

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2020年11月6日提出
<b>【発行者名】</b>	アセットマネジメントOne株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 菅野 暁
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	酒井 隆
<b>【電話番号】</b>	03-6774-5100
<b>【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】</b>	D I A M国内株式インデックスファンド< D C 年金 >
<b>【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】</b>	1兆円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>  
（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

ファンドの受益権は、「社債、株式等の振替に関する法律」（以下、「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下、「委託会社」といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

お申込日の基準価額 とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当りに換算した基準価額で表示することがあります。）

#### <基準価額の照会方法等>

基準価額は、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されません。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

( 5 ) 【申込手数料】

ありません。

( 6 ) 【申込単位】

1円以上1円単位(当初元本1口=1円)

収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位となります。

( 7 ) 【申込期間】

継続申込期間：2020年11月7日から2021年5月7日まで

継続申込期間は、上記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

( 8 ) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

( 9 ) 【払込期日】

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

( 10 ) 【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社所定の方法により、販売会社に買付代金を支払うものとし、

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

( 11 ) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

( 12 ) 【その他】

お申込みの方法

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資(自動けいぞく投資)専用」ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

また、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができます。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

#### 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの収益分配金、償還金、解約代金は、社振法および上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

#### (参考)

##### 投資信託振替制度

投資信託振替制度とは、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するものです。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行われますので、受益証券は発行されません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

#### <ファンドの特色>

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

#### 指数の著作権等

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

株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

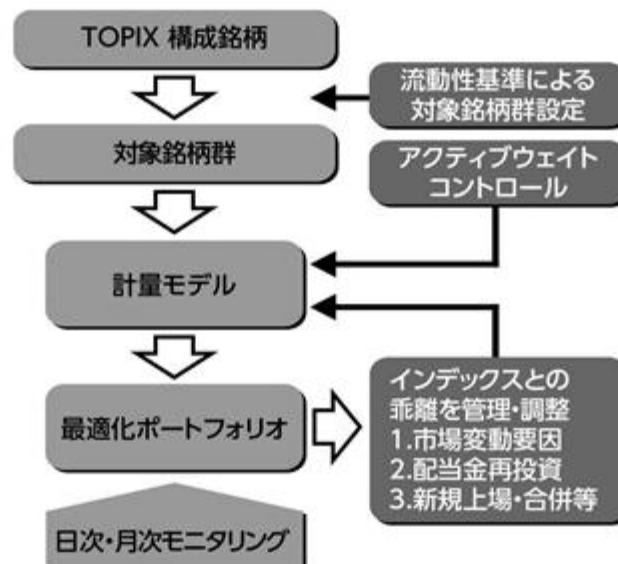
当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

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

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

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

- 2** 流動性を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックス「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」とポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。  
日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。



- 3** 株式（株価指数先物取引を含みます。）の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。  
株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。

### ■ 分配方針

年1回の決算時（2月7日（休業日の場合は翌営業日））に、経費控除後の利子、配当収入および売買益（評価益を含みます。）等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類定義

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

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分定義

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

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



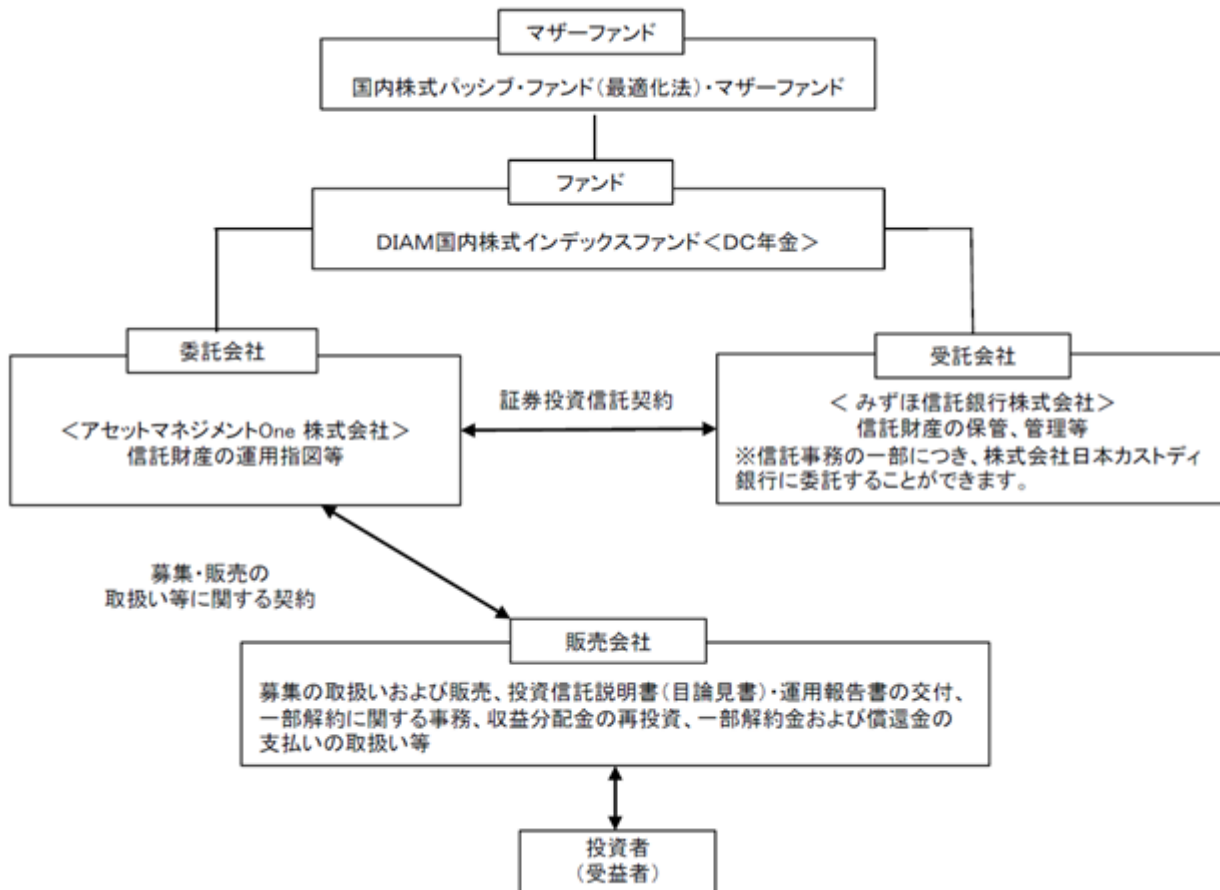
上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) でご覧いただけます。

## (2) 【ファンドの沿革】

2002年11月15日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

2005年10月1日 信託報酬率の変更

## (3) 【ファンドの仕組み】



### ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。

当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

### ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

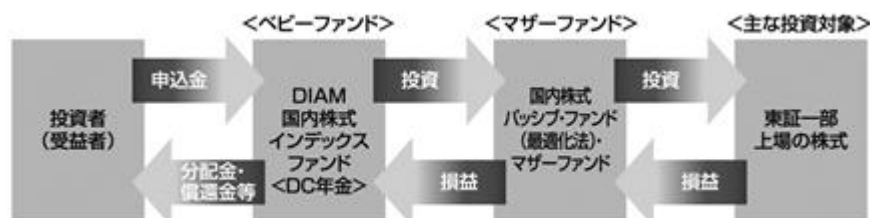
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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

## ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



## 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

## 資本金の額

20億円（2020年8月31日現在）

## 委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2020年8月31日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 <sup>1</sup>	70.0% <sup>2</sup>
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% <sup>2</sup>

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数に連動する投資成果を目標として運用を行います。

<投資対象>

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

<投資態度>

- 1) 主として国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド受益証券に投資し、東証株価指数（TOPIX、配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- 2) 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。
- 3) 株式（株価指数先物取引を含みます。）の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 4) 株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
- 5) 有価証券等の効率的な運用に資するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかるオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- 6) 信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

当ファンドが対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、上記 1ファンドの性格 (1)ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>をご参照ください。

## (2) 【投資対象】

## 1. 投資の対象とする資産の種類(約款第15条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

b. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

## 2. 有価証券の指図範囲(約款第16条第1項)

委託会社は、信託金を主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドの受益証券のほか、次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1) 株券

2) 国債証券

3) 地方債証券

4) 特別の法律により法人の発行する債券

5) 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)

6) 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)

7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)

8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)

9) 特定目的会社に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)

10) コマーシャル・ペーパー

11) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)~10)の証券または証書の性質を有するもの

12) 外国貸付債権信託受益権(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)

13) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。)

14) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)

15) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

16) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)

- 17) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
  - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
- なお、上記1)の証券または証書、11)ならびに14)の証券または証書のうち1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券ならびに11)および14)の証券または証書のうち2)から6)までの性質を有するものを以下「公社債」といいます。

### 3. 金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

委託会社は、信託金を、上記2.に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

4. 上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3.の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。(約款第16条第3項)

## (参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 主として東京証券取引所第一部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</li> <li>3. 株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li> <li>4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</li> <li>5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</li> </ol>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>2. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>3. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>4. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

## (3) 【運用体制】

## a. ファンドの運用体制



## 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

## 運用計画の決定

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

## 売買執行の実施

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

## モニタリング

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

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

#### 内部管理等のモニタリング

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

#### b．ファンドの関係法人に関する管理

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

#### c．運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2020年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

### （４）【分配方針】

#### 収益分配方針

毎決算時（原則として2月7日。ただし、休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

##### 1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当収入および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

##### 2) 分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

##### 3) 留保益の運用方針

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

#### 収益の分配方式

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

1) 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の配当金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2) 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬に



かかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金があるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### 収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に全額無手数料で再投資されます。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に対し支払われます。販売会社は、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

#### (5) 【投資制限】

##### 1) 株式への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2. 運用方法(3)投資制限)

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

##### 2) 外貨建資産への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2. 運用方法(3)投資制限)

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

##### 3) マザーファンドの受益証券への投資割合には制限を設けません。(約款「運用の基本方針」2. 運用方法(3)投資制限)

##### 4) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。(約款「運用の基本方針」2. 運用方法(3)投資制限)

##### 5) 投資する株式等の範囲(約款第18条)

委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

##### 6) 信用取引の指図範囲(約款第19条)

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(b) 上記(a)の信用取引の指図は、次の1.~5.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.~5.に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、

1. 信託財産に属する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売り出しにより取得する株券

5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。))の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券

7) 先物取引等の運用指図・目的(約款第20条)

- (a) 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。))。
- (b) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (c) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

8) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲(約款第21条)

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (b) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (c) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- (d) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

9) デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第21条の2)

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

10) 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第22条)

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1)~2)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
  - 1) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  - 2) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

- (b) 上記(a)の1)~2)で定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (c) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。

11) 特別な場合の外貨建資産への投資制限(約款第24条)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

12) 外貨為替予約の指図(約款第25条)

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引を指図することができます。
- (b) 上記(a)の予約取引の指図は、信託財産に属する為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドに信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (c) 上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

13) 資金の借入れ(約款第33条)

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

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

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。)の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図してはなりません。

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

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

信用リスク

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

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

< その他の留意点 >

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。

資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

当ファンドは受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、受益者のため有利と認められる場合、対象インデックスが改廃の場合、その他やむを得ない事情がある場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了(繰上償還)する場合があります。

#### 注意事項

イ.当ファンドは、実質的に株式など値動きのある有価証券に投資しますので、基準価額は変動します。

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

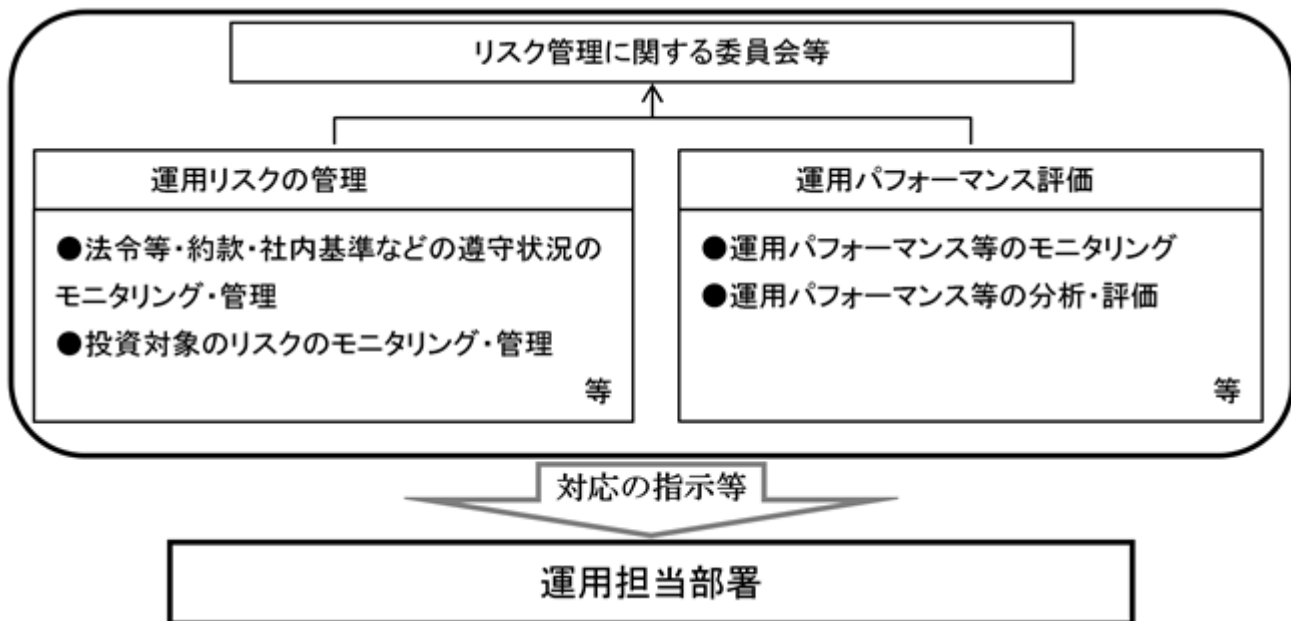
ハ.投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

ニ.投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

### < リスク管理体制 >

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

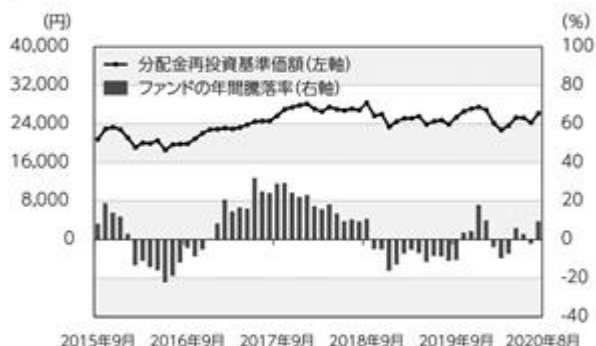
- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



リスク管理体制は2020年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

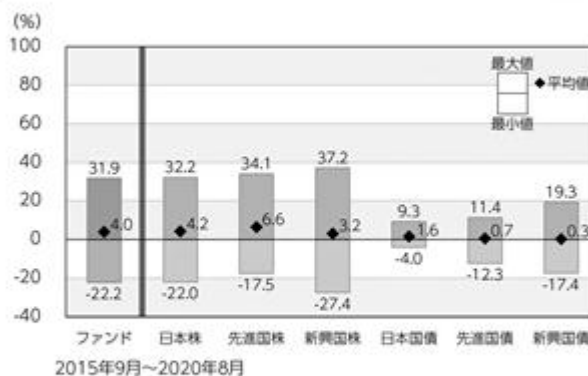
## <参考情報>

### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



2015年9月 2016年9月 2017年9月 2018年9月 2019年9月 2020年8月

### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



2015年9月～2020年8月

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

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

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

\*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 各資産クラスの指数

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

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

## (3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.242%（税抜0.22%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.08%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.11%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## (4)【その他の手数料等】

## イ. 信託財産留保額

ありません。

## ロ. その他の費用

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

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

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

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・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ならびに外貨建資産の保管等に関する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・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ならびに外貨建資産の保管等に関する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。



上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

##### 個人の受益者に対する課税

###### 収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率で源泉徴収による申告不要制度が適用されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用なし）のいずれかを選択することもできます。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

###### 解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

###### 損益通算について

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

##### 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

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

上記は、2020年8月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

#### 個別元本方式について

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

##### < 個別元本について >

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

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

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

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

##### < 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

令和2年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	93,074,112,695	99.99
内 日本	93,074,112,695	99.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,509,401	0.01
純資産総額	93,079,622,096	100.00

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

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

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和2年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	230,936,310,500	97.84
内 日本	230,936,310,500	97.84
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,106,334,776	2.16
純資産総額	236,042,645,276	100.00

その他資産の投資状況

令和2年8月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	5,639,840,000	2.39
内 日本	5,639,840,000	2.39

(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8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	35,821,157,178	2.7223 97,518,918,781	2.5983 93,074,112,695	- -	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

令和2年8月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

## 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和2年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,136,300	7,615.83 8,653,872,330	7,006.00 7,960,917,800	- -	3.37
2	ソニー 日本	株式 電気機器	638,000	7,636.94 4,872,371,754	8,309.00 5,301,142,000	- -	2.25
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	793,000	4,964.00 3,936,458,200	6,598.00 5,232,214,000	- -	2.22
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	92,300	37,990.15 3,506,491,686	43,680.00 4,031,664,000	- -	1.71
5	任天堂 日本	株式 その他製品	62,400	41,142.24 2,567,276,196	56,740.00 3,540,576,000	- -	1.50
6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	847,400	4,305.03 3,648,087,165	3,959.00 3,354,856,600	- -	1.42
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,336,000	2,789.41 3,726,662,955	2,411.50 3,221,764,000	- -	1.36
8	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	6,871,600	548.62 3,769,938,262	442.50 3,040,683,000	- -	1.29
9	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	697,300	4,207.97 2,934,223,080	4,026.00 2,807,329,800	- -	1.19
10	第一三共 日本	株式 医薬品	291,500	8,072.04 2,353,001,724	9,447.00 2,753,800,500	- -	1.17
11	ダイキン工業 日本	株式 機械	129,800	15,989.50 2,075,438,071	19,965.00 2,591,457,000	- -	1.10
12	KDDI 日本	株式 情報・通信業	728,600	3,361.37 2,449,096,010	3,078.00 2,242,630,800	- -	0.95
13	信越化学工業 日本	株式 化学	171,300	13,179.99 2,257,733,166	12,885.00 2,207,200,500	- -	0.94

14	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	801,700	2,783.37 2,231,431,873	2,729.00 2,187,839,300	- -	0.93
15	日本電産 日本	株式 電気機器	245,200	7,184.71 1,761,691,392	8,911.00 2,184,977,200	- -	0.93
16	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	694,700	3,731.23 2,592,092,129	3,118.00 2,166,074,600	- -	0.92
17	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	714,700	3,150.24 2,251,479,240	2,959.00 2,114,797,300	- -	0.90
18	HOYA 日本	株式 精密機器	202,000	10,046.70 2,029,433,652	10,415.00 2,103,830,000	- -	0.89
19	花王 日本	株式 化学	243,800	8,648.14 2,108,418,553	8,069.00 1,967,222,200	- -	0.83
20	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	13,648,000	157.54 2,150,120,378	143.80 1,962,582,400	- -	0.83
21	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	701,600	2,600.19 1,824,294,356	2,723.50 1,910,807,600	- -	0.81
22	村田製作所 日本	株式 電気機器	299,200	6,450.24 1,929,914,185	6,280.00 1,878,976,000	- -	0.80
23	SMC 日本	株式 機械	31,900	50,309.04 1,604,858,642	58,250.00 1,858,175,000	- -	0.79
24	ファナック 日本	株式 電気機器	95,700	19,872.32 1,901,781,746	18,605.00 1,780,498,500	- -	0.75
25	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	64,600	24,061.78 1,554,391,532	27,150.00 1,753,890,000	- -	0.74
26	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	355,200	5,967.84 2,119,777,219	4,890.00 1,736,928,000	- -	0.74
27	日立製作所 日本	株式 電気機器	489,300	4,051.16 1,982,236,641	3,530.00 1,727,229,000	- -	0.73
28	三井物産 日本	株式 卸売業	868,600	1,896.55 1,647,347,116	1,914.00 1,662,500,400	- -	0.70
29	三菱商事 日本	株式 卸売業	657,700	2,795.25 1,838,436,934	2,512.50 1,652,471,250	- -	0.70
30	中外製薬 日本	株式 医薬品	318,600	4,155.79 1,324,034,711	4,721.00 1,504,110,600	- -	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8月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	97.84
合計	97.84

(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8月31日現在

業種	国内 / 外国	投資比率 (%)
電気機器	国内	14.72
情報・通信業		9.95
輸送用機器		7.15
化学		7.01
医薬品		6.42
サービス業		5.38
機械		5.33
小売業		4.88
銀行業		4.87
卸売業		4.67
陸運業		3.76
食料品		3.69
その他製品		2.64
精密機器		2.56
建設業		2.48
不動産業		1.95
保険業		1.95
電気・ガス業		1.40
その他金融業		1.10
証券、商品先物取引業		0.81
ガラス・土石製品		0.75
非鉄金属		0.67
鉄鋼		0.57
ゴム製品		0.55
金属製品		0.54
繊維製品		0.48
石油・石炭製品		0.42
空運業		0.35
パルプ・紙		0.21
倉庫・運輸関連業		0.19
鉱業		0.17
海運業		0.14
水産・農林業	0.09	
合計		97.84

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和2年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0209月	買建	349	5,495,585,170	5,639,840,000	2.39

（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8月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第8計算期間末 (平成23年2月7日)	38,104	38,104	1.2631	1.2631
第9計算期間末 (平成24年2月7日)	35,526	35,526	1.0602	1.0602
第10計算期間末 (平成25年2月7日)	49,488	49,488	1.3587	1.3587
第11計算期間末 (平成26年2月7日)	61,898	61,898	1.6948	1.6948
第12計算期間末 (平成27年2月9日)	73,449	73,449	2.0668	2.0668
第13計算期間末 (平成28年2月8日)	76,274	76,274	2.0357	2.0357
第14計算期間末 (平成29年2月7日)	82,440	82,440	2.2799	2.2799
第15計算期間末 (平成30年2月7日)	95,638	95,638	2.6806	2.6806
第16計算期間末 (平成31年2月7日)	93,647	93,647	2.4513	2.4513
第17計算期間末 (令和2年2月7日)	99,688	99,688	2.7679	2.7679
令和1年8月末日	89,828	-	2.3911	-
9月末日	94,019	-	2.5351	-
10月末日	98,262	-	2.6613	-
11月末日	99,018	-	2.7125	-
12月末日	99,434	-	2.7512	-
令和2年1月末日	97,165	-	2.6915	-
2月末日	86,028	-	2.4146	-
3月末日	81,883	-	2.2700	-
4月末日	85,207	-	2.3676	-
5月末日	91,942	-	2.5284	-
6月末日	91,021	-	2.5237	-
7月末日	86,851	-	2.4217	-
8月末日	93,079	-	2.6190	-



## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金（円）
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
令和2年2月8日～令和2年8月7日	-

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第8計算期間	8.3
第9計算期間	16.1
第10計算期間	28.2
第11計算期間	24.7
第12計算期間	21.9
第13計算期間	1.5
第14計算期間	12.0
第15計算期間	17.6
第16計算期間	8.6
第17計算期間	12.9
令和2年2月8日～令和2年8月7日	9.6

（注）収益率は期間騰落率です。

## （４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第8計算期間	7,387,878,523	3,984,381,861
第9計算期間	8,287,509,892	4,947,169,536
第10計算期間	9,700,581,703	6,785,126,872
第11計算期間	16,783,744,888	16,684,231,460
第12計算期間	12,348,095,889	13,334,064,929
第13計算期間	15,836,928,730	13,906,095,221
第14計算期間	10,393,725,218	11,702,028,376
第15計算期間	10,084,186,998	10,566,397,641
第16計算期間	10,173,881,212	7,648,968,293
第17計算期間	7,250,587,806	9,437,436,083
令和2年2月8日～ 令和2年8月7日	6,260,085,818	6,528,328,678

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2020年8月31日

## 基準価額・純資産の推移 (2010年8月31日～2020年8月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。

※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:2002年11月15日)

## 分配の推移(税引前)

2016年 2月	0円
2017年 2月	0円
2018年 2月	0円
2019年 2月	0円
2020年 2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

## ■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

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

## ■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

## 資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	97.84
内 日本	97.84
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.16
合計(純資産総額)	100.00

## その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.39

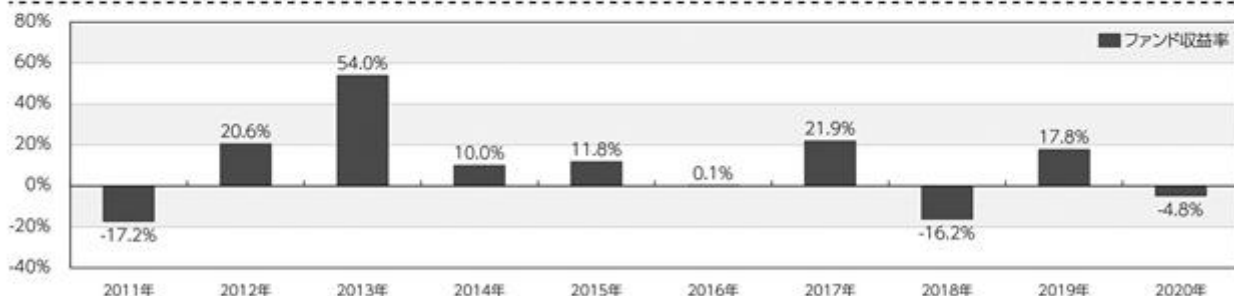
## 株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	14.72
2	情報・通信業	9.95
3	輸送用機器	7.15
4	化学	7.01
5	医薬品	6.42

## 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	3.37
2	ソニー	株式	日本	電気機器	2.25
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.22
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.71
5	任天堂	株式	日本	その他製品	1.50
6	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.42
7	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.36
8	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.29
9	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.19
10	第一三共	株式	日本	医薬品	1.17

## 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。

※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。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### お申込みの方法

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。  
当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。
- ・当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動引きぞく）専用」ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。  
なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。
- ・当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。
- ・委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができるものとします。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

#### お申込価額（発行価格）

- ・お申込日の基準価額 とします。  
収益分配金の再投資を行う場合は各計算期間終了日の基準価額とします。  
「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

#### < 基準価額の照会方法等 >

- ・基準価額は、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されません。  
当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。
  - ・販売会社へのお問い合わせ
  - ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

#### お申込単位

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位とします。

#### お申込手数料

ありません。

#### 払込期日

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

## 2【換金（解約）手続等】

#### 解約のお申込み方法

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に1口単位をもって解約の請求をすることができます。

委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。なお、解約の請求を受益者がするとき、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとし、

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の請求の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことができます。解約の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

#### 解約価額

解約価額は、解約請求受付日の基準価額とします。

解約価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

#### 解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して5営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

##### < 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日において、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ：URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

信託期間は2002年11月15日から原則として無期限です。

下記(5)イ.の場合には信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

a. 計算期間は原則として毎年2月8日から翌年2月7日までとします。

b. 上記a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5) 【その他】

イ. 償還規定

- a. 委託会社は信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- b. 委託会社は、信託終了前にこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- c. 委託会社は上記a. b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記a. b.につき、上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- e. 委託会社は信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 上記c. ~ e.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記c.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- 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、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- 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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- j. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

#### ロ. 信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a.～e.の規定にしたがいます。
- g. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

#### 八．関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として期間満了の3ヵ月前までに、当事者間の別段の意思表示がない限り、1年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

#### 二．公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、委託会社のホームページに掲載します。

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

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

#### ホ．運用報告書

・委託会社は、毎年2月7日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

### 4【受益者の権利等】

#### 収益分配金請求権

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付され、販売会社により自動的に再投資されます。

販売会社は、累積投資約款に基づき、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

#### 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

#### 一部解約請求権



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

#### 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第17期計算期間(平成31年2月8日から令和2年2月7日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【DIAM国内株式インデックスファンド&lt;DC年金&gt;】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第16期 平成31年2月7日現在	第17期 令和2年2月7日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	297,674,393	432,843,711
親投資信託受益証券	93,639,627,508	99,680,267,054
未収入金	41,873,000	-
流動資産合計	93,979,174,901	100,113,110,765
<b>資産合計</b>	<b>93,979,174,901</b>	<b>100,113,110,765</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	216,570,869	307,631,349
未払受託者報酬	15,697,115	15,923,890
未払委託者報酬	99,415,286	100,851,574
その他未払費用	487,666	482,572
流動負債合計	332,170,936	424,889,385
<b>負債合計</b>	<b>332,170,936</b>	<b>424,889,385</b>
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	38,202,443,152	36,015,594,875
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	55,444,560,813	63,672,626,505
(分配準備積立金)	18,411,757,905	18,655,918,168
元本等合計	93,647,003,965	99,688,221,380
<b>純資産合計</b>	<b>93,647,003,965</b>	<b>99,688,221,380</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>93,979,174,901</b>	<b>100,113,110,765</b>

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第16期 自 平成30年2月8日 至 平成31年2月7日	第17期 自 平成31年2月8日 至 令和2年2月7日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	8,243,405,026	12,008,003,546
<b>営業収益合計</b>	<b>8,243,405,026</b>	<b>12,008,003,546</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	254,060	198,142
受託者報酬	31,590,219	30,941,905
委託者報酬	200,071,819	195,965,837
その他費用	997,348	944,354
<b>営業費用合計</b>	<b>232,913,446</b>	<b>228,050,238</b>
営業利益又は営業損失( )	8,476,318,472	11,779,953,308
経常利益又は経常損失( )	8,476,318,472	11,779,953,308
当期純利益又は当期純損失( )	8,476,318,472	11,779,953,308
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	339,948,813	1,090,728,410
期首剰余金又は期首欠損金( )	59,960,554,658	55,444,560,813
剰余金増加額又は欠損金減少額	16,462,378,257	11,279,734,943
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	16,462,378,257	11,279,734,943
剰余金減少額又は欠損金増加額	12,842,002,443	13,740,894,149
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,842,002,443	13,740,894,149
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	55,444,560,813	63,672,626,505

## (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17期	
	自 平成31年2月8日	至 令和2年2月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第16期	第17期
	平成31年2月7日現在	令和2年2月7日現在
1. 期首元本額	35,677,530,233円	38,202,443,152円
期中追加設定元本額	10,173,881,212円	7,250,587,806円
期中一部解約元本額	7,648,968,293円	9,437,436,083円
2. 受益権の総数	38,202,443,152口	36,015,594,875口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第16期	第17期
	自 平成30年2月8日 至 平成31年2月7日	自 平成31年2月8日 至 令和2年2月7日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(40,963,345,637円)及び分配準備積立金(18,411,757,905円)より分配対象収益は59,375,103,542円(1万口当たり15,542.23円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(4,381,056,245円)、信託約款に規定される収益調整金(45,016,881,546円)及び分配準備積立金(14,274,861,923円)より分配対象収益は63,672,799,714円(1万口当たり17,679.23円)ですが、分配を行っておりません。

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第16期 自 平成30年2月8日 至 平成31年2月7日	第17期 自 平成31年2月8日 至 令和2年2月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第16期 平成31年2月7日現在	第17期 令和2年2月7日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第16期 平成31年2月7日現在	第17期 令和2年2月7日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	8,189,294,090	11,421,734,163
合計	8,189,294,090	11,421,734,163

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第16期 平成31年2月7日現在	第17期 令和2年2月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.4513円 (24,513円)	2.7679円 (27,679円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

令和2年2月7日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	36,349,147,451	99,680,267,054	
親投資信託受益証券	合計	36,349,147,451	99,680,267,054	
合計			99,680,267,054	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。



## 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

令和2年2月7日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,473,389,265
株式	263,153,477,450
派生商品評価勘定	143,184,510
未収配当金	415,029,156
流動資産合計	275,185,080,381
資産合計	
275,185,080,381	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,257,590
前受金	180,611,000
未払金	5,048,362,260
未払解約金	193,592,000
流動負債合計	5,424,822,850
負債合計	
5,424,822,850	
純資産の部	
元本等	
元本	98,370,254,055
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	171,390,003,476
元本等合計	269,760,257,531
純資産合計	
269,760,257,531	
負債純資産合計	
275,185,080,381	

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 平成31年2月8日 至 令和2年2月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和2年2月7日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	115,232,523,115円
同期中追加設定元本額	39,816,140,869円
同期中一部解約元本額	56,678,409,929円
元本の内訳 ファンド名	

One DC 国内株式インデックスファンド	13,753,125,332円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	2,300,256,155円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,872,943円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	5,009,685円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	7,743,904円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,418,134円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	18,818,754円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	10,586,919円
たわらノーロード TOPIX	545,594,662円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	324,239,506円
たわらノーロード バランス(堅実型)	10,938,893円
たわらノーロード バランス(標準型)	67,669,431円
たわらノーロード バランス(積極型)	103,376,978円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	439,198円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	31,315,589円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	98,543,681円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	66,484,262円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	135,912,579円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	193,848円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	830,832円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	1,814,864円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,287,993円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,036,718円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	36,349,147,451円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	994,502,045円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,256,411,336円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,366,803,245円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	348,375,776円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,182,324,299円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,119,029,562円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	38,945,261円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,120,067,435円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	25,180,737円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	307,430,970円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	239,536,588円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	419,353,751円
投資のソムリエ	8,729,703,223円
クルーズコントロール	410,638,853円
投資のソムリエ<DC年金>	829,749,325円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	261,682,155円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	316,105,471円
クルーズコントロール<DC年金>	412,795円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	2,507,282円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	7,001,423円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	474,307,956円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,017,761,432円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	5,883,416円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	4,725,965円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,914,158円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	13,386,629円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	35,525,818円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,093,711,974円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	217,750,260円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	900,539円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	766,807円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	889,213円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	197,398円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	97,721,972円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	53,537,910円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	748,659,317円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	42,276,864円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	90,882,753円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	205,217,487円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	13,081,740円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	49,099,169円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	14,085,281円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	11,090,446円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	26,577,334円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	55,241,538円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	856,834,056円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	856,427,853円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,443,533,162円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	174,658,821円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	48,206,798円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	469,721,881円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	125,441,570円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	2,312,004円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	35,583,091円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	490,063,850円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	37,551,836円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	134,171,540円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	347,374,438円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	876,490,927円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	53,451,662円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	23,728,407円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	13,986,618円
DIAMバランス40VA(適格機関投資家限定)	104,317円
DIAMバランス60VA(適格機関投資家限定)	121,717円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	380,720,505円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,210,952,937円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,605,155,025円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	65,047,821円
計	98,370,254,055円

2. 受益権の総数	98,370,254,055口
3. 差入代用有価証券 株式	1,965,500,000円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成31年2月8日 至 令和2年2月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和2年2月7日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	23,020,361,172	
合計	23,020,361,172	

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	令和2年2月7日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	6,373,149,000	-		141,051,000
合計	6,373,149,000	-		141,051,000

## (注) 時価の算定方法

## 株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	令和2年2月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.7423円 (27,423円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

令和2年2月7日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,100	2,888.00	14,728,800	
日本水産	146,500	609.00	89,218,500	
マルハニチロ	21,200	2,596.00	55,035,200	
ハウスイ	900	941.00	846,900	
カネコ種苗	4,500	1,333.00	5,998,500	
サカタのタネ	17,400	3,485.00	60,639,000	
ホクト	11,200	2,010.00	22,512,000	
ホクリヨウ	2,300	785.00	1,805,500	
ヒノキヤグループ	3,700	2,051.00	7,588,700	
ショーボンドホールディングス	22,700	4,655.00	105,668,500	
ミライト・ホールディングス	43,600	1,653.00	72,070,800	
タマホーム	6,900	1,441.00	9,942,900	
サンヨーホームズ	1,200	711.00	853,200	
日本アクア	5,800	618.00	3,584,400	
ファーストコーポレーション	4,500	598.00	2,691,000	
ベステラ	2,500	1,168.00	2,920,000	
TATERU	30,300	211.00	6,393,300	
スペースバリューホールディングス	17,800	563.00	10,021,400	
住石ホールディングス	30,100	141.00	4,244,100	
日鉄鉱業	3,400	4,485.00	15,249,000	
三井松島ホールディングス	5,700	1,159.00	6,606,300	
国際石油開発帝石	587,500	1,077.50	633,031,250	
石油資源開発	19,200	2,804.00	53,836,800	
K&Oエナジーグループ	7,100	1,675.00	11,892,500	
ダイセキ環境ソリューション	2,900	1,133.00	3,285,700	
第一カッター興業	1,800	1,784.00	3,211,200	
安藤・間	87,200	927.00	80,834,400	
東急建設	42,900	791.00	33,933,900	
コムシスホールディングス	51,900	3,180.00	165,042,000	

ビーアールホールディングス	16,000	475.00	7,600,000	
高松コンストラクショングループ	9,100	2,711.00	24,670,100	
東建コーポレーション	4,500	7,800.00	35,100,000	
ソネック	1,500	807.00	1,210,500	
ヤマウラ	6,400	963.00	6,163,200	
大成建設	112,800	4,465.00	503,652,000	
大林組	338,100	1,266.00	428,034,600	
清水建設	343,200	1,165.00	399,828,000	
飛島建設	9,700	1,444.00	14,006,800	
長谷工コーポレーション	130,900	1,494.00	195,564,600	
松井建設	13,400	781.00	10,465,400	
銭高組	1,400	4,025.00	5,635,000	
鹿島建設	265,500	1,451.00	385,240,500	
不動テトラ	8,900	1,718.00	15,290,200	
大末建設	4,000	999.00	3,996,000	
鉄建建設	7,300	2,817.00	20,564,100	
西松建設	26,000	2,571.00	66,846,000	
三井住友建設	81,700	646.00	52,778,200	
大豊建設	7,600	2,783.00	21,150,800	
前田建設工業	84,700	1,095.00	92,746,500	
佐田建設	7,400	437.00	3,233,800	
ナカノフドー建設	9,300	491.00	4,566,300	
奥村組	18,400	2,904.00	53,433,600	
東鉄工業	14,500	3,285.00	47,632,500	
イチケン	2,400	1,807.00	4,336,800	
富士ピー・エス	5,000	585.00	2,925,000	
浅沼組	3,800	5,150.00	19,570,000	
戸田建設	140,300	754.00	105,786,200	
熊谷組	15,700	3,305.00	51,888,500	
北野建設	2,000	2,545.00	5,090,000	
植木組	1,500	2,638.00	3,957,000	
矢作建設工業	14,900	860.00	12,814,000	
ピーエス三菱	11,100	752.00	8,347,200	
日本ハウスホールディングス	23,200	473.00	10,973,600	
大東建託	40,500	12,960.00	524,880,000	
新日本建設	14,400	930.00	13,392,000	
N I P P O	27,900	2,741.00	76,473,900	
東亜道路工業	2,100	3,590.00	7,539,000	
前田道路	35,800	3,695.00	132,281,000	
日本道路	3,300	7,600.00	25,080,000	
東亜建設工業	10,500	1,754.00	18,417,000	
日本国土開発	19,800	613.00	12,137,400	
若築建設	6,100	1,668.00	10,174,800	
東洋建設	37,900	525.00	19,897,500	
五洋建設	134,000	690.00	92,460,000	
世紀東急工業	16,200	925.00	14,985,000	
福田組	3,900	5,050.00	19,695,000	
日本ドライケミカル	2,700	1,759.00	4,749,300	
住友林業	85,700	1,649.00	141,319,300	
日本基礎技術	11,400	402.00	4,582,800	

巴コーポレーション	15,200	425.00	6,460,000
大和ハウス工業	334,500	3,600.00	1,204,200,000
ライト工業	19,400	1,570.00	30,458,000
積水ハウス	369,900	2,442.00	903,295,800
日特建設	8,900	865.00	7,698,500
北陸電気工事	5,800	1,159.00	6,722,200
ユアテック	19,400	678.00	13,153,200
四電工	1,700	2,712.00	4,610,400
中電工	13,700	2,560.00	35,072,000
関電工	48,100	1,054.00	50,697,400
きんでん	80,400	1,872.00	150,508,800
東京エネシス	11,200	898.00	10,057,600
トーエネック	3,400	3,750.00	12,750,000
住友電設	9,600	2,525.00	24,240,000
日本電設工業	18,600	2,366.00	44,007,600
協和エクシオ	51,300	2,810.00	144,153,000
新日本空調	9,000	2,140.00	19,260,000
日本工営	6,900	3,630.00	25,047,000
九電工	23,800	3,235.00	76,993,000
三機工業	24,400	1,506.00	36,746,400
日揮ホールディングス	104,100	1,560.00	162,396,000
中外炉工業	3,700	1,717.00	6,352,900
ヤマト	10,800	829.00	8,953,200
太平電業	8,200	2,421.00	19,852,200
高砂熱学工業	29,400	1,971.00	57,947,400
三晃金属工業	1,400	2,667.00	3,733,800
NEC ネットエスアイ	10,000	4,215.00	42,150,000
朝日工業社	2,200	3,475.00	7,645,000
明星工業	21,800	842.00	18,355,600
大気社	16,400	3,970.00	65,108,000
ダイダン	8,100	2,989.00	24,210,900
日比谷総合設備	10,900	1,950.00	21,255,000
日本製粉	31,600	1,706.00	53,909,600
日清製粉グループ本社	122,300	1,932.00	236,283,600
日東富士製粉	700	6,300.00	4,410,000
昭和産業	10,000	3,115.00	31,150,000
鳥越製粉	9,700	835.00	8,099,500
中部飼料	13,300	1,721.00	22,889,300
フィード・ワン	72,900	187.00	13,632,300
東洋精糖	1,700	1,195.00	2,031,500
日本甜菜製糖	5,700	1,952.00	11,126,400
三井製糖	9,500	2,210.00	20,995,000
塩水港精糖	11,300	231.00	2,610,300
日新製糖	5,100	2,049.00	10,449,900
LIFULL	36,000	583.00	20,988,000
ジェイエイシーリクルートメント	6,900	1,719.00	11,861,100
日本M&Aセンター	77,800	3,830.00	297,974,000
メンバーズ	3,100	1,666.00	5,164,600
中広	1,100	551.00	606,100
UTグループ	12,100	2,628.00	31,798,800



アイティメディア	3,100	1,063.00	3,295,300	
タケエイ	9,900	1,080.00	10,692,000	
E・Jホールディングス	1,200	1,754.00	2,104,800	
ビーネックスグループ	11,300	1,135.00	12,825,500	
コシダカホールディングス	24,800	1,555.00	38,564,000	
アルトナー	2,500	846.00	2,115,000	
パソナグループ	11,100	1,430.00	15,873,000	
CDS	2,500	1,527.00	3,817,500	
リンクアンドモチベーション	22,700	555.00	12,598,500	
GCA	12,400	940.00	11,656,000	
エス・エム・エス	32,000	2,344.00	75,008,000	
サニーサイドアップグループ	2,300	1,073.00	2,467,900	
パーソルホールディングス	103,000	2,178.00	224,334,000	
リニカル	5,000	1,089.00	5,445,000	
クックパッド	36,100	329.00	11,876,900	
エスクリ	3,300	774.00	2,554,200	
アイ・ケイ・ケイ	5,100	739.00	3,768,900	
森永製菓	25,400	5,410.00	137,414,000	
中村屋	2,800	4,080.00	11,424,000	
江崎グリコ	32,100	4,900.00	157,290,000	
名糖産業	5,200	1,412.00	7,342,400	
井村屋グループ	4,600	1,948.00	8,960,800	
不二家	6,000	2,288.00	13,728,000	
山崎製パン	81,200	2,101.00	170,601,200	
第一屋製パン	1,800	935.00	1,683,000	
モロゾフ	1,800	5,050.00	9,090,000	
亀田製菓	6,200	5,110.00	31,682,000	
寿スピリッツ	10,400	6,920.00	71,968,000	
カルビー	49,400	3,255.00	160,797,000	
森永乳業	20,000	4,530.00	90,600,000	
六甲バター	7,100	1,650.00	11,715,000	
ヤクルト本社	74,500	5,740.00	427,630,000	
明治ホールディングス	71,600	7,400.00	529,840,000	
雪印メグミルク	26,100	2,607.00	68,042,700	
プリマハム	16,900	2,671.00	45,139,900	
日本ハム	41,400	4,785.00	198,099,000	
林兼産業	3,700	719.00	2,660,300	
丸大食品	11,600	2,204.00	25,566,400	
S Foods	8,700	2,678.00	23,298,600	
柿安本店	3,800	3,255.00	12,369,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	69,800	711.00	49,627,800	
学情	3,700	2,389.00	8,839,300	
スタジオアリス	5,200	1,907.00	9,916,400	
クロスキャット	2,800	1,264.00	3,539,200	
シミックホールディングス	5,700	1,718.00	9,792,600	
エプコ	1,600	1,380.00	2,208,000	
システナ	37,700	1,675.00	63,147,500	
NJS	2,200	1,811.00	3,984,200	
デジタルアーツ	5,200	5,590.00	29,068,000	
日鉄ソリューションズ	15,900	3,275.00	52,072,500	

総合警備保障	41,000	5,710.00	234,110,000
キューブシステム	5,600	779.00	4,362,400
いちご	135,300	423.00	57,231,900
エイジア	1,900	1,557.00	2,958,300
日本駐車場開発	117,200	151.00	17,697,200
コア	4,500	1,428.00	6,426,000
カカクコム	77,100	3,080.00	237,468,000
アイロムグループ	3,700	1,616.00	5,979,200
セントケア・ホールディング	6,700	478.00	3,202,600
サイネックス	1,700	686.00	1,166,200
ルネサンス	5,700	1,757.00	10,014,900
ディップ	14,500	3,675.00	53,287,500
SBSホールディングス	9,300	1,906.00	17,725,800
オプトホールディング	5,600	1,621.00	9,077,600
新日本科学	11,200	628.00	7,033,600
ツクイ	24,300	578.00	14,045,400
キャリアデザインセンター	2,700	1,226.00	3,310,200
ベネフィット・ワン	28,200	2,015.00	56,823,000
エムスリー	227,100	3,160.00	717,636,000
ツカダ・グローバルホールディング	6,700	583.00	3,906,100
プラス	800	803.00	642,400
アウトソーシング	59,000	995.00	58,705,000
ウェルネット	9,800	711.00	6,967,800
ワールドホールディングス	3,500	1,712.00	5,992,000
ディー・エヌ・エー	50,500	1,533.00	77,416,500
博報堂DYホールディングス	143,300	1,607.00	230,283,100
ぐるなび	18,000	866.00	15,588,000
タカミヤ	11,000	613.00	6,743,000
ジャパンベストレスキューシステム	6,900	953.00	6,575,700
ファンコミュニケーションズ	28,400	477.00	13,546,800
ライク	4,100	1,956.00	8,019,600
ビジネス・ブレークスルー	4,400	400.00	1,760,000
エスプール	19,900	852.00	16,954,800
WDBホールディングス	4,700	2,750.00	12,925,000
ティア	6,100	604.00	3,684,400
CDG	1,100	1,408.00	1,548,800
パリュウ・コマース	5,800	2,681.00	15,549,800
インフォマート	112,900	884.00	99,803,600
サッポロホールディングス	36,900	2,703.00	99,740,700
アサヒグループホールディングス	226,600	5,112.00	1,158,379,200
麒麟ホールディングス	459,000	2,499.00	1,147,041,000
宝ホールディングス	81,000	1,006.00	81,486,000
オエノンホールディングス	28,700	394.00	11,307,800
養命酒製造	3,400	1,983.00	6,742,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	76,000	3,010.00	228,760,000
サントリー食品インターナショナル	72,400	4,720.00	341,728,000
ダイドーグループホールディングス	5,600	4,140.00	23,184,000
伊藤園	32,800	5,450.00	178,760,000
キーコーヒー	10,700	2,295.00	24,556,500

ユニカフェ	2,900	969.00	2,810,100
ジャパンフーズ	1,500	1,257.00	1,885,500
日清オイリオグループ	14,000	3,790.00	53,060,000
不二製油グループ本社	26,400	2,901.00	76,586,400
かどや製油	1,100	3,905.00	4,295,500
J-オイルミルズ	5,600	4,390.00	24,584,000
ローソン	26,800	6,390.00	171,252,000
サンエー	8,900	4,625.00	41,162,500
カワチ薬品	8,300	2,226.00	18,475,800
エービーシー・マート	16,600	7,220.00	119,852,000
ハードオフコーポレーション	4,200	820.00	3,444,000
高千穂交易	4,100	1,172.00	4,805,200
アスクル	11,100	3,585.00	39,793,500
ゲオホールディングス	19,100	1,250.00	23,875,000
アダストリア	14,700	2,136.00	31,399,200
ジーフット	6,400	628.00	4,019,200
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,500	670.00	1,005,000
伊藤忠食品	2,400	5,200.00	12,480,000
くら寿司	5,500	5,840.00	32,120,000
キャンドゥ	5,100	1,683.00	8,583,300
エレマテック	9,900	1,046.00	10,355,400
パルグループホールディングス	5,400	3,400.00	18,360,000
JALUX	3,100	2,388.00	7,402,800
エディオン	48,800	1,061.00	51,776,800
あらた	8,500	4,650.00	39,525,000
サーラコーポレーション	21,600	631.00	13,629,600
ワッツ	4,800	627.00	3,009,600
トーメンデバイス	1,600	3,980.00	6,368,000
ハローズ	4,000	2,830.00	11,320,000
J Pホールディングス	32,400	319.00	10,335,600
フジオフードシステム	9,000	1,769.00	15,921,000
あみやき亭	2,200	3,525.00	7,755,000
東京エレクトロン デバイス	3,900	2,638.00	10,288,200
ひらまつ	19,600	274.00	5,370,400
フィールズ	8,200	571.00	4,682,200
双日	586,600	356.00	208,829,600
アルフレッサ ホールディングス	118,000	2,377.00	280,486,000
大黒天物産	2,500	3,630.00	9,075,000
ハニーズホールディングス	9,400	1,392.00	13,084,800
ファーマライズホールディングス	2,500	659.00	1,647,500
キッコーマン	77,900	5,710.00	444,809,000
味の素	239,000	1,956.50	467,603,500
キュービー	60,300	2,254.00	135,916,200
ハウス食品グループ本社	40,500	3,650.00	147,825,000
カゴメ	41,100	2,852.00	117,217,200
焼津水産化学工業	5,300	1,032.00	5,469,600
アリアケジャパン	9,900	7,260.00	71,874,000
ピエトロ	1,400	1,642.00	2,298,800
エバラ食品工業	2,500	2,180.00	5,450,000
やまみ	500	2,154.00	1,077,000

ニチレイ	51,500	2,802.00	144,303,000
横浜冷凍	29,900	989.00	29,571,100
東洋水産	55,700	4,775.00	265,967,500
イトアンド	3,800	1,902.00	7,227,600
大冷	1,400	1,984.00	2,777,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,900	1,201.00	7,085,900
日清食品ホールディングス	46,000	9,170.00	421,820,000
永谷園ホールディングス	5,300	2,198.00	11,649,400
一正蒲鉾	4,000	984.00	3,936,000
フジッコ	11,700	1,967.00	23,013,900
ロック・フィールド	11,700	1,486.00	17,386,200
日本たばこ産業	624,900	2,301.00	1,437,894,900
ケンコーマヨネーズ	6,100	2,494.00	15,213,400
わらべや日洋ホールディングス	7,100	1,949.00	13,837,900
なとり	6,100	1,741.00	10,620,100
イフジ産業	1,900	759.00	1,442,100
ピクルスコーポレーション	2,300	2,825.00	6,497,500
北の達人コーポレーション	37,700	647.00	24,391,900
ユーグレナ	46,200	908.00	41,949,600
スター・マイカ・ホールディングス	5,500	1,718.00	9,449,000
片倉工業	15,400	1,295.00	19,943,000
グンゼ	7,800	4,425.00	34,515,000
ヒューリック	227,100	1,364.00	309,764,400
神栄	1,500	796.00	1,194,000
ラサ商事	5,600	940.00	5,264,000
アルペン	8,200	1,910.00	15,662,000
ハブ	3,100	1,048.00	3,248,800
ラクーンホールディングス	5,100	817.00	4,166,700
クオールホールディングス	15,600	1,508.00	23,524,800
アルコニックス	11,200	1,331.00	14,907,200
神戸物産	36,600	4,370.00	159,942,000
ソリトンシステムズ	4,600	1,267.00	5,828,200
ジーンズホールディングス	5,600	7,780.00	43,568,000
ビックカメラ	62,900	1,188.00	74,725,200
DCMホールディングス	57,300	1,063.00	60,909,900
ペッパーフードサービス	8,500	948.00	8,058,000
Monotaro	75,500	2,816.00	212,608,000
東京一番フーズ	2,700	620.00	1,674,000
DDホールディングス	4,200	1,671.00	7,018,200
あいホールディングス	15,200	1,874.00	28,484,800
ディービーエクス	3,800	944.00	3,587,200
きちりホールディングス	2,900	779.00	2,259,100
アークランドサービスホールディングス	7,800	2,030.00	15,834,000
J・フロントリテイリング	126,800	1,346.00	170,672,800
ドトール・日レスホールディングス	16,900	2,115.00	35,743,500
マツモトキヨシホールディングス	43,900	4,435.00	194,696,500
ブロンコピリー	5,500	2,657.00	14,613,500
ZOZO	73,000	1,807.00	131,911,000
トレジャー・ファクトリー	3,200	870.00	2,784,000

物語コーポレーション	2,700	9,020.00	24,354,000	
ココカラファイン	11,100	5,660.00	62,826,000	
三越伊勢丹ホールディングス	185,600	848.00	157,388,800	
東洋紡	41,700	1,580.00	65,886,000	
ユニチカ	31,200	351.00	10,951,200	
富士紡ホールディングス	5,100	3,735.00	19,048,500	
日清紡ホールディングス	71,800	1,027.00	73,738,600	
倉敷紡績	10,900	2,450.00	26,705,000	
ダイワボウホールディングス	9,100	6,390.00	58,149,000	
シキボウ	5,600	1,282.00	7,179,200	
日東紡績	16,000	4,810.00	76,960,000	
トヨタ紡織	31,400	1,681.00	52,783,400	
マクニカ・富士エレホールディングス	25,300	1,783.00	45,109,900	
H a m e e	3,300	1,700.00	5,610,000	
ラクト・ジャパン	4,000	4,265.00	17,060,000	
ウエルシアホールディングス	31,600	6,320.00	199,712,000	
クリエイトSDホールディングス	17,800	2,883.00	51,317,400	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,000	1,065.00	21,300,000	
八洲電機	8,300	923.00	7,660,900	
メディアスホールディングス	6,000	820.00	4,920,000	
レスターホールディングス	11,100	1,901.00	21,101,100	
ジューテックホールディングス	2,300	1,163.00	2,674,900	
丸善CHIホールディングス	12,400	368.00	4,563,200	
大光	4,600	672.00	3,091,200	
OCHIホールディングス	3,100	1,496.00	4,637,600	
TOKAIホールディングス	56,200	1,023.00	57,492,600	
黒谷	1,900	503.00	955,700	
ミサワ	2,100	671.00	1,409,100	
ティーライフ	1,400	913.00	1,278,200	
C o m i n i x	1,800	820.00	1,476,000	
エー・ピーカンパニー	2,000	639.00	1,278,000	
三洋貿易	10,600	1,329.00	14,087,400	
チムニー	3,300	2,352.00	7,761,600	
シュッピン	7,200	1,072.00	7,718,400	
ビューティガレージ	1,700	2,193.00	3,728,100	
ウイン・パートナーズ	7,600	1,138.00	8,648,800	
ネクステージ	15,200	1,069.00	16,248,800	
ジョイフル本田	31,100	1,378.00	42,855,800	
鳥貴族	3,500	2,550.00	8,925,000	
キリン堂ホールディングス	4,200	1,801.00	7,564,200	
ホットランド	7,100	1,303.00	9,251,300	
すかいらーくホールディングス	119,000	2,064.00	245,616,000	
SFPホールディングス	4,500	2,247.00	10,111,500	
綿半ホールディングス	4,000	1,951.00	7,804,000	
日本毛織	34,800	1,084.00	37,723,200	
ダイトウボウ	17,800	165.00	2,937,000	
トーア紡コーポレーション	4,100	531.00	2,177,100	
ダイドーリミテッド	14,100	271.00	3,821,100	
ヨシックス	1,700	2,828.00	4,807,600	

ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	30,900	981.00	30,312,900	
三栄建築設計	4,300	1,505.00	6,471,500	
野村不動産ホールディングス	64,500	2,748.00	177,246,000	
三重交通グループホールディングス	21,500	600.00	12,900,000	
サムティ	15,100	1,886.00	28,478,600	
ディア・ライフ	13,700	608.00	8,329,600	
コーセーアールイー	3,200	621.00	1,987,200	
エー・ディー・ワークス	201,800	29.00	5,852,200	
日本商業開発	6,700	1,722.00	11,537,400	
プレサンスコーポレーション	17,400	1,345.00	23,403,000	
ユニゾホールディングス	16,000	5,570.00	89,120,000	
フィル・カンパニー	1,400	4,005.00	5,607,000	
THEグローバル社	5,500	458.00	2,519,000	
ハウスコム	1,400	1,588.00	2,223,200	
日本管理センター	7,000	1,378.00	9,646,000	
サンセイランディック	3,200	889.00	2,844,800	
エストラスト	1,400	882.00	1,234,800	
フージャースホールディングス	21,200	705.00	14,946,000	
オープンハウス	30,900	3,035.00	93,781,500	
東急不動産ホールディングス	289,300	800.00	231,440,000	
飯田グループホールディングス	88,700	1,888.00	167,465,600	
イーグランド	1,700	857.00	1,456,900	
ムゲンエステート	7,300	697.00	5,088,100	
帝国繊維	11,800	2,515.00	29,677,000	
日本コークス工業	92,100	77.00	7,091,700	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,900	644.00	3,155,600	
ミタチ産業	3,200	726.00	2,323,200	
B E E N O S	4,000	1,275.00	5,100,000	
あさひ	8,000	1,349.00	10,792,000	
日本調剤	3,300	3,785.00	12,490,500	
コスモス薬品	4,700	25,100.00	117,970,000	
シップヘルスケアホールディングス	17,000	5,100.00	86,700,000	
トーエル	5,200	824.00	4,284,800	
ソフトクリエイティブホールディングス	4,600	1,790.00	8,234,000	
オンリー	1,800	794.00	1,429,200	
セブン&アイ・ホールディングス	415,400	4,367.00	1,814,051,800	
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	28,600	2,359.00	67,467,400	
明治電機工業	3,400	1,520.00	5,168,000	
ツルハホールディングス	23,100	13,560.00	313,236,000	
デリカフーズホールディングス	3,900	718.00	2,800,200	
スターティアホールディングス	2,400	790.00	1,896,000	
サンマルクホールディングス	8,400	2,231.00	18,740,400	
フェリシモ	2,300	995.00	2,288,500	
トリドールホールディングス	13,200	2,667.00	35,204,400	
帝人	86,200	2,088.00	179,985,600	
東レ	764,700	728.10	556,778,070	
クラレ	166,400	1,374.00	228,633,600	
旭化成	700,000	1,100.00	770,000,000	

サカイオーベックス	2,900	1,796.00	5,208,400	
TOKYO BASE	9,600	520.00	4,992,000	
稲葉製作所	6,000	1,386.00	8,316,000	
宮地エンジニアリンググループ	3,300	2,088.00	6,890,400	
トーカロ	29,600	1,224.00	36,230,400	
アルファ	3,800	1,334.00	5,069,200	
SUMCO	127,700	1,768.00	225,773,600	
川田テクノロジーズ	2,100	6,640.00	13,944,000	
RS Technologies	3,100	2,909.00	9,017,900	
信和	4,600	1,102.00	5,069,200	
ビーロット	2,400	1,835.00	4,404,000	
ファーストブラザーズ	2,400	1,223.00	2,935,200	
ハウズドゥ	5,900	1,311.00	7,734,900	
シーアールイー	2,700	1,151.00	3,107,700	
プロパティエージェント	1,600	1,157.00	1,851,200	
ケイアイスター不動産	3,400	1,929.00	6,558,600	
アグレ都市デザイン	1,500	523.00	784,500	
グッドコムアセット	2,400	2,186.00	5,246,400	
ジェイ・エス・ビー	1,100	5,310.00	5,841,000	
テンポイノベーション	2,400	922.00	2,212,800	
グローバル・リンク・マネジメント	1,700	610.00	1,037,000	
住江織物	2,300	2,484.00	5,713,200	
日本フェルト	5,700	502.00	2,861,400	
イチカワ	1,500	1,422.00	2,133,000	
エコナックホールディングス	18,800	151.00	2,838,800	
日東製網	1,200	1,700.00	2,040,000	
芦森工業	2,200	1,372.00	3,018,400	
アツギ	8,800	775.00	6,820,000	
ウイルプラスホールディングス	1,600	910.00	1,456,000	
JMホールディングス	5,400	2,339.00	12,630,600	
コメダホールディングス	23,200	2,213.00	51,341,600	
サツドラホールディングス	1,500	1,880.00	2,820,000	
アレンザホールディングス	5,300	1,010.00	5,353,000	
串カツ田中ホールディングス	1,600	2,363.00	3,780,800	
パロックジャパンリミテッド	7,300	993.00	7,248,900	
クスリのアオキホールディングス	9,500	7,020.00	66,690,000	
ダイニック	3,900	811.00	3,162,900	
共和レザー	5,800	789.00	4,576,200	
力の源ホールディングス	4,800	1,030.00	4,944,000	
スシローグローバルホールディングス	11,600	9,800.00	113,680,000	
LIXILビバ	10,500	2,231.00	23,425,500	
アセンテック	800	2,485.00	1,988,000	
セーレン	26,000	1,606.00	41,756,000	
ソトー	3,800	973.00	3,697,400	
東海染工	1,400	1,136.00	1,590,400	
小松マテーレ	17,300	830.00	14,359,000	
ワコールホールディングス	27,500	3,005.00	82,637,500	
ホギメディカル	12,000	3,620.00	43,440,000	
レナウン	28,200	107.00	3,017,400	
クラウドディアホールディングス	2,900	484.00	1,403,600	

T S Iホールディングス	35,500	537.00	19,063,500
マツオカコーポレーション	3,100	1,931.00	5,986,100
ワールド	15,000	2,599.00	38,985,000
T I S	35,300	7,090.00	250,277,000
ネオス	4,300	738.00	3,173,400
電算システム	4,100	2,813.00	11,533,300
グリー	64,900	492.00	31,930,800
コーエーテックモホールディングス	21,600	3,155.00	68,148,000
三菱総合研究所	4,600	4,605.00	21,183,000
ボルテージ	1,900	510.00	969,000
電算	1,200	2,243.00	2,691,600
A G S	5,900	853.00	5,032,700
ファインデックス	9,000	1,223.00	11,007,000
ブレインパッド	2,100	5,750.00	12,075,000
K L a b	20,400	821.00	16,748,400
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	12,700	985.00	12,509,500
イーブクイニシアティブジャパン	1,500	1,756.00	2,634,000
ネクソン	301,200	1,651.00	497,281,200
アイスタイル	27,300	450.00	12,285,000
エムアップ	3,100	2,998.00	9,293,800
エイチーム	7,200	966.00	6,955,200
エニグモ	7,500	907.00	6,802,500
テクノスジャパン	8,300	522.00	4,332,600
e n i s h	4,700	555.00	2,608,500
コロプラ	34,700	948.00	32,895,600
オルトプラス	7,900	899.00	7,102,100
ブロードリーフ	52,500	632.00	33,180,000
クロス・マーケティンググループ	4,900	361.00	1,768,900
デジタルハーツホールディングス	5,600	968.00	5,420,800
システム情報	5,400	1,007.00	5,437,800
メディアドゥホールディングス	3,400	3,215.00	10,931,000
じげん	26,200	514.00	13,466,800
ブイキューブ	6,500	638.00	4,147,000
エンカレッジ・テクノロジー	1,700	880.00	1,496,000
サイバーリンクス	1,600	1,145.00	1,832,000
ディー・エル・イー	7,900	195.00	1,540,500
フィックスターズ	11,200	1,525.00	17,080,000
C A R T A H O L D I N G S	5,100	1,079.00	5,502,900
オブティム	2,800	4,650.00	13,020,000
セレス	3,500	1,183.00	4,140,500
S H I F T	2,800	8,170.00	22,876,000
特種東海製紙	6,700	4,120.00	27,604,000
ティーガイア	9,400	2,566.00	24,120,400
セック	1,500	3,925.00	5,887,500
日本アジアグループ	11,100	377.00	4,184,700
豆蔵ホールディングス	7,200	1,882.00	13,550,400
テクマトリックス	7,400	2,863.00	21,186,200
プロシッパ	3,100	1,365.00	4,231,500



ガンホー・オンライン・エンターテイメント	25,500	2,103.00	53,626,500	
GMOペイメントゲートウェイ	17,400	7,350.00	127,890,000	
ザッパラス	5,600	385.00	2,156,000	
システムリサーチ	2,900	1,929.00	5,594,100	
インターネットイニシアティブ	15,600	3,250.00	50,700,000	
さくらインターネット	11,300	651.00	7,356,300	
ヴィンクス	3,000	1,125.00	3,375,000	
GMOクラウド	1,900	2,590.00	4,921,000	
SRAホールディングス	5,600	2,745.00	15,372,000	
システムインテグレータ	3,400	911.00	3,097,400	
朝日ネット	7,500	718.00	5,385,000	
eBASE	6,300	1,754.00	11,050,200	
アバント	7,500	1,055.00	7,912,500	
アドソル日進	3,800	2,529.00	9,610,200	
フリービット	6,300	889.00	5,600,700	
コムチュア	11,800	2,416.00	28,508,800	
サイバーコム	1,800	2,054.00	3,697,200	
アステリア	6,400	574.00	3,673,600	
アイル	3,800	1,924.00	7,311,200	
王子ホールディングス	441,300	613.00	270,516,900	
日本製紙	46,700	1,861.00	86,908,700	
三菱製紙	12,000	473.00	5,676,000	
北越コーポレーション	70,000	527.00	36,890,000	
中越パルプ工業	4,500	1,600.00	7,200,000	
巴川製紙所	3,200	943.00	3,017,600	
大王製紙	46,300	1,483.00	68,662,900	
阿波製紙	2,800	561.00	1,570,800	
マークライNZ	5,300	2,045.00	10,838,500	
メディカル・データ・ビジョン	8,100	900.00	7,290,000	
gumi	13,600	745.00	10,132,000	
ショーケース	2,400	711.00	1,706,400	
モバイルファクトリー	2,300	1,817.00	4,179,100	
テラスカイ	3,800	3,150.00	11,970,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,700	1,734.00	8,149,800	
PCIホールディングス	2,100	2,481.00	5,210,100	
パイブドHD	1,300	1,930.00	2,509,000	
アイピーシー	1,900	1,425.00	2,707,500	
ネオジャパン	1,900	1,239.00	2,354,100	
PR TIMES	900	2,567.00	2,310,300	
ランドコンピュータ	1,600	1,166.00	1,865,600	
ダブルスタンダード	1,300	4,335.00	5,635,500	
オープンドア	5,200	1,345.00	6,994,000	
マイネット	3,500	689.00	2,411,500	
アカツキ	3,800	5,290.00	20,102,000	
ベネフィットジャパン	800	1,766.00	1,412,800	
Ubicomホールディングス	2,300	1,531.00	3,521,300	
LINE	24,200	5,380.00	130,196,000	
カナミックネットワーク	6,400	681.00	4,358,400	

ノムラシステムコーポレーション	2,300	507.00	1,166,100
レンゴー	99,900	907.00	90,609,300
トーモク	6,500	1,844.00	11,986,000
ザ・バック	8,000	4,165.00	33,320,000
チェンジ	2,100	3,730.00	7,833,000
シンクロ・フード	4,600	551.00	2,534,600
オークネット	6,500	1,237.00	8,040,500
セグエグループ	1,700	877.00	1,490,900
エイトレッド	1,300	1,391.00	1,808,300
AOI TYO HOLDINGS	10,700	714.00	7,639,800
マクロミル	18,900	1,016.00	19,202,400
ビーグリー	2,000	1,288.00	2,576,000
オロ	2,800	3,500.00	9,800,000
テモナ	1,300	558.00	725,400
ニーズウェル	1,200	827.00	992,400
サインポスト	1,600	2,005.00	3,208,000
昭和電工	75,200	2,755.00	207,176,000
住友化学	776,000	464.00	360,064,000
住友精化	4,700	3,145.00	14,781,500
日産化学	59,100	4,840.00	286,044,000
ラサ工業	3,800	1,501.00	5,703,800
クレハ	9,100	6,300.00	57,330,000
多木化学	3,100	4,545.00	14,089,500
テイカ	7,800	1,916.00	14,944,800
石原産業	19,000	967.00	18,373,000
片倉コープアグリ	3,000	1,245.00	3,735,000
日本曹達	15,600	3,410.00	53,196,000
東ソー	163,300	1,718.00	280,549,400
トクヤマ	30,500	2,847.00	86,833,500
セントラル硝子	21,600	2,424.00	52,358,400
東亜合成	66,400	1,302.00	86,452,800
大阪ソーダ	10,800	2,984.00	32,227,200
関東電化工業	25,100	1,037.00	26,028,700
デンカ	38,600	3,050.00	117,730,000
イビデン	66,000	2,712.00	178,992,000
信越化学工業	181,300	13,645.00	2,473,838,500
日本カーバイド工業	3,700	1,369.00	5,065,300
堺化学工業	6,800	2,318.00	15,762,400
第一稀元素化学工業	11,500	948.00	10,902,000
エア・ウォーター	90,200	1,563.00	140,982,600
大陽日酸	101,500	2,282.00	231,623,000
日本化学工業	3,300	2,921.00	9,639,300
東邦アセチレン	1,500	1,383.00	2,074,500
日本パーカライズン	53,300	1,184.00	63,107,200
高圧ガス工業	16,900	816.00	13,790,400
チタン工業	1,300	2,413.00	3,136,900
四国化成工業	16,300	1,311.00	21,369,300
戸田工業	2,400	2,157.00	5,176,800
ステラ ケミファ	5,800	3,150.00	18,270,000
保土谷化学工業	4,000	4,525.00	18,100,000

日本触媒	16,400	6,230.00	102,172,000
大日精化工業	9,400	2,978.00	27,993,200
カネカ	27,300	3,520.00	96,096,000
協和キリン	108,400	2,831.00	306,880,400
三菱瓦斯化学	99,700	1,870.00	186,439,000
三井化学	96,000	2,634.00	252,864,000
J S R	98,400	2,163.00	212,839,200
東京応化工業	18,200	4,735.00	86,177,000
大阪有機化学工業	9,800	1,817.00	17,806,600
三菱ケミカルホールディングス	706,200	793.20	560,157,840
K Hネオケム	18,600	2,433.00	45,253,800
ダイセル	144,500	1,048.00	151,436,000
住友ベークライト	16,600	4,155.00	68,973,000
積水化学工業	227,100	1,874.00	425,585,400
日本ゼオン	95,300	1,265.00	120,554,500
アイカ工業	31,700	3,620.00	114,754,000
宇部興産	53,300	2,236.00	119,178,800
積水樹脂	19,000	2,529.00	48,051,000
タキロンシーアイ	22,800	690.00	15,732,000
旭有機材	6,000	1,721.00	10,326,000
日立化成	48,900	4,605.00	225,184,500
ニチパン	5,600	1,782.00	9,979,200
リケンテクノス	26,700	483.00	12,896,100
大倉工業	5,000	1,763.00	8,815,000
積水化成品工業	14,200	713.00	10,124,600
群栄化学工業	2,400	2,455.00	5,892,000
タイガースポリマー	5,600	582.00	3,259,200
ミライアル	3,800	1,244.00	4,727,200
ダイキアクシス	3,800	874.00	3,321,200
ダイキョーニシカワ	22,200	809.00	17,959,800
竹本容器	3,800	901.00	3,423,800
森六ホールディングス	5,700	2,261.00	12,887,700
日本化薬	65,400	1,327.00	86,785,800
カーリットホールディングス	11,300	589.00	6,655,700
E P Sホールディングス	15,500	1,355.00	21,002,500
ソルクシーズ	4,500	905.00	4,072,500
レグス	2,500	1,575.00	3,937,500
プレステージ・インターナショナル	38,600	1,035.00	39,951,000
フェイス	3,800	811.00	3,081,800
プロトコーポレーション	9,500	1,412.00	13,414,000
ハイマックス	1,200	1,971.00	2,365,200
アミューズ	5,600	2,834.00	15,870,400
野村総合研究所	149,900	2,734.00	409,826,600
ドリームインキュベータ	3,200	1,761.00	5,635,200
サイバネットシステム	7,500	818.00	6,135,000
クイック	6,400	1,487.00	9,516,800
T A C	6,700	211.00	1,413,700
C Eホールディングス	6,100	494.00	3,013,400
ケネディクス	98,000	582.00	57,036,000
日本システム技術	1,700	1,378.00	2,342,600

電通グループ	106,200	3,660.00	388,692,000
インテージホールディングス	13,300	909.00	12,089,700
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,000	1,021.00	4,084,000
東邦システムサイエンス	2,900	908.00	2,633,200
ぴあ	2,900	4,485.00	13,006,500
イオンファンタジー	4,000	2,424.00	9,696,000
ソースネクスト	50,200	495.00	24,849,000
シーティーエス	11,600	698.00	8,096,800
ネクシィーズグループ	3,600	1,603.00	5,770,800
インフォコム	11,500	3,030.00	34,845,000
メディカルシステムネットワーク	10,300	504.00	5,191,200
日本精化	8,600	1,329.00	11,429,400
扶桑化学工業	10,700	3,590.00	38,413,000
トリケミカル研究所	2,300	11,930.00	27,439,000
HEROZ	500	5,340.00	2,670,000
ラクスル	5,600	3,715.00	20,804,000
FIG	11,600	300.00	3,480,000
システムサポート	900	2,597.00	2,337,300
ADEKA	48,700	1,658.00	80,744,600
日油	39,800	3,960.00	157,608,000
ミヨシ油脂	4,400	1,213.00	5,337,200
新日本理化	18,000	209.00	3,762,000
ハリマ化成グループ	8,800	1,130.00	9,944,000
イーソル	3,800	2,433.00	9,245,400
アルテリア・ネットワークス	11,700	1,995.00	23,341,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,400	1,711.00	4,106,400
花王	258,100	8,673.00	2,238,501,300
第一工業製薬	4,000	4,665.00	18,660,000
石原ケミカル	3,000	1,843.00	5,529,000
日華化学	3,700	863.00	3,193,100
ニイタカ	1,600	2,289.00	3,662,400
三洋化成工業	6,300	5,000.00	31,500,000
武田薬品工業	897,100	4,498.00	4,035,155,800
アステラス製薬	948,400	1,984.50	1,882,099,800
大日本住友製薬	79,900	1,917.00	153,168,300
塩野義製薬	137,900	6,773.00	933,996,700
わかもと製薬	13,000	258.00	3,354,000
あすか製薬	12,300	1,199.00	14,747,700
日本新薬	28,300	9,360.00	264,888,000
ピオフェルミン製薬	1,700	2,381.00	4,047,700
中外製薬	112,400	12,270.00	1,379,148,000
科研製薬	18,500	6,140.00	113,590,000
エーザイ	129,000	9,350.00	1,206,150,000
理研ビタミン	5,100	4,095.00	20,884,500
ロート製薬	55,300	3,265.00	180,554,500
小野薬品工業	247,600	2,690.50	666,167,800
久光製薬	28,500	5,830.00	166,155,000
有機合成薬品工業	8,500	271.00	2,303,500
持田製薬	15,000	4,370.00	65,550,000

参天製薬	200,800	2,100.00	421,680,000	
扶桑薬品工業	3,800	1,985.00	7,543,000	
日本ケミファ	1,400	2,640.00	3,696,000	
ツムラ	33,500	3,085.00	103,347,500	
日医工	30,600	1,346.00	41,187,600	
テルモ	305,100	3,941.00	1,202,399,100	
みらかホールディングス	28,900	3,025.00	87,422,500	
キッセイ薬品工業	19,100	3,115.00	59,496,500	
生化学工業	20,800	1,259.00	26,187,200	
栄研化学	19,000	2,320.00	44,080,000	
日水製薬	4,600	1,338.00	6,154,800	
鳥居薬品	6,700	3,725.00	24,957,500	
JCRファーマ	7,600	10,050.00	76,380,000	
東和薬品	13,800	2,570.00	35,466,000	
富士製薬工業	7,300	1,378.00	10,059,400	
沢井製薬	22,100	7,390.00	163,319,000	
ゼリア新薬工業	19,600	2,135.00	41,846,000	
第一三共	308,500	8,180.00	2,523,530,000	
キョーリン製薬ホールディングス	23,800	2,225.00	52,955,000	
大幸薬品	4,400	3,945.00	17,358,000	
ダイト	6,300	3,770.00	23,751,000	
大塚ホールディングス	205,400	5,092.00	1,045,896,800	
大正製薬ホールディングス	22,700	8,300.00	188,410,000	
ペプチドリーム	54,600	5,400.00	294,840,000	
大日本塗料	12,000	1,165.00	13,980,000	
日本ペイントホールディングス	87,200	5,450.00	475,240,000	
関西ペイント	118,700	2,566.00	304,584,200	
神東塗料	8,800	207.00	1,821,600	
中国塗料	30,100	1,022.00	30,762,200	
日本特殊塗料	8,000	1,405.00	11,240,000	
藤倉化成	14,500	580.00	8,410,000	
太陽ホールディングス	7,800	5,140.00	40,092,000	
DIC	44,700	2,980.00	133,206,000	
サカタインクス	23,200	1,233.00	28,605,600	
東洋インキSCホールディングス	22,400	2,582.00	57,836,800	
T&K TOKA	8,400	1,025.00	8,610,000	
アルプス技研	9,100	2,130.00	19,383,000	
サニックス	18,100	320.00	5,792,000	
ダイオーズ	2,000	1,379.00	2,758,000	
日本空調サービス	10,800	752.00	8,121,600	
オリエンタルランド	109,500	14,660.00	1,605,270,000	
フォーカスシステムズ	6,500	1,052.00	6,838,000	
ダスキン	26,400	3,060.00	80,784,000	
パーク24	57,100	2,775.00	158,452,500	
明光ネットワークジャパン	12,100	956.00	11,567,600	
ファルコホールディングス	5,700	2,162.00	12,323,400	
クレスコ	6,500	1,877.00	12,200,500	
フジ・メディア・ホールディングス	101,900	1,542.00	157,129,800	
秀英予備校	2,300	457.00	1,051,100	
田谷	2,000	636.00	1,272,000	

ラウンドワン	28,800	1,057.00	30,441,600
リゾートトラスト	47,200	1,768.00	83,449,600
オービック	36,700	15,680.00	575,456,000
ジャストシステム	17,200	5,760.00	99,072,000
TDCソフト	9,300	971.00	9,030,300
Zホールディングス	1,452,900	437.00	634,917,300
ピー・エム・エル	13,300	3,175.00	42,227,500
ワタベウェディング	1,600	540.00	864,000
トレンドマイクロ	47,000	6,050.00	284,350,000
りらいあコミュニケーションズ	18,700	1,486.00	27,788,200
IDホールディングス	4,100	1,583.00	6,490,300
リソー教育	47,100	375.00	17,662,500
日本オラクル	21,400	9,870.00	211,218,000
早稲田アカデミー	3,400	1,082.00	3,678,800
アルファシステムズ	3,300	2,910.00	9,603,000
フューチャー	12,700	1,879.00	23,863,300
CAC Holdings	6,800	1,494.00	10,159,200
SBテクノロジー	3,800	2,427.00	9,222,600
トーセ	2,900	940.00	2,726,000
ユー・エス・エス	115,400	2,006.00	231,492,400
オービックビジネスコンサルタント	10,800	4,375.00	47,250,000
伊藤忠テクノソリューションズ	48,200	3,345.00	161,229,000
アイティフォー	12,900	791.00	10,203,900
東京個別指導学院	3,700	714.00	2,641,800
東計電算	1,500	4,295.00	6,442,500
サイバーエージェント	59,300	4,375.00	259,437,500
楽天	480,200	874.00	419,694,800
エクスネット	1,600	966.00	1,545,600
クリーク・アンド・リバー社	5,300	1,052.00	5,575,600
テー・オー・ダブリュー	9,000	929.00	8,361,000
大塚商会	57,200	5,090.00	291,148,000
サイボウズ	12,300	2,089.00	25,694,700
ソフトブレイン	6,200	572.00	3,546,400
山田コンサルティンググループ	5,000	1,478.00	7,390,000
セントラルスポーツ	3,900	3,070.00	11,973,000
パラカ	2,800	2,034.00	5,695,200
電通国際情報サービス	6,500	4,730.00	30,745,000
デジタルガレージ	19,100	4,245.00	81,079,500
イーエムシステムズ	14,900	922.00	13,737,800
ウェザーニューズ	3,600	3,905.00	14,058,000
C I J	7,900	874.00	6,904,600
ビジネスエンジニアリング	1,200	3,390.00	4,068,000
日本エンタープライズ	10,800	265.00	2,862,000
WOWOW	5,100	2,716.00	13,851,600
スカラ	7,500	756.00	5,670,000
インテリジェント ウェイブ	4,000	774.00	3,096,000
フルキャストホールディングス	10,300	2,480.00	25,544,000
エン・ジャパン	18,400	4,650.00	85,560,000
富士フイルムホールディングス	206,700	5,428.00	1,121,967,600
コニカミノルタ	235,600	701.00	165,155,600

資生堂	214,300	7,108.00	1,523,244,400	
ライオン	140,200	2,119.00	297,083,800	
高砂香料工業	6,800	2,438.00	16,578,400	
マンダム	24,300	2,677.00	65,051,100	
ミルボン	14,400	5,670.00	81,648,000	
ファンケル	43,700	3,110.00	135,907,000	
コーセー	20,300	14,870.00	301,861,000	
コタ	5,700	1,491.00	8,498,700	
シーボン	1,200	2,466.00	2,959,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	46,000	2,461.00	113,206,000	
ノエビアホールディングス	10,300	5,360.00	55,208,000	
アジュバンコスメジャパン	2,300	995.00	2,288,500	
エステー	6,900	1,702.00	11,743,800	
アグロ カネショウ	3,400	1,445.00	4,913,000	
コニシ	17,700	1,618.00	28,638,600	
長谷川香料	14,400	2,270.00	32,688,000	
星光PMC	6,300	959.00	6,041,700	
小林製薬	30,200	9,140.00	276,028,000	
荒川化学工業	9,700	1,550.00	15,035,000	
メック	7,400	1,714.00	12,683,600	
日本高純度化学	3,100	2,698.00	8,363,800	
タカラバイオ	28,200	2,417.00	68,159,400	
JCU	13,100	3,160.00	41,396,000	
新田ゼラチン	6,700	672.00	4,502,400	
OATアグリオ	1,800	1,457.00	2,622,600	
デクセリアルズ	27,800	932.00	25,909,600	
アース製薬	8,200	6,010.00	49,282,000	
北興化学工業	11,100	655.00	7,270,500	
大成ラミック	3,300	2,868.00	9,464,400	
クミアイ化学工業	44,700	896.00	40,051,200	
日本農薬	19,400	583.00	11,310,200	
富士興産	3,300	702.00	2,316,600	
ニチレキ	12,700	1,391.00	17,665,700	
ユシロ化学工業	6,000	1,411.00	8,466,000	
ピーピー・カストロール	3,900	1,470.00	5,733,000	
富士石油	29,000	227.00	6,583,000	
MORESCO	4,000	1,418.00	5,672,000	
出光興産	121,300	2,835.00	343,885,500	
JXTGホールディングス	1,621,800	483.00	783,329,400	
コスモエネルギーホールディングス	31,200	2,177.00	67,922,400	
横浜ゴム	62,400	1,894.00	118,185,600	
TOYO TIRE	61,900	1,415.00	87,588,500	
ブリヂストン	331,400	4,012.00	1,329,576,800	
住友ゴム工業	96,900	1,249.00	121,028,100	
藤倉コンポジット	9,500	442.00	4,199,000	
オカモト	6,500	3,940.00	25,610,000	
アキレス	7,400	1,755.00	12,987,000	
フコク	4,700	705.00	3,313,500	
ニッタ	12,100	3,275.00	39,627,500	
クリエートメディック	3,600	1,080.00	3,888,000	

住友理工	20,900	881.00	18,412,900
三ツ星ベルト	14,200	1,964.00	27,888,800
バンドー化学	19,000	846.00	16,074,000
A G C	106,600	3,620.00	385,892,000
日本板硝子	51,500	598.00	30,797,000
石塚硝子	1,900	2,652.00	5,038,800
有沢製作所	17,000	1,026.00	17,442,000
日本山村硝子	4,500	1,234.00	5,553,000
日本電気硝子	43,300	2,198.00	95,173,400
オハラ	4,300	1,259.00	5,413,700
住友大阪セメント	20,400	4,540.00	92,616,000
太平洋セメント	68,100	3,040.00	207,024,000
リソルホールディングス	1,000	4,255.00	4,255,000
日本ヒューム	10,800	812.00	8,769,600
日本コンクリート工業	23,400	284.00	6,645,600
三谷セキサン	5,000	3,915.00	19,575,000
アジアパイルホールディングス	15,300	579.00	8,858,700
東海カーボン	112,900	1,027.00	115,948,300
日本カーボン	5,500	3,835.00	21,092,500
東洋炭素	6,300	2,148.00	13,532,400
ノリタケカンパニーリミテド	5,900	4,495.00	26,520,500
T O T O	77,000	5,010.00	385,770,000
日本碍子	131,600	1,908.00	251,092,800
日本特殊陶業	83,900	1,967.00	165,031,300
ダントーホールディングス	8,000	115.00	920,000
M A R U W A	4,200	8,100.00	34,020,000
品川リフラクトリーズ	2,900	3,105.00	9,004,500
黒崎播磨	2,100	6,570.00	13,797,000
ヨータイ	8,600	685.00	5,891,000
イソライト工業	5,500	595.00	3,272,500
東京窯業	13,800	318.00	4,388,400
ニッカトー	4,900	676.00	3,312,400
フジインコーポレーテッド	9,600	3,085.00	29,616,000
クニミネ工業	4,400	1,361.00	5,988,400
エーアンドエーマテリアル	1,800	1,552.00	2,793,600
ニチアス	29,500	2,743.00	80,918,500
日本製鉄	477,300	1,552.00	740,769,600
神戸製鋼所	195,100	504.00	98,330,400
中山製鋼所	14,900	495.00	7,375,500
合同製鉄	5,700	2,949.00	16,809,300
ジェイ エフ イー ホールディングス	287,900	1,348.00	388,089,200
東京製鉄	52,000	849.00	44,148,000
共英製鋼	12,000	1,910.00	22,920,000
大和工業	22,600	2,619.00	59,189,400
東京製鋼	4,400	1,492.00	6,564,800
大阪製鉄	5,700	1,628.00	9,279,600
淀川製鋼所	14,400	2,007.00	28,900,800
丸一鋼管	34,600	3,170.00	109,682,000
モリ工業	3,200	3,010.00	9,632,000



大同特殊鋼	17,400	4,520.00	78,648,000
日本高周波鋼業	4,200	433.00	1,818,600
日本冶金工業	8,900	2,147.00	19,108,300
山陽特殊製鋼	7,600	1,425.00	10,830,000
愛知製鋼	6,000	3,565.00	21,390,000
日立金属	114,800	1,790.00	205,492,000
日本金属	2,400	852.00	2,044,800
大平洋金属	7,200	2,282.00	16,430,400
新日本電工	69,200	172.00	11,902,400
栗本鐵工所	5,300	2,192.00	11,617,600
虹 技	1,600	1,330.00	2,128,000
日本鑄鉄管	1,100	1,502.00	1,652,200
日本製鋼所	32,300	2,148.00	69,380,400
三菱製鋼	8,000	1,083.00	8,664,000
日亜鋼業	15,700	326.00	5,118,200
日本精線	1,700	3,790.00	6,443,000
エンビプロ・ホールディングス	4,100	745.00	3,054,500
大紀アルミニウム工業所	17,500	703.00	12,302,500
日本軽金属ホールディングス	270,000	214.00	57,780,000
三井金属鉱業	28,800	2,689.00	77,443,200
東邦亜鉛	5,500	1,955.00	10,752,500
三菱マテリアル	70,500	2,886.00	203,463,000
住友金属鉱山	136,300	3,215.00	438,204,500
DOWAホールディングス	27,000	4,070.00	109,890,000
古河機械金属	19,000	1,390.00	26,410,000
エス・サイエンス	47,600	46.00	2,189,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,100	1,371.00	15,218,100
東邦チタニウム	19,100	869.00	16,597,900
UACJ	16,200	2,323.00	37,632,600
CKサンエツ	1,900	3,320.00	6,308,000
古河電気工業	33,100	2,609.00	86,357,900
住友電気工業	398,600	1,518.00	605,074,800
フジクラ	128,700	380.00	48,906,000
昭和電線ホールディングス	12,300	1,361.00	16,740,300
東京特殊電線	1,600	2,531.00	4,049,600
タツタ電線	21,100	592.00	12,491,200
カナレ電気	1,700	1,834.00	3,117,800
平河ヒューテック	4,000	1,409.00	5,636,000
リョービ	13,200	1,833.00	24,195,600
アーレスティ	14,000	527.00	7,378,000
アサヒホールディングス	18,700	2,738.00	51,200,600
東洋製罐グループホールディングス	67,900	1,969.00	133,695,100
ホッカインホールディングス	5,900	1,970.00	11,623,000
コロナ	5,900	1,040.00	6,136,000
横河ブリッジホールディングス	19,900	2,283.00	45,431,700
OSJBホールディングス	53,100	286.00	15,186,600
駒井ハルテック	1,900	1,872.00	3,556,800
高田機工	900	2,823.00	2,540,700
三和ホールディングス	102,300	1,215.00	124,294,500
文化シャッター	31,500	870.00	27,405,000

三協立山	14,800	1,496.00	22,140,800
アルインコ	7,800	1,177.00	9,180,600
東洋シャッター	2,500	675.00	1,687,500
LIXILグループ	157,400	1,874.00	294,967,600
日本フィルコン	8,300	531.00	4,407,300
ノーリツ	22,100	1,394.00	30,807,400
長府製作所	10,800	2,361.00	25,498,800
リンナイ	20,700	7,870.00	162,909,000
ユニプレス	20,900	1,450.00	30,305,000
ダイニチ工業	5,700	698.00	3,978,600
日東精工	14,700	609.00	8,952,300
三洋工業	1,400	2,007.00	2,809,800
岡部	21,600	884.00	19,094,400
ジーテクト	13,300	1,594.00	21,200,200
東ブレ	19,900	1,737.00	34,566,300
高周波熱錬	20,500	913.00	18,716,500
東京製綱	7,600	1,137.00	8,641,200
サンコール	6,100	539.00	3,287,900
モリテックスチール	8,400	383.00	3,217,200
パイオラックス	15,700	1,973.00	30,976,100
エイチワン	10,500	716.00	7,518,000
日本発条	114,300	937.00	107,099,100
中央発條	1,200	2,982.00	3,578,400
アドバネクス	1,300	1,725.00	2,242,500
三浦工業	46,100	4,230.00	195,003,000
タクマ	36,100	1,251.00	45,161,100
テクノプロ・ホールディングス	20,700	7,750.00	160,425,000
アトラ	2,300	318.00	731,400
インターワークス	1,900	545.00	1,035,500
アイ・アールジャパンホールディングス	4,200	6,100.00	25,620,000
KeepPer 技研	3,900	1,261.00	4,917,900
ファーストロジック	2,300	604.00	1,389,200
三機サービス	2,100	1,062.00	2,230,200
Gunosy	7,100	1,252.00	8,889,200
デザインワン・ジャパン	2,000	306.00	612,000
イー・ガーディアン	5,200	2,082.00	10,826,400
リブセンス	6,700	290.00	1,943,000
ジャパンマテリアル	31,700	1,639.00	51,956,300
ベクトル	12,900	1,222.00	15,763,800
ウチヤマホールディングス	5,200	506.00	2,631,200
チャーム・ケア・コーポレーション	7,500	905.00	6,787,500
ライクキッズ	2,400	857.00	2,056,800
キャリアリンク	3,400	585.00	1,989,000
I B J	7,000	1,270.00	8,890,000
アサンテ	4,200	1,955.00	8,211,000
N・フィールド	7,100	621.00	4,409,100
バリューHR	2,000	3,040.00	6,080,000
M&Aキャピタルパートナーズ	7,300	3,855.00	28,141,500

ライドオンエクスプレスホールディングス	3,900	1,881.00	7,335,900	
E R Iホールディングス	3,000	797.00	2,391,000	
アビスト	1,600	2,634.00	4,214,400	
シグマクシス	7,000	1,852.00	12,964,000	
ウィルグループ	6,700	1,101.00	7,376,700	
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,500	219.00	3,175,500	
リクルートホールディングス	738,000	4,520.00	3,335,760,000	
エラン	6,100	1,730.00	10,553,000	
ツガミ	22,000	1,054.00	23,188,000	
オークマ	12,400	5,230.00	64,852,000	
東芝機械	12,000	3,380.00	40,560,000	
アマダホールディングス	135,500	1,177.00	159,483,500	
アイダエンジニアリング	27,900	912.00	25,444,800	
滝澤鉄工所	3,300	1,359.00	4,484,700	
F U J I	45,800	1,848.00	84,638,400	
牧野フライス製作所	12,400	4,295.00	53,258,000	
オーエスジー	49,300	1,921.00	94,705,300	
ダイジェット工業	1,200	1,430.00	1,716,000	
旭ダイヤモンド工業	27,900	610.00	17,019,000	
D M G森精機	67,400	1,637.00	110,333,800	
ソディック	25,100	878.00	22,037,800	
ディスコ	14,500	26,470.00	383,815,000	
日東工器	5,800	2,564.00	14,871,200	
日進工具	3,200	2,873.00	9,193,600	
パンチ工業	9,800	473.00	4,635,400	
富士ダイス	4,600	724.00	3,330,400	
土木管理総合試験所	4,500	426.00	1,917,000	
ネットマーケティング	3,800	998.00	3,792,400	
日本郵政	844,500	1,030.50	870,257,250	
ベルシステム24ホールディングス	17,200	1,577.00	27,124,400	
鎌倉新書	7,600	1,714.00	13,026,400	
S M N	1,600	880.00	1,408,000	
一蔵	1,100	690.00	759,000	
L I T A L I C O	3,600	2,803.00	10,090,800	
グローバルキッズCOMPANY	1,500	794.00	1,191,000	
エアトリ	4,600	1,616.00	7,433,600	
アトラエ	2,700	3,790.00	10,233,000	
ストライク	3,900	5,220.00	20,358,000	
ソラスト	28,400	1,161.00	32,972,400	
セラク	3,300	1,278.00	4,217,400	
インソース	5,000	3,265.00	16,325,000	
豊田自動織機	87,300	6,250.00	545,625,000	
豊和工業	5,900	825.00	4,867,500	
O K K	4,400	622.00	2,736,800	
石川製作所	2,500	1,623.00	4,057,500	
東洋機械金属	7,500	526.00	3,945,000	
津田駒工業	2,000	1,137.00	2,274,000	
エンシュウ	2,500	1,243.00	3,107,500	
島精機製作所	17,100	2,189.00	37,431,900	

オプトラン	11,900	3,010.00	35,819,000
NCホールディングス	3,300	681.00	2,247,300
イワキ	5,100	1,228.00	6,262,800
フリー	10,400	1,181.00	12,282,400
ヤマシンフィルタ	23,200	776.00	18,003,200
日阪製作所	13,200	947.00	12,500,400
やまびこ	20,700	1,113.00	23,039,100
平田機工	5,000	6,560.00	32,800,000
ペガサスミシン製造	10,700	482.00	5,157,400
マルマエ	4,400	1,012.00	4,452,800
タツモ	5,000	1,263.00	6,315,000
ナブテスコ	62,800	3,195.00	200,646,000
三井海洋開発	11,300	2,085.00	23,560,500
レオン自動機	10,500	1,472.00	15,456,000
S M C	33,900	50,750.00	1,720,425,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	9,300	514.00	4,780,200
ホソカワミクロン	3,800	5,090.00	19,342,000
ユニオンツール	4,000	3,040.00	12,160,000
オイレス工業	13,800	1,614.00	22,273,200
日精エー・エス・ビー機械	3,600	3,930.00	14,148,000
サトーホールディングス	15,200	3,155.00	47,956,000
技研製作所	9,400	4,875.00	45,825,000
日本エアテック	3,400	869.00	2,954,600
カワタ	3,200	995.00	3,184,000
日精樹脂工業	9,000	966.00	8,694,000
オカダアイヨン	3,400	1,244.00	4,229,600
ワイエイシイホールディングス	4,600	658.00	3,026,800
小松製作所	488,300	2,398.50	1,171,187,550
住友重機械工業	61,700	2,901.00	178,991,700
日立建機	43,100	3,025.00	130,377,500
日工	14,800	810.00	11,988,000
巴工業	4,600	2,228.00	10,248,800
井関農機	10,800	1,519.00	16,405,200
T O W A	10,900	1,113.00	12,131,700
丸山製作所	2,200	1,548.00	3,405,600
北川鉄工所	4,800	2,219.00	10,651,200
シンニッタン	16,600	463.00	7,685,800
ローツェ	4,700	4,165.00	19,575,500
タカキタ	3,700	564.00	2,086,800
クボタ	572,100	1,791.50	1,024,917,150
荏原実業	2,700	2,047.00	5,526,900
東洋エンジニアリング	14,200	592.00	8,406,400
三菱化工機	3,800	2,025.00	7,695,000
月島機械	19,900	1,449.00	28,835,100
帝国電機製作所	8,900	1,406.00	12,513,400
東京機械製作所	4,700	362.00	1,701,400
新東工業	25,500	922.00	23,511,000
澁谷工業	9,400	3,125.00	29,375,000
アイチコーポレーション	18,700	731.00	13,669,700

小森コーポレーション	27,300	995.00	27,163,500	
鶴見製作所	8,400	1,849.00	15,531,600	
住友精密工業	1,600	3,255.00	5,208,000	
日本ギア工業	3,500	399.00	1,396,500	
酒井重工業	2,000	2,754.00	5,508,000	
荏原製作所	44,600	3,505.00	156,323,000	
石井鐵工所	1,400	2,829.00	3,960,600	
西島製作所	10,900	897.00	9,777,300	
北越工業	11,100	1,326.00	14,718,600	
ダイキン工業	137,400	16,345.00	2,245,803,000	
オルガノ	3,900	7,390.00	28,821,000	
トーヨーカネツ	4,700	2,216.00	10,415,200	
栗田工業	58,300	3,495.00	203,758,500	
椿本チエイン	15,400	3,530.00	54,362,000	
大同工業	5,200	808.00	4,201,600	
日機装	32,300	1,370.00	44,251,000	
木村化工機	9,000	606.00	5,454,000	
レイズネクスト	18,200	1,403.00	25,534,600	
アネスト岩田	16,700	1,042.00	17,401,400	
ダイフク	55,100	6,910.00	380,741,000	
サムコ	3,000	1,996.00	5,988,000	
加藤製作所	5,900	1,665.00	9,823,500	
油研工業	1,700	1,715.00	2,915,500	
タダノ	52,000	1,068.00	55,536,000	
フジテック	39,200	1,780.00	69,776,000	
C K D	30,000	1,910.00	57,300,000	
キトー	8,200	1,709.00	14,013,800	
平和	30,100	2,268.00	68,266,800	
理想科学工業	9,500	1,883.00	17,888,500	
SANKYO	24,000	3,835.00	92,040,000	
日本金銭機械	11,900	848.00	10,091,200	
マースグループホールディングス	6,800	1,989.00	13,525,200	
フクシマガリレイ	6,600	4,195.00	27,687,000	
オーイズミ	4,600	561.00	2,580,600	
ダイコク電機	5,000	1,573.00	7,865,000	
竹内製作所	18,100	1,963.00	35,530,300	
アマノ	28,300	3,015.00	85,324,500	
JUKI	15,000	802.00	12,030,000	
サンデンホールディングス	14,200	660.00	9,372,000	
蛇の目ミシン工業	10,100	412.00	4,161,200	
ブラザー工業	131,600	2,320.00	305,312,000	
マックス	16,400	2,084.00	34,177,600	
モリタホールディングス	18,900	1,757.00	33,207,300	
グローリー	27,600	3,195.00	88,182,000	
新晃工業	10,000	1,764.00	17,640,000	
大和冷機工業	15,600	1,176.00	18,345,600	
セガサミーホールディングス	107,000	1,583.00	169,381,000	
日本ピストンリング	4,000	1,480.00	5,920,000	
リケン	5,000	3,670.00	18,350,000	
T P R	14,500	1,885.00	27,332,500	

ツバキ・ナカシマ	22,000	1,340.00	29,480,000
ホシザキ	31,500	10,560.00	332,640,000
大豊工業	8,900	727.00	6,470,300
日本精工	203,000	951.00	193,053,000
NTN	249,600	299.00	74,630,400
ジェイテクト	103,400	1,209.00	125,010,600
不二越	10,000	4,270.00	42,700,000
ミネベアミツミ	200,100	2,243.00	448,824,300
日本トムソン	31,900	467.00	14,897,300
THK	62,700	2,911.00	182,519,700
ユーシン精機	8,400	927.00	7,786,800
前澤給装工業	3,900	2,287.00	8,919,300
イーグル工業	13,300	992.00	13,193,600
前澤工業	7,100	396.00	2,811,600
日本ピラー工業	10,900	1,592.00	17,352,800
キッツ	43,800	778.00	34,076,400
日立製作所	518,100	4,269.00	2,211,768,900
三菱電機	1,078,200	1,632.00	1,759,622,400
富士電機	65,000	3,595.00	233,675,000
東洋電機製造	4,300	1,504.00	6,467,200
安川電機	116,100	3,950.00	458,595,000
シンフォニアテクノロジー	14,000	1,259.00	17,626,000
明電舎	19,800	2,075.00	41,085,000
オリジン	3,000	1,539.00	4,617,000
山洋電気	5,200	5,500.00	28,600,000
デンヨー	9,200	2,137.00	19,660,400
ベイカレント・コンサルティング	6,200	8,290.00	51,398,000
Orchestra Holdings	2,000	1,196.00	2,392,000
アイモバイル	3,300	695.00	2,293,500
キャリアインデックス	4,200	375.00	1,575,000
MS - Japan	3,400	1,294.00	4,399,600
船場	1,700	1,037.00	1,762,900
グレイステクノロジー	4,700	3,080.00	14,476,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	10,800	2,451.00	26,470,800
フルテック	1,200	1,185.00	1,422,000
グリーンズ	3,900	932.00	3,634,800
ツナググループ・ホールディングス	1,200	735.00	882,000
GAMewith	2,200	741.00	1,630,200
ソウルドアウト	1,600	2,174.00	3,478,400
MS&Consulting	1,400	1,120.00	1,568,000
日総工産	6,800	841.00	5,718,800
キュービーネットホールディングス	4,300	2,398.00	10,311,400
RPAホールディングス	5,800	1,055.00	6,119,000
三櫻工業	13,700	1,049.00	14,371,300
マキタ	140,600	4,310.00	605,986,000
東芝テック	13,500	4,395.00	59,332,500
芝浦メカトロニクス	1,900	3,655.00	6,944,500
マブチモーター	29,900	4,015.00	120,048,500

日本電産	129,700	14,895.00	1,931,881,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,500	425.00	2,762,500	
トレックス・セミコンダクター	6,200	1,517.00	9,405,400	
東光高岳	6,000	1,192.00	7,152,000	
ダブル・スコープ	16,700	773.00	12,909,100	
宮越ホールディングス	4,000	896.00	3,584,000	
ダイヘン	11,800	3,615.00	42,657,000	
ヤーマン	15,600	683.00	10,654,800	
JVCケンウッド	88,000	249.00	21,912,000	
ミマキエンジニアリング	9,600	517.00	4,963,200	
第一精工	4,000	2,420.00	9,680,000	
日新電機	25,300	1,218.00	30,815,400	
大崎電気工業	21,400	632.00	13,524,800	
オムロン	96,700	6,840.00	661,428,000	
日東工業	15,800	2,313.00	36,545,400	
I D E C	15,600	2,000.00	31,200,000	
正興電機製作所	2,500	1,137.00	2,842,500	
不二電機工業	1,200	1,242.00	1,490,400	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,000	2,245.00	80,820,000	
サクサホールディングス	2,500	2,055.00	5,137,500	
メルコホールディングス	3,800	2,734.00	10,389,200	
テクノメディカ	2,400	2,066.00	4,958,400	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	1,700	978.00	1,662,600	
日本電気	130,900	5,010.00	655,809,000	
富士通	103,900	12,715.00	1,321,088,500	
沖電気工業	43,900	1,400.00	61,460,000	
岩崎通信機	4,800	831.00	3,988,800	
電気興業	5,200	3,665.00	19,058,000	
サンケン電気	11,700	2,932.00	34,304,400	
ナカヨ	1,900	1,662.00	3,157,800	
アイホン	6,100	1,759.00	10,729,900	
ルネサスエレクトロニクス	514,900	744.00	383,085,600	
セイコーエプソン	133,800	1,722.00	230,403,600	
ワコム	72,400	398.00	28,815,200	
アルバック	19,800	4,045.00	80,091,000	
アクセル	4,500	834.00	3,753,000	
E I Z O	8,400	3,935.00	33,054,000	
ジャパンディスプレイ	312,000	74.00	23,088,000	
日本信号	27,400	1,443.00	39,538,200	
京三製作所	25,200	567.00	14,288,400	
能美防災	14,300	2,500.00	35,750,000	
ホーチキ	7,900	1,481.00	11,699,900	
星和電機	5,400	591.00	3,191,400	
エレコム	11,700	4,275.00	50,017,500	
パナソニック	1,231,900	1,236.00	1,522,628,400	
シャープ	124,700	1,547.00	192,910,900	
アンリツ	69,500	2,149.00	149,355,500	
富士通ゼネラル	29,300	2,488.00	72,898,400	
ソニー	681,600	7,826.00	5,334,201,600	

T D K	52,000	12,070.00	627,640,000	
帝国通信工業	4,700	1,249.00	5,870,300	
タムラ製作所	36,000	646.00	23,256,000	
アルプスアルパイン	95,500	2,008.00	191,764,000	
池上通信機	3,500	1,111.00	3,888,500	
日本電波工業	9,800	485.00	4,753,000	
鈴木	5,800	784.00	4,547,200	
日本トリム	1,400	4,405.00	6,167,000	
ローランド ディー . ジー .	5,900	2,034.00	12,000,600	
フォスター電機	11,300	1,641.00	18,543,300	
S M K	2,800	3,130.00	8,764,000	
ヨコオ	6,900	3,020.00	20,838,000	
ティアック	8,000	199.00	1,592,000	
ホシデン	29,500	1,262.00	37,229,000	
ヒロセ電機	16,700	13,950.00	232,965,000	
日本航空電子工業	24,700	2,041.00	50,412,700	
T O A	11,500	1,080.00	12,420,000	
マクセルホールディングス	23,300	1,467.00	34,181,100	
古野電気	13,900	1,110.00	15,429,000	
ユニデンホールディングス	3,000	2,102.00	6,306,000	
スミダコーポレーション	8,300	1,178.00	9,777,400	
アイコム	6,000	2,665.00	15,990,000	
リオン	4,500	3,315.00	14,917,500	
本多通信工業	9,400	542.00	5,094,800	
船井電機	10,900	703.00	7,662,700	
横河電機	98,900	1,992.00	197,008,800	
新電元工業	3,800	3,510.00	13,338,000	
アズビル	68,000	3,010.00	204,680,000	
東亜ディーケーケー	5,300	1,032.00	5,469,600	
日本光電工業	44,600	3,490.00	155,654,000	
チノー	3,700	1,393.00	5,154,100	
共和電業	11,300	433.00	4,892,900	
日本電子材料	4,300	1,067.00	4,588,100	
堀場製作所	21,300	7,210.00	153,573,000	
アドバンテスト	80,200	5,650.00	453,130,000	
小野測器	4,200	608.00	2,553,600	
エスベック	9,500	2,379.00	22,600,500	
キーエンス	97,700	38,320.00	3,743,864,000	
日置電機	5,600	4,120.00	23,072,000	
シスメックス	77,000	8,202.00	631,554,000	
日本マイクロニクス	18,800	1,292.00	24,289,600	
メガチップス	10,000	1,829.00	18,290,000	
O B A R A G R O U P	5,600	3,680.00	20,608,000	
I M A G I C A G R O U P	9,000	514.00	4,626,000	
澤藤電機	1,300	2,156.00	2,802,800	
デンソー	237,400	4,529.00	1,075,184,600	
原田工業	5,100	1,000.00	5,100,000	
コーセル	13,200	1,157.00	15,272,400	
イリソ電子工業	9,100	4,295.00	39,084,500	
オブテックスグループ	17,600	1,556.00	27,385,600	



千代田インテグレ	5,000	2,126.00	10,630,000
アイ・オー・データ機器	4,000	1,043.00	4,172,000
レーザーテック	47,300	5,490.00	259,677,000
スタンレー電気	75,800	3,095.00	234,601,000
岩崎電気	4,200	1,666.00	6,997,200
ウシオ電機	62,600	1,614.00	101,036,400
岡谷電機産業	8,500	372.00	3,162,000
ヘリオス テクノ ホールディング	9,900	445.00	4,405,500
エノモト	3,300	1,309.00	4,319,700
日本セラミック	10,900	2,522.00	27,489,800
遠藤照明	5,400	706.00	3,812,400
古河電池	7,600	764.00	5,806,400
双信電機	5,400	442.00	2,386,800
山一電機	7,900	1,923.00	15,191,700
図研	7,000	2,641.00	18,487,000
日本電子	21,200	3,665.00	77,698,000
カシオ計算機	95,400	2,031.00	193,757,400
ファナック	102,400	20,895.00	2,139,648,000
日本シイエムケイ	25,400	540.00	13,716,000
エンプラス	5,500	3,070.00	16,885,000
大真空	4,000	1,771.00	7,084,000
ローム	47,800	8,580.00	410,124,000
浜松ホトニクス	77,300	4,865.00	376,064,500
三井ハイテック	11,900	1,714.00	20,396,600
新光電気工業	36,200	1,352.00	48,942,400
京セラ	151,700	7,328.00	1,111,657,600
協栄産業	1,200	1,454.00	1,744,800
太陽誘電	47,900	3,500.00	167,650,000
村田製作所	316,700	6,620.00	2,096,554,000
双葉電子工業	17,000	1,345.00	22,865,000
日東電工	74,500	6,310.00	470,095,000
北陸電気工業	4,300	1,168.00	5,022,400
東海理化電機製作所	28,400	1,926.00	54,698,400
ニチコン	36,600	958.00	35,062,800
日本ケミコン	8,200	1,774.00	14,546,800
K O A	16,200	1,250.00	20,250,000
三井E & Sホールディングス	39,000	953.00	37,167,000
日立造船	85,600	427.00	36,551,200
三菱重工業	180,700	4,009.00	724,426,300
川崎重工業	83,900	2,281.00	191,375,900
I H I	77,600	2,870.00	222,712,000
名村造船所	34,700	252.00	8,744,400
サノヤスホールディングス	13,200	178.00	2,349,600
スプリックス	3,500	1,126.00	3,941,000
マネジメントソリューションズ	1,100	3,620.00	3,982,000
日本車輛製造	4,000	3,085.00	12,340,000
三菱ロジスネクスト	14,300	1,600.00	22,880,000
近畿車輛	1,600	1,612.00	2,579,200
F P G	32,800	1,015.00	33,292,000
島根銀行	2,100	650.00	1,365,000

じもとホールディングス	72,200	105.00	7,581,000	
全国保証	30,000	4,485.00	134,550,000	
めぶきフィナンシャルグループ	552,600	251.00	138,702,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,400	1,289.00	18,561,600	
九州フィナンシャルグループ	174,500	468.00	81,666,000	
かんぽ生命保険	37,600	1,885.00	70,876,000	
ゆうちょ銀行	301,300	1,047.00	315,461,100	
富山第一銀行	25,400	333.00	8,458,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	625,300	437.00	273,256,100	
ジェイリース	3,000	386.00	1,158,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	72,500	738.00	53,505,000	
マーキュリアインベストメント	4,700	730.00	3,431,000	
イントラスト	3,800	778.00	2,956,400	
日本モーゲージサービス	2,100	1,982.00	4,162,200	
CASA	3,700	1,514.00	5,601,800	
アルヒ	16,900	1,614.00	27,276,600	
プレミアグループ	5,800	2,038.00	11,820,400	
日産自動車	1,271,600	596.10	758,000,760	
いすゞ自動車	312,400	1,140.50	356,292,200	
トヨタ自動車	1,203,100	7,862.00	9,458,772,200	代用有価証券 250,000株
日野自動車	134,600	1,055.00	142,003,000	
三菱自動車工業	399,000	425.00	169,575,000	
エフテック	7,500	734.00	5,505,000	
レシップホールディングス	4,400	687.00	3,022,800	
GMB	2,000	806.00	1,612,000	
ファルテック	1,900	1,079.00	2,050,100	
武蔵精密工業	24,000	1,338.00	32,112,000	
日産車体	21,100	1,061.00	22,387,100	
新明和工業	29,100	1,341.00	39,023,100	
極東開発工業	20,000	1,486.00	29,720,000	
日信工業	21,900	2,240.00	49,056,000	
トピー工業	8,900	1,829.00	16,278,100	
ティラド	3,900	1,847.00	7,203,300	
曙ブレーキ工業	59,300	236.00	13,994,800	
タチエス	17,600	1,420.00	24,992,000	
NOK	57,900	1,578.00	91,366,200	
フタバ産業	30,100	665.00	20,016,500	
KYB	12,000	3,060.00	36,720,000	
市光工業	16,100	693.00	11,157,300	
大同メタル工業	20,700	682.00	14,117,400	
プレス工業	53,500	377.00	20,169,500	
ミクニ	13,700	343.00	4,699,100	
太平洋工業	22,500	1,358.00	30,555,000	
ケーヒン	24,800	2,582.00	64,033,600	
河西工業	14,500	829.00	12,020,500	
アイシン精機	88,700	3,780.00	335,286,000	
マツダ	317,200	912.00	289,286,400	

今仙電機製作所	10,000	903.00	9,030,000	
本田技研工業	849,000	2,857.50	2,426,017,500	
スズキ	213,700	5,121.00	1,094,357,700	
S U B A R U	334,700	2,841.00	950,882,700	
安永	5,200	1,191.00	6,193,200	
ヤマハ発動機	140,600	2,104.00	295,822,400	
ショーワ	25,400	2,285.00	58,039,000	
小糸製作所	64,600	4,980.00	321,708,000	
T B K	12,900	466.00	6,011,400	
エクセディ	14,700	2,320.00	34,104,000	
ミツバ	19,900	757.00	15,064,300	
豊田合成	34,800	2,471.00	85,990,800	
愛三工業	16,900	720.00	12,168,000	
盟和産業	1,600	1,088.00	1,740,800	
日本プラスト	8,400	692.00	5,812,800	
ヨロズ	10,100	1,456.00	14,705,600	
エフ・シー・シー	17,600	2,248.00	39,564,800	
新家工業	2,400	1,457.00	3,496,800	
シマノ	40,400	18,000.00	727,200,000	
テイ・エス テック	25,000	3,155.00	78,875,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	62,400	614.00	38,313,600	
三十三フィナンシャルグループ	9,900	1,624.00	16,077,600	
第四北越フィナンシャルグループ	18,500	2,725.00	50,412,500	
ジャムコ	5,400	1,437.00	7,759,800	
小野建	9,600	1,373.00	13,180,800	
はるやまホールディングス	4,500	879.00	3,955,500	
南陽	2,100	1,856.00	3,897,600	
ノジマ	18,900	2,317.00	43,791,300	
佐島電機	7,900	883.00	6,975,700	
カップ・クリエイト	14,900	1,487.00	22,156,300	
エコトレーディング	2,300	576.00	1,324,800	
伯東	6,500	1,303.00	8,469,500	
コンドーテック	8,300	1,179.00	9,785,700	
中山福	6,200	520.00	3,224,000	
ライトオン	8,000	599.00	4,792,000	
ナガイレーベン	15,400	2,438.00	37,545,200	
ジーンズメイト	3,400	299.00	1,016,600	
三菱食品	11,600	3,195.00	37,062,000	
良品計画	141,000	1,872.00	263,952,000	
三城ホールディングス	11,500	345.00	3,967,500	
松田産業	7,800	1,583.00	12,347,400	
第一興商	15,800	5,360.00	84,688,000	
メディバルホールディングス	114,600	2,491.00	285,468,600	
アドヴァン	16,200	1,292.00	20,930,400	
S P K	2,200	2,683.00	5,902,600	
萩原電気ホールディングス	4,000	2,560.00	10,240,000	
アルビス	4,000	2,234.00	8,936,000	
アズワン	6,900	9,590.00	66,171,000	
スズデン	3,700	1,438.00	5,320,600	
尾家産業	3,100	1,337.00	4,144,700	

シモジマ	6,500	1,168.00	7,592,000
ドウシシャ	10,100	1,683.00	16,998,300
小津産業	2,300	1,840.00	4,232,000
コナカ	12,500	408.00	5,100,000
高速	6,300	1,234.00	7,774,200
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,696.00	2,204,800
G - 7ホールディングス	6,200	2,464.00	15,276,800
たけびし	3,500	1,471.00	5,148,500
イオン北海道	10,700	834.00	8,923,800
コジマ	18,300	519.00	9,497,700
ヒマラヤ	3,500	829.00	2,901,500
コーナン商事	15,100	2,481.00	37,463,100
ネットワンシステムズ	40,300	1,926.00	77,617,800
エコス	3,900	1,719.00	6,704,100
ワタミ	12,500	1,293.00	16,162,500
マルシェ	2,900	784.00	2,273,600
リックス	2,300	1,686.00	3,877,800
システムソフト	26,300	100.00	2,630,000
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	233,400	2,014.00	470,067,600
丸文	9,400	645.00	6,063,000
西松屋チェーン	23,300	974.00	22,694,200
ゼンショーホールディングス	50,900	2,412.00	122,770,800
ハビネット	8,900	1,354.00	12,050,600
幸楽苑ホールディングス	6,700	1,941.00	13,004,700
ハークスレイ	2,000	1,247.00	2,494,000
橋本総業ホールディングス	2,100	1,846.00	3,876,600
日本ライフライン	31,400	1,484.00	46,597,600
サイゼリヤ	17,500	2,522.00	44,135,000
タカショー	5,400	471.00	2,543,400
エクセル	3,100	1,596.00	4,947,600
V Tホールディングス	44,100	453.00	19,977,300
マルカ	3,800	2,158.00	8,200,400
アルゴグラフィックス	9,000	3,980.00	35,820,000
魚力	3,000	1,607.00	4,821,000
I D O M	28,700	580.00	16,646,000
日本エム・ディ・エム	6,200	2,016.00	12,499,200
ポブラ	2,800	511.00	1,430,800
フジ・コーポレーション	2,900	2,120.00	6,148,000
ユナイテッドアローズ	11,100	2,879.00	31,956,900
進和	6,300	2,279.00	14,357,700
エスケイジャパン	2,200	449.00	987,800
ダイトロン	4,500	1,906.00	8,577,000
ハイデイ日高	15,300	2,029.00	31,043,700
シークス	13,500	1,299.00	17,536,500
京都きもの友禅	7,000	339.00	2,373,000
コロワイド	35,300	2,220.00	78,366,000
ピーシーデポコーポレーション	14,100	560.00	7,896,000
田中商事	3,400	730.00	2,482,000
オーハシテクニカ	5,900	1,690.00	9,971,000

壱番屋	7,400	5,810.00	42,994,000
白銅	3,900	1,553.00	6,056,700
トップカルチャー	3,900	332.00	1,294,800
P L A N T	2,800	565.00	1,582,000
スギホールディングス	21,200	5,560.00	117,872,000
薬王堂ホールディングス	4,600	2,253.00	10,363,800
島津製作所	128,800	3,035.00	390,908,000
J M S	9,200	875.00	8,050,000
クボテック	2,800	409.00	1,145,200
長野計器	7,800	940.00	7,332,000
ブイ・テクノロジー	5,000	5,030.00	25,150,000
スター精密	16,600	1,427.00	23,688,200
東京計器	6,900	1,018.00	7,024,200
愛知時計電機	1,300	4,315.00	5,609,500
インターアクション	5,800	2,661.00	15,433,800
オーバル	9,800	254.00	2,489,200
東京精密	19,500	4,050.00	78,975,000
マニー	42,900	2,890.00	123,981,000
ニコン	174,400	1,338.00	233,347,200
トプコン	54,300	1,286.00	69,829,800
オリンパス	596,700	2,064.00	1,231,588,800
理研計器	9,500	2,290.00	21,755,000
S C R E E Nホールディングス	18,700	6,560.00	122,672,000
キヤノン電子	11,300	2,110.00	23,843,000
タムロン	8,700	2,366.00	20,584,200
H O Y A	215,300	10,175.00	2,190,677,500
シード	4,600	1,042.00	4,793,200
ノーリツ鋼機	7,200	1,545.00	11,124,000
エー・アンド・デイ	9,800	1,010.00	9,898,000
朝日インテック	91,600	3,180.00	291,288,000
キヤノン	580,400	2,958.00	1,716,823,200
リコー	274,300	1,249.00	342,600,700
シチズン時計	126,300	539.00	68,075,700
リズム時計工業	3,400	914.00	3,107,600
大研医器	7,500	689.00	5,167,500
メニコン	14,800	5,280.00	78,144,000
シンシア	1,100	681.00	749,100
中本パックス	2,800	1,654.00	4,631,200
スノーピーク	5,100	1,039.00	5,298,900
パラマウントベッドホールディングス	11,400	4,615.00	52,611,000
トランザクション	6,900	1,122.00	7,741,800
粧美堂	3,200	397.00	1,270,400
ニホンフラッシュ	5,000	2,752.00	13,760,000
前田工織	11,800	2,240.00	26,432,000
永大産業	14,300	341.00	4,876,300
アートネイチャー	11,500	738.00	8,487,000
バンダイナムコホールディングス	111,500	6,295.00	701,892,500
アイフィスジャパン	2,800	728.00	2,038,400
共立印刷	18,400	168.00	3,091,200
S H O E I	5,200	5,440.00	28,288,000

フランスベッドホールディングス	15,300	948.00	14,504,400
マーベラス	16,100	709.00	11,414,900
パイロットコーポレーション	17,500	4,485.00	78,487,500
萩原工業	6,000	1,661.00	9,966,000
エイベックス	18,200	1,296.00	23,587,200
トッパン・フォームズ	23,200	1,221.00	28,327,200
フジシールインターナショナル	24,200	2,167.00	52,441,400
タカラトミー	48,300	1,177.00	56,849,100
廣済堂	7,500	1,044.00	7,830,000
エステールホールディングス	2,800	704.00	1,971,200
アーク	41,500	91.00	3,776,500
レック	11,500	1,096.00	12,604,000
タカノ	4,200	830.00	3,486,000
三光合成	12,400	362.00	4,488,800
プロネクス	9,300	1,205.00	11,206,500
ホクシン	7,200	157.00	1,130,400
ウッドワン	3,500	1,143.00	4,000,500
大建工業	7,200	1,903.00	13,701,600
きもと	18,500	172.00	3,182,000
凸版印刷	152,200	2,210.00	336,362,000
大日本印刷	141,100	3,075.00	433,882,500
共同印刷	3,400	2,977.00	10,121,800
N I S S H A	22,100	1,052.00	23,249,200
光村印刷	900	1,665.00	1,498,500
藤森工業	9,700	3,480.00	33,756,000
ヴィア・ホールディングス	13,100	672.00	8,803,200
TAKARA & COMPANY	5,200	1,730.00	8,996,000
前澤化成工業	6,900	1,190.00	8,211,000
未来工業	5,800	2,125.00	12,325,000
アシックス	89,000	1,602.00	142,578,000
ツツミ	3,400	2,250.00	7,650,000
ウェーブロックホールディングス	3,900	728.00	2,839,200
J S P	6,300	1,990.00	12,537,000
ニチハ	15,000	2,777.00	41,655,000
エフピコ	11,800	6,810.00	80,358,000
小松ウオール工業	3,400	2,213.00	7,524,200
ヤマハ	64,200	5,670.00	364,014,000
河合楽器製作所	3,400	3,340.00	11,356,000
クリナップ	10,100	696.00	7,029,600
ピジョン	65,200	3,985.00	259,822,000
天馬	7,100	2,055.00	14,590,500
オリバー	2,200	3,430.00	7,546,000
兼松サステック	700	1,834.00	1,283,800
キングジム	9,000	899.00	8,091,000
象印マホービン	31,600	2,285.00	72,206,000
リンテック	25,600	2,476.00	63,385,600
信越ポリマー	19,400	1,003.00	19,458,200
東リ	27,100	304.00	8,238,400
イトーキ	22,900	495.00	11,335,500
任天堂	66,100	40,500.00	2,677,050,000

三菱鉛筆	17,700	1,683.00	29,789,100
松風	4,900	1,994.00	9,770,600
タカラスタANDARD	22,200	1,863.00	41,358,600
コクヨ	51,700	1,664.00	86,028,800
ナカバヤシ	10,700	636.00	6,805,200
ニフコ	39,600	2,919.00	115,592,400
立川ブラインド工業	4,700	1,286.00	6,044,200
グロープライド	4,800	2,444.00	11,731,200
オカムラ	37,600	1,092.00	41,059,200
バルカー	8,800	2,457.00	21,621,600
MUTOHホールディングス	1,400	1,742.00	2,438,800
伊藤忠商事	742,800	2,688.00	1,996,646,400
丸紅	1,105,300	808.50	893,635,050
スクロール	16,300	362.00	5,900,600
高島	1,600	1,972.00	3,155,200
ヨンドシーホールディングス	10,800	2,480.00	26,784,000
三陽商会	5,500	1,289.00	7,089,500
長瀬産業	59,800	1,523.00	91,075,400
ナイガイ	4,000	439.00	1,756,000
蝶理	6,800	2,232.00	15,177,600
豊田通商	118,500	3,805.00	450,892,500
オンワードホールディングス	63,500	629.00	39,941,500
三共生興	16,000	588.00	9,408,000
兼松	39,600	1,373.00	54,370,800
美津濃	9,800	2,812.00	27,557,600
ツカモトコーポレーション	1,800	1,150.00	2,070,000
ファミリーマート	84,900	2,507.00	212,844,300
ルックホールディングス	3,600	1,076.00	3,873,600
三井物産	933,400	1,981.00	1,849,065,400
日本紙パルプ商事	6,000	4,050.00	24,300,000
東京エレクトロン	71,900	24,350.00	1,750,765,000
日立ハイテクノロジーズ	36,900	8,020.00	295,938,000
カメイ	13,900	1,182.00	16,429,800
東都水産	1,300	2,961.00	3,849,300
OUGホールディングス	1,600	2,710.00	4,336,000
スターゼン	3,900	4,520.00	17,628,000
セイコーホールディングス	15,200	2,704.00	41,100,800
山善	41,400	1,046.00	43,304,400
椿本興業	1,900	4,110.00	7,809,000
住友商事	670,000	1,700.50	1,139,335,000
日本ユニシス	33,000	3,820.00	126,060,000
内田洋行	4,500	6,830.00	30,735,000
三菱商事	745,200	2,920.00	2,175,984,000
第一実業	5,200	3,720.00	19,344,000
キヤノンマーケティングジャパン	30,400	2,767.00	84,116,800
西華産業	6,000	1,309.00	7,854,000
佐藤商事	8,800	955.00	8,404,000
菱洋エレクトロ	10,800	1,850.00	19,980,000
東京産業	9,600	611.00	5,865,600
ユアサ商事	10,100	3,540.00	35,754,000

神鋼商事	2,700	2,512.00	6,782,400
小林産業	6,300	286.00	1,801,800
阪和興業	19,900	2,755.00	54,824,500
正栄食品工業	6,800	3,885.00	26,418,000
カナデン	8,600	1,355.00	11,653,000
菱電商事	7,600	1,673.00	12,714,800
ニプロ	74,700	1,326.00	99,052,200
フルサト工業	5,900	1,714.00	10,112,600
岩谷産業	23,600	3,670.00	86,612,000
すてきナイスグループ	4,600	1,287.00	5,920,200
昭光通商	3,500	715.00	2,502,500
ニチモウ	1,700	2,033.00	3,456,100
極東貿易	3,100	2,151.00	6,668,100
イワキ	14,000	517.00	7,238,000
兼松エレクトロニクス	5,700	3,615.00	20,605,500
三愛石油	26,100	1,209.00	31,554,900
稲畑産業	23,400	1,547.00	36,199,800
G S Iクレオス	2,500	1,242.00	3,105,000
明和産業	9,800	608.00	5,958,400
クワザワ	3,800	670.00	2,546,000
キムラタン	57,900	29.00	1,679,100
ゴールドウイン	19,200	6,650.00	127,680,000
ユニ・チャーム	207,900	3,752.00	780,040,800
デサント	20,600	1,777.00	36,606,200
キング	5,000	578.00	2,890,000
ワキタ	22,600	1,055.00	23,843,000
ヤマトインターナショナル	6,300	413.00	2,601,900
東邦ホールディングス	34,100	2,373.00	80,919,300
サンゲツ	29,200	1,915.00	55,918,000
ミツウロコグループホールディングス	15,700	1,240.00	19,468,000
シナネンホールディングス	4,400	2,132.00	9,380,800
伊藤忠エネクス	23,500	970.00	22,795,000
サンリオ	29,800	2,219.00	66,126,200
サンワテクノス	7,500	944.00	7,080,000
リョーサン	11,700	2,563.00	29,987,100
新光商事	16,700	866.00	14,462,200
トーヨー	4,800	1,832.00	8,793,600
三信電気	5,700	1,747.00	9,957,900
東陽テクニカ	12,200	1,097.00	13,383,400
モスフードサービス	14,000	3,085.00	43,190,000
加賀電子	10,600	2,376.00	25,185,600
三益半導体工業	8,400	2,422.00	20,344,800
ソーダニッカ	10,800	651.00	7,030,800
立花エレテック	7,900	1,832.00	14,472,800
木曽路	13,900	3,005.00	41,769,500
S R Sホールディングス	12,500	1,054.00	13,175,000
千趣会	19,200	489.00	9,388,800
タカキュー	8,600	186.00	1,599,600
ケーヨー	21,800	558.00	12,164,400
上新電機	12,500	2,313.00	28,912,500



日本瓦斯	16,800	3,645.00	61,236,000
ロイヤルホールディングス	18,600	2,419.00	44,993,400
東天紅	800	1,272.00	1,017,600
いなげや	13,200	1,507.00	19,892,400
島忠	20,000	3,295.00	65,900,000
チヨダ	11,100	1,511.00	16,772,100
ライフコーポレーション	8,100	2,730.00	22,113,000
リンガーハット	13,100	2,490.00	32,619,000
MrMaxHD	14,600	478.00	6,978,800
テンアライド	9,800	447.00	4,380,600
AOKIホールディングス	21,200	1,061.00	22,493,200
オークワ	16,600	1,540.00	25,564,000
コメリ	16,400	2,382.00	39,064,800
青山商事	21,900	1,412.00	30,922,800
しまむら	12,300	8,290.00	101,967,000
はせがわ	5,300	400.00	2,120,000
高島屋	77,400	1,208.00	93,499,200
松屋	21,400	780.00	16,692,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	50,300	1,011.00	50,853,300
近鉄百貨店	4,000	3,610.00	14,440,000
パルコ	10,200	1,848.00	18,849,600
丸井グループ	97,300	2,387.00	232,255,100
クレディセゾン	74,500	1,854.00	138,123,000
アクシアル リテイリング	8,800	3,870.00	34,056,000
井筒屋	5,800	245.00	1,421,000
イオン	408,700	2,344.50	958,197,150
イズミ	21,600	3,570.00	77,112,000
フォーバル	4,700	1,190.00	5,593,000
平和堂	21,500	1,975.00	42,462,500
フジ	12,900	1,888.00	24,355,200
ヤオコー	12,000	5,810.00	69,720,000
ゼビオホールディングス	12,900	1,204.00	15,531,600
ケーズホールディングス	102,500	1,411.00	144,627,500
PALTAC	17,000	5,420.00	92,140,000
三谷産業	14,200	353.00	5,012,600
Olympicグループ	5,500	613.00	3,371,500
日産東京販売ホールディングス	15,900	279.00	4,436,100
新生銀行	78,000	1,729.00	134,862,000
あおぞら銀行	63,300	3,100.00	196,230,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,320,800	579.40	4,241,671,520
りそなホールディングス	1,167,000	466.40	544,288,800
三井住友トラスト・ホールディングス	201,000	4,099.00	823,899,000
三井住友フィナンシャルグループ	735,500	3,954.00	2,908,167,000
千葉銀行	365,700	625.00	228,562,500
群馬銀行	209,000	366.00	76,494,000
武蔵野銀行	15,800	1,759.00	27,792,200
千葉興業銀行	29,200	359.00	10,482,800
筑波銀行	44,400	216.00	9,590,400
七十七銀行	35,900	1,693.00	60,778,700
青森銀行	8,300	2,754.00	22,858,200

秋田銀行	6,800	2,041.00	13,878,800
山形銀行	11,900	1,487.00	17,695,300
岩手銀行	6,900	2,627.00	18,126,300
東邦銀行	95,100	255.00	24,250,500
東北銀行	5,100	1,038.00	5,293,800
みちのく銀行	6,800	1,423.00	9,676,400
ふくおかフィナンシャルグループ	89,500	1,998.00	178,821,000
静岡銀行	263,300	788.00	207,480,400
十六銀行	13,400	2,264.00	30,337,600
スルガ銀行	108,800	434.00	47,219,200
八十二銀行	256,700	430.00	110,381,000
山梨中央銀行	12,300	1,050.00	12,915,000
大垣共立銀行	21,000	2,304.00	48,384,000
福井銀行	9,100	1,674.00	15,233,400
北國銀行	10,900	3,180.00	34,662,000
清水銀行	4,400	2,121.00	9,332,400
富山銀行	2,000	2,191.00	4,382,000
滋賀銀行	21,300	2,686.00	57,211,800
南都銀行	17,600	2,649.00	46,622,400
百五銀行	95,700	336.00	32,155,200
京都銀行	38,000	4,565.00	173,470,000
紀陽銀行	37,600	1,629.00	61,250,400
ほくほくフィナンシャルグループ	70,700	1,073.00	75,861,100
広島銀行	157,100	542.00	85,148,200
山陰合同銀行	63,000	629.00	39,627,000
中国銀行	91,500	1,027.00	93,970,500
鳥取銀行	3,700	1,318.00	4,876,600
伊予銀行	151,700	576.00	87,379,200
百十四銀行	11,300	2,066.00	23,345,800
四国銀行	16,100	964.00	15,520,400
阿波銀行	17,300	2,399.00	41,502,700
大分銀行	6,100	2,574.00	15,701,400
宮崎銀行	7,000	2,495.00	17,465,000
佐賀銀行	6,400	1,573.00	10,067,200
沖縄銀行	9,700	3,650.00	35,405,000
琉球銀行	24,600	1,107.00	27,232,200
セブン銀行	355,300	328.00	116,538,400
みずほフィナンシャルグループ	14,451,200	164.60	2,378,667,520
高知銀行	4,000	842.00	3,368,000
山口フィナンシャルグループ	132,800	683.00	90,702,400
芙蓉総合リース	11,100	7,220.00	80,142,000
みずほリース	16,400	3,420.00	56,088,000
東京センチュリー	21,400	5,310.00	113,634,000
SBIホールディングス	118,800	2,481.00	294,742,800
日本証券金融	46,800	517.00	24,195,600
アイフル	162,300	314.00	50,962,200
日本アジア投資	9,300	277.00	2,576,100
長野銀行	3,500	1,550.00	5,425,000
名古屋銀行	8,600	3,360.00	28,896,000
北洋銀行	160,200	224.00	35,884,800

愛知銀行	3,900	3,420.00	13,338,000	
中京銀行	4,400	2,265.00	9,966,000	
大光銀行	3,700	1,667.00	6,167,900	
愛媛銀行	14,900	1,130.00	16,837,000	
トマト銀行	4,100	1,046.00	4,288,600	
京葉銀行	45,300	592.00	26,817,600	
栃木銀行	51,400	214.00	10,999,600	
北日本銀行	3,400	2,186.00	7,432,400	
東和銀行	18,700	830.00	15,521,000	
福島銀行	10,400	235.00	2,444,000	
大東銀行	5,600	641.00	3,589,600	
リコーリース	8,400	4,295.00	36,078,000	
イオンフィナンシャルサービス	65,100	1,777.00	115,682,700	
アコム	213,700	527.00	112,619,900	
ジャックス	11,700	2,682.00	31,379,400	
オリエントコーポレーション	287,800	165.00	47,487,000	
日立キャピタル	25,100	3,205.00	80,445,500	
アプラスフィナンシャル	51,200	90.00	4,608,000	
オリックス	665,200	1,940.00	1,290,488,000	
三菱UFJリース	269,900	717.00	193,518,300	
ジャフコ	16,300	4,995.00	81,418,500	
九州リースサービス	5,000	609.00	3,045,000	
トモニホールディングス	82,300	374.00	30,780,200	
大和証券グループ本社	853,200	567.30	484,020,360	
野村ホールディングス	1,871,300	561.60	1,050,922,080	
岡三証券グループ	90,600	414.00	37,508,400	
丸三証券	31,500	534.00	16,821,000	
東洋証券	38,200	152.00	5,806,400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	122,000	356.00	43,432,000	
光世証券	2,500	605.00	1,512,500	
水戸証券	30,800	231.00	7,114,800	
いちよし証券	19,800	625.00	12,375,000	
松井証券	60,700	902.00	54,751,400	
SOMPOホールディングス	200,000	4,271.00	854,200,000	
だいこう証券ビジネス	5,200	695.00	3,614,000	
日本取引所グループ	305,300	2,042.00	623,422,600	
マネックスグループ	80,300	258.00	20,717,400	
極東証券	14,300	784.00	11,211,200	
岩井コスモホールディングス	10,000	1,305.00	13,050,000	
藍澤證券	19,100	746.00	14,248,600	
フィデアホールディングス	103,600	127.00	13,157,200	
池田泉州ホールディングス	122,800	196.00	24,068,800	
アニコムホールディングス	8,800	4,095.00	36,036,000	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	278,000	3,729.00	1,036,662,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	87,400	2,654.00	231,959,600	
マネーパートナーズグループ	11,500	235.00	2,702,500	
スパークス・グループ	36,800	282.00	10,377,600	

小林洋行	3,200	272.00	870,400
第一生命ホールディングス	601,800	1,771.00	1,065,787,800
東京海上ホールディングス	380,300	6,213.00	2,362,803,900
アドバンテッジリスクマネジメント	5,200	900.00	4,680,000
イー・ギャランティ	11,400	1,390.00	15,846,000
アサックス	5,500	724.00	3,982,000
NECキャピタルソリューション	4,300	2,486.00	10,689,800
T&Dホールディングス	317,800	1,289.00	409,644,200
アドバンスクリエイト	2,400	1,844.00	4,425,600
三井不動産	524,500	3,020.00	1,583,990,000
三菱地所	745,200	2,182.00	1,626,026,400
平和不動産	19,500	3,425.00	66,787,500
東京建物	116,300	1,788.00	207,944,400
ダイビル	27,400	1,403.00	38,442,200
京阪神ビルディング	17,200	1,498.00	25,765,600
住友不動産	239,100	4,209.00	1,006,371,900
太平洋興発	4,100	799.00	3,275,900
テオオーシー	20,900	950.00	19,855,000
東京楽天地	1,400	6,100.00	8,540,000
レオパレス21	139,400	329.00	45,862,600
スターツコーポレーション	14,500	2,705.00	39,222,500
フジ住宅	12,400	689.00	8,543,600
空港施設	10,800	551.00	5,950,800
明和地所	5,900	624.00	3,681,600
ゴールドクレスト	8,400	1,958.00	16,447,200
リログループ	56,300	3,055.00	171,996,500
エスリード	4,200	1,947.00	8,177,400
日神グループホールディングス	15,700	554.00	8,697,800
日本エスコン	19,200	921.00	17,683,200
タカラレーベン	48,700	501.00	24,398,700
A V A N T I A	6,000	1,002.00	6,012,000
イオンモール	53,300	1,900.00	101,270,000
毎日コムネット	2,200	934.00	2,054,800
ファースト住建	4,600	1,251.00	5,754,600
ランド	589,500	11.00	6,484,500
カチタス	13,200	4,380.00	57,816,000
東祥	6,400	2,162.00	13,836,800
トーセイ	14,700	1,444.00	21,226,800
穴吹興産	2,200	1,745.00	3,839,000
サンフロンティア不動産	14,700	1,350.00	19,845,000
エフ・ジェー・ネクスト	9,300	1,194.00	11,104,200
インテリックス	3,100	728.00	2,256,800
ランドビジネス	4,300	749.00	3,220,700
日本社宅サービス	2,800	1,096.00	3,068,800
グランディハウス	8,300	513.00	4,257,900
東武鉄道	113,700	3,800.00	432,060,000
相鉄ホールディングス	34,500	2,903.00	100,153,500
東急	271,900	1,954.00	531,292,600
京浜急行電鉄	138,500	2,089.00	289,326,500
小田急電鉄	160,300	2,436.00	390,490,800

京王電鉄	56,000	6,240.00	349,440,000
京成電鉄	75,100	4,090.00	307,159,000
富士急行	14,700	3,640.00	53,508,000
新京成電鉄	2,800	2,450.00	6,860,000
東日本旅客鉄道	189,800	9,750.00	1,850,550,000
西日本旅客鉄道	96,100	9,281.00	891,904,100
東海旅客鉄道	89,700	22,155.00	1,987,303,500
西武ホールディングス	144,700	1,818.00	263,064,600
鴻池運輸	17,100	1,580.00	27,018,000
西日本鉄道	29,900	2,623.00	78,427,700
ハマキョウレックス	8,300	3,480.00	28,884,000
サカイ引越センター	5,700	6,210.00	35,397,000
近鉄グループホールディングス	102,100	5,820.00	594,222,000
阪急阪神ホールディングス	136,200	4,340.00	591,108,000
南海電気鉄道	48,400	2,796.00	135,326,400
京阪ホールディングス	45,500	5,000.00	227,500,000
神戸電鉄	2,400	3,980.00	9,552,000
名古屋鉄道	83,900	3,270.00	274,353,000
山陽電気鉄道	7,300	2,194.00	16,016,200
トランコム	2,900	7,970.00	23,113,000
日本通運	36,100	6,140.00	221,654,000
ヤマトホールディングス	179,000	1,970.00	352,630,000
山九	28,400	5,690.00	161,596,000
日新	8,800	1,651.00	14,528,800
丸運	5,900	324.00	1,911,600
丸全昭和運輸	8,300	2,957.00	24,543,100
センコーグループホールディングス	56,300	891.00	50,163,300
トナミホールディングス	2,400	5,220.00	12,528,000
ニッコンホールディングス	36,500	2,602.00	94,973,000
日本石油輸送	1,100	3,120.00	3,432,000
福山通運	13,100	3,830.00	50,173,000
セイノーホールディングス	76,500	1,474.00	112,761,000
エスライン	3,100	1,045.00	3,239,500
神奈川中央交通	2,500	4,030.00	10,075,000
日立物流	18,800	3,240.00	60,912,000
丸和運輸機関	10,800	2,329.00	25,153,200
C & F ロジホールディングス	10,300	1,296.00	13,348,800
日本郵船	85,400	1,798.00	153,549,200
商船三井	64,600	2,614.00	168,864,400
川崎汽船	31,400	1,502.00	47,162,800
N S ユナイテッド海運	5,600	2,005.00	11,228,000
明治海運	10,200	364.00	3,712,800
飯野海運	48,100	373.00	17,941,300
共栄タンカー	1,800	935.00	1,683,000
九州旅客鉄道	91,100	3,630.00	330,693,000
S Gホールディングス	107,200	2,411.00	258,459,200
日本航空	183,800	3,167.00	582,094,600
A N Aホールディングス	186,600	3,459.00	645,449,400
パスコ	1,900	2,204.00	4,187,600

西本Wismettacホールディングス	1,900	3,615.00	6,868,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	2,122.00	1,697,600	
Genky DrugStores	5,200	2,045.00	10,634,000	
国際紙パルプ商事	25,200	286.00	7,207,200	
ナルミヤ・インターナショナル	1,800	1,223.00	2,201,400	
総合メディカルホールディングス	9,300	2,548.00	23,696,400	
ブックオフグループホールディングス	6,200	1,006.00	6,237,200	
三菱倉庫	32,400	2,911.00	94,316,400	
三井倉庫ホールディングス	11,600	1,875.00	21,750,000	
住友倉庫	37,500	1,503.00	56,362,500	
澁澤倉庫	5,600	2,245.00	12,572,000	
ヤマタネ	5,300	1,562.00	8,278,600	
東陽倉庫	18,500	325.00	6,012,500	
乾汽船	5,900	1,231.00	7,262,900	
日本トランスシティ	22,500	491.00	11,047,500	
ケイヒン	1,800	1,338.00	2,408,400	
中央倉庫	6,200	1,174.00	7,278,800	
川西倉庫	1,800	1,041.00	1,873,800	
安田倉庫	8,400	1,117.00	9,382,800	
ファイズホールディングス	2,200	465.00	1,023,000	
東洋埠頭	3,100	1,413.00	4,380,300	
宇徳	8,700	543.00	4,724,100	
上組	58,500	2,411.00	141,043,500	
サンリツ	2,300	703.00	1,616,900	
キムラユニティー	2,800	1,131.00	3,166,800	
キューソー流通システム	2,500	1,999.00	4,997,500	
近鉄エクスプレス	21,600	1,834.00	39,614,400	
東海運	5,800	287.00	1,664,600	
エーアイティー	7,200	988.00	7,113,600	
内外トランスライン	3,600	1,290.00	4,644,000	
ショーエイコーポレーション	1,200	843.00	1,011,600	
日本コンセプト	3,300	1,576.00	5,200,800	
東京放送ホールディングス	64,400	2,102.00	135,368,800	
日本テレビホールディングス	88,300	1,554.00	137,218,200	
朝日放送グループホールディングス	10,500	752.00	7,896,000	
テレビ朝日ホールディングス	29,100	2,175.00	63,292,500	
スカパーJ S A Tホールディングス	69,600	485.00	33,756,000	
テレビ東京ホールディングス	8,700	2,453.00	21,341,100	
日本BS放送	3,600	1,244.00	4,478,400	
ビジョン	9,900	1,413.00	13,988,700	
スマートバリュー	3,100	827.00	2,563,700	
USEN-NEXT HOLDINGS	4,000	1,787.00	7,148,000	
ワイヤレスゲート	5,000	797.00	3,985,000	
コネクシオ	6,000	1,575.00	9,450,000	
日本通信	81,800	231.00	18,895,800	
クロップス	1,900	876.00	1,664,400	
日本電信電話	1,414,300	2,850.50	4,031,462,150	
KDDI	788,500	3,411.00	2,689,573,500	

ソフトバンク	961,600	1,516.00	1,457,785,600
光通信	10,900	27,130.00	295,717,000
NTTドコモ	781,600	3,136.00	2,451,097,600
エムティーアイ	10,200	708.00	7,221,600
GMOインターネット	41,700	2,143.00	89,363,100
ファイバーゲート	2,000	1,292.00	2,584,000
アйдママーケティングコミュニケーション	3,200	611.00	1,955,200
KADOKAWA	28,500	1,832.00	52,212,000
学研ホールディングス	3,600	7,100.00	25,560,000
ゼンリン	21,100	1,584.00	33,422,400
昭文社	5,000	380.00	1,900,000
インプレスホールディングス	8,800	192.00	1,689,600
東京電力ホールディングス	860,800	451.00	388,220,800
中部電力	330,000	1,568.00	517,440,000
関西電力	408,600	1,306.50	533,835,900
中国電力	149,100	1,510.00	225,141,000
北陸電力	98,600	886.00	87,359,600
東北電力	269,600	1,057.00	284,967,200
四国電力	97,200	935.00	90,882,000
九州電力	222,300	921.00	204,738,300
北海道電力	101,000	518.00	52,318,000
沖縄電力	20,000	2,091.00	41,820,000
電源開発	85,900	2,536.00	217,842,400
エフオン	5,100	765.00	3,901,500
イーレックス	15,300	1,718.00	26,285,400
レノバ	17,800	1,153.00	20,523,400
東京瓦斯	207,500	2,456.50	509,723,750
大阪瓦斯	209,300	1,935.00	404,995,500
東邦瓦斯	53,000	4,265.00	226,045,000
北海道瓦斯	5,800	1,680.00	9,744,000
広島ガス	22,400	361.00	8,086,400
西部瓦斯	12,100	2,450.00	29,645,000
静岡ガス	30,600	959.00	29,345,400
メタウォーター	5,200	4,270.00	22,204,000
アイネット	5,400	1,610.00	8,694,000
松竹	7,000	15,180.00	106,260,000
東宝	63,200	4,205.00	265,756,000
エイチ・アイ・エス	16,000	2,667.00	42,672,000
東映	4,000	15,480.00	61,920,000
ラックランド	2,100	2,216.00	4,653,600
エヌ・ティ・ティ・データ	281,700	1,479.00	416,634,300
共立メンテナンス	17,000	4,580.00	77,860,000
イチネンホールディングス	11,500	1,508.00	17,342,000
建設技術研究所	7,100	2,446.00	17,366,600
スペース	6,700	1,227.00	8,220,900
長大	3,800	1,248.00	4,742,400
アインホールディングス	13,100	7,000.00	91,700,000
燦ホールディングス	4,500	1,700.00	7,650,000
ピー・シー・エー	1,300	4,450.00	5,785,000

スバル興業	600	9,470.00	5,682,000	
東京テアトル	4,100	1,373.00	5,629,300	
タナベ経営	1,900	1,288.00	2,447,200	
ビジネスブレイン太田昭和	1,800	2,890.00	5,202,000	
ナガワ	3,300	6,960.00	22,968,000	
よみうりランド	2,200	4,445.00	9,779,000	
東京都競馬	6,700	3,150.00	21,105,000	
常磐興産	4,200	1,696.00	7,123,200	
カナモト	16,800	2,804.00	47,107,200	
東京ドーム	41,800	1,042.00	43,555,600	
D T S	23,700	2,326.00	55,126,200	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	45,100	5,160.00	232,716,000	
シーイーシー	11,300	2,130.00	24,069,000	
カプコン	49,900	3,285.00	163,921,500	
西尾レントオール	10,500	3,015.00	31,657,500	
アイ・エス・ピー	2,000	1,959.00	3,918,000	
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	69,000	31.00	2,139,000	
日本空港ビルデング	34,000	5,500.00	187,000,000	
トランス・コスモス	9,800	2,917.00	28,586,600	
乃村工藝社	44,200	1,310.00	57,902,000	
ジャステック	6,700	1,093.00	7,323,100	
S C S K	24,400	6,130.00	149,572,000	
藤田観光	4,500	2,739.00	12,325,500	
K N T - C Tホールディングス	6,400	1,328.00	8,499,200	
日本管財	11,000	1,937.00	21,307,000	
トーカイ	10,000	2,811.00	28,110,000	
白洋舎	1,100	2,817.00	3,098,700	
セコム	109,300	9,753.00	1,066,002,900	
日本システムウエア	3,500	2,380.00	8,330,000	
セントラル警備保障	5,000	5,960.00	29,800,000	
アイネス	10,400	1,741.00	18,106,400	
丹青社	19,500	1,280.00	24,960,000	
メイテック	12,700	6,280.00	79,756,000	
T K C	9,000	5,640.00	50,760,000	
富士ソフト	13,600	4,620.00	62,832,000	
応用地質	11,100	1,422.00	15,784,200	
船井総研ホールディングス	21,300	3,235.00	68,905,500	
N S D	34,800	1,871.00	65,110,800	
進学会ホールディングス	4,100	512.00	2,099,200	
丸紅建材リース	1,000	1,903.00	1,903,000	
オオバ	8,100	776.00	6,285,600	
コナミホールディングス	38,500	4,390.00	169,015,000	
いであ	1,900	2,148.00	4,081,200	
学究社	3,100	1,462.00	4,532,200	
ベネッセホールディングス	34,300	3,120.00	107,016,000	
イオンディライト	12,700	3,850.00	48,895,000	
ナック	5,700	1,145.00	6,526,500	
福井コンピュータホールディングス	4,200	3,360.00	14,112,000	



ニチイ学館	14,700	1,524.00	22,402,800
ダイセキ	17,200	3,000.00	51,600,000
ステップ	3,800	1,699.00	6,456,200
日鉄物産	7,500	4,860.00	36,450,000
泉州電業	3,300	3,105.00	10,246,500
元気寿司	2,700	3,115.00	8,410,500
トラスコ中山	22,100	2,609.00	57,658,900
ヤマダ電機	323,600	587.00	189,953,200
オートバックスセブン	39,400	1,622.00	63,906,800
モリト	7,800	803.00	6,263,400
アークランドサカモト	16,600	1,234.00	20,484,400
ニトリホールディングス	46,000	17,600.00	809,600,000
グルメ杵屋	7,500	1,209.00	9,067,500
愛眼	8,300	255.00	2,116,500
ケーユーホールディングス	5,500	929.00	5,109,500
吉野家ホールディングス	34,900	2,578.00	89,972,200
加藤産業	16,600	3,605.00	59,843,000
北恵	2,000	918.00	1,836,000
イノテック	6,300	1,155.00	7,276,500
イエローハット	20,100	1,750.00	35,175,000
松屋フーズホールディングス	5,100	4,805.00	24,505,500
JBC Cホールディングス	7,100	2,117.00	15,030,700
J Kホールディングス	9,600	765.00	7,344,000
サガミホールディングス	14,200	1,401.00	19,894,200
日伝	9,600	2,046.00	19,641,600
関西スーパーマーケット	8,900	1,038.00	9,238,200
ミロク情報サービス	9,300	2,872.00	26,709,600
北沢産業	7,800	272.00	2,121,600
杉本商事	5,700	2,009.00	11,451,300
因幡電機産業	30,200	2,759.00	83,321,800
王将フードサービス	7,800	6,580.00	51,324,000
プレナス	11,900	2,010.00	23,919,000
ミニストップ	7,900	1,624.00	12,829,600
アークス	21,700	2,011.00	43,638,700
パローホールディングス	23,500	1,991.00	46,788,500
東テク	3,500	2,745.00	9,607,500
ミスミグループ本社	133,000	2,815.00	374,395,000
藤久	900	720.00	648,000
アルテック	8,600	273.00	2,347,800
ベルク	5,200	6,120.00	31,824,000
大 庄	5,700	1,675.00	9,547,500
タキヒヨー	3,100	1,936.00	6,001,600
ファーストリテイリング	14,200	58,520.00	830,984,000
ソフトバンクグループ	839,500	5,064.00	4,251,228,000
蔵王産業	2,100	1,483.00	3,114,300
スズケン	45,000	4,485.00	201,825,000
サンドラッグ	40,000	3,745.00	149,800,000
サックスパー ホールディングス	9,000	859.00	7,731,000
ジェコス	7,300	1,086.00	7,927,800
ヤマザワ	2,000	1,690.00	3,380,000

やまや	2,100	2,255.00	4,735,500	
グローセル	9,400	454.00	4,267,600	
ペルーナ	22,700	648.00	14,709,600	
合計	127,662,700		263,153,477,450	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期中間計算期間(令和2年2月8日から令和2年8月7日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## 【D I A M国内株式インデックスファンド&lt;DC年金&gt;】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第17期 令和2年2月7日現在	第18期中間計算期間末 令和2年8月7日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	432,843,711	281,251,264
親投資信託受益証券	99,680,267,054	89,486,194,647
未収入金	-	57,355,000
流動資産合計	100,113,110,765	89,824,800,911
資産合計	100,113,110,765	89,824,800,911
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	307,631,349	225,920,083
未払受託者報酬	15,923,890	14,335,681
未払委託者報酬	100,851,574	90,792,930
その他未払費用	482,572	422,731
流動負債合計	424,889,385	331,471,425
負債合計	424,889,385	331,471,425
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	36,015,594,875	35,747,352,015
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	63,672,626,505	53,745,977,471
(分配準備積立金)	18,655,918,168	15,550,752,602
元本等合計	99,688,221,380	89,493,329,486
純資産合計	99,688,221,380	89,493,329,486
負債純資産合計	100,113,110,765	89,824,800,911

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第17期中間計算期間 自 平成31年2月8日 至 令和1年8月7日	第18期中間計算期間 自 令和2年2月8日 至 令和2年8月7日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	2,806,903,619	9,202,703,407
<b>営業収益合計</b>	<b>2,806,903,619</b>	<b>9,202,703,407</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	110,107	90,662
受託者報酬	15,018,015	14,335,681
委託者報酬	95,114,263	90,792,930
その他費用	461,782	422,731
<b>営業費用合計</b>	<b>110,704,167</b>	<b>105,642,004</b>
営業利益又は営業損失( )	2,917,607,786	9,308,345,411
経常利益又は経常損失( )	2,917,607,786	9,308,345,411
中間純利益又は中間純損失( )	2,917,607,786	9,308,345,411
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	154,955,199	2,078,429,765
期首剰余金又は期首欠損金( )	55,444,560,813	63,672,626,505
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,202,188,555	8,618,115,005
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,202,188,555	8,618,115,005
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,374,672,363	11,314,848,393
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,374,672,363	11,314,848,393
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	51,199,514,020	53,745,977,471

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第18期中間計算期間	
	自	令和2年2月8日 至 令和2年8月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第17期	第18期中間計算期間末
	令和2年2月7日現在	令和2年8月7日現在
1. 期首元本額	38,202,443,152円	36,015,594,875円
期中追加設定元本額	7,250,587,806円	6,260,085,818円
期中一部解約元本額	9,437,436,083円	6,528,328,678円
2. 受益権の総数	36,015,594,875口	35,747,352,015口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第17期 令和2年2月7日現在	第18期中間計算期間末 令和2年8月7日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	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。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	第17期 令和2年2月7日現在	第18期中間計算期間末 令和2年8月7日現在
1口当たり純資産額	2,7679円	2,5035円
（1万口当たり純資産額）	(27,679円)	(25,035円)

## （参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。



国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

令和2年8月7日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,643,823,384
株式	220,765,136,106
派生商品評価勘定	6,636,390
未収配当金	293,378,623
前払金	32,735,000
流動資産合計	233,741,709,503
資産合計	233,741,709,503
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	38,765,240
未払金	7,510,876,820
未払解約金	348,779,000
流動負債合計	7,898,421,060
負債合計	7,898,421,060
純資産の部	
元本等	
元本	90,946,057,399
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	134,897,231,044
元本等合計	225,843,288,443
純資産合計	225,843,288,443
負債純資産合計	233,741,709,503

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和2年2月8日 至 令和2年8月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年8月7日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	98,370,254,055円
同期中追加設定元本額	28,342,409,394円
同期中一部解約元本額	35,766,606,050円
元本の内訳	
ファンド名	
One DC 国内株式インデックスファンド	15,248,439,093円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	3,113,422,393円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	3,120,128円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	5,821,766円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	9,588,482円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	33,840,095円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	22,534,409円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,382,917円
たわらノーロード TOPIX	725,479,701円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	504,256,123円
たわらノーロード バランス(堅実型)	18,921,483円
たわらノーロード バランス(標準型)	113,742,995円
たわらノーロード バランス(積極型)	165,988,724円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	687,298円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	47,614,262円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	143,269,955円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	95,370,831円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	171,612,892円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	396,319円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,285,531円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	3,774,536円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,332,313円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	5,554,012円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	36,035,192,948円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	1,095,278,425円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,569,290,977円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,575,292,211円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	370,198,511円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,251,152,320円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,143,770,842円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	38,326,565円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,138,688,254円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	22,648,768円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	332,047,975円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	263,826,802円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	439,122,946円
投資のソムリエ	5,510,130,185円
クルーズコントロール	887,478,408円
投資のソムリエ<DC年金>	480,155,429円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	304,923,106円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	376,458,884円
クルーズコントロール<DC年金>	712,984円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	7,682,979円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	17,123,386円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	159,052,030円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,507,311,248円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	11,034,652円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	5,879,445円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,533,990円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	14,431,236円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	91,650,896円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	794,934,341円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	264,532,969円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	2,778,399円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	1,340,803円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	1,303,040円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,193,693円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	3,830,972円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	4,586,305円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	112,531,148円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	52,688,798円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	196,003,497円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	6,143,524円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	90,400,590円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	187,312,874円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	12,437,508円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	45,212,094円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	13,169,890円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	7,813,291円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	26,901,048円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	58,312,968円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	870,243,517円

D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	885,376,029円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,493,080,392円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	172,374,467円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	46,216,088円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	462,960,691円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	116,055,573円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	2,261,037円
D I A M世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	34,145,932円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	473,564,493円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	33,598,284円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	128,018,942円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	321,728,110円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	403,040,653円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	54,895,544円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	24,525,984円
D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	2,033,809円
D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	108,403円
D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	124,308円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	404,410,942円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,274,945,305円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,685,747,142円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	67,341,342円
計	90,946,057,399円
2. 受益権の総数	90,946,057,399口
3. 差入代用有価証券 株式	1,719,500,000円

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	令和2年8月7日現在			
	契約額等（円）	うち		評価損益（円）
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	5,381,240,000	-	5,349,225,000	32,015,000
合計	5,381,240,000	-	5,349,225,000	32,015,000

## （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。

(1口当たり情報に関する注記)

	令和2年8月7日現在
1口当たり純資産額	2,483.33円
(1万口当たり純資産額)	(24,833.33円)

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

令和2年8月31日現在

資産総額	93,302,143,079円
負債総額	222,520,983円
純資産総額( - )	93,079,622,096円
発行済数量	35,540,030,268口
1口当たり純資産額( / )	2.6190円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

令和2年8月31日現在

資産総額	236,185,318,826円
負債総額	142,673,550円
純資産総額( - )	236,042,645,276円
発行済数量	90,846,562,242口
1口当たり純資産額( / )	2.5983円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

### (5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6) 受益権の再分割

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



(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額（2020年8月31日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構（2020年8月31日現在）

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年8月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,233,048,725,219
追加型株式投資信託	859	14,042,319,951,738
単位型公社債投資信託	36	91,165,290,214
単位型株式投資信託	193	1,256,166,938,083
合計	1,114	16,622,700,905,254

### 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		別途 積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
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おります。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第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います。

#### (2) 販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社千葉銀行	145,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社横浜銀行	215,628	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社百五銀行	20,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社中国銀行	15,149	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社西日本シティ銀行	85,745	日本において銀行業務を営んでおります。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2020年3月末日現在

### 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【その他】

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

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

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

## 独立監査人の監査報告書

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

## 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3月13日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>の平成31年2月8日から令和2年2月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>の令和2年2月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

(注2) X B R Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の中間監査報告書

令和2年9月18日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>の令和2年2月8日から令和2年8月7日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>の令和2年8月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（令和2年2月8日から令和2年8月7日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。