

【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11月8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】	One DC 国内株式インデックスファンド
【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】

One DC 国内株式インデックスファンド
（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」に記載の振替機関及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。

「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。）

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

（５）【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位(当初元本1口=1円)

ただし、収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2021年11月9日から2022年5月6日まで

ただし、お申込みの取扱いは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

(9) 【払込期日】

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

(1 0) 【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

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)

(1 1) 【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

(1 2) 【その他】

お申込みの方法

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資(自動けいぞく投資)」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」に従って分配金累積投資に関する契約を締結します。

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

お申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。また、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付を取り消すことができます。

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

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、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

<ファンドの特色>

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

指数の著作権等

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

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

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

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

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

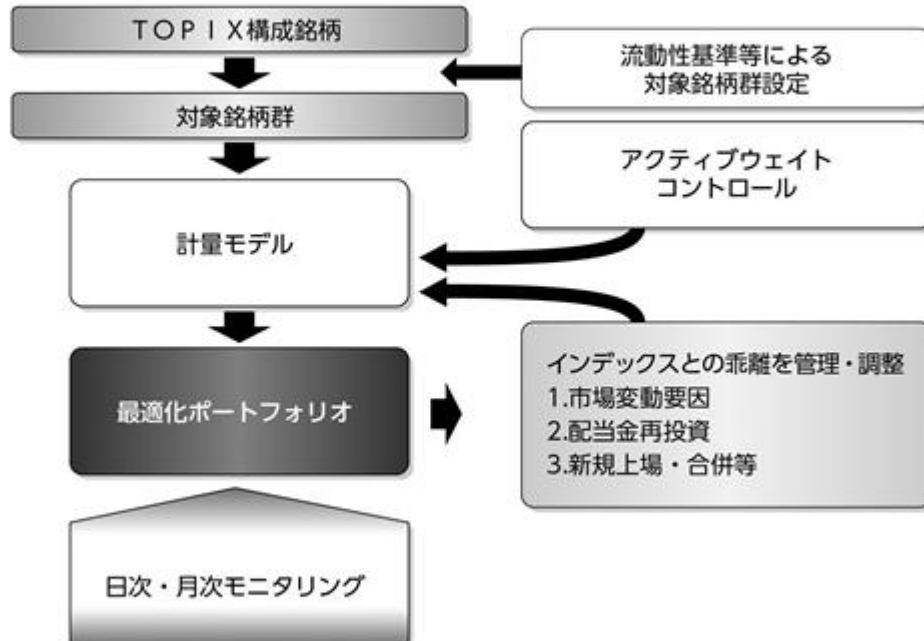
(株)東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

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

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

東証株価指数(TOPIX)は、東証市場再編に伴い、2022年4月4日付で指数の算出要領が変更される予定です。

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



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

■ 分配方針

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

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

商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
		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。

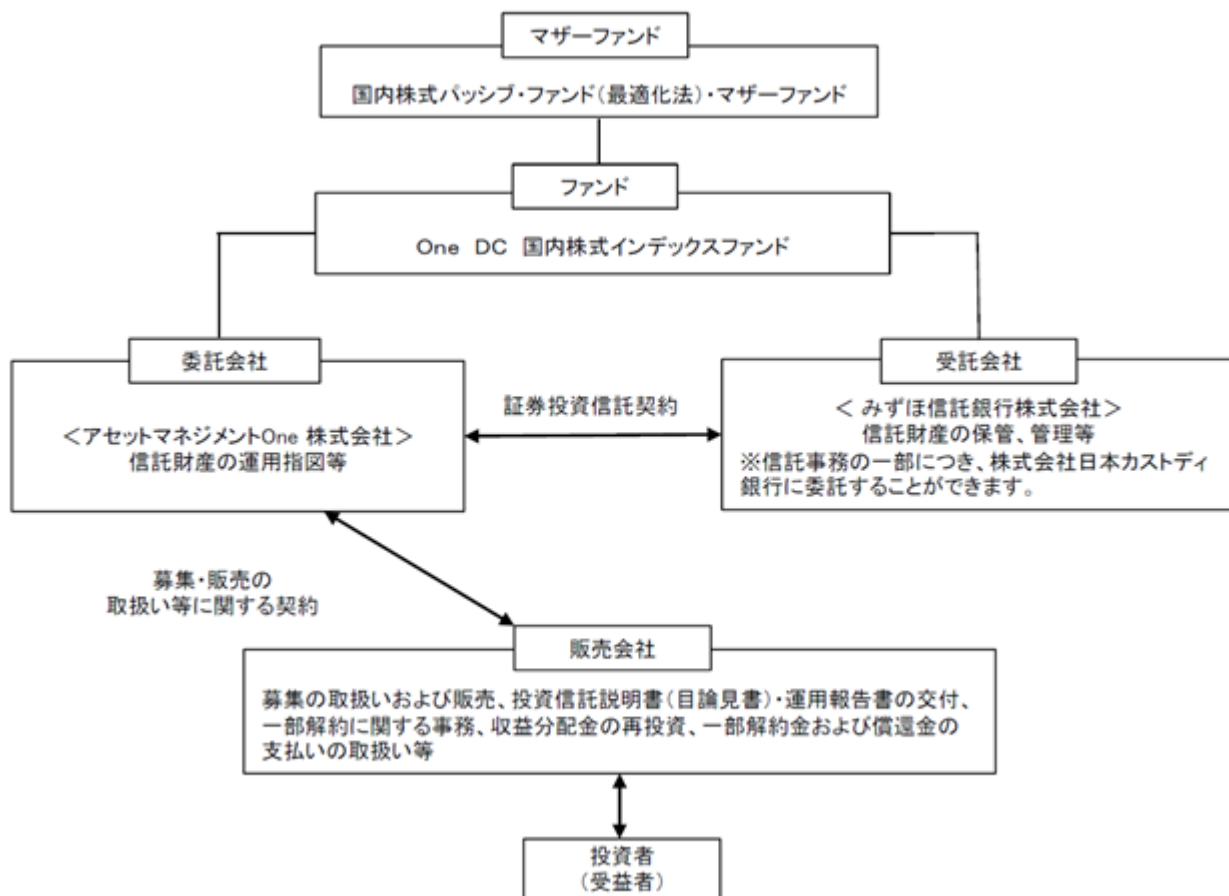
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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】

2007年9月27日	信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
2014年8月29日	信託報酬率の変更
2015年8月28日	信託報酬率の変更
2019年4月1日	信託報酬率の変更
2019年10月1日	ファンドの名称を「DIAM DC 国内株式インデックスファンド」から 「One DC 国内株式インデックスファンド」に変更 信託報酬率の変更

(3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

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

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

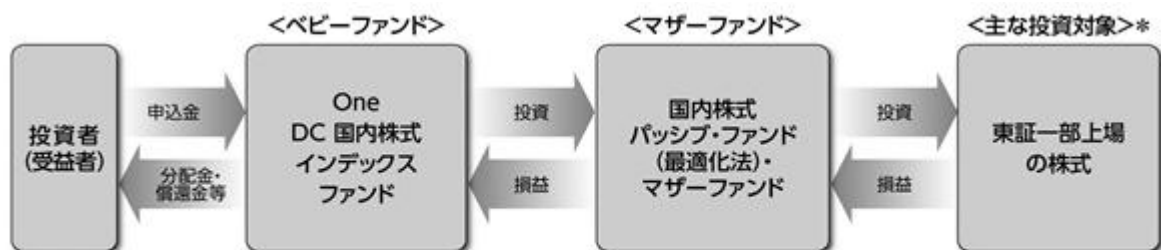
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド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います。



*東証市場再編に伴い、2022年4月4日に「東証一部上場の株式」から「東証株価指数採用銘柄」に変更を行う予定です。

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8月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2021年8月31日現在）

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

イ．基本方針

この投資信託は、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。

ロ．投資対象

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

ハ．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)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- ・最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。
- ・株式(株価指数先物取引を含みます。)の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- ・株式の実質組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。

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

(2)【投資対象】

1.投資の対象とする資産(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

b.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

2. 有価証券の指図範囲 (約款第17条第1項)

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

- 1) 株券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1)~10)の証券または証書の性質を有するもの
- 12) 外国貸付債権信託受益権(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 13) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。)
- 14) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 15) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 16) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
- 17) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの

なお、1)の証券または証書、11)ならびに14)の証券または証書のうち1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券および11)ならびに14)の証券または証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

3. 金融商品の指図範囲（約款第17条第2項）

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

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

4. 上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3.の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。（約款第17条第3項）

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

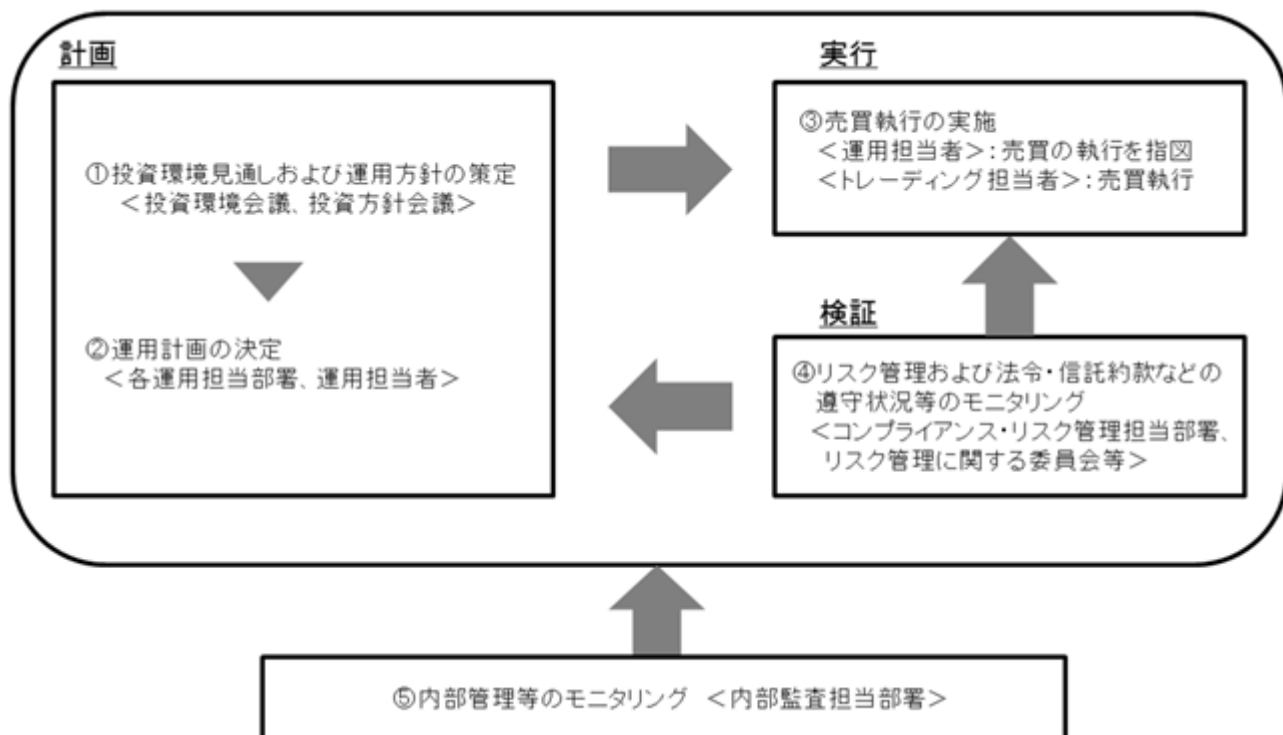
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式 [*] を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式[*]に投資し、「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、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。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>[*] 東証市場再編に伴い、投資対象に関する記載を変更する約款変更を予定しております。約款変更日の2022年4月4日に「東京証券取引所第1部に上場されている株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄」に変更を行う予定です。</p> </div>

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

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（3）【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見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。

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2021年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

収益分配方針

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

1)分配対象額の範囲

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

2)分配対象額についての分配方針

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

3)留保金の運用方針

留保金の運用については、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

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

1. 信託財産に属する配当等収益（利子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、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、監査報酬および当該監査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、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、監査報酬および当該監査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かかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める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。

2) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資されます。

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

(5) 【投資制限】

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

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

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

5) 投資する株式等の範囲(約款第20条)

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

(b) 上記(a)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

6) 信用取引の指図範囲(約款第21条)

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

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

1. 信託財産に属する株券

2. 株式分割により取得する株券

3. 有償増資により取得する株券

4. 売り出しにより取得する株券

5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。))の新株予約権に限り、)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22条)

(a) 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。))および有価証券オプション取引(金融商品取引法

第28条第8項第3号八に掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)

- (b) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (c) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、わが国の取引所における金利に係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これらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

8) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第23条)

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

9) デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第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。

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

11) 特別な場合の外貨建資産への投資制限(約款第26条)

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

12) 外貨為替予約の指図および範囲(約款第27条)

- (a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引を指図することができます。
- (b) 上記(a)の予約取引の指図は、信託財産に属する為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドに信託財産に属する外貨建資産のうち信託

財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

- (c) 上記(b)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

13) 資金の借入れ(約款第34条)

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

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

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

(1) 基準価額の主な変動要因

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

信用リスク

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

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

(2)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と、受益者毎に異なります。

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

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

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

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

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

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

当ファンドは、受益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は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

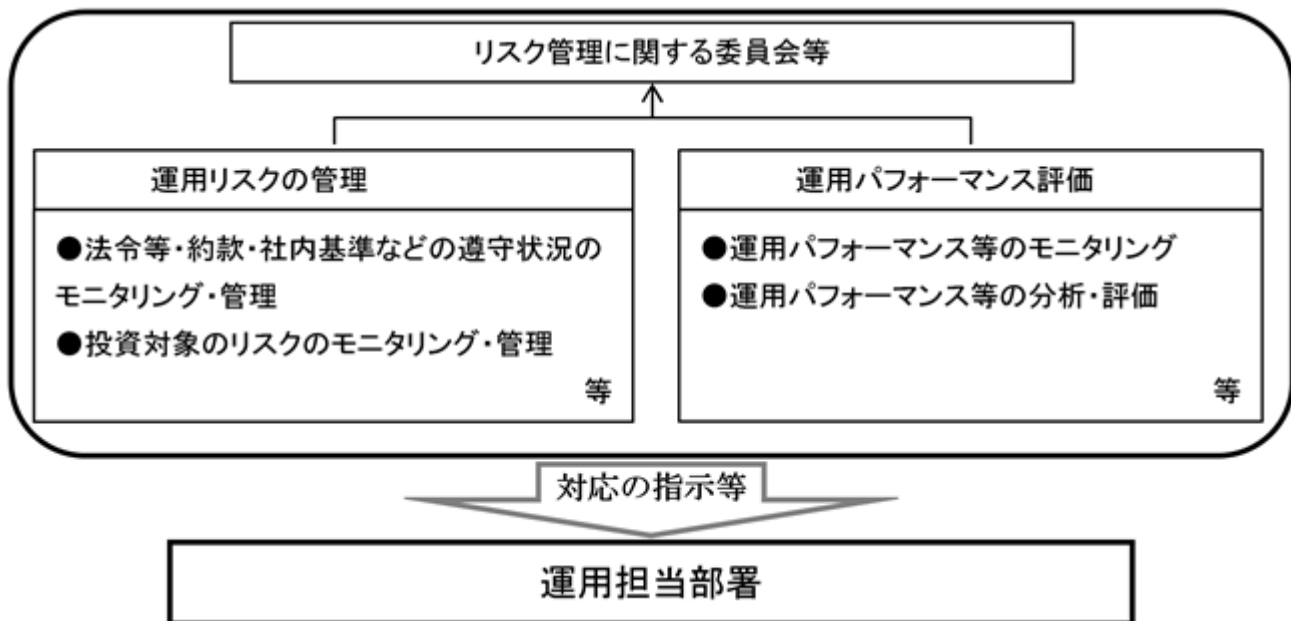
注意事項

- イ．当ファンドは、実質的に株式など値動きのある有価証券（外貨建資産へ投資する場合には為替リスクもあります。）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。



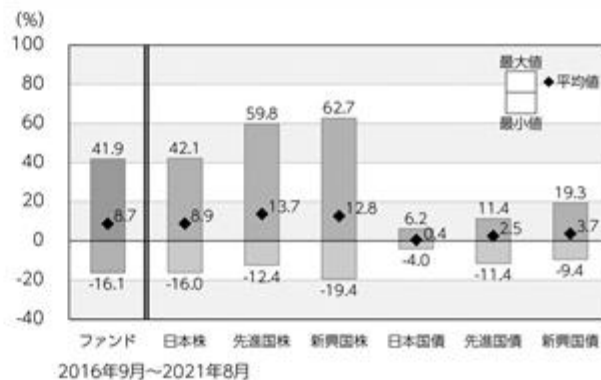
リスク管理体制は2021年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

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

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

*東証株価指数(TOPIX)は、東証市場再編に伴い、2022年4月4日付で指数の算出要領が変更される予定です。

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0.154%（税抜0.14%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.06%	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0.06%	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0.02%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

イ. 信託財産留保額

ありません。

ロ. その他の費用

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

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

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

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・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関する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引に係る手数料・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関する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

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

上記は、2021年8月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2021年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	58,744,468,807	100.00
内 日本	58,744,468,807	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,217,385	0.00
純資産総額	58,746,686,192	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8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	390,822,245,010	97.08
内 日本	390,822,245,010	97.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	11,754,500,414	2.92
純資産総額	402,576,745,424	100.00

その他資産の投資状況

2021年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	11,865,580,000	2.95
内 日本	11,865,580,000	2.95

(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8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	18,268,587,140	3.1273 57,131,516,208	3.2156 58,744,468,807	- -	100.00

(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8月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

(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8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,485,900	8,547.27 12,700,397,069	9,592.00 14,252,752,800	- -	3.54
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	918,700	11,724.63 10,771,419,351	11,360.00 10,436,432,000	- -	2.59
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	143,900	56,469.00 8,125,890,191	66,130.00 9,516,107,000	- -	2.36
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	1,141,900	8,907.03 10,170,948,139	6,181.00 7,058,083,900	- -	1.75
5	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,004,000	5,238.94 5,259,904,012	6,500.00 6,526,000,000	- -	1.62
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	9,895,800	562.85 5,569,872,388	594.40 5,882,063,520	- -	1.46
7	HOYA 日本	株式 精密機器	291,100	13,974.55 4,067,991,950	17,780.00 5,175,758,000	- -	1.29
8	ダイキン工業 日本	株式 機械	186,800	23,006.71 4,297,654,799	27,405.00 5,119,254,000	- -	1.27
9	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,683,500	2,830.40 4,764,985,912	2,936.00 4,942,756,000	- -	1.23
10	信越化学工業 日本	株式 化学	265,700	18,267.07 4,853,562,334	18,205.00 4,837,068,500	- -	1.20
11	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,220,300	3,725.07 4,545,704,046	3,679.00 4,489,483,700	- -	1.12
12	日本電産 日本	株式 電気機器	353,000	13,543.16 4,780,736,043	12,620.00 4,454,860,000	- -	1.11
13	任天堂 日本	株式 その他製品	83,900	62,470.29 5,241,257,978	52,900.00 4,438,310,000	- -	1.10
14	日立製作所 日本	株式 電気機器	705,100	5,366.06 3,783,610,929	6,085.00 4,290,533,500	- -	1.07
15	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	85,900	43,653.82 3,749,863,461	47,240.00 4,057,916,000	- -	1.01
16	村田製作所 日本	株式 電気機器	430,800	9,122.16 3,929,829,129	9,119.00 3,928,465,200	- -	0.98
17	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,154,200	3,417.83 3,944,863,264	3,370.00 3,889,654,000	- -	0.97

18	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,154,700	3,191.34 3,685,044,643	3,342.00 3,859,007,400	- -	0.96
19	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,001,200	3,745.90 3,750,397,086	3,801.00 3,805,561,200	- -	0.95
20	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,010,500	3,213.56 3,247,305,988	3,311.00 3,345,765,500	- -	0.83
21	第一三共 日本	株式 医薬品	1,259,200	2,935.69 3,696,628,086	2,614.50 3,292,178,400	- -	0.82
22	ファナック 日本	株式 電気機器	128,800	27,166.33 3,499,024,469	23,990.00 3,089,912,000	- -	0.77
23	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,965,700	1,570.61 3,087,364,978	1,543.00 3,033,075,100	- -	0.75
24	S M C 日本	株式 機械	42,900	65,258.66 2,799,596,713	70,510.00 3,024,879,000	- -	0.75
25	三菱商事 日本	株式 卸売業	879,500	2,965.40 2,608,074,216	3,311.00 2,912,024,500	- -	0.72
26	三井物産 日本	株式 卸売業	1,172,900	2,210.64 2,592,866,260	2,429.00 2,848,974,100	- -	0.71
27	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	565,200	4,533.27 2,562,207,064	4,815.00 2,721,438,000	- -	0.68
28	富士通 日本	株式 電気機器	132,000	17,244.70 2,276,300,560	20,300.00 2,679,600,000	- -	0.67
29	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	479,500	5,440.32 2,608,633,451	5,377.00 2,578,271,500	- -	0.64
30	デンソー 日本	株式 輸送用機器	323,000	7,058.62 2,279,935,737	7,710.00 2,490,330,000	- -	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8月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	97.08
合計	97.08

(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8月31日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	17.83
情報・通信業		8.07
輸送用機器		7.58
化学		6.97
機械		5.56
サービス業		5.49
医薬品		5.13
銀行業		4.80

卸売業	4.68
小売業	4.24
食料品	3.36
陸運業	3.14
精密機器	2.98
建設業	2.22
その他製品	2.16
不動産業	1.92
保険業	1.91
電気・ガス業	1.15
その他金融業	1.09
鉄鋼	0.88
ガラス・土石製品	0.78
証券、商品先物取引業	0.72
非鉄金属	0.67
ゴム製品	0.65
金属製品	0.61
海運業	0.51
繊維製品	0.48
空運業	0.44
石油・石炭製品	0.38
パルプ・紙	0.22
倉庫・運輸関連業	0.18
鉱業	0.16
水産・農林業	0.09
合計	97.08

（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8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0309月	買建	604	11,635,340,520	11,865,580,000	2.95

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

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第5計算期間末 (2012年2月7日)	2,823	2,823	0.5150	0.5150
第6計算期間末 (2013年2月7日)	4,521	4,521	0.6603	0.6603
第7計算期間末 (2014年2月7日)	6,573	6,573	0.8241	0.8241
第8計算期間末 (2015年2月9日)	8,261	8,261	1.0056	1.0056
第9計算期間末 (2016年2月8日)	11,225	11,225	0.9911	0.9911
第10計算期間末 (2017年2月7日)	13,968	13,968	1.1107	1.1107
第11計算期間末 (2018年2月7日)	22,544	22,544	1.3067	1.3067
第12計算期間末 (2019年2月7日)	30,214	30,214	1.1958	1.1958
第13計算期間末 (2020年2月7日)	37,717	37,717	1.3513	1.3513
第14計算期間末 (2021年2月8日)	49,849	49,849	1.5351	1.5351
2020年8月末日	39,789	-	1.2792	-
9月末日	40,992	-	1.2955	-
10月末日	40,327	-	1.2585	-
11月末日	44,552	-	1.3988	-
12月末日	46,367	-	1.4400	-
2021年1月末日	46,850	-	1.4431	-
2月末日	48,621	-	1.4881	-
3月末日	52,800	-	1.5727	-
4月末日	51,834	-	1.5280	-
5月末日	53,452	-	1.5487	-
6月末日	56,613	-	1.5667	-
7月末日	56,274	-	1.5325	-
8月末日	58,746	-	1.5807	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
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
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
2021年2月9日～2021年8月8日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第5計算期間	16.0
第6計算期間	28.2
第7計算期間	24.8
第8計算期間	22.0
第9計算期間	1.4
第10計算期間	12.1
第11計算期間	17.6
第12計算期間	8.5
第13計算期間	13.0
第14計算期間	13.6
2021年2月9日～2021年8月8日	1.3

(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5計算期間	3,335,462,010	1,114,450,026
第6計算期間	3,710,441,727	2,345,929,733
第7計算期間	6,733,843,082	5,604,546,552
第8計算期間	5,119,097,831	4,880,240,628
第9計算期間	8,364,610,514	5,254,249,325
第10計算期間	7,572,230,014	6,321,925,379
第11計算期間	11,590,956,335	6,914,819,396
第12計算期間	14,073,136,483	6,058,109,779
第13計算期間	10,454,492,002	7,809,755,170
第14計算期間	13,421,884,000	8,860,777,863
2021年2月9日～ 2021年8月8日	7,898,635,254	3,646,360,282

(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8月31日

基準価額・純資産の推移 (2011年8月31日～2021年8月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2007年9月27日)

分配の推移(税引前)

2017年 2月	0円
2018年 2月	0円
2019年 2月	0円
2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	100.00

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	97.08
内 日本	97.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2.92
合計(純資産総額)	100.00

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	3.54
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.59
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	2.36
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.75
5	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.62
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.46
7	HOYA	株式	日本	精密機器	1.29
8	ダイキン工業	株式	日本	機械	1.27
9	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.23
10	信越化学工業	株式	日本	化学	1.20

その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	2.95

株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	17.83
2	情報・通信業	8.07
3	輸送用機器	7.58
4	化学	6.97
5	機械	5.56

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。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みの方法

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

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

お申込価額（発行価格）

お申込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。）

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

お申込単位

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）

ただし、収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位

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）に払込まれます。

2【換金（解約）手続等】

解約のお申込み方法

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

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3時までに行われ、かつ、解約の受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

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

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係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、当該一部解約に係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、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の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

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

解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】**(1)【資産の評価】**

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は2007年9月27日から無期限です。

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

(4)【計算期間】

a. 計算期間は原則として毎年2月8日から翌年2月7日までとします。

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

(5)【その他】

イ. 償還規定

- a. 委託会社は、信託終了前にこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- b. 委託会社は上記a.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- c. 上記a.につき、上記b.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- d. 委託会社は信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨及びその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- e. 上記b.~d.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.の一定の期間が一月を下らずにその公告及び書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- 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き継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

- 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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更」の規定に従い、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. 上記b.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ロ.信託約款の変更

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

ハ.関係法人との契約の更改

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

二．公告

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

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

ホ．運用報告書

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

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

収益分配金請求権

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

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

償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

一部解約請求権

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

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間(2020年2月8日から2021年2月8日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【One DC 国内株式インデックスファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 2020年2月7日現在	第14期 2021年2月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	188,508,121	158,721,109
親投資信託受益証券	37,715,195,597	49,848,126,418
未収入金	-	23,068,000
流動資産合計	37,903,703,718	50,029,915,527
資産合計	37,903,703,718	50,029,915,527
負債の部		
流動負債		
未払解約金	158,424,584	146,083,004
未払受託者報酬	4,034,464	4,799,305
未払委託者報酬	23,630,888	28,796,086
その他未払費用	228,875	250,214
流動負債合計	186,318,811	179,928,609
負債合計	186,318,811	179,928,609
純資産の部		
元本等		
元本	27,912,059,019	32,473,165,156
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,805,325,888	17,376,821,762
（分配準備積立金）	3,677,215,284	9,729,009,068
元本等合計	37,717,384,907	49,849,986,918
純資産合計	37,717,384,907	49,849,986,918
負債純資産合計	37,903,703,718	50,029,915,527

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第13期 自 2019年2月8日 至 2020年2月7日	第14期 自 2020年2月8日 至 2021年2月8日
営業収益		
受取利息	-	149
有価証券売買等損益	4,335,930,349	6,653,227,821
営業収益合計	4,335,930,349	6,653,227,970
営業費用		
支払利息	77,291	54,424
受託者報酬	8,147,187	8,635,870
委託者報酬	45,080,340	51,815,709
その他費用	438,555	466,995
営業費用合計	53,743,373	60,972,998
営業利益又は営業損失()	4,282,186,976	6,592,254,972
経常利益又は経常損失()	4,282,186,976	6,592,254,972
当期純利益又は当期純損失()	4,282,186,976	6,592,254,972
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()	436,100,780	388,632,356
期首剰余金又は期首欠損金()	4,947,125,833	9,805,325,888
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,575,097,548	3,423,346,502
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	2,575,097,548	3,423,346,502
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,562,983,689	2,832,737,956
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,562,983,689	2,832,737,956
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()	9,805,325,888	17,376,821,762

(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14期	
	自 2020年2月8日	至 2021年2月8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2月7日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を2021年2月8日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第13期	第14期
	2020年2月7日現在	2021年2月8日現在
1. 期首元本額	25,267,322,187円	27,912,059,019円
期中追加設定元本額	10,454,492,002円	13,421,884,000円
期中一部解約元本額	7,809,755,170円	8,860,777,863円
2. 受益権の総数	27,912,059,019口	32,473,165,156口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第13期	第14期
	自 2019年2月8日 至 2020年2月7日	自 2020年2月8日 至 2021年2月8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(792,893,825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(823,029,269円)、信託約款に規定される収益調整金(14,171,772,228円)及び分配準備積立金(2,061,292,190円)より分配対象収益は17,848,987,512円(1万口当たり6,394.72円)であります。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(855,898,824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(6,124,988,504円)、信託約款に規定される収益調整金(18,047,633,321円)及び分配準備積立金(2,748,121,740円)より分配対象収益は27,776,642,389円(1万口当たり8,553.72円)であります。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13期	第14期
	自 2019年2月8日 至 2020年2月7日	自 2020年2月8日 至 2021年2月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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13期 2020年2月7日現在	第14期 2021年2月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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13期 2020年2月7日現在	第14期 2021年2月8日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	4,161,771,507	6,660,165,898
合計	4,161,771,507	6,660,165,898

（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13期 2020年2月7日現在	第14期 2021年2月8日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3513円 (13,513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

2021年2月8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	15,975,939,497	49,848,126,418	
親投資信託受益証券	合計	15,975,939,497	49,848,126,418	
合計			49,848,126,418	

（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)

2021年2月8日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,651,925,208
株式	311,274,068,500
派生商品評価勘定	391,827,620
未収配当金	389,312,729
差入委託証拠金	340,200,000
流動資産合計	319,047,334,057
資産合計	319,047,334,057
負債の部	
流動負債	
前受金	261,315,000
未払解約金	199,379,000
流動負債合計	460,694,000
負債合計	460,694,000
純資産の部	
元本等	
元本	102,105,610,506
剰余金	
剰余金又は欠損金()	216,481,029,551
元本等合計	318,586,640,057
純資産合計	318,586,640,057
負債純資産合計	319,047,334,057

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2月8日 至 2021年2月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年2月8日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	98,370,254,055円
同期中追加設定元本額	67,069,989,134円
同期中一部解約元本額	63,334,632,683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	15,975,939,497円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	3,179,107,702円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,626,890円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	5,088,758円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	8,151,762円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	24,072,359円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	14,018,113円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	12,980,814円
たわらノーロード TOPIX	784,765,731円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	612,281,321円
たわらノーロード バランス(堅実型)	23,454,696円
たわらノーロード バランス(標準型)	140,720,417円
たわらノーロード バランス(積極型)	207,209,167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)	1,707,448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)	108,252,549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)	245,952,107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)	166,536,220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)	228,275,842円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	431,973円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,205,302円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	4,833,419円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,885,817円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	6,004,044円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	34,764,926,964円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	1,023,160,847円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,393,344,349円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,451,908,533円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	332,009,300円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,152,607,788円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,085,041,257円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	35,744,954円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,112,139,190円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	21,186,872円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	313,080,893円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	264,026,418円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	439,000,020円
投資のソムリエ	15,620,354,669円
クルーズコントロール	637,176,611円
投資のソムリエ<DC年金>	960,546,620円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	294,854,779円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	367,544,221円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	6,918,316円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	16,838,854円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	264,587,992円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,928,248,506円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	19,134,149円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	9,070,573円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,599,277円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	42,338,447円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	98,734,309円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,803,475,886円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	265,437,692円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	9,278,066円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	5,239,774円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	5,173,103円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,626,870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)	52,904,100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)	64,217,224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)	71,448,850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)	32,545,912円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	41,658,362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)	562,668,029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)	85,977,917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)	72,359,909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)	128,443,286円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,951,637円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	35,906,053円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	8,484,030円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	3,658,825円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	21,889,554円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	46,792,943円

D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	689,878,804円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	729,307,036円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,064,787,625円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	150,408,971円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	37,142,128円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	373,020,041円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	102,439,732円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,576,268円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	468,054,341円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	24,008,365円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	99,685,187円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	238,004,405円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	323,286,503円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	45,168,755円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	20,550,710円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	362,800,005円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,106,076,367円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,467,666,407円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	58,984,178円
計	102,105,610,506円
2. 受益権の総数	102,105,610,506口

(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 2020年2月8日 至 2021年2月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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	2021年2月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年2月8日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)
株式	38,727,073,895
合計	38,727,073,895

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2021年2月8日現在			評価損益(円)
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	
市場取引 先物取引 買建	7,050,125,000	-	7,442,080,000	391,955,000
合計	7,050,125,000	-	7,442,080,000	391,955,000

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

1. 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年2月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.1202円 (31,202円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2021年2月8日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	5,400	3,140.00	16,956,000	
日本水産	148,600	512.00	76,083,200	
マルハニチロ	25,200	2,567.00	64,688,400	
ハウスイ	600	1,008.00	604,800	
雪国まいたけ	9,900	1,818.00	17,998,200	
カネコ種苗	4,600	1,602.00	7,369,200	
サカタのタネ	19,200	3,935.00	75,552,000	
ホクト	13,600	2,180.00	29,648,000	
ホクリヨウ	2,300	708.00	1,628,400	
ヒノキヤグループ	4,000	2,140.00	8,560,000	
ショーボンドホールディングス	22,900	4,710.00	107,859,000	
ミライト・ホールディングス	55,700	1,730.00	96,361,000	
タマホーム	9,700	1,866.00	18,100,200	
サンヨーホームズ	2,200	841.00	1,850,200	
日本アクア	6,400	612.00	3,916,800	
ファーストコーポレーション	4,900	720.00	3,528,000	
ベステラ	3,000	1,644.00	4,932,000	
T A T E R U	29,900	188.00	5,621,200	
キャンディル	2,800	571.00	1,598,800	
スペースバリューホールディングス	19,600	705.00	13,818,000	
住石ホールディングス	27,800	113.00	3,141,400	
日鉄鉱業	3,700	5,630.00	20,831,000	
三井松島ホールディングス	6,700	913.00	6,117,100	
国際石油開発帝石	590,100	698.00	411,889,800	
石油資源開発	21,000	2,344.00	49,224,000	
K & O エナジーグループ	7,700	1,444.00	11,118,800	
ダイセキ環境ソリューション	3,100	799.00	2,476,900	
第一カッター興業	4,000	1,383.00	5,532,000	
明豊ファシリティワークス	5,300	682.00	3,614,600	
安藤・間	102,900	795.00	81,805,500	
東急建設	47,000	568.00	26,696,000	
コムシスホールディングス	56,900	3,420.00	194,598,000	
ビーアールホールディングス	19,000	724.00	13,756,000	
高松コンストラクショングループ	10,100	2,136.00	21,573,600	

東建コーポレーション	4,900	8,860.00	43,414,000	
ソネック	1,700	818.00	1,390,600	
ヤマウラ	7,200	943.00	6,789,600	
大成建設	115,400	3,790.00	437,366,000	
大林組	370,800	945.00	350,406,000	
清水建設	347,300	799.00	277,492,700	
飛島建設	10,500	1,173.00	12,316,500	
長谷工コーポレーション	121,300	1,349.00	163,633,700	
松井建設	14,700	744.00	10,936,800	
銭高組	1,200	4,510.00	5,412,000	
鹿島建設	271,600	1,523.00	413,646,800	
不動テトラ	9,100	1,812.00	16,489,200	
大末建設	4,900	889.00	4,356,100	
鉄建建設	7,500	1,996.00	14,970,000	
西松建設	26,500	2,592.00	68,688,000	
三井住友建設	89,400	480.00	42,912,000	
大豊建設	8,100	3,820.00	30,942,000	
前田建設工業	92,900	967.00	89,834,300	
佐田建設	6,700	444.00	2,974,800	
ナカノフドー建設	9,700	402.00	3,899,400	
奥村組	20,400	2,776.00	56,630,400	
東鉄工業	16,000	2,789.00	44,624,000	
イチケン	2,700	1,988.00	5,367,600	
富士ビー・エス	5,000	620.00	3,100,000	
浅沼組	4,400	4,560.00	20,064,000	
戸田建設	154,100	793.00	122,201,300	
熊谷組	17,100	2,823.00	48,273,300	
北野建設	1,900	2,462.00	4,677,800	
植木組	1,600	2,879.00	4,606,400	
矢作建設工業	16,700	871.00	14,545,700	
ピーエス三菱	12,200	689.00	8,405,800	
日本ハウスホールディングス	25,600	355.00	9,088,000	
大東建託	40,500	12,000.00	486,000,000	
新日本建設	15,900	892.00	14,182,800	
N I P P O	30,800	2,836.00	87,348,800	
東亜道路工業	2,400	3,905.00	9,372,000	
前田道路	22,900	1,999.00	45,777,100	
日本道路	3,600	7,530.00	27,108,000	
東亜建設工業	9,900	2,051.00	20,304,900	
日本国土開発	36,300	572.00	20,763,600	
若築建設	6,700	1,304.00	8,736,800	
東洋建設	41,600	546.00	22,713,600	
五洋建設	157,500	890.00	140,175,000	
世紀東急工業	17,900	866.00	15,501,400	
福田組	4,300	5,230.00	22,489,000	
日本ドライケミカル	3,000	1,582.00	4,746,000	
住友林業	87,200	2,284.00	199,164,800	
日本基礎技術	11,700	497.00	5,814,900	
巴コーポレーション	16,800	406.00	6,820,800	
大和ハウス工業	342,400	3,217.00	1,101,500,800	

ライト工業	21,300	1,796.00	38,254,800
積水ハウス	402,200	2,114.50	850,451,900
日特建設	9,900	804.00	7,959,600
北陸電気工事	6,600	1,234.00	8,144,400
ユアテック	21,300	852.00	18,147,600
日本リーテック	7,700	2,467.00	18,995,900
四電工	1,700	2,850.00	4,845,000
中電工	17,100	2,279.00	38,970,900
関電工	60,400	923.00	55,749,200
きんでん	80,200	1,825.00	146,365,000
東京エネシス	12,300	957.00	11,771,100
トーエネック	3,800	3,930.00	14,934,000
住友電設	10,500	2,582.00	27,111,000
日本電設工業	20,400	2,040.00	41,616,000
協和エクシオ	56,200	2,908.00	163,429,600
新日本空調	9,800	2,235.00	21,903,000
日本工営	7,100	2,777.00	19,716,700
九電工	26,100	3,560.00	92,916,000
三機工業	26,300	1,307.00	34,374,100
日揮ホールディングス	123,600	1,346.00	166,365,600
中外炉工業	4,100	1,737.00	7,121,700
ヤマト	11,900	712.00	8,472,800
太平電業	8,200	2,596.00	21,287,200
高砂熱学工業	33,500	1,655.00	55,442,500
三晃金属工業	1,600	2,971.00	4,753,600
N E C ネットズエスアイ	38,300	1,995.00	76,408,500
朝日工業社	2,100	2,964.00	6,224,400
明星工業	24,100	822.00	19,810,200
大気社	18,000	2,997.00	53,946,000
ダイダグ	8,200	2,900.00	23,780,000
日比谷総合設備	12,200	1,896.00	23,131,200
ニッポン	35,000	1,641.00	57,435,000
日清製粉グループ本社	134,100	1,836.00	246,207,600
日東富士製粉	600	6,720.00	4,032,000
昭和産業	10,100	3,185.00	32,168,500
鳥越製粉	10,800	898.00	9,698,400
中部飼料	14,600	1,485.00	21,681,000
フィード・ワン	16,200	901.00	14,596,200
東洋精糖	1,700	1,228.00	2,087,600
日本甜菜製糖	6,400	1,699.00	10,873,600
三井製糖	9,500	1,979.00	18,800,500
塩水港精糖	14,400	228.00	3,283,200
日新製糖	4,500	1,897.00	8,536,500
L I F U L L	39,400	449.00	17,690,600
ミクシィ	21,600	2,517.00	54,367,200
ジェイエイシーリクルートメント	7,500	1,949.00	14,617,500
日本M&Aセンター	92,600	6,060.00	561,156,000
メンバーズ	3,300	2,593.00	8,556,900
中広	1,200	352.00	422,400
U T グループ	16,300	3,600.00	58,680,000

アイティメディア	3,700	2,242.00	8,295,400
タケエイ	12,500	1,313.00	16,412,500
E・Jホールディングス	4,400	1,005.00	4,422,000
ビーネックスグループ	14,100	1,246.00	17,568,600
コシダカホールディングス	26,800	503.00	13,480,400
アルトナー	2,800	898.00	2,514,400
パソナグループ	12,200	2,050.00	25,010,000
CDS	2,400	1,455.00	3,492,000
リンクアンドモチベーション	20,700	656.00	13,579,200
GCA	14,600	754.00	11,008,400
エス・エム・エス	38,400	3,785.00	145,344,000
サニーサイドアップグループ	4,000	680.00	2,720,000
パーソルホールディングス	113,000	2,185.00	246,905,000
リニカル	6,500	765.00	4,972,500
クックパッド	35,600	326.00	11,605,600
エスクリ	3,600	361.00	1,299,600
アイ・ケイ・ケイ	5,600	625.00	3,500,000
森永製菓	27,800	4,280.00	118,984,000
中村屋	2,500	3,970.00	9,925,000
江崎グリコ	32,700	4,785.00	156,469,500
名糖産業	5,600	1,505.00	8,428,000
井村屋グループ	6,800	2,647.00	17,999,600
不二家	7,600	2,380.00	18,088,000
山崎製パン	89,000	1,934.00	172,126,000
第一屋製パン	2,900	973.00	2,821,700
モロゾフ	1,700	5,710.00	9,707,000
亀田製菓	6,900	4,935.00	34,051,500
寿スピリッツ	11,400	6,660.00	75,924,000
カルビー	54,100	3,085.00	166,898,500
森永乳業	21,900	5,100.00	111,690,000
六甲バター	8,000	1,856.00	14,848,000
ヤクルト本社	81,600	5,370.00	438,192,000
明治ホールディングス	78,500	7,390.00	580,115,000
雪印メグミルク	28,600	2,383.00	68,153,800
プリマハム	16,800	3,325.00	55,860,000
日本ハム	45,400	4,680.00	212,472,000
林兼産業	3,600	611.00	2,199,600
丸大食品	11,800	1,770.00	20,886,000
S Foods	10,700	3,515.00	37,610,500
柿安本店	4,100	2,808.00	11,512,800
伊藤ハム米久ホールディングス	76,700	750.00	57,525,000
学情	3,900	1,421.00	5,541,900
スタジオアリス	5,700	2,129.00	12,135,300
クロスキャット	3,000	1,230.00	3,690,000
シミックホールディングス	5,600	1,623.00	9,088,800
エプコ	2,800	979.00	2,741,200
システナ	41,400	2,009.00	83,172,600
NJS	2,800	2,020.00	5,656,000
デジタルアーツ	6,800	10,300.00	70,040,000
日鉄ソリューションズ	17,300	3,520.00	60,896,000

総合警備保障	45,000	5,270.00	237,150,000
キューブシステム	6,200	1,178.00	7,303,600
いちご	129,600	324.00	41,990,400
エイジア	1,800	1,844.00	3,319,200
日本駐車場開発	115,500	145.00	16,747,500
コア	4,900	1,551.00	7,599,900
カカクコム	83,500	3,450.00	288,075,000
アイロムグループ	4,000	1,921.00	7,684,000
セントケア・ホールディング	8,300	1,020.00	8,466,000
サイネックス	2,200	735.00	1,617,000
ルネサンス	7,000	1,134.00	7,938,000
ディップ	17,600	2,986.00	52,553,600
SBSホールディングス	8,700	2,530.00	22,011,000
デジタルホールディングス	7,800	2,019.00	15,748,200
新日本科学	13,700	689.00	9,439,300
ツクイホールディングス	26,700	685.00	18,289,500
キャリアデザインセンター	2,500	965.00	2,412,500
ベネフィット・ワン	41,200	3,175.00	130,810,000
エムスリー	199,300	8,616.00	1,717,168,800
ツカダ・グローバルホールディング	9,500	312.00	2,964,000
プラス	1,500	488.00	732,000
アウトソーシング	64,700	1,492.00	96,532,400
ウェルネット	11,500	494.00	5,681,000
ワールドホールディングス	3,900	2,023.00	7,889,700
ディー・エヌ・エー	47,800	2,110.00	100,858,000
博報堂DYホールディングス	157,200	1,695.00	266,454,000
ぐるなび	19,600	609.00	11,936,400
タカミヤ	14,100	550.00	7,755,000
ジャパンベストレスキューシステム	8,900	1,008.00	8,971,200
ファンコミュニケーションズ	31,300	420.00	13,146,000
ライク	3,000	2,034.00	6,102,000
ビジネス・ブレークスルー	5,100	438.00	2,233,800
エスプール	28,900	997.00	28,813,300
WDBホールディングス	5,200	2,759.00	14,346,800
手間いらず	1,100	5,320.00	5,852,000
ティア	7,200	445.00	3,204,000
CDG	1,300	1,538.00	1,999,400
アドウェイズ	13,700	716.00	9,809,200
バリューコマース	7,500	3,090.00	23,175,000
インフォマート	114,300	961.00	109,842,300
サッポロホールディングス	40,500	2,185.00	88,492,500
アサヒグループホールディングス	259,300	4,439.00	1,151,032,700
キリンホールディングス	503,300	2,262.50	1,138,716,250
宝ホールディングス	87,900	1,415.00	124,378,500
オエノンホールディングス	34,200	406.00	13,885,200
養命酒製造	4,000	1,953.00	7,812,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	90,800	1,762.00	159,989,600
サントリー食品インターナショナル	79,500	3,805.00	302,497,500
ダイドーグループホールディングス	6,700	5,400.00	36,180,000

伊藤園	36,100	6,700.00	241,870,000
キーコーヒー	11,800	2,181.00	25,735,800
ユニカフェ	3,900	1,017.00	3,966,300
ジャパンフーズ	1,500	1,244.00	1,866,000
日清オイリオグループ	15,300	3,145.00	48,118,500
不二製油グループ本社	29,000	3,290.00	95,410,000
かどや製油	1,000	4,060.00	4,060,000
J-オイルミルズ	5,600	3,810.00	21,336,000
ローソン	29,500	5,380.00	158,710,000
サンエー	8,800	4,285.00	37,708,000
カワチ薬品	8,100	3,040.00	24,624,000
エービーシー・マート	18,100	6,470.00	117,107,000
ハードオフコーポレーション	5,400	790.00	4,266,000
高千穂交易	4,700	1,219.00	5,729,300
アスクル	10,100	3,875.00	39,137,500
ゲオホールディングス	15,600	1,274.00	19,874,400
アダストリア	16,100	2,125.00	34,212,500
ジーフット	7,600	430.00	3,268,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	420.00	840,000
オルパヘルスケアホールディングス	1,600	1,590.00	2,544,000
伊藤忠食品	2,400	5,320.00	12,768,000
くら寿司	6,900	6,770.00	46,713,000
キャンドウ	5,600	1,902.00	10,651,200
エレマテック	9,400	1,066.00	10,020,400
アイケイ	2,500	899.00	2,247,500
パルグループホールディングス	10,200	1,660.00	16,932,000
JALUX	3,300	1,588.00	5,240,400
エディオン	49,300	1,084.00	53,441,200
あらた	9,300	4,900.00	45,570,000
サーラコーポレーション	23,900	586.00	14,005,400
ワッツ	5,200	897.00	4,664,400
トーメンデバイス	1,600	4,000.00	6,400,000
ハローズ	4,400	3,150.00	13,860,000
J Pホールディングス	32,600	297.00	9,682,200
フジオフードグループ本社	9,800	1,309.00	12,828,200
あみやき亭	2,500	2,951.00	7,377,500
東京エレクトロン デバイス	3,800	3,635.00	13,813,000
ひらまつ	21,900	174.00	3,810,600
フィールズ	10,200	567.00	5,783,400
双日	641,600	263.00	168,740,800
アルフレッサ ホールディングス	120,700	2,216.00	267,471,200
大黒天物産	2,700	6,000.00	16,200,000
ハニーズホールディングス	9,100	1,015.00	9,236,500
ファーマライズホールディングス	3,300	781.00	2,577,300
キッコーマン	85,400	7,360.00	628,544,000
味の素	282,300	2,296.50	648,301,950
キュービー	66,000	2,432.00	160,512,000
ハウス食品グループ本社	44,400	3,960.00	175,824,000
カゴメ	48,500	3,495.00	169,507,500
焼津水産化学工業	4,800	1,029.00	4,939,200

アリアケジャパン	10,900	7,170.00	78,153,000
ピエトロ	1,200	1,758.00	2,109,600
エバラ食品工業	2,400	2,785.00	6,684,000
やまみ	1,100	2,120.00	2,332,000
ニチレイ	56,500	2,957.00	167,070,500
横浜冷凍	30,800	903.00	27,812,400
東洋水産	61,000	4,780.00	291,580,000
イートアンドホールディングス	4,200	1,902.00	7,988,400
大冷	1,500	1,946.00	2,919,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,700	912.00	6,110,400
日清食品ホールディングス	46,500	8,620.00	400,830,000
永谷園ホールディングス	6,000	2,403.00	14,418,000
一正蒲鉾	4,000	1,218.00	4,872,000
フジッコ	13,000	2,062.00	26,806,000
ロック・フィールド	12,800	1,607.00	20,569,600
日本たばこ産業	636,500	2,151.00	1,369,111,500
ケンコーマヨネーズ	7,300	1,950.00	14,235,000
わらべや日洋ホールディングス	7,800	1,717.00	13,392,600
なとり	6,900	2,010.00	13,869,000
イフジ産業	2,300	905.00	2,081,500
ピクルスコーポレーション	2,800	3,570.00	9,996,000
北の達人コーポレーション	41,400	627.00	25,957,800
ユーグレナ	51,200	920.00	47,104,000
スター・マイカ・ホールディングス	6,100	1,167.00	7,118,700
S R Eホールディングス	1,300	4,750.00	6,175,000
A Dワークスグループ	22,500	158.00	3,555,000
片倉工業	15,600	1,392.00	21,715,200
グンゼ	8,500	3,870.00	32,895,000
ヒューリック	247,200	1,227.00	303,314,400
神栄	1,600	1,661.00	2,657,600
ラサ商事	6,500	931.00	6,051,500
アルペン	8,900	2,259.00	20,105,100
ハブ	3,600	705.00	2,538,000
ラクーンホールディングス	8,200	1,992.00	16,334,400
クオールホールディングス	15,700	1,402.00	22,011,400
アルコニックス	12,300	1,687.00	20,750,100
神戸物産	80,400	3,035.00	244,014,000
ソリトンシステムズ	5,800	1,766.00	10,242,800
ジンズホールディングス	6,200	7,290.00	45,198,000
ビックカメラ	69,000	1,226.00	84,594,000
D C Mホールディングス	71,900	1,086.00	78,083,400
ペッパーフードサービス	13,200	282.00	3,722,400
ハイパー	2,000	544.00	1,088,000
M o n o t a R O	82,800	5,740.00	475,272,000
東京一番フーズ	2,600	590.00	1,534,000
D Dホールディングス	5,200	684.00	3,556,800
あいホールディングス	16,700	2,096.00	35,003,200
ディービーエクス	4,000	1,067.00	4,268,000
きちりホールディングス	3,400	612.00	2,080,800

アーランドサービスホールディングス	9,700	2,192.00	21,262,400	
J.フロントリテイリング	139,000	1,001.00	139,139,000	
ドトール・日レスホールディングス	18,400	1,678.00	30,875,200	
マツモトキヨシホールディングス	48,100	4,620.00	222,222,000	
ブロンコビリー	6,100	2,318.00	14,139,800	
ZOZO	68,700	3,595.00	246,976,500	
トレジャー・ファクトリー	3,400	812.00	2,760,800	
物語コーポレーション	3,100	12,110.00	37,541,000	
ココカラファイン	10,400	7,650.00	79,560,000	
三越伊勢丹ホールディングス	203,400	740.00	150,516,000	
東洋紡	45,800	1,391.00	63,707,800	
ユニチカ	33,800	454.00	15,345,200	
富士紡ホールディングス	5,600	4,455.00	24,948,000	
日清紡ホールディングス	72,000	871.00	62,712,000	
倉敷紡績	10,700	1,945.00	20,811,500	
ダイワボウホールディングス	10,600	8,520.00	90,312,000	
シキボウ	6,600	1,044.00	6,890,400	
日東紡績	17,500	4,985.00	87,237,500	
トヨタ紡織	34,500	1,873.00	64,618,500	
マクニカ・富士エレホールディングス	27,700	2,235.00	61,909,500	
Hamee	2,900	1,766.00	5,121,400	
ラクト・ジャパン	5,100	2,722.00	13,882,200	
ウエルシアホールディングス	61,500	3,620.00	222,630,000	
クリエイトSDホールディングス	17,100	3,525.00	60,277,500	
グリムス	2,500	1,745.00	4,362,500	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,600	834.00	17,180,400	
八洲電機	9,200	969.00	8,914,800	
メディアスホールディングス	6,800	888.00	6,038,400	
レスターホールディングス	12,200	2,151.00	26,242,200	
ジューテックホールディングス	2,300	1,065.00	2,449,500	
丸善CHIホールディングス	15,400	376.00	5,790,400	
大光	4,900	669.00	3,278,100	
OCHIホールディングス	3,500	1,365.00	4,777,500	
TOKAIホールディングス	56,600	1,005.00	56,883,000	
黒谷	3,300	719.00	2,372,700	
ミサワ	2,400	670.00	1,608,000	
ティーライフ	1,700	1,209.00	2,055,300	
Cominix	1,700	776.00	1,319,200	
エー・ピーホールディングス	1,900	424.00	805,600	
三洋貿易	11,600	1,119.00	12,980,400	
チムニー	3,500	1,411.00	4,938,500	
シュッピン	7,900	949.00	7,497,100	
ビューティガレージ	1,900	2,503.00	4,755,700	
オイシックス・ラ・大地	11,500	3,105.00	35,707,500	
ウイン・パートナーズ	8,500	1,175.00	9,987,500	
ネクステージ	19,900	1,707.00	33,969,300	
ジョイフル本田	34,200	1,444.00	49,384,800	
鳥貴族ホールディングス	3,300	1,627.00	5,369,100	

ホットランド	8,600	1,248.00	10,732,800
すかいらくホールディングス	130,400	1,717.00	223,896,800
SFPホールディングス	5,700	1,503.00	8,567,100
綿半ホールディングス	8,800	1,352.00	11,897,600
日本毛織	38,100	1,000.00	38,100,000
ダイトウボウ	19,300	112.00	2,161,600
トーア紡コーポレーション	4,100	470.00	1,927,000
ダイドーリミテッド	16,600	191.00	3,170,600
ヨシックス	2,300	2,195.00	5,048,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	33,900	1,156.00	39,188,400
三栄建築設計	4,700	1,807.00	8,492,900
野村不動産ホールディングス	70,700	2,420.00	171,094,000
三重交通グループホールディングス	23,700	505.00	11,968,500
サムティ	16,500	1,732.00	28,578,000
ディア・ライフ	16,400	452.00	7,412,800
コーセーアールイー	3,500	614.00	2,149,000
日本商業開発	7,300	1,730.00	12,629,000
プレサンスコーポレーション	19,100	1,500.00	28,650,000
フィル・カンパニー	2,100	1,984.00	4,166,400
THEグローバル社	7,300	276.00	2,014,800
ハウスコム	1,200	1,324.00	1,588,800
日本管理センター	6,200	1,223.00	7,582,600
サンセイランディック	3,500	748.00	2,618,000
エストラスト	1,300	715.00	929,500
フージャースホールディングス	19,000	690.00	13,110,000
オープンハウス	36,700	4,470.00	164,049,000
東急不動産ホールディングス	316,700	653.00	206,805,100
飯田グループホールディングス	97,200	2,493.00	242,319,600
イーグランド	2,300	838.00	1,927,400
ムゲンエステート	7,300	490.00	3,577,000
帝国繊維	13,000	2,339.00	30,407,000
日本コークス工業	100,500	100.00	10,050,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,000	986.00	5,916,000
ミタチ産業	3,000	595.00	1,785,000
B E E N O S	5,400	2,369.00	12,792,600
あさひ	8,600	1,625.00	13,975,000
日本調剤	7,100	1,660.00	11,786,000
コスモス薬品	11,800	16,720.00	197,296,000
シップヘルスケアホールディングス	20,600	6,340.00	130,604,000
トーエル	5,700	838.00	4,776,600
ソフトクリエイトホールディングス	4,500	2,694.00	12,123,000
オンリー	2,600	465.00	1,209,000
セブン&アイ・ホールディングス	455,600	4,248.00	1,935,388,800
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	62,500	887.00	55,437,500
明治電機工業	3,100	1,450.00	4,495,000
ツルハホールディングス	25,400	14,650.00	372,110,000
デリカフーズホールディングス	5,200	640.00	3,328,000
スターティアホールディングス	2,300	1,067.00	2,454,100

サンマルクホールディングス	9,100	1,615.00	14,696,500
フェリシモ	2,600	1,330.00	3,458,000
トリドールホールディングス	28,800	1,632.00	47,001,600
帝人	109,000	1,939.00	211,351,000
東レ	838,400	737.90	618,655,360
クラレ	182,300	1,212.00	220,947,600
旭化成	767,500	1,242.50	953,618,750
サカイオーベックス	3,100	2,183.00	6,767,300
TOKYO BASE	10,400	664.00	6,905,600
稲葉製作所	6,700	1,433.00	9,601,100
宮地エンジニアリンググループ	3,800	2,305.00	8,759,000
トーカロ	30,200	1,424.00	43,004,800
アルファ	4,500	1,058.00	4,761,000
SUMCO	149,600	2,264.00	338,694,400
川田テクノロジーズ	2,400	4,540.00	10,896,000
RS Technologies	3,800	6,440.00	24,472,000
ジェイテックコーポレーション	1,000	3,855.00	3,855,000
信和	6,400	717.00	4,588,800
ビーロット	5,400	654.00	3,531,600
ファーストブラザーズ	2,200	1,003.00	2,206,600
ハウズドゥ	5,600	1,241.00	6,949,600
シーアールイー	3,000	1,259.00	3,777,000
プロパティエージェント	1,900	1,370.00	2,603,000
ケイアイスター不動産	3,600	2,650.00	9,540,000
アグレ都市デザイン	2,100	783.00	1,644,300
グッドコムアセット	5,500	1,326.00	7,293,000
ジェイ・エス・ビー	2,200	3,555.00	7,821,000
テンポイノベーション	3,300	943.00	3,111,900
グローバル・リンク・マネジメント	2,000	750.00	1,500,000
住江織物	2,100	2,063.00	4,332,300
日本フェルト	5,500	451.00	2,480,500
イチカワ	1,300	1,295.00	1,683,500
エコナックホールディングス	20,700	95.00	1,966,500
日東製網	1,300	1,516.00	1,970,800
芦森工業	2,400	1,025.00	2,460,000
アツギ	9,300	513.00	4,770,900
ウイルプラスホールディングス	1,900	829.00	1,575,100
JMホールディングス	8,800	2,119.00	18,647,200
コメダホールディングス	25,400	1,982.00	50,342,800
サツドラホールディングス	1,500	2,065.00	3,097,500
アレンザホールディングス	6,700	1,394.00	9,339,800
串カツ田中ホールディングス	3,000	1,724.00	5,172,000
バロックジャパンリミテッド	8,100	818.00	6,625,800
クスリのアオキホールディングス	11,600	8,840.00	102,544,000
ダイニック	3,600	792.00	2,851,200
共和レザー	6,800	686.00	4,664,800
ピーバンドットコム	1,500	951.00	1,426,500
力の源ホールディングス	5,400	652.00	3,520,800
スシローグローバルホールディングス	63,900	4,220.00	269,658,000
アセンテック	2,900	1,868.00	5,417,200

セーレン	28,500	1,825.00	52,012,500
ソトー	4,000	818.00	3,272,000
東海染工	1,300	1,122.00	1,458,600
小松マテーレ	19,100	1,052.00	20,093,200
ワコールホールディングス	28,900	2,377.00	68,695,300
ホギメディカル	15,600	3,265.00	50,934,000
クラウドシアホールディングス	2,400	288.00	691,200
T S Iホールディングス	34,700	289.00	10,028,300
マツオカコーポレーション	3,700	2,105.00	7,788,500
ワールド	15,100	1,443.00	21,789,300
T I S	116,000	2,442.00	283,272,000
J N Sホールディングス	5,500	573.00	3,151,500
電算システム	4,300	3,030.00	13,029,000
グリー	71,100	615.00	43,726,500
G M Oベパボ	800	5,780.00	4,624,000
コーエーテックモホールディングス	23,700	6,290.00	149,073,000
三菱総合研究所	5,000	4,195.00	20,975,000
ボルテージ	2,800	540.00	1,512,000
電算	1,000	2,539.00	2,539,000
A G S	6,100	837.00	5,105,700
ファインデックス	9,700	1,120.00	10,864,000
ブレインパッド	2,900	4,275.00	12,397,500
K L a b	21,200	989.00	20,966,800
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	15,400	1,207.00	18,587,800
イーブクイニシアティブジャパン	1,900	2,488.00	4,727,200
ネクソン	293,100	3,470.00	1,017,057,000
アイスタイル	35,300	473.00	16,696,900
エムアップホールディングス	3,000	2,422.00	7,266,000
エイチーム	8,000	1,224.00	9,792,000
エニグモ	10,900	1,297.00	14,137,300
テクノスジャパン	8,900	715.00	6,363,500
e n i s h	5,900	505.00	2,979,500
コロブラ	38,000	947.00	35,986,000
オルトプラス	6,800	433.00	2,944,400
ブロードリーフ	57,400	652.00	37,424,800
クロス・マーケティンググループ	5,400	397.00	2,143,800
デジタルハーツホールディングス	5,300	1,319.00	6,990,700
システム情報	8,500	1,186.00	10,081,000
メディアドゥ	4,400	6,190.00	27,236,000
じげん	28,200	423.00	11,928,600
ブイキューブ	6,300	3,055.00	19,246,500
エンカレッジ・テクノロジー	2,200	669.00	1,471,800
サイバーリンクス	3,800	2,160.00	8,208,000
ディー・エル・イー	9,200	326.00	2,999,200
フィックスターズ	12,200	1,010.00	12,322,000
C A R T A H O L D I N G S	4,700	1,337.00	6,283,900
オブティム	8,100	3,255.00	26,365,500
セレス	3,800	2,700.00	10,260,000
S H I F T	5,200	12,940.00	67,288,000

特種東海製紙	7,200	4,785.00	34,452,000
ティーガイア	12,300	1,921.00	23,628,300
セック	1,700	2,845.00	4,836,500
日本アジアグループ	11,200	1,288.00	14,425,600
テクマトリックス	17,900	1,939.00	34,708,100
プロシップ	3,400	1,426.00	4,848,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	27,900	2,623.00	73,181,700
GMOペイメントゲートウェイ	24,600	15,390.00	378,594,000
ザッパラス	4,600	455.00	2,093,000
システムリサーチ	3,400	1,837.00	6,245,800
インターネットイニシアティブ	30,900	2,267.00	70,050,300
さくらインターネット	12,200	696.00	8,491,200
ヴィンクス	3,200	1,201.00	3,843,200
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,500	9,980.00	24,950,000
SRAホールディングス	6,200	2,581.00	16,002,200
システムインテグレータ	3,200	633.00	2,025,600
朝日ネット	9,400	879.00	8,262,600
eBASE	13,800	1,027.00	14,172,600
アバント	12,400	1,541.00	19,108,400
アドソル日進	4,100	2,915.00	11,951,500
ODKソリューションズ	2,000	775.00	1,550,000
フリービット	6,900	972.00	6,706,800
コムチュア	10,700	3,095.00	33,116,500
サイバーコム	2,100	1,740.00	3,654,000
アステリア	8,300	1,050.00	8,715,000
アイル	6,500	1,581.00	10,276,500
王子ホールディングス	521,300	666.00	347,185,800
日本製紙	51,100	1,472.00	75,219,200
三菱製紙	17,100	348.00	5,950,800
北越コーポレーション	82,900	468.00	38,797,200
中越パルプ工業	4,700	1,214.00	5,705,800
巴川製紙所	3,700	824.00	3,048,800
大王製紙	56,000	1,856.00	103,936,000
阿波製紙	3,000	469.00	1,407,000
マークライنز	4,800	2,518.00	12,086,400
メディカル・データ・ビジョン	13,200	2,572.00	33,950,400
gumi	16,000	917.00	14,672,000
ショーケース	2,400	1,004.00	2,409,600
モバイルファクトリー	2,400	1,117.00	2,680,800
テラスカイ	3,700	3,825.00	14,152,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,100	1,612.00	8,221,200
PCIホールディングス	4,400	1,390.00	6,116,000
パイブドHD	2,400	1,582.00	3,796,800
アイビーシー	1,900	1,106.00	2,101,400
ネオジャパン	2,200	1,842.00	4,052,400
PR TIMES	2,400	3,735.00	8,964,000
ランドコンピュータ	1,500	1,138.00	1,707,000

ダブルスタンダード	1,500	4,410.00	6,615,000
オープンドア	6,900	2,069.00	14,276,100
マイネット	3,800	944.00	3,587,200
アカツキ	4,600	4,340.00	19,964,000
ベネフィットジャパン	900	1,941.00	1,746,900
Ubicomホールディングス	3,000	3,240.00	9,720,000
カナミックネットワーク	10,600	727.00	7,706,200
ノムラシステムコーポレーション	5,100	374.00	1,907,400
レンゴー	119,400	923.00	110,206,200
トーモク	7,200	1,915.00	13,788,000
ザ・パック	8,700	2,679.00	23,307,300
チェンジ	16,200	3,635.00	58,887,000
シンクロ・フード	6,900	372.00	2,566,800
オークネット	6,100	1,315.00	8,021,500
キャピタル・アセット・プランニング	1,500	994.00	1,491,000
セグエグループ	2,900	1,302.00	3,775,800
エイトレッド	2,200	2,599.00	5,717,800
AOI TYO HOLDINGS	12,000	465.00	5,580,000
マクロミル	23,600	866.00	20,437,600
ピーグリー	2,300	1,763.00	4,054,900
オロ	3,600	3,850.00	13,860,000
ユーザーローカル	1,800	4,200.00	7,560,000
テモナ	2,500	1,011.00	2,527,500
ニーズウェル	2,200	689.00	1,515,800
サインポスト	2,600	1,012.00	2,631,200
昭和電工	87,900	2,652.00	233,110,800
住友化学	911,200	513.00	467,445,600
住友精化	5,700	4,170.00	23,769,000
日産化学	63,900	5,990.00	382,761,000
ラサ工業	3,800	2,407.00	9,146,600
クレハ	9,900	7,130.00	70,587,000
多木化学	4,500	6,210.00	27,945,000
テイカ	8,400	1,523.00	12,793,200
石原産業	20,600	827.00	17,036,200
片倉コープアグリ	2,400	1,264.00	3,033,600
日本曹達	16,200	3,350.00	54,270,000
東ソー	178,900	1,869.00	334,364,100
トクヤマ	34,300	2,671.00	91,615,300
セントラル硝子	22,000	2,229.00	49,038,000
東亜合成	70,700	1,192.00	84,274,400
大阪ソーダ	11,900	2,749.00	32,713,100
関東電化工業	27,300	871.00	23,778,300
デンカ	42,200	4,165.00	175,763,000
イビデン	56,800	4,875.00	276,900,000
信越化学工業	214,100	18,075.00	3,869,857,500
日本カーバイド工業	4,200	1,360.00	5,712,000
堺化学工業	8,100	2,135.00	17,293,500
第一稀元素化学工業	11,700	991.00	11,594,700
エア・ウォーター	118,100	1,768.00	208,800,800
日本酸素ホールディングス	95,300	2,061.00	196,413,300

日本化学工業	3,200	3,035.00	9,712,000
東邦アセチレン	1,900	1,452.00	2,758,800
日本パーカライジング	58,400	1,110.00	64,824,000
高压ガス工業	18,500	752.00	13,912,000
チタン工業	1,500	2,369.00	3,553,500
四国化成工業	15,500	1,246.00	19,313,000
戸田工業	2,400	2,228.00	5,347,200
ステラ ケミファ	6,300	3,575.00	22,522,500
保土谷化学工業	3,400	5,070.00	17,238,000
日本触媒	21,000	6,000.00	126,000,000
大日精化工業	9,600	2,374.00	22,790,400
カネカ	30,000	3,995.00	119,850,000
協和キリン	119,000	3,185.00	379,015,000
三菱瓦斯化学	116,000	2,517.00	291,972,000
三井化学	100,000	3,355.00	335,500,000
J S R	116,200	3,120.00	362,544,000
東京応化工業	19,900	7,180.00	142,882,000
大阪有機化学工業	10,700	3,660.00	39,162,000
三菱ケミカルホールディングス	774,100	746.60	577,943,060
K Hネオケム	19,100	2,533.00	48,380,300
ダイセル	155,500	838.00	130,309,000
住友ベークライト	18,200	4,070.00	74,074,000
積水化学工業	244,900	2,051.00	502,289,900
日本ゼオン	104,500	1,650.00	172,425,000
アイカ工業	32,200	3,800.00	122,360,000
宇部興産	58,400	2,107.00	123,048,800
積水樹脂	19,100	2,168.00	41,408,800
タキロンシーアイ	25,200	698.00	17,589,600
旭有機材	6,600	1,599.00	10,553,400
ニチバン	6,200	1,825.00	11,315,000
リケンテクノス	28,200	501.00	14,128,200
大倉工業	5,500	1,986.00	10,923,000
積水化成品工業	15,600	572.00	8,923,200
群栄化学工業	2,200	2,512.00	5,526,400
タイガースポリマー	6,700	435.00	2,914,500
ミライアル	3,700	1,195.00	4,421,500
ダイキアクシス	4,300	1,068.00	4,592,400
ダイキョーニシカワ	24,500	899.00	22,025,500
竹本容器	4,200	879.00	3,691,800
森六ホールディングス	6,300	2,178.00	13,721,400
恵和	1,700	2,074.00	3,525,800
日本化薬	71,600	1,051.00	75,251,600
カーリットホールディングス	11,500	755.00	8,682,500
E P Sホールディングス	15,300	1,305.00	19,966,500
ソルクシーズ	4,400	997.00	4,386,800
レグス	2,700	1,810.00	4,887,000
プレステージ・インターナショナル	42,200	841.00	35,490,200
フェイス	3,600	834.00	3,002,400
プロトコーポレーション	10,400	1,233.00	12,823,200
ハイマックス	2,900	1,502.00	4,355,800

アミューズ	6,200	2,749.00	17,043,800	
野村総合研究所	211,800	3,550.00	751,890,000	
ドリームインキュベータ	3,500	1,226.00	4,291,000	
サイバネットシステム	8,200	985.00	8,077,000	
クイック	7,000	1,234.00	8,638,000	
T A C	6,300	270.00	1,701,000	
C Eホールディングス	6,200	620.00	3,844,000	
ケネディクス	32,300	747.00	24,128,100	
日本システム技術	2,100	1,573.00	3,303,300	
電通グループ	127,000	3,725.00	473,075,000	
インテージホールディングス	14,400	1,203.00	17,323,200	
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,200	667.00	3,468,400	
東邦システムサイエンス	3,000	939.00	2,817,000	
ぴあ	3,200	3,140.00	10,048,000	
イオンファンタジー	4,300	2,461.00	10,582,300	
ソースネクスト	54,700	315.00	17,230,500	
シーティーエス	12,600	954.00	12,020,400	
ネクシィーズグループ	3,500	962.00	3,367,000	
インフォコム	10,600	3,065.00	32,489,000	
メディカルシステムネットワーク	10,200	755.00	7,701,000	
日本精化	8,400	1,426.00	11,978,400	
扶桑化学工業	9,100	3,625.00	32,987,500	
トリケミカル研究所	9,800	4,140.00	40,572,000	
HEROZ	3,200	3,090.00	9,888,000	
ラクスル	9,400	4,095.00	38,493,000	
I P S	2,100	2,663.00	5,592,300	
F I G	12,600	268.00	3,376,800	
システムサポート	3,400	1,534.00	5,215,600	
A D E K A	53,300	1,868.00	99,564,400	
日油	43,600	5,690.00	248,084,000	
ミヨシ油脂	4,400	1,205.00	5,302,000	
新日本理化	19,000	266.00	5,054,000	
ハリマ化成グループ	8,700	966.00	8,404,200	
イーソル	6,200	1,341.00	8,314,200	
アルテリア・ネットワークス	12,800	1,643.00	21,030,400	
E D U L A B	1,100	7,310.00	8,041,000	
東海ソフト	1,400	1,192.00	1,668,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,000	2,124.00	4,248,000	
東名	600	1,118.00	670,800	
ヴィッツ	400	2,137.00	854,800	
トピラシステムズ	1,100	1,436.00	1,579,600	
L i n k - U	700	1,380.00	966,000	
ギフトィ	5,200	3,420.00	17,784,000	
花王	283,100	7,517.00	2,128,062,700	
第一工業製薬	3,900	3,850.00	15,015,000	
石原ケミカル	3,000	2,080.00	6,240,000	
日華化学	4,300	897.00	3,857,100	
ニイタカ	2,400	2,848.00	6,835,200	
三洋化成工業	6,900	5,390.00	37,191,000	

ベース	1,000	5,420.00	5,420,000	
武田薬品工業	983,700	3,644.00	3,584,602,800	
アステラス製薬	1,025,100	1,836.00	1,882,083,600	
大日本住友製薬	87,600	1,878.00	164,512,800	
塩野義製薬	148,700	5,941.00	883,426,700	
わかもと製薬	14,300	247.00	3,532,100	
あすか製薬	13,400	1,516.00	20,314,400	
日本新薬	33,500	8,050.00	269,675,000	
ピオフェルミン製薬	2,200	2,572.00	5,658,400	
中外製薬	369,800	5,361.00	1,982,497,800	
科研製薬	20,200	4,130.00	83,426,000	
エーザイ	130,600	7,813.00	1,020,377,800	
理研ビタミン	11,200	1,410.00	15,792,000	
ロート製薬	56,300	3,230.00	181,849,000	
小野薬品工業	271,500	3,156.00	856,854,000	
久光製薬	34,400	6,570.00	226,008,000	
有機合成薬品工業	9,200	306.00	2,815,200	
持田製薬	16,400	4,265.00	69,946,000	
参天製薬	205,700	1,718.00	353,392,600	
扶桑薬品工業	3,800	2,789.00	10,598,200	
日本ケミファ	1,200	2,253.00	2,703,600	
ツムラ	39,500	3,515.00	138,842,500	
日医工	33,400	1,077.00	35,971,800	
テルモ	362,500	4,560.00	1,653,000,000	
H.U.グループホールディングス	31,700	3,110.00	98,587,000	
キッセイ薬品工業	20,900	2,351.00	49,135,900	
生化学工業	20,900	1,117.00	23,345,300	
栄研化学	20,800	2,340.00	48,672,000	
日水製薬	4,600	1,021.00	4,696,600	
鳥居薬品	7,400	3,175.00	23,495,000	
JCRファーマ	33,300	3,175.00	105,727,500	
東和薬品	17,100	2,125.00	36,337,500	
富士製薬工業	8,100	1,366.00	11,064,600	
沢井製薬	25,900	4,925.00	127,557,500	
ゼリア新薬工業	21,500	2,165.00	46,547,500	
第一三共	1,015,000	3,225.00	3,273,375,000	
キョーリン製薬ホールディングス	26,100	1,955.00	51,025,500	
大幸薬品	14,500	1,602.00	23,229,000	
ダイト	7,500	3,805.00	28,537,500	
大塚ホールディングス	245,800	4,743.00	1,165,829,400	
大正製薬ホールディングス	28,100	7,140.00	200,634,000	
ペプチドリーム	60,100	6,510.00	391,251,000	
大日本塗料	13,200	985.00	13,002,000	
日本ペイントホールディングス	95,500	9,700.00	926,350,000	
関西ペイント	130,100	3,110.00	404,611,000	
神東塗料	9,300	210.00	1,953,000	
中国塗料	27,900	928.00	25,891,200	
日本特殊塗料	8,700	1,144.00	9,952,800	
藤倉化成	16,000	516.00	8,256,000	
太陽ホールディングス	8,500	6,130.00	52,105,000	

D I C	48,900	2,758.00	134,866,200
サカタインクス	25,300	1,127.00	28,513,100
東洋インキS Cホールディングス	24,500	1,931.00	47,309,500
T & K T O K A	9,400	830.00	7,802,000
アルプス技研	10,000	2,160.00	21,600,000
サニックス	17,700	339.00	6,000,300
ダイオーズ	2,200	975.00	2,145,000
日本空調サービス	12,200	732.00	8,930,400
オリエンタルランド	120,100	17,830.00	2,141,383,000
フォーカスシステムズ	7,700	980.00	7,546,000
ダスキン	26,200	2,881.00	75,482,200
パーク24	62,500	2,287.00	142,937,500
明光ネットワークジャパン	14,200	602.00	8,548,400
ファルコホールディングス	5,400	1,808.00	9,763,200
クレスコ	7,900	1,417.00	11,194,300
フジ・メディア・ホールディングス	120,100	1,327.00	159,372,700
秀英予備校	2,800	438.00	1,226,400
田谷	1,700	573.00	974,100
ラウンドワン	38,500	1,008.00	38,808,000
リゾートトラスト	51,700	1,703.00	88,045,100
オービック	36,600	19,640.00	718,824,000
ジャストシステム	16,500	7,820.00	129,030,000
T D C ソフト	10,200	971.00	9,904,200
Zホールディングス	1,593,800	667.00	1,063,064,600
ビー・エム・エル	14,600	3,525.00	51,465,000
ワタベウェディング	1,700	331.00	562,700
トレンドマイクロ	61,900	6,010.00	372,019,000
りらいあコミュニケーションズ	17,100	1,433.00	24,504,300
I Dホールディングス	4,500	1,273.00	5,728,500
リソー教育	57,300	352.00	20,169,600
日本オラクル	23,500	12,810.00	301,035,000
早稲田アカデミー	4,400	979.00	4,307,600
アルファシステムズ	3,100	3,860.00	11,966,000
フューチャー	14,000	1,954.00	27,356,000
C A C H o l d i n g s	7,500	1,430.00	10,725,000
S Bテクノロジー	4,200	3,095.00	12,999,000
トーセ	3,300	804.00	2,653,200
ユー・エス・エス	126,400	2,175.00	274,920,000
オービックビジネスコンサルタント	11,900	6,800.00	80,920,000
伊藤忠テクノソリューションズ	52,900	3,700.00	195,730,000
アイティフォー	15,100	910.00	13,741,000
東京個別指導学院	9,900	674.00	6,672,600
東計電算	1,800	4,190.00	7,542,000
サイバーエージェント	69,600	6,710.00	467,016,000
楽天	526,600	1,109.00	583,999,400
エクスネット	2,200	1,003.00	2,206,600
クリーク・アンド・リバー社	5,800	1,225.00	7,105,000
モーニングスター	12,400	484.00	6,001,600
テー・オー・ダブリュー	19,800	295.00	5,841,000
大塚商会	62,800	5,280.00	331,584,000

サイボウズ	13,500	2,795.00	37,732,500
山田コンサルティンググループ	6,600	1,052.00	6,943,200
セントラルスポーツ	4,200	2,439.00	10,243,800
パラカ	3,100	1,651.00	5,118,100
電通国際情報サービス	14,400	4,030.00	58,032,000
A C C E S S	10,800	780.00	8,424,000
デジタルガレージ	19,100	4,040.00	77,164,000
イーエムシステムズ	19,200	954.00	18,316,800
ウェザーニューズ	3,400	5,180.00	17,612,000
C I J	7,900	905.00	7,149,500
ビジネスエンジニアリング	1,200	3,400.00	4,080,000
日本エンタープライズ	11,600	247.00	2,865,200
WOWOW	5,700	2,878.00	16,404,600
スカラ	10,300	830.00	8,549,000
インテリジェント ウェイブ	6,900	721.00	4,974,900
フルキャストホールディングス	9,800	1,862.00	18,247,600
エン・ジャパン	20,100	3,395.00	68,239,500
富士フイルムホールディングス	207,800	6,169.00	1,281,918,200
コニカミノルタ	239,400	549.00	131,430,600
資生堂	235,000	7,788.00	1,830,180,000
ライオン	153,700	2,368.00	363,961,600
高砂香料工業	7,400	2,613.00	19,336,200
マンダム	24,700	1,744.00	43,076,800
ミルボン	15,800	7,040.00	111,232,000
ファンケル	43,000	3,920.00	168,560,000
コーセー	22,200	17,370.00	385,614,000
コタ	7,000	1,529.00	10,703,000
シーボン	1,300	1,986.00	2,581,800
ポーラ・オルビスホールディングス	50,500	2,170.00	109,585,000
ノエビアホールディングス	10,000	5,050.00	50,500,000
アジュバンコスメジャパン	3,000	1,089.00	3,267,000
新日本製薬	2,400	2,711.00	6,506,400
エステー	7,700	2,080.00	16,016,000
アグロ カネショウ	4,500	1,547.00	6,961,500
コニシ	19,500	1,657.00	32,311,500
長谷川香料	20,500	2,098.00	43,009,000
星光P M C	6,900	777.00	5,361,300
小林製薬	33,100	11,000.00	364,100,000
荒川化学工業	9,900	1,291.00	12,780,900
メック	8,100	2,135.00	17,293,500
日本高純度化学	3,300	2,772.00	9,147,600
タカラバイオ	31,000	3,115.00	96,565,000
J C U	13,300	3,685.00	49,010,500
新田ゼラチン	7,700	675.00	5,197,500
O A T アグリオ	2,300	1,331.00	3,061,300
デクセリアルズ	33,000	1,420.00	46,860,000
アース製薬	8,900	6,210.00	55,269,000
北興化学工業	10,900	1,139.00	12,415,100
大成ラミック	3,700	2,995.00	11,081,500
クマイ化学工業	48,800	909.00	44,359,200

日本農薬	21,200	511.00	10,833,200
富士興産	3,500	1,333.00	4,665,500
ニチレキ	14,000	1,565.00	21,910,000
ユシロ化学工業	6,800	1,165.00	7,922,000
ピーピー・カストロール	4,300	1,256.00	5,400,800
富士石油	28,800	232.00	6,681,600
MORESCO	4,500	1,178.00	5,301,000
出光興産	131,200	2,587.00	339,414,400
ENEOSホールディングス	1,778,300	443.40	788,498,220
コスモエネルギーホールディングス	37,300	2,374.00	88,550,200
横浜ゴム	68,400	1,821.00	124,556,400
TOYO TIRE	62,200	1,824.00	113,452,800
ブリヂストン	314,400	4,141.00	1,301,930,400
住友ゴム工業	106,000	1,045.00	110,770,000
藤倉コンポジット	10,800	441.00	4,762,800
オカモト	7,300	4,025.00	29,382,500
アキレス	8,200	1,520.00	12,464,000
フコク	4,400	712.00	3,132,800
ニッタ	12,200	2,528.00	30,841,600
クリエートメディック	4,200	982.00	4,124,400
住友理工	22,800	683.00	15,572,400
三ツ星ベルト	14,400	1,773.00	25,531,200
バンドー化学	20,900	709.00	14,818,100
AGC	108,600	3,755.00	407,793,000
日本板硝子	59,800	605.00	36,179,000
石塚硝子	2,100	1,871.00	3,929,100
有沢製作所	16,500	1,010.00	16,665,000
日本山村硝子	5,300	912.00	4,833,600
日本電気硝子	43,800	2,452.00	107,397,600
オハラ	4,700	1,892.00	8,892,400
住友大阪セメント	21,300	3,350.00	71,355,000
太平洋セメント	70,000	2,816.00	197,120,000
リソルホールディングス	900	3,950.00	3,555,000
日本ヒューム	11,000	790.00	8,690,000
日本コンクリート工業	25,400	326.00	8,280,400
三谷セキサン	5,500	5,050.00	27,775,000
アジアパイルホールディングス	18,500	505.00	9,342,500
東海カーボン	115,500	1,567.00	180,988,500
日本カーボン	6,500	4,165.00	27,072,500
東洋炭素	7,000	2,047.00	14,329,000
ノリタケカンパニーリミテド	6,600	3,660.00	24,156,000
TOTO	84,500	7,250.00	612,625,000
日本碍子	130,000	1,911.00	248,430,000
日本特殊陶業	90,000	1,999.00	179,910,000
ダントーホールディングス	8,600	431.00	3,706,600
MARUWA	4,100	10,960.00	44,936,000
品川リフラクトリーズ	2,800	2,881.00	8,066,800
黒崎播磨	2,000	4,915.00	9,830,000
ヨータイ	8,600	942.00	8,101,200
イソライト工業	5,300	589.00	3,121,700

東京窯業	15,700	334.00	5,243,800
ニッカトー	5,400	769.00	4,152,600
フジインコーポレーテッド	9,500	4,050.00	38,475,000
クニミネ工業	3,800	1,314.00	4,993,200
エーアンドエーマテリアル	2,400	1,094.00	2,625,600
ニチアス	29,900	2,559.00	76,514,100
日本製鉄	558,100	1,469.00	819,848,900
神戸製鋼所	213,700	632.00	135,058,400
中山製鋼所	17,100	397.00	6,788,700
合同製鐵	6,300	2,079.00	13,097,700
ジェイ エフ イー ホールディングス	338,200	1,078.00	364,579,600
東京製鐵	45,600	763.00	34,792,800
共英製鋼	13,100	1,445.00	18,929,500
大和工業	24,900	2,754.00	68,574,600
東京鐵鋼	4,500	1,961.00	8,824,500
大阪製鐵	6,300	1,279.00	8,057,700
淀川製鋼所	15,900	2,289.00	36,395,100
丸一鋼管	37,900	2,430.00	92,097,000
モリ工業	3,500	2,341.00	8,193,500
大同特殊鋼	19,100	4,855.00	92,730,500
日本高周波鋼業	4,000	382.00	1,528,000
日本冶金工業	9,100	2,047.00	18,627,700
山陽特殊製鋼	14,000	1,663.00	23,282,000
愛知製鋼	6,600	3,305.00	21,813,000
日立金属	110,300	1,740.00	191,922,000
日本金属	2,900	1,208.00	3,503,200
大平洋金属	7,800	2,262.00	17,643,600
新日本電工	75,300	282.00	21,234,600
栗本鐵工所	5,400	1,774.00	9,579,600
虹 技	1,300	1,148.00	1,492,400
日本鑄鉄管	1,400	1,306.00	1,828,400
日本製鋼所	35,500	3,195.00	113,422,500
三菱製鋼	8,800	699.00	6,151,200
日亜鋼業	17,800	300.00	5,340,000
日本精線	1,700	3,890.00	6,613,000
エンピプロ・ホールディングス	5,100	692.00	3,529,200
大紀アルミニウム工業所	17,700	805.00	14,248,500
日本輕金属ホールディングス	31,900	2,129.00	67,915,100
三井金属鉱業	31,600	3,980.00	125,768,000
東邦亜鉛	6,500	2,452.00	15,938,000
三菱マテリアル	77,200	2,526.00	195,007,200
住友金属鉱山	149,400	5,005.00	747,747,000
DOWAホールディングス	29,600	4,285.00	126,836,000
古河機械金属	19,300	1,335.00	25,765,500
エス・サイエンス	54,700	45.00	2,461,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,000	831.00	9,972,000
東邦チタニウム	20,900	928.00	19,395,200
UACJ	17,700	2,297.00	40,656,900
CKサンエツ	2,100	3,885.00	8,158,500

古河電気工業	36,400	2,916.00	106,142,400
住友電気工業	407,900	1,599.00	652,232,100
フジクラ	141,100	550.00	77,605,000
昭和電線ホールディングス	11,300	1,900.00	21,470,000
東京特殊電線	1,500	2,580.00	3,870,000
タツタ電線	20,600	701.00	14,440,600
カナレ電気	2,200	1,780.00	3,916,000
平河ヒューテック	6,500	1,224.00	7,956,000
リョービ	14,200	1,311.00	18,616,200
アーレスティ	14,600	408.00	5,956,800
アサヒホールディングス	21,900	4,260.00	93,294,000
東洋製罐グループホールディングス	74,500	1,348.00	100,426,000
ホッカンホールディングス	6,000	1,491.00	8,946,000
コロナ	6,800	952.00	6,473,600
横河ブリッジホールディングス	20,100	1,995.00	40,099,500
OSJBホールディングス	54,100	277.00	14,985,700
駒井ハルテック	2,400	2,207.00	5,296,800
高田機工	800	2,571.00	2,056,800
三和ホールディングス	110,200	1,330.00	146,566,000
文化シャッター	34,600	979.00	33,873,400
三協立山	15,000	871.00	13,065,000
アルインコ	7,800	976.00	7,612,800
東洋シャッター	2,400	701.00	1,682,400
LIXIL	161,000	2,885.00	464,485,000
日本フィルコン	8,500	507.00	4,309,500
ノーリツ	24,300	1,623.00	39,438,900
長府製作所	12,000	2,155.00	25,860,000
リンナイ	22,700	11,110.00	252,197,000
ユニプレス	19,300	1,122.00	21,654,600
ダイニチ工業	5,700	883.00	5,033,100
日東精工	15,100	488.00	7,368,800
三洋工業	1,300	1,889.00	2,455,700
岡部	24,100	797.00	19,207,700
ジーテクト	14,600	1,578.00	23,038,800
東プレ	21,900	1,624.00	35,565,600
高周波熱錬	22,300	562.00	12,532,600
東京製綱	8,200	1,448.00	11,873,600
サンコール	10,300	478.00	4,923,400
モリテックスチール	9,000	423.00	3,807,000
パイオラックス	17,300	1,647.00	28,493,100
エイチワン	11,600	842.00	9,767,200
日本発条	116,400	855.00	99,522,000
中央発條	1,000	2,803.00	2,803,000
アドバネクス	1,600	1,629.00	2,606,400
三浦工業	50,600	5,940.00	300,564,000
タクマ	39,600	2,273.00	90,010,800
テクノプロ・ホールディングス	22,500	8,000.00	180,000,000
アトラ	2,500	356.00	890,000
インターワークス	3,500	367.00	1,284,500

アイ・アールジャパンホールディングス	4,600	14,860.00	68,356,000	
Keepers 技研	7,300	2,041.00	14,899,300	
ファーストロジック	2,200	805.00	1,771,000	
三機サービス	2,300	1,000.00	2,300,000	
Gunosy	6,800	823.00	5,596,400	
デザインワン・ジャパン	3,500	215.00	752,500	
イー・ガーディアン	4,900	3,125.00	15,312,500	
リブセンス	6,200	238.00	1,475,600	
ジャパンマテリアル	34,800	1,531.00	53,278,800	
ベクトル	14,000	1,287.00	18,018,000	
ウチヤマホールディングス	5,800	360.00	2,088,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	8,400	1,362.00	11,440,800	
キャリアリンク	3,600	3,150.00	11,340,000	
IBJ	9,100	976.00	8,881,600	
アサンテ	4,100	1,706.00	6,994,600	
N・フィールド	7,600	994.00	7,554,400	
バリューHR	4,500	1,715.00	7,717,500	
M&Aキャピタルパートナーズ	9,300	4,975.00	46,267,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,300	2,127.00	9,146,100	
ERIホールディングス	2,800	639.00	1,789,200	
アビスト	1,800	2,973.00	5,351,400	
シグマクシス	6,200	1,895.00	11,749,000	
ウィルグループ	8,200	1,043.00	8,552,600	
エスクロー・エージェント・ジャパン	16,600	305.00	5,063,000	
メドピア	5,300	7,210.00	38,213,000	
レアジョブ	1,600	2,391.00	3,825,600	
リクルートホールディングス	809,300	4,980.00	4,030,314,000	
エラン	15,600	1,505.00	23,478,000	
ツガミ	24,200	1,695.00	41,019,000	
オークマ	13,600	6,300.00	85,680,000	
芝浦機械	12,200	2,799.00	34,147,800	
アマダ	171,200	1,290.00	220,848,000	
アイダエンジニアリング	30,700	1,035.00	31,774,500	
滝澤鉄工所	3,900	1,052.00	4,102,800	
FUJI	46,600	2,774.00	129,268,400	
牧野フライス製作所	13,700	4,210.00	57,677,000	
オーエスジー	57,600	1,938.00	111,628,800	
ダイジェット工業	1,000	1,416.00	1,416,000	
旭ダイヤモンド工業	31,000	502.00	15,562,000	
DMG森精機	73,900	1,718.00	126,960,200	
ソディック	25,600	985.00	25,216,000	
ディスコ	15,900	33,950.00	539,805,000	
日東工器	5,700	1,857.00	10,584,900	
日進工具	4,600	2,826.00	12,999,600	
パンチ工業	9,900	467.00	4,623,300	
富士ダイス	6,400	665.00	4,256,000	
土木管理総合試験所	5,700	355.00	2,023,500	
ネットマーケティング	5,400	685.00	3,699,000	

日本郵政	855,300	882.40	754,716,720	
ベルシステム24ホールディングス	18,900	1,914.00	36,174,600	
鎌倉新書	11,400	920.00	10,488,000	
S MN	2,400	773.00	1,855,200	
一蔵	1,700	382.00	649,400	
L I T A L I C O	4,600	3,600.00	16,560,000	
グローバルキッズCOMPANY	2,100	896.00	1,881,600	
エアトリ	6,100	1,657.00	10,107,700	
アトラエ	3,400	3,080.00	10,472,000	
ストライク	4,200	4,815.00	20,223,000	
ソラスト	27,700	1,496.00	41,439,200	
セラク	3,500	1,769.00	6,191,500	
インソース	9,400	2,199.00	20,670,600	
豊田自動織機	95,700	9,530.00	912,021,000	
豊和工業	6,500	888.00	5,772,000	
O K K	4,800	470.00	2,256,000	
石川製作所	3,000	1,765.00	5,295,000	
東洋機械金属	8,400	474.00	3,981,600	
津田駒工業	2,400	929.00	2,229,600	
エンシュウ	2,400	906.00	2,174,400	
島精機製作所	17,100	2,304.00	39,398,400	
オプトラ	14,600	2,633.00	38,441,800	
N Cホールディングス	3,100	649.00	2,011,900	
イワキ	7,600	846.00	6,429,600	
フリー	11,500	1,153.00	13,259,500	
ヤマシンフィルタ	23,500	848.00	19,928,000	
日阪製作所	14,800	861.00	12,742,800	
やまびこ	22,600	1,357.00	30,668,200	
平田機工	5,500	8,300.00	45,650,000	
ペガサスマシン製造	12,200	411.00	5,014,200	
マルマエ	4,300	1,301.00	5,594,300	
タツモ	4,900	1,553.00	7,609,700	
ナブテスコ	68,900	4,895.00	337,265,500	
三井海洋開発	12,400	2,092.00	25,940,800	
レオン自動機	11,400	1,238.00	14,113,200	
S M C	34,600	64,860.00	2,244,156,000	
ホソカワミクロン	4,100	6,250.00	25,625,000	
ユニオンツール	4,400	3,450.00	15,180,000	
オイレス工業	16,500	1,741.00	28,726,500	
日精エー・エス・ビー機械	3,400	6,060.00	20,604,000	
サトーホールディングス	15,400	2,394.00	36,867,600	
技研製作所	10,300	5,100.00	52,530,000	
日本エアテック	3,800	1,497.00	5,688,600	
カワタ	3,200	965.00	3,088,000	
日精樹脂工業	9,200	943.00	8,675,600	
オカダアイヨン	3,800	1,176.00	4,468,800	
ワイエイシーホールディングス	4,600	1,039.00	4,779,400	
小松製作所	535,700	3,088.00	1,654,241,600	
住友重機械工業	67,600	3,155.00	213,278,000	
日立建機	55,300	3,010.00	166,453,000	

日工	17,600	751.00	13,217,600
巴工業	4,800	2,070.00	9,936,000
井関農機	11,800	1,475.00	17,405,000
TOWA	11,000	2,006.00	22,066,000
丸山製作所	2,400	1,648.00	3,955,200
北川鉄工所	5,500	1,443.00	7,936,500
シンニッタン	14,500	217.00	3,146,500
ローツェ	5,200	7,760.00	40,352,000
タカキタ	4,300	715.00	3,074,500
クボタ	621,200	2,525.00	1,568,530,000
荏原実業	2,900	4,090.00	11,861,000
東洋エンジニアリング	15,400	487.00	7,499,800
三菱化工機	3,700	3,065.00	11,340,500
月島機械	21,800	1,399.00	30,498,200
帝国電機製作所	8,300	1,272.00	10,557,600
東京機械製作所	4,300	313.00	1,345,900
新東工業	28,200	792.00	22,334,400
澁谷工業	10,400	3,560.00	37,024,000
アイチコーポレーション	20,500	939.00	19,249,500
小森コーポレーション	30,100	724.00	21,792,400
鶴見製作所	9,200	1,840.00	16,928,000
住友精密工業	1,900	2,083.00	3,957,700
日本ギア工業	6,000	307.00	1,842,000
酒井重工業	1,900	2,193.00	4,166,700
荏原製作所	49,000	3,785.00	185,465,000
石井鐵工所	1,200	2,918.00	3,501,600
西島製作所	12,200	881.00	10,748,200
北越工業	12,400	1,101.00	13,652,400
ダイキン工業	150,600	23,370.00	3,519,522,000
オルガノ	3,800	6,490.00	24,662,000
トーヨーカネツ	4,400	2,562.00	11,272,800
栗田工業	64,000	4,185.00	267,840,000
椿本チエイン	16,900	2,882.00	48,705,800
大同工業	4,600	797.00	3,666,200
日機装	38,200	1,101.00	42,058,200
木村化工機	9,800	620.00	6,076,000
レイズネクスト	20,000	1,190.00	23,800,000
アネスト岩田	20,000	1,118.00	22,360,000
ダイフク	65,100	11,150.00	725,865,000
サムコ	2,900	3,670.00	10,643,000
加藤製作所	6,400	1,002.00	6,412,800
油研工業	1,700	1,652.00	2,808,400
タダノ	57,000	1,006.00	57,342,000
フジテック	40,800	2,530.00	103,224,000
CKD	27,400	2,397.00	65,677,800
キトー	10,000	1,500.00	15,000,000
平和	32,900	1,584.00	52,113,600
理想科学工業	9,200	1,479.00	13,606,800
SANKYO	28,000	3,040.00	85,120,000
日本金銭機械	13,200	550.00	7,260,000

マースグループホールディングス	7,600	1,585.00	12,046,000
フクシマガリレイ	8,100	4,525.00	36,652,500
オーイズミ	5,100	419.00	2,136,900
ダイコク電機	5,600	934.00	5,230,400
竹内製作所	19,700	2,577.00	50,766,900
アマノ	31,000	2,556.00	79,236,000
JUKI	16,500	678.00	11,187,000
サンデンホールディングス	16,500	444.00	7,326,000
蛇の目ミシン工業	10,600	889.00	9,423,400
ブラザー工業	144,300	2,399.00	346,175,700
マックス	16,300	1,641.00	26,748,300
モリタホールディングス	19,000	1,833.00	34,827,000
グローリー	30,400	2,304.00	70,041,600
新晃工業	11,000	1,947.00	21,417,000
大和冷機工業	19,000	1,136.00	21,584,000
セガサミーホールディングス	107,500	1,716.00	184,470,000
日本ピストンリング	4,500	1,023.00	4,603,500
リケン	5,500	2,250.00	12,375,000
T P R	16,000	1,578.00	25,248,000
ツバキ・ナカシマ	22,500	1,332.00	29,970,000
ホシザキ	37,200	10,700.00	398,040,000
大豊工業	9,800	787.00	7,712,600
日本精工	242,600	1,051.00	254,972,600
NTN	272,600	310.00	84,506,000
ジェイテクト	113,300	1,130.00	128,029,000
不二越	11,000	4,385.00	48,235,000
ミネベアミツミ	203,700	2,564.00	522,286,800
日本トムソン	32,200	508.00	16,357,600
THK	73,700	3,545.00	261,266,500
ユーシン精機	7,900	998.00	7,884,200
前澤給装工業	4,200	2,204.00	9,256,800
イーグル工業	14,700	1,209.00	17,772,300
前澤工業	7,300	597.00	4,358,100
日本ピラー工業	12,100	1,831.00	22,155,100
キッツ	36,600	617.00	22,582,200
日立製作所	568,400	4,997.00	2,840,294,800
三菱電機	1,182,400	1,724.50	2,039,048,800
富士電機	71,200	4,360.00	310,432,000
東洋電機製造	4,700	1,254.00	5,893,800
安川電機	127,300	5,750.00	731,975,000
シンフォニアテクノロジー	15,400	1,400.00	21,560,000
明電舎	20,000	2,446.00	48,920,000
オリジン	2,600	1,360.00	3,536,000
山洋電気	5,700	6,430.00	36,651,000
デンヨー	10,100	2,108.00	21,290,800
ベイカレント・コンサルティング	7,400	17,660.00	130,684,000
Orchestra Holdings	2,500	2,359.00	5,897,500
アイモバイル	4,000	1,225.00	4,900,000
キャリアインデックス	4,600	605.00	2,783,000

MS - J a p a n	4,500	1,203.00	5,413,500	
船場	1,600	877.00	1,403,200	
グレイステクノロジー	5,700	6,220.00	35,454,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	32,500	2,375.00	77,187,500	
フルテック	1,800	1,408.00	2,534,400	
グリーンズ	4,200	525.00	2,205,000	
ツナググループ・ホールディングス	1,700	355.00	603,500	
G A M E W I T H	3,500	593.00	2,075,500	
ソウルドアウト	2,700	1,728.00	4,665,600	
M S & C o n s u l t i n g	1,900	622.00	1,181,800	
エル・ティー・エス	800	4,170.00	3,336,000	
ミダック	2,400	3,215.00	7,716,000	
日総工産	8,700	895.00	7,786,500	
キュービーネットホールディングス	5,200	1,697.00	8,824,400	
R P A ホールディングス	12,800	676.00	8,652,800	
三櫻工業	16,300	937.00	15,273,100	
マキタ	154,200	4,970.00	766,374,000	
東芝テック	12,700	4,270.00	54,229,000	
芝浦メカトロニクス	2,100	4,820.00	10,122,000	
マブチモーター	32,700	4,775.00	156,142,500	
日本電産	284,600	14,210.00	4,044,166,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,000	591.00	4,137,000	
トレックス・セミコンダクター	6,400	1,469.00	9,401,600	
東光高岳	6,000	1,594.00	9,564,000	
ダブル・スコープ	23,200	992.00	23,014,400	
宮越ホールディングス	4,400	783.00	3,445,200	
ダイヘン	12,900	4,970.00	64,113,000	
ヤーマン	19,300	1,890.00	36,477,000	
J V C ケンウッド	101,900	206.00	20,991,400	
ミマキエンジニアリング	11,000	545.00	5,995,000	
I - P E X	5,500	2,241.00	12,325,500	
日新電機	27,700	1,300.00	36,010,000	
大崎電気工業	23,400	623.00	14,578,200	
オムロン	98,400	9,700.00	954,480,000	
日東工業	17,300	2,145.00	37,108,500	
I D E C	15,900	1,862.00	29,605,800	
正興電機製作所	2,700	2,326.00	6,280,200	
不二電機工業	2,300	1,297.00	2,983,100	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	42,400	3,445.00	146,068,000	
サクサホールディングス	2,800	1,423.00	3,984,400	
メルコホールディングス	4,100	3,850.00	15,785,000	
テクノメディカ	2,800	1,620.00	4,536,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	3,400	1,866.00	6,344,400	
日本電気	150,200	6,320.00	949,264,000	
富士通	106,400	16,075.00	1,710,380,000	
沖電気工業	47,900	1,116.00	53,456,400	
岩崎通信機	4,400	880.00	3,872,000	
電気興業	5,700	2,907.00	16,569,900	

サンケン電気	13,800	4,445.00	61,341,000
ナカヨ	1,900	1,500.00	2,850,000
アイホン	6,800	1,783.00	12,124,400
ルネサスエレクトロニクス	508,700	1,203.00	611,966,100
セイコーエプソン	146,600	1,863.00	273,115,800
ワコム	85,500	891.00	76,180,500
アルバック	21,800	4,925.00	107,365,000
アクセル	4,900	765.00	3,748,500
E I Z O	10,000	3,825.00	38,250,000
ジャパンディスプレイ	404,000	51.00	20,604,000
日本信号	27,600	980.00	27,048,000
京三製作所	25,400	438.00	11,125,200
能美防災	15,700	2,345.00	36,816,500
ホーチキ	8,600	1,310.00	11,266,000
星和電機	5,900	724.00	4,271,600
エレコム	13,500	5,070.00	68,445,000
パナソニック	1,260,900	1,449.00	1,827,044,100
シャープ	136,800	2,241.00	306,568,800
アンリツ	71,000	2,516.00	178,636,000
富士通ゼネラル	36,200	3,200.00	115,840,000
ソニー	740,600	12,095.00	8,957,557,000
T D K	57,100	15,830.00	903,893,000
帝国通信工業	5,600	1,124.00	6,294,400
タムラ製作所	42,300	560.00	23,688,000
アルプスアルパイン	96,500	1,489.00	143,688,500
池上通信機	4,000	867.00	3,468,000
日本電波工業	11,500	728.00	8,372,000
鈴木	5,300	1,195.00	6,333,500
日本トリム	2,500	4,600.00	11,500,000
ローランド ディー・ジー	7,000	1,834.00	12,838,000
フォスター電機	12,400	1,525.00	18,910,000
S M K	3,100	3,065.00	9,501,500
ヨコオ	8,700	3,300.00	28,710,000
ティアック	7,300	135.00	985,500
ホシデン	32,200	1,125.00	36,225,000
ヒロセ電機	18,200	16,320.00	297,024,000
日本航空電子工業	27,000	1,699.00	45,873,000
T O A	14,000	905.00	12,670,000
マクセルホールディングス	23,400	1,468.00	34,351,200
古野電気	15,100	1,188.00	17,938,800
ユニデンホールディングス	3,000	2,371.00	7,113,000
スミダコーポレーション	10,000	1,041.00	10,410,000
アイコム	4,900	2,845.00	13,940,500
リオン	5,000	3,195.00	15,975,000
本多通信工業	9,400	499.00	4,690,600
船井電機	13,400	472.00	6,324,800
横河電機	118,300	2,391.00	282,855,300
新電元工業	4,500	2,969.00	13,360,500
アズビル	80,000	5,060.00	404,800,000
東亜ディーケーケー	6,100	863.00	5,264,300

日本光電工業	48,900	3,150.00	154,035,000
チノー	3,800	1,449.00	5,506,200
共和電業	13,000	399.00	5,187,000
日本電子材料	4,300	1,948.00	8,376,400
堀場製作所	23,400	7,070.00	165,438,000
アドバンテスト	87,900	8,840.00	777,036,000
小野測器	4,300	556.00	2,390,800
エスベック	10,500	2,022.00	21,231,000
キーエンス	116,000	56,750.00	6,583,000,000
日置電機	5,700	4,165.00	23,740,500
シスメックス	92,200	11,885.00	1,095,797,000
日本マイクロニクス	20,600	1,591.00	32,774,600
メガチップス	11,900	2,958.00	35,200,200
OBARA GROUP	7,000	4,150.00	29,050,000
IMAGICA GROUP	10,000	403.00	4,030,000
澤藤電機	1,300	2,078.00	2,701,400
デンソー	260,400	6,719.00	1,749,627,600
原田工業	5,000	910.00	4,550,000
コーセル	14,400	1,189.00	17,121,600
イリソ電子工業	9,900	5,150.00	50,985,000
オブテックスグループ	19,400	1,950.00	37,830,000
千代田インテグレ	5,100	1,829.00	9,327,900
アイ・オー・データ機器	4,400	1,034.00	4,549,600
レーザーテック	51,900	13,560.00	703,764,000
スタンレー電気	82,900	3,520.00	291,808,000
岩崎電気	4,300	1,584.00	6,811,200
ウシオ電機	60,600	1,400.00	84,840,000
岡谷電機産業	8,900	383.00	3,408,700
ヘリオス テクノ ホールディング	11,200	357.00	3,998,400
エノモト	3,300	1,765.00	5,824,500
日本セラミック	12,000	3,030.00	36,360,000
遠藤照明	6,700	584.00	3,912,800
古河電池	8,400	1,677.00	14,086,800
双信電機	5,800	451.00	2,615,800
山一電機	7,600	1,572.00	11,947,200
図研	7,700	3,065.00	23,600,500
日本電子	21,600	4,190.00	90,504,000
カシオ計算機	95,100	2,004.00	190,580,400
ファナック	103,800	28,255.00	2,932,869,000
日本シイエムケイ	25,500	467.00	11,908,500
エンプラス	5,300	5,010.00	26,553,000
大真空	4,000	2,406.00	9,624,000
ローム	49,200	11,210.00	551,532,000
浜松ホトニクス	84,800	6,390.00	541,872,000
三井ハイテック	11,600	4,120.00	47,792,000
新光電気工業	39,700	2,704.00	107,348,800
京セラ	180,200	6,930.00	1,248,786,000
協栄産業	1,500	1,397.00	2,095,500
太陽誘電	52,500	5,870.00	308,175,000
村田製作所	347,300	9,468.00	3,288,236,400

双葉電子工業	20,300	1,001.00	20,320,300
日東電工	75,700	9,700.00	734,290,000
北陸電気工業	4,600	966.00	4,443,600
東海理化電機製作所	31,200	1,926.00	60,091,200
ニチコン	37,100	1,422.00	52,756,200
日本ケミコン	11,900	1,736.00	20,658,400
K O A	16,300	1,663.00	27,106,900
三井E & Sホールディングス	45,700	443.00	20,245,100
日立造船	93,700	652.00	61,092,400
三菱重工業	185,700	3,178.00	590,154,600
川崎重工業	91,900	2,405.00	221,019,500
I H I	79,500	2,098.00	166,791,000
名村造船所	35,700	195.00	6,961,500
サノヤスホールディングス	15,500	159.00	2,464,500
スプリックス	3,200	827.00	2,646,400
マネジメントソリューションズ	5,500	1,803.00	9,916,500
プロレド・パートナーズ	1,600	3,515.00	5,624,000
and factory	1,000	770.00	770,000
テノ・ホールディングス	900	1,267.00	1,140,300
フロンティア・マネジメント	2,000	2,446.00	4,892,000
ピアラ	600	2,015.00	1,209,000
コプロ・ホールディングス	600	3,775.00	2,265,000
ギークス	1,500	1,573.00	2,359,500
カーブスホールディングス	31,000	964.00	29,884,000
フォーラムエンジニアリング	5,800	1,025.00	5,945,000
日本車輛製造	4,300	2,592.00	11,145,600
三菱ロジスネクスト	15,700	1,191.00	18,698,700
近畿車輛	1,600	1,272.00	2,035,200
F P G	35,800	601.00	21,515,800
島根銀行	4,300	676.00	2,906,800
じもとホールディングス	8,000	831.00	6,648,000
全国保証	30,300	4,970.00	150,591,000
めぶきフィナンシャルグループ	604,600	216.00	130,593,600
ジャパンインベストメントアドバイザー	5,900	1,294.00	7,634,600
東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,600	1,168.00	17,052,800
九州フィナンシャルグループ	238,000	442.00	105,196,000
かんぽ生命保険	144,500	2,248.00	324,836,000
ゆうちょ銀行	330,800	963.00	318,560,400
富山第一銀行	28,600	301.00	8,608,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	709,700	411.00	291,686,700
ジェイリース	3,800	769.00	2,922,200
西日本フィナンシャルホールディングス	77,600	688.00	53,388,800
マーキュリアンベストメント	4,800	755.00	3,624,000
イントラスト	3,300	760.00	2,508,000
日本モーゲージサービス	5,900	1,196.00	7,056,400
C A S A	3,200	1,018.00	3,257,600
アルヒ	17,100	1,739.00	29,736,900

プレミアグループ	5,400	2,463.00	13,300,200
日産自動車	1,394,400	629.60	877,914,240
いすゞ自動車	342,600	1,148.00	393,304,800
トヨタ自動車	1,197,800	8,037.00	9,626,718,600
日野自動車	147,700	992.00	146,518,400
三菱自動車工業	437,100	311.00	135,938,100
エフテック	8,400	709.00	5,955,600
レシップホールディングス	4,600	615.00	2,829,000
G M B	2,200	1,048.00	2,305,600
ファルテック	2,300	753.00	1,731,900
武蔵精密工業	26,400	1,652.00	43,612,800
日産車体	17,300	911.00	15,760,300
新明和工業	33,300	969.00	32,267,700
極東開発工業	20,400	1,606.00	32,762,400
トビー工業	9,800	1,442.00	14,131,600
ティラド	3,700	1,595.00	5,901,500
曙ブレーキ工業	64,100	171.00	10,961,100
タチエス	18,100	1,198.00	21,683,800
N O K	57,200	1,420.00	81,224,000
フタバ産業	29,600	561.00	16,605,600
K Y B	13,200	2,640.00	34,848,000
市光工業	17,600	779.00	13,710,400
大同メタル工業	24,600	556.00	13,677,600
プレス工業	58,500	357.00	20,884,500
ミクニ	16,100	287.00	4,620,700
太平洋工業	24,800	1,249.00	30,975,200
河西工業	16,200	451.00	7,306,200
アイシン精機	86,500	3,600.00	311,400,000
マツダ	370,800	966.00	358,192,800
今仙電機製作所	10,400	760.00	7,904,000
本田技研工業	930,900	3,013.00	2,804,801,700
スズキ	234,400	4,978.00	1,166,843,200
S U B A R U	338,800	2,117.00	717,239,600
安永	5,700	1,249.00	7,119,300
ヤマハ発動機	167,100	2,477.00	413,906,700
小糸製作所	70,800	7,690.00	544,452,000
T B K	11,800	449.00	5,298,200
エクセディ	16,000	1,662.00	26,592,000
ミツバ	21,700	507.00	11,001,900
豊田合成	38,200	3,000.00	114,600,000
愛三工業	18,500	612.00	11,322,000
盟和産業	1,600	916.00	1,465,600
日本プラスト	10,300	579.00	5,963,700
ヨロズ	10,200	1,400.00	14,280,000
エフ・シー・シー	19,300	1,686.00	32,539,800
新家工業	3,100	1,425.00	4,417,500
シマノ	44,300	24,555.00	1,087,786,500
テイ・エス テック	27,400	3,170.00	86,858,000
関西みらいフィナンシャルグループ	54,800	569.00	31,181,200
三十三フィナンシャルグループ	10,200	1,337.00	13,637,400

第四北越フィナンシャルグループ	19,000	2,330.00	44,270,000	
ひろぎんホールディングス	172,200	641.00	110,380,200	
ダイレクトマーケティングミックス	4,400	3,225.00	14,190,000	
ポピンズホールディングス	2,300	2,763.00	6,354,900	
ジャムコ	7,000	758.00	5,306,000	
小野建	10,700	1,253.00	13,407,100	
はるやまホールディングス	6,100	719.00	4,385,900	
南陽	2,100	1,686.00	3,540,600	
ノジマ	20,700	2,779.00	57,525,300	
佐島電機	7,400	762.00	5,638,800	
カップ・クリエイト	16,400	1,550.00	25,420,000	
エコートレーディング	2,600	692.00	1,799,200	
伯東	7,100	1,296.00	9,201,600	
コンドーテック	9,200	1,079.00	9,926,800	
中山福	7,100	538.00	3,819,800	
ライトオン	8,800	652.00	5,737,600	
ナガイレーベン	15,500	3,110.00	48,205,000	
ジーンズメイト	3,600	314.00	1,130,400	
三菱食品	12,900	2,905.00	37,474,500	
良品計画	154,500	2,533.00	391,348,500	
三城ホールディングス	14,900	296.00	4,410,400	
松田産業	8,500	1,905.00	16,192,500	
第一興商	17,300	4,010.00	69,373,000	
メディバルホールディングス	116,700	2,238.00	261,174,600	
アドヴァン	12,000	1,130.00	13,560,000	
S P K	5,200	1,310.00	6,812,000	
萩原電気ホールディングス	4,400	2,799.00	12,315,600	
アルビス	3,700	2,534.00	9,375,800	
アズワン	8,300	15,400.00	127,820,000	
スズデン	3,500	1,254.00	4,389,000	
尾家産業	3,000	1,326.00	3,978,000	
シモジマ	6,500	1,407.00	9,145,500	
ドウシシャ	11,000	1,880.00	20,680,000	
小津産業	2,300	1,912.00	4,397,600	
コナカ	14,100	341.00	4,808,100	
高速	6,300	1,605.00	10,111,500	
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,695.00	2,034,000	
G - 7ホールディングス	6,900	2,445.00	16,870,500	
たけびし	3,500	1,590.00	5,565,000	
イオン北海道	15,600	1,053.00	16,426,800	
コジマ	19,900	667.00	13,273,300	
ヒマラヤ	4,300	946.00	4,067,800	
コーナン商事	16,600	2,976.00	49,401,600	
ネットワンシステムズ	47,300	3,640.00	172,172,000	
エコス	4,300	1,949.00	8,380,700	
ワタミ	15,300	1,025.00	15,682,500	
マルシェ	3,000	508.00	1,524,000	
リックス	2,200	1,715.00	3,773,000	
システムソフト	25,500	124.00	3,162,000	

パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	232,800	2,460.00	572,688,000	
丸文	10,600	565.00	5,989,000	
西松屋チェーン	25,500	1,517.00	38,683,500	
ゼンショーホールディングス	62,500	2,901.00	181,312,500	
ハビネット	9,700	1,677.00	16,266,900	
幸楽苑ホールディングス	7,300	1,773.00	12,942,900	
ハークスレイ	2,000	926.00	1,852,000	
橋本総業ホールディングス	2,000	2,504.00	5,008,000	
日本ライフライン	37,600	1,473.00	55,384,800	
サイゼリヤ	17,200	2,156.00	37,083,200	
タカショー	7,400	764.00	5,653,600	
V Tホールディングス	43,900	436.00	19,140,400	
マルカ	3,800	1,981.00	7,527,800	
アルゴグラフィックス	9,000	3,145.00	28,305,000	
魚力	3,500	1,841.00	6,443,500	
I D O M	39,300	664.00	26,095,200	
日本エム・ディ・エム	6,800	2,163.00	14,708,400	
ポブラ	3,300	344.00	1,135,200	
フジ・コーポレーション	3,100	2,256.00	6,993,600	
ユナイテッドアローズ	13,200	2,018.00	26,637,600	
進和	7,000	2,234.00	15,638,000	
エスケイジャパン	2,700	458.00	1,236,600	
ダイトロン	5,000	1,660.00	8,300,000	
ハイデイ日高	16,800	1,857.00	31,197,600	
シークス	14,800	1,647.00	24,375,600	
京都きもの友禅	6,400	244.00	1,561,600	
コロワイド	38,600	1,989.00	76,775,400	
ピーシーデポコーポレーション	13,600	604.00	8,214,400	
田中商事	3,100	702.00	2,176,200	
オーハシテクニカ	6,200	1,371.00	8,500,200	
壱番屋	8,200	5,200.00	42,640,000	
白銅	3,600	1,478.00	5,320,800	
トップカルチャー	4,800	352.00	1,689,600	
P L A N T	3,100	749.00	2,321,900	
スギホールディングス	23,200	7,380.00	171,216,000	
ダイコー通産	1,100	1,583.00	1,741,300	
薬王堂ホールディングス	5,100	2,692.00	13,729,200	
島津製作所	152,200	4,190.00	637,718,000	
J M S	10,000	1,154.00	11,540,000	
クボテック	3,100	374.00	1,159,400	
長野計器	8,500	963.00	8,185,500	
ブイ・テクノロジー	5,500	6,400.00	35,200,000	
スター精密	18,200	1,663.00	30,266,600	
東京計器	7,500	957.00	7,177,500	
愛知時計電機	1,200	4,445.00	5,334,000	
インターアクション	5,900	2,550.00	15,045,000	
オーバル	10,700	329.00	3,520,300	
東京精密	19,900	4,560.00	90,744,000	
マニー	47,000	2,869.00	134,843,000	

ニコン	180,400	899.00	162,179,600	
トプコン	59,500	1,364.00	81,158,000	
オリンパス	654,200	2,043.50	1,336,857,700	
理研計器	10,500	3,065.00	32,182,500	
S C R E E Nホールディングス	20,500	8,390.00	171,995,000	
キヤノン電子	10,900	1,764.00	19,227,600	
タムロン	9,500	2,159.00	20,510,500	
H O Y A	234,600	13,065.00	3,065,049,000	
シード	5,200	645.00	3,354,000	
ノーリツ鋼機	10,600	2,209.00	23,415,400	
エー・アンド・デイ	9,900	1,322.00	13,087,800	
朝日インテック	124,400	3,330.00	414,252,000	
キヤノン	587,500	2,375.00	1,395,312,500	
リコー	300,700	940.00	282,658,000	
シチズン時計	149,200	362.00	54,010,400	
リズム	3,100	730.00	2,263,000	
大研医器	9,500	573.00	5,443,500	
メニコン	18,100	6,680.00	120,908,000	
シンシア	1,200	687.00	824,400	
中本パックス	3,100	1,748.00	5,418,800	
スノーピーク	7,000	2,054.00	14,378,000	
パラマウントベッドホールディングス	11,400	4,795.00	54,663,000	
トランザクション	6,400	1,122.00	7,180,800	
粧美堂	3,000	406.00	1,218,000	
ニホンフラッシュ	10,100	1,267.00	12,796,700	
前田工織	13,000	2,876.00	37,388,000	
永大産業	16,800	315.00	5,292,000	
アートネイチャー	11,600	689.00	7,992,400	
バンダイナムコホールディングス	97,800	9,239.00	903,574,200	
アイフィスジャパン	3,200	721.00	2,307,200	
共立印刷	21,900	129.00	2,825,100	
S H O E I	10,400	4,250.00	44,200,000	
フランスベッドホールディングス	15,400	983.00	15,138,200	
マーベラス	18,200	901.00	16,398,200	
パイロットコーポレーション	20,900	3,225.00	67,402,500	
萩原工業	6,700	1,481.00	9,922,700	
エイベックス	19,900	1,434.00	28,536,600	
トッパン・フォームズ	21,200	1,137.00	24,104,400	
フジシールインターナショナル	24,300	2,061.00	50,082,300	
タカラトミー	52,900	959.00	50,731,100	
廣済堂	8,100	848.00	6,868,800	
エステールホールディングス	4,000	646.00	2,584,000	
レック	14,000	1,343.00	18,802,000	
タカノ	4,500	601.00	2,704,500	
三光合成	12,400	455.00	5,642,000	
プロネクサス	10,300	1,168.00	12,030,400	
ホクシン	8,500	117.00	994,500	
ウッドワン	3,400	1,098.00	3,733,200	
大建工業	8,000	1,851.00	14,808,000	
きもと	18,900	199.00	3,761,100	

凸版印刷	179,600	1,620.00	290,952,000
大日本印刷	142,800	2,006.00	286,456,800
共同印刷	3,700	3,675.00	13,597,500
N I S S H A	24,300	1,450.00	35,235,000
光村印刷	800	1,796.00	1,436,800
藤森工業	10,600	4,790.00	50,774,000
ヴィア・ホールディングス	14,200	285.00	4,047,000
TAKARA & COMPANY	5,800	1,800.00	10,440,000
前澤化成工業	7,800	997.00	7,776,600
未来工業	4,300	1,792.00	7,705,600
アシックス	104,600	1,957.00	204,702,200
ツツミ	3,000	1,913.00	5,739,000
ウェーブロックホールディングス	4,000	836.00	3,344,000
J S P	7,000	1,849.00	12,943,000
ニチハ	16,500	3,375.00	55,687,500
ローランド	6,900	3,930.00	27,117,000
エフピコ	21,800	4,215.00	91,887,000
小松ウオール工業	3,700	1,796.00	6,645,200
ヤマハ	70,300	6,360.00	447,108,000
河合楽器製作所	3,300	3,050.00	10,065,000
クリナップ	11,400	510.00	5,814,000
ピジョン	75,900	4,485.00	340,411,500
天馬	8,900	2,217.00	19,731,300
オリバー	2,400	2,644.00	6,345,600
兼松サステック	600	1,763.00	1,057,800
キングジム	10,200	899.00	9,169,800
象印マホービン	31,900	1,869.00	59,621,100
リンテック	25,400	2,416.00	61,366,400
信越ポリマー	18,200	1,045.00	19,019,000
東リ	31,100	252.00	7,837,200
イトーキ	23,300	348.00	8,108,400
任天堂	67,700	63,450.00	4,295,565,000
三菱鉛筆	19,500	1,429.00	27,865,500
松風	5,500	1,868.00	10,274,000
タカラスタンダード	24,500	1,649.00	40,400,500
コクヨ	56,600	1,453.00	82,239,800
ナカバヤシ	12,100	625.00	7,562,500
ニフコ	43,400	3,990.00	173,166,000
立川ブラインド工業	5,300	1,336.00	7,080,800
グローブライト	5,700	4,275.00	24,367,500
オカムラ	45,400	1,089.00	49,440,600
バルカー	9,700	2,126.00	20,622,200
MUTOHホールディングス	1,200	1,557.00	1,868,400
伊藤忠商事	814,600	3,101.00	2,526,074,600
丸紅	1,148,100	743.80	853,956,780
スクロール	16,600	1,251.00	20,766,600
高島	1,600	1,694.00	2,710,400
ヨンドシーホールディングス	10,800	2,043.00	22,064,400
三陽商会	6,000	752.00	4,512,000
長瀬産業	65,500	1,745.00	114,297,500

ナイガイ	3,800	329.00	1,250,200
蝶理	7,500	1,655.00	12,412,500
豊田通商	116,900	4,710.00	550,599,000
オンワードホールディングス	69,300	291.00	20,166,300
三共生興	18,000	522.00	9,396,000
兼松	46,500	1,449.00	67,378,500
美津濃	11,700	2,320.00	27,144,000
ツカモトコーポレーション	1,700	1,521.00	2,585,700
ルックホールディングス	4,000	938.00	3,752,000
三井物産	945,500	2,010.00	1,900,455,000
日本紙パルプ商事	6,100	3,695.00	22,539,500
東京エレクトロン	69,300	41,150.00	2,851,695,000
カメイ	15,200	1,246.00	18,939,200
東都水産	1,400	3,545.00	4,963,000
OUGホールディングス	1,800	2,846.00	5,122,800
スターゼン	4,300	4,505.00	19,371,500
セイコーホールディングス	16,600	1,603.00	26,609,800
山善	45,500	1,044.00	47,502,000
椿本興業	1,700	3,665.00	6,230,500
住友商事	734,900	1,489.50	1,094,633,550
日本ユニシス	40,300	3,555.00	143,266,500
内田洋行	4,600	4,445.00	20,447,000
三菱商事	709,000	2,838.00	2,012,142,000
第一実業	5,300	4,240.00	22,472,000
キャノンマーケティングジャパン	28,900	2,473.00	71,469,700
西華産業	6,200	1,431.00	8,872,200
佐藤商事	10,000	985.00	9,850,000
菱洋エレクトロ	8,800	2,918.00	25,678,400
東京産業	11,000	670.00	7,370,000
ユアサ商事	12,000	3,290.00	39,480,000
神鋼商事	2,700	2,001.00	5,402,700
トルク	5,800	267.00	1,548,600
阪和興業	23,200	2,935.00	68,092,000
正栄食品工業	7,500	3,925.00	29,437,500
カナデン	9,600	1,273.00	12,220,800
菱電商事	8,400	1,641.00	13,784,400
ニプロ	88,100	1,334.00	117,525,400
フルサト工業	6,300	1,328.00	8,366,400
岩谷産業	27,900	6,460.00	180,234,000
ナイス	4,700	1,652.00	7,764,400
昭光通商	3,400	674.00	2,291,600
ニチモウ	1,600	1,929.00	3,086,400
極東貿易	3,000	1,405.00	4,215,000
イワキ	15,200	652.00	9,910,400
兼松エレクトロニクス	6,400	3,840.00	24,576,000
三愛石油	28,700	1,127.00	32,344,900
稲畑産業	27,900	1,627.00	45,393,300
G S I クレオス	2,800	2,180.00	6,104,000
明和産業	10,800	470.00	5,076,000
クワザワホールディングス	4,400	673.00	2,961,200

キムラタン	68,300	25.00	1,707,500
ヤマエ久野	8,500	1,131.00	9,613,500
ゴールドウイン	19,100	7,320.00	139,812,000
ユニ・チャーム	250,800	4,670.00	1,171,236,000
デサント	19,800	1,779.00	35,224,200
キング	4,600	595.00	2,737,000
ワキタ	22,900	1,028.00	23,541,200
ヤマトインターナショナル	10,600	350.00	3,710,000
東邦ホールディングス	37,300	2,091.00	77,994,300
サンゲツ	31,500	1,668.00	52,542,000
ミツウロコグループホールディングス	17,100	1,267.00	21,665,700
シナネンホールディングス	4,300	3,270.00	14,061,000
伊藤忠エネクス	26,000	1,035.00	26,910,000
サンリオ	32,600	1,701.00	55,452,600
サンワテクノス	7,600	1,110.00	8,436,000
リョーサン	12,800	2,378.00	30,438,400
新光商事	15,900	786.00	12,497,400
トーヨー	5,400	1,908.00	10,303,200
三信電気	6,400	2,085.00	13,344,000
東陽テクニカ	12,200	1,193.00	14,554,600
モスフードサービス	16,500	3,110.00	51,315,000
加賀電子	10,500	2,562.00	26,901,000
三益半導体工業	9,100	2,654.00	24,151,400
都築電気	4,300	1,561.00	6,712,300
ソーダニッカ	11,300	540.00	6,102,000
立花エレテック	8,700	1,634.00	14,215,800
木曽路	15,300	2,409.00	36,857,700
SRSホールディングス	14,600	862.00	12,585,200
千趣会	20,900	338.00	7,064,200
タカキュー	9,900	150.00	1,485,000
リテールパートナーズ	14,100	1,398.00	19,711,800
ケーヨー	21,600	758.00	16,372,800
上新電機	13,700	3,120.00	42,744,000
日本瓦斯	19,200	5,250.00	100,800,000
ロイヤルホールディングス	20,300	1,919.00	38,955,700
東天紅	600	924.00	554,400
いなげや	13,000	1,750.00	22,750,000
チヨダ	12,200	1,007.00	12,285,400
ライフコーポレーション	8,800	3,370.00	29,656,000
リンガーハット	14,400	2,494.00	35,913,600
MrMaxHD	15,900	784.00	12,465,600
テンアライド	11,700	361.00	4,223,700
AOKIホールディングス	23,100	636.00	14,691,600
オークワ	18,200	1,281.00	23,314,200
コメリ	18,000	2,886.00	51,948,000
青山商事	25,700	729.00	18,735,300
しまむら	13,500	11,670.00	157,545,000
はせがわ	5,200	298.00	1,549,600
高島屋	84,700	1,098.00	93,000,600
松屋	25,400	960.00	24,384,000

エイチ・ツー・オー リテイリング	55,000	833.00	45,815,000
近鉄百貨店	4,500	3,395.00	15,277,500
丸井グループ	98,500	2,107.00	207,539,500
クレディセゾン	68,000	1,351.00	91,868,000
アクシアル リテイリング	9,700	5,020.00	48,694,000
井筒屋	6,300	225.00	1,417,500
イオン	448,100	3,445.00	1,543,704,500
イズミ	23,600	4,050.00	95,580,000
フォーバル	4,300	849.00	3,650,700
平和堂	21,500	2,212.00	47,558,000
フジ	14,100	2,020.00	28,482,000
ヤオコー	13,200	6,970.00	92,004,000
ゼビオホールディングス	14,000	960.00	13,440,000
ケーズホールディングス	103,700	1,482.00	153,683,400
PALTA C	18,700	5,790.00	108,273,000
三谷産業	15,600	455.00	7,098,000
Olympicグループ	6,000	921.00	5,526,000
日産東京販売ホールディングス	14,300	271.00	3,875,300
新生銀行	95,100	1,382.00	131,428,200
あおぞら銀行	69,400	2,135.00	148,169,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,977,200	519.60	4,144,953,120
りそなホールディングス	1,267,600	405.30	513,758,280
三井住友トラスト・ホールディングス	220,500	3,499.00	771,529,500
三井住友フィナンシャルグループ	807,100	3,570.00	2,881,347,000
千葉銀行	388,800	645.00	250,776,000
群馬銀行	239,800	340.00	81,532,000
武蔵野銀行	17,300	1,632.00	28,233,600
千葉興業銀行	29,800	258.00	7,688,400
筑波銀行	48,400	186.00	9,002,400
七十七銀行	36,600	1,413.00	51,715,800
青森銀行	9,000	2,453.00	22,077,000
秋田銀行	7,100	1,421.00	10,089,100
山形銀行	13,000	1,068.00	13,884,000
岩手銀行	7,600	2,037.00	15,481,200
東邦銀行	104,100	212.00	22,069,200
東北銀行	5,900	1,115.00	6,578,500
みちのく銀行	7,500	1,039.00	7,792,500
ふくおかフィナンシャルグループ	105,100	2,062.00	216,716,200
静岡銀行	283,900	812.00	230,526,800
十六銀行	14,600	1,995.00	29,127,000
スルガ銀行	101,600	341.00	34,645,600
八十二銀行	262,300	370.00	97,051,000
山梨中央銀行	13,600	857.00	11,655,200
大垣共立銀行	23,000	2,079.00	47,817,000
福井銀行	10,000	1,921.00	19,210,000
北國銀行	10,900	2,642.00	28,797,800
清水銀行	4,900	1,709.00	8,374,100
富山銀行	1,900	2,868.00	5,449,200
滋賀銀行	23,300	1,981.00	46,157,300
南都銀行	17,000	1,805.00	30,685,000

百五銀行	105,200	308.00	32,401,600	
京都銀行	41,700	6,110.00	254,787,000	
紀陽銀行	41,300	1,422.00	58,728,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	77,500	980.00	75,950,000	
山陰合同銀行	73,600	498.00	36,652,800	
中国銀行	100,400	860.00	86,344,000	
鳥取銀行	4,000	1,120.00	4,480,000	
伊予銀行	154,600	645.00	99,717,000	
百十四銀行	12,200	1,574.00	19,202,800	
四国銀行	16,700	719.00	12,007,300	
阿波銀行	17,800	2,272.00	40,441,600	
大分銀行	6,800	2,135.00	14,518,000	
宮崎銀行	7,300	2,260.00	16,498,000	
佐賀銀行	6,700	1,353.00	9,065,100	
沖縄銀行	10,700	2,831.00	30,291,700	
琉球銀行	25,400	778.00	19,761,200	
セブン銀行	389,000	246.00	95,694,000	
みずほフィナンシャルグループ	1,584,600	1,529.50	2,423,645,700	
高知銀行	4,200	769.00	3,229,800	
山口フィナンシャルグループ	145,400	636.00	92,474,400	
芙蓉総合リース	12,200	7,650.00	93,330,000	
みずほリース	18,000	3,405.00	61,290,000	
東京センチュリー	27,100	8,750.00	237,125,000	
SBIホールディングス	143,000	2,890.00	413,270,000	
日本証券金融	49,400	624.00	30,825,600	
アイフル	195,200	284.00	55,436,800	
日本アジア投資	10,100	243.00	2,454,300	
長野銀行	3,900	1,280.00	4,992,000	
名古屋銀行	9,400	2,794.00	26,263,600	
北洋銀行	176,000	232.00	40,832,000	
愛知銀行	3,900	2,911.00	11,352,900	
中京銀行	4,300	1,818.00	7,817,400	
大光銀行	3,500	1,286.00	4,501,000	
愛媛銀行	16,500	979.00	16,153,500	
トマト銀行	4,500	1,069.00	4,810,500	
京葉銀行	49,700	437.00	21,718,900	
栃木銀行	56,100	182.00	10,210,200	
北日本銀行	3,700	1,913.00	7,078,100	
東和銀行	20,500	684.00	14,022,000	
福島銀行	13,200	228.00	3,009,600	
大東銀行	5,900	649.00	3,829,100	
リコーリース	9,200	3,300.00	30,360,000	
イオンフィナンシャルサービス	71,300	1,399.00	99,748,700	
アコム	234,500	472.00	110,684,000	
ジャックス	12,800	2,167.00	27,737,600	
オリエントコーポレーション	315,100	143.00	45,059,300	
日立キャピタル	27,500	2,881.00	79,227,500	
オリックス	723,400	1,841.00	1,331,779,400	
三菱UFJリース	262,400	571.00	149,830,400	
ジャフコグループ	17,900	6,030.00	107,937,000	

九州リースサービス	6,500	655.00	4,257,500
トモホールディングス	90,100	322.00	29,012,200
大和証券グループ本社	873,300	517.70	452,107,410
野村ホールディングス	1,780,300	602.70	1,072,986,810
岡三証券グループ	99,200	399.00	39,580,800
丸三証券	34,600	590.00	20,414,000
東洋証券	38,200	154.00	5,882,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	123,800	348.00	43,082,400
光世証券	3,000	654.00	1,962,000
水戸証券	31,200	271.00	8,455,200
いちよし証券	23,200	572.00	13,270,400
松井証券	57,100	875.00	49,962,500
SOMPOホールディングス	205,600	4,367.00	897,855,200
日本取引所グループ	315,000	2,540.50	800,257,500
マネックスグループ	104,400	704.00	73,497,600
極東証券	15,700	803.00	12,607,100
岩井コスモホールディングス	11,900	1,511.00	17,980,900
藍澤證券	21,100	849.00	17,913,900
フィデアホールディングス	114,000	116.00	13,224,000
池田泉州ホールディングス	133,500	160.00	21,360,000
アニコムホールディングス	32,800	1,126.00	36,932,800
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	283,300	3,200.00	906,560,000
マネーパートナーズグループ	12,800	217.00	2,777,600
スパークス・グループ	53,800	314.00	16,893,200
小林洋行	3,000	274.00	822,000
第一生命ホールディングス	616,000	1,810.00	1,114,960,000
東京海上ホールディングス	386,600	5,525.00	2,135,965,000
アドバンテッジリスクマネジメント	5,700	740.00	4,218,000
イー・ギャランティ	13,300	2,461.00	32,731,300
アサックス	6,500	752.00	4,888,000
NECキャピタルソリューション	4,800	2,037.00	9,777,600
T&Dホールディングス	348,400	1,426.00	496,818,400
アドバンスクリエイト	2,400	1,915.00	4,596,000
三井不動産	531,400	2,407.00	1,279,079,800
三菱地所	766,000	1,830.00	1,401,780,000
平和不動産	20,000	3,820.00	76,400,000
東京建物	114,900	1,597.00	183,495,300
ダイビル	30,100	1,280.00	38,528,000
京阪神ビルディング	20,100	1,581.00	31,778,100
住友不動産	262,100	3,601.00	943,822,100
太平洋興発	5,100	642.00	3,274,200
テーオーシー	22,900	765.00	17,518,500
東京楽天地	2,000	4,530.00	9,060,000
レオパレス21	96,500	163.00	15,729,500
スターツコーポレーション	13,800	2,872.00	39,633,600
フジ住宅	13,600	671.00	9,125,600
空港施設	12,100	537.00	6,497,700
明和地所	5,500	644.00	3,542,000

ゴールドクレスト	10,500	1,805.00	18,952,500
リログループ	61,700	2,576.00	158,939,200
エスリード	4,600	1,550.00	7,130,000
日神グループホールディングス	17,600	454.00	7,990,400
日本エスコン	21,100	783.00	16,521,300
タカラレーベン	48,600	349.00	16,961,400
A V A N T I A	6,600	920.00	6,072,000
イオンモール	58,400	1,853.00	108,215,200
毎日コムネット	3,500	691.00	2,418,500
ファースト住建	5,000	1,107.00	5,535,000
ランド	624,600	10.00	6,246,000
カチタス	28,900	3,140.00	90,746,000
東祥	7,100	1,817.00	12,900,700
トーセイ	16,100	1,077.00	17,339,700
穴吹興産	2,700	1,672.00	4,514,400
サンフロンティア不動産	14,100	947.00	13,352,700
エフ・ジェー・ネクスト	11,600	1,145.00	13,282,000
インテリックス	2,700	552.00	1,490,400
ランドビジネス	4,400	339.00	1,491,600
サンネクスタグループ	3,800	974.00	3,701,200
グランディハウス	8,100	449.00	3,636,900
東武鉄道	123,200	3,200.00	394,240,000
相鉄ホールディングス	40,500	2,627.00	106,393,500
東急	298,100	1,450.00	432,245,000
京浜急行電鉄	151,800	1,767.00	268,230,600
小田急電鉄	189,400	3,290.00	623,126,000
京王電鉄	66,000	8,560.00	564,960,000
京成電鉄	88,600	3,980.00	352,628,000
富士急行	16,100	5,760.00	92,736,000
新京成電鉄	3,000	2,291.00	6,873,000
東日本旅客鉄道	208,100	7,691.00	1,600,497,100
西日本旅客鉄道	105,300	6,462.00	680,448,600
東海旅客鉄道	98,300	17,075.00	1,678,472,500
西武ホールディングス	142,400	1,194.00	170,025,600
鴻池運輸	19,000	1,095.00	20,805,000
西日本鉄道	32,800	2,960.00	97,088,000
ハマキョウレックス	9,100	3,370.00	30,667,000
サカイ引越センター	5,500	5,290.00	29,095,000
近鉄グループホールディングス	111,900	4,790.00	536,001,000
阪急阪神ホールディングス	149,300	3,720.00	555,396,000
南海電気鉄道	53,100	2,725.00	144,697,500
京阪ホールディングス	49,900	5,170.00	257,983,000
神戸電鉄	2,800	3,750.00	10,500,000
名古屋鉄道	92,100	2,838.00	261,379,800
山陽電気鉄道	8,100	2,108.00	17,074,800
トランコム	3,400	8,720.00	29,648,000
日本通運	38,800	7,720.00	299,536,000
ヤマトホールディングス	157,000	2,866.00	449,962,000
山九	28,700	4,470.00	128,289,000
日新	9,000	1,399.00	12,591,000

丸運	7,600	259.00	1,968,400
丸全昭和運輸	9,100	3,560.00	32,396,000
センコーグループホールディングス	61,900	1,015.00	62,828,500
トナミホールディングス	2,300	5,870.00	13,501,000
ニッコンホールディングス	37,600	2,275.00	85,540,000
日本石油輸送	900	2,660.00	2,394,000
福山通運	14,400	4,530.00	65,232,000
セイノーホールディングス	83,900	1,534.00	128,702,600
エスライン	3,000	903.00	2,709,000
神奈川中央交通	2,500	3,930.00	9,825,000
日立物流	24,700	3,430.00	84,721,000
丸和運輸機関	23,600	2,136.00	50,409,600
C & F ロジホールディングス	11,400	2,036.00	23,210,400
日本郵船	93,600	2,950.00	276,120,000
商船三井	66,400	3,085.00	204,844,000
川崎汽船	34,500	1,969.00	67,930,500
NSユナイテッド海運	5,400	1,566.00	8,456,400
明治海運	12,300	410.00	5,043,000
飯野海運	52,400	434.00	22,741,600
共栄タンカー	2,200	948.00	2,085,600
九州旅客鉄道	86,400	2,554.00	220,665,600
SGホールディングス	211,700	2,572.00	544,492,400
日本航空	272,700	2,223.00	606,212,100
ANAホールディングス	302,100	2,388.50	721,565,850
パスコ	2,200	1,553.00	3,416,600
西本Wismettacホールディングス	2,600	2,790.00	7,254,000
シルバーライフ	1,600	2,121.00	3,393,600
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	1,551.00	1,706,100
一家ダイニングプロジェクト	1,100	625.00	687,500
Genky DrugStores	5,100	3,950.00	20,145,000
コア商事ホールディングス	3,300	1,371.00	4,524,300
国際紙パルプ商事	25,500	246.00	6,273,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,300	984.00	2,263,200
ブックオフグループホールディングス	6,800	882.00	5,997,600
ギフト	1,100	2,093.00	2,302,300
三菱倉庫	38,700	3,230.00	125,001,000
三井倉庫ホールディングス	11,900	2,272.00	27,036,800
住友倉庫	40,300	1,401.00	56,460,300
澁澤倉庫	6,300	2,312.00	14,565,600
ヤマタネ	5,300	1,428.00	7,568,400
東陽倉庫	16,800	345.00	5,796,000
乾汽船	5,900	991.00	5,846,900
日本トランスシティ	25,100	590.00	14,809,000
ケイヒン	1,700	1,369.00	2,327,300
中央倉庫	6,400	1,192.00	7,628,800
川西倉庫	2,100	1,181.00	2,480,100
安田倉庫	9,600	956.00	9,177,600
ファイズホールディングス	2,000	1,148.00	2,296,000
東洋埠頭	3,000	1,422.00	4,266,000

宇徳	8,500	470.00	3,995,000
上組	62,400	1,981.00	123,614,400
サンリツ	2,300	717.00	1,649,100
キムラユニティー	3,500	1,136.00	3,976,000
キューソー流通システム	2,900	1,608.00	4,663,200
近鉄エクスプレス	21,200	2,716.00	57,579,200
東海運	7,900	318.00	2,512,200
エーアイティー	7,200	1,098.00	7,905,600
内外トランスライン	4,100	1,259.00	5,161,900
ショーエイコーポレーション	2,600	1,049.00	2,727,400
日本コンセプト	3,700	1,729.00	6,397,300
TBSホールディングス	76,900	2,219.00	170,641,100
日本テレビホールディングス	96,600	1,426.00	137,751,600
朝日放送グループホールディングス	12,100	727.00	8,796,700
テレビ朝日ホールディングス	35,800	2,168.00	77,614,400
スカパーJSAATHホールディングス	76,300	496.00	37,844,800
テレビ東京ホールディングス	8,500	2,491.00	21,173,500
日本BS放送	4,100	1,177.00	4,825,700
ビジョン	14,200	999.00	14,185,800
スマートバリュー	3,100	948.00	2,938,800
USEN-NEXT HOLDINGS	4,400	1,775.00	7,810,000
ワイヤレスゲート	4,800	651.00	3,124,800
コネクシオ	6,700	1,402.00	9,393,400
日本通信	102,000	205.00	20,910,000
クロップス	2,300	794.00	1,826,200
日本電信電話	1,357,100	2,786.50	3,781,559,150
KDDI	930,400	3,337.00	3,104,744,800
ソフトバンク	1,054,500	1,418.50	1,495,808,250
光通信	13,700	21,600.00	295,920,000
エムティーアイ	11,400	884.00	10,077,600
GMOインターネット	41,500	3,250.00	134,875,000
ファイバーゲート	3,700	2,187.00	8,091,900
アйдママーケティングコミュニケーション	2,900	463.00	1,342,700
KADOKAWA	31,300	3,890.00	121,757,000
学研ホールディングス	15,600	1,715.00	26,754,000
ゼンリン	21,000	1,405.00	29,505,000
昭文社ホールディングス	4,400	466.00	2,050,400
インプレスホールディングス	10,000	195.00	1,950,000
東京電力ホールディングス	1,002,300	407.00	407,936,100
中部電力	361,800	1,349.50	488,249,100
関西電力	448,000	1,070.00	479,360,000
中国電力	170,700	1,311.00	223,787,700
北陸電力	108,100	702.00	75,886,200
東北電力	276,800	937.00	259,361,600
四国電力	98,200	759.00	74,533,800
九州電力	261,000	943.00	246,123,000
北海道電力	110,300	470.00	51,841,000
沖縄電力	23,000	1,447.00	33,281,000

電源開発	94,000	1,755.00	164,970,000
エフオン	7,200	1,121.00	8,071,200
イーレックス	17,300	1,757.00	30,396,100
レノバ	19,900	3,740.00	74,426,000
東京瓦斯	227,300	2,321.50	527,676,950
大阪瓦斯	214,100	2,018.00	432,053,800
東邦瓦斯	58,100	6,560.00	381,136,000
北海道瓦斯	6,600	1,635.00	10,791,000
広島ガス	25,400	386.00	9,804,400
西部瓦斯	13,300	2,993.00	39,806,900
静岡ガス	33,500	990.00	33,165,000
メタウォーター	13,400	2,303.00	30,860,200
アイネット	6,000	1,528.00	9,168,000
松竹	7,600	15,380.00	116,888,000
東宝	68,500	4,225.00	289,412,500
エイチ・アイ・エス	16,400	2,059.00	33,767,600
東映	3,800	20,170.00	76,646,000
ラックランド	3,200	2,393.00	7,657,600
エヌ・ティ・ティ・データ	309,000	1,677.00	518,193,000
共立メンテナンス	18,700	3,915.00	73,210,500
イチネンホールディングス	11,800	1,356.00	16,000,800
建設技術研究所	7,300	2,517.00	18,374,100
スペース	7,700	823.00	6,337,100
長 大	4,500	1,598.00	7,191,000
アインホールディングス	16,900	7,250.00	122,525,000
燦ホールディングス	4,700	1,210.00	5,687,000
ピー・シー・エー	1,700	4,490.00	7,633,000
スバル興業	700	8,150.00	5,705,000
東京テアトル	4,600	1,308.00	6,016,800
タナベ経営	2,200	1,410.00	3,102,000
ビジネスブレイン太田昭和	4,000	1,809.00	7,236,000
ナガワ	3,600	11,490.00	41,364,000
よみうりランド	600	6,030.00	3,618,000
東京都競馬	7,300	4,590.00	33,507,000
常磐興産	4,700	1,361.00	6,396,700
カナモト	19,900	2,411.00	47,978,900
東京ドーム	44,500	1,297.00	57,716,500
D T S	24,000	2,420.00	58,080,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	49,500	7,010.00	346,995,000
シーイーシー	12,200	1,449.00	17,677,800
カブコン	49,700	6,840.00	339,948,000
西尾レントオール	10,400	2,603.00	27,071,200
アイ・エス・ビー	5,300	1,365.00	7,234,500
アゴラ・ホスピタリティ・グループ	71,200	27.00	1,922,400
日本空港ビルデング	37,200	5,700.00	212,040,000
トランス・コスモス	10,800	2,868.00	30,974,400
乃村工藝社	48,300	828.00	39,992,400
ジャステック	7,300	1,249.00	9,117,700

SCSK	26,800	6,680.00	179,024,000
藤田観光	4,400	1,657.00	7,290,800
KNT-CTホールディングス	6,000	1,019.00	6,114,000
日本管財	12,200	2,099.00	25,607,800
トーカイ	11,000	2,244.00	24,684,000
白洋舎	1,000	2,427.00	2,427,000
セコム	111,300	10,245.00	1,140,268,500
日本システムウエア	3,800	2,085.00	7,923,000
セントラル警備保障	5,400	3,520.00	19,008,000
アイネス	11,300	1,393.00	15,740,900
丹青社	21,100	808.00	17,048,800
メイテック	13,800	5,590.00	77,142,000
TKC	9,800	7,250.00	71,050,000
富士ソフト	12,300	5,730.00	70,479,000
応用地質	13,200	1,319.00	17,410,800
船井総研ホールディングス	23,100	2,586.00	59,736,600
NSD	37,300	2,037.00	75,980,100
進学会ホールディングス	4,900	490.00	2,401,000
丸紅建材リース	900	1,839.00	1,655,100
オオバ	7,900	750.00	5,925,000
コナミホールディングス	42,100	7,350.00	309,435,000
いであ	2,700	1,809.00	4,884,300
学究社	3,400	1,421.00	4,831,400
ベネッセホールディングス	41,400	2,242.00	92,818,800
イオンディライト	13,900	2,949.00	40,991,100
ナック	5,600	984.00	5,510,400
福井コンピュータホールディングス	5,300	3,945.00	20,908,500
ダイセキ	18,900	3,420.00	64,638,000
ステップ	4,300	1,561.00	6,712,300
日鉄物産	8,300	3,865.00	32,079,500
泉州電業	3,300	3,340.00	11,022,000
元気寿司	3,200	2,532.00	8,102,400
トラスコ中山	26,700	2,871.00	76,655,700
ヤマダホールディングス	390,200	550.00	214,610,000
オートバックスセブン	43,200	1,427.00	61,646,400
モリト	9,000	618.00	5,562,000
アークランドサカモト	18,200	1,555.00	28,301,000
ニトリホールディングス	46,300	20,605.00	954,011,500
グルメ杵屋	8,400	1,013.00	8,509,200
愛眼	7,600	233.00	1,770,800
ケーユーホールディングス	6,000	848.00	5,088,000
吉野家ホールディングス	38,200	2,224.00	84,956,800
加藤産業	16,900	3,590.00	60,671,000
北恵	3,200	939.00	3,004,800
イノテック	6,600	1,221.00	8,058,600
イエローハット	21,900	1,794.00	39,288,600
松屋フーズホールディングス	5,600	3,665.00	20,524,000
JBCホールディングス	7,800	1,517.00	11,832,600
JKホールディングス	10,700	854.00	9,137,800
サガミホールディングス	15,700	1,217.00	19,106,900

日伝	9,700	2,246.00	21,786,200	
関西スーパーマーケット	8,800	1,184.00	10,419,200	
ミロク情報サービス	11,500	2,231.00	25,656,500	
北沢産業	7,300	265.00	1,934,500	
杉本商事	5,900	2,383.00	14,059,700	
因幡電機産業	31,100	2,532.00	78,745,200	
王将フードサービス	7,700	6,020.00	46,354,000	
プレナス	13,200	1,999.00	26,386,800	
ミニストップ	8,700	1,459.00	12,693,300	
アークス	22,100	2,409.00	53,238,900	
パローホールディングス	23,800	2,547.00	60,618,600	
東テク	3,900	2,849.00	11,111,100	
ミスミグループ本社	146,000	3,600.00	525,600,000	
藤久	2,700	785.00	2,119,500	
アルテック	8,800	287.00	2,525,600	
ベルク	5,800	6,110.00	35,438,000	
大 庄	6,300	1,061.00	6,684,300	
タキヒヨー	4,000	2,014.00	8,056,000	
ファーストリテイリング	15,600	93,630.00	1,460,628,000	
ソフトバンクグループ	920,500	9,485.00	8,730,942,500	
蔵王産業	1,900	1,395.00	2,650,500	
スズケン	49,300	4,305.00	212,236,500	
サンドラッグ	43,800	4,380.00	191,844,000	
サックスパー ホールディングス	10,000	590.00	5,900,000	
ジェコス	8,200	974.00	7,986,800	
ヤマザワ	2,600	1,752.00	4,555,200	
やまや	2,500	2,231.00	5,577,500	
グローセル	12,900	509.00	6,566,100	
ベルーナ	25,000	1,054.00	26,350,000	
合計	124,117,800		311,274,068,500	

(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15期中間計算期間(2021年2月9日から2021年8月8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】

【One DC 国内株式インデックスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第14期 2021年2月8日現在	第15期中間計算期間末 2021年8月8日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	63,865,324
コール・ローン	158,721,109	198,815,165
親投資信託受益証券	49,848,126,418	57,081,653,957
未収入金	23,068,000	-
流動資産合計	50,029,915,527	57,344,334,446
資産合計	50,029,915,527	57,344,334,446
負債の部		
流動負債		
未払解約金	146,083,004	188,940,852
未払受託者報酬	4,799,305	5,823,822
未払委託者報酬	28,796,086	34,943,194
未払利息	-	346
その他未払費用	250,214	284,120
流動負債合計	179,928,609	229,992,334
負債合計	179,928,609	229,992,334
純資産の部		
元本等		
元本	32,473,165,156	36,725,440,128
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	17,376,821,762	20,388,901,984
(分配準備積立金)	9,729,009,068	8,743,582,108
元本等合計	49,849,986,918	57,114,342,112
純資産合計	49,849,986,918	57,114,342,112
負債純資産合計	50,029,915,527	57,344,334,446

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第14期中間計算期間 自 2020年2月8日 至 2020年8月7日	第15期中間計算期間 自 2021年2月9日 至 2021年8月8日
営業収益		
受取利息	-	78
有価証券売買等損益	3,321,399,798	668,511,539
営業収益合計	3,321,399,798	668,511,617
営業費用		
支払利息	32,949	16,258
受託者報酬	3,836,565	5,823,822
委託者報酬	23,019,623	34,943,194
その他費用	216,781	284,120
営業費用合計	27,105,918	41,067,394
営業利益又は営業損失()	3,348,505,716	627,444,223
経常利益又は経常損失()	3,348,505,716	627,444,223
中間純利益又は中間純損失()	3,348,505,716	627,444,223
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()	644,216,995	66,139,195
期首剰余金又は期首欠損金()	9,805,325,888	17,376,821,762
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,291,598,383	4,408,819,098
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	1,291,598,383	4,408,819,098
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,494,476,613	1,958,043,904
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,494,476,613	1,958,043,904
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()	6,898,158,937	20,388,901,984

(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15期中間計算期間	
	自 2021年2月9日	至 2021年8月8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2月7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2021年2月8日、当中間計算期間末日を2021年8月8日としております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第14期	第15期中間計算期間末
	2021年2月8日現在	2021年8月8日現在
1. 期首元本額	27,912,059,019円	32,473,165,156円
期中追加設定元本額	13,421,884,000円	7,898,635,254円
期中一部解約元本額	8,860,777,863円	3,646,360,282円
2. 受益権の総数	32,473,165,156口	36,725,440,128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14期	第15期中間計算期間末
	2021年2月8日現在	2021年8月8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14期 2021年2月8日現在	第15期中間計算期間末 2021年8月8日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,5351円 (15,351円)	1,5552円 (15,552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8月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		7,658,045,388
株式		385,657,795,660
派生商品評価勘定		19,284,610
未収配当金		377,969,616
前払金		30,028,100
差入委託証拠金		305,280,000
流動資産合計		394,048,403,374
資産合計		394,048,403,374
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		30,075,200
未払金		199,560
未払解約金		934,947,000
未払利息		13,372
流動負債合計		965,235,132
負債合計		965,235,132
純資産の部		
元本等		
元本		124,257,774,580
剰余金		
剰余金又は欠損金()		268,825,393,662
元本等合計		393,083,168,242
純資産合計		393,083,168,242
負債純資産合計		394,048,403,374

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年2月9日 至 2021年8月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年8月8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	102,105,610,506円
同期中追加設定元本額	66,623,424,864円
同期中一部解約元本額	44,471,260,790円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	638,707,013円
MHAM TOPIXオープン	2,731,091,474円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	6,898,056,801円
One DC 国内株式インデックスファンド	18,044,399,683円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,474,052,156円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,203,380円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	12,853,838円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	14,252,458円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	27,768,354円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	20,863,020円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	14,798,618円
たわらノーロード TOPIX	1,074,552,520円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	835,842,561円
たわらノーロード バランス(堅実型)	32,499,384円
たわらノーロード バランス(標準型)	201,047,070円
たわらノーロード バランス(積極型)	304,443,871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)	2,223,859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)	147,336,942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)	365,360,945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)	239,798,807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)	351,031,657円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	688,195円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,007,134円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	20,605,215円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,365,239円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	13,199,117円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,732,678,428円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,038,340,231円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,383,131,872円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,577,571,074円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	335,853,030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	1,107,920,794円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	31,447,514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	18,322,288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)	289,126,384円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	513,561,966円
投資のソムリエ	16,587,524,220円
クルーズコントロール	405,048,101円
投資のソムリエ<DC年金>	870,933,905円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	290,485,480円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	442,054,733円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	3,323,107円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	9,106,965円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	471,706,296円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,673,953,575円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	28,503,090円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	14,287,131円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,487,868円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	67,722,288円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	141,108,558円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,062,446,034円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	269,764,524円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	21,701,092円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	10,486,648円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	8,526,328円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	44,943,934円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	91,224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)	24,333,587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)	29,792,402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)	49,670,055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)	15,115,934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)	23,724,989円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	53,233,500円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-05(適格機関投資家限定)	88,868,794円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	87,327,181円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-07(適格機関投資家限定)	142,526,091円

投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	427,171,527円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	36,886,093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)	176,468,152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)	39,969,665円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(F O F s用)(適格機関投資家専用)	28,457円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	63,250,452円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	108,062,890円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	6,117,262円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	29,831,738円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,705,267円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,026,552円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	14,138,893円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	38,492,921円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	619,953,536円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	683,954,724円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,949,108,352円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	51,441,884円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	34,268,583円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	331,533,214円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	84,174,459円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,607,354円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	405,877,526円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	23,643,684円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	88,576,740円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	200,574,348円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	294,438,364円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	41,054,743円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	19,096,822円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	321,266,809円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	992,662,363円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,314,318,490円
D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	52,594,563円
動的パッケージファンド<DC年金>	20,462,695円
コア資産形成ファンド	16,425,966円
MHAMトピックスファンド	651,426,049円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	67,529,461円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	2,992,356,855円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,150,278,085円
計	124,257,774,580円

2. 受益権の総数

124,257,774,580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8月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2021年8月8日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引				
先物取引				
買建	7,406,394,200	-	7,395,730,000	10,664,200
合計	7,406,394,200	-	7,395,730,000	10,664,200

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

- 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年8月8日現在
1口当たり純資産額	3.1634円
（1万口当たり純資産額）	（31,634円）

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年8月31日現在

資産総額	58,874,862,810円
負債総額	128,176,618円
純資産総額(-)	58,746,686,192円
発行済数量	37,165,489,699口
1口当たり純資産額(/)	1.5807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8月31日現在

資産総額	408,098,363,746円
負債総額	5,521,618,322円
純資産総額(-)	402,576,745,424円
発行済数量	125,194,135,504口
1口当たり純資産額(/)	3.2156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8月31日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2021年8月31日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年8月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,416,324,156,163
追加型株式投資信託	830	15,897,211,446,199
単位型公社債投資信託	28	61,097,291,401
単位型株式投資信託	217	1,337,529,201,064
合計	1,101	18,712,162,094,827

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おります。

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

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

5【その他】

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

2021年3月末日現在 247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社武蔵野銀行	45,743	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社京葉銀行	49,759	日本において銀行業務を営んでおります。
信金中央金庫	() 690,998	日本において全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の受給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
松井証券株式会社	11,945	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2021年3月末日現在

() 出資の総額

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集販売の取扱い
- (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

2021年3月19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 長谷川 敬 印
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているOne DC 国内株式インデックスファンドの2020年2月8日から2021年2月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、One DC 国内株式インデックスファンドの2021年2月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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9月17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
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One DC 国内株式インデックスファンドの2021年2月9日から2021年8月8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、One DC 国内株式インデックスファンドの2021年8月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年2月9日から2021年8月8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。