

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年7月12日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	D I A M国内株式パッシブ・ファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

D I A M国内株式パッシブ・ファンド

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

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。

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

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

<基準価額の照会方法等>

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

す。
当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

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

（５）【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2021年7月13日から2022年1月12日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(11) 【振替機関に関する事項】

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】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

ぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合には、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後2時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続が完了したものを当日のお申込みとします。

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

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

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

振替受益権について

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

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

（参考）

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

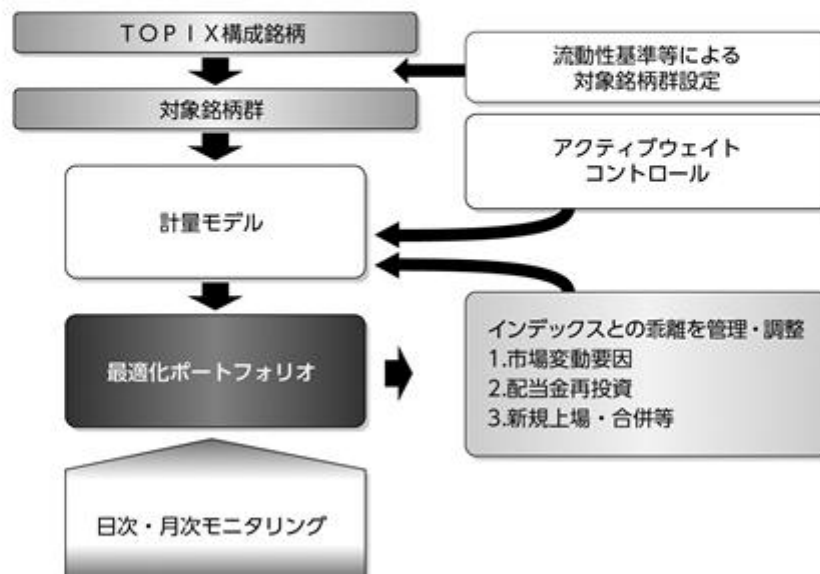
当ファンドの信託金の限度額は、5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

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

2 流動性基準等により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。

※組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。



3 原則として、マザーファンドの組入比率は高位を維持します。

■ 分配方針

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

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

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「㈱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㈱東京証券取引所が有しています。㈱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。

㈱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。

㈱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、㈱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。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドは、㈱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。

㈱東京証券取引所は、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

㈱東京証券取引所は、委託会社または国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、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、㈱東京証券取引所は国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドの発行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。

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

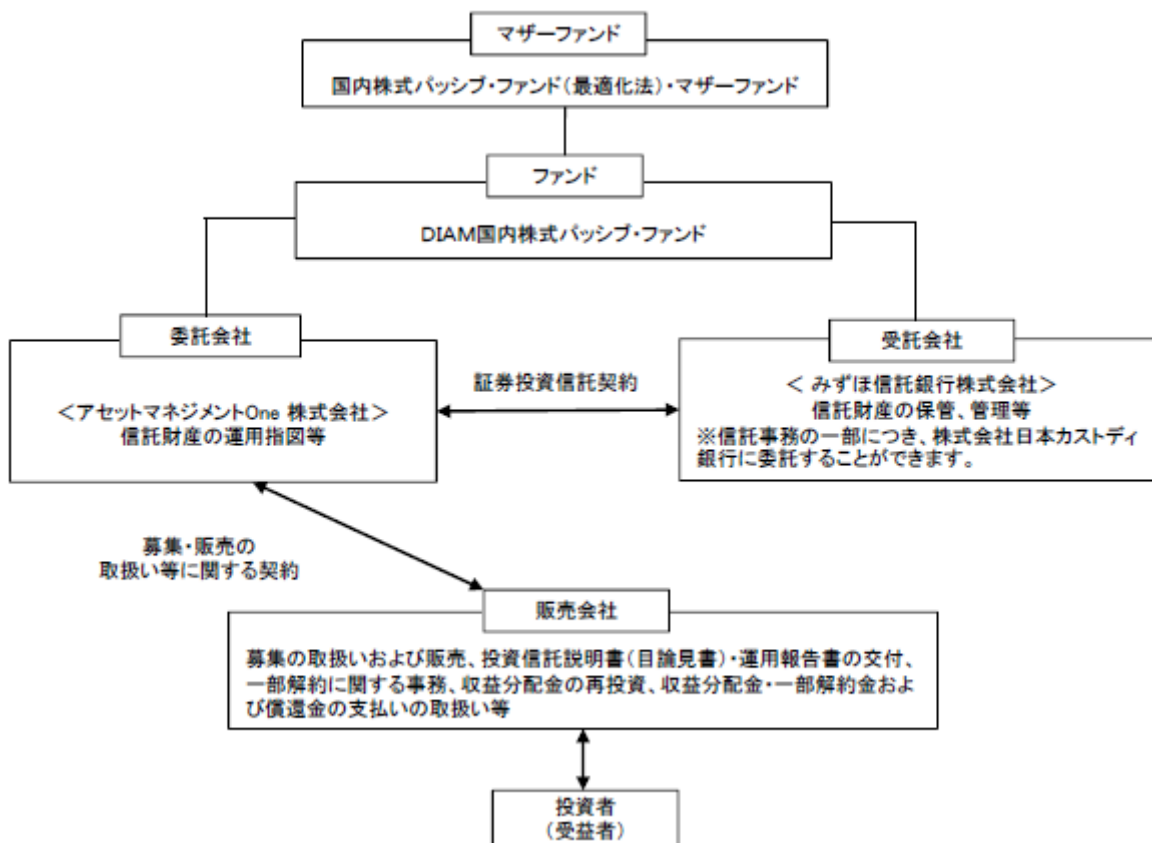
その他資産 (投資信託証券 (株式))	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として株式へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。 (注)商品分類表の投資対象資産は株式に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産(投資信託証券(株式))に分類されます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
日本	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリー ファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズ)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

- 2009年1月30日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
2021年1月13日 信託報酬率(税抜)を「年率0.45%」から「年率0.25%」に引き下げ

(3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

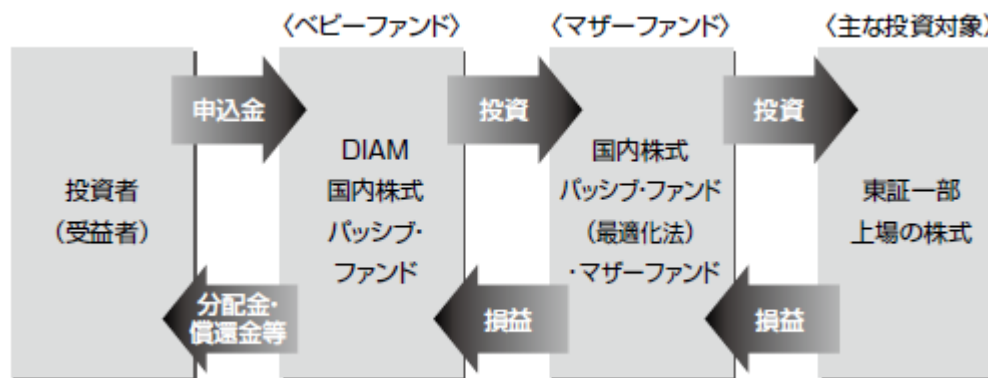
委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

ファミリーファンド方式とは

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



委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2021年4月30日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2021年4月30日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

<基本方針>

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

<投資対象>

この投資信託は、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。

<投資態度>

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

原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持します。

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

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

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

有価証券の指図範囲（約款第16条第1項）

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

1．株券または新株引受権証券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

6．資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)

7．投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。)

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

9．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)

10．資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)

11．コマーシャル・ペーパー

12．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

13．外国または外国の者の発行する証券または証書で、1．～12．の証券または証書の性質を有するもの

14．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。)

15. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
16. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
17. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
18. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
21. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、13.ならびに18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券および13.ならびに18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

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

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

(参考) 当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

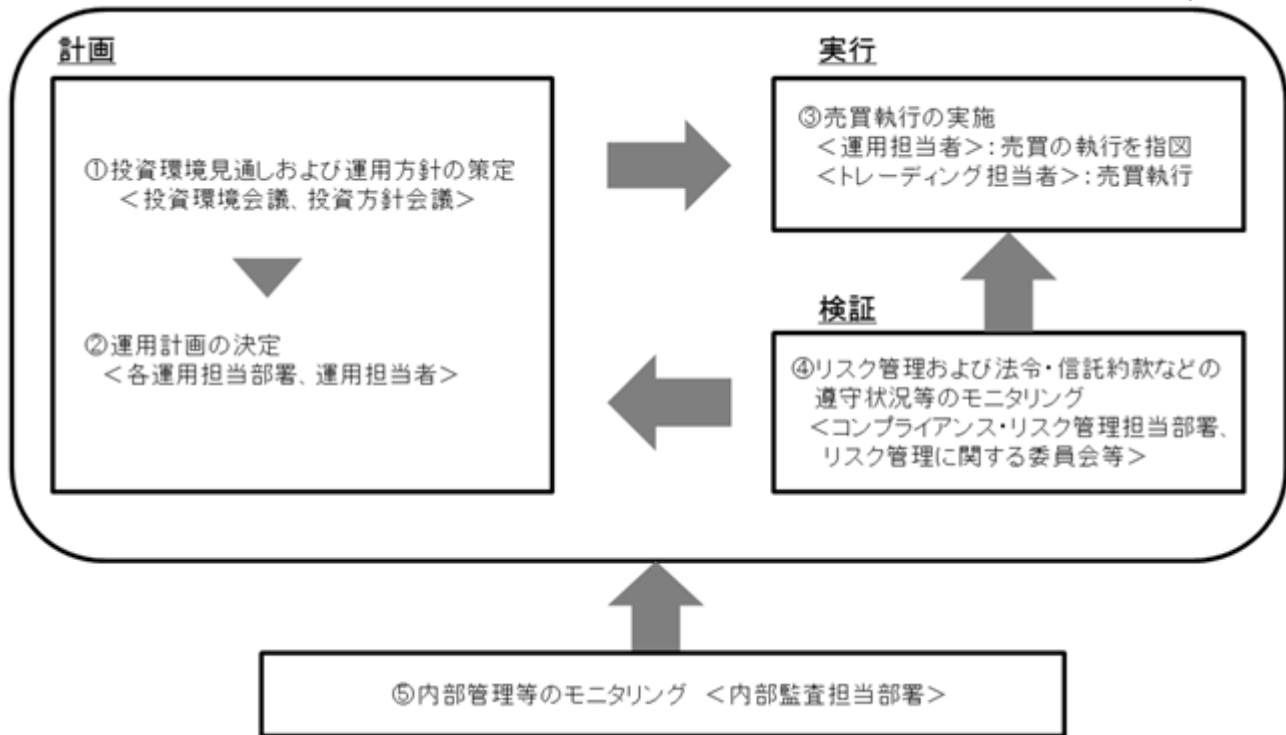
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 3. 株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 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。 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。 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。

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。

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2021年4月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【配分方針】

収益配分方針

毎決算時（原則として毎年10月12日。休業日の場合は翌営業日。）に、以下の方針に基づき分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

2) 分配対象額についての配分方針

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

3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

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

1) 信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、監査費用および当該監査費用に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、監査報酬および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

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

b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

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

「分配金自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は税引後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5) 【投資制限】

- 1) マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。(約款「運用の基本方針」 2. 運用方法 (3) 投資制限)
- 2) 株式への実質投資割合には制限を設けません。(約款「運用の基本方針」 2. 運用方法 (3) 投資制限)
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。(約款「運用の基本方針」 2. 運用方法 (3) 投資制限)
- 4) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。(約款「運用の基本方針」 2. 運用方法 (3) 投資制限)
- 5) 投資する株式等の範囲(約款第19条)
 - a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずるものとして市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 - b. 上記a.の規定にかかわらず、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとし、
- 6) 信用取引の指図範囲(約款第20条)
 - a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとし、
 - b. 上記a.の信用取引の指図は、次の1.~6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.~6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。))の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券

6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

7) 先物取引等の運用指図(約款第21条)

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)および外国の取引所におけるわが国の有価証券にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)
- b. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

8) スワップ取引の運用指図(約款第22条)

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。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. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

9) 金利先渡取引の運用指図(約款第23条)

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。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. 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、金利先渡取引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。

10) デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第23条の2)

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

11) 有価証券の貸付の指図および範囲（約款第24条）

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1)～2)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
 - 1) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - 2) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. 上記a. 1)～2)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

12) 資金の借入れ（約款第30条）

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- 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、資金借入れ額は借入指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入れ額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- d. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行う全ての委託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。

(1) 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。

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

(2) 信用リスク

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

金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

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

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

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

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

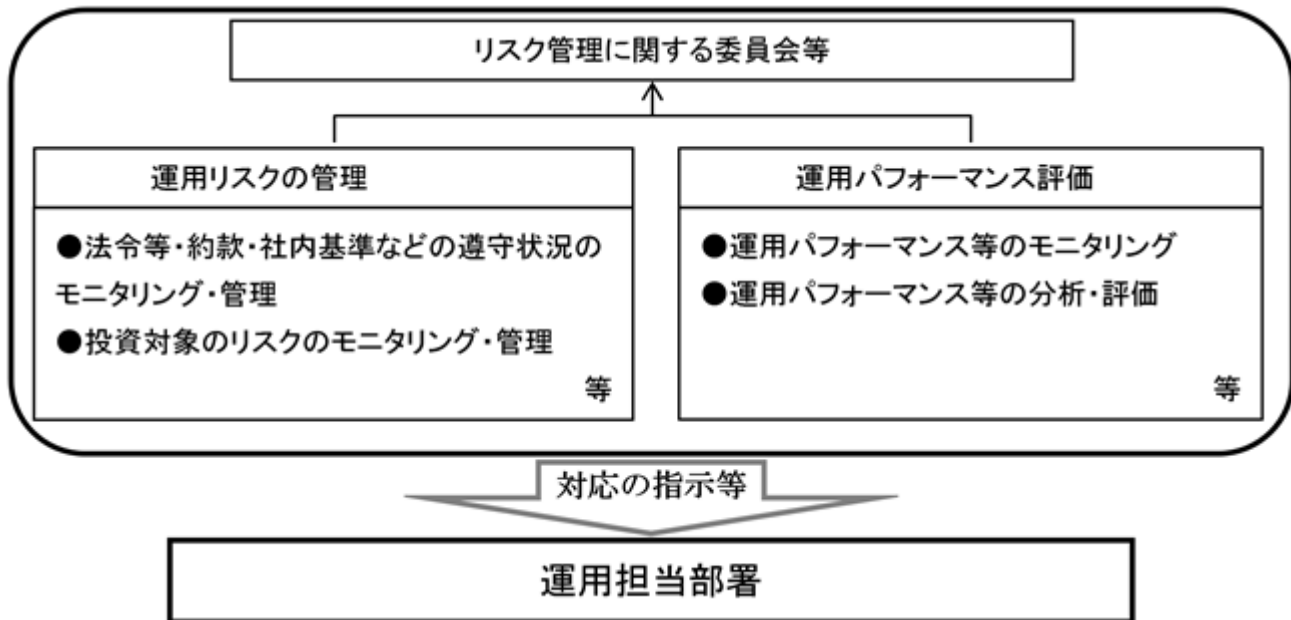
注意事項

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

<リスク管理体制>

委託会社における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2021年4月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

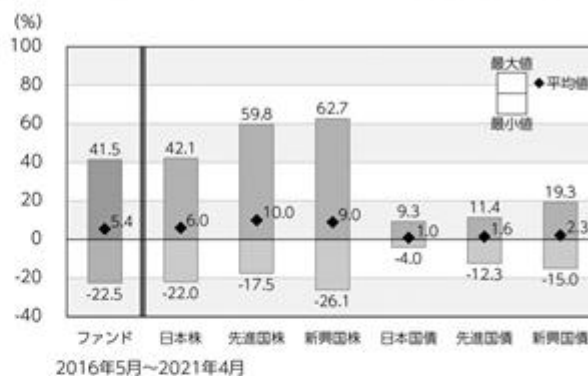
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



*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。

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公算利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」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0.275%（税抜0.25%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.20%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.02%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

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

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

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2021年4月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2021年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	13,492,193,365	99.99
内 日本	13,492,193,365	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,430,148	0.01
純資産総額	13,493,623,513	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

2021年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	339,774,388,460	96.55
内 日本	339,774,388,460	96.55
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	12,141,596,010	3.45
純資産総額	351,915,984,470	100.00

その他資産の投資状況

2021年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	12,188,615,000	3.46
内 日本	12,188,615,000	3.46

(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】

2021年4月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	4,342,794,311	2.8286 12,284,382,801	3.1068 13,492,193,365	- -	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

2021年4月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2021年4月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,320,800	8,115.17 10,718,522,960	8,127.00 10,734,141,600	- -	3.05
2	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	1,015,000	9,619.47 9,763,770,572	9,885.00 10,033,275,000	- -	2.85
3	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	816,600	12,069.13 9,855,653,807	10,900.00 8,900,940,000	- -	2.53
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	127,900	55,626.80 7,114,668,398	52,520.00 6,717,308,000	- -	1.91
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,795,500	538.70 4,738,174,136	578.00 5,083,799,000	- -	1.44
6	任天堂 日本	株式 その他製品	74,500	63,279.62 4,714,332,276	62,690.00 4,670,405,000	- -	1.33
7	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	892,400	5,037.39 4,495,373,600	4,939.00 4,407,563,600	- -	1.25
8	信越化学工業 日本	株式 化学	236,100	18,237.15 4,305,791,809	18,450.00 4,356,045,000	- -	1.24
9	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,496,300	2,801.46 4,191,827,164	2,755.00 4,122,306,500	- -	1.17
10	日本電産 日本	株式 電気機器	313,900	14,072.76 4,417,440,919	12,655.00 3,972,404,500	- -	1.13
11	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,084,500	3,725.16 4,039,939,952	3,635.00 3,942,157,500	- -	1.12
12	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	76,400	42,473.31 3,244,961,174	48,320.00 3,691,648,000	- -	1.05
13	ダイキン工業 日本	株式 機械	166,000	23,209.01 3,852,696,291	21,930.00 3,640,380,000	- -	1.03
14	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,025,900	3,372.04 3,459,378,267	3,306.00 3,391,625,400	- -	0.96
15	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	889,900	3,672.68 3,268,318,265	3,802.00 3,383,399,800	- -	0.96
16	日立製作所 日本	株式 電気機器	626,600	5,016.54 3,143,364,193	5,381.00 3,371,734,600	- -	0.96
17	村田製作所 日本	株式 電気機器	383,100	9,406.63 3,603,680,913	8,703.00 3,334,119,300	- -	0.95

18	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,026,300	3,076.86 3,157,787,632	3,232.00 3,317,001,600	- -	0.94
19	HOYA 日本	株式 精密機器	256,600	13,095.18 3,360,224,099	12,435.00 3,190,821,000	- -	0.91
20	第一三共 日本	株式 医薬品	1,119,300	3,212.95 3,596,265,372	2,787.00 3,119,489,100	- -	0.89
21	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	898,200	3,194.31 2,869,131,836	3,408.00 3,061,065,600	- -	0.87
22	ファナック 日本	株式 電気機器	114,500	28,096.97 3,217,103,785	25,175.00 2,882,537,500	- -	0.82
23	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,747,100	1,550.22 2,708,399,345	1,535.00 2,681,798,500	- -	0.76
24	SMC 日本	株式 機械	38,100	64,923.94 2,473,602,114	63,450.00 2,417,445,000	- -	0.69
25	三井物産 日本	株式 卸売業	1,042,300	2,079.79 2,167,770,149	2,303.50 2,400,938,050	- -	0.68
26	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	502,300	4,303.25 2,161,526,162	4,699.00 2,360,307,700	- -	0.67
27	三菱商事 日本	株式 卸売業	781,500	2,903.78 2,269,306,364	3,020.00 2,360,130,000	- -	0.67
28	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	423,300	5,495.64 2,326,306,381	5,230.00 2,213,859,000	- -	0.63
29	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,303,800	1,721.20 2,244,101,467	1,682.00 2,192,991,600	- -	0.62
30	花王 日本	株式 化学	312,200	7,476.37 2,334,123,486	7,007.00 2,187,585,400	- -	0.62

(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

2021年4月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	96.55
合計	96.55

(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

2021年4月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	17.35
情報・通信業		9.22
化学		7.15
輸送用機器		6.86
機械		5.52
サービス業		5.33
医薬品		5.02
銀行業		4.86
卸売業		4.60
小売業		4.48

陸運業	3.25
食料品	3.17
精密機器	2.47
その他製品	2.36
建設業	2.30
不動産業	1.91
保険業	1.80
電気・ガス業	1.24
その他金融業	1.06
ガラス・土石製品	0.80
鉄鋼	0.80
証券、商品先物取引業	0.80
非鉄金属	0.74
金属製品	0.62
ゴム製品	0.60
繊維製品	0.46
空運業	0.44
石油・石炭製品	0.41
海運業	0.27
パルプ・紙	0.24
倉庫・運輸関連業	0.17
鉱業	0.17
水産・農林業	0.09
合計	96.55

（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

2021年4月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0306月	買建	641	12,547,666,530	12,188,615,000	3.46

（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（2021年4月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第3計算期間末 (2011年10月12日)	1,130	1,130	0.9904	0.9904
第4計算期間末 (2012年10月12日)	1,188	1,188	0.9615	0.9615
第5計算期間末 (2013年10月15日)	1,832	1,832	1.6235	1.6235
第6計算期間末 (2014年10月14日)	2,347	2,347	1.6680	1.6680
第7計算期間末 (2015年10月13日)	3,717	3,717	2.0908	2.0908
第8計算期間末 (2016年10月12日)	3,124	3,124	1.8950	1.8950
第9計算期間末 (2017年10月12日)	5,490	5,490	2.4352	2.4352
第10計算期間末 (2018年10月12日)	5,758	5,758	2.4781	2.4781
第11計算期間末 (2019年10月15日)	7,445	7,445	2.4073	2.4073
第12計算期間末 (2020年10月12日)	8,368	8,368	2.4889	2.4889
2020年4月末日	6,383	-	2.2007	-
5月末日	6,855	-	2.3496	-
6月末日	7,656	-	2.3447	-
7月末日	7,408	-	2.2494	-
8月末日	8,084	-	2.4322	-
9月末日	8,256	-	2.4624	-
10月末日	8,006	-	2.3915	-
11月末日	8,927	-	2.6572	-
12月末日	9,184	-	2.7348	-
2021年1月末日	9,250	-	2.7401	-
2月末日	9,488	-	2.8253	-
3月末日	9,783	-	2.9856	-
4月末日	13,493	-	2.9005	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000

2020年10月13日～2021年4月12日	-
------------------------	---

【収益率の推移】

	収益率(%)
第3計算期間	7.1
第4計算期間	2.9
第5計算期間	68.9
第6計算期間	2.7
第7計算期間	25.3
第8計算期間	9.4
第9計算期間	28.5
第10計算期間	1.8
第11計算期間	2.9
第12計算期間	3.4
2020年10月13日～2021年4月12日	20.0

(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3計算期間	530,173,605	303,610,533
第4計算期間	330,350,174	235,209,696
第5計算期間	548,351,616	655,828,394
第6計算期間	796,957,698	518,389,663
第7計算期間	1,112,887,322	742,283,812
第8計算期間	1,141,968,717	1,270,849,953
第9計算期間	1,114,201,443	508,681,373
第10計算期間	1,049,666,198	980,435,336
第11計算期間	1,644,306,045	875,365,431
第12計算期間	1,205,686,297	936,032,169
2020年10月13日～ 2021年4月12日	1,620,901,417	328,337,472

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2021年4月30日

基準価額・純資産の推移 (2011年4月28日～2021年4月30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:2009年1月30日)

分配の推移(税引前)

2016年10月	0円
2017年10月	0円
2018年10月	0円
2019年10月	0円
2020年10月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

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

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	96.55
内 日本	96.55
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.45
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)	3.46

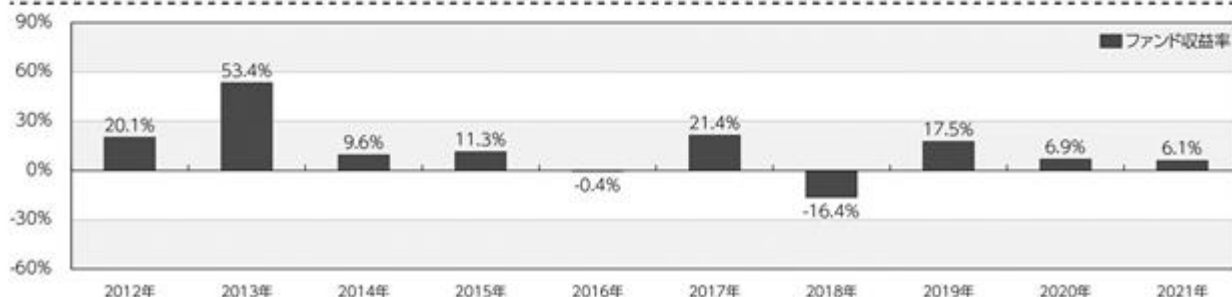
株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	17.35
2	情報・通信業	9.22
3	化学	7.15
4	輸送用機器	6.86
5	機械	5.52

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	3.05
2	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.85
3	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.53
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.91
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.44
6	任天堂	株式	日本	その他製品	1.33
7	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.25
8	信越化学工業	株式	日本	化学	1.24
9	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.17
10	日本電産	株式	日本	電気機器	1.13

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。

※2021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。

○掲載データ等はい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】

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合には、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後2時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

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

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

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

- ・お申込価額

お申込日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

・ お申込手数料

ありません。

・ 払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

- ・ 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し解約の請求をすることができます。受益者が解約の請求をするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後2時までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

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

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求

を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して4営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、2009年1月30日から原則として無期限です。ただし、下記「(5)その他 イ.償還規定」の場合には信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

- a. 計算期間は、原則として毎年10月13日から翌年10月12日までとします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5)【その他】

イ.償還規定

- a. 委託会社は、受益権総口数が10億口を下回る事となった場合、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合、対象インデックスが改廃の場合またはやむを得ない事情が発生した場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更等b.」の書面決議が否決された場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ. 信託約款の変更等

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

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

八. 関係法人との契約の更改

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

二. 公告

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

(URL <http://www.am-one.co.jp/>)

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

ホ. 運用報告書

・委託会社は、毎年10月12日(休業日の場合は翌営業日とします。)および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

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

(URL <http://www.am-one.co.jp/>)

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金請求権

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

受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

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

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

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期計算期間(令和1年10月16日から令和2年10月12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国内株式パッシブ・ファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第11期 令和1年10月15日現在	第12期 令和2年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,341,106	19,072,510
親投資信託受益証券	7,444,428,487	8,367,711,177
未収入金	-	4,899,000
流動資産合計	7,460,769,593	8,391,682,687
資産合計	7,460,769,593	8,391,682,687
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	4,670,397
未払受託者報酬	1,040,846	1,214,525
未払委託者報酬	14,572,510	17,003,845
その他未払費用	52,649	58,152
流動負債合計	15,666,005	22,946,919
負債合計	15,666,005	22,946,919
純資産の部		
元本等		
元本	3,092,725,388	3,362,379,516
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,352,378,200	5,006,356,252
(分配準備積立金)	643,849,709	833,461,456
元本等合計	7,445,103,588	8,368,735,768
純資産合計	7,445,103,588	8,368,735,768
負債純資産合計	7,460,769,593	8,391,682,687

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第11期 自 平成30年10月13日 至 令和1年10月15日	第12期 自 令和1年10月16日 至 令和2年10月12日
営業収益		
有価証券売買等損益	20,236,034	599,254,690
営業収益合計	20,236,034	599,254,690
営業費用		
支払利息	11,793	4,537
受託者報酬	1,998,362	2,265,014
委託者報酬	27,978,087	31,711,333
その他費用	101,073	109,918
営業費用合計	30,089,315	34,090,802
営業利益又は営業損失()	50,325,349	565,163,888
経常利益又は経常損失()	50,325,349	565,163,888
当期純利益又は当期純損失()	50,325,349	565,163,888
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()	93,481,158	92,096,201
期首剰余金又は期首欠損金()	3,434,713,855	4,352,378,200
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,138,373,795	1,493,894,780
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	2,138,373,795	1,493,894,780
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,263,865,259	1,312,984,415
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,263,865,259	1,312,984,415
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()	4,352,378,200	5,006,356,252

(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12期	
	自 令和1年10月16日	至 令和2年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年10月12日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を令和1年10月15日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第11期	第12期
	令和1年10月15日現在	令和2年10月12日現在
1. 期首元本額	2,323,784,774円	3,092,725,388円
期中追加設定元本額	1,644,306,045円	1,205,686,297円
期中一部解約元本額	875,365,431円	936,032,169円
2. 受益権の総数	3,092,725,388口	3,362,379,516口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期	第12期
	自 平成30年10月13日 至 令和1年10月15日	自 令和1年10月16日 至 令和2年10月12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(124,578,875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(3,708,528,491円)及び分配準備積立金(519,270,834円)より分配対象収益は4,352,378,200円(1万口当たり14,072.95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(143,836,894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(230,560,521円)、信託約款に規定される収益調整金(4,172,894,796円)及び分配準備積立金(459,064,041円)より分配対象収益は5,006,356,252円(1万口当たり14,889.32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11期	第12期
	自 平成30年10月13日 至 令和1年10月15日	自 令和1年10月16日 至 令和2年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、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。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期 令和1年10月15日現在	第12期 令和2年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第11期 令和1年10月15日現在	第12期 令和2年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	65,497,240	504,313,148
合計	65,497,240	504,313,148

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第11期 令和1年10月15日現在	第12期 令和2年10月12日現在
1口当たり純資産額	2.4073円	2.4889円
(1万口当たり純資産額)	(24,073円)	(24,889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10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	3,145,283,107	8,367,711,177	
親投資信託受益証券	合計	3,145,283,107	8,367,711,177	
合計			8,367,711,177	

(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10月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,110,016,027
株式	269,699,004,960
派生商品評価勘定	38,555,220
未収入金	4,074,720
未収配当金	2,067,976,218
流動資産合計	276,919,627,145
資産合計	276,919,627,145
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	35,267,170
前受金	24,305,000
未払解約金	215,976,000
流動負債合計	275,548,170
負債合計	275,548,170
純資産の部	
元本等	
元本	103,987,218,101
剰余金	
剰余金又は欠損金()	172,656,860,874
元本等合計	276,644,078,975
純資産合計	276,644,078,975
負債純資産合計	276,919,627,145

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1年10月16日 至 令和2年10月12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10月12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	94,478,900,732円
同期中追加設定元本額	62,911,417,452円
同期中一部解約元本額	53,403,100,083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	15,596,694,041円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	3,145,283,107円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,925,045円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	5,660,716円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	8,814,010円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	29,269,087円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	19,603,715円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	14,400,527円
たわらノーロード TOPIX	757,672,275円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	537,458,539円
たわらノーロード バランス(堅実型)	19,766,839円
たわらノーロード バランス(標準型)	119,195,468円
たわらノーロード バランス(積極型)	177,047,384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)	1,604,015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)	97,288,187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)	223,677,685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)	145,191,063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)	218,526,474円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	403,495円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,265,161円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	3,821,304円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,271,430円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	5,345,728円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	35,844,058,632円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,073,404,189円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,534,387,970円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,559,616,924円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	360,911,430円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,241,126,125円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,129,169,578円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	37,792,869円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,133,520,861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)	328,799,044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)	442,628,172円
投資のソムリエ	13,620,655,457円
クルーズコントロール	771,396,244円
投資のソムリエ<DC年金>	1,007,815,859円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	302,075,337円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	366,764,607円
クルーズコントロール<DC年金>	527,293円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	8,865,869円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	21,318,868円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	351,600,145円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,638,240,185円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	13,626,172円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	7,374,605円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,524,698円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	25,509,602円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	95,656,027円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,790,638,779円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	257,236,143円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	3,629,002円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	1,865,449円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	1,717,874円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,276,212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)	57,113,175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)	70,040,989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)	110,692,735円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	30,719,994円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	47,510,969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)	396,339,217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)	106,023,462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)	82,863,403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)	164,576,067円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	11,563,792円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	39,512,373円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	12,255,544円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	7,200,779円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	25,290,673円

D I A M世界バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	53,806,919円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	787,600,443円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限定)	811,053,974円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2,294,573,600円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	164,232,371円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	43,745,035円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	418,524,178円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	123,002,092円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	2,167,321円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	538,953,561円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	29,078,825円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	110,427,892円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	259,635,174円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	420,246,693円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	50,827,276円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	22,503,927円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定)	393,007,566円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定)	1,221,729,553円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定)	1,617,326,889円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定)	64,680,554円
計	103,987,218,101円
2. 受益権の総数	103,987,218,101口
3. 差入代用有価証券 株式	1,727,750,000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 令和1年10月16日 至 令和2年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動による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。
-------------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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10月12日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)
株式	4,147,088,819
合計	4,147,088,819

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	令和2年10月12日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	6,802,575,000	-	6,806,000,000	3,425,000
合計	6,802,575,000	-	6,806,000,000	3,425,000

(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

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10月12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6604円 (26,604円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

令和2年10月12日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	5,700	2,785.00	15,874,500	
日本水産	159,000	429.00	68,211,000	
マルハニチロ	23,000	2,304.00	52,992,000	
ハウスイ	700	938.00	656,600	
カネコ種苗	4,900	1,549.00	7,590,100	
サカタのタネ	19,000	3,990.00	75,810,000	
ホクト	12,200	2,260.00	27,572,000	
ホクリヨウ	2,500	690.00	1,725,000	
ヒノキヤグループ	4,000	1,984.00	7,936,000	
ショーボンドホールディングス	24,700	5,090.00	125,723,000	
ミライト・ホールディングス	47,100	1,620.00	76,302,000	
タマホーム	8,500	1,449.00	12,316,500	
サンヨーホームズ	1,100	682.00	750,200	
日本アクア	6,400	739.00	4,729,600	
ファーストコーポレーション	4,900	743.00	3,640,700	
ベステラ	2,800	1,427.00	3,995,600	
TATERU	30,000	213.00	6,390,000	
キャンディル	2,700	682.00	1,841,400	
スペースバリューホールディングス	19,400	579.00	11,232,600	
住石ホールディングス	32,500	126.00	4,095,000	
日鉄鉱業	3,700	4,650.00	17,205,000	
三井松島ホールディングス	6,200	734.00	4,550,800	
国際石油開発帝石	584,600	569.10	332,695,860	
石油資源開発	20,800	1,849.00	38,459,200	
K&Oエナジーグループ	7,800	1,490.00	11,622,000	
ダイセキ環境ソリューション	2,900	722.00	2,093,800	
第一カッター興業	2,000	2,238.00	4,476,000	
明豊ファシリティワークス	5,100	626.00	3,192,600	
安藤・間	94,700	727.00	68,846,900	
東急建設	46,600	482.00	22,461,200	
コムシスホールディングス	56,400	2,872.00	161,980,800	
ピーアールホールディングス	17,300	769.00	13,303,700	

高松コンストラクショングループ	10,000	2,268.00	22,680,000	
東建コーポレーション	4,900	7,940.00	38,906,000	
ソネック	1,900	865.00	1,643,500	
ヤマウラ	7,100	898.00	6,375,800	
大成建設	122,400	3,580.00	438,192,000	
大林組	367,400	942.00	346,090,800	
清水建設	372,700	785.00	292,569,500	
飛島建設	10,700	1,075.00	11,502,500	
長谷工コーポレーション	142,000	1,350.00	191,700,000	
松井建設	14,600	710.00	10,366,000	
銭高組	1,300	4,480.00	5,824,000	
鹿島建設	288,300	1,231.00	354,897,300	
不動テトラ	9,600	1,520.00	14,592,000	
大末建設	3,900	906.00	3,533,400	
鉄建建設	8,100	2,052.00	16,621,200	
西松建設	28,300	2,090.00	59,147,000	
三井住友建設	88,300	443.00	39,116,900	
大豊建設	8,300	3,190.00	26,477,000	
前田建設工業	92,000	781.00	71,852,000	
佐田建設	7,300	455.00	3,321,500	
ナカノフドー建設	11,000	411.00	4,521,000	
奥村組	17,300	2,581.00	44,651,300	
東鉄工業	15,800	2,800.00	44,240,000	
イチケン	2,700	1,696.00	4,579,200	
富士ピー・エス	5,500	589.00	3,239,500	
浅沼組	4,100	4,105.00	16,830,500	
戸田建設	152,700	707.00	107,958,900	
熊谷組	17,000	2,619.00	44,523,000	
北野建設	2,100	2,691.00	5,651,100	
植木組	1,700	2,681.00	4,557,700	
矢作建設工業	16,300	870.00	14,181,000	
ピーエス三菱	12,200	613.00	7,478,600	
日本ハウスホールディングス	25,500	273.00	6,961,500	
大東建託	40,100	9,504.00	381,110,400	
新日本建設	15,700	894.00	14,035,800	
N I P P O	30,500	2,846.00	86,803,000	
東亜道路工業	2,300	3,620.00	8,326,000	
前田道路	32,400	1,814.00	58,773,600	
日本道路	3,600	7,540.00	27,144,000	
東亜建設工業	11,500	1,812.00	20,838,000	
日本国土開発	35,800	613.00	21,945,400	
若築建設	6,700	1,186.00	7,946,200	
東洋建設	41,100	424.00	17,426,400	
五洋建設	145,600	658.00	95,804,800	
世紀東急工業	17,700	822.00	14,549,400	
福田組	4,300	5,030.00	21,629,000	
日本ドライケミカル	2,900	1,470.00	4,263,000	
住友林業	93,000	1,698.00	157,914,000	
日本基礎技術	12,500	459.00	5,737,500	
巴コーポレーション	16,600	384.00	6,374,400	

大和ハウス工業	363,300	2,895.00	1,051,753,500
ライト工業	21,100	1,593.00	33,612,300
積水ハウス	398,300	1,775.50	707,181,650
日特建設	9,800	782.00	7,663,600
北陸電気工事	6,500	1,204.00	7,826,000
ユアテック	21,400	652.00	13,952,800
日本リーテック	7,700	2,453.00	18,888,100
四電工	1,800	2,281.00	4,105,800
中電工	14,900	2,190.00	32,631,000
関電工	52,600	849.00	44,657,400
きんでん	87,400	1,790.00	156,446,000
東京エネシス	12,400	756.00	9,374,400
トーエネック	3,300	3,495.00	11,533,500
住友電設	10,400	2,511.00	26,114,400
日本電設工業	20,200	2,118.00	42,783,600
協和エクシオ	55,600	2,649.00	147,284,400
新日本空調	9,700	2,203.00	21,369,100
日本工営	7,500	2,781.00	20,857,500
九電工	25,800	3,045.00	78,561,000
三機工業	26,100	1,172.00	30,589,200
日揮ホールディングス	112,900	987.00	111,432,300
中外炉工業	4,100	1,504.00	6,166,400
ヤマト	11,900	688.00	8,187,200
太平電業	8,900	2,247.00	19,998,300
高砂熱学工業	30,900	1,513.00	46,751,700
三晃金属工業	1,400	2,626.00	3,676,400
NEC ネットエスアイ	32,500	2,036.00	66,170,000
朝日工業社	2,300	2,970.00	6,831,000
明星工業	23,800	798.00	18,992,400
大気社	17,900	2,857.00	51,140,300
ダイダン	8,800	2,691.00	23,680,800
日比谷総合設備	11,900	1,729.00	20,575,100
日本製粉	34,500	1,731.00	59,719,500
日清製粉グループ本社	132,800	1,684.00	223,635,200
日東富士製粉	700	6,500.00	4,550,000
昭和産業	10,900	3,345.00	36,460,500
鳥越製粉	10,700	1,043.00	11,160,100
中部飼料	14,400	1,636.00	23,558,400
フィード・ワン	15,880	919.00	14,593,720
東洋精糖	1,900	1,269.00	2,411,100
日本甜菜製糖	6,200	1,818.00	11,271,600
三井製糖	10,400	1,906.00	19,822,400
塩水港精糖	13,200	226.00	2,983,200
日新製糖	4,800	1,889.00	9,067,200
LIFULL	39,000	418.00	16,302,000
ミクシィ	21,300	3,040.00	64,752,000
ジェイエイシーリクルートメント	7,500	1,369.00	10,267,500
日本M&Aセンター	85,600	6,450.00	552,120,000
メンバーズ	3,300	1,973.00	6,510,900
中広	1,300	497.00	646,100

UTグループ	17,600	3,770.00	66,352,000
アイティメディア	4,500	2,940.00	13,230,000
タケエイ	12,200	1,060.00	12,932,000
E・Jホールディングス	2,000	2,470.00	4,940,000
ビーネックスグループ	14,000	1,209.00	16,926,000
コシダカホールディングス	26,700	430.00	11,481,000
アルトナー	2,600	949.00	2,467,400
パソナグループ	12,100	1,591.00	19,251,100
CDS	2,700	1,365.00	3,685,500
リンクアンドモチベーション	20,600	433.00	8,919,800
GCA	14,400	674.00	9,705,600
エス・エム・エス	34,800	3,305.00	115,014,000
サニーサイドアップグループ	3,900	715.00	2,788,500
パーソルホールディングス	111,800	1,714.00	191,625,200
リニカル	5,500	830.00	4,565,000
クックパッド	35,100	379.00	13,302,900
エスクリ	3,200	372.00	1,190,400
アイ・ケイ・ケイ	5,600	633.00	3,544,800
森永製菓	27,600	4,200.00	115,920,000
中村屋	2,800	4,080.00	11,424,000
江崎グリコ	32,400	4,645.00	150,498,000
名糖産業	5,900	1,506.00	8,885,400
井村屋グループ	6,800	2,437.00	16,571,600
不二家	7,600	2,423.00	18,414,800
山崎製パン	88,100	1,817.00	160,077,700
第一屋製パン	1,900	996.00	1,892,400
モロゾフ	1,800	5,930.00	10,674,000
亀田製菓	6,800	5,240.00	35,632,000
寿スピリッツ	11,300	5,310.00	60,003,000
カルビー	53,600	3,365.00	180,364,000
森永乳業	21,800	5,440.00	118,592,000
六甲バター	7,900	1,763.00	13,927,700
ヤクルト本社	80,900	5,380.00	435,242,000
明治ホールディングス	77,700	7,660.00	595,182,000
雪印メグミルク	28,400	2,470.00	70,148,000
プリマハム	18,400	3,105.00	57,132,000
日本ハム	44,900	4,460.00	200,254,000
林兼産業	3,700	574.00	2,123,800
丸大食品	12,600	1,759.00	22,163,400
S Foods	9,400	2,880.00	27,072,000
柿安本店	4,100	2,544.00	10,430,400
伊藤ハム米久ホールディングス	75,900	743.00	56,393,700
学情	3,900	1,212.00	4,726,800
スタジオアリス	5,700	1,731.00	9,866,700
クロスキャット	3,000	1,510.00	4,530,000
シミックホールディングス	5,600	1,349.00	7,554,400
エプロ	2,700	1,018.00	2,748,600
システナ	41,000	1,853.00	75,973,000
NJS	2,300	1,904.00	4,379,200
デジタルアーツ	5,600	8,400.00	47,040,000

日鉄ソリューションズ	17,200	3,230.00	55,556,000
総合警備保障	44,500	5,100.00	226,950,000
キューブシステム	6,100	1,494.00	9,113,400
いちご	147,000	332.00	48,804,000
エイジア	2,100	2,344.00	4,922,400
日本駐車場開発	114,200	130.00	14,846,000
コア	4,900	1,407.00	6,894,300
カカクコム	82,600	3,070.00	253,582,000
アイロムグループ	4,000	2,025.00	8,100,000
セントケア・ホールディング	7,300	777.00	5,672,100
サイネックス	2,000	841.00	1,682,000
ルネサンス	6,200	925.00	5,735,000
ディップ	15,300	2,263.00	34,623,900
SBSホールディングス	8,700	2,310.00	20,097,000
デジタルホールディングス	7,800	1,452.00	11,325,600
新日本科学	12,100	751.00	9,087,100
ツクイホールディングス	26,400	567.00	14,968,800
キャリアデザインセンター	2,700	1,003.00	2,708,100
ベネフィット・ワン	40,700	2,810.00	114,367,000
エムスリー	246,800	7,070.00	1,744,876,000
ツカダ・グローバルホールディング	9,100	277.00	2,520,700
プラス	1,600	466.00	745,600
アウトソーシング	64,000	1,143.00	73,152,000
ウェルネット	11,300	618.00	6,983,400
ワールドホールディングス	3,800	2,253.00	8,561,400
ディー・エヌ・エー	47,300	1,963.00	92,849,900
博報堂DYホールディングス	155,600	1,478.00	229,976,800
ぐるなび	19,400	808.00	15,675,200
タカミヤ	12,200	548.00	6,685,600
ジャパンベストレスキューシステム	8,800	1,172.00	10,313,600
ファンコミュニケーションズ	30,800	478.00	14,722,400
ライク	3,700	2,340.00	8,658,000
ビジネス・ブレークスルー	4,400	377.00	1,658,800
エスプール	28,700	803.00	23,046,100
WDBホールディングス	5,100	3,165.00	16,141,500
手間いらず	700	6,120.00	4,284,000
ティア	6,800	400.00	2,720,000
CDG	1,400	1,650.00	2,310,000
バリューコマース	7,500	3,785.00	28,387,500
インフォマート	113,200	998.00	112,973,600
サッポロホールディングス	40,100	1,896.00	76,029,600
アサヒグループホールディングス	256,800	3,760.00	965,568,000
キリンホールディングス	498,500	1,987.50	990,768,750
宝ホールディングス	87,200	1,093.00	95,309,600
オエノンホールディングス	33,800	440.00	14,872,000
養命酒製造	3,800	1,838.00	6,984,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	90,000	1,749.00	157,410,000
サントリー食品インターナショナル	78,700	3,975.00	312,832,500
ダイドーグループホールディングス	6,000	5,190.00	31,140,000

伊藤園	35,700	7,260.00	259,182,000
キーコーヒー	11,600	2,262.00	26,239,200
ユニカフェ	2,900	1,038.00	3,010,200
ジャパンフーズ	1,600	1,289.00	2,062,400
日清オイリオグループ	15,100	3,100.00	46,810,000
不二製油グループ本社	28,700	3,420.00	98,154,000
かどや製油	1,100	3,870.00	4,257,000
J-オイルミルズ	6,100	3,855.00	23,515,500
ローソン	29,200	5,170.00	150,964,000
サンエー	9,600	4,460.00	42,816,000
カワチ薬品	8,900	2,808.00	24,991,200
エービーシー・マート	18,000	5,580.00	100,440,000
ハードオフコーポレーション	4,800	671.00	3,220,800
高千穂交易	4,700	988.00	4,643,600
アスクル	12,100	4,645.00	56,204,500
ゲオホールディングス	20,700	1,655.00	34,258,500
アダストリア	15,900	1,553.00	24,692,700
ジーフット	7,600	489.00	3,716,400
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,800	435.00	783,000
伊藤忠食品	2,600	5,420.00	14,092,000
くら寿司	6,800	6,200.00	42,160,000
キャンドウ	5,500	2,117.00	11,643,500
エレマテック	10,900	960.00	10,464,000
パルグループホールディングス	11,800	1,137.00	13,416,600
JALUX	3,300	1,578.00	5,207,400
エディオン	53,000	1,089.00	57,717,000
あらた	9,200	4,940.00	45,448,000
サーラコーポレーション	23,900	590.00	14,101,000
ワッツ	5,100	942.00	4,804,200
トーメンデバイス	1,800	4,125.00	7,425,000
ハローズ	4,400	3,780.00	16,632,000
J Pホールディングス	35,500	305.00	10,827,500
フジオフードグループ本社	9,800	1,441.00	14,121,800
あみやき亭	2,500	3,030.00	7,575,000
東京エレクトロン デバイス	4,200	3,270.00	13,734,000
ひらまつ	21,400	210.00	4,494,000
フィールズ	8,800	336.00	2,956,800
双日	636,800	238.00	151,558,400
アルフレッサ ホールディングス	128,100	2,259.00	289,377,900
大黒天物産	2,800	5,630.00	15,764,000
ハニーズホールディングス	10,100	974.00	9,837,400
ファーマライズホールディングス	2,700	835.00	2,254,500
キッコーマン	84,600	5,340.00	451,764,000
味の素	259,600	2,113.50	548,664,600
キュービー	65,400	2,285.00	149,439,000
ハウス食品グループ本社	44,000	3,625.00	159,500,000
カゴメ	48,100	3,645.00	175,324,500
焼津水産化学工業	5,100	1,023.00	5,217,300
アリアケジャパン	10,700	7,110.00	76,077,000
ピエトロ	1,300	1,690.00	2,197,000

エバラ食品工業	2,600	2,442.00	6,349,200
やまみ	1,100	2,180.00	2,398,000
ニチレイ	56,000	2,722.00	152,432,000
横浜冷凍	30,400	882.00	26,812,800
東洋水産	60,500	5,410.00	327,305,000
イトアンドホールディングス	4,300	1,896.00	8,152,800
大冷	1,600	2,177.00	3,483,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,500	1,024.00	6,656,000
日清食品ホールディングス	50,000	9,570.00	478,500,000
永谷園ホールディングス	5,900	2,430.00	14,337,000
一正蒲鉾	4,100	1,172.00	4,805,200
フジッコ	12,800	2,053.00	26,278,400
ロック・フィールド	12,700	1,501.00	19,062,700
日本たばこ産業	630,300	2,006.00	1,264,381,800
ケンコーマヨネーズ	6,700	1,850.00	12,395,000
わらべや日洋ホールディングス	7,800	1,545.00	12,051,000
なとり	6,700	2,071.00	13,875,700
イフジ産業	2,500	904.00	2,260,000
ピクルスコーポレーション	2,600	3,125.00	8,125,000
北の達人コーポレーション	41,100	539.00	22,152,900
ユーグレナ	50,800	893.00	45,364,400
スター・マイカ・ホールディングス	6,000	1,467.00	8,802,000
A Dワークスグループ	21,500	159.00	3,418,500
片倉工業	15,400	1,205.00	18,557,000
ゲンゼ	8,400	4,040.00	33,936,000
ヒューリック	244,900	1,033.00	252,981,700
神栄	1,700	610.00	1,037,000
ラサ商事	6,300	895.00	5,638,500
アルペン	8,900	2,113.00	18,805,700
ハブ	3,300	651.00	2,148,300
ラクーンホールディングス	5,500	2,248.00	12,364,000
クオールホールディングス	17,000	1,180.00	20,060,000
アルコニックス	12,400	1,538.00	19,071,200
神戸物産	39,800	5,780.00	230,044,000
ソリトンシステムズ	5,700	2,147.00	12,237,900
ジinzホールディングス	6,100	8,690.00	53,009,000
ビックカメラ	68,300	1,302.00	88,926,600
D C Mホールディングス	70,100	1,429.00	100,172,900
ペッパーフードサービス	10,200	330.00	3,366,000
ハイパー	1,900	581.00	1,103,900
MonotaRO	82,000	5,630.00	461,660,000
東京一番フーズ	2,900	579.00	1,679,100
DDホールディングス	4,600	771.00	3,546,600
あいホールディングス	16,500	1,959.00	32,323,500
ディービーエックス	4,300	1,055.00	4,536,500
きちりホールディングス	3,200	655.00	2,096,000
アークランドサービスホールディングス	9,700	2,098.00	20,350,600
J.フロントリテイリング	137,600	807.00	111,043,200
ドトール・日レスホールディングス	16,600	1,682.00	27,921,200

マツモトキヨシホールディングス	47,600	4,135.00	196,826,000
ブロンコビリー	6,000	2,379.00	14,274,000
ZOZO	79,300	3,150.00	249,795,000
トレジャー・ファクトリー	3,400	811.00	2,757,400
物語コーポレーション	3,100	11,220.00	34,782,000
ココカラファイン	12,000	6,970.00	83,640,000
三越伊勢丹ホールディングス	201,500	588.00	118,482,000
東洋紡	45,300	1,507.00	68,267,100
ユニチカ	33,500	389.00	13,031,500
富士紡ホールディングス	5,500	3,625.00	19,937,500
日清紡ホールディングス	71,500	712.00	50,908,000
倉敷紡績	11,500	1,895.00	21,792,500
ダイワボウホールディングス	9,800	6,540.00	64,092,000
シキボウ	6,200	972.00	6,026,400
日東紡績	17,400	4,225.00	73,515,000
トヨタ紡織	34,200	1,545.00	52,839,000
マクニカ・富士エレホールディングス	27,500	1,900.00	52,250,000
Hamee	4,100	2,415.00	9,901,500
ラクト・ジャパン	5,000	3,775.00	18,875,000
ウエルシアホールディングス	68,600	4,185.00	287,091,000
クリエイトSDホールディングス	19,400	3,515.00	68,191,000
パイタルケーエスケー・ホールディングス	22,000	1,052.00	23,144,000
八洲電機	9,000	945.00	8,505,000
メディアスホールディングス	6,700	914.00	6,123,800
レスターホールディングス	12,100	2,203.00	26,656,300
ジュテックホールディングス	2,500	1,031.00	2,577,500
丸善CHIホールディングス	15,000	374.00	5,610,000
大光	4,600	708.00	3,256,800
OCHIホールディングス	3,000	1,800.00	5,400,000
TOKAIホールディングス	61,000	1,062.00	64,782,000
黒谷	3,500	525.00	1,837,500
ミサワ	2,200	758.00	1,667,600
ティーライフ	1,700	1,286.00	2,186,200
Cominix	1,900	712.00	1,352,800
エー・ピーホールディングス	2,100	418.00	877,800
三洋貿易	11,600	1,029.00	11,936,400
チムニー	3,400	1,356.00	4,610,400
シュッピン	7,800	908.00	7,082,400
ビューティガレージ	1,900	2,968.00	5,639,200
オイシックス・ラ・大地	11,400	3,535.00	40,299,000
ウイン・パートナーズ	8,500	1,043.00	8,865,500
ネクステージ	19,300	1,519.00	29,316,700
ジョイフル本田	33,800	1,609.00	54,384,200
鳥貴族	3,300	1,586.00	5,233,800
麒麟堂ホールディングス	4,500	3,490.00	15,705,000
ホットランド	8,600	1,213.00	10,431,800
すかいらーくホールディングス	129,200	1,503.00	194,187,600
SFPホールディングス	6,600	1,430.00	9,438,000
綿半ホールディングス	8,600	1,488.00	12,796,800

日本毛織	37,800	1,017.00	38,442,600
ダイトウボウ	18,700	108.00	2,019,600
トーア紡コーポレーション	4,200	516.00	2,167,200
ダイドーリミテッド	14,100	203.00	2,862,300
ヨシックス	1,900	1,855.00	3,524,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	33,500	1,164.00	38,994,000
三栄建築設計	4,700	1,645.00	7,731,500
野村不動産ホールディングス	70,200	1,992.00	139,838,400
三重交通グループホールディングス	23,600	464.00	10,950,400
サムティ	16,400	1,752.00	28,732,800
ディア・ライフ	16,100	417.00	6,713,700
コーセーアールイー	3,600	588.00	2,116,800
日本商業開発	7,300	1,796.00	13,110,800
プレサンスコーポレーション	18,900	1,452.00	27,442,800
フィル・カンパニー	2,100	2,057.00	4,319,700
THEグローバル社	5,400	219.00	1,182,600
ハウスコム	1,300	1,299.00	1,688,700
日本管理センター	6,300	1,296.00	8,164,800
サンセイランディック	3,500	770.00	2,695,000
エストラスト	1,400	775.00	1,085,000
フージャースホールディングス	23,100	648.00	14,968,800
オープンハウス	36,400	3,845.00	139,958,000
東急不動産ホールディングス	313,800	494.00	155,017,200
飯田グループホールディングス	96,300	2,036.00	196,066,800
イーグランド	2,100	800.00	1,680,000
ムゲンエステート	7,400	520.00	3,848,000
帝国繊維	12,900	2,639.00	34,043,100
日本コークス工業	99,900	64.00	6,393,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,100	796.00	4,855,600
ミタチ産業	3,100	629.00	1,949,900
B E E N O S	5,300	1,862.00	9,868,600
あさひ	8,600	1,897.00	16,314,200
日本調剤	7,100	1,780.00	12,638,000
コスモス薬品	10,200	17,210.00	175,542,000
シップヘルスケアホールディングス	18,500	5,390.00	99,715,000
トーエル	5,700	843.00	4,805,100
ソフトクリエイイトホールディングス	5,000	3,215.00	16,075,000
オンリー	1,800	554.00	997,200
セブン&アイ・ホールディングス	451,200	3,528.00	1,591,833,600
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	62,000	630.00	39,060,000
明治電機工業	3,300	1,381.00	4,557,300
ツルハホールディングス	25,100	14,960.00	375,496,000
デリカフーズホールディングス	4,900	620.00	3,038,000
スターティアホールディングス	2,600	754.00	1,960,400
サンマルクホールディングス	9,200	1,654.00	15,216,800
フェリシモ	2,700	1,504.00	4,060,800
トリドールホールディングス	28,500	1,451.00	41,353,500
帝人	93,700	1,694.00	158,727,800

東レ	830,400	500.40	415,532,160
クラレ	180,600	1,050.00	189,630,000
旭化成	760,100	938.50	713,353,850
サカイオーベックス	3,100	2,100.00	6,510,000
TOKYO BASE	10,400	412.00	4,284,800
稲葉製作所	6,700	1,364.00	9,138,800
宮地エンジニアリンググループ	3,600	1,694.00	6,098,400
トーカロ	32,100	1,139.00	36,561,900
アルファ	3,700	1,019.00	3,770,300
SUMCO	148,100	1,567.00	232,072,700
川田テクノロジーズ	2,400	4,655.00	11,172,000
RS Technologies	3,800	3,610.00	13,718,000
信和	6,800	706.00	4,800,800
ビーロッド	5,400	812.00	4,384,800
ファーストブラザーズ	2,500	977.00	2,442,500
ハウストゥ	5,700	1,340.00	7,638,000
シーアールイー	3,000	1,358.00	4,074,000
プロパティエージェント	1,900	1,360.00	2,584,000
ケイアイスター不動産	3,600	2,774.00	9,986,400
アグレ都市デザイン	2,000	683.00	1,366,000
グッドコムアセット	2,800	3,670.00	10,276,000
ジェイ・エス・ビー	2,100	3,030.00	6,363,000
テンポイノベーション	2,600	822.00	2,137,200
グローバル・リンク・マネジメント	2,000	766.00	1,532,000
住江織物	2,300	2,169.00	4,988,700
日本フェルト	6,000	483.00	2,898,000
イチカワ	1,400	1,340.00	1,876,000
エコナックホールディングス	19,900	98.00	1,950,200
日東製網	1,400	1,505.00	2,107,000
芦森工業	2,300	887.00	2,040,100
アツギ	9,600	562.00	5,395,200
ウイルプラスホールディングス	1,700	593.00	1,008,100
JMホールディングス	8,700	2,611.00	22,715,700
コメダホールディングス	25,100	1,975.00	49,572,500
サツドラホールディングス	1,600	2,022.00	3,235,200
アレンザホールディングス	5,800	1,546.00	8,966,800
串カツ田中ホールディングス	3,000	1,747.00	5,241,000
バロックジャパンリミテッド	8,100	633.00	5,127,300
クスリのアオキホールディングス	10,300	8,340.00	85,902,000
ダイニック	3,700	830.00	3,071,000
共和レザー	5,500	616.00	3,388,000
ピーバンドットコム	1,100	968.00	1,064,800
力の源ホールディングス	5,300	629.00	3,333,700
スシローグローバルホールディングス	63,300	2,921.00	184,899,300
アセンテック	2,400	2,396.00	5,750,400
セーレン	28,200	1,603.00	45,204,600
ソトー	4,100	948.00	3,886,800
東海染工	1,400	1,116.00	1,562,400
小松マテーレ	19,000	822.00	15,618,000
ワコールホールディングス	28,600	2,039.00	58,315,400

ホギメディカル	13,100	3,550.00	46,505,000
クラウドシアホールディングス	2,700	305.00	823,500
T S Iホールディングス	34,800	278.00	9,674,400
マツオカコーポレーション	3,300	2,185.00	7,210,500
ワールド	16,200	1,414.00	22,906,800
T I S	114,900	2,261.00	259,788,900
J N Sホールディングス	4,600	766.00	3,523,600
電算システム	4,000	3,905.00	15,620,000
グリー	70,800	521.00	36,886,800
コーエーテクモホールディングス	23,500	5,260.00	123,610,000
三菱総合研究所	4,900	4,390.00	21,511,000
ボルテージ	2,700	626.00	1,690,200
電算	1,100	2,442.00	2,686,200
A G S	6,600	920.00	6,072,000
ファインデックス	9,700	1,520.00	14,744,000
ブレインパッド	3,000	4,445.00	13,335,000
K L a b	20,800	1,007.00	20,945,600
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	13,900	1,050.00	14,595,000
イーブクイニシアティブジャパン	1,700	3,385.00	5,754,500
ネクソン	289,900	2,616.00	758,378,400
アイスタイル	32,100	401.00	12,872,100
エムアップホールディングス	3,300	3,045.00	10,048,500
エイチーム	7,800	857.00	6,684,600
エニグモ	10,800	1,539.00	16,621,200
テクノスジャパン	8,900	962.00	8,561,800
e n i s h	6,000	647.00	3,882,000
コロブラ	37,700	966.00	36,418,200
オルトプラス	6,900	525.00	3,622,500
ブロードリーフ	56,800	562.00	31,921,600
クロス・マーケティンググループ	5,100	395.00	2,014,500
デジタルハーツホールディングス	6,100	1,131.00	6,899,100
システム情報	8,600	1,409.00	12,117,400
メディアドゥ	3,700	8,430.00	31,191,000
じげん	28,300	370.00	10,471,000
バイキューブ	6,300	2,307.00	14,534,100
エンカレッジ・テクノロジー	2,500	887.00	2,217,500
サイバーリンクス	1,900	3,555.00	6,754,500
ディー・エル・イー	9,200	447.00	4,112,400
フィックスターズ	12,200	1,110.00	13,542,000
C A R T A H O L D I N G S	4,900	1,380.00	6,762,000
オブティム	6,000	3,360.00	20,160,000
セレス	3,800	2,401.00	9,123,800
S H I F T	4,600	17,550.00	80,730,000
特種東海製紙	7,100	4,640.00	32,944,000
ティーガイア	10,200	1,956.00	19,951,200
セック	1,700	3,090.00	5,253,000
日本アジアグループ	12,600	301.00	3,792,600
テクマトリックス	16,200	2,490.00	40,338,000
プロシップ	3,400	1,538.00	5,229,200

ガンホー・オンライン・エンターテイメント	27,700	2,184.00	60,496,800	
GMOペイメントゲートウェイ	24,300	12,310.00	299,133,000	
ザッパラス	4,700	457.00	2,147,900	
システムリサーチ	3,000	1,912.00	5,736,000	
インターネットイニシアティブ	17,000	5,250.00	89,250,000	
さくらインターネット	12,300	809.00	9,950,700	
ヴィンクス	3,300	1,308.00	4,316,400	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,500	10,860.00	27,150,000	
SRAホールディングス	6,100	2,408.00	14,688,800	
システムインテグレータ	3,500	715.00	2,502,500	
朝日ネット	8,100	1,026.00	8,310,600	
eBASE	13,700	1,288.00	17,645,600	
アバント	10,900	1,229.00	13,396,100	
アドソル日進	4,100	2,739.00	11,229,900	
フリービット	6,000	1,000.00	6,000,000	
コムチュア	12,900	3,035.00	39,151,500	
サイバーコム	2,100	1,869.00	3,924,900	
アステリア	7,000	889.00	6,223,000	
アイル	6,400	1,513.00	9,683,200	
王子ホールディングス	479,500	481.00	230,639,500	
日本製紙	50,800	1,298.00	65,938,400	
三菱製紙	13,700	344.00	4,712,800	
北越コーポレーション	68,700	377.00	25,899,900	
中越パルプ工業	4,300	1,425.00	6,127,500	
巴川製紙所	3,500	951.00	3,328,500	
大王製紙	52,900	1,547.00	81,836,300	
阿波製紙	3,200	474.00	1,516,800	
マークライنز	4,800	2,570.00	12,336,000	
メディカル・データ・ビジョン	13,100	2,754.00	36,077,400	
gumi	14,700	1,001.00	14,714,700	
ショーケース	2,600	925.00	2,405,000	
モバイルファクトリー	2,600	1,290.00	3,354,000	
テラスカイ	4,100	5,610.00	23,001,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,500	1,395.00	6,277,500	
PCIホールディングス	4,300	1,280.00	5,504,000	
パイプドHD	1,500	1,765.00	2,647,500	
アイビーシー	1,900	1,188.00	2,257,200	
ネオジャパン	2,200	2,497.00	5,493,400	
PR TIMES	1,900	2,903.00	5,515,700	
ランドコンピュータ	1,600	1,144.00	1,830,400	
ダブルスタンダード	1,500	5,150.00	7,725,000	
オーブンドア	5,700	1,419.00	8,088,300	
マイネット	3,800	1,415.00	5,377,000	
アカツキ	4,100	4,980.00	20,418,000	
ベネフィットジャパン	900	2,024.00	1,821,600	
Ubicomホールディングス	2,500	3,105.00	7,762,500	
LINE	26,500	5,410.00	143,365,000	

カナミックネットワーク	10,500	826.00	8,673,000
ノムラシステムコーポレーション	4,900	454.00	2,224,600
レンゴー	108,500	843.00	91,465,500
トーモク	7,100	1,709.00	12,133,900
ザ・パック	8,700	2,945.00	25,621,500
チェンジ	8,000	9,700.00	77,600,000
シンクロ・フード	4,600	351.00	1,614,600
オークネット	6,300	1,577.00	9,935,100
セグエグループ	2,900	1,558.00	4,518,200
エイトレッド	1,900	3,050.00	5,795,000
AOI TYO HOLDINGS	11,800	441.00	5,203,800
マクロミル	23,400	770.00	18,018,000
ビーグリー	2,200	2,191.00	4,820,200
オロ	3,600	3,715.00	13,374,000
ユーザーローカル	1,100	5,460.00	6,006,000
テモナ	2,400	1,550.00	3,720,000
ニーズウェル	2,200	965.00	2,123,000
サインポスト	2,400	1,327.00	3,184,800
昭和電工	87,100	1,953.00	170,106,300
住友化学	842,400	365.00	307,476,000
住友精化	5,100	3,635.00	18,538,500
日産化学	63,300	5,570.00	352,581,000
ラサ工業	4,000	2,186.00	8,744,000
クレハ	9,800	4,670.00	45,766,000
多木化学	4,500	6,900.00	31,050,000
テイカ	8,400	1,419.00	11,919,600
石原産業	20,500	724.00	14,842,000
片倉コープアグリ	2,700	1,276.00	3,445,200
日本曹達	17,000	2,943.00	50,031,000
東ソー	177,300	1,695.00	300,523,500
トクヤマ	33,100	2,524.00	83,544,400
セントラル硝子	23,500	2,257.00	53,039,500
東亜合成	72,000	1,102.00	79,344,000
大阪ソーダ	11,700	2,649.00	30,993,300
関東電化工業	27,200	727.00	19,774,400
デンカ	41,900	3,155.00	132,194,500
イビデン	71,700	3,790.00	271,743,000
信越化学工業	196,900	14,110.00	2,778,259,000
日本カーバイド工業	4,100	1,255.00	5,145,500
堺化学工業	7,400	2,028.00	15,007,200
第一稀元素化学工業	12,600	725.00	9,135,000
エア・ウォーター	106,700	1,511.00	161,223,700
日本酸素ホールディングス	110,300	1,652.00	182,215,600
日本化学工業	3,600	2,327.00	8,377,200
東邦アセチレン	1,600	1,261.00	2,017,600
日本パーカライジング	57,900	1,055.00	61,084,500
高圧ガス工業	18,200	825.00	15,015,000
チタン工業	1,300	1,760.00	2,288,000
四国化成工業	16,800	1,155.00	19,404,000
戸田工業	2,700	2,297.00	6,201,900

ステラ ケミファ	6,300	2,983.00	18,792,900
保土谷化学工業	4,300	4,840.00	20,812,000
日本触媒	17,800	5,630.00	100,214,000
大日精化工業	10,200	2,223.00	22,674,600
カネカ	29,600	3,255.00	96,348,000
協和キリン	117,900	2,768.00	326,347,200
三菱瓦斯化学	106,700	1,993.00	212,653,100
三井化学	106,300	2,642.00	280,844,600
J S R	106,900	2,553.00	272,915,700
東京応化工業	19,700	5,920.00	116,624,000
大阪有機化学工業	10,600	2,540.00	26,924,000
三菱ケミカルホールディングス	766,700	616.00	472,287,200
K Hネオケム	18,900	2,601.00	49,158,900
ダイセル	149,100	804.00	119,876,400
住友ベークライト	18,000	2,935.00	52,830,000
積水化学工業	242,500	1,763.00	427,527,500
日本ゼオン	103,500	1,201.00	124,303,500
アイカ工業	34,400	3,685.00	126,764,000
宇部興産	57,800	1,845.00	106,641,000
積水樹脂	20,700	2,118.00	43,842,600
タキロンシーアイ	25,100	706.00	17,720,600
旭有機材	6,500	1,362.00	8,853,000
ニチバン	6,100	1,658.00	10,113,800
リケンテクノス	28,000	420.00	11,760,000
大倉工業	5,500	1,768.00	9,724,000
積水化成品工業	15,600	603.00	9,406,800
群栄化学工業	2,400	2,641.00	6,338,400
タイガースポリマー	5,500	427.00	2,348,500
ミライアル	4,100	1,175.00	4,817,500
ダイキアクシス	4,200	895.00	3,759,000
ダイキョーニシカワ	24,200	603.00	14,592,600
竹本容器	4,100	1,041.00	4,268,100
森六ホールディングス	6,200	1,779.00	11,029,800
日本化薬	70,900	916.00	64,944,400
カーリットホールディングス	12,600	527.00	6,640,200
E P Sホールディングス	15,100	981.00	14,813,100
ソルクシーズ	4,600	1,177.00	5,414,200
レグス	2,800	1,152.00	3,225,600
プレステージ・インターナショナル	41,900	907.00	38,003,300
フェイス	4,000	1,013.00	4,052,000
プロトコーポレーション	10,300	1,297.00	13,359,100
ハイマックス	2,800	1,227.00	3,435,600
アミューズ	6,100	2,589.00	15,792,900
野村総合研究所	162,900	3,140.00	511,506,000
ドリームインキュベータ	3,400	1,476.00	5,018,400
サイバネットシステム	8,200	932.00	7,642,400
クイック	6,900	1,244.00	8,583,600
T A C	7,000	223.00	1,561,000
C Eホールディングス	6,100	691.00	4,215,100
ケネディクス	96,200	548.00	52,717,600

日本システム技術	1,800	2,116.00	3,808,800
電通グループ	125,800	3,005.00	378,029,000
インテージホールディングス	14,400	1,007.00	14,500,800
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,300	635.00	2,730,500
東邦システムサイエンス	3,200	942.00	3,014,400
ぴあ	3,200	3,345.00	10,704,000
イオンファンタジー	4,300	2,136.00	9,184,800
ソースネクスト	54,300	329.00	17,864,700
シーティーエス	12,600	1,010.00	12,726,000
ネクシィーズグループ	3,400	1,080.00	3,672,000
インフォコム	12,600	4,335.00	54,621,000
メディカルシステムネットワーク	11,500	454.00	5,221,000
日本精化	9,300	1,599.00	14,870,700
扶桑化学工業	11,600	3,685.00	42,746,000
トリケミカル研究所	2,600	13,500.00	35,100,000
HEROZ	1,600	3,475.00	5,560,000
ラクスル	9,200	4,750.00	43,700,000
F I G	12,700	278.00	3,530,600
システムサポート	2,600	1,803.00	4,687,800
A D E K A	52,800	1,499.00	79,147,200
日油	43,200	4,115.00	177,768,000
ミヨシ油脂	4,400	1,117.00	4,914,800
新日本理化	19,900	163.00	3,243,700
ハリマ化成グループ	9,600	1,132.00	10,867,200
イーソル	6,200	1,333.00	8,264,600
アルテリア・ネットワークス	12,700	1,822.00	23,139,400
東海ソフト	800	1,221.00	976,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,100	1,360.00	2,856,000
東名	600	1,465.00	879,000
ヴィッツ	400	3,115.00	1,246,000
トピラスシステムズ	1,100	2,058.00	2,263,800
L i n k - U	800	1,995.00	1,596,000
花王	280,400	7,785.00	2,182,914,000
第一工業製薬	4,300	3,995.00	17,178,500
石原ケミカル	3,200	2,187.00	6,998,400
日華化学	3,500	975.00	3,412,500
ニイタカ	2,400	3,125.00	7,500,000
三洋化成工業	6,800	4,930.00	33,524,000
武田薬品工業	974,400	3,746.00	3,650,102,400
アステラス製薬	1,015,400	1,497.00	1,520,053,800
大日本住友製薬	86,900	1,317.00	114,447,300
塩野義製薬	147,300	5,485.00	807,940,500
わかもと製薬	14,100	264.00	3,722,400
あすか製薬	13,300	1,455.00	19,351,500
日本新薬	30,600	8,070.00	246,942,000
ビオフェルミン製薬	1,800	2,474.00	4,453,200
中外製薬	366,300	4,555.00	1,668,496,500
科研製薬	20,100	4,600.00	92,460,000
エーザイ	140,200	9,303.00	1,304,280,600

理研ビタミン	11,200	2,010.00	22,512,000
ロート製薬	60,100	3,455.00	207,645,500
小野薬品工業	268,900	3,342.00	898,663,800
久光製薬	31,000	5,270.00	163,370,000
有機合成薬品工業	8,900	342.00	3,043,800
持田製薬	16,300	4,075.00	66,422,500
参天製薬	218,200	2,130.00	464,766,000
扶桑薬品工業	3,700	2,603.00	9,631,100
日本ケミファ	1,300	2,624.00	3,411,200
ツムラ	36,300	3,300.00	119,790,000
日医工	33,200	1,152.00	38,246,400
テルモ	331,400	4,105.00	1,360,397,000
H.U.グループホールディングス	31,300	2,880.00	90,144,000
キッセイ薬品工業	20,700	2,248.00	46,533,600
生化学工業	22,800	1,050.00	23,940,000
栄研化学	20,600	2,398.00	49,398,800
日水製薬	5,100	1,134.00	5,783,400
鳥居薬品	7,300	3,180.00	23,214,000
JCRファーマ	33,000	2,798.00	92,334,000
東和薬品	15,000	2,039.00	30,585,000
富士製薬工業	7,900	1,238.00	9,780,200
沢井製薬	24,000	5,080.00	121,920,000
ゼリア新薬工業	21,300	1,989.00	42,365,700
第一三共	1,005,400	2,838.00	2,853,325,200
キョーリン製薬ホールディングス	25,900	2,121.00	54,933,900
大幸薬品	14,400	2,128.00	30,643,200
ダイト	7,500	3,555.00	26,662,500
大塚ホールディングス	243,400	4,234.00	1,030,555,600
大正製薬ホールディングス	24,800	6,900.00	171,120,000
ペプチドリーム	59,500	4,925.00	293,037,500
大日本塗料	13,100	910.00	11,921,000
日本ペイントホールディングス	94,700	10,520.00	996,244,000
関西ペイント	128,900	2,707.00	348,932,300
神東塗料	9,500	182.00	1,729,000
中国塗料	32,700	1,002.00	32,765,400
日本特殊塗料	8,700	980.00	8,526,000
藤倉化成	15,800	525.00	8,295,000
太陽ホールディングス	8,400	5,440.00	45,696,000
D I C	48,500	2,677.00	129,834,500
サカタインクス	25,000	1,124.00	28,100,000
東洋インキS Cホールディングス	24,300	2,012.00	48,891,600
T & K T O K A	9,100	851.00	7,744,100
アルプス技研	9,900	2,078.00	20,572,200
サニックス	19,500	250.00	4,875,000
ダイオーズ	2,400	970.00	2,328,000
日本空調サービス	11,800	736.00	8,684,800
オリエンタルランド	119,000	15,110.00	1,798,090,000
フォーカスシステムズ	7,200	1,020.00	7,344,000
ダスキン	27,800	2,847.00	79,146,600
パーク24	61,900	1,685.00	104,301,500

明光ネットワークジャパン	14,200	740.00	10,508,000
ファルコホールディングス	6,200	1,479.00	9,169,800
クレスコ	7,000	1,313.00	9,191,000
フジ・メディア・ホールディングス	110,400	1,043.00	115,147,200
秀英予備校	3,000	455.00	1,365,000
田谷	1,900	557.00	1,058,300
ラウンドワン	31,200	944.00	29,452,800
リゾートトラスト	51,300	1,729.00	88,697,700
オービック	39,800	18,280.00	727,544,000
ジャストシステム	18,700	7,120.00	133,144,000
TDCソフト	10,100	1,062.00	10,726,200
Zホールディングス	1,578,200	778.00	1,227,839,600
ビー・エム・エル	14,400	3,265.00	47,016,000
ワタベウェディング	1,900	319.00	606,100
トレンドマイクロ	61,300	6,340.00	388,642,000
りらいあコミュニケーションズ	19,400	1,284.00	24,909,600
IDホールディングス	4,400	1,443.00	6,349,200
リソー教育	51,300	322.00	16,518,600
日本オラクル	23,300	10,800.00	251,640,000
早稲田アカデミー	4,900	971.00	4,757,900
アルファシステムズ	3,600	3,555.00	12,798,000
フューチャー	13,900	2,231.00	31,010,900
CAC Holdings	7,500	1,423.00	10,672,500
SBテクノロジー	4,100	3,905.00	16,010,500
トーセ	3,200	904.00	2,892,800
ユー・エス・エス	125,200	1,970.00	246,644,000
オービックビジネスコンサルタント	11,700	5,850.00	68,445,000
伊藤忠テクノソリューションズ	52,400	3,880.00	203,312,000
アイティフォー	13,900	914.00	12,704,600
東京個別指導学院	4,000	592.00	2,368,000
東計電算	1,700	4,645.00	7,896,500
サイバーエージェント	68,900	6,660.00	458,874,000
楽天	521,600	1,232.00	642,611,200
エクスネット	2,000	1,036.00	2,072,000
クリーク・アンド・リバー社	5,900	1,222.00	7,209,800
テー・オー・ダブリュー	17,800	314.00	5,589,200
大塚商会	62,200	5,340.00	332,148,000
サイボウズ	13,400	3,370.00	45,158,000
ソフトブレイン	9,000	867.00	7,803,000
山田コンサルティンググループ	7,300	1,170.00	8,541,000
セントラルスポーツ	4,200	2,298.00	9,651,600
パラカ	3,000	1,639.00	4,917,000
電通国際情報サービス	7,100	6,750.00	47,925,000
ACCESS	10,700	873.00	9,341,100
デジタルガレージ	20,700	3,715.00	76,900,500
イーエムシステムズ	16,200	900.00	14,580,000
ウェザーニューズ	3,900	5,710.00	22,269,000
CIJ	7,800	926.00	7,222,800
ビジネスエンジニアリング	1,300	3,800.00	4,940,000
日本エンタープライズ	11,500	274.00	3,151,000

WOWOW	5,500	2,849.00	15,669,500
スカラ	7,600	1,016.00	7,721,600
インテリジェント ウェイブ	6,800	787.00	5,351,600
フルキャストホールディングス	9,800	1,812.00	17,757,600
エン・ジャパン	19,800	2,728.00	54,014,400
富士フイルムホールディングス	224,600	5,192.00	1,166,123,200
コニカミノルタ	255,400	287.00	73,299,800
資生堂	232,700	6,599.00	1,535,587,300
ライオン	152,300	2,099.00	319,677,700
高砂香料工業	7,400	2,230.00	16,502,000
マンダム	26,200	1,815.00	47,553,000
ミルボン	15,700	5,600.00	87,920,000
ファンケル	47,400	3,540.00	167,796,000
コーセー	22,000	14,200.00	312,400,000
コタ	6,900	1,353.00	9,335,700
シーボン	1,400	1,998.00	2,797,200
ポーラ・オルビスホールディングス	50,000	2,115.00	105,750,000
ノエビアホールディングス	9,900	4,700.00	46,530,000
アジュバンコスメジャパン	2,500	1,003.00	2,507,500
エステー	7,600	2,185.00	16,606,000
アグロ カネショウ	4,400	1,707.00	7,510,800
コニシ	19,400	1,572.00	30,496,800
長谷川香料	20,200	2,153.00	43,490,600
星光PMC	7,000	661.00	4,627,000
小林製薬	32,800	10,510.00	344,728,000
荒川化学工業	10,500	1,248.00	13,104,000
メック	8,000	1,939.00	15,512,000
日本高純度化学	3,000	2,639.00	7,917,000
タカラバイオ	30,700	2,948.00	90,503,600
JCU	14,200	3,400.00	48,280,000
新田ゼラチン	7,700	695.00	5,351,500
OATアグリオ	2,200	1,321.00	2,906,200
デクセリアルズ	30,300	1,144.00	34,663,200
アース製薬	8,400	7,040.00	59,136,000
北興化学工業	10,900	793.00	8,643,700
大成ラミック	3,500	2,827.00	9,894,500
クミアイ化学工業	48,400	1,106.00	53,530,400
日本農薬	20,900	505.00	10,554,500
富士興産	3,500	759.00	2,656,500
ニチレキ	13,900	1,732.00	24,074,800
ユシロ化学工業	6,700	1,377.00	9,225,900
ビーピー・カストロール	4,300	1,245.00	5,353,500
富士石油	31,200	195.00	6,084,000
MORESCO	4,400	1,026.00	4,514,400
出光興産	130,000	2,272.00	295,360,000
ENEOSホールディングス	1,761,600	385.80	679,625,280
コスモエネルギーホールディングス	33,900	1,620.00	54,918,000
横浜ゴム	67,800	1,476.00	100,072,800
TOYO TIRE	61,600	1,713.00	105,520,800
ブリヂストン	311,400	3,409.00	1,061,562,600

住友ゴム工業	105,200	971.00	102,149,200
藤倉コンポジット	11,000	350.00	3,850,000
オカモト	7,200	4,250.00	30,600,000
アキレス	8,100	1,727.00	13,988,700
フコク	4,700	678.00	3,186,600
ニッタ	13,200	2,357.00	31,112,400
クリエートメディック	3,500	1,030.00	3,605,000
住友理工	22,900	559.00	12,801,100
三ツ星ベルト	15,400	1,697.00	26,133,800
バンドー化学	20,800	598.00	12,438,400
A G C	107,500	3,105.00	333,787,500
日本板硝子	55,900	391.00	21,856,900
石塚硝子	2,300	1,945.00	4,473,500
有沢製作所	18,600	944.00	17,558,400
日本山村硝子	5,000	896.00	4,480,000
日本電気硝子	43,400	1,974.00	85,671,600
オハラ	4,700	1,269.00	5,964,300
住友大阪セメント	22,200	3,385.00	75,147,000
太平洋セメント	73,900	2,761.00	204,037,900
リソルホールディングス	1,000	3,795.00	3,795,000
日本ヒューム	11,800	793.00	9,357,400
日本コンクリート工業	25,400	313.00	7,950,200
三谷セキサン	5,500	5,590.00	30,745,000
アジアパイルホールディングス	17,000	480.00	8,160,000
東海カーボン	114,600	1,219.00	139,697,400
日本カーボン	6,400	3,840.00	24,576,000
東洋炭素	6,900	1,813.00	12,509,700
ノリタケカンパニーリミテド	6,500	3,180.00	20,670,000
T O T O	83,700	4,860.00	406,782,000
日本碍子	140,500	1,477.00	207,518,500
日本特殊陶業	89,000	1,893.00	168,477,000
ダントーホールディングス	8,700	720.00	6,264,000
M A R U W A	4,500	9,750.00	43,875,000
品川リフラクトリーズ	3,100	2,414.00	7,483,400
黒崎播磨	2,300	3,020.00	6,946,000
ヨータイ	9,500	815.00	7,742,500
イソライト工業	6,100	492.00	3,001,200
東京窯業	15,500	332.00	5,146,000
ニッカトー	4,800	705.00	3,384,000
フジインコーポレーテッド	10,400	3,740.00	38,896,000
クニミネ工業	4,800	1,022.00	4,905,600
エーアンドエーマテリアル	1,800	1,088.00	1,958,400
ニチアス	32,000	2,427.00	77,664,000
日本製鉄	518,200	1,081.00	560,174,200
神戸製鋼所	211,400	426.00	90,056,400
中山製鋼所	16,600	357.00	5,926,200
合同製鐵	6,200	1,989.00	12,331,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	312,600	773.00	241,639,800
東京製鐵	56,400	736.00	41,510,400

共英製鋼	13,100	1,326.00	17,370,600
大和工業	24,600	2,570.00	63,222,000
東京鐵鋼	4,800	1,731.00	8,308,800
大阪製鐵	6,300	1,135.00	7,150,500
淀川製鋼所	15,700	1,936.00	30,395,200
丸一鋼管	37,600	2,603.00	97,872,800
モリ工業	3,200	2,497.00	7,990,400
大同特殊鋼	18,900	3,445.00	65,110,500
日本高周波鋼業	4,100	354.00	1,451,400
日本冶金工業	9,600	1,569.00	15,062,400
山陽特殊製鋼	7,900	1,041.00	8,223,900
愛知製鋼	6,500	2,597.00	16,880,500
日立金属	124,800	1,608.00	200,678,400
日本金属	2,800	675.00	1,890,000
大平洋金属	7,800	1,676.00	13,072,800
新日本電工	74,500	226.00	16,837,000
栗本鐵工所	5,700	1,852.00	10,556,400
虹 技	1,400	1,320.00	1,848,000
日本鑄鉄管	1,200	1,232.00	1,478,400
日本製鋼所	35,200	2,042.00	71,878,400
三菱製鋼	8,600	572.00	4,919,200
日亜鋼業	17,400	289.00	5,028,600
日本精線	1,900	3,280.00	6,232,000
エンビプロ・ホールディングス	5,100	547.00	2,789,700
大紀アルミニウム工業所	19,300	547.00	10,557,100
日本輕金属ホールディングス	29,360	1,683.00	49,412,880
三井金属鉱業	31,200	2,511.00	78,343,200
東邦亜鉛	5,900	1,991.00	11,746,900
三菱マテリアル	76,500	2,040.00	156,060,000
住友金属鉱山	148,000	3,319.00	491,212,000
D O W Aホールディングス	29,300	3,130.00	91,709,000
古河機械金属	20,600	1,183.00	24,369,800
エス・サイエンス	47,700	46.00	2,194,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,000	920.00	11,040,000
東邦チタニウム	20,700	688.00	14,241,600
U A C J	17,600	1,679.00	29,550,400
C Kサンエツ	2,300	3,700.00	8,510,000
古河電気工業	36,000	2,521.00	90,756,000
住友電気工業	433,200	1,189.50	515,291,400
フジクラ	139,600	295.00	41,182,000
昭和電線ホールディングス	13,500	1,200.00	16,200,000
東京特殊電線	1,600	2,450.00	3,920,000
タツタ電線	23,200	618.00	14,337,600
カナレ電気	1,800	1,748.00	3,146,400
平河ヒューテック	5,800	1,053.00	6,107,400
リョービ	14,300	1,162.00	16,616,600
アーレスティ	15,400	338.00	5,205,200
アサヒホールディングス	20,300	3,570.00	72,471,000
東洋製罐グループホールディングス	73,700	1,013.00	74,658,100
ホッカフホールディングス	6,400	1,447.00	9,260,800

コロナ	6,700	1,030.00	6,901,000
横河ブリッジホールディングス	21,500	1,938.00	41,667,000
OSJBホールディングス	57,800	242.00	13,987,600
駒井ハルテック	2,100	1,527.00	3,206,700
高田機工	900	2,513.00	2,261,700
三和ホールディングス	109,200	1,173.00	128,091,600
文化シャッター	34,300	845.00	28,983,500
三協立山	15,000	987.00	14,805,000
アルインコ	8,600	942.00	8,101,200
東洋シャッター	2,700	763.00	2,060,100
LIXILグループ	170,900	2,209.00	377,518,100
日本ファイルコン	7,900	588.00	4,645,200
ノーリツ	24,000	1,493.00	35,832,000
長府製作所	11,800	2,174.00	25,653,200
リンナイ	22,500	10,660.00	239,850,000
ユニプレス	22,700	872.00	19,794,400
ダイニチ工業	6,700	784.00	5,252,800
日東精工	14,600	479.00	6,993,400
三洋工業	1,400	1,961.00	2,745,400
岡部	23,700	812.00	19,244,400
ジーテクト	14,400	1,223.00	17,611,200
東プレ	21,600	1,154.00	24,926,400
高周波熱錬	22,300	528.00	11,774,400
東京製綱	8,300	552.00	4,581,600
サンコール	9,000	438.00	3,942,000
モリテックスチール	9,400	307.00	2,885,800
パイオラックス	17,100	1,585.00	27,103,500
エイチワン	11,700	591.00	6,914,700
日本発条	124,100	686.00	85,132,600
中央発條	1,100	2,790.00	3,069,000
アドバネクス	1,700	1,308.00	2,223,600
三浦工業	50,100	5,160.00	258,516,000
タクマ	39,200	1,677.00	65,738,400
テクノプロ・ホールディングス	22,300	7,140.00	159,222,000
アトラ	2,800	279.00	781,200
インターワークス	2,100	346.00	726,600
アイ・アールジャパンホールディングス	4,500	12,890.00	58,005,000
Keeper 技研	8,200	1,416.00	11,611,200
ファーストロジック	2,200	799.00	1,757,800
三機サービス	2,200	1,173.00	2,580,600
Gunosy	6,900	984.00	6,789,600
デザインワン・ジャパン	3,200	282.00	902,400
イー・ガーディアン	4,900	3,530.00	17,297,000
リブセンス	6,700	284.00	1,902,800
ジャパンマテリアル	34,400	1,431.00	49,226,400
ベクトル	13,900	1,025.00	14,247,500
ウチヤマホールディングス	6,300	319.00	2,009,700
チャーム・ケア・コーポレーション	9,500	1,234.00	11,723,000
キャリアリンク	3,700	1,590.00	5,883,000

I B J	9,100	999.00	9,090,900
アサンテ	4,500	1,593.00	7,168,500
N・フィールド	7,600	740.00	5,624,000
バリューHR	4,500	1,864.00	8,388,000
M&Aキャピタルパートナーズ	9,100	5,390.00	49,049,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,300	2,366.00	10,173,800
E R Iホールディングス	3,000	664.00	1,992,000
アビスト	1,700	2,967.00	5,043,900
シグマクシス	7,600	1,710.00	12,996,000
ウィルグループ	7,300	875.00	6,387,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	16,500	349.00	5,758,500
リクルートホールディングス	801,600	4,257.00	3,412,411,200
エラン	7,700	2,604.00	20,050,800
ツガミ	23,900	1,292.00	30,878,800
オークマ	13,500	5,000.00	67,500,000
芝浦機械	13,100	2,169.00	28,413,900
アマダ	143,500	977.00	140,199,500
アイダエンジニアリング	30,300	789.00	23,906,700
滝澤鉄工所	3,300	1,015.00	3,349,500
F U J I	49,800	2,109.00	105,028,200
牧野フライス製作所	13,500	3,705.00	50,017,500
オーエスジー	57,100	1,656.00	94,557,600
ダイジェット工業	1,100	1,466.00	1,612,600
旭ダイヤモンド工業	30,500	493.00	15,036,500
D M G森精機	73,200	1,467.00	107,384,400
ソディック	25,300	754.00	19,076,200
ディスコ	15,700	27,680.00	434,576,000
日東工器	6,400	2,085.00	13,344,000
日進工具	4,600	2,169.00	9,977,400
パンチ工業	10,500	403.00	4,231,500
富士ダイス	4,700	635.00	2,984,500
土木管理総合試験所	5,700	385.00	2,194,500
ネットマーケティング	4,300	650.00	2,795,000
日本郵政	917,600	736.40	675,720,640
ベルシステム24ホールディングス	18,800	1,690.00	31,772,000
鎌倉新書	8,400	992.00	8,332,800
S M N	2,400	986.00	2,366,400
一蔵	1,300	369.00	479,700
L I T A L I C O	3,900	3,050.00	11,895,000
グローバルキッズCOMPANY	2,100	845.00	1,774,500
エアトリ	5,800	1,527.00	8,856,600
アトラエ	3,400	2,783.00	9,462,200
ストライク	4,200	6,640.00	27,888,000
ソラスト	30,900	1,394.00	43,074,600
セラク	3,500	2,046.00	7,161,000
インソース	4,600	3,450.00	15,870,000
豊田自動織機	94,800	6,850.00	649,380,000
豊和工業	6,500	839.00	5,453,500
O K K	5,200	381.00	1,981,200

石川製作所	2,800	1,708.00	4,782,400
東洋機械金属	9,100	411.00	3,740,100
津田駒工業	2,100	837.00	1,757,700
エンシュウ	2,700	945.00	2,551,500
島精機製作所	18,200	1,741.00	31,686,200
オプトラン	14,500	2,249.00	32,610,500
NCホールディングス	3,300	655.00	2,161,500
イワキ	7,500	875.00	6,562,500
フリー	11,400	1,344.00	15,321,600
ヤマシンフィルタ	25,100	1,066.00	26,756,600
日阪製作所	14,500	899.00	13,035,500
やまびこ	22,400	1,346.00	30,150,400
平田機工	5,500	6,690.00	36,795,000
ペガサスミシン製造	12,200	291.00	3,550,200
マルマエ	4,300	931.00	4,003,300
タツモ	4,900	1,568.00	7,683,200
ナブテスコ	68,200	3,950.00	269,390,000
三井海洋開発	12,300	1,605.00	19,741,500
レオン自動機	11,400	1,086.00	12,380,400
S M C	36,700	57,600.00	2,113,920,000
ホソカワミクロン	4,100	5,230.00	21,443,000
ユニオンツール	4,400	3,080.00	13,552,000
オイレス工業	15,000	1,498.00	22,470,000
日精エー・エス・ピー機械	3,400	4,215.00	14,331,000
サトーホールディングス	16,500	2,270.00	37,455,000
技研製作所	10,200	4,010.00	40,902,000
日本エアテック	3,800	1,624.00	6,171,200
カワタ	3,500	891.00	3,118,500
日精樹脂工業	9,900	895.00	8,860,500
オカダアイヨン	3,700	1,071.00	3,962,700
ワイエイシイホールディングス	4,900	681.00	3,336,900
小松製作所	530,500	2,456.50	1,303,173,250
住友重機械工業	67,000	2,394.00	160,398,000
日立建機	46,900	3,665.00	171,888,500
日工	16,000	691.00	11,056,000
巴工業	4,600	2,140.00	9,844,000
井関農機	11,800	1,372.00	16,189,600
T O W A	11,800	1,227.00	14,478,600
丸山製作所	2,500	1,357.00	3,392,500
北川鉄工所	5,400	1,415.00	7,641,000
シンニッタン	18,600	220.00	4,092,000
ローツェ	5,100	5,110.00	26,061,000
タカキタ	4,300	700.00	3,010,000
クボタ	621,300	1,931.00	1,199,730,300
荏原実業	3,000	3,310.00	9,930,000
東洋エンジニアリング	15,400	329.00	5,066,600
三菱化工機	4,100	1,850.00	7,585,000
月島機械	21,500	1,274.00	27,391,000
帝国電機製作所	9,700	1,095.00	10,621,500
東京機械製作所	4,600	283.00	1,301,800

新東工業	28,000	707.00	19,796,000
澁谷工業	10,300	3,450.00	35,535,000
アイチコーポレーション	20,200	883.00	17,836,600
小森コーポレーション	29,800	747.00	22,260,600
鶴見製作所	9,000	1,823.00	16,407,000
住友精密工業	1,800	2,137.00	3,846,600
日本ギア工業	3,700	300.00	1,110,000
酒井重工業	2,100	2,427.00	5,096,700
荏原製作所	48,500	2,953.00	143,220,500
石井鐵工所	1,300	2,668.00	3,468,400
西島製作所	12,000	812.00	9,744,000
北越工業	12,200	1,029.00	12,553,800
ダイキン工業	149,200	19,085.00	2,847,482,000
オルガノ	4,200	5,690.00	23,898,000
トーヨーカネツ	5,100	2,290.00	11,679,000
栗田工業	63,300	3,410.00	215,853,000
椿本チエイン	16,700	2,381.00	39,762,700
大同工業	4,900	608.00	2,979,200
日機装	37,800	1,060.00	40,068,000
木村化工機	9,700	427.00	4,141,900
レイズネクスト	19,700	1,309.00	25,787,300
アネスト岩田	18,300	850.00	15,555,000
ダイフク	59,800	11,120.00	664,976,000
サムコ	2,900	2,872.00	8,328,800
加藤製作所	6,400	1,090.00	6,976,000
油研工業	1,800	1,520.00	2,736,000
タダノ	56,400	894.00	50,421,600
フジテック	42,600	2,379.00	101,345,400
C K D	32,100	1,699.00	54,537,900
キトー	9,000	1,182.00	10,638,000
平和	32,700	1,764.00	57,682,800
理想科学工業	10,400	1,391.00	14,466,400
S A N K Y O	26,000	2,704.00	70,304,000
日本金銭機械	13,100	561.00	7,349,100
マースグループホールディングス	7,500	1,670.00	12,525,000
フクシマガリレイ	7,200	3,820.00	27,504,000
オーイズミ	5,200	403.00	2,095,600
ダイコク電機	5,400	1,005.00	5,427,000
竹内製作所	19,500	2,323.00	45,298,500
アマノ	30,700	2,615.00	80,280,500
J U K I	16,300	451.00	7,351,300
サンデンホールディングス	15,200	316.00	4,803,200
蛇の目マシン工業	10,600	588.00	6,232,800
ブラザー工業	143,000	1,664.00	237,952,000
マックス	17,900	1,528.00	27,351,200
モリタホールディングス	20,500	1,981.00	40,610,500
グローリー	30,100	2,323.00	69,922,300
新晃工業	10,900	1,495.00	16,295,500
大和冷機工業	18,800	935.00	17,578,000
セガサミーホールディングス	116,100	1,303.00	151,278,300

日本ピストンリング	4,300	1,013.00	4,355,900
リケン	5,400	2,686.00	14,504,400
T P R	15,800	1,304.00	20,603,200
ツバキ・ナカシマ	22,300	835.00	18,620,500
ホシザキ	36,900	8,900.00	328,410,000
大豊工業	9,800	576.00	5,644,800
日本精工	220,200	832.00	183,206,400
N T N	269,800	204.00	55,039,200
ジェイテクト	112,300	851.00	95,567,300
不二越	10,900	3,730.00	40,657,000
ミネベアミツミ	217,300	1,960.00	425,908,000
日本トムソン	34,600	371.00	12,836,600
T H K	72,900	2,656.00	193,622,400
ユーシン精機	9,100	710.00	6,461,000
前澤給装工業	4,400	2,280.00	10,032,000
イーグル工業	14,500	805.00	11,672,500
前澤工業	8,100	500.00	4,050,000
日本プレー工業	11,800	1,575.00	18,585,000
キッツ	47,500	579.00	27,502,500
日立製作所	562,700	3,592.00	2,021,218,400
三菱電機	1,171,100	1,404.00	1,644,224,400
富士電機	70,600	3,270.00	230,862,000
東洋電機製造	4,300	1,108.00	4,764,400
安川電機	126,000	4,090.00	515,340,000
シンフォニア テクノロジー	15,300	1,191.00	18,222,300
明電舎	21,500	1,588.00	34,142,000
オリジン	2,900	1,392.00	4,036,800
山洋電気	5,700	4,755.00	27,103,500
デンヨー	9,900	2,358.00	23,344,200
ベイカレント・コンサルティング	6,800	15,660.00	106,488,000
Orchestra Holdings	2,300	2,622.00	6,030,600
アイモバイル	3,900	1,508.00	5,881,200
キャリアインデックス	4,500	611.00	2,749,500
M S - J a p a n	3,600	845.00	3,042,000
船場	1,700	975.00	1,657,500
グレイステクノロジー	5,200	6,190.00	32,188,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	12,700	3,815.00	48,450,500
フルテック	1,400	1,406.00	1,968,400
グリーンズ	2,700	531.00	1,433,700
ツナググループ・ホールディングス	1,900	445.00	845,500
G A M E W I T H	3,300	592.00	1,953,600
ソウルドアウト	2,600	1,559.00	4,053,400
M S & C o n s u l t i n g	2,000	682.00	1,364,000
エル・ティー・エス	800	5,430.00	4,344,000
ミダック	1,400	2,803.00	3,924,200
日総工産	7,400	844.00	6,245,600
キュービーネットホールディングス	4,600	1,780.00	8,188,000
R P A ホールディングス	8,500	828.00	7,038,000

三櫻工業	14,800	661.00	9,782,800
マキタ	152,700	4,965.00	758,155,500
東芝テック	14,700	4,410.00	64,827,000
芝浦メカトロニクス	2,100	3,135.00	6,583,500
マブチモーター	32,400	4,225.00	136,890,000
日本電産	281,900	10,175.00	2,868,332,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,000	358.00	2,506,000
トレックス・セミコンダクター	6,800	1,300.00	8,840,000
東光高岳	6,600	1,079.00	7,121,400
ダブル・スコープ	18,500	820.00	15,170,000
宮越ホールディングス	4,400	740.00	3,256,000
ダイヘン	12,800	4,025.00	51,520,000
ヤーマン	19,100	1,487.00	28,401,700
JVCケンウッド	95,500	146.00	13,943,000
ミマキエンジニアリング	10,800	446.00	4,816,800
I - P E X	5,500	2,123.00	11,676,500
日新電機	27,500	1,107.00	30,442,500
大崎電気工業	23,500	619.00	14,546,500
オムロン	105,000	8,010.00	841,050,000
日東工業	17,200	2,028.00	34,881,600
I D E C	17,000	1,892.00	32,164,000
正興電機製作所	2,800	1,148.00	3,214,400
不二電機工業	2,200	1,315.00	2,893,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	39,100	1,883.00	73,625,300
サクサホールディングス	2,600	1,415.00	3,679,000
メルコホールディングス	4,100	2,506.00	10,274,600
テクノメディカ	2,800	1,727.00	4,835,600
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	2,600	679.00	1,765,400
日本電気	142,100	5,960.00	846,916,000
富士通	112,900	14,245.00	1,608,260,500
沖電気工業	47,700	1,145.00	54,616,500
岩崎通信機	4,700	843.00	3,962,100
電気興業	5,600	2,685.00	15,036,000
サンケン電気	12,800	2,795.00	35,776,000
ナカヨ	2,100	1,500.00	3,150,000
アイホン	6,700	1,504.00	10,076,800
ルネサスエレクトロニクス	501,000	842.00	421,842,000
セイコーエプソン	145,300	1,119.00	162,590,700
ワコム	78,700	671.00	52,807,700
アルバック	21,500	3,975.00	85,462,500
アクセル	4,900	906.00	4,439,400
E I Z O	9,100	3,815.00	34,716,500
ジャパンディスプレイ	338,500	52.00	17,602,000
日本信号	29,800	1,002.00	29,859,600
京三製作所	27,400	447.00	12,247,800
能美防災	15,500	2,387.00	36,998,500
ホーチキ	8,500	1,242.00	10,557,000
星和電機	6,000	640.00	3,840,000
エレコム	13,300	4,945.00	65,768,500

パナソニック	1,338,100	888.70	1,189,169,470	
シャープ	135,500	1,301.00	176,285,500	
アンリツ	75,400	2,554.00	192,571,600	
富士通ゼネラル	31,800	2,944.00	93,619,200	
ソニー	733,600	7,768.00	5,698,604,800	
T D K	56,500	12,030.00	679,695,000	
帝国通信工業	4,700	1,169.00	5,494,300	
タムラ製作所	39,000	545.00	21,255,000	
アルプスアルパイン	103,600	1,504.00	155,814,400	
池上通信機	3,400	842.00	2,862,800	
日本電波工業	10,700	423.00	4,526,100	
鈴木	6,000	696.00	4,176,000	
日本トリム	1,600	3,735.00	5,976,000	
ローランド ディー・ジー・	6,900	1,361.00	9,390,900	
フォスター電機	12,300	1,236.00	15,202,800	
S M K	3,000	2,666.00	7,998,000	
ヨコオ	7,600	2,630.00	19,988,000	
ティアック	7,900	126.00	995,400	
ホシデン	32,100	940.00	30,174,000	
ヒロセ電機	18,000	14,590.00	262,620,000	
日本航空電子工業	26,800	1,575.00	42,210,000	
T O A	12,600	811.00	10,218,600	
マクセルホールディングス	25,200	1,062.00	26,762,400	
古野電気	15,200	1,106.00	16,811,200	
ユニデンホールディングス	3,300	2,029.00	6,695,700	
スミダコーポレーション	10,000	818.00	8,180,000	
アイコム	6,500	2,725.00	17,712,500	
リオン	5,000	2,448.00	12,240,000	
本多通信工業	10,200	521.00	5,314,200	
船井電機	12,000	474.00	5,688,000	
横河電機	107,500	1,719.00	184,792,500	
新電元工業	4,100	2,035.00	8,343,500	
アズビル	73,900	4,235.00	312,966,500	
東亜ディーケーケー	5,900	848.00	5,003,200	
日本光電工業	48,400	3,510.00	169,884,000	
チノー	3,700	1,364.00	5,046,800	
共和電業	11,100	428.00	4,750,800	
日本電子材料	4,600	2,058.00	9,466,800	
堀場製作所	23,200	5,380.00	124,816,000	
アドバンテスト	87,100	5,450.00	474,695,000	
小野測器	4,600	528.00	2,428,800	
エスベック	10,400	1,829.00	19,021,600	
キーエンス	106,100	49,600.00	5,262,560,000	
日置電機	5,600	3,805.00	21,308,000	
シスメックス	83,700	10,445.00	874,246,500	
日本マイクロニクス	20,400	1,133.00	23,113,200	
メガチップス	10,900	3,065.00	33,408,500	
O B A R A G R O U P	6,800	3,600.00	24,480,000	
I M A G I C A G R O U P	10,200	402.00	4,100,400	
澤藤電機	1,400	1,810.00	2,534,000	

デンソー	257,900	4,841.00	1,248,493,900
原田工業	5,000	888.00	4,440,000
コーセル	15,600	1,033.00	16,114,800
イリソ電子工業	9,800	4,205.00	41,209,000
オブテックスグループ	19,200	1,658.00	31,833,600
千代田インテグレ	5,000	1,623.00	8,115,000
アイ・オー・データ機器	3,800	1,026.00	3,898,800
レーザーテック	51,400	9,670.00	497,038,000
スタンレー電気	82,100	3,065.00	251,636,500
岩崎電気	4,600	1,467.00	6,748,200
ウシオ電機	64,600	1,319.00	85,207,400
岡谷電機産業	9,600	365.00	3,504,000
ヘリオス テクノ ホールディング	11,000	337.00	3,707,000
エノモト	3,600	1,120.00	4,032,000
日本セラミック	11,900	2,688.00	31,987,200
遠藤照明	5,100	650.00	3,315,000
古河電池	8,300	1,089.00	9,038,700
双信電機	5,800	454.00	2,633,200
山一電機	8,400	1,358.00	11,407,200
図研	7,600	2,820.00	21,432,000
日本電子	23,100	3,795.00	87,664,500
カシオ計算機	103,600	1,584.00	164,102,400
ファナック	110,100	20,075.00	2,210,257,500
日本シイエムケイ	27,500	474.00	13,035,000
エンプラス	6,000	2,243.00	13,458,000
大真空	4,300	2,274.00	9,778,200
ローム	48,700	8,500.00	413,950,000
浜松ホトニクス	84,000	5,330.00	447,720,000
三井ハイテック	12,900	1,982.00	25,567,800
新光電気工業	39,300	2,019.00	79,346,700
京セラ	164,800	6,026.00	993,084,800
協栄産業	1,100	1,414.00	1,555,400
太陽誘電	52,100	3,565.00	185,736,500
村田製作所	344,000	6,866.00	2,361,904,000
双葉電子工業	18,500	909.00	16,816,500
日東電工	80,800	7,130.00	576,104,000
北陸電気工業	4,300	954.00	4,102,200
東海理化電機製作所	30,800	1,576.00	48,540,800
ニチコン	39,700	793.00	31,482,100
日本ケミコン	8,900	1,363.00	12,130,700
K O A	17,700	1,160.00	20,532,000
三井E & Sホールディングス	42,100	385.00	16,208,500
日立造船	93,000	427.00	39,711,000
三菱重工業	196,300	2,291.00	449,723,300
川崎重工業	91,000	1,370.00	124,670,000
I H I	84,300	1,426.00	120,211,800
名村造船所	37,700	160.00	6,032,000
サノヤスホールディングス	13,000	167.00	2,171,000
スプリックス	3,000	854.00	2,562,000
マネジメントソリューションズ	5,400	1,663.00	8,980,200

プロレド・パートナーズ	1,500	5,270.00	7,905,000	
and factory	1,100	1,189.00	1,307,900	
ピアラ	600	2,726.00	1,635,600	
ギークス	1,100	1,306.00	1,436,600	
カーブスホールディングス	30,700	667.00	20,476,900	
フォーラムエンジニアリング	5,800	839.00	4,866,200	
日本車輛製造	4,300	2,711.00	11,657,300	
三菱ロジスネクスト	15,600	950.00	14,820,000	
近畿車輛	1,700	1,365.00	2,320,500	
F P G	35,400	551.00	19,505,400	
島根銀行	3,100	667.00	2,067,700	
じもとホールディングス	7,790	991.00	7,719,890	
全国保証	32,500	4,325.00	140,562,500	
めぶきフィナンシャルグループ	599,600	221.00	132,511,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	15,600	1,135.00	17,706,000	
九州フィナンシャルグループ	252,900	494.00	124,932,600	
かんぼ生命保険	40,900	1,760.00	71,984,000	
ゆうちょ銀行	327,500	815.00	266,912,500	
富山第一銀行	28,100	296.00	8,317,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	659,000	375.00	247,125,000	
ジェイリース	3,100	694.00	2,151,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	76,800	727.00	55,833,600	
マーキュリアインベストメント	4,700	671.00	3,153,700	
イントラスト	4,100	879.00	3,603,900	
日本モーゲージサービス	4,700	1,182.00	5,555,400	
C A S A	4,000	1,258.00	5,032,000	
アルヒ	18,300	1,960.00	35,868,000	
プレミアグループ	6,300	2,168.00	13,658,400	
日産自動車	1,381,000	381.00	526,161,000	
いすゞ自動車	339,300	955.20	324,099,360	
トヨタ自動車	1,306,700	6,911.00	9,030,603,700	代用有価証券 250,000株
日野自動車	146,100	778.00	113,665,800	
三菱自動車工業	432,300	223.00	96,402,900	
エフテック	8,300	525.00	4,357,500	
レシップホールディングス	4,900	580.00	2,842,000	
G M B	1,900	641.00	1,217,900	
ファルテック	1,900	618.00	1,174,200	
武蔵精密工業	26,100	1,176.00	30,693,600	
日産車体	22,900	920.00	21,068,000	
新明和工業	31,600	871.00	27,523,600	
極東開発工業	21,700	1,371.00	29,750,700	
日信工業	23,900	2,247.00	53,703,300	
トピー工業	9,700	1,077.00	10,446,900	
ティラド	4,300	1,304.00	5,607,200	
曙ブレーキ工業	64,300	150.00	9,645,000	
タチエス	19,200	1,030.00	19,776,000	
N O K	62,900	1,119.00	70,385,100	

フタバ産業	32,600	549.00	17,897,400
K Y B	13,100	2,207.00	28,911,700
市光工業	17,600	481.00	8,465,600
大同メタル工業	22,900	530.00	12,137,000
プレス工業	58,100	301.00	17,488,100
ミクニ	15,900	279.00	4,436,100
太平洋工業	24,500	1,013.00	24,818,500
ケーヒン	27,000	2,595.00	70,065,000
河西工業	16,100	378.00	6,085,800
アイシン精機	96,400	3,340.00	321,976,000
マツダ	344,300	604.00	207,957,200
今仙電機製作所	11,300	650.00	7,345,000
本田技研工業	922,100	2,534.50	2,337,062,450
スズキ	232,100	4,852.00	1,126,149,200
S U B A R U	363,500	2,091.50	760,260,250
安永	5,700	1,193.00	6,800,100
ヤマハ発動機	165,300	1,583.00	261,669,900
ショーワ	27,700	2,296.00	63,599,200
小糸製作所	70,200	5,340.00	374,868,000
T B K	12,600	457.00	5,758,200
エクセディ	15,900	1,341.00	21,321,900
ミツバ	21,600	386.00	8,337,600
豊田合成	37,800	2,458.00	92,912,400
愛三工業	18,600	491.00	9,132,600
盟和産業	1,700	926.00	1,574,200
日本プラスト	9,600	428.00	4,108,800
ヨロズ	11,000	1,038.00	11,418,000
エフ・シー・シー	19,100	2,020.00	38,582,000
新家工業	2,900	1,150.00	3,335,000
シマノ	43,800	20,800.00	911,040,000
テイ・エス テック	27,200	2,908.00	79,097,600
関西みらいフィナンシャルグループ	67,800	442.00	29,967,600
三十三フィナンシャルグループ	10,800	1,332.00	14,385,600
第四北越フィナンシャルグループ	20,100	2,199.00	44,199,900
ひろぎんホールディングス	170,400	612.00	104,284,800
ジャムコ	5,900	675.00	3,982,500
小野建	10,700	1,150.00	12,305,000
はるやまホールディングス	4,700	700.00	3,290,000
南陽	2,300	1,740.00	4,002,000
ノジマ	20,500	2,845.00	58,322,500
佐鳥電機	8,100	845.00	6,844,500
カッパ・クリエイト	16,200	1,517.00	24,575,400
エコートレーディング	2,900	627.00	1,818,300
伯東	7,100	1,160.00	8,236,000
コンドーテック	9,000	1,070.00	9,630,000
中山福	5,700	481.00	2,741,700
ライトオン	8,700	606.00	5,272,200
ナガイレーベン	15,300	2,672.00	40,881,600
ジーンズメイト	4,100	218.00	893,800
三菱食品	12,700	2,797.00	35,521,900

良品計画	153,100	2,058.00	315,079,800
三城ホールディングス	11,100	288.00	3,196,800
松田産業	8,500	1,477.00	12,554,500
第一興商	17,100	3,665.00	62,671,500
メディカルホールディングス	124,500	2,057.00	256,096,500
アドヴァン	17,600	1,355.00	23,848,000
S P K	4,600	1,276.00	5,869,600
萩原電気ホールディングス	4,400	2,212.00	9,732,800
アルビス	4,400	2,613.00	11,497,200
アズワン	7,500	16,150.00	121,125,000
スズデン	3,600	1,227.00	4,417,200
尾家産業	3,100	1,641.00	5,087,100
シモジマ	7,100	1,377.00	9,776,700
ドウシシャ	10,900	2,074.00	22,606,600
小津産業	2,500	1,880.00	4,700,000
コナカ	14,000	274.00	3,836,000
高速	6,900	1,541.00	10,632,900
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,658.00	2,155,400
G - 7ホールディングス	6,800	2,548.00	17,326,400
たけびし	3,600	1,560.00	5,616,000
イオン北海道	15,300	886.00	13,555,800
コジマ	19,900	636.00	12,656,400
ヒマラヤ	4,300	880.00	3,784,000
コーナン商事	16,400	3,775.00	61,910,000
ネットワンシステムズ	43,800	5,010.00	219,438,000
エコス	4,300	2,131.00	9,163,300
ワタミ	13,600	997.00	13,559,200
マルシェ	3,100	568.00	1,760,800
リックス	2,400	1,640.00	3,936,000
システムソフト	26,300	111.00	2,919,300
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	253,600	2,396.00	607,625,600
丸文	10,400	518.00	5,387,200
西松屋チェーン	25,300	1,551.00	39,240,300
ゼンショーホールディングス	55,300	2,517.00	139,190,100
ハビネット	9,700	1,457.00	14,132,900
幸楽苑ホールディングス	7,300	1,785.00	13,030,500
ハークスレイ	2,200	967.00	2,127,400
橋本総業ホールディングス	2,200	2,423.00	5,330,600
日本ライフライン	34,200	1,407.00	48,119,400
サイゼリヤ	17,100	2,060.00	35,226,000
タカショー	7,600	693.00	5,266,800
V Tホールディングス	48,000	411.00	19,728,000
マルカ	3,800	2,305.00	8,759,000
アルゴグラフィックス	9,800	3,290.00	32,242,000
魚力	3,300	1,688.00	5,570,400
I D O M	31,100	691.00	21,490,100
日本エム・ディ・エム	6,700	2,021.00	13,540,700
ポブラ	3,400	442.00	1,502,800
フジ・コーポレーション	3,100	2,447.00	7,585,700

ユナイテッドアローズ	12,000	1,484.00	17,808,000
進和	6,900	2,089.00	14,414,100
エスケイジャパン	2,800	358.00	1,002,400
ダイترون	4,900	1,535.00	7,521,500
ハイデイ日高	16,600	1,776.00	29,481,600
シークス	14,700	1,282.00	18,845,400
京都きもの友禅	6,900	227.00	1,566,300
コロワイド	38,300	1,662.00	63,654,600
ピーシーデポコーポレーション	15,200	691.00	10,503,200
田中商事	3,300	694.00	2,290,200
オーハシテクニカ	6,000	1,489.00	8,934,000
壱番屋	8,100	5,520.00	44,712,000
白銅	3,700	1,357.00	5,020,900
トップカルチャー	4,400	401.00	1,764,400
P L A N T	2,900	879.00	2,549,100
スギホールディングス	23,000	7,100.00	163,300,000
ダイコー通産	700	1,425.00	997,500
薬王堂ホールディングス	5,000	2,605.00	13,025,000
島津製作所	140,000	3,115.00	436,100,000
J M S	10,000	915.00	9,150,000
クボテック	2,900	333.00	965,700
長野計器	8,600	854.00	7,344,400
ブイ・テクノロジー	5,500	4,860.00	26,730,000
スター精密	18,000	1,449.00	26,082,000
東京計器	7,600	915.00	6,954,000
愛知時計電機	1,300	4,420.00	5,746,000
インターアクション	6,300	1,978.00	12,461,400
オーバル	12,200	230.00	2,806,000
東京精密	21,200	3,515.00	74,518,000
マニー	46,700	2,725.00	127,257,500
ニコン	178,700	679.00	121,337,300
トプコン	58,900	1,048.00	61,727,200
オリンパス	648,000	2,225.00	1,441,800,000
理研計器	10,400	2,800.00	29,120,000
S C R E E Nホールディングス	20,300	6,340.00	128,702,000
キヤノン電子	10,800	1,438.00	15,530,400
タムロン	9,500	1,585.00	15,057,500
H O Y A	232,300	12,045.00	2,798,053,500
シード	5,200	698.00	3,629,600
ノーリツ鋼機	7,900	1,885.00	14,891,500
エー・アンド・デイ	10,800	651.00	7,030,800
朝日インテック	132,700	3,485.00	462,459,500
キヤノン	581,800	1,670.00	971,606,000
リコー	297,900	682.00	203,167,800
シチズン時計	137,000	268.00	36,716,000
リズム	3,300	647.00	2,135,100
大研医器	8,500	535.00	4,547,500
メニコン	16,600	7,350.00	122,010,000
シンシア	1,300	408.00	530,400
中本パックス	2,800	1,621.00	4,538,800

スノーピーク	6,900	1,967.00	13,572,300
パラマウントベッドホールディングス	12,400	4,270.00	52,948,000
トランザクション	6,400	1,189.00	7,609,600
粧美堂	3,200	382.00	1,222,400
ニホンフラッシュ	10,900	1,344.00	14,649,600
前田工織	12,900	2,783.00	35,900,700
永大産業	15,800	312.00	4,929,600
アートネイチャー	12,600	639.00	8,051,400
パンダイナムコホールディングス	121,100	7,819.00	946,880,900
アイフィスジャパン	3,100	785.00	2,433,500
共立印刷	17,300	133.00	2,300,900
SHOEI	10,200	3,205.00	32,691,000
フランスベッドホールディングス	16,800	872.00	14,649,600
マーベラス	17,600	798.00	14,044,800
パイロットコーポレーション	20,700	3,055.00	63,238,500
萩原工業	6,500	1,607.00	10,445,500
エイベックス	19,700	1,153.00	22,714,100
トッパン・フォームズ	25,100	1,011.00	25,376,100
フジシールインターナショナル	26,300	2,068.00	54,388,400
タカラトミー	52,500	980.00	51,450,000
廣済堂	8,200	668.00	5,477,600
エステールホールディングス	4,100	616.00	2,525,600
レック	12,500	1,583.00	19,787,500
タカノ	4,800	602.00	2,889,600
三光合成	13,900	299.00	4,156,100
プロネクス	10,200	1,119.00	11,413,800
ホクシン	6,900	118.00	814,200
ウッドワン	3,500	1,247.00	4,364,500
大建工業	8,000	1,818.00	14,544,000
きもと	20,400	163.00	3,325,200
凸版印刷	165,300	1,427.00	235,883,100
大日本印刷	153,300	2,040.00	312,732,000
共同印刷	3,200	2,575.00	8,240,000
NISSHA	24,000	1,316.00	31,584,000
光村印刷	900	1,700.00	1,530,000
藤森工業	10,500	4,305.00	45,202,500
ヴィア・ホールディングス	14,000	304.00	4,256,000
TAKARA & COMPANY	5,600	2,140.00	11,984,000
前澤化成工業	7,600	967.00	7,349,200
未来工業	6,400	2,027.00	12,972,800
アシックス	103,500	1,488.00	154,008,000
ツツミ	3,700	2,428.00	8,983,600
ウェーブロックホールディングス	4,100	742.00	3,042,200
JSP	7,000	1,669.00	11,683,000
ニチハ	16,300	3,200.00	52,160,000
エフピコ	24,600	4,155.00	102,213,000
小松ウオール工業	3,700	1,788.00	6,615,600
ヤマハ	69,700	5,040.00	351,288,000
河合楽器製作所	3,600	2,644.00	9,518,400
クリナップ	11,200	506.00	5,667,200

ビジョン	75,200	4,965.00	373,368,000
天馬	7,800	1,813.00	14,141,400
オリバー	2,300	2,878.00	6,619,400
兼松サステック	600	1,599.00	959,400
キングジム	9,900	871.00	8,622,900
象印マホービン	31,700	1,826.00	57,884,200
リンテック	27,900	2,434.00	67,908,600
信越ポリマー	21,000	925.00	19,425,000
東リ	30,000	265.00	7,950,000
イトーキ	23,400	356.00	8,330,400
任天堂	71,800	58,730.00	4,216,814,000
三菱鉛筆	19,300	1,289.00	24,877,700
松風	5,400	1,397.00	7,543,800
タカラスタANDARD	24,300	1,443.00	35,064,900
コクヨ	56,200	1,344.00	75,532,800
ナカバヤシ	12,000	630.00	7,560,000
ニフコ	43,000	3,095.00	133,085,000
立川ブラインド工業	5,200	1,304.00	6,780,800
グロープライド	5,200	3,120.00	16,224,000
オカムラ	40,900	738.00	30,184,200
バルカー	9,600	1,899.00	18,230,400
MUTOHホールディングス	1,300	1,530.00	1,989,000
伊藤忠商事	806,700	2,628.50	2,120,410,950
丸紅	1,200,500	604.60	725,822,300
スクロール	17,700	939.00	16,620,300
高島	1,700	1,826.00	3,104,200
ヨンドシーホールディングス	11,700	1,734.00	20,287,800
三陽商会	5,900	551.00	3,250,900
長瀬産業	64,900	1,414.00	91,768,600
ナイガイ	3,900	383.00	1,493,700
蝶理	7,400	1,679.00	12,424,600
豊田通商	128,700	3,015.00	388,030,500
オンワードホールディングス	68,300	235.00	16,050,500
三共生興	17,800	432.00	7,689,600
兼松	43,000	1,308.00	56,244,000
美津濃	10,700	1,861.00	19,912,700
ツカモトコーポレーション	1,900	1,272.00	2,416,800
ファミリーマート	92,200	2,305.00	212,521,000
ルックホールディングス	4,000	829.00	3,316,000
三井物産	998,600	1,832.50	1,829,934,500
日本紙パルプ商事	6,600	3,805.00	25,113,000
東京エレクトロン	74,300	28,410.00	2,110,863,000
カメイ	15,100	1,058.00	15,975,800
東都水産	1,200	3,530.00	4,236,000
OUGホールディングス	2,000	2,854.00	5,708,000
スターゼン	4,300	3,980.00	17,114,000
セイコーホールディングス	16,500	1,385.00	22,852,500
山善	45,100	1,094.00	49,339,400
椿本興業	1,900	3,745.00	7,115,500
住友商事	727,700	1,251.00	910,352,700

日本ユニシス	35,900	3,490.00	125,291,000	
内田洋行	4,500	5,630.00	25,335,000	
三菱商事	756,300	2,531.50	1,914,573,450	
第一実業	5,600	3,895.00	21,812,000	
キヤノンマーケティングジャパン	28,600	2,018.00	57,714,800	
西華産業	6,700	1,403.00	9,400,100	
佐藤商事	9,700	987.00	9,573,900	
菱洋エレクトロ	11,700	2,904.00	33,976,800	
東京産業	10,700	560.00	5,992,000	
ユアサ商事	11,000	3,355.00	36,905,000	
神鋼商事	3,000	1,854.00	5,562,000	
トルク	6,300	301.00	1,896,300	
阪和興業	21,500	2,126.00	45,709,000	
正栄食品工業	7,500	4,180.00	31,350,000	
カナデン	9,500	1,453.00	13,803,500	
菱電商事	8,400	1,527.00	12,826,800	
ニプロ	81,300	1,180.00	95,934,000	
フルサト工業	6,600	1,461.00	9,642,600	
岩谷産業	26,100	4,130.00	107,793,000	
ナイス	5,000	1,247.00	6,235,000	
昭光通商	3,500	627.00	2,194,500	
ニチモウ	1,700	1,944.00	3,304,800	
極東貿易	3,100	1,486.00	4,606,600	
イワキ	15,300	543.00	8,307,900	
兼松エレクトロニクス	6,300	4,440.00	27,972,000	
三愛石油	28,400	1,054.00	29,933,600	
稲畑産業	25,500	1,309.00	33,379,500	
G S Iクレオス	2,800	1,841.00	5,154,800	
明和産業	10,700	426.00	4,558,200	
クワザワホールディングス	3,700	563.00	2,083,100	
キムラタン	56,600	28.00	1,584,800	
ヤマエ久野	8,500	1,188.00	10,098,000	
ゴールドウイン	20,800	8,260.00	171,808,000	
ユニ・チャーム	248,300	4,842.00	1,202,268,600	
デサント	22,400	1,648.00	36,915,200	
キング	4,900	584.00	2,861,600	
ワキタ	24,700	1,056.00	26,083,200	
ヤマトインターナショナル	10,200	337.00	3,437,400	
東邦ホールディングス	37,000	2,203.00	81,511,000	
サンゲツ	31,200	1,563.00	48,765,600	
ミツウロコグループホールディングス	17,000	1,276.00	21,692,000	
シナネンホールディングス	4,800	3,120.00	14,976,000	
伊藤忠エネクス	25,600	965.00	24,704,000	
サンリオ	32,400	1,897.00	61,462,800	
サンワテクノス	8,200	860.00	7,052,000	
リョーサン	12,800	2,069.00	26,483,200	
新光商事	17,500	871.00	15,242,500	
トーヨー	5,300	1,894.00	10,038,200	
三信電気	6,300	2,010.00	12,663,000	
東陽テクニカ	12,300	1,000.00	12,300,000	

モスフードサービス	15,200	2,842.00	43,198,400
加賀電子	11,500	2,184.00	25,116,000
三益半導体工業	9,100	2,392.00	21,767,200
都築電気	3,700	1,657.00	6,130,900
ソーダニッカ	12,100	556.00	6,727,600
立花エレテック	8,700	1,737.00	15,111,900
木曽路	15,000	2,575.00	38,625,000
S R S ホールディングス	13,600	897.00	12,199,200
千趣会	20,900	384.00	8,025,600
タカキュー	10,300	150.00	1,545,000
リテールパートナーズ	15,300	1,589.00	24,311,700
ケーヨー	23,700	780.00	18,486,000
上新電機	13,600	2,501.00	34,013,600
日本瓦斯	18,200	5,120.00	93,184,000
ロイヤルホールディングス	20,100	1,866.00	37,506,600
東天紅	700	1,011.00	707,700
いなげや	14,300	1,895.00	27,098,500
島忠	21,700	4,185.00	90,814,500
チヨダ	12,300	979.00	12,041,700
ライフコーポレーション	8,800	4,200.00	36,960,000
リンガーハット	14,200	2,407.00	34,179,400
M r M a x H D	15,900	804.00	12,783,600
テンアライド	11,100	388.00	4,306,800
A O K I ホールディングス	22,800	506.00	11,536,800
オークワ	18,100	1,431.00	25,901,100
コメリ	17,800	3,125.00	55,625,000
青山商事	23,500	544.00	12,784,000
しまむら	13,400	10,710.00	143,514,000
はせがわ	5,600	305.00	1,708,000
高島屋	83,800	850.00	71,230,000
松屋	23,200	796.00	18,467,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	54,500	757.00	41,256,500
近鉄百貨店	4,400	3,270.00	14,388,000
丸井グループ	105,700	2,095.00	221,441,500
クレディセゾン	80,800	1,193.00	96,394,400
アクシアル リテイリング	9,600	4,685.00	44,976,000
井筒屋	6,000	171.00	1,026,000
イオン	443,800	2,813.00	1,248,409,400
イズミ	23,400	3,700.00	86,580,000
フォーバル	5,200	998.00	5,189,600
平和堂	23,400	2,333.00	54,592,200
フジ	13,900	1,971.00	27,396,900
ヤオコー	13,100	7,570.00	99,167,000
ゼビオホールディングス	14,000	750.00	10,500,000
ケーズホールディングス	111,200	1,442.00	160,350,400
P A L T A C	18,500	5,520.00	102,120,000
三谷産業	15,500	381.00	5,905,500
O l y m p i c グループ	6,000	1,157.00	6,942,000
日産東京販売ホールディングス	15,500	259.00	4,014,500
新生銀行	84,700	1,344.00	113,836,800

あおぞら銀行	68,600	1,777.00	121,902,200	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,901,200	427.10	3,374,602,520	
りそなホールディングス	1,255,700	359.30	451,173,010	
三井住友トラスト・ホールディングス	218,300	2,854.50	623,137,350	
三井住友フィナンシャルグループ	798,700	2,997.50	2,394,103,250	
千葉銀行	385,000	588.00	226,380,000	
群馬銀行	221,400	356.00	78,818,400	
武蔵野銀行	17,100	1,556.00	26,607,600	
千葉興業銀行	31,700	268.00	8,495,600	
筑波銀行	48,000	199.00	9,552,000	
七十七銀行	39,000	1,585.00	61,815,000	
青森銀行	9,000	2,352.00	21,168,000	
秋田銀行	7,400	1,523.00	11,270,200	
山形銀行	13,100	1,356.00	17,763,600	
岩手銀行	7,600	2,487.00	18,901,200	
東邦銀行	103,800	234.00	24,289,200	
東北銀行	5,800	1,137.00	6,594,600	
みちのく銀行	7,500	1,305.00	9,787,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	97,200	1,788.00	173,793,600	
静岡銀行	281,100	725.00	203,797,500	
十六銀行	14,500	1,978.00	28,681,000	
スルガ銀行	117,500	378.00	44,415,000	
八十二銀行	278,500	415.00	115,577,500	
山梨中央銀行	13,400	840.00	11,256,000	
大垣共立銀行	22,800	2,332.00	53,169,600	
福井銀行	9,900	1,821.00	18,027,900	
北國銀行	11,500	3,070.00	35,305,000	
清水銀行	4,800	1,807.00	8,673,600	
富山銀行	2,100	3,110.00	6,531,000	
滋賀銀行	23,200	2,396.00	55,587,200	
南都銀行	19,300	1,978.00	38,175,400	
百五銀行	104,300	326.00	34,001,800	
京都銀行	41,300	5,030.00	207,739,000	
紀陽銀行	41,000	1,572.00	64,452,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	76,800	1,028.00	78,950,400	
山陰合同銀行	68,500	554.00	37,949,000	
中国銀行	99,500	964.00	95,918,000	
鳥取銀行	4,200	1,151.00	4,834,200	
伊予銀行	164,800	701.00	115,524,800	
百十四銀行	12,300	1,813.00	22,299,900	
四国銀行	17,600	737.00	12,971,200	
阿波銀行	18,900	2,545.00	48,100,500	
大分銀行	6,700	2,474.00	16,575,800	
宮崎銀行	7,700	2,384.00	18,356,800	
佐賀銀行	7,000	1,302.00	9,114,000	
沖縄銀行	10,600	3,010.00	31,906,000	
琉球銀行	26,500	897.00	23,770,500	
セブン銀行	385,500	258.00	99,459,000	
みずほフィナンシャルグループ	1,569,310	1,326.00	2,080,905,060	
高知銀行	4,500	763.00	3,433,500	

山口フィナンシャルグループ	144,100	694.00	100,005,400	
芙蓉総合リース	12,100	6,340.00	76,714,000	
みずほリース	17,800	2,733.00	48,647,400	
東京センチュリー	23,300	5,820.00	135,606,000	
SBIホールディングス	130,500	2,588.00	337,734,000	
日本証券金融	50,900	519.00	26,417,100	
アイフル	175,700	279.00	49,020,300	
日本アジア投資	9,800	226.00	2,214,800	
長野銀行	4,000	1,404.00	5,616,000	
名古屋銀行	8,600	2,682.00	23,065,200	
北洋銀行	173,900	232.00	40,344,800	
愛知銀行	4,200	3,010.00	12,642,000	
中京銀行	4,900	2,038.00	9,986,200	
大光銀行	3,600	1,372.00	4,939,200	
愛媛銀行	16,300	1,174.00	19,136,200	
トマト銀行	4,800	1,031.00	4,948,800	
京葉銀行	49,500	486.00	24,057,000	
栃木銀行	55,400	183.00	10,138,200	
北日本銀行	3,600	1,990.00	7,164,000	
東和銀行	20,400	717.00	14,626,800	
福島銀行	10,900	242.00	2,637,800	
大東銀行	6,200	620.00	3,844,000	
リコーリース	9,100	2,869.00	26,107,900	
イオンフィナンシャルサービス	70,600	1,137.00	80,272,200	
アコム	232,300	456.00	105,928,800	
ジャックス	12,800	1,737.00	22,233,600	
オリエントコーポレーション	311,700	118.00	36,780,600	
日立キャピタル	27,200	2,400.00	65,280,000	
アプラスフィナンシャル	56,300	79.00	4,447,700	
オリックス	716,400	1,375.50	985,408,200	
三菱UFJリース	292,800	481.00	140,836,800	
ジャフコグループ	17,700	4,515.00	79,915,500	
九州リースサービス	6,500	610.00	3,965,000	
トモニホールディングス	89,500	333.00	29,803,500	
大和証券グループ本社	927,100	452.50	419,512,750	
野村ホールディングス	2,032,600	487.10	990,079,460	
岡三証券グループ	98,000	349.00	34,202,000	
丸三証券	34,200	466.00	15,937,200	
東洋証券	41,100	115.00	4,726,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	132,000	279.00	36,828,000	
光世証券	2,500	663.00	1,657,500	
水戸証券	33,400	204.00	6,813,600	
いちよし証券	21,300	472.00	10,053,600	
松井証券	66,000	931.00	61,446,000	
SOMPOホールディングス	217,200	3,756.00	815,803,200	
日本取引所グループ	331,500	2,772.00	918,918,000	
マネックスグループ	84,900	274.00	23,262,600	
極東証券	15,400	631.00	9,717,400	
岩井コスモホールディングス	10,900	1,300.00	14,170,000	

藍澤證券	20,800	695.00	14,456,000
フィデアホールディングス	112,300	111.00	12,465,300
池田泉州ホールディングス	132,200	170.00	22,474,000
アニコムホールディングス	38,300	1,151.00	44,083,300
MS & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	302,100	2,814.50	850,260,450
マネーパートナーズグループ	13,100	205.00	2,685,500
スパークス・グループ	53,600	253.00	13,560,800
小林洋行	3,100	269.00	833,900
第一生命ホールディングス	653,600	1,615.50	1,055,890,800
東京海上ホールディングス	408,400	4,778.00	1,951,335,200
アドバンテッジリスクマネジメント	5,700	764.00	4,354,800
イー・ギャランティ	13,200	2,376.00	31,363,200
アサックス	6,300	762.00	4,800,600
NECキャピタルソリューション	4,800	1,871.00	8,980,800
T & Dホールディングス	345,000	1,088.00	375,360,000
アドバンスクリエイト	2,500	2,182.00	5,455,000
三井不動産	561,500	1,889.50	1,060,954,250
三菱地所	809,300	1,623.50	1,313,898,550
平和不動産	21,200	3,060.00	64,872,000
東京建物	114,000	1,242.00	141,588,000
ダイビル	29,800	1,322.00	39,395,600
京阪神ビルディング	18,600	1,823.00	33,907,800
住友不動産	259,600	2,981.00	773,867,600
太平洋興発	4,200	648.00	2,721,600
テオーシー	22,800	671.00	15,298,800
東京楽天地	1,700	4,280.00	7,276,000
レオパレス21	151,400	171.00	25,889,400
スターツコーポレーション	15,700	2,490.00	39,093,000
フジ住宅	13,700	542.00	7,425,400
空港施設	11,900	471.00	5,604,900
明和地所	6,500	502.00	3,263,000
ゴールドクレスト	9,100	1,343.00	12,221,300
リログループ	61,200	2,669.00	163,342,800
エスリード	4,500	1,419.00	6,385,500
日神グループホールディングス	17,500	417.00	7,297,500
日本エスコン	20,900	954.00	19,938,600
タカラレーベン	52,700	312.00	16,442,400
A V A N T I A	6,500	819.00	5,323,500
イオンモール	57,900	1,626.00	94,145,400
毎日コムネット	2,700	746.00	2,014,200
ファースト住建	5,000	1,145.00	5,725,000
ランド	572,100	9.00	5,148,900
カチタス	28,600	3,175.00	90,805,000
東祥	6,900	1,320.00	9,108,000
トーセイ	15,800	1,079.00	17,048,200
穴吹興産	2,400	1,585.00	3,804,000
サンフロンティア不動産	15,900	904.00	14,373,600
エフ・ジェー・ネクスト	10,100	955.00	9,645,500
インテリックス	3,000	519.00	1,557,000

ランドビジネス	3,800	337.00	1,280,600
サンネクスタグループ	3,700	1,020.00	3,774,000
グランディハウス	9,000	400.00	3,600,000
東武鉄道	122,100	3,170.00	387,057,000
相鉄ホールディングス	37,500	2,784.00	104,400,000
東急	295,300	1,347.00	397,769,100
京浜急行電鉄	150,300	1,620.00	243,486,000
小田急電鉄	174,200	2,620.00	456,404,000
京王電鉄	60,800	6,400.00	389,120,000
京成電鉄	81,500	2,930.00	238,795,000
富士急行	16,000	4,205.00	67,280,000
新京成電鉄	3,100	2,321.00	7,195,100
東日本旅客鉄道	206,100	6,374.00	1,313,681,400
西日本旅客鉄道	104,300	5,049.00	526,610,700
東海旅客鉄道	97,400	14,930.00	1,454,182,000
西武ホールディングス	152,800	1,147.00	175,261,600
鴻池運輸	18,800	1,177.00	22,127,600
西日本鉄道	32,500	2,990.00	97,175,000
ハマキョウレックス	9,000	3,190.00	28,710,000
サカイ引越センター	6,200	5,150.00	31,930,000
近鉄グループホールディングス	110,900	4,465.00	495,168,500
阪急阪神ホールディングス	147,900	3,375.00	499,162,500
南海電気鉄道	52,600	2,296.00	120,769,600
京阪ホールディングス	49,400	4,310.00	212,914,000
神戸電鉄	2,700	3,625.00	9,787,500
名古屋鉄道	91,300	2,853.00	260,478,900
山陽電気鉄道	8,000	2,142.00	17,136,000
トランコム	3,100	7,760.00	24,056,000
日本通運	38,400	5,960.00	228,864,000
ヤマトホールディングス	194,400	2,781.00	540,626,400
山九	30,800	4,175.00	128,590,000
日新	9,600	1,570.00	15,072,000
丸運	7,600	253.00	1,922,800
丸全昭和運輸	9,000	3,390.00	30,510,000
センコーグループホールディングス	61,200	985.00	60,282,000
トナミホールディングス	2,500	6,220.00	15,550,000
ニッコンホールディングス	39,700	2,248.00	89,245,600
日本石油輸送	1,000	2,682.00	2,682,000
福山通運	14,200	4,760.00	67,592,000
セイノーホールディングス	83,000	1,408.00	116,864,000
エスライン	3,100	991.00	3,072,100
神奈川中央交通	2,800	4,005.00	11,214,000
日立物流	20,400	3,360.00	68,544,000
丸和運輸機関	11,700	4,320.00	50,544,000
C & F ロジホールディングス	11,200	1,802.00	20,182,400
日本郵船	92,700	1,940.00	179,838,000
商船三井	70,100	2,273.00	159,337,300
川崎汽船	34,100	1,329.00	45,318,900
NSユナイテッド海運	6,200	1,513.00	9,380,600
明治海運	10,900	396.00	4,316,400

飯野海運	53,000	378.00	20,034,000
共栄タンカー	2,000	768.00	1,536,000
九州旅客鉄道	97,100	2,239.00	217,406,900
S Gホールディングス	116,400	5,700.00	663,480,000
日本航空	196,000	2,028.00	397,488,000
A N Aホールディングス	202,700	2,464.00	499,452,800
パスコ	2,200	1,431.00	3,148,200
西本W i s m e t t a cホールディングス	2,700	1,897.00	5,121,900
シルバーライフ	1,600	2,004.00	3,206,400
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,405.00	1,264,500
一家ダイニングプロジェクト	1,200	588.00	705,600
Genky Drug Stores	5,100	3,850.00	19,635,000
コア商事ホールディングス	1,100	2,730.00	3,003,000
国際紙パルプ商事	27,700	292.00	8,088,400
ナルミヤ・インターナショナル	2,600	725.00	1,885,000
ブックオフグループホールディングス	6,800	875.00	5,950,000
三菱倉庫	35,200	2,935.00	103,312,000
三井倉庫ホールディングス	12,700	1,905.00	24,193,500
住友倉庫	40,000	1,323.00	52,920,000
澁澤倉庫	6,100	2,360.00	14,396,000
ヤマタネ	5,900	1,363.00	8,041,700
東陽倉庫	18,000	338.00	6,084,000
乾汽船	6,500	932.00	6,058,000
日本トランスシティ	24,800	556.00	13,788,800
ケイヒン	1,900	1,411.00	2,680,900
中央倉庫	6,900	1,205.00	8,314,500
川西倉庫	2,300	1,090.00	2,507,000
安田倉庫	9,400	922.00	8,666,800
ファイズホールディングス	2,400	1,180.00	2,832,000
東洋埠頭	3,100	1,492.00	4,625,200
宇徳	8,400	492.00	4,132,800
上組	61,800	1,946.00	120,262,800
サンリツ	2,500	642.00	1,605,000
キムラユニティー	3,400	1,070.00	3,638,000
キューソー流通システム	2,900	1,658.00	4,808,200
近鉄エクスプレス	23,600	2,297.00	54,209,200
東海運	7,400	306.00	2,264,400
エーアイテイー	7,900	1,075.00	8,492,500
内外トランスライン	3,900	1,254.00	4,890,600
ショーエイコーポレーション	1,800	1,230.00	2,214,000
日本コンセプト	3,600	1,480.00	5,328,000
T B Sホールディングス	69,900	1,796.00	125,540,400
日本テレビホールディングス	95,800	1,153.00	110,457,400
朝日放送グループホールディングス	11,600	704.00	8,166,400
テレビ朝日ホールディングス	31,600	1,664.00	52,582,400
スカパーJ S A Tホールディングス	75,500	453.00	34,201,500
テレビ東京ホールディングス	9,400	2,405.00	22,607,000
日本B S放送	4,000	1,098.00	4,392,000
ビジョン	14,200	946.00	13,433,200

スマートバリュー	3,000	1,159.00	3,477,000	
USEN-NEXT HOLDINGS	4,400	1,372.00	6,036,800	
ワイヤレスゲート	5,000	773.00	3,865,000	
コネクシオ	6,500	1,207.00	7,845,500	
日本通信	89,300	228.00	20,360,400	
クロップス	2,200	841.00	1,850,200	
日本電信電話	1,536,200	2,257.00	3,467,203,400	
KDDI	837,700	2,704.50	2,265,559,650	
ソフトバンク	1,044,400	1,195.00	1,248,058,000	
光通信	11,800	24,890.00	293,702,000	
NTTドコモ	821,800	3,876.00	3,185,296,800	
エムティーアイ	11,200	937.00	10,494,400	
GMOインターネット	41,200	3,025.00	124,630,000	
ファイバーゲート	3,700	2,097.00	7,758,900	
アйдママーケティングコミュニケーション	3,200	420.00	1,344,000	
KADOKAWA	30,900	2,978.00	92,020,200	
学研ホールディングス	15,400	1,546.00	23,808,400	
ゼンリン	22,900	1,213.00	27,777,700	
昭文社ホールディングス	4,700	490.00	2,303,000	
インプレスホールディングス	9,800	184.00	1,803,200	
東京電力ホールディングス	934,300	284.00	265,341,200	
中部電力	358,400	1,269.50	454,988,800	
関西電力	443,600	1,016.00	450,697,600	
中国電力	168,900	1,325.00	223,792,500	
北陸電力	107,100	751.00	80,432,100	
東北電力	292,600	964.00	282,066,400	
四国電力	105,400	800.00	84,320,000	
九州電力	241,400	953.00	230,054,200	
北海道電力	109,400	461.00	50,433,400	
沖縄電力	22,800	1,598.00	36,434,400	
電源開発	93,000	1,543.00	143,499,000	
エフオン	6,300	707.00	4,454,100	
イーレックス	16,700	1,208.00	20,173,600	
レノバ	19,600	1,345.00	26,362,000	
東京瓦斯	225,200	2,386.00	537,327,200	
大阪瓦斯	227,200	2,011.00	456,899,200	
東邦瓦斯	57,600	5,150.00	296,640,000	
北海道瓦斯	6,500	1,544.00	10,036,000	
広島ガス	25,000	365.00	9,125,000	
西部瓦斯	13,200	2,654.00	35,032,800	
静岡ガス	33,200	925.00	30,710,000	
メタウォーター	11,300	2,309.00	26,091,700	
アイネット	5,900	1,569.00	9,257,100	
松竹	7,600	15,310.00	116,356,000	
東宝	67,800	4,380.00	296,964,000	
エイチ・アイ・エス	17,400	1,650.00	28,710,000	
東映	4,300	17,260.00	74,218,000	
ラックランド	3,200	2,350.00	7,520,000	

エヌ・ティ・ティ・データ	306,000	1,332.00	407,592,000
共立メンテナンス	18,500	4,065.00	75,202,500
イチネンホールディングス	12,600	1,321.00	16,644,600
建設技術研究所	7,200	1,938.00	13,953,600
スペース	7,500	810.00	6,075,000
長 大	4,400	1,260.00	5,544,000
アインホールディングス	14,200	7,260.00	103,092,000
燦ホールディングス	5,000	1,259.00	6,295,000
ピー・シー・エー	2,000	4,905.00	9,810,000
スバル興業	500	7,820.00	3,910,000
東京テアトル	4,700	1,310.00	6,157,000
タナベ経営	2,400	1,378.00	3,307,200
ビジネスブレイン太田昭和	4,000	1,530.00	6,120,000
ナガワ	3,600	7,990.00	28,764,000
よみうりランド	2,500	4,305.00	10,762,500
東京都競馬	7,300	5,460.00	39,858,000
常磐興産	4,600	1,468.00	6,752,800
カナモト	19,700	2,386.00	47,004,200
東京ドーム	45,300	806.00	36,511,800
D T S	25,600	2,203.00	56,396,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	49,000	6,720.00	329,280,000
シーイーシー	12,300	1,599.00	19,667,700
カプコン	54,200	6,140.00	332,788,000
西尾レントオール	10,300	2,218.00	22,845,400
アイ・エス・ピー	2,600	2,906.00	7,555,600
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	67,900	27.00	1,833,300
日本空港ビルデング	36,800	4,700.00	172,960,000
トランス・コスモス	10,600	2,778.00	29,446,800
乃村工藝社	47,900	766.00	36,691,400
ジャステック	7,300	1,449.00	10,577,700
S C S K	26,500	5,930.00	157,145,000
藤田観光	4,400	1,642.00	7,224,800
K N T - C Tホールディングス	6,900	1,112.00	7,672,800
日本管財	12,100	2,040.00	24,684,000
トーカイ	10,800	2,084.00	22,507,200
白洋舎	1,100	2,511.00	2,762,100
セコム	118,800	9,327.00	1,108,047,600
日本システムウエア	3,800	2,136.00	8,116,800
セントラル警備保障	5,400	3,835.00	20,709,000
アイネス	11,300	1,634.00	18,464,200
丹青社	21,000	733.00	15,393,000
メイテック	13,700	5,410.00	74,117,000
T K C	9,700	6,930.00	67,221,000
富士ソフト	12,200	5,550.00	67,710,000
応用地質	13,100	1,242.00	16,270,200
船井総研ホールディングス	23,100	2,448.00	56,548,800
N S D	36,900	2,002.00	73,873,800
進学会ホールディングス	4,100	468.00	1,918,800

丸紅建材リース	1,000	1,764.00	1,764,000	
オオバ	8,000	777.00	6,216,000	
コナミホールディングス	41,700	4,525.00	188,692,500	
いであ	2,700	1,910.00	5,157,000	
学究社	3,400	1,079.00	3,668,600	
ベネッセホールディングス	37,300	2,625.00	97,912,500	
イオンディライト	13,800	2,947.00	40,668,600	
ナック	6,400	981.00	6,278,400	
福井コンピュータホールディングス	4,500	3,070.00	13,815,000	
ダイセキ	18,700	2,779.00	51,967,300	
ステップ	4,300	1,560.00	6,708,000	
日鉄物産	8,300	3,060.00	25,398,000	
泉州電業	3,300	3,205.00	10,576,500	
元気寿司	2,900	2,435.00	7,061,500	
トラスコ中山	26,400	2,626.00	69,326,400	
ヤマダホールディングス	351,400	515.00	180,971,000	
オートバックスセブン	42,800	1,410.00	60,348,000	
モリト	8,700	717.00	6,237,900	
アークランドサカモト	18,100	2,234.00	40,435,400	
ニトリホールディングス	49,900	21,675.00	1,081,582,500	
グルメ杵屋	8,300	970.00	8,051,000	
愛眼	8,400	228.00	1,915,200	
ケーユーホールディングス	6,500	845.00	5,492,500	
吉野家ホールディングス	37,900	1,916.00	72,616,400	
加藤産業	16,700	3,655.00	61,038,500	
北恵	3,100	1,141.00	3,537,100	
イノテック	6,100	1,033.00	6,301,300	
イエローハット	21,800	1,823.00	39,741,400	
松屋フーズホールディングス	5,600	3,630.00	20,328,000	
J B C Cホールディングス	7,700	1,673.00	12,882,100	
J Kホールディングス	10,600	820.00	8,692,000	
サガミホールディングス	15,400	1,264.00	19,465,600	
日伝	10,500	2,273.00	23,866,500	
関西スーパーマーケット	9,600	1,323.00	12,700,800	
ミロク情報サービス	10,200	2,311.00	23,572,200	
北沢産業	7,900	282.00	2,227,800	
杉本商事	6,300	1,891.00	11,913,300	
因幡電機産業	32,800	2,593.00	85,050,400	
王将フードサービス	8,500	6,140.00	52,190,000	
プレナス	13,000	1,772.00	23,036,000	
ミニストップ	8,600	1,467.00	12,616,200	
アークス	23,500	2,551.00	59,948,500	
パローホールディングス	25,500	2,753.00	70,201,500	
東テック	3,900	2,313.00	9,020,700	
ミスミグループ本社	144,600	2,960.00	428,016,000	
藤久	2,500	975.00	2,437,500	
アルテック	8,800	300.00	2,640,000	
ベルク	5,700	6,960.00	39,672,000	
大 庄	6,100	1,237.00	7,545,700	
タキヒヨー	3,500	1,773.00	6,205,500	

ファーストリテイリング	15,400	69,150.00	1,064,910,000	
ソフトバンクグループ	911,800	7,182.00	6,548,547,600	
蔵王産業	2,100	1,457.00	3,059,700	
スズケン	48,800	3,990.00	194,712,000	
サンドラッグ	43,400	4,070.00	176,638,000	
サックスパー ホールディングス	9,800	573.00	5,615,400	
ジェコス	8,100	936.00	7,581,600	
ヤマザワ	2,900	1,802.00	5,225,800	
やまや	2,500	2,165.00	5,412,500	
グローセル	10,300	413.00	4,253,900	
ベルーナ	24,700	960.00	23,712,000	
合計	124,766,940		269,699,004,960	

(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13期中間計算期間(2020年10月13日から2021年4月12日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【DIAM国内株式パッシブ・ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第12期 2020年10月12日現在	第13期中間計算期間末 2021年4月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	19,072,510	19,313,975
親投資信託受益証券	8,367,711,177	13,901,112,013
未収入金	4,899,000	17,536,000
流動資産合計	8,391,682,687	13,937,961,988
資産合計	8,391,682,687	13,937,961,988
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,670,397	18,091,697
未払受託者報酬	1,214,525	1,542,519
未払委託者報酬	17,003,845	16,197,207
その他未払費用	58,152	72,919
流動負債合計	22,946,919	35,904,342
負債合計	22,946,919	35,904,342
純資産の部		
元本等		
元本	3,362,379,516	4,654,943,461
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	5,006,356,252	9,247,114,185
(分配準備積立金)	833,461,456	755,931,360
元本等合計	8,368,735,768	13,902,057,646
純資産合計	8,368,735,768	13,902,057,646
負債純資産合計	8,391,682,687	13,937,961,988

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第12期中間計算期間 自 2019年10月16日 至 2020年4月15日	第13期中間計算期間 自 2020年10月13日 至 2021年4月12日
営業収益		
受取利息	-	22
有価証券売買等損益	438,651,194	1,694,314,836
営業収益合計	438,651,194	1,694,314,858
営業費用		
支払利息	2,233	1,179
受託者報酬	1,050,489	1,542,519
委託者報酬	14,707,488	16,197,207
その他費用	51,766	72,919
営業費用合計	15,811,976	17,813,824
営業利益又は営業損失()	454,463,170	1,676,501,034
経常利益又は経常損失()	454,463,170	1,676,501,034
中間純利益又は中間純損失()	454,463,170	1,676,501,034
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()	89,923,207	100,684,435
期首剰余金又は期首欠損金()	4,352,378,200	5,006,356,252
剰余金増加額又は欠損金減少額	741,342,157	3,157,056,799
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	741,342,157	3,157,056,799
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,189,187,334	492,115,465
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,189,187,334	492,115,465
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()	3,360,146,646	9,247,114,185

(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13期中間計算期間	
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12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12期	第13期中間計算期間末
	2020年10月12日現在	2021年4月12日現在
1. 期首元本額	3,092,725,388円	3,362,379,516円
期中追加設定元本額	1,205,686,297円	1,620,901,417円
期中一部解約元本額	936,032,169円	328,337,472円
2. 受益権の総数	3,362,379,516口	4,654,943,461口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期	第13期中間計算期間末
	2020年10月12日現在	2021年4月12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12期 2020年10月12日現在	第13期中間計算期間末 2021年4月12日現在
1口当たり純資産額	2,4889円	2,9865円
(1万口当たり純資産額)	(24,889円)	(29,865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)

2021年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,577,888,926
株式	344,931,255,952
派生商品評価勘定	63,735,460
未収入金	27,504,360
未収配当金	2,737,903,410
差入委託証拠金	644,160,000
流動資産合計	358,982,448,108
資産合計	358,982,448,108
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	30,064,960
前受金	71,165,000
未払解約金	149,251,000
流動負債合計	250,480,960
負債合計	250,480,960
純資産の部	
元本等	
元本	112,157,626,770
剰余金	
剰余金又は欠損金()	246,574,340,378
元本等合計	358,731,967,148
純資産合計	358,731,967,148
負債純資産合計	358,982,448,108

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年10月13日 至 2021年4月12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	2021年4月12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	103,987,218,101円
同期中追加設定元本額	48,377,030,329円
同期中一部解約元本額	40,206,621,660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	16,521,581,177円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,346,134,755円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,802,636円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	9,658,570円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	8,814,621円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	27,167,124円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	23,209,699円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	13,265,330円
たわらノーロード TOPIX	904,872,655円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	666,161,399円
たわらノーロード バランス(堅実型)	24,315,686円
たわらノーロード バランス(標準型)	151,516,006円
たわらノーロード バランス(積極型)	227,818,816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)	1,750,523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)	106,847,484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)	249,722,787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)	171,608,619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)	242,645,528円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	474,980円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,169,890円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	5,936,223円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,840,857円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	6,645,556円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	34,561,134,956円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	991,164,342円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,353,144,978円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,429,821,205円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	324,563,721円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,126,818,055円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,073,730,854円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	31,789,513円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,023,706,018円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	21,497,518円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	302,674,443円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	261,308,083円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	445,951,184円
投資のソムリエ	18,691,342,042円
クルーズコントロール	827,996,174円
投資のソムリエ<DC年金>	1,033,446,231円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	287,321,539円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	376,972,979円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	8,511,678円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	17,496,515円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	536,403,276円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,875,277,337円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	20,309,982円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	9,591,683円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,234,980円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	46,013,153円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	107,532,965円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,717,986,886円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	255,551,335円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	11,495,619円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	5,760,868円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	5,903,346円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	11,856,999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)	23,829,892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)	29,371,292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)	68,321,700円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	14,678,803円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	24,770,536円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	435,951,476円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	38,910,669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)	456,171,362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)	39,021,505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)	63,744,593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)	105,628,204円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,472,667円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	32,895,788円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,480,170円

DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,955,597円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	13,704,070円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	37,517,416円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	624,199,391円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	676,510,638円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,927,305,181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)	108,625,592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)	33,581,091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)	337,389,775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)	90,202,974円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,520,991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)	427,872,992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)	22,774,131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)	93,394,269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)	219,632,884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)	293,639,414円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	42,012,712円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	18,806,528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)	321,266,809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)	992,662,363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)	1,314,318,490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)	52,594,563円
MHAMトピックスファンド	641,618,864円
計	112,157,626,770円
2. 受益権の総数	112,157,626,770口

(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	2021年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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	2021年4月12日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	12,699,615,000	-	12,733,500,000	33,885,000	
合計	12,699,615,000	-	12,733,500,000	33,885,000	

(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ではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年4月12日現在
1口当たり純資産額	3,1985円
(1万口当たり純資産額)	(31,985円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年4月30日現在

資産総額	13,508,038,582円
負債総額	14,415,069円
純資産総額(-)	13,493,623,513円
発行済数量	4,652,168,201口
1口当たり純資産額(/)	2.9005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

2021年4月30日現在

資産総額	353,066,896,353円
負債総額	1,150,911,883円
純資産総額(-)	351,915,984,470円
発行済数量	113,274,466,274口
1口当たり純資産額(/)	3.1068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（2021年4月30日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2021年4月30日現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年4月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,470,877,769,130
追加型株式投資信託	843	15,735,956,827,061
単位型公社債投資信託	30	64,520,748,527
単位型株式投資信託	207	1,285,603,401,803
合計	1,106	18,556,958,746,521

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36期事業年度(自2020年4月1日至2021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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	32,932,013	36,734,502
金銭の信託	28,548,165	25,670,526
有価証券	996	-
未収委託者報酬	11,487,393	16,804,456
未収運用受託報酬	4,674,225	5,814,654
未収投資助言報酬	331,543	317,567
未収収益	11,674	7,412
前払費用	480,129	724,591
その他	2,815,351	2,419,487
流動資産計	81,281,494	88,493,198
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 1,006,793	1 915,815
器具備品	1 270,768	1 202,902
建設仮勘定	894	609
無形固定資産		
ソフトウェア	3,299,065	2,878,179
ソフトウェア仮勘定	221,784	1,109,723
電話加入権	3,931	3,931
投資その他の資産		
投資有価証券	261,361	261,360
関係会社株式	5,299,196	5,299,196
長期差入保証金	1,302,402	1,324,203
繰延税金資産	2,508,004	3,676,823
その他	111,162	591,970
固定資産計	14,285,364	16,264,717
資産合計	95,566,859	104,757,915

(単位:千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	3,702,906	3,730,283
未払金	4,803,140	7,337,541
未払収益分配金	966	846
未払償還金	9,999	9,999
未払手数料	4,582,140	6,889,193
その他未払金	210,034	437,502
未払費用	6,673,320	9,713,972
未払法人税等	4,090,268	4,199,922
未払消費税等	1,338,183	2,106,617
賞与引当金	1,373,328	1,789,597
役員賞与引当金	65,290	76,410
流動負債計	22,046,438	28,954,345
固定負債		
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
時効後支払損引当金	174,139	157,945
固定負債計	2,293,087	2,450,431
負債合計	24,339,526	31,404,777
(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	49,674,383	51,800,187
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	49,551,090	51,676,893
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	17,871,090	19,996,893
株主資本計	71,227,341	73,353,144
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	7	6
評価・換算差額等計	7	6
純資産合計	71,227,333	73,353,137
負債・純資産合計	95,566,859	104,757,915

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	84,426,075		89,905,293	
運用受託報酬	16,912,305		17,640,234	
投資助言報酬	1,208,954		1,103,477	
その他営業収益	68,156		781,735	
営業収益計		102,615,492		109,430,741
営業費用				
支払手数料	34,980,736		37,003,102	
広告宣伝費	340,791		424,598	
公告費	375		400	
調査費	25,132,268		30,794,092	
調査費	10,586,542		11,302,420	
委託調査費	14,545,725		19,491,671	
委託計算費	698,723		543,135	
営業雑経費	990,002		938,891	
通信費	44,209		46,358	
印刷費	738,330		680,272	
協会費	71,386		71,361	
諸会費	22,790		23,936	
支払販売手数料	113,286		116,962	
営業費用計		62,142,897		69,704,220
一般管理費				
給料	10,817,861		10,586,117	
役員報酬	174,795		163,394	
給料・手当	9,087,800		9,030,562	
賞与	1,555,264		1,392,160	
交際費	40,436		8,168	
寄付金	8,906		7,757	
旅費交通費	320,037		50,081	
租税公課	651,265		912,570	
不動産賃借料	1,479,503		1,499,753	
退職給付費用	505,189		524,845	
固定資産減価償却費	882,526		1,078,185	
福利厚生費	44,352		44,004	
修繕費	1,843		777	
賞与引当金繰入額	1,373,328		1,789,597	
役員賞与引当金繰入額	65,290		76,410	
機器リース料	233		208	
事務委託費	3,625,424		3,793,883	
事務用消耗品費	104,627		68,534	
器具備品費	1,620		548	
諸経費	197,094		152,830	
一般管理費計		20,119,543		20,594,276
営業利益		20,353,050		19,132,244

(単位:千円)

	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	4,440		27,079	
受取配当金	11,185		2,356	
時効成立分配金・償還金	49,164		362	
投資信託償還益	5,528		-	
為替差益	-		7,314	
金銭の信託運用益	-		1,229,697	
受取負担金	297,886		-	
雑収入	7,394		13,505	
時効後支払損引当金戻入額	3,473		13,011	
営業外収益計		379,073		1,293,326
営業外費用				
為替差損	19,750		-	
投資信託償還損	1		3	
金銭の信託運用損	169,505		-	
システム解約料	31,680		-	
早期割増退職金	-		48,755	
雑損失	104		5	
営業外費用計		221,042		48,764
経常利益		20,511,082		20,376,806
特別利益				
投資有価証券売却益	1,169,758		-	
特別利益計		1,169,758		-
特別損失				
固定資産除却損	1 16,085		1 1,511	
特別損失計		16,085		1,511
税引前当期純利益		21,664,754		20,375,294
法人税、住民税及び事業税		7,045,579		7,418,311
法人税等調整額		385,835		1,168,820
法人税等合計		6,659,743		6,249,491
当期純利益		15,005,011		14,125,803

(3)【株主資本等変動計算書】

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	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	14,146,079	45,949,372	67,502,329
当期変動額									
剰余金の配当							11,280,000	11,280,000	11,280,000
当期純利益							15,005,011	15,005,011	15,005,011
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,725,011	3,725,011	3,725,011
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341

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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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				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	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341
当期変動額									
剰余金の配当							12,000,000	12,000,000	12,000,000
当期純利益							14,125,803	14,125,803	14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,125,803	2,125,803	2,125,803
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	19,996,893	51,800,187	73,353,144

	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	7	7	71,227,333
当期変動額			
剰余金の配当			12,000,000
当期純利益			14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	1	1	1
当期変動額合計	1	1	2,125,804
当期末残高	6	6	73,353,137

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。

(未適用の会計基準等)

1. 収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)

(1) 概要

国際会計基準審議会(IASB)及び米国財務会計基準審議会(FASB)は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、2014年5月に「顧客との契約から生じる収益」(IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic 606)を公表しており、IFRS第15号は2018年1月1日以後開始する事業年度から、Topic 606は2017年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわせない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

(2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等

- ・「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)

(1) 概要

国際会計基準審議会(IASB)及び米国財務会計基準審議会(FASB)が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス(国際財務報告基準(IFRS)においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」)を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされています。

(2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
建物	320,020	407,133
器具備品	949,984	978,763

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第35期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)	第36期 (自2020年4月1日 至2021年3月31日)
建物	-	944
器具備品	9,609	566
ソフトウエア	6,475	-

(株主資本等変動計算書関係)

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

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					

第36期(自2020年4月1日至2021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
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18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
2021年6月16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
2021年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種 類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

有価証券及び投資有価証券の発行体の信用リスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しています。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。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	-

第36期(2021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	36,734,502	36,734,502	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	25,670,526	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	16,804,456	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	5,814,654	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	1,990	1,990	-
資産計	85,026,130	85,026,130	-
(1) 未払手数料	6,889,193	6,889,193	-
負債計	6,889,193	6,889,193	-

(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、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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
非上場株式	259,369	259,369
関係会社株式	5,299,196	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 其他有価証券」には含めておりません。

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第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 其他有価証券(投資信託)	996	994	997	-

第36期(2021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	36,734,502	-	-	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1,990	-	-

(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35期の貸借対照表計上額5,299,196千円、第36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。

第36期(2021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	1,990	2,000	9
小計	1,990	2,000	9
合計	1,990	2,000	9

(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

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
投資信託	996	-	3

（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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,289,044	2,422,901
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の発生額	18,448	4,319
退職給付の支払額	187,749	245,143
過去勤務費用の発生額	-	1,567
その他	1,476	1,567
退職給付債務の期末残高	2,422,901	2,479,619

（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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未積立退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未認識数理計算上の差異	130,155	84,264
未認識過去勤務費用	173,798	102,868
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の費用処理額	38,861	41,571
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,362
その他	11,303	7,720
確定給付制度に係る退職給付費用	401,711	409,394

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、当事業年度において48,755千円を営業外費用に計上しております。

(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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021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% ~ 3.76%

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103,477千円、当事業年度100,806千円であります。

(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35期	第36期
	(2020年3月31日現在)	(2021年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	221,053	260,377
未払事業所税	10,778	10,711
賞与引当金	420,513	547,974
未払法定福利費	78,439	92,748
未払給与	10,410	8,535
受取負担金	47,781	-
運用受託報酬	331,395	1,410,516
資産除去債務	14,116	18,079
減価償却超過額(一括償却資産)	50,942	25,808
減価償却超過額	82,684	51,986
繰延資産償却超過額(税法上)	323,132	301,965
退職給付引当金	648,821	701,959
時効後支払損引当金	53,321	48,362
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	11,532	5,283
その他有価証券評価差額金	3	2
繰延税金資産小計	2,508,004	3,676,823
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,508,004	3,676,823
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	2,508,004	3,676,823

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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	94,605,736千円	84,609,003千円
資産合計	94,605,736千円	84,609,003千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	8,278,713千円	5,570,814千円
負債合計	8,278,713千円	5,570,814千円
純資産	86,327,023千円	79,038,188千円

(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	62,885,491千円	59,074,249千円
顧客関連資産	34,810,031千円	29,793,358千円

(2) 損益計算書項目

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	8,954,439千円	8,823,626千円
経常利益	8,954,439千円	8,823,626千円
税引前当期純利益	9,111,312千円	8,823,626千円
当期純利益	7,536,465千円	7,288,834千円
1株当たり当期純利益	188,411円64銭	182,220円85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	5,149,555千円	5,016,672千円

(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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)及び第36期(自 2020年4月1日 至 2021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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

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
	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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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	6,435,839	未払 手数料	1,457,765
	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	12,767,199	未払 手数料	2,524,882

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) 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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	1,780,683円32銭	1,833,828円44銭
1株当たり当期純利益金額	375,125円27銭	353,145円08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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
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通りです。

名 称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
水戸証券株式会社	12,272	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

(1)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、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

2021年5月26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 丘本 正彦 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2020年4月1日から2021年3月31日までの第36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2021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。

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

利害関係

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) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

令和2年11月20日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 丘本正彦 印
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAM国内株式パッシブ・ファンドの令和1年10月16日から令和2年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、DIAM国内株式パッシブ・ファンドの令和2年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年5月28日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 印
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAM国内株式パッシブ・ファンドの2020年10月13日から2021年4月12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。

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、DIAM国内株式パッシブ・ファンドの2021年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年10月13日から2021年4月12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。

中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、アセットマネジメントOne株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、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。

中間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中間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中間財務諸表の作成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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間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。
- ・ 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中間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、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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

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) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。