額は、2.に掲げる損失を控除し、繰越欠損金があるときは、その全額を補てんした後、次期に繰り越します。

1. 有価証券売買益(評価益を含みます。)、先物取引等取引益(評価益を含みます。)、交換(解約)差益金、追加信託差益金
2. 有価証券売買損(評価損を含みます。)、先物取引等取引損(評価損を含みます。)、交換(解約)差損金、追加信託差損金

3 収益分配金の支払い

- (1) 受託会社は、計算期間終了日において受益者名簿に名義登録されている者を計算期間終了日における受益者(以下「名義登録受益者」といいます。)として、当該名義登録受益者に収益分配金を支払います。
- (2) 受託会社は、収益分配金の支払いについて、受益者名簿の作成を委託した者にこれを委託することができます。
- (3) 上記(1)に規定する収益分配金の支払いは、原則として、毎計算期間終了日から起算して40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定する預金口座等に当該収益分配金を振り込む方式または同日から分配金領収証等により行うものとします。なお、名義登録受益者が金融商品取引所の会員と別途収益分配金の取扱いにかかる契約を締結している場合は、当該契約にしたがい支払われるものとします。

(5) 【投資制限】

株式への投資割合には、制限を設けません。(約款第21条)

外貨建資産への投資は、行いません。(約款第21条)

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。(約款第21条)

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、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。(約款第21条)

投資する株式等の範囲(約款第23条)

1) 委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。

2) 上記1)の規定にかかわらず、上場予定の株式で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができます。

先物取引等の運用指図(約款第24条)

委託会社は、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。)、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。

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を貸付時点において、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範囲内で貸付の指図をすることができます。
- 2) 上記1)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、株式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にかかる議決権(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。)の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図しないものとします。

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。

当ファンドは株式に投資をしますので、株式市場が下落した場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

信用リスク

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

当ファンドが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。

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もあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。

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。

当ファンドは、基準価額が対象指数と連動する投資成果を目指しますが、主として次のような要因があるため、対象指数と一致した推移をすることを運用上お約束できるものではありません。

- ・対象指数の構成銘柄について、指数の算出方法どおりの評価価格若しくは構成銘柄異動のタイミングで取引できない場合があること
- ・当ファンドと対象指数の個別銘柄毎の構成比率が完全に一致しないこと
- ・追加設定の一部が金銭にて行われた場合、または組入銘柄の配当金や権利処理等によって、信託財産に現金が発生すること
- ・先物を利用した場合、先物価格と同指数との間に価格差があること
- ・信託報酬等のコスト負担があること

当ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。

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、取得申込の受付または交換請求の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付または交換請求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、受益権の口数が200万口を下回ることとなった場合、または、やむを得ない事情が発生した場合は、信託を終了(繰上償還)する場合があります。

委託会社は、信託期間中において下記に該当することとなった場合は、受託会社と合意のうえ、信託を終了(繰上償還)させます。

1. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合
2. 対象指数が廃止された場合
3. 対象指数の計算方法の変更等に伴って委託会社または受託会社が必要と認めた約款の変更が書面決議により否決された場合

なお、1.に掲げる事由によりこの信託契約を解約する場合には、その廃止された日に信託を終了(繰上償還)するための手続きを開始するものとします。

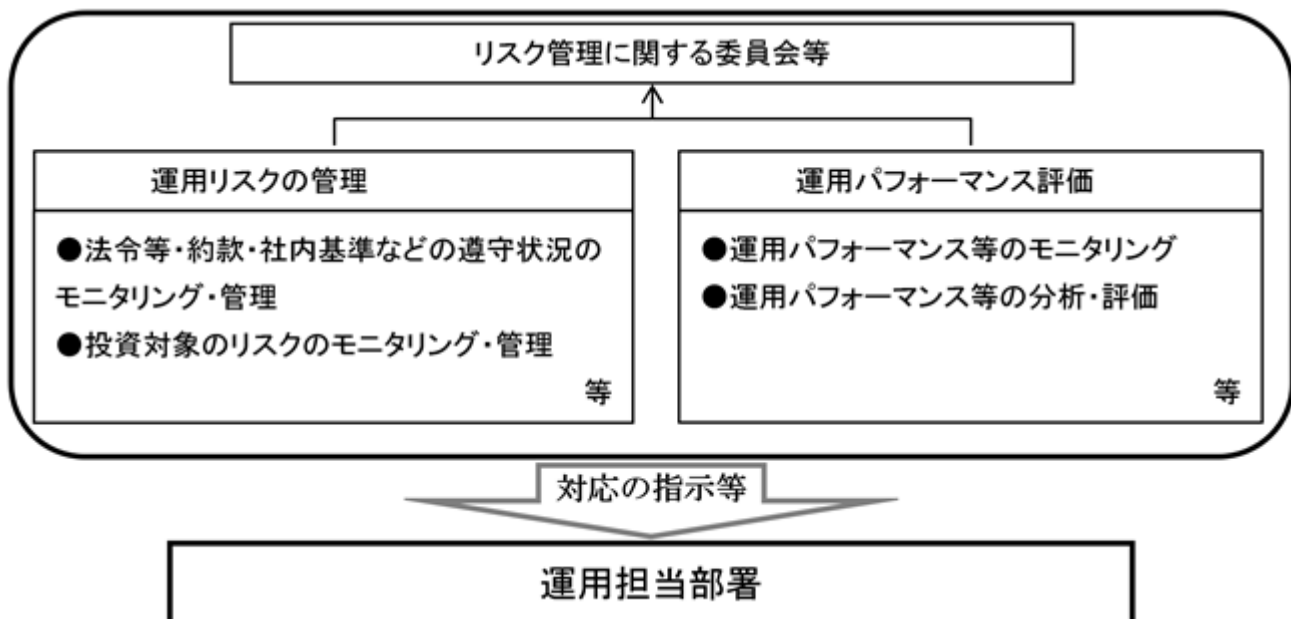
・注意事項

- イ.当ファンドは、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、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2020年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

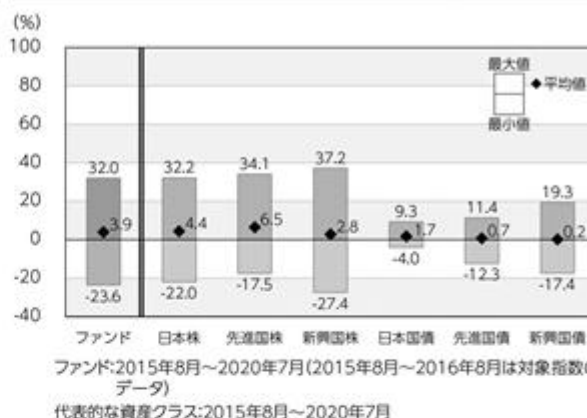
<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



- *ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- *ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- *ファンド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指数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。
- *ファンドの対象指数は東証株価指数(TOPIX)です。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

販売会社が定める額とします。

消費税等相当額がかかります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

お申込手数料は、商品や投資環境の説明および情報提供等、ならびに取得に関する事務手続き等にかかる費用の対価として、販売会社に支払われます。

(2)【換金（解約）手数料】

販売会社が定める額とします。

消費税等相当額がかかります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

交換手数料は、受益権の交換または受益権の買取りに関する事務手続き等にかかる費用の対価として、販売会社に支払われます。

(3)【信託報酬等】

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、以下により計算される と の合計額とします。

ただし、 により計算される額（税抜）と により計算される額（税抜）の合計額は、各計算期間においてファンドの純資産総額に対して年率0.25%（税抜）を乗じて得た額を超えないものとします。

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.0858%（税抜0.078%）以内の率を乗じて得た額

2020年10月8日現在は、年率0.0858%（税抜0.078%）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0.050%	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
受託会社	年率0.028%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行、名義登録事務・分配金支払関係事務等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

株式の貸付の指図を行った場合は、その品貸料に55%（税抜 50%）以内の率を乗じた額につき、委託会社と受託会社で折半します。

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。

受益権の上場にかかる費用(年間上場料(毎年末の純資産総額に対して0.00825%(税抜0.0075%))、追加上場料(追加上場時の増加額(毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額)に対して0.00825%(税抜0.0075%))は、信託財産から支払うことができるものとします。

対象指数についての商標(これに類する商標を含みます。)の使用料(信託財産の純資産総額に対して最大年率0.033%(税抜0.030%)、ただし165万円(税抜150万円)を下回る場合は165万円(税抜150万円))は、信託財産から支払うことができるものとします。

お申込時に要するその他の費用

- ・対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内に該当する日において、委託会社の判断により取得申込みを受け付けるときには、配当落または権利落対象銘柄の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額として委託会社が定める金額(当該時価総額の0.05%)を徴することができるものとします。
- ・取得申込者が現物株式ポートフォリオに含まれる株式の発行会社等である場合には、原則として当該株式の時価総額に相当する金額を金銭にて支払います。この場合、当該株式を取得するために必要な経費に相当する金額(当該時価総額の0.05%)を金銭にて支払うものとします。

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。

2020年10月8日現在。

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）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上特定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

受益権の売却時

売却時の差益（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。

売却価額から取得費用（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

収益分配時

収益分配金は配当所得として課税されます。

原則として、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（申告不要）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。

受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記と同様の取扱いとなります。

売却時および交換時の差損（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ます。）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

特定株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入したETF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（特定株式投資信託の場合、収益分配金の受取方法として、非課税口座を開設する金融機関等経由で受領する「株式数比例配分方式」を選択する必要があります。）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

受益権の売却時

通常の株式の売却時と同様に、譲渡益について、他の法人所得と合算して課税されます。

収益分配金の受取り時

収益分配金については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率で源泉徴収されます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。なお、当ファンドは、原則として、益金不算入制度の適用が可能です。

受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記と同様の取扱いとなります。

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。

上記は2020年7月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

令和2年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	231,168,172,370	98.66
内 日本	231,168,172,370	98.66
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,137,767,633	1.34
純資産総額	234,305,940,003	100.00

その他資産の投資状況

令和2年7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）	3,127,685,000	1.33
内 日本	3,127,685,000	1.33

（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2年7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	1,230,400	6,728.97 8,279,326,926	6,217.00 7,649,396,800	- -	3.26
2	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	858,500	6,036.44 5,182,285,612	6,595.00 5,661,807,500	- -	2.42
3	ソニー 日本	株式 電気機器	690,800	7,465.66 5,157,281,729	8,076.00 5,578,900,800	- -	2.38
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	99,900	44,612.05 4,456,744,619	44,220.00 4,417,578,000	- -	1.89
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,446,400	2,488.61 3,599,533,886	2,443.50 3,534,278,400	- -	1.51
6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	917,400	3,767.65 3,456,445,946	3,756.00 3,445,754,400	- -	1.47
7	任天堂 日本	株式 その他製品	67,600	49,553.84 3,349,840,000	46,440.00 3,139,344,000	- -	1.34
8	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	7,439,600	420.05 3,125,025,161	393.20 2,925,250,720	- -	1.25
9	第一三共 日本	株式 医薬品	315,500	8,529.85 2,691,168,108	9,258.00 2,920,899,000	- -	1.25
10	ダイキン工業 日本	株式 機械	140,500	18,402.31 2,585,525,000	18,450.00 2,592,225,000	- -	1.11

11	KDDI 日本	株式 情報・通 信業	788,800	3,262.21 2,573,238,091	3,259.00 2,570,699,200	- -	1.10
12	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス 業	754,900	3,628.49 2,739,152,566	3,268.00 2,467,013,200	- -	1.05
13	HOYA 日本	株式 精密機器	218,800	10,728.61 2,347,422,000	10,420.00 2,279,896,000	- -	0.97
14	信越化学工業 日本	株式 化学	185,400	12,405.51 2,299,983,000	12,275.00 2,275,785,000	- -	0.97
15	NTTドコモ 日本	株式 情報・通 信業	773,700	2,926.71 2,264,399,025	2,907.50 2,249,532,750	- -	0.96
16	日本電産 日本	株式 電気機器	265,400	7,106.11 1,885,963,900	8,375.00 2,222,725,000	- -	0.95
17	本田技研工業 日本	株式 輸送用機 器	868,200	2,727.37 2,367,903,865	2,524.00 2,191,336,800	- -	0.94
18	村田製作所 日本	株式 電気機器	323,900	6,559.89 2,124,751,015	6,609.00 2,140,655,100	- -	0.91
19	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	752,200	3,036.18 2,283,820,528	2,800.00 2,106,160,000	- -	0.90
20	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	70,000	29,798.74 2,085,912,000	28,800.00 2,016,000,000	- -	0.86
21	花王 日本	株式 化学	264,000	8,533.39 2,252,815,600	7,636.00 2,015,904,000	- -	0.86
22	SMC 日本	株式 機械	34,600	56,585.95 1,957,874,000	55,070.00 1,905,422,000	- -	0.81
23	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	14,778,200	132.30 1,955,213,286	127.60 1,885,698,320	- -	0.80
24	ファナック 日本	株式 電気機器	103,700	19,372.67 2,008,946,500	17,705.00 1,836,008,500	- -	0.78
25	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	759,600	2,311.42 1,755,757,020	2,300.00 1,747,080,000	- -	0.75
26	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	384,500	4,657.77 1,790,915,122	4,436.00 1,705,642,000	- -	0.73
27	日立製作所 日本	株式 電気機器	529,800	3,393.20 1,797,717,870	3,128.00 1,657,214,400	- -	0.71
28	中外製薬 日本	株式 医薬品	344,900	5,520.71 1,904,095,789	4,736.00 1,633,446,400	- -	0.70
29	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	956,100	1,732.43 1,656,376,918	1,650.00 1,577,565,000	- -	0.67
30	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,102,600	1,404.66 1,548,782,011	1,370.50 1,511,113,300	- -	0.64

(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2年7月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	98.66
合計	98.66

(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2年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	15.55
情報・通信業		10.65
化学		7.14
輸送用機器		6.94
医薬品		6.75
機械		5.31
サービス業		5.19
小売業		5.02
銀行業		4.76
卸売業		4.44
食料品		3.83
陸運業		3.49
精密機器		2.62
その他製品		2.48
建設業		2.45
不動産業		1.86
保険業		1.83
電気・ガス業		1.45
その他金融業		1.07
証券、商品先物取引業		0.81
ガラス・土石製品		0.74
非鉄金属		0.69
ゴム製品		0.54
金属製品		0.53
鉄鋼		0.53
繊維製品		0.47
石油・石炭製品		0.41
空運業		0.31
パルプ・紙		0.22
倉庫・運輸関連業		0.18
鉱業		0.17
海運業		0.13
水産・農林業		0.09
合計		98.66

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

令和2年7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 0209月	買建	209	3,247,114,620	3,127,685,000	1.33

(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2年7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)	東京証券取引所 市場相場
第1計算期間末 (平成28年1月8日)	40,584	40,937	1,447.21	1,459.81	1,450
第2計算期間末 (平成28年7月8日)	44,899	45,464	1,208.07	1,223.27	-
第3計算期間末 (平成29年1月8日)	56,557	57,023	1,552.83	1,565.63	1,549
第4計算期間末 (平成29年7月8日)	91,052	91,952	1,608.21	1,624.11	1,606
第5計算期間末 (平成30年1月8日)	120,051	120,757	1,887.27	1,898.37	1,882
第6計算期間末 (平成30年7月8日)	140,726	142,050	1,700.57	1,716.57	1,706
第7計算期間末 (平成31年1月8日)	142,613	144,146	1,525.21	1,541.61	1,533
第8計算期間末 (令和1年7月8日)	171,217	173,344	1,586.07	1,605.77	1,586
第9計算期間末 (令和2年1月8日)	201,916	203,981	1,711.25	1,728.75	1,710
第10計算期間末 (令和2年7月8日)	234,565	237,149	1,570.66	1,587.96	1,573
令和1年7月末日	169,939	-	1,572.79	-	1,575
8月末日	176,585	-	1,519.59	-	1,519
9月末日	185,153	-	1,611.14	-	1,609
10月末日	197,750	-	1,691.58	-	1,692
11月末日	198,161	-	1,724.31	-	1,726
12月末日	206,385	-	1,749.12	-	1,749
令和2年1月末日	198,752	-	1,694.15	-	1,695
2月末日	176,834	-	1,519.94	-	1,521
3月末日	186,667	-	1,429.44	-	1,438
4月末日	178,573	-	1,491.01	-	1,492
5月末日	195,726	-	1,592.33	-	1,596
6月末日	234,274	-	1,589.65	-	1,602
7月末日	234,305	-	1,508.88	-	1,509

(注) 計算期間末日が休業日の場合は、前営業日の市場相場を記載しています。

【分配の推移】

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	12.60
第2計算期間	15.20
第3計算期間	12.80
第4計算期間	15.90
第5計算期間	11.10
第6計算期間	16.00
第7計算期間	16.40
第8計算期間	19.70
第9計算期間	17.50
第10計算期間	17.30

【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	1.0
第2計算期間	15.5
第3計算期間	29.6
第4計算期間	4.6
第5計算期間	18.0
第6計算期間	9.0
第7計算期間	9.3
第8計算期間	5.3
第9計算期間	9.0
第10計算期間	7.2

（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	35,858,160	7,815,108
第2計算期間	24,924,100	15,800,837
第3計算期間	24,942,000	25,686,378
第4計算期間	51,843,900	31,648,350
第5計算期間	42,764,100	35,770,629
第6計算期間	54,811,700	35,670,362
第7計算期間	24,523,700	13,771,799
第8計算期間	20,383,600	5,937,088
第9計算期間	14,005,300	3,962,287
第10計算期間	81,712,800	50,364,192

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

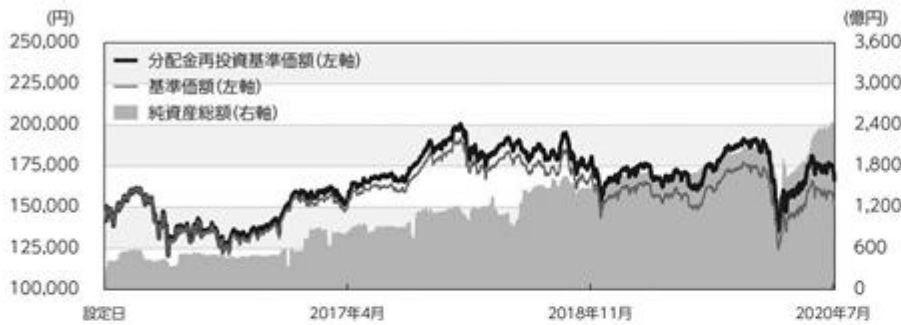
（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

（注3）解約口数は交換口数を表示しています。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2020年7月31日

基準価額・純資産の推移 (2015年9月4日~2020年7月31日)



※基準価額は100口当たり信託報酬控除後の価額です。設定当初の投資元本は147,500円(100口当たり)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:2015年9月4日)

分配の推移(税引前)

2018年7月	1,600円
2019年1月	1,640円
2019年7月	1,970円
2020年1月	1,750円
2020年7月	1,730円
設定来累計	15,450円

※分配金は100口当たりです。

主要な資産の状況

※比率(%)は、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	98.66
内 日本	98.66
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.34
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)	1.33

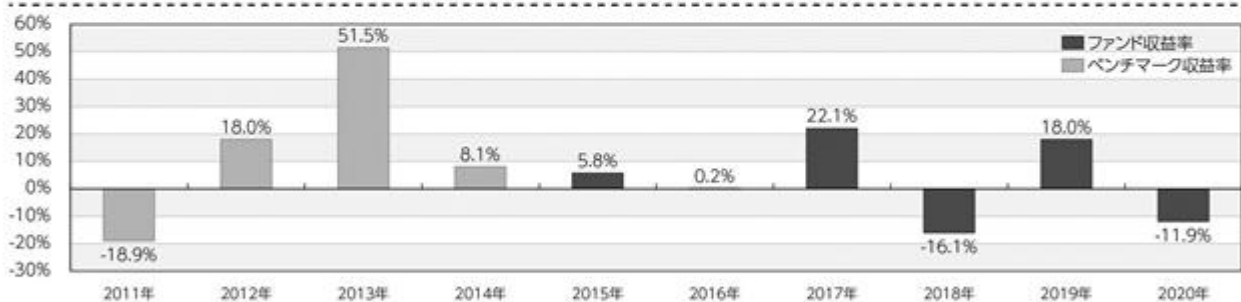
株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	15.55
2	情報・通信業	10.65
3	化学	7.14
4	輸送用機器	6.94
5	医薬品	6.75

組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.26
2	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.42
3	ソニー	株式	日本	電気機器	2.38
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.89
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.51
6	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.47
7	任天堂	株式	日本	その他製品	1.34
8	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.25
9	第一三共	株式	日本	医薬品	1.25
10	ダイキン工業	株式	日本	機械	1.11

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。
 ※2015年は設定日から年末までの収益率、および2020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。
 ※2014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)」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】

・お申込の受付

取得申込みの受付は原則として販売会社の毎営業日に行われます。

取得申込みの受付は原則として正午までにお申込みが行われ、かつ、取得申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとして取扱います。

原則として、以下の日を取得申込受付日とする申込みはできません。ただし、下記1.から4.に該当する場合であっても、委託会社の判断により、受益権の取得申込みを受け付けることがあります。

- 1.対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内
- 2.対象指数の銘柄変更実施日および銘柄株数変更実施日の各々3営業日前から起算して4営業日以内
- 3.計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内(ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内)
- 4.ファンドが終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
- 5.上記1.から4.のほか、委託会社が、運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めるとき

・お申込単位

1ユニット以上1ユニット単位とします。

「ユニット」とは、対象指数に連動すると委託会社が想定する現物株式ポートフォリオの1単位に相当する口数の受益権をいいます。

取得申込口数は、100口の整数倍とし、現物株式ポートフォリオ1単位の評価額を取得申込受付日の基準価額で除して得た口数をもとに、取得申込受付日に委託会社が定めます。

・お申込価額

取得申込受付日の基準価額 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。当ファンドの基準価額は100口当たりで表示されます。

< 基準価額の照会方法等 >

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)

・お申込方法

受益権の取得は、原則として委託会社が事前に提示する現物株式ポートフォリオによる設定に限定します。

委託会社は、取得申込受付日の2営業日前までに、取得申込日に適用される現物株式ポートフォリオの銘柄および数量を申込みユニット数に応じて決定し、提示します。

現物株式ポートフォリオの評価額が、取得申込口数に取得申込受付日の基準価額を乗じて得た額に満たない場合は、その差額に相当する金額について金銭を充当するものとします。

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、原則として取得申込のユニット数に応じた現物株式ポートフォリオおよび金銭(現物株式ポートフォリオ等)を販売会社に引き渡すものとします。

対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内に該当する日において、委託会社の判断により取得申込みを受け付けるときには、当該取得申込みにかかる有価証券のうち、配当落または権利落対象銘柄の株式の個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを受け付けることができるものとします。この場合において、委託会社は、配当落または権利落対象銘柄の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額として委託会社が定める金額(当該時価総額の0.05%)を徴することができるものとします。

取得申込者が対象指数に採用されている銘柄の株式の発行会社またはその子会社(会社法第2条第3号に規定する子会社をいい、当該発行会社を含めて以下「発行会社等」といいます。)である場合には、取得申込みにかかる有価証券のうち当該発行会社等の株式の個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを受け付けることができるものとします。この場合において、委託会社は、当該発行会社の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額として委託会社が定める金額(当該時価総額の0.05%)を徴することができるものとします。また、取得申込みを当該取得申込者から受け付けた販売会社は、取得申込みを取り次ぐ際に委託会社にその旨を書面をもって通知するものとします。この通知が取得申込みの取次ぎの際に行われなかった場合において、そのことによって信託財産その他に損害が生じたときには、取得申込みを取り次いだ販売会社がその責を負うものとします。

・ 申込手数料

販売会社が定める額とします。

消費税等相当額がかかります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・ その他

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、取得申込みの受け付けを中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受け付けを取り消すことができます。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、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、販売会社は、当該取得申込みにかかる現物株式ポートフォリオ等の受渡しまたは支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載

または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託にかかる現物株式ポートフォリオ等について受入れまたは振替済の通知を受けた場合には、振替機関に対し追加信託が行われた旨を通知するものとします。

2【換金（解約）手続等】

・解約の受付

解約の請求はできません。

・交換の受付

受益者は、毎営業日、自己に帰属する受益権と信託財産に属する有価証券との交換（「交換」といいます。）を請求できます。受益者が交換の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

交換請求の受付は、原則として正午までに交換請求が行われ、かつ、交換請求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該交換請求受付日の請求として取扱います。

原則として、以下の日を交換請求受付日とする請求はできません。ただし、下記1.から4.に該当する場合であっても、委託会社の判断により、受益権の交換請求を受け付けることがあります。

- 1.対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日
 - 2.対象指数の銘柄変更実施日および銘柄株数変更実施日の各々3営業日前から起算して6営業日以内
 - 3.計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内）
 - 4.ファンドが終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
 - 5.上記1.から4.のほか、委託会社が、約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めたとき
- また、委託会社は約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合に、大口の交換請求に制限を設ける場合があります。

・交換単位

委託会社が定める口数（最小交換口数）の整数倍とします。

「最小交換口数」は、委託会社が交換請求受付日の2営業日前までに提示します。

・交換価額

交換にかかる受益権の評価額は交換請求受付日の基準価額 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。

< 基準価額の照会方法等 >

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)

・交換の方法

委託会社は、交換の請求を受け付けた場合には、受益者から提示された口数から受益者が取得できる個別銘柄の有価証券の数と、交換に要する受益権の口数を計算します。

委託会社は、受託会社に対し、上記により計算された口数の受益権と信託財産に属する有価証券のうち取引所売買単位(金融商品取引所が定める一売買単位をいいます。)の整数倍となる有価証券を交換するよう指図します。

受益者への交換有価証券の交付に際しては、原則として交換請求受付日から起算して3営業日目から振替機関等の口座に交換請求を行った受益者にかかる有価証券の増加の記載または記録が行われます。

交換の請求を行った受益者が対象指数に採用されている銘柄の株式の発行会社等である場合には、原則として、委託会社は、交換に要する受益権の口数から当該発行会社の株式の個別銘柄時価総額に相当する口数を除いた口数の受益権と、取引所売買単位の整数倍となる有価証券(当該発行会社の株式を除きます。)を交換するよう指図するものとします。なお、この場合、当該交換の請求を受益者から受け付けた販売会社は、交換の請求を取り次ぐ際に委託会社にその旨を書面をもって通知するものとします。この通知が交換の請求の取次ぎの際に行われなかった場合において、そのことによって信託財産その他に損害が生じたときには、交換の請求を取り次いだ販売会社がその責を負うものとします。

対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日に該当する日において、委託会社の判断により、受益権の交換請求を受け付けた場合には、交換に要する受益権の口数と信託財産に属する有価証券のうち取引所売買単位の整数倍となる有価証券(当該配当落または権利落対象銘柄(以下、「対象銘柄」という場合があります。))を除きます。)および当該対象銘柄の個別銘柄時価総額に相当する金銭を交換するよう指図します。

・交換手数料

販売会社が定める額とします。

消費税等相当額がかかります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・その他

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、交換請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた交換請求の受付を取り消すことがあります。交換請求の受付を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交換請求を撤回できます。ただし、受益者がその交換請求を撤回しない場合には、当該受益権の交換価額は、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交換請求を受け付けたものとして計算した価額とします。

販売会社は、振替機関の定める方法により、振替受益権の抹消にかかる手続きを行うものとします。当該抹消にかかる手続きおよび交換有価証券にかかる振替の請求が行われた後に、振替機関は、当該交換にかかる受益権の口数と同口数の振替受益権を抹消するものとし、社振法の規定にしたがい振替機関等の口座に交換の請求を行った受益者にかかる当該口数の減少の記載または記録が行われます。委託会社は、交換請求の受付日の翌営業日以降、交換によって抹消されることとなる振替受益権と同口数の受益権を失効したのものとして取り扱うこととし、受託会社は委託会社の交換の指図に基づいて、交換にかかる振替受益権については、振替口座簿における抹消の手続きおよび交換有価証券の振替日における抹消の確認をもって、当該振替受益権を受入れ抹消したのものとして取り扱います。

・買取り

販売会社は、次に該当する場合で受益者の請求があるときは、受益権を買い取ります。

買取請求の受付は、原則として販売会社の定める時刻までに買取請求が行われ、かつ、買取請求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買取請求受付分とします。

ただし、2.の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。

1. 交換により生じた取引所売買単位未満の振替受益権
2. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になったとき

受益権の買取価額は、買取請求の受付日の基準価額とします。

販売会社は、受益権の買取りを行うときは、販売会社が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を徴することができるものとします。

販売会社は、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、委託会社との協議に基づいて受益権の買取りを停止することおよびすでに受け付けた受益権の買取りを取り消すことができます。

受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取停止以前に行った当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、買取停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受け付けたものとします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは、純資産総額(信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券を除きます。))を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除して得た金額)を、計算日における受益権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
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場

なお、当ファンドの基準価額は100口当たりで表示されます。

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、2015年9月4日から無期限です。

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】

計算期間は、原則として毎年1月9日から7月8日まで、および7月9日から翌年1月8日までとすることを原則とし、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、信託財産の一部を受益権と交換することにより受益権の口数が200万口を下回ることとなった場合、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、信託期間中において次の1.から3.に該当することとなった場合は、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させます。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るものとします。

1.受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合

2.対象指数が廃止された場合

3.対象指数の計算方法の変更等に伴って委託会社または受託会社が必要と認めた約款の変更が書面決議により否決された場合

なお、1.に掲げる事由によりこの信託契約を解約する場合には、その廃止された日に信託を終了するための手続きを開始するものとします。

c.委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約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。

- d. 上記c.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。以下本d.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- e. 上記c.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- f. 上記c.からe.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c.からe.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。
- g. 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。
- h. 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。
- i. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- j. 信託契約の解約を行う場合には、書面決議において当該解約に反対した受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続きに関する事項は、上記c.に規定する書面に付記します。

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ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項(上記a.の変更事項にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及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。以下本c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 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であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁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. 重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続に関する事項は、上記b.に規定する書面に付記します。

八．関係法人との契約の更改

証券投資信託の指定参加者契約について、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

運用報告書は作成しません。

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権および名義登録

受益者(計算期間終了日において受益者名簿に名義登録されている受益者(「名義登録受益者」といいます。))とします。)は、収益分配金を持分にに応じて請求する権利を有します。

受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失います。

収益分配金は、原則として、毎計算期間終了日から起算して40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定する預金口座等に当該収益分配金を振り込む方式または同日から分配金領収証等により支払われます。

(注) 受託会社は、ファンドにかかる受益者名簿を作成し、受益者について、その氏名または名称、住所および個人番号(行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律(平成二十五年法律第二十七号)第二条第五項に規定する個人番号をいう。以下同じ。)または法人番号(同条第十五項に規定する法人番号をいう。以下同じ。)(個人番号または法人番号を有しない者にあつては、氏名または名称および住所。)、その他受託会社が定める事項を、受益者名簿に名義登録するものとします。また、計算期間終了日において、社振法等関係法令、諸規則等に基づき、振替機関より通知を受けた受益権の帰属者を振替機関等の振替口座簿に記載または記録された受益権にかかる受益者として、その氏名または名称、住所および個人番号または法人番号(個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所。)、その他受託会社の定める事項を受益者名簿に登録するものとします。なお、受託会社は他の証券代行会社等、受託会社が適当と認める者と委託契約を締結し、受益者名簿の作成および受益者名簿への名義登録を委託することができます。

受益者は、ファンドの受益権が上場されている金融商品取引所の会員(口座管理機関であるものに限ります。)を経由して受益者名簿の名義登録を請求することができます。この場合、当該会員は、当該会員が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を徴することができるものとします。ただし、証券金融会社等は登録を受託会社(受託会社が受益者名簿の作成を委託した場合は、その委託をした者)に対して直接に行うことができます。

名義登録は、毎計算期間の末日の翌日から15日間停止するものとします。また、ファンドが終了することとなる場合は、信託終了日の直前5営業日間において名義登録を停止するものとします。

(2) 信託終了時の交換請求権

受益者は、信託が終了するときは、持ち分に応じて交換を請求する権利を有します。

委託会社は、この信託が終了するときは、委託会社が別に定める一定口数以上の受益権を有する受益者に対しては、信託財産に属する有価証券を当該受益権として振替口座簿に記載または記録されている振替受益権と引換えに交換するものとします。この場合、受益者が取得する個別銘柄の株数は、信託終了日の5営業日前の日の基準価額に基づいて計算された株数とし、取引所売買単位の整数倍とします。その他の事項については、「2 換金(解約)手続等」の規定に準じるものとします。

販売会社は、委託会社が別に定める一定口数未満の受益権について買取るものとします。この場合には、当該販売会社が別に定める手数料および当該手数料に対する消費税等相当額を徴することができるものとします。

この信託が終了するときは、販売会社は、その所有にかかるすべての受益権を交換請求するものとします。交換により引渡される株式に当該販売会社の発行する株式または当該販売会社が子会社となる株式が含まれる場合には、委託会社は、受託会社に対しこれを売却する指図をするとともに、当該株式等の評価額に相当する口数の受益権を、受託会社は信託財産をもって買取るものとします。

受益者が、信託終了時における交換による有価証券、信託終了にかかる金銭および買取りにかかる金銭について信託終了日から10年間その受渡しを請求しないときは、その権利を失います。

(3) 交換請求権および買取請求権

受益者は、保有する受益権について、交換または買取りを請求する権利を有します。権利行使の方法等については、「2 換金(解約)手続等」をご参照下さい。

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) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 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10期計算期間(令和2年1月9日から令和2年7月8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】

【One ETF トピックス】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第9期 令和2年1月8日現在	第10期 令和2年7月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	69,940,566,477	98,945,669,617
株式	199,334,924,323	231,502,723,980
未収配当金	282,116,453	306,091,135
未収利息	3,505,275	4,698,928
前払金	-	179,766,270
その他未収収益	41,219,839	55,533,552
差入委託証拠金	131,040,000	201,465,000
流動資産合計	269,733,372,367	331,195,948,482
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	33,819,830	125,015,670
前受金	5,985,000	-
未払金	22,406,520	108,791,040
未払収益分配金	2,064,890,135	2,583,622,309
未払受託者報酬	37,050,337	38,642,643
未払委託者報酬	59,700,473	61,713,605
受入担保金	65,565,604,691	93,654,371,243
その他未払費用	27,661,880	58,363,230
流動負債合計	67,817,118,866	96,630,519,740
純資産の部		
元本等		
元本	174,040,739,950	220,279,936,750
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	27,875,513,551	14,285,491,992
(分配準備積立金)	8,650,450	1,771,855
元本等合計	201,916,253,501	234,565,428,742
純資産合計	201,916,253,501	234,565,428,742
負債純資産合計	269,733,372,367	331,195,948,482

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第9期 自 令和1年7月9日 至 令和2年1月8日	第10期 自 令和2年1月9日 至 令和2年7月8日
営業収益		
受取配当金	1,953,507,627	2,228,734,262
受取利息	15,770,901	16,641,125
有価証券売買等損益	14,758,323,698	19,161,492,062
派生商品取引等損益	308,258,214	73,832,940
その他収益	250,428,628	491,913,748
営業収益合計	17,286,289,068	16,350,369,987
営業費用		
支払利息	16,732,808	17,362,615
受託者報酬	37,050,337	38,642,643
委託者報酬	59,700,473	61,713,605
その他費用	39,457,435	42,826,558
営業費用合計	152,941,053	160,545,421
営業利益又は営業損失()	17,133,348,015	16,510,915,408
経常利益又は経常損失()	17,133,348,015	16,510,915,408
当期純利益又は当期純損失()	17,133,348,015	16,510,915,408
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額()	-	-
期首剰余金又は期首欠損金()	11,990,624,570	27,875,513,551
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,497,733,156	5,504,516,158
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	2,376,256,350
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,497,733,156	3,128,259,808
剰余金減少額又は欠損金増加額	681,302,055	-
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	681,302,055	-
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	2,064,890,135	2,583,622,309
期末剰余金又は期末欠損金()	27,875,513,551	14,285,491,992

(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10期	
	自	至
	令和2年1月9日	令和2年7月8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	第9期	第10期
	令和2年1月8日現在	令和2年7月8日現在
1. 期首元本額	159,227,295,775円	174,040,739,950円
期中追加設定元本額	20,657,817,500円	120,526,380,000円
期中一部交換元本額	5,844,373,325円	74,287,183,200円
2. 受益権の総数	117,993,722口	149,342,330口
3. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	62,616,166,600円	88,067,768,950円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第9期	第10期
	自 令和1年7月9日 至 令和2年1月8日	自 令和2年1月9日 至 令和2年7月8日
1. その他費用	その他費用の内訳は、監査費用(542,424円)、ライセンス料(29,650,772円)、その他(9,264,239円)となっております。	その他費用の内訳は、監査費用(505,236円)、ライセンス料(30,582,084円)、その他(11,739,238円)となっております。
2. 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当金等収益額(2,202,974,348円)及び分配準備積立金(6,774,482円)の合計額から、経費(136,208,245円)を控除して計算される分配対象額は2,073,540,585円(100口当たり1,757円)であり、うち2,064,890,135円(100口当たり1,750円)を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当金等収益額(2,719,926,520円)及び分配準備積立金(8,650,450円)の合計額から、経費(143,182,806円)を控除して計算される分配対象額は2,585,394,164円(100口当たり1,731円)であり、うち2,583,622,309円(100口当たり1,730円)を分配金額としております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第9期	第10期
	自 令和1年7月9日 至 令和2年1月8日	自 令和2年1月9日 至 令和2年7月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第9期 令和2年1月8日現在	第10期 令和2年7月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(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。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第9期 令和2年1月8日現在	第10期 令和2年7月8日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	14,317,773,114	6,284,728,238
合計	14,317,773,114	6,284,728,238

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	第9期 令和2年1月8日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	2,597,750,000	-	2,563,980,000	33,770,000
合計	2,597,750,000	-	2,563,980,000	33,770,000

種類	第10期 令和2年7月8日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	3,213,430,000	-	3,088,480,000	124,950,000
合計	3,213,430,000	-	3,088,480,000	124,950,000

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（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9期 令和2年1月8日現在	第10期 令和2年7月8日現在
1口当たり純資産額 (100口当たり純資産額)	1,711.25円 (171,125円)	1,570.66円 (157,066円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

令和2年7月8日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	5,000	2,733.00	13,665,000	貸付株式数 1,700株
日本水産	143,900	467.00	67,201,300	貸付株式数 64,600株 (33,800株)
マルハニチロ	20,800	2,138.00	44,470,400	貸付株式数 9,300株

ハウスイ	800	895.00	716,000	
カネコ種苗	4,400	1,440.00	6,336,000	貸付株式数 1,300株
サカタのタネ	17,200	3,260.00	56,072,000	貸付株式数 7,700株
ホクト	11,000	2,004.00	22,044,000	貸付株式数 4,900株
ホクリヨウ	2,200	646.00	1,421,200	貸付株式数 900株
ヒノキヤグループ	3,600	1,552.00	5,587,200	貸付株式数 1,400株
ショーボンドホールディングス	22,400	4,830.00	108,192,000	貸付株式数 10,000株
ミライト・ホールディングス	42,800	1,566.00	67,024,800	貸付株式数 19,200株
タマホーム	7,800	1,213.00	9,461,400	貸付株式数 3,300株
サンヨーホームズ	1,200	633.00	759,600	貸付株式数 400株
日本アクア	5,700	607.00	3,459,900	貸付株式数 2,400株
ファーストコーポレーション	4,400	555.00	2,442,000	貸付株式数 1,600株
ベステラ	2,500	1,010.00	2,525,000	貸付株式数 800株
TATERU	29,700	182.00	5,405,400	貸付株式数 10,400株 (1,000株)
キャンディル	2,400	536.00	1,286,400	貸付株式数 1,000株 (400株)
スペースバリューホールディングス	17,500	356.00	6,230,000	貸付株式数 7,300株
住石ホールディングス	29,100	121.00	3,521,100	貸付株式数 3,700株
日鉄鉱業	3,300	4,210.00	13,893,000	貸付株式数 700株
三井松島ホールディングス	5,600	792.00	4,435,200	貸付株式数 1,000株
国際石油開発帝石	577,300	634.00	366,008,200	貸付株式数 172,600株
石油資源開発	18,800	1,815.00	34,122,000	貸付株式数 8,400株
K&Oエナジーグループ	7,000	1,455.00	10,185,000	貸付株式数 2,000株
ダイセキ環境ソリューション	2,800	811.00	2,270,800	貸付株式数 1,200株
第一カッター興業	1,800	2,388.00	4,298,400	貸付株式数 500株
明豊ファシリティワークス	4,600	548.00	2,520,800	貸付株式数 2,000株

安藤・間	85,700	602.00	51,591,400	貸付株式数 38,400株
東急建設	42,200	540.00	22,788,000	貸付株式数 17,900株
コムシスホールディングス	51,000	3,115.00	158,865,000	貸付株式数 22,900株 (15,300株)
ビーアールホールディングス	15,700	572.00	8,980,400	貸付株式数 7,000株
高松コンストラクショングループ	9,000	2,365.00	21,285,000	貸付株式数 3,000株
東建コーポレーション	4,400	6,970.00	30,668,000	貸付株式数 1,800株
ソネック	1,500	789.00	1,183,500	貸付株式数 400株
ヤマウラ	6,200	845.00	5,239,000	貸付株式数 2,700株
大成建設	110,800	3,840.00	425,472,000	貸付株式数 41,400株
大林組	332,300	990.00	328,977,000	貸付株式数 139,900株 (113,500株)
清水建設	337,300	847.00	285,693,100	貸付株式数 150,900株 (106,700株)
飛鳥建設	9,500	1,055.00	10,022,500	貸付株式数 3,900株
長谷工コーポレーション	128,700	1,336.00	171,943,200	貸付株式数 57,300株
松井建設	13,100	630.00	8,253,000	貸付株式数 4,900株
銭高組	1,500	3,730.00	5,595,000	貸付株式数 100株
鹿島建設	260,900	1,248.00	325,603,200	貸付株式数 31,300株 (1,800株)
不動テトラ	8,700	1,454.00	12,649,800	貸付株式数 3,000株
大末建設	3,800	820.00	3,116,000	貸付株式数 1,600株
鉄建建設	7,200	2,026.00	14,587,200	貸付株式数 2,500株
西松建設	25,600	2,076.00	53,145,600	貸付株式数 11,500株
三井住友建設	80,300	459.00	36,857,700	貸付株式数 29,500株
大豊建設	7,500	2,408.00	18,060,000	貸付株式数 3,300株
前田建設工業	83,200	794.00	66,060,800	貸付株式数 37,200株 (28,600株)

佐田建設	7,100	418.00	2,967,800	貸付株式数 2,200株
ナカノフドー建設	9,100	364.00	3,312,400	貸付株式数 4,000株
奥村組	18,000	2,448.00	44,064,000	貸付株式数 7,500株
東鉄工業	14,300	2,671.00	38,195,300	貸付株式数 6,400株
イチケン	2,400	1,510.00	3,624,000	貸付株式数 800株
富士ピー・エス	4,900	607.00	2,974,300	貸付株式数 2,100株
浅沼組	3,700	4,090.00	15,133,000	貸付株式数 1,200株
戸田建設	138,000	688.00	94,944,000	貸付株式数 61,900株 (7,200株)
熊谷組	15,400	2,584.00	39,793,600	貸付株式数 3,400株
北野建設	2,000	2,663.00	5,326,000	貸付株式数 800株
植木組	1,500	2,499.00	3,748,500	
矢作建設工業	14,700	770.00	11,319,000	貸付株式数 5,500株
ピーエス三菱	10,900	528.00	5,755,200	貸付株式数 200株 (200株)
日本ハウスホールディングス	22,700	270.00	6,129,000	貸付株式数 300株
大東建託	36,300	9,866.00	358,135,800	貸付株式数 16,000株
新日本建設	14,100	831.00	11,717,100	貸付株式数 4,000株
N I P P O	27,500	2,663.00	73,232,500	貸付株式数 12,300株
東亜道路工業	2,100	3,130.00	6,573,000	貸付株式数 900株
前田道路	29,300	1,997.00	58,512,100	貸付株式数 12,400株
日本道路	3,200	7,110.00	22,752,000	貸付株式数 1,400株
東亜建設工業	10,400	1,553.00	16,151,200	貸付株式数 4,600株 (2,000株)
日本国土開発	32,300	570.00	18,411,000	貸付株式数 14,500株
若築建設	6,000	1,240.00	7,440,000	貸付株式数 2,600株
東洋建設	37,300	391.00	14,584,300	貸付株式数 10,700株

五洋建設	131,700	585.00	77,044,500	貸付株式数 59,100株
世紀東急工業	16,000	750.00	12,000,000	貸付株式数 4,900株
福田組	3,800	4,765.00	18,107,000	
日本ドライケミカル	2,600	1,728.00	4,492,800	
住友林業	84,200	1,303.00	109,712,600	貸付株式数 37,000株
日本基礎技術	11,200	422.00	4,726,400	貸付株式数 2,000株
巴コーポレーション	14,800	335.00	4,958,000	貸付株式数 3,200株
大和ハウス工業	328,800	2,454.00	806,875,200	貸付株式数 147,600株
ライト工業	19,000	1,459.00	27,721,000	貸付株式数 8,500株
積水ハウス	360,400	2,053.50	740,081,400	貸付株式数 161,900株
日特建設	8,700	771.00	6,707,700	
北陸電気工事	5,800	953.00	5,527,400	貸付株式数 300株
ユアテック	19,000	630.00	11,970,000	貸付株式数 6,600株
日本リーテック	7,000	2,630.00	18,410,000	貸付株式数 3,100株
四電工	1,800	2,419.00	4,354,200	貸付株式数 100株
中電工	13,400	2,243.00	30,056,200	貸付株式数 5,000株
関電工	47,300	894.00	42,286,200	貸付株式数 20,000株 (500株)
きんでん	78,900	1,749.00	137,996,100	貸付株式数 35,400株
東京エネシス	11,000	754.00	8,294,000	貸付株式数 4,200株
トーエネック	3,300	3,615.00	11,929,500	貸付株式数 1,400株
住友電設	9,400	2,359.00	22,174,600	貸付株式数 3,200株
日本電設工業	18,200	2,357.00	42,897,400	貸付株式数 8,100株 (2,300株)
協和エクシオ	50,400	2,554.00	128,721,600	貸付株式数 22,600株
新日本空調	8,800	2,305.00	20,284,000	貸付株式数 3,900株 (400株)
日本工営	6,800	2,950.00	20,060,000	貸付株式数 2,400株

九電工	23,300	3,140.00	73,162,000	貸付株式数 10,400株
三機工業	23,900	1,218.00	29,110,200	貸付株式数 10,700株
日揮ホールディングス	102,300	1,119.00	114,473,700	貸付株式数 40,000株 (40,000株)
中外炉工業	3,600	1,619.00	5,828,400	貸付株式数 1,600株
ヤマト	10,600	611.00	6,476,600	貸付株式数 4,000株
太平電業	8,000	2,227.00	17,816,000	貸付株式数 3,000株
高砂熱学工業	28,900	1,564.00	45,199,600	貸付株式数 12,900株
三晃金属工業	1,400	2,091.00	2,927,400	貸付株式数 600株
NEC ネットエスアイ	29,500	2,222.00	65,549,000	貸付株式数 10,200株
朝日工業社	2,200	3,215.00	7,073,000	貸付株式数 800株
明星工業	21,500	781.00	16,791,500	貸付株式数 5,200株
大気社	16,200	3,010.00	48,762,000	貸付株式数 7,200株 (3,200株)
ダイダン	7,900	2,695.00	21,290,500	貸付株式数 3,100株
日比谷総合設備	10,700	1,816.00	19,431,200	貸付株式数 4,200株 (1,200株)
日本製粉	31,100	1,617.00	50,288,700	貸付株式数 13,900株
日清製粉グループ本社	120,200	1,556.00	187,031,200	貸付株式数 53,900株
日東富士製粉	800	6,000.00	4,800,000	貸付株式数 100株
昭和産業	9,800	3,165.00	31,017,000	貸付株式数 4,300株
鳥越製粉	9,400	856.00	8,046,400	貸付株式数 4,200株
中部飼料	13,000	1,563.00	20,319,000	貸付株式数 5,700株
フィード・ワン	71,400	193.00	13,780,200	貸付株式数 28,200株
東洋精糖	1,800	1,201.00	2,161,800	貸付株式数 200株
日本甜菜製糖	5,500	1,720.00	9,460,000	貸付株式数 2,100株
三井製糖	9,300	1,970.00	18,321,000	貸付株式数 4,000株

塩水港精糖	11,500	236.00	2,714,000	貸付株式数 4,300株
日新製糖	5,000	1,801.00	9,005,000	貸付株式数 1,800株
L I F U L L	35,300	419.00	14,790,700	貸付株式数 14,000株 (1,500株)
ジェイエシーリクルートメント	6,800	1,124.00	7,643,200	
日本M&Aセンター	76,500	5,010.00	383,265,000	貸付株式数 32,900株 (2,200株)
メンバーズ	3,000	1,431.00	4,293,000	
中広	1,400	543.00	760,200	貸付株式数 400株
UTグループ	15,900	2,591.00	41,196,900	貸付株式数 6,100株
アイティメディア	4,100	1,843.00	7,556,300	貸付株式数 1,700株
タケエイ	9,700	1,000.00	9,700,000	貸付株式数 2,400株 (2,400株)
E・Jホールディングス	1,800	1,878.00	3,380,400	貸付株式数 600株
ビーネックスグループ	12,700	947.00	12,026,900	貸付株式数 5,600株
コシダカホールディングス	24,400	399.00	9,735,600	貸付株式数 10,900株
アルトナー	2,400	886.00	2,126,400	貸付株式数 900株
パソナグループ	11,000	1,178.00	12,958,000	貸付株式数 4,200株
C D S	2,500	1,200.00	3,000,000	貸付株式数 900株
リンクアンドモチベーション	22,300	367.00	8,184,100	貸付株式数 8,900株
G C A	12,300	594.00	7,306,200	貸付株式数 300株
エス・エム・エス	31,500	2,333.00	73,489,500	貸付株式数 14,100株
サニーサイドアップグループ	3,500	698.00	2,443,000	貸付株式数 1,500株
パーソルホールディングス	101,200	1,450.00	146,740,000	貸付株式数 45,400株
リニカル	4,900	803.00	3,934,700	貸付株式数 1,800株
クックパッド	35,300	318.00	11,225,400	
エスクリ	3,200	349.00	1,116,800	貸付株式数 600株
アイ・ケイ・ケイ	4,900	551.00	2,699,900	貸付株式数 2,200株

森永製菓	25,000	4,045.00	101,125,000	貸付株式数 11,200株 (200株)
中村屋	2,800	4,000.00	11,200,000	貸付株式数 900株
江崎グリコ	31,500	5,100.00	160,650,000	貸付株式数 14,100株
名糖産業	5,100	1,366.00	6,966,600	貸付株式数 2,300株
井村屋グループ	6,000	2,187.00	13,122,000	貸付株式数 1,000株
不二家	5,900	2,273.00	13,410,700	
山崎製パン	79,700	1,835.00	146,249,500	貸付株式数 35,700株
第一屋製パン	1,800	987.00	1,776,600	貸付株式数 600株
モロゾフ	1,800	5,500.00	9,900,000	貸付株式数 600株
亀田製菓	6,100	5,160.00	31,476,000	貸付株式数 2,400株 (800株)
寿スピリッツ	10,200	4,325.00	44,115,000	貸付株式数 4,300株
カルビー	48,500	3,040.00	147,440,000	貸付株式数 21,700株
森永乳業	19,700	4,770.00	93,969,000	貸付株式数 8,800株
六甲バター	7,100	1,501.00	10,657,100	貸付株式数 3,000株 (300株)
ヤクルト本社	73,200	6,150.00	450,180,000	貸付株式数 32,800株
明治ホールディングス	70,300	8,450.00	594,035,000	貸付株式数 31,500株
雪印メグミルク	25,600	2,446.00	62,617,600	貸付株式数 11,500株
プリマハム	16,600	2,789.00	46,297,400	貸付株式数 7,400株 (100株)
日本ハム	40,600	4,285.00	173,971,000	貸付株式数 12,600株
林兼産業	3,500	569.00	1,991,500	
丸大食品	11,300	1,879.00	21,232,700	貸付株式数 4,200株
S Foods	8,500	2,597.00	22,074,500	貸付株式数 3,800株 (1,700株)
柿安本店	3,700	2,704.00	10,004,800	貸付株式数 1,600株

伊藤ハム米久ホールディングス	68,500	634.00	43,429,000	貸付株式数 30,800株 (12,500株)
学情	3,600	1,110.00	3,996,000	貸付株式数 1,300株
スタジオアリス	5,100	1,525.00	7,777,500	貸付株式数 1,800株
クロスキャット	2,700	1,196.00	3,229,200	貸付株式数 900株
シミックホールディングス	5,000	1,387.00	6,935,000	貸付株式数 2,100株
エプロ	2,100	1,195.00	2,509,500	貸付株式数 500株
システナ	37,100	1,400.00	51,940,000	貸付株式数 16,600株
N J S	2,200	1,738.00	3,823,600	貸付株式数 700株
デジタルアーツ	5,100	8,570.00	43,707,000	貸付株式数 1,800株
日鉄ソリューションズ	15,600	2,943.00	45,910,800	貸付株式数 7,000株
総合警備保障	40,300	5,010.00	201,903,000	貸付株式数 18,000株
キューブシステム	5,500	969.00	5,329,500	貸付株式数 2,200株
いちご	133,000	254.00	33,782,000	貸付株式数 59,700株
エイジア	1,900	1,404.00	2,667,600	貸付株式数 600株
日本駐車場開発	103,200	138.00	14,241,600	貸付株式数 29,600株
コア	4,400	1,191.00	5,240,400	貸付株式数 1,700株
カカクコム	74,800	2,660.00	198,968,000	貸付株式数 32,900株
アイロムグループ	3,600	2,578.00	9,280,800	貸付株式数 1,500株
セントケア・ホールディング	6,500	419.00	2,723,500	貸付株式数 2,200株
サイネックス	1,700	742.00	1,261,400	
ルネサンス	5,600	942.00	5,275,200	
ディップ	14,300	2,108.00	30,144,400	貸付株式数 5,600株
S B Sホールディングス	9,100	2,200.00	20,020,000	貸付株式数 4,100株
デジタルホールディングス	5,500	1,469.00	8,079,500	貸付株式数 2,000株
新日本科学	11,000	632.00	6,952,000	貸付株式数 4,900株
ツクイ	23,800	512.00	12,185,600	貸付株式数 10,500株

キャリアデザインセンター	2,300	871.00	2,003,300	貸付株式数 800株
ベネフィット・ワン	36,800	2,167.00	79,745,600	貸付株式数 16,500株
エムスリー	223,300	4,860.00	1,085,238,000	貸付株式数 90,600株
ツカダ・グローバルホールディング	6,400	286.00	1,830,400	貸付株式数 2,200株
プラス	1,300	501.00	651,300	貸付株式数 200株
アウトソーシング	58,000	630.00	36,540,000	貸付株式数 26,000株
ウェルネット	10,200	645.00	6,579,000	貸付株式数 4,600株
ワールドホールディングス	3,500	1,565.00	5,477,500	貸付株式数 1,000株
ディー・エヌ・エー	42,800	1,320.00	56,496,000	貸付株式数 19,200株
博報堂DYホールディングス	140,800	1,219.00	171,635,200	貸付株式数 60,300株
ぐるなび	17,600	722.00	12,707,200	貸付株式数 3,700株 (2,800株)
タカミヤ	10,700	541.00	5,788,700	貸付株式数 4,800株
ジャパンベストレスキューシステム	8,000	818.00	6,544,000	貸付株式数 3,500株
ファンコミュニケーションズ	27,800	438.00	12,176,400	貸付株式数 10,100株 (1,500株)
ライク	3,300	1,304.00	4,303,200	貸付株式数 1,300株
ビジネス・ブレークスルー	4,200	375.00	1,575,000	貸付株式数 1,500株
エスプール	26,000	684.00	17,784,000	
WDBホールディングス	4,600	2,659.00	12,231,400	貸付株式数 1,000株
手間いらず	600	4,170.00	2,502,000	
ティア	5,900	506.00	2,985,400	
CDG	1,100	1,600.00	1,760,000	貸付株式数 500株
パリュコマース	5,700	2,948.00	16,803,600	貸付株式数 2,000株
インフォマート	111,000	744.00	82,584,000	貸付株式数 49,800株
サッポロホールディングス	36,300	1,960.00	71,148,000	貸付株式数 16,200株 (4,700株)
アサヒグループホールディングス	222,700	3,682.00	819,981,400	貸付株式数 99,900株

キリンホールディングス	451,100	2,165.50	976,857,050	貸付株式数 202,500株
宝ホールディングス	78,800	952.00	75,017,600	貸付株式数 26,200株 (24,900株)
オエノンホールディングス	28,100	395.00	11,099,500	貸付株式数 6,800株
養命酒製造	3,300	1,810.00	5,973,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	74,700	1,924.00	143,722,800	貸付株式数 33,400株
サントリー食品インターナショナル	71,200	4,210.00	299,752,000	貸付株式数 31,900株
ダイドグループホールディングス	5,500	4,860.00	26,730,000	貸付株式数 2,100株
伊藤園	32,300	6,270.00	202,521,000	貸付株式数 14,400株
キーコーヒー	10,500	2,207.00	23,173,500	貸付株式数 4,600株
ユニカフェ	2,700	1,034.00	2,791,800	貸付株式数 900株
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	13,700	3,330.00	45,621,000	貸付株式数 6,100株 (800株)
不二製油グループ本社	25,900	2,747.00	71,147,300	貸付株式数 11,600株
かどや製油	1,200	3,680.00	4,416,000	
J - オイルミルズ	5,500	4,010.00	22,055,000	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
ローソン	26,400	5,440.00	143,616,000	貸付株式数 11,800株
サンエー	8,700	4,005.00	34,843,500	貸付株式数 3,300株 (2,400株)
カワチ薬品	8,100	2,870.00	23,247,000	貸付株式数 3,100株 (400株)
エービーシー・マート	16,300	6,100.00	99,430,000	貸付株式数 4,800株
ハードオフコーポレーション	4,100	683.00	2,800,300	貸付株式数 1,800株
高千穂交易	4,000	920.00	3,680,000	貸付株式数 1,300株
アスクル	10,900	3,490.00	38,041,000	貸付株式数 4,600株
ゲオホールディングス	18,800	1,373.00	25,812,400	貸付株式数 1,200株
アダストリア	14,500	1,595.00	23,127,500	貸付株式数 6,400株

ジーフット	6,300	506.00	3,187,800	貸付株式数 2,800株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,500	474.00	711,000	
カワニシホールディングス	1,200	1,318.00	1,581,600	貸付株式数 400株
伊藤忠食品	2,600	4,975.00	12,935,000	
くら寿司	5,400	5,270.00	28,458,000	貸付株式数 2,000株
キャンドウ	5,000	2,063.00	10,315,000	貸付株式数 1,700株
エレマテック	9,700	833.00	8,080,100	貸付株式数 3,400株
パルグループホールディングス	10,700	1,232.00	13,182,400	貸付株式数 3,700株
JALUX	2,900	1,723.00	4,996,700	貸付株式数 1,300株
エディオン	47,900	1,058.00	50,678,200	貸付株式数 21,500株 (2,500株)
あらた	8,300	4,645.00	38,553,500	貸付株式数 3,700株
サーラコーポレーション	21,200	586.00	12,423,200	貸付株式数 4,500株
ワッツ	4,600	1,056.00	4,857,600	貸付株式数 1,900株
トーメンデバイス	1,600	3,625.00	5,800,000	貸付株式数 500株
ハローズ	3,900	3,400.00	13,260,000	貸付株式数 1,700株
J Pホールディングス	31,800	266.00	8,458,800	貸付株式数 14,200株
フジオフードグループ本社	8,800	1,332.00	11,721,600	貸付株式数 3,900株
あみやき亭	2,300	2,950.00	6,785,000	
東京エレクトロン デバイス	3,800	3,740.00	14,212,000	貸付株式数 1,400株
ひらまつ	19,200	170.00	3,264,000	貸付株式数 7,500株 (2,100株)
フィールズ	8,000	341.00	2,728,000	貸付株式数 2,700株
双日	576,500	233.00	134,324,500	貸付株式数 172,500株
アルフレッサ ホールディングス	116,000	2,168.00	251,488,000	貸付株式数 52,000株
大黒天物産	2,500	5,300.00	13,250,000	
ハニーズホールディングス	9,200	1,118.00	10,285,600	貸付株式数 4,100株
ファーマライズホールディングス	2,500	684.00	1,710,000	貸付株式数 1,100株

キッコーマン	76,500	5,000.00	382,500,000	貸付株式数 34,300株
味の素	234,900	1,747.50	410,487,750	貸付株式数 105,300株
キューピー	59,200	1,924.00	113,900,800	貸付株式数 26,500株
ハウス食品グループ本社	39,800	3,395.00	135,121,000	貸付株式数 17,800株
カゴメ	40,400	3,235.00	130,694,000	貸付株式数 17,500株
焼津水産化学工業	5,200	900.00	4,680,000	貸付株式数 1,600株
アリアケジャパン	9,700	6,760.00	65,572,000	貸付株式数 3,200株
ピエトロ	1,400	1,628.00	2,279,200	
エバラ食品工業	2,600	2,158.00	5,610,800	
やまみ	900	2,291.00	2,061,900	貸付株式数 300株
ニチレイ	50,700	3,115.00	157,930,500	貸付株式数 16,600株
横浜冷凍	27,300	882.00	24,078,600	貸付株式数 12,200株
東洋水産	54,700	6,190.00	338,593,000	貸付株式数 24,500株
イトアイト	3,700	1,765.00	6,530,500	貸付株式数 1,300株
大冷	1,400	2,016.00	2,822,400	貸付株式数 400株
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,900	1,183.00	6,979,700	貸付株式数 2,600株
日清食品ホールディングス	45,200	9,520.00	430,304,000	貸付株式数 19,000株
永谷園ホールディングス	5,200	2,143.00	11,143,600	貸付株式数 1,700株
一正蒲鉾	4,100	981.00	4,022,100	貸付株式数 500株
フジッコ	11,500	2,035.00	23,402,500	貸付株式数 5,100株
ロック・フィールド	11,500	1,288.00	14,812,000	貸付株式数 4,900株
日本たばこ産業	614,200	1,969.50	1,209,666,900	貸付株式数 275,800株
ケンコーマヨネーズ	6,000	1,867.00	11,202,000	貸付株式数 2,200株 (2,100株)
わらべや日洋ホールディングス	7,000	1,569.00	10,983,000	貸付株式数 2,400株
なとり	5,900	1,740.00	10,266,000	貸付株式数 500株
イフジ産業	1,900	821.00	1,559,900	

ピックルスコーポレーション	2,300	2,932.00	6,743,600	貸付株式数 800株
北の達人コーポレーション	37,100	541.00	20,071,100	貸付株式数 14,700株
ユーグレナ	45,900	761.00	34,929,900	貸付株式数 20,600株
スター・マイカ・ホールディングス	5,400	1,473.00	7,954,200	
A Dワークスグループ	19,400	173.00	3,356,200	貸付株式数 5,800株
片倉工業	15,100	1,106.00	16,700,600	
グンゼ	7,600	4,045.00	30,742,000	貸付株式数 3,400株 (800株)
ヒューリック	223,200	980.00	218,736,000	貸付株式数 100,200株
神栄	1,400	513.00	718,200	
ラサ商事	5,500	928.00	5,104,000	
アルペン	8,000	1,698.00	13,584,000	貸付株式数 3,600株 (300株)
ハブ	3,000	597.00	1,791,000	貸付株式数 1,300株
ラクーンホールディングス	4,700	975.00	4,582,500	貸付株式数 1,700株 (500株)
クオールホールディングス	15,400	1,097.00	16,893,800	貸付株式数 6,100株 (800株)
アルコニックス	11,100	1,226.00	13,608,600	貸付株式数 4,600株
神戸物産	36,000	6,560.00	236,160,000	貸付株式数 15,100株
ソリトンシステムズ	4,500	1,490.00	6,705,000	貸付株式数 1,900株
ジンズホールディングス	5,500	7,540.00	41,470,000	貸付株式数 2,300株
ビックカメラ	61,900	1,151.00	71,246,900	貸付株式数 27,800株
D C Mホールディングス	57,800	1,312.00	75,833,600	貸付株式数 22,400株 (600株)
ペッパーフードサービス	9,100	572.00	5,205,200	貸付株式数 3,200株
ハイパー	1,600	590.00	944,000	貸付株式数 600株
Monotaro	74,200	4,620.00	342,804,000	貸付株式数 33,300株
東京一番フーズ	2,600	514.00	1,336,400	貸付株式数 1,100株
D Dホールディングス	4,100	797.00	3,267,700	貸付株式数 1,800株

あいホールディングス	14,900	1,520.00	22,648,000	貸付株式数 6,600株
ディーブイエックス	3,700	888.00	3,285,600	貸付株式数 1,600株
きちりホールディングス	2,800	587.00	1,643,600	貸付株式数 800株
アークランドサービスホールディングス	7,600	1,883.00	14,310,800	貸付株式数 2,900株
J.フロントリテイリング	124,600	685.00	85,351,000	貸付株式数 55,900株
ドトール・日レスホールディングス	15,000	1,717.00	25,755,000	貸付株式数 6,700株
マツモトキヨシホールディングス	43,100	3,935.00	169,598,500	貸付株式数 19,300株
ブロンコピリー	5,500	2,308.00	12,694,000	貸付株式数 400株
ZOZO	71,800	2,459.00	176,556,200	貸付株式数 29,000株
トレジャー・ファクトリー	3,100	803.00	2,489,300	貸付株式数 1,300株
物語コーポレーション	2,800	8,050.00	22,540,000	貸付株式数 1,100株
ココカラファイン	10,900	5,980.00	65,182,000	貸付株式数 3,200株
三越伊勢丹ホールディングス	182,500	613.00	111,872,500	貸付株式数 81,900株
東洋紡	41,000	1,471.00	60,311,000	貸付株式数 18,400株
ユニチカ	30,400	346.00	10,518,400	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
富士紡ホールディングス	5,000	3,200.00	16,000,000	貸付株式数 1,900株
日清紡ホールディングス	70,600	770.00	54,362,000	貸付株式数 31,700株
倉敷紡績	10,300	2,113.00	21,763,900	貸付株式数 4,400株
ダイワボウホールディングス	8,900	7,200.00	64,080,000	貸付株式数 600株
シキボウ	5,400	990.00	5,346,000	貸付株式数 2,400株
日東紡績	15,800	5,110.00	80,738,000	貸付株式数 7,000株
トヨタ紡織	30,900	1,408.00	43,507,200	貸付株式数 11,600株 (1,800株)
マクニカ・富士エレホールディングス	24,900	1,493.00	37,175,700	貸付株式数 9,900株
Hamee	3,700	1,840.00	6,808,000	貸付株式数 1,600株

ラクト・ジャパン	3,900	3,425.00	13,357,500	貸付株式数 1,700株
ウエルシアホールディングス	31,000	8,910.00	276,210,000	貸付株式数 13,900株
クリエイトSDホールディングス	17,600	3,345.00	58,872,000	貸付株式数 7,900株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	19,600	1,027.00	20,129,200	貸付株式数 8,800株
八洲電機	8,100	923.00	7,476,300	貸付株式数 3,600株
メディアスホールディングス	5,900	873.00	5,150,700	貸付株式数 300株
レスターホールディングス	10,900	2,035.00	22,181,500	貸付株式数 2,300株
ジューテックホールディングス	2,400	1,034.00	2,481,600	貸付株式数 600株
丸善CHIホールディングス	12,200	403.00	4,916,600	
大光	4,400	662.00	2,912,800	貸付株式数 1,900株
OCHIホールディングス	3,000	1,492.00	4,476,000	貸付株式数 1,200株
TOKAIホールディングス	55,100	994.00	54,769,400	貸付株式数 24,700株 (12,600株)
黒谷	2,800	539.00	1,509,200	貸付株式数 400株
ミサワ	2,100	658.00	1,381,800	貸付株式数 800株
ティーライフ	1,500	1,092.00	1,638,000	貸付株式数 500株
Cominix	1,800	738.00	1,328,400	貸付株式数 600株
エー・ピーカンパニー	2,000	433.00	866,000	
三洋貿易	10,500	975.00	10,237,500	貸付株式数 4,700株
チムニー	3,200	1,266.00	4,051,200	
シュッピン	7,100	711.00	5,048,100	貸付株式数 2,600株
ビューティガレージ	1,700	2,133.00	3,626,100	
オイシックス・ラ・大地	10,300	2,065.00	21,269,500	貸付株式数 4,600株
ウイン・パートナーズ	7,500	923.00	6,922,500	貸付株式数 3,300株
ネクステージ	15,000	915.00	13,725,000	貸付株式数 5,800株
ジョイフル本田	30,600	1,450.00	44,370,000	貸付株式数 13,700株
鳥貴族	3,100	1,513.00	4,690,300	貸付株式数 1,100株
キリン堂ホールディングス	4,100	2,529.00	10,368,900	

ホットランド	7,000	1,106.00	7,742,000	貸付株式数 2,500株
すかいらくホールディングス	117,000	1,622.00	189,774,000	貸付株式数 46,500株 (300株)
SFPホールディングス	5,900	1,482.00	8,743,800	貸付株式数 2,500株
綿半ホールディングス	3,900	1,890.00	7,371,000	貸付株式数 1,300株
日本毛織	34,100	1,006.00	34,304,600	貸付株式数 15,300株
ダイトウボウ	16,800	113.00	1,898,400	貸付株式数 7,200株
トーア紡コーポレーション	4,100	474.00	1,943,400	貸付株式数 1,300株
ダイドーリミテッド	13,600	209.00	2,842,400	貸付株式数 6,100株
ヨシックス	1,700	1,866.00	3,172,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	30,300	1,277.00	38,693,100	貸付株式数 13,500株
三栄建築設計	4,200	1,413.00	5,934,600	貸付株式数 1,700株
野村不動産ホールディングス	63,500	1,923.00	122,110,500	貸付株式数 28,400株
三重交通グループホールディングス	21,200	467.00	9,900,400	貸付株式数 9,500株
サムティ	14,800	1,276.00	18,884,800	貸付株式数 6,600株
ディア・ライフ	14,800	491.00	7,266,800	貸付株式数 6,600株 (400株)
コーセーアールイー	3,100	530.00	1,643,000	貸付株式数 1,100株
日本商業開発	6,600	1,509.00	9,959,400	貸付株式数 2,900株
プレサンスコーポレーション	17,200	1,195.00	20,554,000	貸付株式数 7,700株
フィル・カンパニー	1,900	2,358.00	4,480,200	貸付株式数 600株 (600株)
THEグローバル社	4,900	222.00	1,087,800	貸付株式数 2,100株
ハウスコム	1,800	1,279.00	2,302,200	貸付株式数 600株
日本管理センター	6,900	1,060.00	7,314,000	
サンセイランディック	3,100	792.00	2,455,200	貸付株式数 1,300株
エストラスト	1,400	658.00	921,200	
フージャースホールディングス	20,800	528.00	10,982,400	貸付株式数 7,000株 (1,900株)

オープンハウス	30,400	3,735.00	113,544,000	貸付株式数 13,600株
東急不動産ホールディングス	284,200	464.00	131,868,800	貸付株式数 127,600株 (7,400株)
飯田グループホールディングス	87,200	1,724.00	150,332,800	貸付株式数 35,500株
イーグランド	1,700	696.00	1,183,200	貸付株式数 500株
ムゲンエステート	7,200	498.00	3,585,600	貸付株式数 3,200株
帝国繊維	11,700	2,218.00	25,950,600	貸付株式数 5,200株
日本コークス工業	89,500	65.00	5,817,500	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,800	517.00	2,481,600	貸付株式数 1,000株
ミタチ産業	3,100	570.00	1,767,000	
B E E N O S	4,800	1,143.00	5,486,400	貸付株式数 2,000株
あさひ	7,800	1,563.00	12,191,400	貸付株式数 1,100株
日本調剤	6,300	1,691.00	10,653,300	貸付株式数 1,500株
コスモス薬品	9,200	17,150.00	157,780,000	貸付株式数 4,100株
シップヘルスケアホールディングス	16,700	4,560.00	76,152,000	貸付株式数 7,500株
トーエル	5,000	701.00	3,505,000	貸付株式数 2,200株
ソフトクリエイトホールディングス	4,500	2,233.00	10,048,500	貸付株式数 1,900株
オンリー	1,800	580.00	1,044,000	貸付株式数 700株
セブン&アイ・ホールディングス	408,300	3,425.00	1,398,427,500	貸付株式数 148,400株
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	56,100	649.00	36,408,900	貸付株式数 22,300株
明治電機工業	3,300	1,374.00	4,534,200	貸付株式数 1,400株
ツルハホールディングス	22,700	14,900.00	338,230,000	貸付株式数 10,200株
デリカフーズホールディングス	3,700	617.00	2,282,900	貸付株式数 1,300株
スターティアホールディングス	2,400	614.00	1,473,600	貸付株式数 800株
サンマルクホールディングス	8,200	1,590.00	13,038,000	貸付株式数 3,200株 (300株)
フェリシモ	2,300	1,096.00	2,520,800	
トリドールホールディングス	25,800	1,203.00	31,037,400	貸付株式数 10,200株

帝人	84,700	1,663.00	140,856,100	貸付株式数 35,600株 (19,000株)
東レ	751,500	497.70	374,021,550	貸付株式数 199,900株
クラレ	163,500	1,087.00	177,724,500	貸付株式数 73,300株
旭化成	687,900	835.90	575,015,610	貸付株式数 308,800株
サカイオーベックス	2,800	2,229.00	6,241,200	貸付株式数 1,000株
TOKYO BASE	9,400	376.00	3,534,400	
稲葉製作所	5,900	1,410.00	8,319,000	貸付株式数 2,500株 (1,100株)
宮地エンジニアリンググループ	3,200	1,623.00	5,193,600	貸付株式数 1,000株
トーカロ	29,100	1,152.00	33,523,200	貸付株式数 13,000株
アルファ	3,700	916.00	3,389,200	貸付株式数 1,000株
SUMCO	124,500	1,655.00	206,047,500	貸付株式数 55,300株
川田テクノロジーズ	2,100	4,815.00	10,111,500	
RS Technologies	3,000	3,830.00	11,490,000	貸付株式数 1,000株
信和	6,000	718.00	4,308,000	貸付株式数 1,700株
ビーロッド	4,900	623.00	3,052,700	
ファーストブラザーズ	2,400	775.00	1,860,000	貸付株式数 900株
ハウズドゥ	5,100	883.00	4,503,300	貸付株式数 2,000株
シーアールイー	2,600	1,580.00	4,108,000	貸付株式数 1,100株
プロパティエージェント	1,700	1,027.00	1,745,900	貸付株式数 500株
ケイアイスター不動産	3,300	1,789.00	5,903,700	貸付株式数 1,200株
アグレ都市デザイン	1,700	506.00	860,200	
グッドコムアセット	2,500	1,569.00	3,922,500	貸付株式数 900株
ジェイ・エス・ビー	2,200	2,745.00	6,039,000	
テンポイノベーション	2,300	667.00	1,534,100	貸付株式数 800株
グローバル・リンク・マネジメント	1,700	628.00	1,067,600	貸付株式数 600株
住江織物	2,300	2,019.00	4,643,700	貸付株式数 300株
日本フェルト	5,900	449.00	2,649,100	

イチカワ	1,500	1,190.00	1,785,000	
エコナックホールディングス	18,300	93.00	1,701,900	貸付株式数 2,800株
日東製網	1,200	1,368.00	1,641,600	
芦森工業	2,200	1,001.00	2,202,200	貸付株式数 700株
アツギ	8,500	604.00	5,134,000	貸付株式数 2,300株
ウイルプラスホールディングス	1,300	621.00	807,300	貸付株式数 400株
J Mホールディングス	7,900	3,385.00	26,741,500	貸付株式数 3,100株 (300株)
コメダホールディングス	22,700	1,831.00	41,563,700	貸付株式数 10,200株
サツドラホールディングス	1,600	1,980.00	3,168,000	貸付株式数 600株
アレンザホールディングス	5,200	1,106.00	5,751,200	貸付株式数 2,200株
串カツ田中ホールディングス	2,100	1,630.00	3,423,000	貸付株式数 600株
パロックジャパンリミテッド	7,200	647.00	4,658,400	貸付株式数 500株 (500株)
クスリのアオキホールディングス	9,300	9,740.00	90,582,000	貸付株式数 4,100株
ダイニック	3,900	757.00	2,952,300	
共和レザー	5,600	661.00	3,701,600	貸付株式数 1,700株
ピーバンドットコム	1,000	985.00	985,000	
力の源ホールディングス	4,700	679.00	3,191,300	貸付株式数 2,000株
スシローグローバルホールディングス	57,300	2,514.00	144,052,200	貸付株式数 25,700株
L I X I L ビバ	9,700	2,596.00	25,181,200	貸付株式数 3,600株
アセンテック	1,100	3,765.00	4,141,500	貸付株式数 400株
セーレン	25,500	1,313.00	33,481,500	貸付株式数 11,400株
ソトー	4,100	951.00	3,899,100	貸付株式数 1,400株
東海染工	1,400	1,133.00	1,586,200	
小松マテーレ	17,000	730.00	12,410,000	貸付株式数 7,600株
ワコールホールディングス	25,900	1,940.00	50,246,000	貸付株式数 11,600株 (9,200株)
ホギメディカル	11,800	3,125.00	36,875,000	貸付株式数 5,300株

クラウドシアホールディングス	2,600	367.00	954,200	貸付株式数 900株 (900株)
T S Iホールディングス	34,800	356.00	12,388,800	貸付株式数 14,100株
マツオカコーポレーション	3,000	1,786.00	5,358,000	貸付株式数 1,000株
ワールド	14,700	1,554.00	22,843,800	貸付株式数 5,700株
T I S	104,000	2,258.00	234,832,000	貸付株式数 46,600株
ネオス	4,200	715.00	3,003,000	貸付株式数 1,300株
電算システム	4,000	4,480.00	17,920,000	貸付株式数 1,700株
グリー	63,800	464.00	29,603,200	
コーエーテックモホールディングス	21,300	3,545.00	75,508,500	貸付株式数 9,500株
三菱総合研究所	4,500	4,305.00	19,372,500	貸付株式数 1,500株
ボルテージ	2,400	479.00	1,149,600	貸付株式数 900株
電算	1,200	2,150.00	2,580,000	貸付株式数 300株
A G S	5,900	801.00	4,725,900	貸付株式数 800株
ファインデックス	8,800	936.00	8,236,800	貸付株式数 1,100株
ブレインパッド	2,700	4,555.00	12,298,500	貸付株式数 1,200株
K L a b	20,100	740.00	14,874,000	貸付株式数 8,500株
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	12,500	864.00	10,800,000	貸付株式数 400株
イーブックイニシアティブジャパン	1,500	3,165.00	4,747,500	貸付株式数 600株
ネクソン	290,400	2,605.00	756,492,000	貸付株式数 130,400株
アイスタイル	29,100	289.00	8,409,900	貸付株式数 13,000株
エムアップホールディングス	3,000	2,526.00	7,578,000	貸付株式数 1,300株
エイチーム	7,200	851.00	6,127,200	貸付株式数 3,000株
エニグモ	9,800	1,257.00	12,318,600	貸付株式数 1,600株
テクノスジャパン	8,100	784.00	6,350,400	
e n i s h	5,700	848.00	4,833,600	貸付株式数 2,500株
コロプラ	34,100	1,046.00	35,668,600	貸付株式数 13,300株

オルトプラス	6,300	460.00	2,898,000	貸付株式数 2,900株
ブロードリーフ	51,500	559.00	28,788,500	貸付株式数 23,100株
クロス・マーケティンググループ	4,600	352.00	1,619,200	貸付株式数 2,000株
デジタルハーツホールディングス	5,500	918.00	5,049,000	貸付株式数 2,300株
システム情報	7,800	1,473.00	11,489,400	貸付株式数 3,100株
メディアドゥ	3,300	4,410.00	14,553,000	
じげん	25,700	324.00	8,326,800	貸付株式数 11,500株
ブイキューブ	6,400	1,252.00	8,012,800	貸付株式数 2,700株
エンカレッジ・テクノロジー	2,300	851.00	1,957,300	貸付株式数 500株
サイバーリンクス	1,600	2,168.00	3,468,800	
ディー・エル・イー	8,400	542.00	4,552,800	貸付株式数 3,600株
フィックスターズ	11,100	1,253.00	13,908,300	貸付株式数 200株 (200株)
CARTA HOLDINGS	5,000	1,269.00	6,345,000	貸付株式数 2,100株
オブティム	5,400	3,510.00	18,954,000	貸付株式数 1,900株
セレス	3,400	1,111.00	3,777,400	貸付株式数 1,500株
SHIFT	4,200	11,140.00	46,788,000	貸付株式数 1,800株
特種東海製紙	6,600	4,565.00	30,129,000	貸付株式数 2,300株
ティーガイア	9,200	1,994.00	18,344,800	貸付株式数 2,100株
セック	1,500	3,075.00	4,612,500	貸付株式数 500株
日本アジアグループ	11,000	296.00	3,256,000	貸付株式数 4,600株
テクマトリックス	14,600	1,891.00	27,608,600	貸付株式数 4,800株
プロシップ	3,000	1,406.00	4,218,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	25,100	2,119.00	53,186,900	貸付株式数 10,900株
GMOペイメントゲートウェイ	22,000	11,770.00	258,940,000	貸付株式数 9,900株
ザッパラス	4,500	388.00	1,746,000	貸付株式数 1,900株
システムリサーチ	2,800	1,988.00	5,566,400	

インターネットイニシアティブ	15,400	3,685.00	56,749,000	貸付株式数 6,700株
さくらインターネット	11,100	637.00	7,070,700	貸付株式数 5,000株
ヴィンクス	2,900	1,375.00	3,987,500	貸付株式数 1,300株
GMOクラウド	1,900	9,120.00	17,328,000	貸付株式数 700株
S R Aホールディングス	5,500	2,334.00	12,837,000	貸付株式数 2,100株
システムインテグレータ	3,300	1,054.00	3,478,200	貸付株式数 700株
朝日ネット	7,400	1,165.00	8,621,000	貸付株式数 3,100株
e B A S E	12,400	1,317.00	16,330,800	貸付株式数 5,500株
アバント	9,900	975.00	9,652,500	貸付株式数 600株
アドソル日進	3,700	2,370.00	8,769,000	
フリービット	5,400	715.00	3,861,000	貸付株式数 2,400株
コムチュア	11,700	2,705.00	31,648,500	貸付株式数 4,800株
サイバーコム	1,800	1,820.00	3,276,000	貸付株式数 600株
アステリア	6,300	513.00	3,231,900	貸付株式数 600株
アイル	5,800	1,565.00	9,077,000	貸付株式数 2,500株 (900株)
王子ホールディングス	433,900	480.00	208,272,000	貸付株式数 194,400株 (127,000株)
日本製紙	45,900	1,442.00	66,187,800	貸付株式数 20,500株
三菱製紙	11,800	337.00	3,976,600	
北越コーポレーション	61,900	370.00	22,903,000	貸付株式数 27,700株
中越パルプ工業	4,400	1,483.00	6,525,200	貸付株式数 1,500株
巴川製紙所	3,100	995.00	3,084,500	貸付株式数 1,100株
大王製紙	45,800	1,434.00	65,677,200	貸付株式数 20,500株
阿波製紙	2,700	490.00	1,323,000	貸付株式数 900株
マークラインズ	5,200	2,285.00	11,882,000	貸付株式数 2,300株 (500株)
メディカル・データ・ビジョン	7,900	1,252.00	9,890,800	貸付株式数 3,000株

gumi	13,300	1,007.00	13,393,100	貸付株式数 5,100株
ショーケース	2,500	711.00	1,777,500	貸付株式数 800株
モバイルファクトリー	2,300	1,026.00	2,359,800	貸付株式数 900株
テラスカイ	3,700	2,830.00	10,471,000	貸付株式数 1,600株
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,100	1,370.00	5,617,000	貸付株式数 1,400株
PCIホールディングス	3,900	1,147.00	4,473,300	
パイプドHD	1,300	1,548.00	2,012,400	貸付株式数 400株
アイビーシー	1,700	993.00	1,688,100	貸付株式数 500株
ネオジャパン	2,000	2,297.00	4,594,000	貸付株式数 700株
PR TIMES	900	2,876.00	2,588,400	
ランドコンピュータ	1,600	1,010.00	1,616,000	
ダブルスタンダード	1,300	5,620.00	7,306,000	貸付株式数 400株
オーブンドア	5,100	1,244.00	6,344,400	貸付株式数 1,800株
マイネット	3,300	1,162.00	3,834,600	
アカツキ	3,700	4,020.00	14,874,000	貸付株式数 1,300株
ベネフィットジャパン	800	1,567.00	1,253,600	
Ubicomホールディングス	2,300	2,123.00	4,882,900	貸付株式数 700株
LINE	23,800	5,480.00	130,424,000	貸付株式数 10,700株
カナミックネットワーク	9,500	926.00	8,797,000	貸付株式数 4,200株
ノムラシステムコーポレーション	4,500	339.00	1,525,500	
レンゴー	98,100	841.00	82,502,100	貸付株式数 44,000株
トーモク	6,400	1,716.00	10,982,400	貸付株式数 2,800株
ザ・パック	7,900	2,942.00	23,241,800	貸付株式数 2,700株
チェンジ	3,600	7,960.00	28,656,000	
シンクロ・フード	4,400	321.00	1,412,400	貸付株式数 1,100株
オークネット	6,400	1,019.00	6,521,600	貸付株式数 2,800株
セグエグループ	2,300	885.00	2,035,500	貸付株式数 800株
エイトレッド	1,700	1,911.00	3,248,700	貸付株式数 700株

AOI TYO HOLDINGS	10,500	407.00	4,273,500	貸付株式数 4,500株
マクロミル	21,200	726.00	15,391,200	貸付株式数 900株
ビーグリー	2,000	1,932.00	3,864,000	貸付株式数 700株 (700株)
オロ	2,700	2,759.00	7,449,300	貸付株式数 1,100株
ユーザーローカル	1,000	3,585.00	3,585,000	
テモナ	2,200	971.00	2,136,200	貸付株式数 800株
ニーズウェル	2,000	741.00	1,482,000	
サインポスト	2,200	1,656.00	3,643,200	貸付株式数 900株
昭和電工	73,900	2,346.00	173,369,400	貸付株式数 32,700株
住友化学	762,500	327.00	249,337,500	貸付株式数 263,000株
住友精化	4,600	3,515.00	16,169,000	貸付株式数 1,600株
日産化学	57,600	5,460.00	314,496,000	貸付株式数 25,900株
ラサ工業	3,700	1,490.00	5,513,000	
クレハ	8,900	4,590.00	40,851,000	貸付株式数 4,000株
多木化学	4,000	6,850.00	27,400,000	貸付株式数 1,700株
テイカ	7,600	1,381.00	10,495,600	貸付株式数 2,900株
石原産業	18,600	695.00	12,927,000	貸付株式数 6,300株
片倉コープアグリ	2,700	1,234.00	3,331,800	貸付株式数 200株
日本曹達	15,400	2,778.00	42,781,200	貸付株式数 6,800株
東ソー	160,400	1,443.00	231,457,200	貸付株式数 69,100株 (23,100株)
トクヤマ	29,900	2,425.00	72,507,500	貸付株式数 11,600株
セントラル硝子	21,200	1,846.00	39,135,200	貸付株式数 8,500株
東亜合成	65,100	1,060.00	69,006,000	貸付株式数 29,200株
大阪ソーダ	10,600	2,340.00	24,804,000	貸付株式数 2,800株
関東電化工業	24,600	837.00	20,590,200	貸付株式数 8,500株

デンカ	37,900	2,568.00	97,327,200	貸付株式数 16,700株 (4,000株)
イビデン	64,900	3,155.00	204,759,500	貸付株式数 29,000株 (14,200株)
信越化学工業	178,200	12,375.00	2,205,225,000	貸付株式数 35,700株
日本カーバイド工業	3,500	1,204.00	4,214,000	貸付株式数 1,000株
堺化学工業	6,700	2,008.00	13,453,600	貸付株式数 2,200株
第一稀元素化学工業	11,200	772.00	8,646,400	貸付株式数 300株
エア・ウォーター	96,500	1,502.00	144,943,000	貸付株式数 24,900株
大陽日酸	99,700	1,773.00	176,768,100	貸付株式数 41,400株
日本化学工業	3,200	2,168.00	6,937,600	貸付株式数 100株
東邦アセチレン	1,600	1,290.00	2,064,000	貸付株式数 500株
日本パーカライジング	52,400	1,103.00	57,797,200	貸付株式数 23,400株
高压ガス工業	16,500	764.00	12,606,000	貸付株式数 6,200株
チタン工業	1,300	1,757.00	2,284,100	貸付株式数 400株
四国化成工業	16,000	1,045.00	16,720,000	
戸田工業	2,400	1,754.00	4,209,600	貸付株式数 800株
ステラ ケミファ	5,700	2,370.00	13,509,000	貸付株式数 500株 (500株)
保土谷化学工業	3,900	4,865.00	18,973,500	
日本触媒	16,100	5,580.00	89,838,000	貸付株式数 7,200株
大日精化工業	9,200	2,267.00	20,856,400	貸付株式数 3,500株
カネカ	26,800	2,661.00	71,314,800	貸付株式数 12,000株
協和キリン	106,600	2,717.00	289,632,200	貸付株式数 47,800株
三菱瓦斯化学	96,600	1,604.00	154,946,400	貸付株式数 42,900株
三井化学	94,200	2,243.00	211,290,600	貸付株式数 42,200株 (1,800株)
J S R	96,700	2,116.00	204,617,200	貸付株式数 43,400株

東京応化工業	17,800	5,660.00	100,748,000	貸付株式数 8,000株
大阪有機化学工業	9,600	2,674.00	25,670,400	貸付株式数 4,100株
三菱ケミカルホールディングス	693,800	620.90	430,780,420	貸付株式数 311,600株
KHネオケム	18,300	2,048.00	37,478,400	貸付株式数 7,900株
ダイセル	135,100	790.00	106,729,000	貸付株式数 29,800株
住友ベークライト	16,300	2,864.00	46,683,200	貸付株式数 7,300株
積水化学工業	219,500	1,501.00	329,469,500	貸付株式数 100,200株
日本ゼオン	93,600	949.00	88,826,400	貸付株式数 41,900株 (1,100株)
アイカ工業	31,100	3,505.00	109,005,500	貸付株式数 11,700株
宇部興産	52,400	1,802.00	94,424,800	貸付株式数 8,000株
積水樹脂	18,700	2,055.00	38,428,500	貸付株式数 7,900株 (3,900株)
タキロンシーアイ	22,500	678.00	15,255,000	貸付株式数 9,900株
旭有機材	5,900	1,403.00	8,277,700	貸付株式数 2,300株
ニチバン	5,500	1,475.00	8,112,500	貸付株式数 2,200株 (400株)
リケンテクノス	26,100	406.00	10,596,600	貸付株式数 11,600株
大倉工業	4,900	1,563.00	7,658,700	貸付株式数 1,700株
積水化成成品工業	13,900	548.00	7,617,200	貸付株式数 4,800株
群栄化学工業	2,400	2,622.00	6,292,800	
タイガースポリマー	5,500	480.00	2,640,000	貸付株式数 1,800株
ミライアル	3,700	1,047.00	3,873,900	
ダイキアクシス	3,700	739.00	2,734,300	貸付株式数 1,300株
ダイキョーニシカワ	21,900	457.00	10,008,300	貸付株式数 8,300株
竹本容器	3,700	685.00	2,534,500	貸付株式数 1,600株
森六ホールディングス	5,600	1,641.00	9,189,600	貸付株式数 1,900株

日本化薬	64,200	1,084.00	69,592,800	貸付株式数 21,700株 (12,200株)
カーリットホールディングス	11,100	502.00	5,572,200	
E P Sホールディングス	13,700	1,013.00	13,878,100	貸付株式数 5,200株
ソルクシーズ	4,400	729.00	3,207,600	貸付株式数 300株
レッグス	2,500	873.00	2,182,500	貸付株式数 1,000株
プレステージ・インターナショナル	37,900	851.00	32,252,900	貸付株式数 17,000株 (7,700株)
フェイス	3,600	637.00	2,293,200	貸付株式数 1,600株
プロトコーポレーション	9,300	953.00	8,862,900	貸付株式数 3,600株
ハイマックス	1,200	1,997.00	2,396,400	
アミューズ	5,500	2,252.00	12,386,000	貸付株式数 2,400株 (300株)
野村総合研究所	147,400	2,921.00	430,555,400	貸付株式数 57,400株 (6,000株)
ドリームインキュベータ	3,100	1,317.00	4,082,700	
サイバネットシステム	7,400	670.00	4,958,000	貸付株式数 3,300株 (2,900株)
クイック	6,300	1,140.00	7,182,000	貸付株式数 1,400株
T A C	6,100	197.00	1,201,700	貸付株式数 2,700株
C Eホールディングス	5,500	545.00	2,997,500	貸付株式数 1,000株
ケネディクス	94,300	512.00	48,281,600	貸付株式数 42,300株
日本システム技術	1,700	1,700.00	2,890,000	貸付株式数 500株
電通グループ	104,400	2,548.00	266,011,200	貸付株式数 46,400株
インテージホールディングス	13,000	878.00	11,414,000	貸付株式数 2,000株
テイクアンドグヴ・ニーズ	3,900	573.00	2,234,700	貸付株式数 1,500株
東邦システムサイエンス	2,700	920.00	2,484,000	貸付株式数 400株 (400株)
ぴあ	2,900	3,090.00	8,961,000	貸付株式数 1,300株
イオンファンタジー	3,900	1,495.00	5,830,500	貸付株式数 1,700株

ソースネクスト	49,300	284.00	14,001,200	貸付株式数 22,100株 (1,300株)
シーティーエス	11,400	906.00	10,328,400	貸付株式数 4,500株
ネクシィーズグループ	3,100	955.00	2,960,500	貸付株式数 1,300株
インフォコム	11,400	3,065.00	34,941,000	貸付株式数 5,000株
メディカルシステムネットワーク	10,100	501.00	5,060,100	貸付株式数 1,500株
日本精化	8,300	1,400.00	11,620,000	貸付株式数 1,800株
扶桑化学工業	10,500	3,885.00	40,792,500	貸付株式数 4,700株
トリケミカル研究所	2,300	11,560.00	26,588,000	貸付株式数 1,000株
HEROZ	1,500	3,585.00	5,377,500	貸付株式数 500株
ラクスル	8,300	3,015.00	25,024,500	貸付株式数 3,600株
F I G	11,200	272.00	3,046,400	貸付株式数 5,000株
システムサポート	2,300	2,046.00	4,705,800	貸付株式数 400株
A D E K A	47,800	1,415.00	67,637,000	貸付株式数 21,300株 (2,000株)
日油	39,100	3,890.00	152,099,000	貸付株式数 17,500株
ミヨシ油脂	4,100	1,072.00	4,395,200	貸付株式数 1,000株
新日本理化	17,200	160.00	2,752,000	貸付株式数 6,800株
ハリマ化成グループ	8,600	930.00	7,998,000	貸付株式数 2,400株
イーソル	4,900	1,159.00	5,679,100	貸付株式数 1,700株
アルテリア・ネットワークス	11,500	2,031.00	23,356,500	貸付株式数 4,300株
東海ソフト	700	1,484.00	1,038,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	1,800	1,027.00	1,848,600	貸付株式数 700株
トピラスシステムズ	1,200	1,864.00	2,236,800	貸付株式数 400株
花王	253,700	8,529.00	2,163,807,300	貸付株式数 113,900株
第一工業製薬	3,900	4,990.00	19,461,000	貸付株式数 1,200株 (400株)
石原ケミカル	2,800	1,971.00	5,518,800	

日華化学	3,500	867.00	3,034,500	
ニイタカ	2,200	5,260.00	11,572,000	貸付株式数 900株
三洋化成工業	6,200	4,680.00	29,016,000	
武田薬品工業	881,700	3,766.00	3,320,482,200	貸付株式数 282,400株
アステラス製薬	918,800	1,732.50	1,591,821,000	貸付株式数 412,500株
大日本住友製薬	78,500	1,384.00	108,644,000	貸付株式数 33,500株 (6,900株)
塩野義製薬	133,300	6,286.00	837,923,800	貸付株式数 59,800株
わかもと製薬	12,600	284.00	3,578,400	貸付株式数 5,600株
あすか製薬	12,100	1,172.00	14,181,200	貸付株式数 4,600株
日本新薬	27,700	7,970.00	220,769,000	貸付株式数 12,400株
バイオフェルミン製薬	1,800	2,235.00	4,023,000	貸付株式数 800株
中外製薬	331,500	5,533.00	1,834,189,500	貸付株式数 148,800株
科研製薬	18,100	5,200.00	94,120,000	貸付株式数 4,500株 (1,500株)
エーザイ	126,800	8,535.00	1,082,238,000	貸付株式数 56,800株
理研ビタミン	10,000	2,220.00	22,200,000	貸付株式数 4,400株
ロート製薬	54,400	3,425.00	186,320,000	貸付株式数 24,400株
小野薬品工業	243,400	3,014.00	733,607,600	貸付株式数 74,400株
久光製薬	28,000	5,480.00	153,440,000	貸付株式数 12,600株
有機合成薬品工業	8,000	350.00	2,800,000	貸付株式数 3,300株
持田製薬	14,700	3,905.00	57,403,500	貸付株式数 6,600株
参天製薬	197,500	1,925.00	380,187,500	貸付株式数 87,600株
扶桑薬品工業	3,700	2,310.00	8,547,000	貸付株式数 1,300株
日本ケミファ	1,400	2,479.00	3,470,600	
ツムラ	32,800	2,747.00	90,101,600	貸付株式数 14,600株
日医工	30,000	1,261.00	37,830,000	貸付株式数 10,700株
テルモ	299,900	4,022.00	1,206,197,800	貸付株式数 131,400株

H.U.グループホールディングス	28,300	2,584.00	73,127,200	貸付株式数 12,700株
キッセイ薬品工業	18,800	2,380.00	44,744,000	貸付株式数 8,300株
生化学工業	20,600	1,079.00	22,227,400	貸付株式数 9,200株 (300株)
栄研化学	18,600	1,618.00	30,094,800	貸付株式数 8,300株
日水製薬	4,500	1,103.00	4,963,500	貸付株式数 1,600株
鳥居薬品	6,600	3,075.00	20,295,000	
JCRファーマ	7,500	10,650.00	79,875,000	貸付株式数 1,900株
東和薬品	13,600	1,916.00	26,057,600	貸付株式数 5,900株
富士製薬工業	7,200	1,151.00	8,287,200	貸付株式数 2,400株
沢井製薬	21,800	5,200.00	113,360,000	貸付株式数 9,600株
ゼリア新薬工業	19,200	1,866.00	35,827,200	貸付株式数 8,600株
第一三共	303,300	8,516.00	2,582,902,800	貸付株式数 123,200株
キョーリン製薬ホールディングス	23,400	2,063.00	48,274,200	貸付株式数 7,100株
大幸薬品	12,900	2,266.00	29,231,400	貸付株式数 5,100株
ダイト	6,500	3,760.00	24,440,000	貸付株式数 1,400株
大塚ホールディングス	201,900	4,579.00	924,500,100	貸付株式数 90,600株
大正製薬ホールディングス	22,400	6,240.00	139,776,000	貸付株式数 10,000株
ペプチドリーム	53,900	4,675.00	251,982,500	貸付株式数 24,100株
大日本塗料	11,700	882.00	10,319,400	貸付株式数 3,000株
日本ペイントホールディングス	85,600	7,970.00	682,232,000	貸付株式数 38,400株
関西ペイント	116,600	2,236.00	260,717,600	貸付株式数 52,300株
神東塗料	8,200	176.00	1,443,200	貸付株式数 3,200株
中国塗料	29,500	805.00	23,747,500	貸付株式数 13,200株
日本特殊塗料	7,800	971.00	7,573,800	貸付株式数 900株
藤倉化成	14,000	512.00	7,168,000	貸付株式数 6,200株

太陽ホールディングス	7,600	5,070.00	38,532,000	貸付株式数 1,600株
D I C	43,800	2,655.00	116,289,000	貸付株式数 19,500株
サカティンクス	22,700	1,026.00	23,290,200	貸付株式数 600株
東洋インキS Cホールディングス	21,900	2,033.00	44,522,700	貸付株式数 9,800株
T & K T O K A	8,000	841.00	6,728,000	貸付株式数 1,700株
アルプス技研	9,000	1,866.00	16,794,000	貸付株式数 1,400株
サニックス	17,700	281.00	4,973,700	貸付株式数 7,900株
ダイオーズ	2,000	996.00	1,992,000	
日本空調サービス	10,600	725.00	7,685,000	貸付株式数 3,800株
オリエンタルランド	107,700	14,120.00	1,520,724,000	貸付株式数 45,800株
フォーカスシステムズ	6,400	833.00	5,331,200	貸付株式数 2,800株
ダスキン	25,200	2,702.00	68,090,400	貸付株式数 11,200株
パーク24	56,100	1,773.00	99,465,300	貸付株式数 20,400株
明光ネットワークジャパン	12,800	826.00	10,572,800	貸付株式数 4,800株 (800株)
ファルコホールディングス	5,600	1,528.00	8,556,800	貸付株式数 2,000株
クレスコ	6,300	1,352.00	8,517,600	貸付株式数 1,400株
フジ・メディア・ホールディングス	100,200	989.00	99,097,800	貸付株式数 44,900株
秀英予備校	2,200	428.00	941,600	貸付株式数 800株
田谷	1,800	530.00	954,000	貸付株式数 600株
ラウンドワン	28,300	757.00	21,423,100	貸付株式数 11,900株
リゾートトラスト	46,400	1,349.00	62,593,600	貸付株式数 9,300株
オービック	36,000	19,400.00	698,400,000	貸付株式数 14,800株
ジャストシステム	16,900	7,720.00	130,468,000	貸付株式数 7,500株
T D Cソフト	9,100	927.00	8,435,700	
Zホールディングス	1,428,000	540.00	771,120,000	貸付株式数 640,700株 (160,500株)

ピー・エム・エル	13,000	2,730.00	35,490,000	貸付株式数 5,800株
ワタベウェディング	1,600	295.00	472,000	貸付株式数 500株 (500株)
トレンドマイクロ	46,200	6,140.00	283,668,000	貸付株式数 12,600株
りらいあコミュニケーションズ	18,300	1,032.00	18,885,600	貸付株式数 8,100株
IDホールディングス	4,000	1,371.00	5,484,000	貸付株式数 1,700株
リソー教育	46,300	304.00	14,075,200	
日本オラクル	21,100	13,290.00	280,419,000	貸付株式数 9,200株
早稲田アカデミー	4,400	939.00	4,131,600	貸付株式数 1,900株
アルファシステムズ	3,200	3,865.00	12,368,000	貸付株式数 1,400株 (1,100株)
フューチャー	12,500	1,730.00	21,625,000	貸付株式数 3,200株
CAC Holdings	6,800	1,203.00	8,180,400	貸付株式数 100株
SBテクノロジー	3,700	3,675.00	13,597,500	貸付株式数 1,600株
トーセ	2,800	939.00	2,629,200	貸付株式数 1,200株 (900株)
ユー・エス・エス	113,400	1,709.00	193,800,600	貸付株式数 45,800株
オービックビジネスコンサルタント	10,600	5,900.00	62,540,000	貸付株式数 3,900株 (1,000株)
伊藤忠テクノソリューションズ	47,400	4,135.00	195,999,000	貸付株式数 21,200株
アイティフォー	12,600	739.00	9,311,400	貸付株式数 4,600株
東京個別指導学院	3,600	500.00	1,800,000	貸付株式数 1,200株
東計電算	1,500	4,245.00	6,367,500	貸付株式数 500株
サイバーエージェント	62,400	5,970.00	372,528,000	貸付株式数 28,000株
楽天	472,000	992.00	468,224,000	貸付株式数 196,000株
エクスネット	1,600	978.00	1,564,800	
クリーク・アンド・リバー社	5,300	1,081.00	5,729,300	貸付株式数 1,900株
テー・オー・ダブリュー	16,100	340.00	5,474,000	
大塚商会	56,300	5,760.00	324,288,000	貸付株式数 24,600株

サイボウズ	12,200	3,365.00	41,053,000	貸付株式数 4,000株
ソフトブレーン	6,100	426.00	2,598,600	貸付株式数 2,700株
山田コンサルティンググループ	6,500	1,234.00	8,021,000	貸付株式数 2,400株
セントラルスポーツ	3,800	2,184.00	8,299,200	貸付株式数 300株
パラカ	2,700	1,625.00	4,387,500	貸付株式数 1,100株
電通国際情報サービス	6,400	5,000.00	32,000,000	貸付株式数 1,900株
A C C E S S	9,700	967.00	9,379,900	貸付株式数 4,100株
デジタルガレージ	18,700	3,535.00	66,104,500	貸付株式数 8,300株 (300株)
イーエムシステムズ	14,600	976.00	14,249,600	貸付株式数 3,000株
ウェザーニューズ	3,500	3,500.00	12,250,000	貸付株式数 1,500株
C I J	7,100	791.00	5,616,100	貸付株式数 3,000株
ビジネスエンジニアリング	1,200	2,605.00	3,126,000	
日本エンタープライズ	10,600	264.00	2,798,400	貸付株式数 4,000株
WOWOW	5,000	2,440.00	12,200,000	貸付株式数 2,200株 (1,400株)
スカラ	6,900	664.00	4,581,600	貸付株式数 2,500株
インテリジェント ウェイブ	6,100	812.00	4,953,200	貸付株式数 2,600株
フルキャストホールディングス	10,100	1,369.00	13,826,900	
エン・ジャパン	18,000	2,651.00	47,718,000	貸付株式数 8,000株
富士フイルムホールディングス	203,200	4,665.00	947,928,000	貸付株式数 79,500株
コニカミノルタ	231,500	375.00	86,812,500	貸付株式数 104,000株
資生堂	210,600	6,845.00	1,441,557,000	貸付株式数 94,500株
ライオン	137,800	2,625.00	361,725,000	貸付株式数 61,800株
高砂香料工業	6,600	2,120.00	13,992,000	貸付株式数 2,300株
マンダム	23,800	1,927.00	45,862,600	貸付株式数 10,600株 (1,400株)
ミルボン	14,200	4,990.00	70,858,000	貸付株式数 6,300株

ファンケル	42,900	3,110.00	133,419,000	貸付株式数 19,200株
コーセー	19,900	12,780.00	254,322,000	貸付株式数 8,900株
コタ	6,100	1,177.00	7,179,700	
シーボン	1,400	1,903.00	2,664,200	貸付株式数 400株
ポーラ・オルビスホールディングス	45,200	1,811.00	81,857,200	貸付株式数 20,200株
ノエビアホールディングス	9,000	4,560.00	41,040,000	貸付株式数 3,800株
アジュバンコスメジャパン	2,400	951.00	2,282,400	貸付株式数 1,000株
エステー	6,800	1,666.00	11,328,800	
アグロ カネショウ	4,400	1,289.00	5,671,600	貸付株式数 1,900株
コニシ	17,400	1,429.00	24,864,600	貸付株式数 7,800株
長谷川香料	18,300	2,379.00	43,535,700	貸付株式数 8,100株 (300株)
星光PMC	6,100	707.00	4,312,700	貸付株式数 400株 (400株)
小林製薬	29,700	9,460.00	280,962,000	貸付株式数 13,100株
荒川化学工業	9,500	1,207.00	11,466,500	貸付株式数 2,800株
メック	7,300	2,064.00	15,067,200	貸付株式数 3,100株
日本高純度化学	2,900	2,584.00	7,493,600	
タカラバイオ	27,700	3,055.00	84,623,500	貸付株式数 11,300株
JCU	12,800	3,230.00	41,344,000	貸付株式数 5,700株
新田ゼラチン	6,600	677.00	4,468,200	
OATアグリオ	1,800	1,130.00	2,034,000	
デクセリアルズ	27,400	813.00	22,276,200	貸付株式数 12,300株
アース製薬	8,000	7,620.00	60,960,000	貸付株式数 3,500株
北興化学工業	10,900	561.00	6,114,900	貸付株式数 300株
大成ラミック	3,500	2,715.00	9,502,500	貸付株式数 1,500株
クミアイ化学工業	43,800	989.00	43,318,200	貸付株式数 19,600株 (3,900株)
日本農薬	18,900	500.00	9,450,000	貸付株式数 8,400株

富士興産	3,200	429.00	1,372,800	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
ニチレキ	12,500	1,613.00	20,162,500	貸付株式数 4,700株
ユシロ化学工業	5,900	1,310.00	7,729,000	貸付株式数 1,500株
ビーピー・カストロール	3,800	1,119.00	4,252,200	
富士石油	28,300	161.00	4,556,300	貸付株式数 400株
MORESCO	3,800	1,004.00	3,815,200	
出光興産	117,600	2,327.00	273,655,200	貸付株式数 52,800株
ENEOSホールディングス	1,594,200	383.10	610,738,020	貸付株式数 643,200株
コスモエネルギーホールディングス	30,700	1,567.00	48,106,900	貸付株式数 13,500株
横浜ゴム	61,400	1,504.00	92,345,600	貸付株式数 27,500株
TOYO TIRE	60,800	1,432.00	87,065,600	貸付株式数 27,300株
ブリヂストン	305,300	3,398.00	1,037,409,400	貸付株式数 137,000株
住友ゴム工業	95,200	1,016.00	96,723,200	貸付株式数 42,700株
藤倉コンポジット	9,300	372.00	3,459,600	貸付株式数 4,100株
オカモト	6,400	3,870.00	24,768,000	貸付株式数 1,700株
アキレス	7,300	1,990.00	14,527,000	貸付株式数 2,500株
フコク	4,600	664.00	3,054,400	貸付株式数 1,000株
ニッタ	12,000	2,327.00	27,924,000	貸付株式数 5,300株
クリエートメディック	3,500	983.00	3,440,500	貸付株式数 600株 (600株)
住友理工	20,500	600.00	12,300,000	貸付株式数 7,800株
三ツ星ベルト	13,900	1,682.00	23,379,800	貸付株式数 5,100株
バンドー化学	18,600	621.00	11,550,600	貸付株式数 7,100株
AGC	104,800	3,130.00	328,024,000	貸付株式数 47,000株
日本板硝子	50,700	382.00	19,367,400	貸付株式数 21,700株
石塚硝子	1,900	1,802.00	3,423,800	

有沢製作所	16,800	825.00	13,860,000	貸付株式数 7,500株 (500株)
日本山村硝子	4,400	856.00	3,766,400	貸付株式数 1,300株
日本電気硝子	42,600	1,687.00	71,866,200	貸付株式数 19,100株
オハラ	4,200	1,098.00	4,611,600	貸付株式数 1,800株
住友大阪セメント	20,100	3,675.00	73,867,500	貸付株式数 7,800株 (6,000株)
太平洋セメント	66,900	2,378.00	159,088,200	貸付株式数 23,600株
リソルホールディングス	1,100	3,460.00	3,806,000	貸付株式数 400株
日本ヒューム	10,600	775.00	8,215,000	貸付株式数 4,000株
日本コンクリート工業	22,800	270.00	6,156,000	貸付株式数 5,600株
三谷セキサン	4,900	5,200.00	25,480,000	貸付株式数 1,400株
アジアパイルホールディングス	15,000	461.00	6,915,000	貸付株式数 5,700株
東海カーボン	111,000	992.00	110,112,000	貸付株式数 39,800株
日本カーボン	5,500	3,435.00	18,892,500	貸付株式数 1,800株
東洋炭素	6,200	1,699.00	10,533,800	貸付株式数 2,700株 (2,100株)
ノリタケカンパニーリミテド	5,900	3,345.00	19,735,500	貸付株式数 1,900株
TOTO	75,700	4,175.00	316,047,500	貸付株式数 27,500株
日本碍子	127,200	1,435.00	182,532,000	貸付株式数 55,500株 (49,700株)
日本特殊陶業	80,600	1,491.00	120,174,600	貸付株式数 36,200株
ダントーホールディングス	7,900	92.00	726,800	貸付株式数 3,500株
MARUWA	4,100	7,970.00	32,677,000	貸付株式数 1,700株
品川リフラクトリーズ	2,800	2,136.00	5,980,800	貸付株式数 1,000株
黒崎播磨	2,100	3,640.00	7,644,000	
ヨータイ	8,400	714.00	5,997,600	貸付株式数 3,000株
イソライト工業	5,400	418.00	2,257,200	貸付株式数 900株

東京窯業	13,500	297.00	4,009,500	貸付株式数 5,100株
ニッカトー	4,800	682.00	3,273,600	貸付株式数 1,800株
フジインコーポレーテッド	9,400	3,335.00	31,349,000	貸付株式数 1,900株
クニミネ工業	4,300	943.00	4,054,900	貸付株式数 700株
エーアンドエーマテリアル	1,800	1,070.00	1,926,000	
ニチアス	29,000	2,260.00	65,540,000	貸付株式数 12,500株
日本製鉄	469,000	1,018.00	477,442,000	貸付株式数 210,300株
神戸製鋼所	191,800	377.00	72,308,600	貸付株式数 43,700株
中山製鋼所	14,500	353.00	5,118,500	貸付株式数 6,500株
合同製鐵	5,600	1,794.00	10,046,400	貸付株式数 2,200株
ジェイ エフ イー ホールディングス	283,000	792.00	224,136,000	貸付株式数 127,000株
東京製鐵	51,000	618.00	31,518,000	貸付株式数 20,100株 (2,300株)
共英製鋼	11,800	1,277.00	15,068,600	貸付株式数 4,700株 (700株)
大和工業	22,300	2,113.00	47,119,900	貸付株式数 10,000株
東京鐵鋼	4,300	1,496.00	6,432,800	貸付株式数 1,700株
大阪製鐵	5,600	1,224.00	6,854,400	貸付株式数 1,700株
淀川製鋼所	14,100	1,831.00	25,817,100	貸付株式数 6,300株
丸一鋼管	34,000	2,654.00	90,236,000	貸付株式数 7,600株
モリ工業	3,100	2,320.00	7,192,000	貸付株式数 1,000株
大同特殊鋼	17,200	3,285.00	56,502,000	貸付株式数 6,200株
日本高周波鋼業	3,900	355.00	1,384,500	貸付株式数 1,300株 (900株)
日本冶金工業	8,700	1,549.00	13,476,300	貸付株式数 2,400株
山陽特殊製鋼	7,200	878.00	6,321,600	貸付株式数 2,700株
愛知製鋼	5,900	2,986.00	17,617,400	貸付株式数 2,000株

日立金属	112,900	1,289.00	145,528,100	貸付株式数 42,400株
日本金属	2,400	610.00	1,464,000	貸付株式数 300株
大太平洋金属	7,100	1,550.00	11,005,000	貸付株式数 2,800株
新日本電工	67,500	164.00	11,070,000	貸付株式数 25,500株
栗本鐵工所	5,200	1,636.00	8,507,200	貸付株式数 1,800株
虹 技	1,500	1,239.00	1,858,500	貸付株式数 500株
日本鑄鉄管	1,100	1,272.00	1,399,200	貸付株式数 300株
日本製鋼所	31,800	1,525.00	48,495,000	貸付株式数 14,200株
三菱製鋼	7,800	643.00	5,015,400	貸付株式数 700株
日亜鋼業	15,300	290.00	4,437,000	貸付株式数 5,100株
日本精線	1,700	3,325.00	5,652,500	貸付株式数 500株
エンビプロ・ホールディングス	4,500	543.00	2,443,500	貸付株式数 2,000株
大紀アルミニウム工業所	17,200	529.00	9,098,800	貸付株式数 3,300株 (2,700株)
日本軽金属ホールディングス	265,200	184.00	48,796,800	貸付株式数 98,400株
三井金属鉱業	28,300	2,208.00	62,486,400	貸付株式数 10,000株
東邦亜鉛	5,400	1,522.00	8,218,800	貸付株式数 2,100株 (900株)
三菱マテリアル	69,200	2,265.00	156,738,000	貸付株式数 29,900株
住友金属鉱山	134,000	3,130.00	419,420,000	貸付株式数 60,100株 (1,300株)
DOWAホールディングス	26,500	3,235.00	85,727,500	貸付株式数 11,900株 (4,100株)
古河機械金属	18,600	1,074.00	19,976,400	貸付株式数 2,300株
エス・サイエンス	46,300	47.00	2,176,100	貸付株式数 4,900株
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,900	909.00	9,908,100	貸付株式数 4,900株
東邦チタニウム	18,800	645.00	12,126,000	貸付株式数 8,400株

UACJ	15,900	1,882.00	29,923,800	貸付株式数 5,600株
CKサンエツ	2,200	3,075.00	6,765,000	貸付株式数 700株
古河電気工業	32,600	2,622.00	85,477,200	貸付株式数 14,300株
住友電気工業	391,800	1,249.50	489,554,100	貸付株式数 175,600株 (24,000株)
フジクラ	126,500	322.00	40,733,000	貸付株式数 56,700株
昭和電線ホールディングス	12,200	1,152.00	14,054,400	貸付株式数 4,700株
東京特殊電線	1,600	2,124.00	3,398,400	
タツタ電線	20,800	540.00	11,232,000	貸付株式数 8,000株
カナレ電気	1,700	1,712.00	2,910,400	
平河ヒューテック	5,200	1,022.00	5,314,400	貸付株式数 1,600株
リョービ	12,900	1,144.00	14,757,600	貸付株式数 5,500株
アーレスティ	13,700	345.00	4,726,500	貸付株式数 5,200株
アサヒホールディングス	18,400	2,844.00	52,329,600	貸付株式数 7,600株
東洋製罐グループホールディングス	66,700	1,169.00	77,972,300	貸付株式数 29,900株 (15,200株)
ホッカンホールディングス	5,800	1,731.00	10,039,800	貸付株式数 2,000株
コロナ	5,800	1,006.00	5,834,800	貸付株式数 1,500株
横河ブリッジホールディングス	19,500	2,201.00	42,919,500	貸付株式数 8,100株
OSJBホールディングス	52,400	225.00	11,790,000	貸付株式数 23,300株
駒井ハルテック	2,000	1,430.00	2,860,000	貸付株式数 600株
高田機工	1,000	2,407.00	2,407,000	貸付株式数 100株
三和ホールディングス	98,800	921.00	90,994,800	貸付株式数 35,400株
文化シャッター	30,900	742.00	22,927,800	貸付株式数 11,700株
三協立山	13,500	911.00	12,298,500	貸付株式数 5,700株
アルインコ	7,600	929.00	7,060,400	貸付株式数 700株
東洋シャッター	2,500	675.00	1,687,500	貸付株式数 900株 (900株)

LIXILグループ	154,600	1,547.00	239,166,200	貸付株式数 54,400株
日本ファイルコン	8,000	456.00	3,648,000	貸付株式数 3,400株 (400株)
ノーリツ	21,700	1,317.00	28,578,900	貸付株式数 9,200株
長府製作所	10,700	2,179.00	23,315,300	貸付株式数 3,400株
リンナイ	20,400	8,860.00	180,744,000	貸付株式数 9,100株
ユニプレス	20,500	890.00	18,245,000	貸付株式数 5,300株
ダイニチ工業	5,600	692.00	3,875,200	貸付株式数 2,500株
日東精工	14,500	458.00	6,641,000	貸付株式数 6,000株
三洋工業	1,400	1,883.00	2,636,200	貸付株式数 600株
岡部	21,200	800.00	16,960,000	貸付株式数 9,500株
ジーテクト	13,000	988.00	12,844,000	貸付株式数 4,900株
東プレ	19,600	1,145.00	22,442,000	貸付株式数 3,400株
高周波熱錬	20,200	507.00	10,241,400	貸付株式数 6,500株
東京製綱	7,500	580.00	4,350,000	貸付株式数 2,600株
サンコール	7,800	418.00	3,260,400	貸付株式数 3,500株
モリテックスチール	8,200	290.00	2,378,000	貸付株式数 3,500株
パイオラックス	15,500	1,535.00	23,792,500	貸付株式数 6,900株
エイチワン	10,300	550.00	5,665,000	貸付株式数 3,500株
日本発条	112,400	667.00	74,970,800	貸付株式数 50,400株 (2,800株)
中央発條	1,300	2,765.00	3,594,500	貸付株式数 500株
アドバネクス	1,500	1,400.00	2,100,000	貸付株式数 500株
三浦工業	45,300	4,455.00	201,811,500	貸付株式数 20,300株 (300株)
タクマ	35,500	1,460.00	51,830,000	貸付株式数 14,100株
テクノプロ・ホールディングス	20,200	5,820.00	117,564,000	貸付株式数 8,800株

アトラ	2,300	231.00	531,300	貸付株式数 1,000株
インターワークス	1,900	346.00	657,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	4,100	11,440.00	46,904,000	貸付株式数 1,400株
KeePer 技研	3,700	1,773.00	6,560,100	貸付株式数 1,300株
ファーストロジック	1,900	615.00	1,168,500	貸付株式数 700株
三機サービス	1,900	932.00	1,770,800	貸付株式数 700株
Gunosy	6,300	927.00	5,840,100	貸付株式数 2,700株
デザインワン・ジャパン	3,000	288.00	864,000	貸付株式数 1,200株
イー・ガーディアン	4,500	2,979.00	13,405,500	
リブセンス	6,500	288.00	1,872,000	貸付株式数 2,800株
ジャパンマテリアル	31,100	1,733.00	53,896,300	貸付株式数 13,900株 (300株)
ベクトル	12,600	881.00	11,100,600	貸付株式数 4,900株
ウチヤマホールディングス	5,000	301.00	1,505,000	貸付株式数 2,200株
チャーム・ケア・コーポレーション	8,600	770.00	6,622,000	貸付株式数 3,100株
ライクキッズ	1,600	1,003.00	1,604,800	
キャリアリンク	3,300	724.00	2,389,200	貸付株式数 1,100株 (1,100株)
I B J	6,900	679.00	4,685,100	貸付株式数 2,600株
アサンテ	4,100	1,452.00	5,953,200	貸付株式数 1,200株
N・フィールド	7,000	524.00	3,668,000	貸付株式数 300株 (300株)
バリューHR	4,000	1,375.00	5,500,000	貸付株式数 500株
M&Aキャピタルパートナーズ	8,200	4,120.00	33,784,000	貸付株式数 3,600株 (1,000株)
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,900	2,505.00	9,769,500	貸付株式数 1,600株 (1,300株)
E R Iホールディングス	2,800	642.00	1,797,600	貸付株式数 1,000株
アピスト	1,600	2,666.00	4,265,600	貸付株式数 500株

シグマクシス	6,900	1,587.00	10,950,300	貸付株式数 800株
ウィルグループ	6,600	648.00	4,276,800	貸付株式数 2,200株
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,000	204.00	2,856,000	貸付株式数 5,900株 (4,900株)
リクルートホールディングス	725,500	3,630.00	2,633,565,000	貸付株式数 309,400株
エラン	6,000	1,708.00	10,248,000	貸付株式数 2,600株
ツガミ	21,700	880.00	19,096,000	貸付株式数 7,600株
オークマ	12,200	4,475.00	54,595,000	貸付株式数 5,000株 (3,000株)
芝浦機械	11,800	2,109.00	24,886,200	
アマダ	130,000	833.00	108,290,000	貸付株式数 45,700株 (25,300株)
アイダエンジニアリング	27,400	718.00	19,673,200	貸付株式数 12,300株
滝澤鉄工所	3,200	1,003.00	3,209,600	
F U J I	45,100	1,879.00	84,742,900	貸付株式数 20,200株
牧野フライス製作所	12,300	3,175.00	39,052,500	貸付株式数 5,500株
オーエスジー	48,400	1,639.00	79,327,600	貸付株式数 21,700株
ダイジェット工業	1,200	1,330.00	1,596,000	
旭ダイヤモンド工業	27,500	471.00	12,952,500	貸付株式数 12,300株
D M G 森精機	66,300	1,282.00	84,996,600	貸付株式数 29,800株
ソディック	24,600	805.00	19,803,000	貸付株式数 8,200株
ディスコ	14,200	27,610.00	392,062,000	貸付株式数 6,300株
日東工器	5,700	1,886.00	10,750,200	貸付株式数 2,000株
日進工具	4,100	2,491.00	10,213,100	貸付株式数 1,800株 (600株)
パンチ工業	9,500	406.00	3,857,000	貸付株式数 3,600株
富士ダイス	4,600	660.00	3,036,000	
土木管理総合試験所	4,400	417.00	1,834,800	貸付株式数 1,900株
ネットマーケティング	3,900	630.00	2,457,000	貸付株式数 1,700株

日本郵政	830,000	761.90	632,377,000	貸付株式数 372,700株
ベルシステム24ホールディングス	17,000	1,409.00	23,953,000	貸付株式数 5,200株 (600株)
鎌倉新書	7,600	1,055.00	8,018,000	貸付株式数 3,100株
S M N	2,100	1,093.00	2,295,300	
一蔵	1,100	394.00	433,400	貸付株式数 300株
L I T A L I C O	3,500	2,297.00	8,039,500	貸付株式数 1,400株
グローバルキッズCOMPANY	1,800	614.00	1,105,200	貸付株式数 600株
エアトリ	5,300	1,185.00	6,280,500	貸付株式数 1,800株
アトラエ	3,100	3,105.00	9,625,500	貸付株式数 1,200株
ストライク	3,800	5,170.00	19,646,000	貸付株式数 1,300株
ソラスト	27,900	1,061.00	29,601,900	貸付株式数 7,400株
セラク	3,200	1,110.00	3,552,000	
インソース	4,200	2,642.00	11,096,400	貸付株式数 1,700株
豊田自動織機	85,800	5,600.00	480,480,000	貸付株式数 38,100株 (14,000株)
豊和工業	5,800	760.00	4,408,000	貸付株式数 2,600株
O K K	4,300	388.00	1,668,400	貸付株式数 1,800株
石川製作所	2,500	1,591.00	3,977,500	貸付株式数 900株 (900株)
東洋機械金属	7,500	400.00	3,000,000	貸付株式数 300株
津田駒工業	2,000	864.00	1,728,000	貸付株式数 600株
エンシュウ	2,500	945.00	2,362,500	
島精機製作所	16,500	1,415.00	23,347,500	貸付株式数 6,400株 (6,400株)
オプトラン	11,700	2,548.00	29,811,600	貸付株式数 5,200株
N Cホールディングス	3,200	544.00	1,740,800	
イワキ	6,700	982.00	6,579,400	
フリー	10,200	986.00	10,057,200	貸付株式数 4,500株

ヤマシンフィルタ	22,800	1,041.00	23,734,800	貸付株式数 10,200株
日阪製作所	12,900	745.00	9,610,500	貸付株式数 4,500株
やまびこ	20,300	926.00	18,797,800	貸付株式数 2,000株
平田機工	5,000	6,050.00	30,250,000	貸付株式数 1,800株
ペガサスマシン製造	10,600	312.00	3,307,200	貸付株式数 4,000株
マルマエ	3,900	1,220.00	4,758,000	貸付株式数 1,700株
タツモ	4,900	1,813.00	8,883,700	貸付株式数 2,100株
ナプテスコ	61,800	3,350.00	207,030,000	貸付株式数 27,700株
三井海洋開発	11,100	1,553.00	17,238,300	貸付株式数 3,400株
レオン自動機	10,300	1,243.00	12,802,900	貸付株式数 4,600株
S M C	33,200	56,530.00	1,876,796,000	貸付株式数 3,000株
ホソカワミクロン	3,700	5,630.00	20,831,000	貸付株式数 1,100株
ユニオンツール	3,900	2,628.00	10,249,200	貸付株式数 1,400株
オイレス工業	13,500	1,389.00	18,751,500	貸付株式数 6,100株 (500株)
日精エー・エス・ビー機械	3,000	3,070.00	9,210,000	貸付株式数 800株
サトーホールディングス	14,900	2,372.00	35,342,800	貸付株式数 5,300株
技研製作所	9,200	4,945.00	45,494,000	
日本エアテック	3,700	1,076.00	3,981,200	貸付株式数 1,600株
カワタ	3,100	734.00	2,275,400	貸付株式数 1,100株
日精樹脂工業	8,800	803.00	7,066,400	貸付株式数 3,300株
オカダアイヨン	3,300	934.00	3,082,200	貸付株式数 1,400株
ワイエイシイホールディングス	4,500	649.00	2,920,500	貸付株式数 1,900株
小松製作所	480,000	2,180.00	1,046,400,000	貸付株式数 215,500株
住友重機械工業	60,700	2,249.00	136,514,300	貸付株式数 27,200株 (1,200株)
日立建機	42,500	3,000.00	127,500,000	貸付株式数 19,000株

日工	14,500	619.00	8,975,500	貸付株式数 4,900株
巴工業	4,500	1,830.00	8,235,000	貸付株式数 1,000株
井関農機	10,600	1,131.00	11,988,600	
TOWA	10,700	1,416.00	15,151,200	貸付株式数 4,500株
丸山製作所	2,200	1,151.00	2,532,200	貸付株式数 300株
北川鉄工所	4,800	1,527.00	7,329,600	貸付株式数 1,700株
シンニッタン	16,300	220.00	3,586,000	貸付株式数 5,900株
ローツェ	4,600	5,800.00	26,680,000	貸付株式数 700株
タカキタ	3,700	601.00	2,223,700	貸付株式数 1,600株
クボタ	562,200	1,549.50	871,128,900	貸付株式数 251,300株
荏原実業	2,700	2,851.00	7,697,700	
東洋エンジニアリング	14,000	345.00	4,830,000	貸付株式数 5,900株
三菱化工機	3,600	1,871.00	6,735,600	
月島機械	19,500	1,134.00	22,113,000	貸付株式数 6,100株 (500株)
帝国電機製作所	8,700	1,232.00	10,718,400	貸付株式数 3,300株
東京機械製作所	4,300	289.00	1,242,700	貸付株式数 1,700株
新東工業	25,100	759.00	19,050,900	貸付株式数 11,200株 (600株)
澁谷工業	9,300	2,818.00	26,207,400	貸付株式数 1,000株
アイチコーポレーション	18,300	739.00	13,523,700	貸付株式数 6,400株
小森コーポレーション	26,900	683.00	18,372,700	貸付株式数 10,700株 (1,200株)
鶴見製作所	8,100	1,826.00	14,790,600	貸付株式数 2,800株
住友精密工業	1,600	2,137.00	3,419,200	貸付株式数 100株 (100株)
日本ギア工業	4,200	282.00	1,184,400	
酒井重工業	2,000	2,030.00	4,060,000	
荏原製作所	43,900	2,570.00	112,823,000	貸付株式数 19,700株

石井鐵工所	1,400	2,505.00	3,507,000	貸付株式数 100株
西島製作所	10,700	834.00	8,923,800	貸付株式数 4,000株
北越工業	10,900	1,033.00	11,259,700	貸付株式数 3,800株
ダイキン工業	135,000	18,365.00	2,479,275,000	貸付株式数 58,300株
オルガノ	3,800	5,600.00	21,280,000	貸付株式数 1,100株
トーヨーカネツ	4,600	2,072.00	9,531,200	貸付株式数 1,600株
栗田工業	57,300	2,993.00	171,498,900	貸付株式数 25,700株
椿本チエイン	15,100	2,579.00	38,942,900	貸付株式数 6,700株
大同工業	5,000	649.00	3,245,000	貸付株式数 400株
日機装	31,800	978.00	31,100,400	貸付株式数 3,800株
木村化工機	8,800	415.00	3,652,000	貸付株式数 3,700株
レイズネクスト	17,800	1,252.00	22,285,600	貸付株式数 5,800株
アネスト岩田	16,500	832.00	13,728,000	貸付株式数 1,300株
ダイフク	54,200	10,190.00	552,298,000	貸付株式数 24,300株
サムコ	2,600	2,940.00	7,644,000	貸付株式数 1,000株
加藤製作所	5,800	1,204.00	6,983,200	貸付株式数 2,500株
油研工業	1,800	1,481.00	2,665,800	貸付株式数 300株
タダノ	51,100	891.00	45,530,100	貸付株式数 22,900株
フジテック	38,500	1,923.00	74,035,500	貸付株式数 17,300株
C K D	29,000	2,045.00	59,305,000	貸付株式数 10,800株
キトー	8,000	1,242.00	9,936,000	貸付株式数 1,700株
平和	29,600	1,787.00	52,895,200	貸付株式数 4,700株
理想科学工業	9,400	1,341.00	12,605,400	貸付株式数 4,200株
SANKYO	23,600	2,633.00	62,138,800	貸付株式数 10,500株
日本金銭機械	11,700	571.00	6,680,700	貸付株式数 4,400株

マースグループホールディングス	6,700	1,614.00	10,813,800	貸付株式数 2,300株
フクシマガリレイ	6,500	3,265.00	21,222,500	貸付株式数 2,400株
オーイズミ	4,400	382.00	1,680,800	
ダイコク電機	4,900	1,215.00	5,953,500	
竹内製作所	17,700	1,759.00	31,134,300	貸付株式数 6,100株
アマノ	27,700	2,298.00	63,654,600	貸付株式数 12,400株
J U K I	14,700	535.00	7,864,500	貸付株式数 1,200株
サンデンホールディングス	13,900	302.00	4,197,800	貸付株式数 5,800株 (400株)
蛇の目ミシン工業	9,600	441.00	4,233,600	貸付株式数 4,300株
ブラザー工業	129,400	1,861.00	240,813,400	貸付株式数 58,100株
マックス	16,200	1,513.00	24,510,600	貸付株式数 7,000株 (3,700株)
モリタホールディングス	18,500	1,779.00	32,911,500	貸付株式数 8,300株
グローリー	27,200	2,493.00	67,809,600	貸付株式数 12,200株
新晃工業	9,800	1,448.00	14,190,400	貸付株式数 1,900株 (900株)
大和冷機工業	15,300	943.00	14,427,900	貸付株式数 1,200株
セガサミーホールディングス	105,100	1,311.00	137,786,100	貸付株式数 47,100株
日本ピストンリング	3,900	1,191.00	4,644,900	貸付株式数 1,000株
リケン	4,900	2,859.00	14,009,100	貸付株式数 2,100株 (1,600株)
T P R	14,300	1,298.00	18,561,400	貸付株式数 3,100株
ツバキ・ナカシマ	21,600	807.00	17,431,200	貸付株式数 700株
ホシザキ	31,000	9,150.00	283,650,000	貸付株式数 13,900株
大豊工業	8,600	530.00	4,558,000	貸付株式数 3,000株
日本精工	199,500	786.00	156,807,000	貸付株式数 59,300株 (29,600株)
N T N	245,300	212.00	52,003,600	貸付株式数 110,100株

ジェイテクト	101,700	802.00	81,563,400	貸付株式数 45,600株 (29,500株)
不二越	9,800	3,315.00	32,487,000	
ミネベアミツミ	196,700	1,917.00	377,073,900	貸付株式数 88,300株
日本トムソン	31,400	335.00	10,519,000	貸付株式数 11,300株
THK	61,700	2,719.00	167,762,300	貸付株式数 27,600株
ユーシン精機	8,200	706.00	5,789,200	貸付株式数 900株
前澤給装工業	3,800	2,017.00	7,664,600	貸付株式数 1,300株
イーグル工業	13,100	703.00	9,209,300	貸付株式数 4,600株
前澤工業	7,000	407.00	2,849,000	
日本ピラー工業	10,700	1,380.00	14,766,000	貸付株式数 2,000株
キッツ	42,900	678.00	29,086,200	貸付株式数 19,300株
日立製作所	509,200	3,391.00	1,726,697,200	貸付株式数 220,400株
三菱電機	1,059,700	1,405.00	1,488,878,500	貸付株式数 224,800株
富士電機	63,900	2,885.00	184,351,500	貸付株式数 26,800株 (4,400株)
東洋電機製造	3,800	1,190.00	4,522,000	貸付株式数 500株
安川電機	114,100	4,040.00	460,964,000	貸付株式数 51,200株
シンフォニアテクノロジー	13,700	1,027.00	14,069,900	貸付株式数 6,100株 (1,200株)
明電舎	19,500	1,603.00	31,258,500	貸付株式数 8,700株
オリジン	2,900	1,339.00	3,883,100	貸付株式数 700株
山洋電気	5,100	4,795.00	24,454,500	貸付株式数 1,800株
デンヨー	9,000	1,990.00	17,910,000	貸付株式数 3,400株
ベイカレント・コンサルティング	6,100	9,190.00	56,059,000	
Orchestra Holdings	2,100	1,648.00	3,460,800	貸付株式数 900株
アイモバイル	3,600	699.00	2,516,400	貸付株式数 1,500株
キャリアインデックス	4,100	482.00	1,976,200	貸付株式数 1,800株

MS - J a p a n	3,300	777.00	2,564,100	貸付株式数 1,100株
船場	1,700	1,036.00	1,761,200	貸付株式数 500株
グレイステクノロジー	4,600	5,670.00	26,082,000	貸付株式数 1,800株
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	10,700	3,610.00	38,627,000	貸付株式数 4,800株
フルテック	1,400	1,309.00	1,832,600	貸付株式数 500株
グリーンズ	2,500	463.00	1,157,500	貸付株式数 500株
ツナググループ・ホールディングス	1,700	426.00	724,200	貸付株式数 700株
G A M E W I T H	3,000	579.00	1,737,000	貸付株式数 1,300株
ソウルドアウト	2,100	2,669.00	5,604,900	貸付株式数 700株
M S & C o n s u l t i n g	1,900	566.00	1,075,400	貸付株式数 800株 (500株)
ミダック	1,300	1,684.00	2,189,200	
日総工産	6,800	644.00	4,379,200	貸付株式数 2,500株 (2,500株)
キュービーネットホールディングス	4,200	1,965.00	8,253,000	貸付株式数 1,400株
R P A ホールディングス	7,700	748.00	5,759,600	貸付株式数 3,400株
三櫻工業	13,400	670.00	8,978,000	貸付株式数 6,000株
マキタ	138,200	3,965.00	547,963,000	貸付株式数 62,000株
東芝テック	13,300	4,180.00	55,594,000	貸付株式数 5,900株
芝浦メカトロニクス	1,900	2,822.00	5,361,800	貸付株式数 600株
マブチモーター	29,300	3,325.00	97,422,500	貸付株式数 13,100株
日本電産	255,000	7,074.00	1,803,870,000	貸付株式数 114,500株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,300	418.00	2,633,400	貸付株式数 2,700株
トレックス・セミコンダクター	6,100	1,234.00	7,527,400	
東光高岳	5,900	1,008.00	5,947,200	貸付株式数 2,100株
ダブル・スコープ	16,800	782.00	13,137,600	貸付株式数 7,500株
宮越ホールディングス	3,900	748.00	2,917,200	貸付株式数 1,500株

ダイヘン	11,600	4,015.00	46,574,000	貸付株式数 5,100株
ヤーマン	17,300	977.00	16,902,100	貸付株式数 700株
JVCケンウッド	86,300	158.00	13,635,400	
ミマキエンジニアリング	9,500	382.00	3,629,000	貸付株式数 4,200株
第一精工	4,300	2,064.00	8,875,200	貸付株式数 900株
日新電機	24,800	1,030.00	25,544,000	貸付株式数 3,500株
大崎電気工業	21,100	517.00	10,908,700	貸付株式数 9,400株
オムロン	95,000	7,330.00	696,350,000	貸付株式数 42,600株
日東工業	15,600	1,807.00	28,189,200	貸付株式数 6,800株
I D E C	15,300	1,640.00	25,092,000	貸付株式数 6,800株 (4,900株)
正興電機製作所	2,500	958.00	2,395,000	貸付株式数 900株
不二電機工業	1,800	1,340.00	2,412,000	貸付株式数 700株
ジーエス・ユアサ コーポレーション	35,400	1,838.00	65,065,200	貸付株式数 13,800株 (800株)
サクサホールディングス	2,500	1,566.00	3,915,000	貸付株式数 300株
メルコホールディングス	3,700	3,275.00	12,117,500	貸付株式数 100株
テクノメディカ	2,400	1,786.00	4,286,400	貸付株式数 800株
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	2,300	581.00	1,336,300	貸付株式数 800株
日本電気	128,500	5,570.00	715,745,000	貸付株式数 46,600株
富士通	102,200	12,980.00	1,326,556,000	貸付株式数 45,800株
沖電気工業	43,000	1,065.00	45,795,000	貸付株式数 8,400株
岩崎通信機	4,600	830.00	3,818,000	
電気興業	5,100	2,523.00	12,867,300	貸付株式数 1,700株
サンケン電気	11,600	2,062.00	23,919,200	貸付株式数 4,900株
ナカヨ	2,100	1,410.00	2,961,000	貸付株式数 400株
アイホン	6,000	1,449.00	8,694,000	貸付株式数 2,100株

ルネサスエレクトロニクス	507,800	598.00	303,664,400	貸付株式数 228,000株
セイコーエプソン	131,500	1,207.00	158,720,500	貸付株式数 59,000株 (1,700株)
ワコム	71,200	577.00	41,082,400	貸付株式数 32,000株
アルバック	19,500	3,265.00	63,667,500	貸付株式数 8,700株
アクセル	4,400	761.00	3,348,400	貸付株式数 1,900株
E I Z O	8,200	4,110.00	33,702,000	貸付株式数 3,500株
ジャパンディスプレイ	306,200	49.00	15,003,800	貸付株式数 137,300株
日本信号	27,000	1,112.00	30,024,000	貸付株式数 12,100株
京三製作所	24,800	551.00	13,664,800	貸付株式数 11,100株 (1,200株)
能美防災	14,000	2,024.00	28,336,000	貸付株式数 6,200株
ホーチキ	7,700	1,220.00	9,394,000	貸付株式数 2,600株
星和電機	5,200	616.00	3,203,200	貸付株式数 1,200株
エレコム	11,800	5,410.00	63,838,000	貸付株式数 4,100株 (1,700株)
パナソニック	1,210,800	956.30	1,157,888,040	貸付株式数 461,800株
シャープ	122,600	1,150.00	140,990,000	貸付株式数 54,900株
アンリツ	68,200	2,505.00	170,841,000	貸付株式数 29,900株
富士通ゼネラル	28,800	2,373.00	68,342,400	貸付株式数 12,900株
ソニー	663,800	7,430.00	4,932,034,000	貸付株式数 297,200株
T D K	51,200	10,490.00	537,088,000	貸付株式数 22,400株
帝国通信工業	4,700	1,185.00	5,569,500	貸付株式数 1,000株
タムラ製作所	35,400	441.00	15,611,400	貸付株式数 15,800株
アルプスアルパイン	93,800	1,393.00	130,663,400	貸付株式数 42,100株 (14,300株)
池上通信機	3,400	863.00	2,934,200	貸付株式数 1,400株

日本電波工業	9,600	336.00	3,225,600	貸付株式数 3,300株
鈴木	5,200	683.00	3,551,600	
日本トリム	1,400	3,270.00	4,578,000	
ローランド ディー.ジー.	5,800	1,140.00	6,612,000	貸付株式数 1,600株
フォスター電機	11,100	1,069.00	11,865,900	貸付株式数 2,500株
S M K	2,700	2,629.00	7,098,300	貸付株式数 900株 (900株)
ヨコオ	6,900	2,704.00	18,657,600	貸付株式数 3,000株
ティアック	7,600	150.00	1,140,000	貸付株式数 3,000株
ホシデン	29,000	932.00	27,028,000	貸付株式数 13,000株
ヒロセ電機	16,400	11,840.00	194,176,000	貸付株式数 7,200株 (900株)
日本航空電子工業	24,300	1,459.00	35,453,700	貸付株式数 10,900株
T O A	11,400	743.00	8,470,200	貸付株式数 4,300株
マクセルホールディングス	22,800	960.00	21,888,000	貸付株式数 3,900株
古野電気	13,600	978.00	13,300,800	貸付株式数 6,100株
ユニデンホールディングス	2,900	1,772.00	5,138,800	貸付株式数 1,300株
スミダコーポレーション	8,100	721.00	5,840,100	貸付株式数 2,600株
アイコム	5,900	2,981.00	17,587,900	貸付株式数 2,100株
リオン	4,400	2,118.00	9,319,200	貸付株式数 1,500株
本多通信工業	9,100	408.00	3,712,800	貸付株式数 3,400株 (300株)
船井電機	10,700	493.00	5,275,100	貸付株式数 3,400株
横河電機	97,200	1,652.00	160,574,400	貸付株式数 42,700株 (9,400株)
新電元工業	3,700	2,112.00	7,814,400	貸付株式数 1,400株 (300株)
アズビル	66,900	3,390.00	226,791,000	貸付株式数 29,500株 (4,400株)

東亜ディーケーケー	5,200	853.00	4,435,600	貸付株式数 1,800株
日本光電工業	43,800	3,580.00	156,804,000	貸付株式数 17,300株
チノー	3,700	1,380.00	5,106,000	貸付株式数 300株
共和電業	11,100	418.00	4,639,800	貸付株式数 4,200株
日本電子材料	4,200	1,477.00	6,203,400	貸付株式数 1,500株
堀場製作所	21,000	5,750.00	120,750,000	貸付株式数 9,400株
アドバンテスト	78,800	6,820.00	537,416,000	貸付株式数 35,300株 (4,500株)
小野測器	4,400	517.00	2,274,800	貸付株式数 1,900株
エスペック	9,400	1,763.00	16,572,200	貸付株式数 2,900株
キーエンス	96,000	44,560.00	4,277,760,000	貸付株式数 42,000株
日置電機	5,500	3,260.00	17,930,000	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
シスメックス	75,700	8,012.00	606,508,400	貸付株式数 33,900株
日本マイクロニクス	18,400	1,228.00	22,595,200	貸付株式数 2,000株
メガチップス	9,900	1,998.00	19,780,200	貸付株式数 2,500株 (2,000株)
OBARA GROUP	6,200	3,375.00	20,925,000	貸付株式数 2,200株 (500株)
IMAGICA GROUP	8,800	383.00	3,370,400	貸付株式数 3,700株
澤藤電機	1,300	1,734.00	2,254,200	貸付株式数 400株
デンソー	233,300	4,168.00	972,394,400	貸付株式数 55,800株
原田工業	5,000	935.00	4,675,000	貸付株式数 2,200株
コーセル	14,100	860.00	12,126,000	貸付株式数 800株
イリソ電子工業	8,900	3,240.00	28,836,000	
オブテックスグループ	17,400	1,217.00	21,175,800	貸付株式数 7,700株
千代田インテグレ	4,900	1,603.00	7,854,700	貸付株式数 2,000株
アイ・オー・データ機器	3,400	1,031.00	3,505,400	

レーザーテック	46,500	11,140.00	518,010,000	貸付株式数 20,800株
スタンレー電気	74,300	2,582.00	191,842,600	貸付株式数 33,400株
岩崎電気	4,100	1,877.00	7,695,700	貸付株式数 1,800株
ウシオ電機	58,500	1,370.00	80,145,000	貸付株式数 25,800株
岡谷電機産業	8,300	306.00	2,539,800	貸付株式数 3,600株
ヘリオス テクノ ホールディング	9,800	317.00	3,106,600	貸付株式数 3,400株
エノモト	3,200	1,052.00	3,366,400	
日本セラミック	10,800	2,234.00	24,127,200	貸付株式数 4,800株 (2,900株)
遠藤照明	5,300	616.00	3,264,800	貸付株式数 800株
古河電池	7,600	1,360.00	10,336,000	貸付株式数 3,400株
双信電機	5,100	416.00	2,121,600	貸付株式数 2,200株
山一電機	7,700	1,368.00	10,533,600	貸付株式数 900株
図研	6,900	3,050.00	21,045,000	貸付株式数 3,000株
日本電子	20,900	3,110.00	64,999,000	貸付株式数 9,300株
カシオ計算機	93,700	1,850.00	173,345,000	貸付株式数 18,600株 (1,000株)
ファナック	99,700	19,320.00	1,926,204,000	貸付株式数 34,900株
日本シイエムケイ	24,900	410.00	10,209,000	貸付株式数 9,900株 (600株)
エンプラス	5,400	2,345.00	12,663,000	貸付株式数 2,100株 (600株)
大真空	3,900	2,316.00	9,032,400	貸付株式数 1,700株
ローム	47,000	7,100.00	333,700,000	貸付株式数 19,300株
浜松ホトニクス	76,000	4,810.00	365,560,000	貸付株式数 34,100株
三井ハイテック	11,700	1,690.00	19,773,000	貸付株式数 4,500株
新光電気工業	35,600	1,626.00	57,885,600	貸付株式数 12,200株
京セラ	149,100	5,755.00	858,070,500	貸付株式数 50,400株

協栄産業	1,200	1,153.00	1,383,600	貸付株式数 400株
太陽誘電	47,100	3,395.00	159,904,500	貸付株式数 21,100株
村田製作所	311,300	6,553.00	2,039,948,900	貸付株式数 139,700株
双葉電子工業	16,800	960.00	16,128,000	
日東電工	73,100	5,850.00	427,635,000	貸付株式数 32,200株 (16,800株)
北陸電気工業	4,300	848.00	3,646,400	貸付株式数 600株
東海理化電機製作所	27,900	1,499.00	41,822,100	貸付株式数 12,500株
ニチコン	35,900	700.00	25,130,000	貸付株式数 600株
日本ケミコン	8,100	1,933.00	15,657,300	貸付株式数 3,600株
K O A	16,000	968.00	15,488,000	貸付株式数 5,600株
三井E & Sホールディングス	38,300	432.00	16,545,600	貸付株式数 15,200株 (6,200株)
日立造船	84,000	375.00	31,500,000	貸付株式数 33,500株 (13,900株)
三菱重工業	177,600	2,571.00	456,609,600	貸付株式数 79,600株 (1,400株)
川崎重工業	82,500	1,559.00	128,617,500	貸付株式数 36,400株
I H I	76,300	1,572.00	119,943,600	貸付株式数 14,600株
名村造船所	34,100	155.00	5,285,500	貸付株式数 15,200株
サノヤスホールディングス	12,900	159.00	2,051,100	貸付株式数 4,200株
スプリックス	2,800	699.00	1,957,200	貸付株式数 1,200株
マネジメントソリューションズ	4,400	1,267.00	5,574,800	貸付株式数 500株
プロレド・パートナーズ	1,400	5,300.00	7,420,000	
and factory	1,000	951.00	951,000	貸付株式数 300株
ギークス	1,000	1,211.00	1,211,000	
カーブスホールディングス	27,800	583.00	16,207,400	貸付株式数 12,400株 (400株)
フォーラムエンジニアリング	5,300	748.00	3,964,400	貸付株式数 1,700株

日本車輛製造	3,900	2,443.00	9,527,700	貸付株式数 1,300株
三菱ロジスネクスト	14,000	913.00	12,782,000	貸付株式数 5,400株 (1,900株)
近畿車輛	1,600	1,225.00	1,960,000	貸付株式数 500株
F P G	32,200	578.00	18,611,600	貸付株式数 10,100株
島根銀行	2,800	559.00	1,565,200	貸付株式数 1,200株
じもとホールディングス	70,600	93.00	6,565,800	貸付株式数 31,700株
全国保証	29,500	4,010.00	118,295,000	貸付株式数 12,900株
めぶきフィナンシャルグループ	543,100	248.00	134,688,800	貸付株式数 243,900株
東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,100	1,117.00	15,749,700	貸付株式数 4,600株
九州フィナンシャルグループ	228,700	448.00	102,457,600	貸付株式数 102,700株 (39,400株)
かんぼ生命保険	37,000	1,425.00	52,725,000	貸付株式数 15,900株
ゆうちょ銀行	296,100	807.00	238,952,700	貸付株式数 131,700株
富山第一銀行	24,900	267.00	6,648,300	貸付株式数 8,100株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	597,000	342.00	204,174,000	貸付株式数 268,100株
ジェイリース	2,900	345.00	1,000,500	貸付株式数 1,000株
西日本フィナンシャルホールディングス	69,500	702.00	48,789,000	貸付株式数 31,100株
マーキュリアインベストメント	4,600	578.00	2,658,800	
イントラスト	3,700	727.00	2,689,900	貸付株式数 1,600株
日本モーゲージサービス	2,100	2,071.00	4,349,100	貸付株式数 700株
C A S A	3,600	1,135.00	4,086,000	貸付株式数 1,500株
アルヒ	16,600	1,567.00	26,012,200	貸付株式数 7,400株
プレミアグループ	5,700	1,964.00	11,194,800	貸付株式数 2,200株
日産自動車	1,249,800	391.20	488,921,760	貸付株式数 561,200株
いすゞ自動車	307,100	949.70	291,652,870	貸付株式数 135,600株 (35,200株)

トヨタ自動車	1,182,400	6,728.00	7,955,187,200	貸付株式数 315,400株
日野自動車	132,300	706.00	93,403,800	貸付株式数 59,400株 (37,500株)
三菱自動車工業	392,300	271.00	106,313,300	貸付株式数 166,900株
エフテック	7,400	484.00	3,581,600	貸付株式数 2,300株
レシップホールディングス	4,100	550.00	2,255,000	貸付株式数 1,500株
G M B	1,900	611.00	1,160,900	貸付株式数 300株
ファルテック	1,900	694.00	1,318,600	
武蔵精密工業	23,600	886.00	20,909,600	貸付株式数 10,300株
日産車体	20,700	899.00	18,609,300	貸付株式数 8,200株 (4,400株)
新明和工業	28,500	1,018.00	29,013,000	貸付株式数 10,100株
極東開発工業	19,700	1,325.00	26,102,500	貸付株式数 7,400株
日信工業	19,100	2,193.00	41,886,300	貸付株式数 8,500株
トピー工業	8,700	1,165.00	10,135,500	貸付株式数 3,100株
ティラド	3,800	1,281.00	4,867,800	貸付株式数 1,200株
曙ブレーキ工業	58,200	172.00	10,010,400	貸付株式数 26,100株
タチエス	17,400	863.00	15,016,200	貸付株式数 7,800株
N O K	57,000	1,315.00	74,955,000	貸付株式数 25,500株
フタバ産業	29,500	441.00	13,009,500	貸付株式数 10,100株
K Y B	11,900	1,977.00	23,526,300	貸付株式数 600株 (600株)
市光工業	15,800	481.00	7,599,800	貸付株式数 1,100株
大同メタル工業	20,300	532.00	10,799,600	貸付株式数 9,100株 (800株)
プレス工業	52,500	284.00	14,910,000	貸付株式数 18,500株
ミクニ	13,400	268.00	3,591,200	貸付株式数 5,100株
太平洋工業	22,200	906.00	20,113,200	貸付株式数 7,800株

ケーヒン	24,300	2,533.00	61,551,900	貸付株式数 10,800株
河西工業	14,300	438.00	6,263,400	貸付株式数 6,300株
アイシン精機	87,300	3,105.00	271,066,500	貸付株式数 39,100株
マツダ	311,800	653.00	203,605,400	貸付株式数 138,100株
今仙電機製作所	9,800	693.00	6,791,400	貸付株式数 2,500株
本田技研工業	834,400	2,726.00	2,274,574,400	貸付株式数 374,600株
スズキ	210,000	3,794.00	796,740,000	貸付株式数 94,200株
S U B A R U	329,000	2,222.00	731,038,000	貸付株式数 125,100株
安永	5,100	1,007.00	5,135,700	貸付株式数 2,200株
ヤマハ発動機	138,200	1,642.00	226,924,400	貸付株式数 61,900株
ショーワ	24,800	2,236.00	55,452,800	貸付株式数 11,100株
小糸製作所	63,500	4,365.00	277,177,500	貸付株式数 28,500株
T B K	12,600	435.00	5,481,000	貸付株式数 5,600株
エクセディ	14,400	1,530.00	22,032,000	貸付株式数 6,400株
ミツバ	19,500	399.00	7,780,500	貸付株式数 6,500株
豊田合成	34,200	2,162.00	73,940,400	貸付株式数 15,300株
愛三工業	16,600	510.00	8,466,000	貸付株式数 7,000株
盟和産業	1,600	920.00	1,472,000	貸付株式数 500株
日本プラスト	8,300	443.00	3,676,900	貸付株式数 1,900株
ヨロズ	9,900	1,026.00	10,157,400	貸付株式数 3,800株
エフ・シー・シー	17,300	1,808.00	31,278,400	貸付株式数 7,700株
新家工業	2,400	1,169.00	2,805,600	貸付株式数 800株
シマノ	39,700	21,520.00	854,344,000	貸付株式数 17,700株
テイ・エス テック	24,600	2,877.00	70,774,200	貸付株式数 11,000株
関西みらいフィナンシャルグループ	61,300	396.00	24,274,800	貸付株式数 24,300株 (2,000株)

三十三フィナンシャルグループ	9,700	1,310.00	12,707,000	貸付株式数 4,400株
第四北越フィナンシャルグループ	18,100	2,070.00	37,467,000	貸付株式数 8,100株 (1,000株)
ジャムコ	5,300	742.00	3,932,600	貸付株式数 2,200株
小野建	9,300	1,195.00	11,113,500	貸付株式数 1,400株
はるやまホールディングス	4,900	729.00	3,572,100	貸付株式数 500株
南陽	2,300	1,568.00	3,606,400	貸付株式数 800株
ノジマ	18,600	2,644.00	49,178,400	貸付株式数 8,300株
佐鳥電機	7,100	798.00	5,665,800	貸付株式数 3,100株
カップ・クリエイト	14,600	1,383.00	20,191,800	貸付株式数 6,500株
エコートレーディング	2,400	551.00	1,322,400	貸付株式数 400株
伯東	6,400	951.00	6,086,400	貸付株式数 2,200株
コンドーテック	8,100	1,149.00	9,306,900	貸付株式数 2,800株
中山福	6,000	454.00	2,724,000	貸付株式数 2,600株
ライトオン	7,800	619.00	4,828,200	貸付株式数 2,900株
ナガイレーベン	13,800	2,641.00	36,445,800	貸付株式数 3,100株
ジーンズメイト	3,200	226.00	723,200	貸付株式数 1,400株
三菱食品	11,500	2,675.00	30,762,500	貸付株式数 5,000株
良品計画	138,600	1,438.00	199,306,800	貸付株式数 11,800株
三城ホールディングス	11,100	292.00	3,241,200	貸付株式数 3,800株
松田産業	7,600	1,361.00	10,343,600	貸付株式数 2,700株
第一興商	15,500	3,140.00	48,670,000	貸付株式数 6,900株
メディパルホールディングス	112,600	1,980.00	222,948,000	貸付株式数 50,500株
アドヴァン	15,900	1,302.00	20,701,800	貸付株式数 7,100株 (600株)
S P K	4,500	1,300.00	5,850,000	貸付株式数 1,400株

萩原電気ホールディングス	3,900	2,034.00	7,932,600	貸付株式数 800株
アルピス	4,000	2,230.00	8,920,000	貸付株式数 1,400株
アズワン	6,800	11,380.00	77,384,000	貸付株式数 2,500株
スズデン	3,600	1,216.00	4,377,600	貸付株式数 1,200株
尾家産業	3,000	1,310.00	3,930,000	貸付株式数 1,000株
シモジマ	6,400	1,185.00	7,584,000	貸付株式数 2,800株
ドウシシャ	9,800	1,625.00	15,925,000	貸付株式数 3,400株
小津産業	2,300	1,739.00	3,999,700	貸付株式数 800株
コナカ	12,300	303.00	3,726,900	貸付株式数 1,000株
高速	6,200	1,423.00	8,822,600	貸付株式数 2,700株
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,601.00	2,081,300	
G - 7ホールディングス	6,100	2,417.00	14,743,700	貸付株式数 1,800株
たけびし	3,700	1,437.00	5,316,900	貸付株式数 1,200株
イオン北海道	13,800	821.00	11,329,800	貸付株式数 6,100株 (200株)
コジマ	17,900	545.00	9,755,500	貸付株式数 8,000株
ヒマラヤ	3,600	824.00	2,966,400	貸付株式数 1,100株 (600株)
コーナン商事	14,800	3,465.00	51,282,000	貸付株式数 6,600株
ネットワンシステムズ	39,600	3,575.00	141,570,000	貸付株式数 17,800株
エコス	3,800	2,067.00	7,854,600	貸付株式数 1,200株
ワタミ	12,300	888.00	10,922,400	貸付株式数 5,500株
マルシェ	2,700	506.00	1,366,200	貸付株式数 1,200株
リックス	2,300	1,622.00	3,730,600	貸付株式数 800株
システムソフト	22,400	97.00	2,172,800	
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	229,400	2,422.00	555,606,800	貸付株式数 97,100株
丸文	9,200	553.00	5,087,600	貸付株式数 4,100株

西松屋チェーン	22,900	1,079.00	24,709,100	貸付株式数 10,200株 (500株)
ゼンショーホールディングス	50,000	2,144.00	107,200,000	貸付株式数 22,400株
ハピネット	8,700	1,106.00	9,622,200	貸付株式数 3,000株
幸楽苑ホールディングス	6,600	1,512.00	9,979,200	貸付株式数 2,800株
ハークスレイ	2,200	1,012.00	2,226,400	貸付株式数 500株
橋本総業ホールディングス	2,100	2,044.00	4,292,400	貸付株式数 500株
日本ライフライン	30,900	1,315.00	40,633,500	貸付株式数 10,200株
サイゼリヤ	15,500	1,975.00	30,612,500	貸付株式数 6,300株
タカショー	6,800	489.00	3,325,200	貸付株式数 3,000株
V Tホールディングス	43,200	357.00	15,422,400	貸付株式数 19,300株
マルカ	3,700	1,831.00	6,774,700	貸付株式数 1,600株
アルゴグラフィックス	8,800	3,300.00	29,040,000	貸付株式数 3,900株
魚力	2,900	1,604.00	4,651,600	貸付株式数 500株
I D O M	28,100	499.00	14,021,900	貸付株式数 800株
日本エム・ディ・エム	6,100	1,570.00	9,577,000	貸付株式数 2,400株 (2,200株)
ポブラ	2,700	401.00	1,082,700	貸付株式数 1,200株
フジ・コーポレーション	2,800	1,982.00	5,549,600	貸付株式数 900株
ユナイテッドアローズ	10,900	1,615.00	17,603,500	貸付株式数 3,200株
進和	6,200	1,948.00	12,077,600	貸付株式数 2,600株
エスケイジャパン	2,200	289.00	635,800	貸付株式数 1,000株
ダイترون	4,400	1,527.00	6,718,800	
ハイデイ日高	15,100	1,556.00	23,495,600	貸付株式数 5,800株
シークス	13,300	956.00	12,714,800	貸付株式数 5,000株
京都きもの友禅	6,600	256.00	1,689,600	
コロワイド	34,700	1,406.00	48,788,200	貸付株式数 15,500株

ピーシーデポコーポレーション	13,900	697.00	9,688,300	貸付株式数 6,200株
田中商事	3,200	696.00	2,227,200	貸付株式数 400株
オーハシテクニカ	5,300	1,564.00	8,289,200	貸付株式数 2,300株
壱番屋	7,400	4,795.00	35,483,000	貸付株式数 400株
白銅	3,700	1,384.00	5,120,800	貸付株式数 1,200株
トップカルチャー	3,800	351.00	1,333,800	
P L A N T	2,700	640.00	1,728,000	貸付株式数 400株
スギホールディングス	20,800	7,390.00	153,712,000	貸付株式数 9,300株
ダイコー通産	700	1,353.00	947,100	
薬王堂ホールディングス	4,500	2,727.00	12,271,500	貸付株式数 100株
島津製作所	126,600	2,898.00	366,886,800	貸付株式数 56,800株
J M S	9,000	786.00	7,074,000	貸付株式数 3,400株
クボテック	2,700	365.00	985,500	貸付株式数 1,200株
長野計器	7,700	1,032.00	7,946,400	
ブイ・テクノロジー	5,000	3,870.00	19,350,000	貸付株式数 1,800株 (400株)
スター精密	16,300	1,260.00	20,538,000	貸付株式数 7,300株
東京計器	6,700	941.00	6,304,700	貸付株式数 3,000株
愛知時計電機	1,400	4,515.00	6,321,000	貸付株式数 600株
インターアクション	5,700	1,927.00	10,983,900	貸付株式数 2,500株
オーバル	9,500	219.00	2,080,500	貸付株式数 3,600株
東京精密	19,200	3,465.00	66,528,000	貸付株式数 8,600株
マニー	42,200	2,922.00	123,308,400	貸付株式数 18,900株 (500株)
ニコン	161,800	870.00	140,766,000	貸付株式数 72,700株 (25,800株)
トプコン	53,400	825.00	44,055,000	貸付株式数 22,300株
オリンパス	586,400	1,990.50	1,167,229,200	貸付株式数 238,300株 (24,900株)

理研計器	9,300	2,361.00	21,957,300	貸付株式数 4,100株
S C R E E Nホールディングス	18,400	5,290.00	97,336,000	貸付株式数 4,900株 (2,700株)
キヤノン電子	11,100	1,583.00	17,571,300	貸付株式数 4,900株
タムロン	8,500	1,760.00	14,960,000	貸付株式数 3,200株
H O Y A	210,200	10,730.00	2,255,446,000	貸付株式数 63,200株
シード	4,500	724.00	3,258,000	貸付株式数 2,000株
ノーリツ鋼機	7,100	1,614.00	11,459,400	貸付株式数 3,100株
エー・アンド・デイ	9,700	676.00	6,557,200	貸付株式数 3,400株
朝日インテック	120,000	3,045.00	365,400,000	貸付株式数 53,800株
キヤノン	570,500	2,085.00	1,189,492,500	貸付株式数 254,100株
リコー	269,600	780.00	210,288,000	貸付株式数 60,800株
シチズン時計	124,100	339.00	42,069,900	貸付株式数 49,200株 (5,700株)
リズム時計工業	3,300	600.00	1,980,000	貸付株式数 1,100株
大研医器	7,300	570.00	4,161,000	貸付株式数 2,600株
メニコン	15,000	5,350.00	80,250,000	貸付株式数 6,700株
シンシア	1,100	392.00	431,200	貸付株式数 400株 (400株)
中本パックス	2,700	1,518.00	4,098,600	
スノーピーク	5,600	1,260.00	7,056,000	
パラマウントベッドホールディングス	11,200	4,360.00	48,832,000	貸付株式数 5,000株
トランザクション	5,800	1,079.00	6,258,200	貸付株式数 2,600株
粧美堂	3,100	346.00	1,072,600	貸付株式数 1,300株
ニホンフラッシュ	9,900	1,340.00	13,266,000	貸付株式数 4,400株
前田工織	11,700	2,523.00	29,519,100	貸付株式数 4,500株
永大産業	13,900	299.00	4,156,100	貸付株式数 400株
アートネイチャー	11,300	599.00	6,768,700	貸付株式数 5,100株

パンダイナムコホールディングス	109,600	5,777.00	633,159,200	貸付株式数 49,200株
アイフィスジャパン	2,700	728.00	1,965,600	貸付株式数 1,000株
共立印刷	17,700	135.00	2,389,500	貸付株式数 1,000株
SHOEI	9,300	2,818.00	26,207,400	貸付株式数 2,000株
フランスベッドホールディングス	15,000	822.00	12,330,000	貸付株式数 5,500株
マーベラス	15,900	700.00	11,130,000	貸付株式数 7,100株
パイロットコーポレーション	17,300	3,330.00	57,609,000	貸付株式数 5,000株
萩原工業	5,900	1,455.00	8,584,500	貸付株式数 2,100株
エイベックス	17,900	872.00	15,608,800	貸付株式数 8,000株
トッパン・フォームズ	22,700	1,043.00	23,676,100	貸付株式数 10,200株
フジシールインターナショナル	23,800	1,990.00	47,362,000	貸付株式数 10,600株 (2,700株)
タカラトミー	47,500	863.00	40,992,500	貸付株式数 21,300株
廣済堂	7,400	771.00	5,705,400	貸付株式数 2,900株
エステールホールディングス	2,800	618.00	1,730,400	貸付株式数 1,000株
アーク	40,400	116.00	4,686,400	
レック	11,300	1,485.00	16,780,500	貸付株式数 4,300株 (4,000株)
タカノ	4,100	685.00	2,808,500	貸付株式数 600株
三光合成	12,100	261.00	3,158,100	貸付株式数 5,100株
プロネクサス	9,100	1,200.00	10,920,000	貸付株式数 3,100株
ホクシン	6,500	120.00	780,000	貸付株式数 300株
ウッドワン	3,600	1,151.00	4,143,600	貸付株式数 1,000株
大建工業	7,100	1,766.00	12,538,600	貸付株式数 2,500株
きもと	18,000	166.00	2,988,000	貸付株式数 8,000株
凸版印刷	149,600	1,710.00	255,816,000	貸付株式数 67,100株 (31,600株)

大日本印刷	138,700	2,421.00	335,792,700	貸付株式数 55,700株 (55,300株)
共同印刷	3,300	2,750.00	9,075,000	貸付株式数 500株
N I S S H A	21,800	986.00	21,494,800	
光村印刷	900	1,509.00	1,358,100	貸付株式数 300株
藤森工業	9,500	3,560.00	33,820,000	貸付株式数 3,300株
ヴィア・ホールディングス	12,800	349.00	4,467,200	
TAKARA & COMPANY	5,100	2,095.00	10,684,500	貸付株式数 2,300株
前澤化成工業	6,700	983.00	6,586,100	貸付株式数 3,000株
未来工業	5,700	1,901.00	10,835,700	貸付株式数 1,800株
アシックス	87,500	1,238.00	108,325,000	貸付株式数 37,000株
ツツミ	3,300	1,831.00	6,042,300	貸付株式数 1,000株
ウェーブロックホールディングス	3,700	919.00	3,400,300	貸付株式数 1,300株
J S P	6,200	1,409.00	8,735,800	貸付株式数 500株
ニチハ	14,700	2,239.00	32,913,300	貸付株式数 6,000株 (900株)
エフピコ	11,700	8,610.00	100,737,000	貸付株式数 4,200株 (1,000株)
小松ウオール工業	3,200	1,744.00	5,580,800	貸付株式数 1,000株
ヤマハ	63,000	4,820.00	303,660,000	貸付株式数 28,300株
河合楽器製作所	3,300	2,699.00	8,906,700	貸付株式数 1,100株
クリナップ	9,900	566.00	5,603,400	貸付株式数 3,500株
ピジョン	64,000	4,425.00	283,200,000	貸付株式数 29,100株
天馬	7,100	1,609.00	11,423,900	貸付株式数 2,500株
オリバー	2,200	2,573.00	5,660,600	貸付株式数 800株
兼松サステック	700	1,473.00	1,031,100	
キングジム	8,800	822.00	7,233,600	
象印マホービン	31,100	1,335.00	41,518,500	貸付株式数 13,900株

リンテック	25,200	2,550.00	64,260,000	貸付株式数 11,300株 (8,200株)
信越ポリマー	19,000	871.00	16,549,000	貸付株式数 8,500株
東リ	26,400	262.00	6,916,800	貸付株式数 10,000株
イトーキ	22,500	339.00	7,627,500	貸付株式数 600株
任天堂	65,000	49,630.00	3,225,950,000	貸付株式数 8,300株
三菱鉛筆	17,400	1,256.00	21,854,400	貸付株式数 7,800株
松風	4,800	1,452.00	6,969,600	貸付株式数 1,600株
タカラスタンダード	21,900	1,505.00	32,959,500	貸付株式数 9,700株 (900株)
コクヨ	50,800	1,260.00	64,008,000	貸付株式数 22,700株
ナカバヤシ	10,400	577.00	6,000,800	貸付株式数 2,000株
ニフコ	38,900	2,270.00	88,303,000	貸付株式数 17,400株
立川ブラインド工業	4,600	1,261.00	5,800,600	貸付株式数 1,600株
グロープライド	4,700	2,085.00	9,799,500	貸付株式数 1,800株 (300株)
オカムラ	37,000	750.00	27,750,000	貸付株式数 16,600株
バルカー	8,600	1,862.00	16,013,200	貸付株式数 1,800株
MUTOHホールディングス	1,300	1,522.00	1,978,600	貸付株式数 100株
伊藤忠商事	730,000	2,307.50	1,684,475,000	貸付株式数 213,200株
丸紅	1,086,400	482.90	524,622,560	貸付株式数 487,900株
スクロール	16,000	438.00	7,008,000	貸付株式数 7,100株
高島	1,700	1,788.00	3,039,600	
ヨンドシーホールディングス	10,600	1,667.00	17,670,200	
三陽商会	5,400	568.00	3,067,200	貸付株式数 1,800株
長瀬産業	58,700	1,300.00	76,310,000	貸付株式数 26,300株
ナイガイ	3,800	354.00	1,345,200	貸付株式数 1,600株
蝶理	6,700	1,716.00	11,497,200	貸付株式数 2,300株

豊田通商	116,500	2,696.00	314,084,000	貸付株式数 52,300株 (13,100株)
オンワードホールディングス	62,300	285.00	17,755,500	貸付株式数 27,900株
三共生興	15,800	431.00	6,809,800	貸付株式数 7,000株
兼松	38,900	1,256.00	48,858,400	貸付株式数 15,400株
美津濃	9,600	2,016.00	19,353,600	貸付株式数 2,400株
ツカモトコーポレーション	1,900	1,125.00	2,137,500	
ファミリーマート	83,400	1,754.00	146,283,600	貸付株式数 25,400株
ルックホールディングス	3,500	708.00	2,478,000	貸付株式数 1,300株
三井物産	903,700	1,574.00	1,422,423,800	貸付株式数 147,600株
日本紙パルプ商事	5,900	3,755.00	22,154,500	貸付株式数 1,800株
東京エレクトロン	67,200	29,810.00	2,003,232,000	貸付株式数 22,700株
カメイ	13,600	1,000.00	13,600,000	貸付株式数 4,500株
東都水産	1,300	3,325.00	4,322,500	
OUGホールディングス	1,600	2,606.00	4,169,600	貸付株式数 500株
スターゼン	3,900	4,025.00	15,697,500	貸付株式数 1,400株
セイコーホールディングス	15,000	1,618.00	24,270,000	貸付株式数 6,700株
山善	40,800	900.00	36,720,000	貸付株式数 16,200株
椿本興業	1,900	3,320.00	6,308,000	貸付株式数 600株
住友商事	658,500	1,233.50	812,259,750	貸付株式数 295,600株
日本ユニシス	32,500	3,320.00	107,900,000	貸付株式数 14,500株
内田洋行	4,100	6,310.00	25,871,000	貸付株式数 1,700株
三菱商事	684,300	2,276.50	1,557,808,950	貸付株式数 263,000株
第一実業	5,100	3,660.00	18,666,000	貸付株式数 1,800株
キヤノンマーケティングジャパン	25,900	2,153.00	55,762,700	貸付株式数 11,600株
西華産業	5,900	1,221.00	7,203,900	貸付株式数 1,000株
佐藤商事	8,600	859.00	7,387,400	貸付株式数 1,000株

菱洋エレクトロ	10,600	3,190.00	33,814,000	貸付株式数 500株
東京産業	9,400	513.00	4,822,200	貸付株式数 3,900株
ユアサ商事	9,900	2,904.00	28,749,600	貸付株式数 4,400株
神鋼商事	2,600	1,841.00	4,786,600	貸付株式数 900株
トルク	6,200	287.00	1,779,400	貸付株式数 2,700株
阪和興業	19,500	1,966.00	38,337,000	貸付株式数 100株
正栄食品工業	6,800	4,015.00	27,302,000	
カナデン	8,500	1,237.00	10,514,500	貸付株式数 3,400株
菱電商事	7,500	1,422.00	10,665,000	貸付株式数 2,600株
ニプロ	73,300	1,155.00	84,661,500	貸付株式数 32,900株
フルサト工業	5,800	1,355.00	7,859,000	貸付株式数 2,000株
岩谷産業	23,200	3,755.00	87,116,000	貸付株式数 10,400株
ナイス	4,400	860.00	3,784,000	貸付株式数 800株
昭光通商	3,300	601.00	1,983,300	貸付株式数 1,300株
ニチモウ	1,600	1,896.00	3,033,600	貸付株式数 600株
極東貿易	3,000	1,287.00	3,861,000	
イワキ	13,700	510.00	6,987,000	貸付株式数 4,700株
兼松エレクトロニクス	5,700	4,015.00	22,885,500	貸付株式数 1,600株
三愛石油	25,700	928.00	23,849,600	貸付株式数 11,500株
稲畑産業	23,000	1,314.00	30,222,000	貸付株式数 9,400株
G S Iクレオス	2,600	1,192.00	3,099,200	貸付株式数 1,100株 (300株)
明和産業	9,600	455.00	4,368,000	貸付株式数 4,100株
クワザワ	3,700	527.00	1,949,900	貸付株式数 200株
キムラタン	54,900	27.00	1,482,300	
ヤマエ久野	7,600	1,248.00	9,484,800	貸付株式数 3,300株
ゴールドウイン	18,800	6,700.00	125,960,000	貸付株式数 8,400株

ユニ・チャーム	204,300	4,794.00	979,414,200	貸付株式数 67,500株
デサント	20,200	1,524.00	30,784,800	貸付株式数 9,100株
キング	4,900	453.00	2,219,700	貸付株式数 1,700株
ワキタ	22,300	927.00	20,672,100	貸付株式数 5,900株
ヤマトインターナショナル	9,100	381.00	3,467,100	
東邦ホールディングス	33,500	1,875.00	62,812,500	貸付株式数 15,000株
サンゲツ	28,400	1,481.00	42,060,400	貸付株式数 12,700株
ミツウロコグループホールディングス	15,400	1,139.00	17,540,600	貸付株式数 6,900株
シナネンホールディングス	4,300	2,638.00	11,343,400	貸付株式数 1,800株
伊藤忠エネクス	23,100	849.00	19,611,900	貸付株式数 6,100株
サンリオ	29,300	1,654.00	48,462,200	貸付株式数 13,100株
サンワテクノス	7,400	872.00	6,452,800	
リョーサン	11,500	2,192.00	25,208,000	貸付株式数 3,300株
新光商事	16,400	832.00	13,644,800	貸付株式数 5,300株
トーヨー	4,700	1,859.00	8,737,300	貸付株式数 1,700株
三信電気	5,600	1,606.00	8,993,600	貸付株式数 2,500株
東陽テクニカ	11,200	973.00	10,897,600	貸付株式数 3,500株
モスフードサービス	13,700	2,845.00	38,976,500	貸付株式数 1,300株
加賀電子	10,400	1,983.00	20,623,200	貸付株式数 3,900株
三益半導体工業	8,200	2,377.00	19,491,400	貸付株式数 2,400株
ソーダニッカ	10,800	512.00	5,529,600	貸付株式数 1,700株
立花エレテック	7,700	1,740.00	13,398,000	貸付株式数 2,800株
木曽路	13,600	2,351.00	31,973,600	貸付株式数 5,800株
S R Sホールディングス	12,300	878.00	10,799,400	貸付株式数 5,500株
千趣会	18,800	347.00	6,523,600	貸付株式数 8,400株
タカキュー	8,100	131.00	1,061,100	貸付株式数 1,100株

リテールパートナーズ	13,800	1,855.00	25,599,000	貸付株式数 6,100株
ケーヨー	21,400	749.00	16,028,600	貸付株式数 8,100株
上新電機	12,300	2,083.00	25,620,900	貸付株式数 4,400株
日本瓦斯	16,500	4,605.00	75,982,500	貸付株式数 7,400株
ロイヤルホールディングス	18,200	1,762.00	32,068,400	貸付株式数 8,100株
東天紅	800	973.00	778,400	
いなげや	12,900	1,711.00	22,071,900	貸付株式数 3,700株
島忠	19,600	2,994.00	58,682,400	貸付株式数 8,800株
チヨダ	11,000	1,131.00	12,441,000	貸付株式数 3,800株
ライフコーポレーション	7,900	3,725.00	29,427,500	貸付株式数 2,700株
リンガーハット	12,900	2,252.00	29,050,800	貸付株式数 5,700株 (1,000株)
MrMaxHD	14,300	645.00	9,223,500	貸付株式数 5,100株
テンアライド	9,600	370.00	3,552,000	貸付株式数 4,200株
AOKIホールディングス	20,900	596.00	12,456,400	貸付株式数 9,300株 (700株)
オークワ	16,400	1,512.00	24,796,800	貸付株式数 400株
コメリ	16,100	2,736.00	44,049,600	貸付株式数 7,200株
青山商事	21,600	662.00	14,299,200	
しまむら	12,100	7,190.00	86,999,000	貸付株式数 5,200株
はせがわ	5,500	316.00	1,738,000	貸付株式数 1,800株
高島屋	76,000	822.00	62,472,000	貸付株式数 34,100株 (8,700株)
松屋	21,000	670.00	14,070,000	貸付株式数 9,400株
エイチ・ツー・オー リテイリング	49,400	703.00	34,728,200	貸付株式数 12,800株
近鉄百貨店	4,000	2,999.00	11,996,000	貸付株式数 1,500株
丸井グループ	95,700	1,802.00	172,451,400	貸付株式数 34,000株 (2,200株)

クレディセゾン	73,200	1,139.00	83,374,800	貸付株式数 31,100株 (19,600株)
アクシアル リテイリング	8,700	4,440.00	38,628,000	貸付株式数 3,000株 (700株)
井筒屋	5,700	175.00	997,500	
イオン	401,600	2,533.50	1,017,453,600	貸付株式数 180,300株
イズミ	21,200	3,345.00	70,914,000	貸付株式数 8,600株
フォーバル	4,600	990.00	4,554,000	貸付株式数 1,800株
平和堂	21,200	1,877.00	39,792,400	貸付株式数 9,000株
フジ	12,600	1,807.00	22,768,200	貸付株式数 5,600株
ヤオコー	11,800	7,850.00	92,630,000	貸付株式数 3,700株
ゼビオホールディングス	12,600	809.00	10,193,400	貸付株式数 5,100株 (3,000株)
ケーズホールディングス	100,700	1,391.00	140,073,700	貸付株式数 19,400株
PALTA C	16,700	4,830.00	80,661,000	貸付株式数 7,200株 (1,100株)
三谷産業	13,700	340.00	4,658,000	貸付株式数 5,200株
Olympicグループ	5,400	883.00	4,768,200	貸付株式数 2,000株
日産東京販売ホールディングス	15,300	253.00	3,870,900	
新生銀行	76,700	1,281.00	98,252,700	貸付株式数 31,800株
あおぞら銀行	62,300	1,865.00	116,189,500	貸付株式数 27,900株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,149,800	420.20	3,004,345,960	貸付株式数 2,547,200株
りそなホールディングス	1,147,000	368.60	422,784,200	貸付株式数 355,400株
三井住友トラスト・ホールディングス	197,600	2,976.00	588,057,600	貸付株式数 80,700株
三井住友フィナンシャルグループ	722,900	3,036.00	2,194,724,400	貸付株式数 29,700株
千葉銀行	348,800	506.00	176,492,800	貸付株式数 156,600株 (107,900株)
群馬銀行	200,800	328.00	65,862,400	貸付株式数 90,100株
武蔵野銀行	15,600	1,510.00	23,556,000	貸付株式数 5,900株

千葉興業銀行	28,700	225.00	6,457,500	貸付株式数 12,800株 (4,000株)
筑波銀行	43,500	171.00	7,438,500	貸付株式数 19,500株
七十七銀行	35,300	1,519.00	53,620,700	貸付株式数 15,800株 (10,000株)
青森銀行	8,100	2,190.00	17,739,000	貸付株式数 3,600株 (500株)
秋田銀行	6,700	1,459.00	9,775,300	貸付株式数 2,300株
山形銀行	11,700	1,240.00	14,508,000	貸付株式数 5,200株
岩手銀行	6,800	2,509.00	17,061,200	貸付株式数 2,700株 (700株)
東邦銀行	93,500	223.00	20,850,500	貸付株式数 41,900株 (8,800株)
東北銀行	5,000	963.00	4,815,000	貸付株式数 1,700株
みちのく銀行	6,700	1,082.00	7,249,400	貸付株式数 2,600株 (2,000株)
ふくおかフィナンシャルグループ	88,000	1,667.00	146,696,000	貸付株式数 39,500株
静岡銀行	254,500	689.00	175,350,500	貸付株式数 108,600株
十六銀行	13,100	1,945.00	25,479,500	貸付株式数 5,900株
スルガ銀行	106,900	370.00	39,553,000	貸付株式数 48,000株
八十二銀行	252,200	401.00	101,132,200	貸付株式数 113,200株
山梨中央銀行	12,100	852.00	10,309,200	貸付株式数 4,200株
大垣共立銀行	20,600	2,200.00	45,320,000	貸付株式数 9,200株
福井銀行	8,900	1,617.00	14,391,300	貸付株式数 500株
北國銀行	10,400	2,918.00	30,347,200	貸付株式数 4,700株
清水銀行	4,300	1,651.00	7,099,300	貸付株式数 1,500株 (1,500株)
富山銀行	2,000	2,282.00	4,564,000	貸付株式数 800株
滋賀銀行	21,000	2,454.00	51,534,000	貸付株式数 9,400株

南都銀行	17,400	2,015.00	35,061,000	貸付株式数 7,600株
百五銀行	94,100	318.00	29,923,800	貸付株式数 42,200株 (8,400株)
京都銀行	37,400	3,830.00	143,242,000	貸付株式数 16,800株
紀陽銀行	37,000	1,591.00	58,867,000	貸付株式数 16,600株 (3,900株)
ほくほくフィナンシャルグループ	69,600	887.00	61,735,200	貸付株式数 31,200株
広島銀行	154,300	496.00	76,532,800	貸付株式数 69,300株
山陰合同銀行	62,000	516.00	31,992,000	貸付株式数 23,100株
中国銀行	89,900	977.00	87,832,300	貸付株式数 40,300株
鳥取銀行	3,600	1,155.00	4,158,000	貸付株式数 1,600株
伊予銀行	149,100	659.00	98,256,900	貸付株式数 66,900株 (2,800株)
百十四銀行	11,100	1,855.00	20,590,500	貸付株式数 5,000株
四国銀行	15,900	775.00	12,322,500	貸付株式数 1,900株 (1,900株)
阿波銀行	17,100	2,361.00	40,373,100	貸付株式数 7,600株 (3,000株)
大分銀行	6,000	2,365.00	14,190,000	貸付株式数 2,300株
宮崎銀行	7,000	2,294.00	16,058,000	貸付株式数 2,400株
佐賀銀行	6,300	1,169.00	7,364,700	貸付株式数 2,100株
沖縄銀行	9,600	3,015.00	28,944,000	貸付株式数 4,300株 (1,900株)
琉球銀行	24,100	943.00	22,726,300	貸付株式数 9,300株 (200株)
セブン銀行	349,200	294.00	102,664,800	貸付株式数 127,100株 (1,000株)
みずほフィナンシャルグループ	14,202,600	132.10	1,876,163,460	貸付株式数 1,271,800株
高知銀行	3,800	625.00	2,375,000	貸付株式数 1,300株

山口フィナンシャルグループ	130,500	639.00	83,389,500	貸付株式数 58,500株
芙蓉総合リース	11,000	5,820.00	64,020,000	貸付株式数 4,800株 (300株)
みずほリース	16,100	2,356.00	37,931,600	貸付株式数 7,000株
東京センチュリー	21,000	5,500.00	115,500,000	貸付株式数 9,400株 (600株)
SBIホールディングス	116,700	2,290.00	267,243,000	貸付株式数 52,400株
日本証券金融	46,100	504.00	23,234,400	貸付株式数 20,600株 (6,000株)
アイフル	159,400	230.00	36,662,000	貸付株式数 68,200株
日本アジア投資	8,800	229.00	2,015,200	
長野銀行	3,400	1,117.00	3,797,800	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
名古屋銀行	7,800	2,333.00	18,197,400	貸付株式数 500株
北洋銀行	157,600	210.00	33,096,000	貸付株式数 66,900株
愛知銀行	3,800	2,755.00	10,469,000	貸付株式数 1,100株
中京銀行	4,300	2,030.00	8,729,000	貸付株式数 1,700株
大光銀行	3,600	1,426.00	5,133,600	貸付株式数 1,300株
愛媛銀行	14,600	1,164.00	16,994,400	貸付株式数 3,900株 (3,500株)
トマト銀行	4,000	990.00	3,960,000	貸付株式数 1,000株
京葉銀行	44,600	505.00	22,523,000	貸付株式数 20,000株 (1,400株)
栃木銀行	50,500	159.00	8,029,500	貸付株式数 22,600株
北日本銀行	3,300	1,800.00	5,940,000	貸付株式数 900株 (400株)
東和銀行	18,300	669.00	12,242,700	貸付株式数 8,200株 (1,300株)
福島銀行	9,800	163.00	1,597,400	
大東銀行	5,400	619.00	3,342,600	貸付株式数 2,400株 (300株)

リコーリース	8,200	2,983.00	24,460,600	貸付株式数 500株
イオンフィナンシャルサービス	64,000	1,128.00	72,192,000	貸付株式数 4,000株
アコム	210,100	401.00	84,250,100	貸付株式数 82,100株
ジャックス	11,500	1,703.00	19,584,500	貸付株式数 4,400株
オリエントコーポレーション	282,700	112.00	31,662,400	貸付株式数 126,800株 (45,600株)
日立キャピタル	24,600	2,369.00	58,277,400	貸付株式数 11,000株
アプラスフィナンシャル	50,100	66.00	3,306,600	貸付株式数 22,400株 (600株)
オリックス	648,500	1,307.00	847,589,500	貸付株式数 243,500株
三菱UFJリース	265,300	495.00	131,323,500	貸付株式数 63,600株
ジャフコ	16,100	3,660.00	58,926,000	貸付株式数 7,100株 (400株)
九州リースサービス	5,100	540.00	2,754,000	貸付株式数 2,100株
トモニホールディングス	80,800	335.00	27,068,000	貸付株式数 36,200株
大和証券グループ本社	838,700	473.00	396,705,100	貸付株式数 372,200株
野村ホールディングス	1,839,100	497.30	914,584,430	貸付株式数 825,800株
岡三証券グループ	89,100	327.00	29,135,700	貸付株式数 39,900株
丸三証券	31,000	411.00	12,741,000	貸付株式数 12,300株
東洋証券	37,400	115.00	4,301,000	貸付株式数 400株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	120,000	234.00	28,080,000	貸付株式数 53,800株
光世証券	2,500	522.00	1,305,000	貸付株式数 900株
水戸証券	30,200	192.00	5,798,400	貸付株式数 13,500株 (11,300株)
いちよし証券	19,500	442.00	8,619,000	貸付株式数 6,700株
松井証券	59,700	838.00	50,028,600	貸付株式数 26,800株 (1,700株)
SOMPOホールディングス	196,500	3,683.00	723,709,500	貸付株式数 41,700株

日本取引所グループ	300,000	2,567.00	770,100,000	貸付株式数 134,700株
マネックスグループ	76,700	222.00	17,027,400	貸付株式数 32,400株
極東証券	14,000	505.00	7,070,000	貸付株式数 6,000株
岩井コスモホールディングス	9,900	1,098.00	10,870,200	
藍澤證券	18,800	694.00	13,047,200	貸付株式数 7,100株
フィデアホールディングス	101,500	99.00	10,048,500	貸付株式数 45,500株
池田泉州ホールディングス	120,200	158.00	18,991,600	貸付株式数 53,900株
アニコムホールディングス	8,600	4,530.00	38,958,000	貸付株式数 1,000株 (400株)
MS & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	273,300	2,930.50	800,905,650	貸付株式数 93,100株
ソニーフィナンシャルホールディング ス	85,800	2,596.00	222,736,800	貸付株式数 31,100株 (12,600株)
マネーパートナーズグループ	11,100	215.00	2,386,500	
スパークス・グループ	48,300	214.00	10,336,200	貸付株式数 11,100株
小林洋行	3,000	254.00	762,000	
第一生命ホールディングス	591,500	1,334.50	789,356,750	貸付株式数 221,100株
東京海上ホールディングス	369,500	4,656.00	1,720,392,000	貸付株式数 126,500株
アドバンテッジリスクマネジメント	5,100	807.00	4,115,700	貸付株式数 1,000株
イー・ギャランティ	11,200	2,626.00	29,411,200	貸付株式数 4,000株
アサックス	5,400	679.00	3,666,600	
NECキャピタルソリューション	4,300	1,917.00	8,243,100	貸付株式数 1,300株
T & Dホールディングス	312,400	940.00	293,656,000	貸付株式数 94,900株
アドバンスクリエイト	2,200	2,084.00	4,584,800	貸付株式数 800株
三井不動産	515,500	1,857.00	957,283,500	貸付株式数 231,400株
三菱地所	732,300	1,576.50	1,154,470,950	貸付株式数 152,900株
平和不動産	19,200	2,941.00	56,467,200	貸付株式数 7,900株
東京建物	110,100	1,203.00	132,450,300	貸付株式数 49,400株
ダイビル	26,900	1,015.00	27,303,500	貸付株式数 12,000株

京阪神ビルディング	16,700	1,354.00	22,611,800	貸付株式数 5,600株
住友不動産	235,000	2,781.00	653,535,000	貸付株式数 96,600株
太平洋興発	4,100	620.00	2,542,000	貸付株式数 1,000株
テーオーシー	20,500	662.00	13,571,000	貸付株式数 7,600株 (4,600株)
東京楽天地	1,700	4,125.00	7,012,500	貸付株式数 500株
レオパレス21	137,000	186.00	25,482,000	貸付株式数 61,400株
スターツコーポレーション	14,200	2,163.00	30,714,600	貸付株式数 6,300株
フジ住宅	12,100	522.00	6,316,200	貸付株式数 800株
空港施設	10,500	411.00	4,315,500	貸付株式数 2,700株
明和地所	5,700	394.00	2,245,800	貸付株式数 1,000株
ゴールドクレスト	8,200	1,400.00	11,480,000	貸付株式数 3,500株
リログループ	55,400	1,999.00	110,744,600	貸付株式数 17,800株
エスリード	4,100	1,345.00	5,514,500	
日神グループホールディングス	15,400	361.00	5,559,400	貸付株式数 5,900株
日本エスコン	18,900	802.00	15,157,800	貸付株式数 8,400株
タカラレーベン	47,800	355.00	16,969,000	貸付株式数 13,300株 (4,700株)
A V A N T I A	5,900	884.00	5,215,600	貸付株式数 2,600株
イオンモール	52,400	1,333.00	69,849,200	貸付株式数 23,500株
毎日コムネット	2,700	809.00	2,184,300	
ファースト住建	4,400	938.00	4,127,200	貸付株式数 1,500株
ランド	568,900	10.00	5,689,000	貸付株式数 103,400株
カチタス	25,900	2,625.00	67,987,500	貸付株式数 11,600株
東祥	6,300	1,247.00	7,856,100	
トーセイ	14,400	894.00	12,873,600	貸付株式数 5,700株 (900株)
穴吹興産	2,300	1,465.00	3,369,500	貸付株式数 800株

サンフロンティア不動産	14,400	835.00	12,024,000	貸付株式数 3,600株 (2,800株)
エフ・ジェー・ネクスト	9,100	859.00	7,816,900	貸付株式数 3,400株 (300株)
インテリックス	2,900	462.00	1,339,800	貸付株式数 1,300株
ランドビジネス	3,500	350.00	1,225,000	
サンネクスタグループ	3,200	1,032.00	3,302,400	貸付株式数 1,400株
グランディハウス	8,100	375.00	3,037,500	貸付株式数 2,800株
東武鉄道	110,500	3,490.00	385,645,000	貸付株式数 49,600株 (33,800株)
相鉄ホールディングス	33,900	2,819.00	95,564,100	貸付株式数 15,200株
東急	267,300	1,439.00	384,644,700	貸付株式数 106,700株
京浜急行電鉄	136,100	1,595.00	217,079,500	貸付株式数 61,000株 (12,900株)
小田急電鉄	157,600	2,606.00	410,705,600	貸付株式数 70,800株 (12,600株)
京王電鉄	55,000	5,960.00	327,800,000	貸付株式数 23,600株 (3,900株)
京成電鉄	73,700	3,210.00	236,577,000	貸付株式数 30,300株
富士急行	14,400	3,250.00	46,800,000	貸付株式数 6,400株
新京成電鉄	2,700	2,225.00	6,007,500	貸付株式数 1,000株
東日本旅客鉄道	186,500	7,235.00	1,349,327,500	貸付株式数 83,400株 (37,000株)
西日本旅客鉄道	94,400	5,677.00	535,908,800	貸付株式数 42,300株
東海旅客鉄道	88,100	15,620.00	1,376,122,000	貸付株式数 39,000株 (800株)
西武ホールディングス	138,400	1,151.00	159,298,400	貸付株式数 62,100株
鴻池運輸	16,900	1,114.00	18,826,600	貸付株式数 5,500株
西日本鉄道	29,400	2,867.00	84,289,800	貸付株式数 13,100株 (1,500株)

ハマキョウレックス	8,100	3,170.00	25,677,000	貸付株式数 3,100株
サカイ引越センター	5,600	5,290.00	29,624,000	貸付株式数 1,900株
近鉄グループホールディングス	100,400	4,670.00	468,868,000	貸付株式数 45,000株
阪急阪神ホールディングス	133,900	3,525.00	471,997,500	貸付株式数 60,100株
南海電気鉄道	47,600	2,418.00	115,096,800	貸付株式数 21,300株
京阪ホールディングス	44,700	4,700.00	210,090,000	貸付株式数 20,000株 (9,600株)
神戸電鉄	2,400	3,750.00	9,000,000	貸付株式数 800株
名古屋鉄道	82,500	2,999.00	247,417,500	貸付株式数 39,000株 (2,000株)
山陽電気鉄道	7,200	2,186.00	15,739,200	貸付株式数 2,300株
トランコム	2,800	7,260.00	20,328,000	貸付株式数 1,000株 (100株)
日本通運	34,700	5,540.00	192,238,000	貸付株式数 15,400株 (13,200株)
ヤマトホールディングス	175,900	2,771.00	487,418,900	貸付株式数 51,600株
山九	27,900	3,995.00	111,460,500	貸付株式数 12,500株
日新	8,700	1,500.00	13,050,000	貸付株式数 3,900株
丸運	5,700	223.00	1,271,100	貸付株式数 2,500株
丸全昭和運輸	8,100	3,040.00	24,624,000	貸付株式数 2,800株
センコーグループホールディングス	55,300	803.00	44,405,900	貸付株式数 20,200株 (19,300株)
トナミホールディングス	2,400	5,520.00	13,248,000	
ニッコンホールディングス	35,900	2,080.00	74,672,000	貸付株式数 16,100株
日本石油輸送	1,100	3,195.00	3,514,500	貸付株式数 200株
福山通運	12,800	3,750.00	48,000,000	貸付株式数 5,700株 (300株)
セイノーホールディングス	75,200	1,390.00	104,528,000	貸付株式数 33,700株
エスライン	3,000	937.00	2,811,000	

神奈川中央交通	2,500	4,090.00	10,225,000	貸付株式数 800株
日立物流	18,400	2,835.00	52,164,000	貸付株式数 7,700株
丸和運輸機関	10,600	3,255.00	34,503,000	貸付株式数 4,200株
C & F ロジホールディングス	10,100	1,562.00	15,776,200	貸付株式数 1,400株
日本郵船	83,900	1,490.00	125,011,000	貸付株式数 37,600株
商船三井	63,500	1,996.00	126,746,000	貸付株式数 3,100株
川崎汽船	30,900	1,065.00	32,908,500	貸付株式数 12,400株
NSユナイテッド海運	5,500	1,483.00	8,156,500	貸付株式数 400株
明治海運	10,700	322.00	3,445,400	貸付株式数 4,800株
飯野海運	47,500	342.00	16,245,000	貸付株式数 21,300株
共栄タンカー	1,800	801.00	1,441,800	
九州旅客鉄道	88,000	2,654.00	233,552,000	貸付株式数 39,500株
SGホールディングス	105,300	3,730.00	392,769,000	貸付株式数 47,300株 (3,100株)
日本航空	177,500	1,971.00	349,852,500	貸付株式数 79,700株
ANAホールディングス	183,500	2,448.00	449,208,000	貸付株式数 78,600株
パスコ	1,900	1,473.00	2,798,700	
西本Wismettacホールディングス	1,900	2,157.00	4,098,300	貸付株式数 600株
シルバーライフ	1,400	2,150.00	3,010,000	貸付株式数 300株
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,815.00	1,633,500	
一家ダイニングプロジェクト	1,100	601.00	661,100	貸付株式数 400株
Genky DrugStores	4,600	3,590.00	16,514,000	貸付株式数 2,000株
国際紙パルプ商事	24,700	284.00	7,014,800	貸付株式数 6,700株
ナルミヤ・インターナショナル	2,300	605.00	1,391,500	
ブックオフグループホールディングス	6,100	792.00	4,831,200	貸付株式数 2,700株
三菱倉庫	31,800	2,736.00	87,004,800	貸付株式数 8,800株 (8,300株)
三井倉庫ホールディングス	11,500	1,522.00	17,503,000	貸付株式数 4,300株

住友倉庫	36,100	1,268.00	45,774,800	貸付株式数 16,100株
澁澤倉庫	5,500	2,039.00	11,214,500	貸付株式数 1,500株
ヤマタネ	5,200	1,176.00	6,115,200	貸付株式数 500株
東陽倉庫	18,100	318.00	5,755,800	貸付株式数 8,100株
乾汽船	5,800	787.00	4,564,600	
日本トランスシティ	22,100	474.00	10,475,400	貸付株式数 7,800株
ケイヒン	1,900	1,295.00	2,460,500	貸付株式数 400株
中央倉庫	6,100	950.00	5,795,000	貸付株式数 2,100株
川西倉庫	1,800	1,019.00	1,834,200	貸付株式数 600株
安田倉庫	8,200	879.00	7,207,800	貸付株式数 3,100株
ファイズホールディングス	2,100	1,144.00	2,402,400	貸付株式数 300株 (300株)
東洋埠頭	3,100	1,365.00	4,231,500	貸付株式数 1,000株
宇徳	8,600	484.00	4,162,400	貸付株式数 3,000株
上組	56,000	2,071.00	115,976,000	貸付株式数 25,100株
サンリツ	2,400	579.00	1,389,600	貸付株式数 800株
キムラユニティー	2,700	1,046.00	2,824,200	
キューソー流通システム	2,500	1,453.00	3,632,500	
近鉄エクスプレス	21,300	1,950.00	41,535,000	貸付株式数 9,400株
東海運	5,700	273.00	1,556,100	貸付株式数 2,500株
エーアイティー	7,100	751.00	5,332,100	貸付株式数 3,100株
内外トランスライン	3,500	1,000.00	3,500,000	貸付株式数 900株
ショーエイコーポレーション	1,600	900.00	1,440,000	貸付株式数 400株
日本コンセプト	3,200	1,230.00	3,936,000	
東京放送ホールディングス	63,200	1,653.00	104,469,600	貸付株式数 28,300株 (4,400株)
日本テレビホールディングス	86,800	1,160.00	100,688,000	貸付株式数 38,900株
朝日放送グループホールディングス	10,300	737.00	7,591,100	貸付株式数 4,400株

テレビ朝日ホールディングス	28,600	1,532.00	43,815,200	貸付株式数 1,400株 (800株)
スカパーJ S A Tホールディングス	68,400	415.00	28,386,000	貸付株式数 12,500株
テレビ東京ホールディングス	8,500	2,324.00	19,754,000	貸付株式数 2,100株
日本BS放送	3,500	1,085.00	3,797,500	貸付株式数 500株
ビジョン	9,700	671.00	6,508,700	貸付株式数 4,300株
スマートバリュー	2,700	1,157.00	3,123,900	貸付株式数 1,200株
USEN-NEXT HOLDINGS	4,000	1,304.00	5,216,000	貸付株式数 1,700株
ワイヤレスゲート	4,900	760.00	3,724,000	貸付株式数 2,100株
コネクシオ	5,900	1,420.00	8,378,000	貸付株式数 2,100株
日本通信	81,100	227.00	18,409,700	貸付株式数 36,400株
クロップス	1,900	716.00	1,360,400	貸付株式数 600株
日本電信電話	1,390,000	2,486.00	3,455,540,000	貸付株式数 516,100株
KDDI	758,100	3,259.00	2,470,647,900	貸付株式数 340,400株
ソフトバンク	945,000	1,386.00	1,309,770,000	貸付株式数 424,400株
光通信	10,700	23,590.00	252,413,000	貸付株式数 2,800株
NTTドコモ	743,600	2,925.00	2,175,030,000	貸付株式数 264,800株
エムティーアイ	10,100	813.00	8,211,300	貸付株式数 4,000株 (2,000株)
GMOインターネット	41,000	3,075.00	126,075,000	貸付株式数 18,400株
ファイバーゲート	3,300	1,555.00	5,131,500	貸付株式数 1,500株 (300株)
アйдママーケティングコミュニケーション	3,100	458.00	1,419,800	貸付株式数 1,300株
KADOKAWA	28,000	2,329.00	65,212,000	貸付株式数 8,000株
学研ホールディングス	13,900	1,461.00	20,307,900	貸付株式数 1,000株
ゼンリン	20,700	1,161.00	24,032,700	貸付株式数 9,200株
昭文社ホールディングス	4,800	431.00	2,068,800	

インプレスホールディングス	8,600	148.00	1,272,800	貸付株式数 3,400株
東京電力ホールディングス	846,000	315.00	266,490,000	貸付株式数 31,200株
中部電力	324,200	1,334.50	432,644,900	貸付株式数 97,700株 (61,000株)
関西電力	401,500	1,060.50	425,790,750	貸付株式数 180,300株
中国電力	152,900	1,418.00	216,812,200	貸付株式数 68,600株 (4,500株)
北陸電力	96,900	667.00	64,632,300	貸付株式数 43,400株
東北電力	264,700	1,001.00	264,964,700	貸付株式数 118,800株
四国電力	95,400	775.00	73,935,000	貸付株式数 42,800株
九州電力	218,400	885.00	193,284,000	貸付株式数 98,100株
北海道電力	99,200	401.00	39,779,200	貸付株式数 44,500株
沖縄電力	20,600	1,742.00	35,885,200	貸付株式数 9,200株
電源開発	84,300	1,779.00	149,969,700	貸付株式数 23,000株
エフオン	5,700	592.00	3,374,400	
イーレックス	15,100	1,462.00	22,076,200	貸付株式数 6,700株
レノバ	17,700	965.00	17,080,500	貸付株式数 7,400株 (4,000株)
東京瓦斯	203,800	2,575.50	524,886,900	貸付株式数 91,400株
大阪瓦斯	205,600	2,132.00	438,339,200	貸付株式数 82,500株 (18,900株)
東邦瓦斯	52,100	5,340.00	278,214,000	貸付株式数 23,400株
北海道瓦斯	5,700	1,594.00	9,085,800	貸付株式数 2,100株
広島ガス	21,800	352.00	7,673,600	貸付株式数 7,600株
西部瓦斯	11,900	2,531.00	30,118,900	貸付株式数 5,200株
静岡ガス	30,100	909.00	27,360,900	貸付株式数 13,500株
メタウォーター	5,100	4,730.00	24,123,000	貸付株式数 1,800株 (300株)

アイネット	5,300	1,515.00	8,029,500	貸付株式数 2,400株
松竹	6,900	14,630.00	100,947,000	貸付株式数 2,400株
東宝	61,400	3,685.00	226,259,000	貸付株式数 26,400株
エイチ・アイ・エス	15,800	1,638.00	25,880,400	貸付株式数 6,800株
東映	3,900	14,420.00	56,238,000	貸付株式数 1,300株
ラックランド	2,300	2,094.00	4,816,200	貸付株式数 1,000株
エヌ・ティ・ティ・データ	276,900	1,171.00	324,249,900	貸付株式数 124,300株
共立メンテナンス	16,800	3,545.00	59,556,000	貸付株式数 7,500株
イチネンホールディングス	11,300	1,210.00	13,673,000	貸付株式数 3,800株
建設技術研究所	7,000	1,784.00	12,488,000	貸付株式数 2,400株
スペース	6,600	917.00	6,052,200	貸付株式数 2,900株
長 大	4,000	1,085.00	4,340,000	
アインホールディングス	12,800	6,880.00	88,064,000	貸付株式数 5,600株 (300株)
燦ホールディングス	4,400	1,203.00	5,293,200	貸付株式数 1,000株
ピー・シー・エー	1,800	4,370.00	7,866,000	貸付株式数 700株
スバル興業	600	8,150.00	4,890,000	
東京テアトル	4,000	1,205.00	4,820,000	貸付株式数 1,300株
タナベ経営	1,900	1,283.00	2,437,700	
ビジネスブレイン太田昭和	3,600	1,200.00	4,320,000	
ナガワ	3,200	7,330.00	23,456,000	貸付株式数 1,100株
よみうりランド	2,200	3,525.00	7,755,000	貸付株式数 700株
東京都競馬	6,600	4,100.00	27,060,000	貸付株式数 2,900株
常磐興産	4,100	1,400.00	5,740,000	貸付株式数 1,400株
カナモト	16,600	2,379.00	39,491,400	貸付株式数 6,300株
東京ドーム	41,000	725.00	29,725,000	貸付株式数 16,300株 (4,700株)

D T S	23,200	2,195.00	50,924,000	貸付株式数 10,500株 (7,500株)
スクウェア・エニックス・ホールディングス	44,300	5,490.00	243,207,000	貸付株式数 19,800株
シーイーシー	11,100	1,706.00	18,936,600	貸付株式数 4,000株
カブコン	49,000	4,095.00	200,655,000	貸付株式数 22,000株
西尾レントオール	9,300	2,233.00	20,766,900	貸付株式数 4,000株 (3,000株)
アイ・エス・ビー	2,000	2,144.00	4,288,000	貸付株式数 400株 (400株)
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	64,900	32.00	2,076,800	貸付株式数 29,100株
日本空港ビルデング	33,400	4,505.00	150,467,000	貸付株式数 14,900株
トランス・コスモス	9,600	2,362.00	22,675,200	貸付株式数 3,700株 (1,300株)
乃村工藝社	43,400	885.00	38,409,000	貸付株式数 18,400株
ジャステック	6,600	1,267.00	8,362,200	貸付株式数 2,900株
S C S K	24,000	5,180.00	124,320,000	貸付株式数 10,700株
藤田観光	4,400	1,560.00	6,864,000	貸付株式数 1,500株
K N T - C Tホールディングス	6,300	959.00	6,041,700	貸付株式数 2,700株
日本管財	10,800	1,884.00	20,347,200	貸付株式数 4,100株
トーカイ	9,800	2,322.00	22,755,600	貸付株式数 3,300株
白洋舎	1,200	2,881.00	3,457,200	
セコム	107,500	9,396.00	1,010,070,000	貸付株式数 48,200株
日本システムウエア	3,400	1,981.00	6,735,400	
セントラル警備保障	4,900	3,960.00	19,404,000	貸付株式数 1,700株
アイネス	10,200	1,355.00	13,821,000	貸付株式数 4,500株
丹青社	19,100	724.00	13,828,400	貸付株式数 200株
メイテック	12,400	5,080.00	62,992,000	貸付株式数 4,700株
T K C	8,800	5,970.00	52,536,000	貸付株式数 3,100株

富士ソフト	13,300	4,425.00	58,852,500	貸付株式数 5,700株
応用地質	10,900	1,435.00	15,641,500	
船井総研ホールディングス	20,900	2,363.00	49,386,700	貸付株式数 9,300株
NSD	33,400	1,939.00	64,762,600	貸付株式数 15,000株
進学会ホールディングス	4,000	460.00	1,840,000	貸付株式数 1,700株
丸紅建材リース	1,000	1,540.00	1,540,000	
オオバ	7,200	609.00	4,384,800	
コナミホールディングス	37,800	3,365.00	127,197,000	貸付株式数 16,900株 (2,900株)
いであ	2,500	1,988.00	4,970,000	貸付株式数 900株
学究社	3,000	1,118.00	3,354,000	貸付株式数 1,200株 (200株)
ベネッセホールディングス	33,700	2,834.00	95,505,800	貸付株式数 13,700株
イオンディライト	12,500	2,887.00	36,087,500	貸付株式数 1,000株
ナック	5,600	881.00	4,933,600	貸付株式数 2,300株
福井コンピュータホールディングス	4,100	2,680.00	10,988,000	貸付株式数 1,500株
ニチイ学館	11,800	1,591.00	18,773,800	貸付株式数 5,400株
ダイセキ	17,000	2,551.00	43,367,000	貸付株式数 7,500株
ステップ	3,700	1,533.00	5,672,100	貸付株式数 1,300株
日鉄物産	7,400	3,395.00	25,123,000	貸付株式数 3,300株
泉州電業	3,200	2,733.00	8,745,600	貸付株式数 1,400株
元気寿司	2,600	2,275.00	5,915,000	貸付株式数 900株
トラスコ中山	21,700	2,741.00	59,479,700	貸付株式数 9,700株
ヤマダ電機	318,000	506.00	160,908,000	貸付株式数 142,700株
オートバックスセブン	38,700	1,357.00	52,515,900	貸付株式数 16,200株
モリト	7,600	671.00	5,099,600	貸付株式数 2,600株
アークランドサカモト	16,300	1,812.00	29,535,600	貸付株式数 3,900株
ニトリホールディングス	45,200	22,325.00	1,009,090,000	貸付株式数 20,200株

グルメ杵屋	7,400	935.00	6,919,000	貸付株式数 2,900株
愛眼	8,300	227.00	1,884,100	貸付株式数 2,000株 (2,000株)
ケーユーホールディングス	5,400	826.00	4,460,400	貸付株式数 1,900株
吉野家ホールディングス	34,300	2,134.00	73,196,200	貸付株式数 15,300株
加藤産業	15,100	3,360.00	50,736,000	貸付株式数 6,700株
北恵	2,600	945.00	2,457,000	貸付株式数 900株
イノテック	5,400	973.00	5,254,200	
イエローハット	19,700	1,503.00	29,609,100	貸付株式数 8,800株
松屋フーズホールディングス	5,000	3,570.00	17,850,000	貸付株式数 1,700株
J B C Cホールディングス	7,000	1,430.00	10,010,000	貸付株式数 2,400株
J Kホールディングス	9,400	783.00	7,360,200	
サガミホールディングス	14,000	1,208.00	16,912,000	貸付株式数 6,200株
日伝	9,400	2,201.00	20,689,400	貸付株式数 3,300株
関西スーパーマーケット	8,700	1,112.00	9,674,400	
ミロク情報サービス	9,200	2,232.00	20,534,400	貸付株式数 3,800株
北沢産業	7,800	280.00	2,184,000	貸付株式数 3,300株
杉本商事	5,600	1,788.00	10,012,800	貸付株式数 2,400株
因幡電機産業	29,700	2,437.00	72,378,900	貸付株式数 12,400株
王将フードサービス	7,700	5,810.00	44,737,000	貸付株式数 2,400株
プレナス	11,700	1,773.00	20,744,100	貸付株式数 4,500株
ミニストップ	7,700	1,435.00	11,049,500	貸付株式数 2,700株
アークス	21,300	2,473.00	52,674,900	貸付株式数 8,900株
バローホールディングス	23,100	2,180.00	50,358,000	貸付株式数 10,300株
東テク	3,500	2,216.00	7,756,000	
ミスミグループ本社	130,800	2,686.00	351,328,800	貸付株式数 58,700株
藤久	1,100	1,073.00	1,180,300	貸付株式数 400株 (400株)

アルテック	8,300	238.00	1,975,400	貸付株式数 200株
ベルク	5,100	7,680.00	39,168,000	
大 庄	5,600	1,203.00	6,736,800	貸付株式数 2,500株
タキヒヨー	3,200	1,865.00	5,968,000	貸付株式数 1,000株
ファーストリテイリング	14,000	62,130.00	869,820,000	貸付株式数 6,200株 (300株)
ソフトバンクグループ	825,100	6,019.00	4,966,276,900	貸付株式数 212,000株
蔵王産業	2,000	1,429.00	2,858,000	
スズケン	44,200	3,745.00	165,529,000	貸付株式数 19,800株
サンドラッグ	39,300	3,540.00	139,122,000	貸付株式数 17,600株
サクスパー ホールディングス	8,800	557.00	4,901,600	貸付株式数 2,100株
ジェコス	7,200	861.00	6,199,200	貸付株式数 3,200株
ヤマザワ	2,400	1,736.00	4,166,400	貸付株式数 900株
やまや	2,100	2,137.00	4,487,700	貸付株式数 900株
グローセル	10,400	419.00	4,357,600	貸付株式数 4,300株
ベルーナ	22,400	637.00	14,268,800	貸付株式数 8,500株
合計	125,674,500		231,502,723,980	

(注) 貸付株式数のうち(括弧書)の数値は、委託者の利害関係人であるみずほ証券株式会社に対する貸付であります。

(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2年7月31日現在

資産総額	338,876,044,690円
負債総額	104,570,104,687円
純資産総額(-)	234,305,940,003円
発行済数量	155,284,430口
1口当たり純資産額(/)	1,508.88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) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 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。

(6) 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、交換請求の受付、交換有価証券の交付および信託終了にかかる金銭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(2020年7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(2020年7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。

2020年7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	1,216,222,423,902
追加型株式投資信託	861	13,687,667,821,911
単位型公社債投資信託	36	92,342,483,722
単位型株式投資信託	188	1,257,025,532,490
合計	1,111	16,253,258,262,025

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第35期事業年度(自2019年4月1日至2020年3月31日)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	41,087,475	32,932,013
金銭の信託	18,773,228	28,548,165
有価証券	153,518	996
未収委託者報酬	12,438,085	11,487,393
未収運用受託報酬	3,295,109	4,674,225
未収投資助言報酬	327,064	331,543
未収収益	56,925	11,674
前払費用	573,874	480,129
その他	491,914	2,815,351
流動資産計	77,197,195	81,281,494
固定資産		
有形固定資産		
建物	1,461,316	1,278,455
1 建物	1,096,916	1,006,793
器具備品	1 364,399	1 270,768
建設仮勘定	-	894
無形固定資産		
ソフトウェア	2,411,540	3,524,781
ソフトウェア仮勘定	885,545	3,299,065
1,522,040		221,784
電話加入権	3,931	3,931
電信電話専用施設利用権	23	-
投資その他の資産		
投資有価証券	9,269,808	9,482,127
関係会社株式	1,611,931	261,361
4,499,196		5,299,196
長期差入保証金	1,312,328	1,302,402
繰延税金資産	1,748,459	2,508,004
その他	97,892	111,162
固定資産計	13,142,665	14,285,364
資産合計	90,339,861	95,566,859

(単位:千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	2,183,889	3,702,906
未払金	5,697,942	4,803,140
未払収益分配金	1,053	966
未払償還金	48,968	9,999
未払手数料	4,883,723	4,582,140
その他未払金	764,196	210,034
未払費用	6,724,986	6,673,320
未払法人税等	3,341,238	4,090,268
未払消費税等	576,632	1,338,183
賞与引当金	1,344,466	1,373,328
役員賞与引当金	48,609	65,290
流動負債計	19,917,766	22,046,438
固定負債		
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
時効後支払損引当金	177,851	174,139
固定負債計	2,073,009	2,293,087
負債合計	21,990,776	24,339,526
(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	45,949,372	49,674,383
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	45,826,079	49,551,090
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	14,146,079	17,871,090
株主資本計	67,502,329	71,227,341
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	846,755	7
評価・換算差額等計	846,755	7
純資産合計	68,349,085	71,227,333
負債・純資産合計	90,339,861	95,566,859

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	84,812,585		84,426,075	
運用受託報酬	16,483,356		16,912,305	
投資助言報酬	1,235,553		1,208,954	
その他営業収益	113,622		68,156	
営業収益計		102,645,117		102,615,492
営業費用				
支払手数料	36,100,556		34,980,736	
広告宣伝費	387,028		340,791	
公告費	375		375	
調査費	24,389,003		25,132,268	
調査費	9,956,757		10,586,542	
委託調査費	14,432,246		14,545,725	
委託計算費	936,075		698,723	
営業雑経費	1,254,114		990,002	
通信費	47,007		44,209	
印刷費	978,185		738,330	
協会費	63,558		71,386	
諸会費	22,877		22,790	
支払販売手数料	142,485		113,286	
営業費用計		63,067,153		62,142,897
一般管理費				
給料	10,859,354		10,817,861	
役員報酬	189,198		174,795	
給料・手当	9,098,957		9,087,800	
賞与	1,571,197		1,555,264	
交際費	60,115		40,436	
寄付金	7,255		8,906	
旅費交通費	361,479		320,037	
租税公課	588,172		651,265	
不動産賃借料	1,511,876		1,479,503	
退職給付費用	521,184		505,189	
固定資産減価償却費	590,667		882,526	
福利厚生費	45,292		44,352	
修繕費	16,247		1,843	
賞与引当金繰入額	1,344,466		1,373,328	
役員賞与引当金繰入額	48,609		65,290	
機器リース料	130		233	
事務委託費	3,302,806		3,625,424	
事務用消耗品費	131,074		104,627	
器具備品費	8,112		1,620	
諸経費	188,367		197,094	
一般管理費計		19,585,212		20,119,543
営業利益		19,992,752		20,353,050

(単位:千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	1,749		4,440	
受取配当金	73,517		11,185	
時効成立分配金・償還金	8,582		49,164	
投資信託償還益	-		5,528	
受取負担金	177,066		297,886	
雑収入	24,919		7,394	
時効後支払損引当金戻入額	19,797		3,473	
営業外収益計		305,633		379,073
営業外費用				
為替差損	17,542		19,750	
投資信託償還損	-		1	
金銭の信託運用損	175,164		169,505	
システム解約料	-		31,680	
雑損失	5,659		104	
営業外費用計		198,365		221,042
経常利益		20,100,019		20,511,082
特別利益				
投資有価証券売却益	353,644		1,169,758	
特別利益計		353,644		1,169,758
特別損失				
固定資産除却損	1 19,121		1 16,085	
特別損失計		19,121		16,085
税引前当期純利益		20,434,543		21,664,754
法人税、住民税及び事業税		6,386,793		7,045,579
法人税等調整額		71,767		385,835
法人税等合計		6,315,026		6,659,743
当期純利益		14,119,516		15,005,011

(3)【株主資本等変動計算書】

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
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

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		利益剰余金合計	
					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	45,949,372	67,502,329
当期変動額									
剰余金の配当							11,280,000	11,280,000	11,280,000
当期純利益							15,005,011	15,005,011	15,005,011
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,725,011	3,725,011	3,725,011
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	846,755	846,755	68,349,085
当期変動額			
剰余金の配当			11,280,000
当期純利益			15,005,011
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	846,763	846,763	846,763
当期変動額合計	846,763	846,763	2,878,247
当期末残高	7	7	71,227,333

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>
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

（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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
建物	229,897	320,020
器具備品	927,688	949,984

（損益計算書関係）

1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)	第35期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)
建物	1,550	-
器具備品	439	9,609
ソフトウエア	17,130	6,475

（株主資本等変動計算書関係）

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

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					

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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
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
2020年6月17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
2020年6月17日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種 類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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おります。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第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	-

第35期(2020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	32,932,013	32,932,013	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	28,548,165	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	11,487,393	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	4,674,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	2,988	2,988	-
資産計	77,644,787	77,644,787	-
(1) 未払手数料	4,582,140	4,582,140	-
負債計	4,582,140	4,582,140	-

(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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非上場株式	276,764	259,369
関係会社株式	4,499,196	5,299,196

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第34期(2019年3月31日現在)

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

第35期(2020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	32,932,013	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	996	994	997	-

(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34期の貸借対照表計上額4,499,196千円、第35期の貸借対照表計上額5,299,196千円)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、記載していません。

2. その他有価証券

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276,764千円)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35期(2020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	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計			
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	2,988	3,000	11
小計	2,988	3,000	11
合計	2,988	3,000	11

(注)非上場株式(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。

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

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	-	-	-

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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	1,298,377	1,169,758	-
投資信託	159,526	5,528	1

(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、償還によるものであります。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,154,607	2,289,044
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の発生額	10,147	18,448
退職給付の支払額	158,018	187,749
その他	438	1,476
退職給付債務の期末残高	2,289,044	2,422,901

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

(千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未積立退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未認識数理計算上の差異	150,568	130,155
未認識過去勤務費用	243,317	173,798
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の費用処理額	43,920	38,861
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,519
その他	3,640	11,303
確定給付制度に係る退職給付費用	411,963	401,711

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020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. 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104,720千円、当事業年度103,477千円であります。

(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34期	第35期
	(2019年3月31日現在)	(2020年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	173,805	221,053
未払事業所税	10,915	10,778
賞与引当金	411,675	420,513
未払法定福利費	80,253	78,439
未払給与	7,961	10,410
受取負担金	138,994	47,781
運用受託報酬	102,490	331,395
資産除去債務	10,152	14,116
減価償却超過額(一括償却資産)	4,569	50,942
減価償却超過額	125,839	82,684
繰延資産償却超過額(税法上)	135,542	323,132
退職給付引当金	580,297	648,821
時効後支払損引当金	54,458	53,321
ゴルフ会員権評価損	7,360	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
その他	29,494	11,532
その他有価証券評価差額金	-	3
繰延税金資産小計	2,069,527	2,508,004
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,069,527	2,508,004
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	321,067	-
繰延税金負債合計	321,067	-
繰延税金資産の純額	1,748,459	2,508,004

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

(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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	104,326,078千円	94,605,736千円
資産合計	104,326,078千円	94,605,736千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	10,571,428千円	8,278,713千円
負債合計	10,571,428千円	8,278,713千円
純資産	93,754,650千円	86,327,023千円

(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	66,696,733千円	62,885,491千円
顧客関連資産	39,959,586千円	34,810,031千円

(2) 損益計算書項目

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	9,043,138千円	8,954,439千円
経常利益	9,043,138千円	8,954,439千円
税引前当期純利益	9,091,728千円	9,111,312千円
当期純利益	7,489,721千円	7,536,465千円
1株当たり当期純利益	187,243円04銭	188,411円64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	5,241,252千円	5,149,555千円

(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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)及び第35期(自 2019年4月1日 至 2020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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業 上 の関 係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,048,352	未払 手数料	915,980
								子会社株式 の取得	1,270,000	-	-
子 会 社	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

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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	5,793,912	未払 手数料	1,112,061
子 会 社	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	10,294,840	未払 手数料	1,231,431

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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	1,708,727円13銭	1,780,683円32銭
1株当たり当期純利益金額	352,987円92銭	375,125円27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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
当期純利益金額	14,119,516千円	15,005,011千円
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	14,119,516千円	15,005,011千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
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

2020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
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	(1) 40,500	「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。
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616	「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。
みずほ証券株式会社	125,167	「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。
J P モルガン証券株式会社	73,272	「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。
U B S 証券株式会社	32,100	「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。
ソシエテ・ジェネラル証券株式会社	35,765	「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。
シティグループ証券株式会社	(2) 96,307	「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。
大和証券株式会社	100,000	「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。
東海東京証券株式会社	6,000	「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。
S M B C 日興証券株式会社	10,000	「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。
野村證券株式会社	10,000	「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。
B N P パリバ証券株式会社	102,025	「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。
エービーエヌ・アムロ・クリアリング証券株式会社	5,505	「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。
メリルリンチ日本証券株式会社	(2) 83,140	「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。

モルガン・スタンレーMUF G証券 株式会社	62,149	「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2020年3月末日現在

(1) 2020年8月1日現在

(2) 2019年12月31日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集販売の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 交換請求の受付
- (4) 受益権の買取りに関する事務
- (5) 信託終了時の取扱い
- (6) その他上記に付帯する業務

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【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	2020年4月8日
有価証券届出書	2020年4月8日

独立監査人の監査報告書

2020年5月27日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 山野 浩 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬 印
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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2年8月14日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 山野浩印
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているOne ETF トピックスの令和2年1月9日から令和2年7月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、One ETF トピックスの令和2年7月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、アセットマネジメントOne株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

監査人は、経営者に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以 上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。