

【表紙】

| | |
|---|-----------------------------|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長 |
| 【提出日】 | 平成29年5月2日 |
| 【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 西 恵正 |
| 【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】 | 三木谷 正直 |
| 【電話番号】 | 03-6774-5100 |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 | D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金> |
| 【届出の対象とした募集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】

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の基準価額 とします。

収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位(当初元本1口=1円)

収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位となります。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：平成29年5月3日から平成30年5月7日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

(9) 【払込期日】

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとし、各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を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。

(10) 【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

・株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

お申込みの方法

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

振替受益権について

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

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

(参考)

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

<ファンドの特色>

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

東証株価指数(TOPIX)とは

東証株価指数(TOPIX)とは、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、東京証券取引所が公表する株式指数で、東京証券取引所第1部に上場されている全ての株式の時価総額で加重平均し、指数化したものです。

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」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利および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、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若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、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの引用に関して得られる結果について、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、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用を行いますが、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。

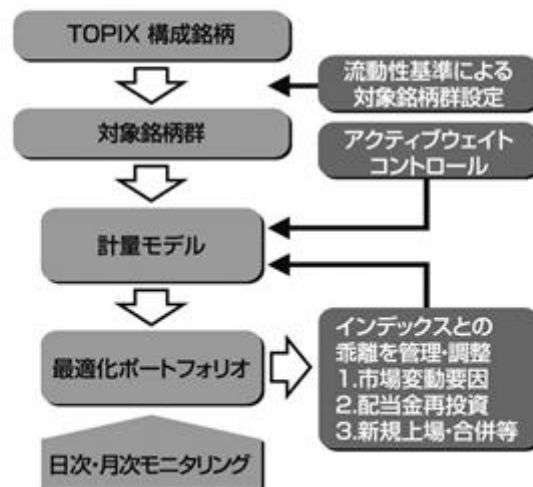
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。

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

株東京証券取引所は、当社又は国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、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国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドおよび国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンドに投資するファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

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



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

分配方針

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

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

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

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

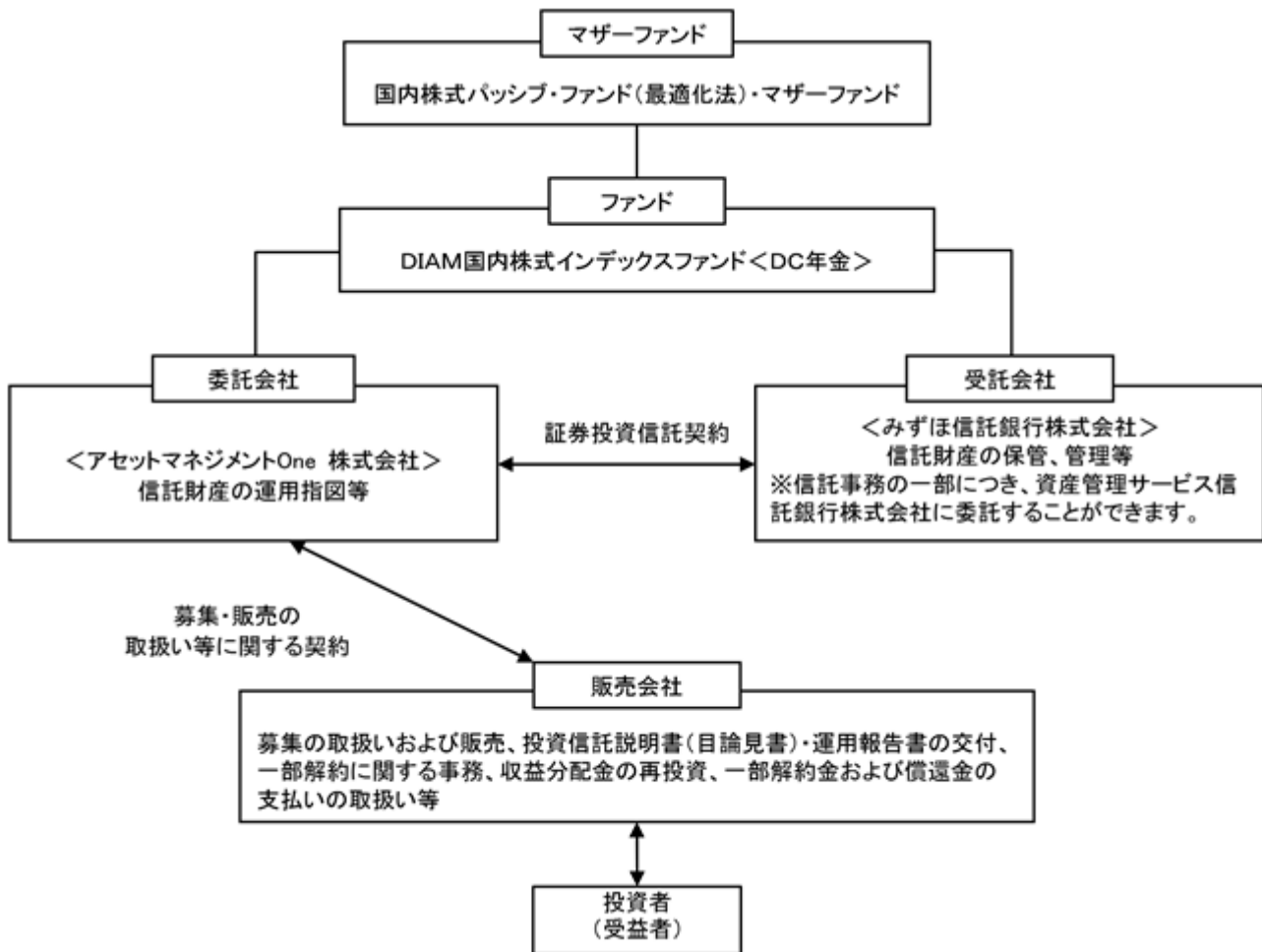
| | |
|---------------------------|--|
| その他資産 (投資信託証券 (株式)) | 目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として株式へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。 (注) 商品分類表の投資対象資産は株式に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産(投資信託証券(株式))に分類されます。 |
| 年1回 | 目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。 |
| 日本 | 目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるも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

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

(2) 【ファンドの沿革】

平成14年11月15日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
 平成17年10月 1日 信託報酬率の変更

(3) 【ファンドの仕組み】



・ 「証券投資信託契約」の概要

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

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

・ 「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

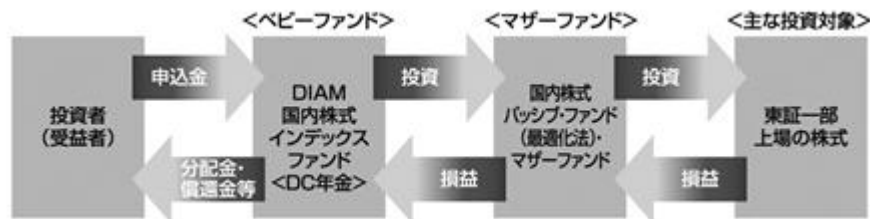
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

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

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（平成29年2月28日現在）

委託会社の沿革

- 昭和60年 7月 1日 会社設立
- 平成10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
- 平成10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
- 平成11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。
- 平成20年 1月 1日 「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更
- 平成28年10月 1日 DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

（平成29年2月28日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

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

<投資対象>

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

<投資態度>

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

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

(2) 【投資対象】

1. 投資の対象とする資産の種類(約款第15条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

b. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

2. 有価証券の指図範囲(約款第16条第1項)

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

1) 株券

2) 国債証券

3) 地方債証券

4) 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10) コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

15) 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

3. 金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

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

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

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

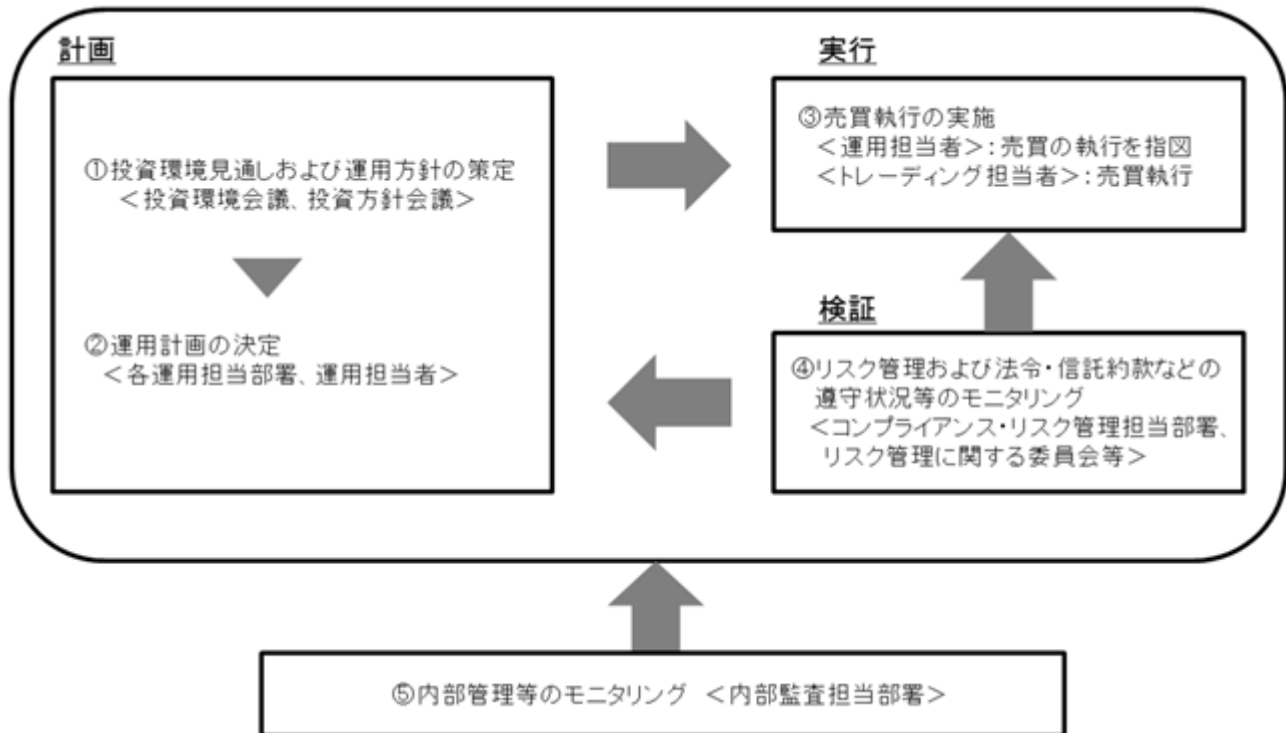
(参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

| | |
|--------|--|
| ファンド名 | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド |
| 基本方針 | この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に連動する投資成果を目標として運用を行います。 |
| 主な投資対象 | 東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。 |
| 投資態度 | <ol style="list-style-type: none">1. 主として東京証券取引所第一部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。3. 株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。 |
| 主な投資制限 | 株式への投資割合には、制限を設けません。 |

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b．ファンドの関係法人に関する管理

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

c．運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は平成29年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

収益分配方針

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

1)分配対象額の範囲

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

2)分配対象額についての分配方針

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

3)留保益の運用方針

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

収益の分配方式

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

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

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

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

b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に全額無手数料で再投資されます。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)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」(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」(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」(3)投資制限)

4) 投資する株式等の範囲(約款第18条)

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

5) 信用取引の指図範囲(約款第19条)

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡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ます。)の行使により取得可能な株券

6) 先物取引等の運用指図・目的(約款第20条)

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

7) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲(約款第21条)

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

8) デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第21条の2)

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

9) 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第22条)

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

2) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

(b) 上記(a)の1)~2)で定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(c) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。

10) 特別な場合の外貨建資産への投資制限(約款第24条)

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

11) 外貨為替予約の指図(約款第25条)

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引を指図することができます。

(b) 上記(a)の予約取引の指図は、信託財産に属する為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドに信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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

12) 資金の借入れ(約款第33条)

(a) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

(b) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

(c) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

(d) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

3【投資リスク】

<基準価額の主な変動要因>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

株価変動リスク

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

信用リスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

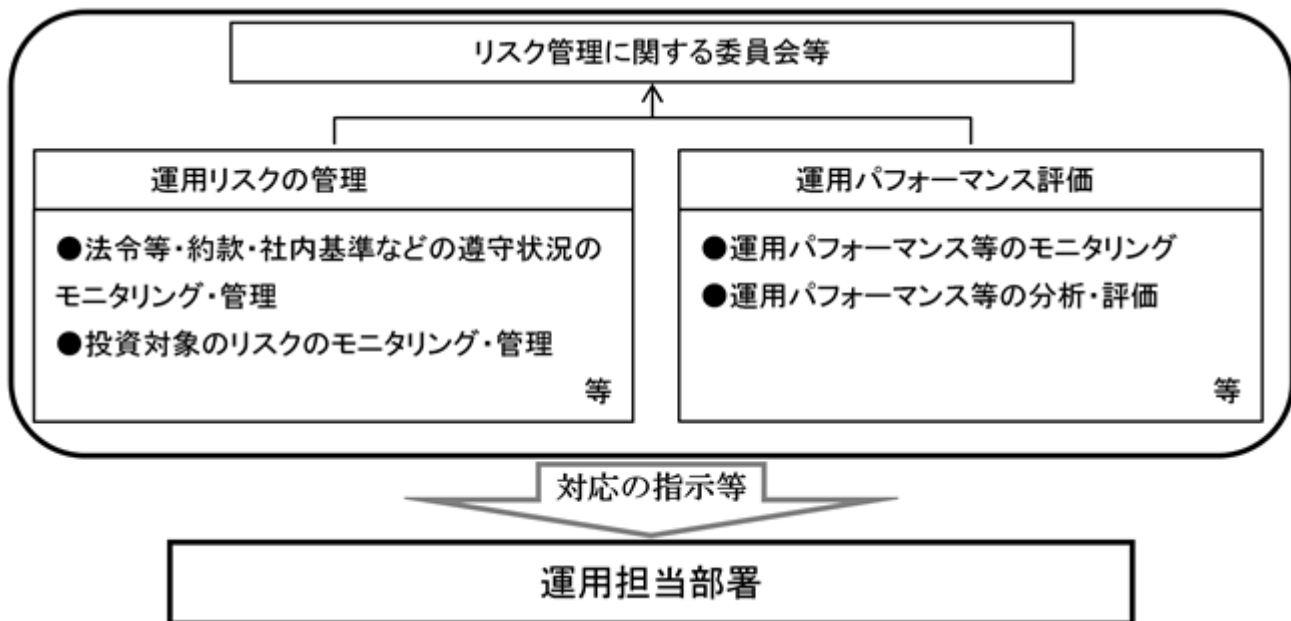
注意事項

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

< リスク管理体制 >

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

- ・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。



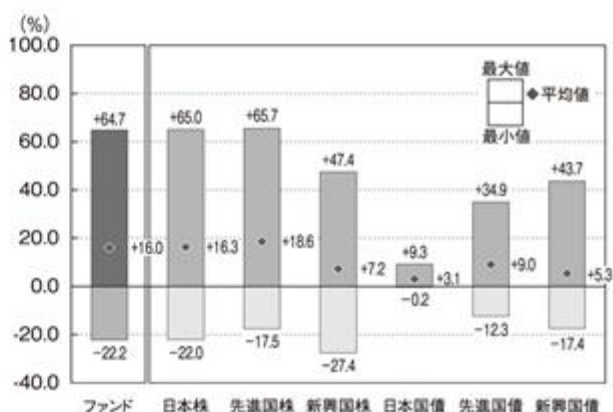
上記体制は平成29年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

＜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



2012年3月～2017年2月

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

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

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

* 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

- 日本株…東証株価指数(TOPIX) (配当込み)
 - 先進国株…MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)
 - 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)
 - 日本国債…NOMURA-BPI国債
 - 先進国債…シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
 - 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)
- (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、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所 (株東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。
- 「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。
- 「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。
- 「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。
- 「シティ世界国債インデックス (除く日本)」は、シティグループ・インデックスLLCが開発した債券指数で、日本を除く世界主要国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シティグループ・インデックスLLCに帰属します。
- 「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。

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0.2376%（税抜0.22%）

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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

イ. 信託財産留保額

ありません。

ロ. その他の費用

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

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

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

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額ならびに外貨建資産の保管等に関する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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、平成29年2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】

平成29年2月28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 | 83,227,549,845 | 100.00 |
| 内 日本 | 83,227,549,845 | 100.00 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 1,448,479 | 0.00 |
| 純資産総額 | 83,226,101,366 | 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

平成29年2月28日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 株式 | 280,876,308,590 | 98.34 |
| 内 日本 | 280,876,308,590 | 98.34 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 4,729,479,775 | 1.66 |
| 純資産総額 | 285,605,788,365 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成29年2月28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） | 4,479,280,000 | 1.57 |
| 内 日本 | 4,479,280,000 | 1.57 |

（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】

平成29年2月28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 | 36,625,395,989 | 2.2429 82,150,731,115 | 2.2724 83,227,549,845 | - - | 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

平成29年2月28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

平成29年2月28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 | 1,526,000 | 6,346.00 9,683,996,000 | 6,365.00 9,712,990,000 | - - | 3.40% |
| 2 | 三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本 | 株式 銀行業 | 9,387,800 | 751.20 7,052,115,360 | 738.40 6,931,951,520 | - - | 2.43% |
| 3 | 日本電信電話 日本 | 株式 情報・通信業 | 994,500 | 4,874.00 4,847,193,000 | 4,751.00 4,724,869,500 | - - | 1.65% |
| 4 | ソフトバンクグループ 日本 | 株式 情報・通信業 | 557,700 | 8,664.00 4,831,912,800 | 8,362.00 4,663,487,400 | - - | 1.63% |
| 5 | 三井住友フィナンシャルグ ループ 日本 | 株式 銀行業 | 992,000 | 4,479.00 4,443,168,000 | 4,377.00 4,341,984,000 | - - | 1.52% |
| 6 | 本田技研工業 日本 | 株式 輸送用機器 | 1,129,500 | 3,541.00 3,999,559,500 | 3,489.00 3,940,825,500 | - - | 1.38% |
| 7 | KDDI 日本 | 株式 情報・通信業 | 1,225,600 | 2,947.00 3,611,843,200 | 2,939.00 3,602,038,400 | - - | 1.26% |
| 8 | みずほフィナンシャルグ ループ 日本 | 株式 銀行業 | 16,819,100 | 208.50 3,506,782,350 | 209.70 3,526,965,270 | - - | 1.23% |
| 9 | ソニー 日本 | 株式 電気機器 | 886,200 | 3,599.00 3,189,433,800 | 3,478.00 3,082,203,600 | - - | 1.08% |

| | | | | | | | |
|----|-----------------------|------------------|-----------|----------------------------|----------------------------|--------|-------|
| 10 | 日本たばこ産業 日本 | 株式 食料品 | 779,500 | 3,632.00 2,831,144,000 | 3,757.00 2,928,581,500 | - - | 1.03% |
| 11 | ファナック 日本 | 株式 電気機器 | 127,300 | 21,565.00 2,745,224,500 | 22,125.00 2,816,512,500 | - - | 0.99% |
| 12 | 武田薬品工業 日本 | 株式 医薬品 | 492,900 | 5,021.00 2,474,850,900 | 5,222.00 2,573,923,800 | - - | 0.90% |
| 13 | キーエンス 日本 | 株式 電気機器 | 56,900 | 43,880.00 2,496,772,000 | 43,460.00 2,472,874,000 | - - | 0.87% |
| 14 | 東京海上ホールディングス 日本 | 株式 保険業 | 501,900 | 4,705.00 2,361,439,500 | 4,919.00 2,468,846,100 | - - | 0.86% |
| 15 | NTTドコモ 日本 | 株式 情報・通信業 | 925,700 | 2,690.00 2,490,133,000 | 2,667.00 2,468,841,900 | - - | 0.86% |
| 16 | 東日本旅客鉄道 日本 | 株式 陸運業 | 242,800 | 9,995.00 2,426,786,000 | 10,155.00 2,465,634,000 | - - | 0.86% |
| 17 | 三菱商事 日本 | 株式 卸売業 | 929,600 | 2,541.00 2,362,113,600 | 2,534.50 2,356,071,200 | - - | 0.82% |
| 18 | セブン&アイ・ホールディングス 日本 | 株式 小売業 | 518,500 | 4,428.00 2,295,918,000 | 4,400.00 2,281,400,000 | - - | 0.80% |
| 19 | 信越化学工業 日本 | 株式 化学 | 235,800 | 9,505.00 2,241,279,000 | 9,503.00 2,240,807,400 | - - | 0.78% |
| 20 | キヤノン 日本 | 株式 電気機器 | 675,700 | 3,252.00 2,197,376,400 | 3,281.00 2,216,971,700 | - - | 0.78% |
| 21 | 三菱電機 日本 | 株式 電気機器 | 1,338,900 | 1,608.50 2,153,620,650 | 1,647.50 2,205,837,750 | - - | 0.77% |
| 22 | 村田製作所 日本 | 株式 電気機器 | 131,700 | 15,385.00 2,026,204,500 | 16,150.00 2,126,955,000 | - - | 0.74% |
| 23 | アステラス製薬 日本 | 株式 医薬品 | 1,343,100 | 1,490.50 2,001,890,550 | 1,512.00 2,030,767,200 | - - | 0.71% |
| 24 | 三菱地所 日本 | 株式 不動産業 | 921,000 | 2,194.50 2,021,134,500 | 2,195.00 2,021,595,000 | - - | 0.71% |
| 25 | ブリヂストン 日本 | 株式 ゴム製品 | 443,600 | 4,054.00 1,798,354,400 | 4,481.00 1,987,771,600 | - - | 0.70% |
| 26 | 花王 日本 | 株式 化学 | 333,900 | 5,863.00 1,957,655,700 | 5,801.00 1,936,953,900 | - - | 0.68% |
| 27 | 三井物産 日本 | 株式 卸売業 | 1,120,100 | 1,654.00 1,852,645,400 | 1,719.00 1,925,451,900 | - - | 0.67% |
| 28 | 東海旅客鉄道 日本 | 株式 陸運業 | 104,400 | 17,995.00 1,878,678,000 | 18,380.00 1,918,872,000 | - - | 0.67% |
| 29 | 日立製作所 日本 | 株式 電気機器 | 3,014,000 | 672.30 2,026,312,200 | 618.80 1,865,063,200 | - - | 0.65% |
| 30 | 野村ホールディングス 日本 | 株式 証券、商品先物取引業 | 2,532,800 | 737.10 1,866,926,880 | 729.30 1,847,171,040 | - - | 0.65% |

(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

平成29年2月28日現在

| 種類 | 投資比率 |
|----|--------|
| 株式 | 98.34% |
| 合計 | 98.34% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成29年2月28日現在

| 業種 | 国内/外国 | 投資比率 |
|------------|--------|--------|
| 電気機器 | 国内 | 12.34% |
| 輸送用機器 | | 9.12% |
| 銀行業 | | 8.37% |
| 情報・通信業 | | 7.67% |
| 化学 | | 6.64% |
| 機械 | | 5.02% |
| 医薬品 | | 4.67% |
| 小売業 | | 4.55% |
| 卸売業 | | 4.50% |
| 食料品 | | 4.36% |
| 陸運業 | | 4.12% |
| サービス業 | | 3.65% |
| 建設業 | | 2.86% |
| 保険業 | | 2.70% |
| 不動産業 | | 2.45% |
| 電気・ガス業 | | 1.75% |
| その他製品 | | 1.71% |
| 精密機器 | | 1.51% |
| 鉄鋼 | | 1.33% |
| その他金融業 | | 1.24% |
| 証券、商品先物取引業 | | 1.22% |
| ガラス・土石製品 | | 0.98% |
| 非鉄金属 | | 0.97% |
| ゴム製品 | | 0.94% |
| 繊維製品 | | 0.71% |
| 金属製品 | | 0.70% |
| 空運業 | | 0.57% |
| 石油・石炭製品 | | 0.55% |
| 鋳業 | | 0.33% |
| パルプ・紙 | | 0.25% |
| 海運業 | | 0.25% |
| 倉庫・運輸関連業 | 0.20% | |
| 水産・農林業 | 0.11% | |
| 合計 | 98.34% | |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【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

平成29年2月28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 2903月 | 買建 | 292 | 4,442,084,764 | 4,479,280,000 | 1.57% |

(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(平成29年2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 (平成20年2月7日) | 30,110 | 30,110 | 1.6674 | 1.6674 |
| 第6計算期間末 (平成21年2月9日) | 22,737 | 22,737 | 1.0115 | 1.0115 |
| 第7計算期間末 (平成22年2月8日) | 31,206 | 31,206 | 1.1660 | 1.1660 |
| 第8計算期間末 (平成23年2月7日) | 38,104 | 38,104 | 1.2631 | 1.2631 |
| 第9計算期間末 (平成24年2月7日) | 35,526 | 35,526 | 1.0602 | 1.0602 |
| 第10計算期間末 (平成25年2月7日) | 49,488 | 49,488 | 1.3587 | 1.3587 |
| 第11計算期間末 (平成26年2月7日) | 61,898 | 61,898 | 1.6948 | 1.6948 |
| 第12計算期間末 (平成27年2月9日) | 73,449 | 73,449 | 2.0668 | 2.0668 |
| 第13計算期間末 (平成28年2月8日) | 76,274 | 76,274 | 2.0357 | 2.0357 |
| 第14計算期間末 (平成29年2月7日) | 82,440 | 82,440 | 2.2799 | 2.2799 |
| 平成28年2月末日 | 71,836 | - | 1.9139 | - |
| 3月末日 | 75,801 | - | 2.0056 | - |
| 4月末日 | 75,239 | - | 1.9951 | - |
| 5月末日 | 78,116 | - | 2.0540 | - |
| 6月末日 | 70,688 | - | 1.8568 | - |
| 7月末日 | 75,422 | - | 1.9715 | - |
| 8月末日 | 76,172 | - | 1.9816 | - |
| 9月末日 | 76,601 | - | 1.9875 | - |
| 10月末日 | 80,436 | - | 2.0928 | - |
| 11月末日 | 83,738 | - | 2.2077 | - |
| 12月末日 | 84,112 | - | 2.2839 | - |
| 平成29年1月末日 | 82,941 | - | 2.2881 | - |
| 2月末日 | 83,226 | - | 2.3096 | - |

【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 |

【収益率の推移】

| | 収益率(%) |
|---------|--------|
| 第5計算期間 | 23.7 |
| 第6計算期間 | 39.3 |
| 第7計算期間 | 15.3 |
| 第8計算期間 | 8.3 |
| 第9計算期間 | 16.1 |
| 第10計算期間 | 28.2 |
| 第11計算期間 | 24.7 |
| 第12計算期間 | 21.9 |
| 第13計算期間 | 1.5 |
| 第14計算期間 | 12.0 |

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

| | 設定口数 | 解約口数 |
|---------|----------------|----------------|
| 第5計算期間 | 8,779,618,539 | 5,384,513,066 |
| 第6計算期間 | 8,569,368,552 | 4,148,881,796 |
| 第7計算期間 | 8,901,159,838 | 4,615,887,504 |
| 第8計算期間 | 7,387,878,523 | 3,984,381,861 |
| 第9計算期間 | 8,287,509,892 | 4,947,169,536 |
| 第10計算期間 | 9,700,581,703 | 6,785,126,872 |
| 第11計算期間 | 16,783,744,888 | 16,684,231,460 |
| 第12計算期間 | 12,348,095,889 | 13,334,064,929 |
| 第13計算期間 | 15,836,928,730 | 13,906,095,221 |
| 第14計算期間 | 10,393,725,218 | 11,702,028,376 |

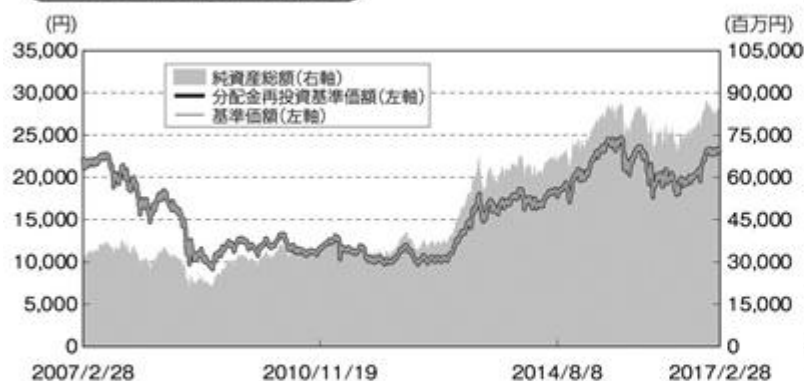
(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2017年2月28日

基準価額・純資産の推移

(2007年2月28日～2017年2月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2002年11月15日)
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移(税引前)

| | | |
|-------|--------------|----|
| 第10期 | (2013.02.07) | 0円 |
| 第11期 | (2014.02.07) | 0円 |
| 第12期 | (2015.02.09) | 0円 |
| 第13期 | (2016.02.08) | 0円 |
| 第14期 | (2017.02.07) | 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

■組入銘柄一覧 ※投資比率(%)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 | 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 | 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

※投資比率(%)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、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

| 資産の種類 | 投資比率(%) |
|-----------------------|---------|
| 株式 | 98.34 |
| 内 日本 | 98.34 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 1.66 |
| 純資産総額 | 100.00 |

その他資産の投資状況

| 資産の種類 | 投資比率(%) |
|--------------|---------|
| 株価指数先物取引(買建) | 1.57 |

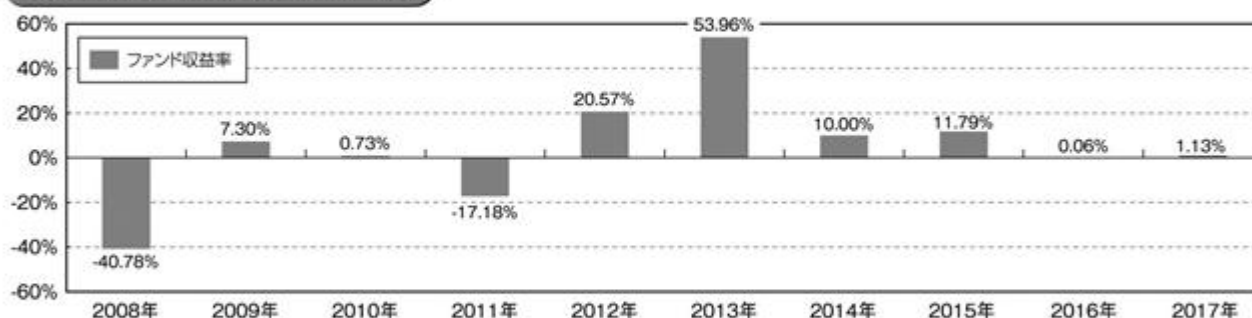
組入上位5業種(国内株式)

| 順位 | 業種 | 投資比率 |
|----|--------|--------|
| 1 | 電気機器 | 12.34% |
| 2 | 輸送用機器 | 9.12% |
| 3 | 銀行業 | 8.37% |
| 4 | 情報・通信業 | 7.67% |
| 5 | 化学 | 6.64% |

組入上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 発行国/地域 | 業種 | 投資比率 |
|----|-------------------|----|--------|--------|-------|
| 1 | トヨタ自動車 | 株式 | 日本 | 輸送用機器 | 3.40% |
| 2 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 株式 | 日本 | 銀行業 | 2.43% |
| 3 | 日本電信電話 | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 1.65% |
| 4 | ソフトバンクグループ | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 1.63% |
| 5 | 三井住友フィナンシャルグループ | 株式 | 日本 | 銀行業 | 1.52% |
| 6 | 本田技研工業 | 株式 | 日本 | 輸送用機器 | 1.38% |
| 7 | KDDI | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 1.26% |
| 8 | みずほフィナンシャルグループ | 株式 | 日本 | 銀行業 | 1.23% |
| 9 | ソニー | 株式 | 日本 | 電気機器 | 1.08% |
| 10 | 日本たばこ産業 | 株式 | 日本 | 食料品 | 1.03% |

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
 ※2017年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みの方法

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

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

お申込価額（発行価格）

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

お申込単位

1円以上1円単位(当初元本1口=1円)

収益分配金を再投資する場合は、1口以上1口単位とします。

お申込手数料

ありません。

払込期日

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

2【換金(解約)手続等】

解約のお申込み方法

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

委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

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

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

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

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

解約価額

解約価額は、解約請求受付日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ：URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

（2）【保管】

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、受益証券を発行しませんので、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

信託期間は平成14年11月15日から原則として無期限です。

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

(4) 【計算期間】

a. 計算期間は原則として毎年2月8日から翌年2月7日までとします。

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

(5) 【その他】

イ. 償還規定

- a. 委託会社は信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- b. 委託会社は、信託終了前にこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。委託会社はかかる事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- c. 委託会社は上記a. b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記a. b.につき、上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- e. 委託会社は信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 上記c. ~ e.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記c.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- g. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

- h. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- i. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- j. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ロ. 信託約款の変更

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

八．関係法人との契約の更改

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

二．公告

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

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

ホ．運用報告書

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

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

収益分配金請求権

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

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

償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

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(平成28年2月9日から平成29年2月7日まで)の財務諸表について、PWCあらた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】

D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第13期 平成28年2月8日現在 | 第14期 平成29年2月7日現在 |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 298,233,769 | 353,531,624 |
| 親投資信託受益証券 | 76,272,395,045 | 82,430,214,672 |
| 未収入金 | - | 37,000,000 |
| 流動資産合計 | 76,570,628,814 | 82,820,746,296 |
| 資産合計 | 76,570,628,814 | 82,820,746,296 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 196,968,807 | 284,271,739 |
| 未払受託者報酬 | 13,211,830 | 13,006,847 |
| 未払委託者報酬 | 83,675,190 | 82,376,989 |
| その他未払費用 | 2,091,784 | 785,253 |
| 流動負債合計 | 295,947,611 | 380,440,828 |
| 負債合計 | 295,947,611 | 380,440,828 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 37,468,044,034 | 1 36,159,740,876 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 38,806,637,169 | 46,280,564,592 |
| （分配準備積立金） | 11,931,069,673 | 14,639,438,277 |
| 元本等合計 | 76,274,681,203 | 82,440,305,468 |
| 純資産合計 | 76,274,681,203 | 82,440,305,468 |
| 負債純資産合計 | 76,570,628,814 | 82,820,746,296 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第13期 自 平成27年2月10日 至 平成28年2月8日 | 第14期 自 平成28年2月9日 至 平成29年2月7日 |
|---|-------------------------------------|------------------------------------|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 194,086 | 3,388 |
| 有価証券売買等損益 | 1,124,847,839 | 9,602,985,627 |
| 営業収益合計 | 1,124,653,753 | 9,602,989,015 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | - | 178,763 |
| 受託者報酬 | 26,172,218 | 24,909,687 |
| 委託者報酬 | 165,757,955 | 157,761,919 |
| その他費用 | 4,143,759 | 1,843,342 |
| 営業費用合計 | 196,073,932 | 184,693,711 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 1,320,727,685 | 9,418,295,304 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 1,320,727,685 | 9,418,295,304 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | 1,320,727,685 | 9,418,295,304 |
| 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（ ） | 2,461,053,579 | 749,945,756 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 37,912,403,493 | 38,806,637,169 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 20,062,207,144 | 10,845,701,215 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 20,062,207,144 | 10,845,701,215 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 15,386,192,204 | 12,040,123,340 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 15,386,192,204 | 12,040,123,340 |
| 分配金 | 1 - | 1 - |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 38,806,637,169 | 46,280,564,592 |

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|----------------------------|---|
| 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、前計算期間末日を平成28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 平成28年2月8日現在 | 第14期 平成29年2月7日現在 |
|--------------------------------------|---|---|
| 1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額 | 35,537,210,525円 15,836,928,730円 13,906,095,221円 | 37,468,044,034円 10,393,725,218円 11,702,028,376円 |
| 2. 受益権の総数 | 37,468,044,034口 | 36,159,740,876口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第13期 自 平成27年2月10日 至 平成28年2月8日 | 第14期 自 平成28年2月9日 至 平成29年2月7日 |
|---------------|---|--|
| 1. 1 分配金の計算過程 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(27,848,920,821円)及び分配準備積立金(11,931,069,673円)より分配対象収益は39,779,990,494円(1万口当たり10,617.04円)ですが、分配を行っておりません。 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(5,897,616,510円)、信託約款に規定される収益調整金(31,641,281,283円)及び分配準備積立金(8,741,821,767円)より分配対象収益は46,280,719,560円(1万口当たり12,798.96円)ですが、分配を行っておりません。 |

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 第13期 自 平成27年2月10日 至 平成28年2月8日 | 第14期 自 平成28年2月9日 至 平成29年2月7日 |
|--------------------------|--|------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 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、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 | 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 平成28年2月8日現在 | 第14期 平成29年2月7日現在 |
|----------------------------|---|---------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 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 平成28年2月8日現在 | 第14期 平成29年2月7日現在 |
|-----------|---------------------------|---------------------------|
| | 当期の 損益に含まれた 評価差額(円) | 当期の 損益に含まれた 評価差額(円) |
| 親投資信託受益証券 | 2,080,479,791 | 9,173,111,631 |
| 合計 | 2,080,479,791 | 9,173,111,631 |

(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 平成28年2月8日現在 | 第14期 平成29年2月7日現在 |
|--------------|---------------------|---------------------|
| 1口当たり純資産額 | 2.0357円 | 2.2799円 |
| (1万口当たり純資産額) | (20,357円) | (22,799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

平成29年2月7日現在

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 (円) | 評価額 (円) | 備考 |
|-----------|---------------------------------|----------------|----------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化 法)・マザーファンド | 36,751,622,753 | 82,430,214,672 | |
| 親投資信託受益証券 | 合計 | 36,751,622,753 | 82,430,214,672 | |
| 合計 | | 36,751,622,753 | 82,430,214,672 | |

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」の状況

貸借対照表

（単位：円）

| 科 目 | 注記 番号 | 平成28年2月8日現在 | 平成29年2月7日現在 |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| コール・ローン | | 5,429,529,564 | 6,578,745,130 |
| 株式 | 2 | 281,831,760,820 | 277,454,420,930 |
| 未収入金 | | 33,300,100 | - |
| 未収配当金 | | 387,169,296 | 416,723,486 |
| 前払金 | | 146,427,000 | 144,461,700 |
| 流動資産合計 | | 287,828,186,780 | 284,594,351,246 |
| 資産合計 | | 287,828,186,780 | 284,594,351,246 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 84,351,696 | 155,490,616 |
| 未払金 | | 1,567,776 | 4,635,124 |
| 未払解約金 | | 844,877,000 | 184,794,000 |
| 流動負債合計 | | 930,796,472 | 344,919,740 |
| 負債合計 | | 930,796,472 | 344,919,740 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 143,582,065,487 | 126,730,528,618 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | | 143,315,324,821 | 157,518,902,888 |
| 元本等合計 | | 286,897,390,308 | 284,249,431,506 |
| 純資産合計 | | 286,897,390,308 | 284,249,431,506 |
| 負債純資産合計 | | 287,828,186,780 | 284,594,351,246 |

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

| | |
|------------------------|--|
| 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 | 平成28年2月8日現在 | 平成29年2月7日現在 |
|--|------------------|------------------|
| 1 . 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 | 160,436,237,384円 | 143,582,065,487円 |
| 同期中追加設定元本額 | 38,536,719,607円 | 31,895,226,101円 |
| 同期中一部解約元本額 | 55,390,891,504円 | 48,746,762,970円 |
| 元本の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| DIAM DC 国内株式インデックスファンド | 5,617,682,100円 | 6,225,361,204円 |
| DIAM国内株式パッシブ・ファンド | 1,820,166,879円 | 1,668,812,063円 |
| MITO ラップ型ファンド（安定型） | 6,660,487円 | 4,626,916円 |
| MITO ラップ型ファンド（中立型） | 13,299,631円 | 12,027,439円 |
| MITO ラップ型ファンド（積極型） | 31,387,977円 | 25,367,529円 |
| グローバル8資産ラップファンド（安定型） | 15,547,145円 | 14,362,796円 |
| グローバル8資産ラップファンド（中立型） | 11,093,364円 | 11,463,058円 |
| グローバル8資産ラップファンド（積極型） | 11,755,011円 | 14,507,613円 |
| DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金> | 38,172,461,361円 | 36,751,622,753円 |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型 | 786,499,443円 | 831,977,748円 |
| DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型 | 2,836,468,246円 | 2,911,107,155円 |

| | | |
|-----------------------------------|----------------|----------------|
| DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型 | 2,892,104,565円 | 2,958,943,396円 |
| DIAM DC バランス30インデックスファンド | 368,856,638円 | 382,522,985円 |
| DIAM DC バランス50インデックスファンド | 1,224,436,857円 | 1,247,411,604円 |
| DIAM DC バランス70インデックスファンド | 1,092,740,778円 | 1,101,637,707円 |
| マネックス資産設計ファンド<隔月分配型> | 60,704,664円 | 59,530,357円 |
| マネックス資産設計ファンド<育成型> | 1,226,882,342円 | 1,323,202,308円 |
| マネックス資産設計ファンドエボリューション | 27,113,958円 | 29,654,177円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10) | 24,706,633円 | 35,207,524円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20) | 49,577,626円 | 68,501,796円 |
| DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30) | 106,323,778円 | 138,115,824円 |
| 投資のソムリエ | 1,057,072,049円 | 737,581,150円 |
| クルーズコントロール | 708,256,115円 | 994,925,241円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 18,989,955円 | 21,909,381円 |
| DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金> | 76,867,727円 | 114,690,983円 |
| DIAM DC バランス・F(成長型) | 55,564,467円 | 122,403,177円 |
| クルーズコントロール<DC年金> | 182,825円 | 362,468円 |
| DIAMコア資産設計ファンド(堅実型) | 12,186,127円 | 8,655,666円 |
| DIAMコア資産設計ファンド(積極型) | 30,724,957円 | 24,905,651円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型 | 660,417円 | 5,679,470円 |
| ダイナミック・ナビゲーション | -円 | 1,959,663円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド | -円 | 13,656,955円 |
| DIAMアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定) | 266,833,209円 | 313,751,716円 |
| DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定) | 113,636,589円 | 88,264,704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) | 536,918,730円 | 215,433,771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) | 478,804,153円 | 404,699,772円 |
| DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定) | 41,760,119円 | 27,745,336円 |

| | | |
|--|-----------------|-----------------|
| D I A M国際分散バランスファン ド5 0 V A (適格機関投資家 限定) | 166,681,120円 | 121,678,076円 |
| D I A M国内重視バランスファン ド3 0 V A (適格機関投資家 限定) | 41,989,158円 | 30,140,688円 |
| D I A M国内重視バランスファン ド5 0 V A (適格機関投資家 限定) | 58,181,496円 | 33,363,257円 |
| D I A M世界バランスファンド 4 0 V A (適格機関投資家限 定) | 5,375,516,838円 | 1,086,480,641円 |
| D I A M世界バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限 定) | 2,050,277,399円 | 462,558,924円 |
| D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定) | 2,019,290,758円 | 1,499,138,856円 |
| D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限 定) | 1,613,319,467円 | 1,318,666,795円 |
| D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定) | 4,174,989,311円 | 3,594,704,089円 |
| D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定) | 322,112,731円 | 279,956,927円 |
| D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定) | 853,964,228円 | 475,695,865円 |
| D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定) | 1,010,419,845円 | 813,891,427円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け) | 4,107,539,986円 | 3,192,555,936円 |
| D I A Mグローバル 私募ファ ンド (適格機関投資家向け) | 46,003,219円 | 44,963,165円 |
| D I A M世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限 定) | 1,335,804,233円 | 1,068,353,473円 |
| D I A M世界バランスファンド 3 5 V A (適格機関投資家限 定) | 5,542,900,861円 | 4,854,751,930円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定) | 21,045,587,384円 | 18,832,685,135円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A (適格機関投 資家限定) | 799,834,907円 | 686,951,680円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定) | 2,401,484,718円 | 2,144,274,950円 |

| | | | | |
|-----|--|-------------------|--|-------------------|
| | D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定) | 13,407,676,777円 | | 11,925,835,750円 |
| | D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定) | 4,455,809円 | | 6,826,388円 |
| | D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定) | 7,115,578円 | | 328,366円 |
| | D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定) | 5,949,384円 | | 4,672,150円 |
| | D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定) | 12,049,845,453円 | | 10,678,056,698円 |
| | D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定) | 113,139,882円 | | 95,074,077円 |
| | D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定) | 42,673,735円 | | 34,152,004円 |
| | D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定) | 39,006,138円 | | 36,517,217円 |
| | D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定) | 12,245,363円 | | 73,509円 |
| | D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定) | 120,493円 | | 119,539円 |
| | D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定) | 670,998,289円 | | 621,830,741円 |
| | D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定) | 1,887,540,594円 | | 1,622,373,744円 |
| | D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定) | 2,485,634,300円 | | 2,159,696,264円 |
| | D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定) | 94,839,111円 | | 91,571,301円 |
| | 計 | 143,582,065,487円 | | 126,730,528,618円 |
| 2 . | 受益権の総数 | 143,582,065,487口 | | 126,730,528,618口 |
| 3 . | 2 差入代用有価証券 | 株式 3,277,500,000円 | | 株式 3,173,000,000円 |

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成27年2月10日 至 平成28年2月8日 | 自 平成28年2月9日 至 平成29年2月7日 |
|--------------------------|---|----------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 同左 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。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、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。 | 同左 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 | 同左 |

2. 金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 平成28年2月8日現在 | 平成29年2月7日現在 |
|----------------------------|--|-------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短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。</p> | 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 平成28年2月8日現在 | 平成29年2月7日現在 |
|----|---------------------------|---------------------------|
| | 当期の 損益に含まれた 評価差額(円) | 当期の 損益に含まれた 評価差額(円) |
| 株式 | 9,657,161,479 | 25,897,750,063 |
| 合計 | 9,657,161,479 | 25,897,750,063 |

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

| 種類 | 平成28年2月8日 現在 | | | | 平成29年2月7日 現在 | | | |
|------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-----------|---------------|-------------|
| | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | うち 1年超 | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| | | | | | | | | |
| 市場取引 | | | | | | | | |
| 先物取引 | | | | | | | | |
| 買建 | 4,960,587,000 | - | 4,876,350,000 | 84,237,000 | 6,728,280,000 | - | 6,572,930,000 | 155,350,000 |
| 合計 | 4,960,587,000 | - | 4,876,350,000 | 84,237,000 | 6,728,280,000 | - | 6,572,930,000 | 155,350,000 |

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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)

| | 平成28年2月8日現在 | 平成29年2月7日現在 |
|--------------|-------------|-------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.9981円 | 2.2429円 |
| (1万口当たり純資産額) | (19,981円) | (22,429円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成29年2月7日現在

| 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 |
|-----------------|---------|----------|-------------|----|
| | | 単価 | 金額 | |
| 極洋 | 5,700 | 2,731.00 | 15,566,700 | |
| 日本水産 | 182,800 | 589.00 | 107,669,200 | |
| マルハニチロ | 26,700 | 3,380.00 | 90,246,000 | |
| ハウスイ | 12,000 | 125.00 | 1,500,000 | |
| カネコ種苗 | 4,900 | 1,453.00 | 7,119,700 | |
| サカタのタネ | 20,800 | 3,140.00 | 65,312,000 | |
| ホクト | 14,400 | 2,131.00 | 30,686,400 | |
| ホクリヨウ | 1,600 | 735.00 | 1,176,000 | |
| ショーボンドホールディングス | 13,600 | 4,810.00 | 65,416,000 | |
| ミライト・ホールディングス | 43,300 | 1,087.00 | 47,067,100 | |
| タマホーム | 10,800 | 544.00 | 5,875,200 | |
| サンヨーホームズ | 3,200 | 655.00 | 2,096,000 | |
| インベスターズクラウド | 1,300 | 3,805.00 | 4,946,500 | |
| 住石ホールディングス | 39,800 | 97.00 | 3,860,600 | |
| 日鉄鉱業 | 3,900 | 5,910.00 | 23,049,000 | |
| 三井松島産業 | 8,700 | 1,505.00 | 13,093,500 | |
| 国際石油開発帝石 | 740,900 | 1,074.50 | 796,097,050 | |
| 日本海洋掘削 | 4,900 | 2,289.00 | 11,216,100 | |
| 石油資源開発 | 22,200 | 2,448.00 | 54,345,600 | |
| K&Oエナジーグループ | 9,500 | 1,765.00 | 16,767,500 | |
| ダイセキ環境ソリューション | 3,300 | 1,651.00 | 5,448,300 | |
| 安藤・間 | 101,100 | 797.00 | 80,576,700 | |
| 東急建設 | 49,900 | 885.00 | 44,161,500 | |
| コムシスホールディングス | 55,000 | 2,015.00 | 110,825,000 | |
| ミサワホーム | 16,600 | 1,057.00 | 17,546,200 | |
| ビーアールホールディングス | 13,200 | 296.00 | 3,907,200 | |
| 高松コンストラクショングループ | 10,600 | 2,573.00 | 27,273,800 | |
| 東建コーポレーション | 5,200 | 7,950.00 | 41,340,000 | |
| ヤマウラ | 6,900 | 604.00 | 4,167,600 | |
| 大成建設 | 715,000 | 800.00 | 572,000,000 | |
| 大林組 | 421,800 | 1,077.00 | 454,278,600 | |
| 清水建設 | 430,000 | 1,029.00 | 442,470,000 | |
| 飛鳥建設 | 135,500 | 178.00 | 24,119,000 | |
| 長谷工コーポレーション | 164,100 | 1,235.00 | 202,663,500 | |
| 松井建設 | 15,500 | 1,066.00 | 16,523,000 | |
| 銭高組 | 20,000 | 478.00 | 9,560,000 | |
| 鹿島建設 | 618,000 | 778.00 | 480,804,000 | |
| 不動テトラ | 113,800 | 208.00 | 23,670,400 | |
| 大末建設 | 5,100 | 973.00 | 4,962,300 | |
| 鉄建建設 | 85,000 | 335.00 | 28,475,000 | |
| 西松建設 | 162,000 | 565.00 | 91,530,000 | |
| 三井住友建設 | 538,300 | 125.00 | 67,287,500 | |
| 大豊建設 | 51,000 | 515.00 | 26,265,000 | |

| | | | |
|---------------|---------|-----------|---------------|
| 前田建設工業 | 87,000 | 983.00 | 85,521,000 |
| 佐田建設 | 9,800 | 422.00 | 4,135,600 |
| ナカノフドー建設 | 10,800 | 547.00 | 5,907,600 |
| 奥村組 | 115,000 | 701.00 | 80,615,000 |
| 東鉄工業 | 16,900 | 3,285.00 | 55,516,500 |
| イチケン | 13,000 | 466.00 | 6,058,000 |
| 浅沼組 | 45,000 | 356.00 | 16,020,000 |
| 戸田建設 | 163,000 | 636.00 | 103,668,000 |
| 熊谷組 | 221,000 | 322.00 | 71,162,000 |
| 青木あすなろ建設 | 9,200 | 796.00 | 7,323,200 |
| 北野建設 | 29,000 | 312.00 | 9,048,000 |
| 植木組 | 18,000 | 255.00 | 4,590,000 |
| 三井ホーム | 18,000 | 555.00 | 9,990,000 |
| 矢作建設工業 | 19,200 | 1,096.00 | 21,043,200 |
| ピーエス三菱 | 14,900 | 376.00 | 5,602,400 |
| 日本ハウスホールディングス | 28,700 | 506.00 | 14,522,200 |
| 大東建託 | 51,700 | 15,595.00 | 806,261,500 |
| 新日本建設 | 16,800 | 899.00 | 15,103,200 |
| N I P P O | 33,000 | 2,127.00 | 70,191,000 |
| 東亜道路工業 | 27,000 | 335.00 | 9,045,000 |
| 前田道路 | 44,000 | 1,896.00 | 83,424,000 |
| 日本道路 | 42,000 | 457.00 | 19,194,000 |
| 東亜建設工業 | 11,400 | 1,806.00 | 20,588,400 |
| 若築建設 | 82,000 | 150.00 | 12,300,000 |
| 東洋建設 | 40,500 | 402.00 | 16,281,000 |
| 五洋建設 | 156,200 | 546.00 | 85,285,200 |
| 大林道路 | 14,600 | 671.00 | 9,796,600 |
| 世紀東急工業 | 20,400 | 492.00 | 10,036,800 |
| 福田組 | 23,000 | 1,105.00 | 25,415,000 |
| 日本ドライケミカル | 1,700 | 2,314.00 | 3,933,800 |
| 住友林業 | 96,700 | 1,562.00 | 151,045,400 |
| 日本基礎技術 | 15,800 | 351.00 | 5,545,800 |
| 日成ビルド工業 | 42,000 | 570.00 | 23,940,000 |
| ヤマダ・エスバイエルホーム | 74,000 | 79.00 | 5,846,000 |
| 巴コーポレーション | 17,600 | 355.00 | 6,248,000 |
| パナホーム | 53,000 | 958.00 | 50,774,000 |
| 大和ハウス工業 | 415,400 | 3,033.00 | 1,259,908,200 |
| ライト工業 | 27,100 | 1,201.00 | 32,547,100 |
| 積水ハウス | 442,400 | 1,801.00 | 796,762,400 |
| 日特建設 | 12,200 | 451.00 | 5,502,200 |
| 北陸電気工事 | 6,900 | 861.00 | 5,940,900 |
| ユアテック | 22,000 | 810.00 | 17,820,000 |
| 西部電気工業 | 2,400 | 2,208.00 | 5,299,200 |
| 四電工 | 6,000 | 417.00 | 2,502,000 |
| 中電工 | 17,700 | 2,341.00 | 41,435,700 |
| 関電工 | 56,000 | 944.00 | 52,864,000 |
| きんでん | 93,600 | 1,461.00 | 136,749,600 |
| 東京エネシス | 15,000 | 970.00 | 14,550,000 |
| トーエネック | 20,000 | 553.00 | 11,060,000 |
| 住友電設 | 9,700 | 1,247.00 | 12,095,900 |

| | | | |
|-----------------|---------|----------|-------------|
| 日本電設工業 | 22,900 | 2,032.00 | 46,532,800 |
| 協和エクシオ | 55,100 | 1,571.00 | 86,562,100 |
| 新日本空調 | 10,900 | 1,345.00 | 14,660,500 |
| 日本工営 | 8,800 | 2,492.00 | 21,929,600 |
| NDS | 2,200 | 2,872.00 | 6,318,400 |
| 九電工 | 27,300 | 2,799.00 | 76,412,700 |
| 三機工業 | 31,200 | 952.00 | 29,702,400 |
| 日揮 | 131,200 | 1,898.00 | 249,017,600 |
| 中外炉工業 | 43,000 | 227.00 | 9,761,000 |
| ヤマト | 12,900 | 526.00 | 6,785,400 |
| 太平電業 | 19,000 | 1,086.00 | 20,634,000 |
| 高砂熱学工業 | 38,700 | 1,539.00 | 59,559,300 |
| 三晃金属工業 | 1,300 | 3,175.00 | 4,127,500 |
| NEC ネットエスアイ | 13,600 | 2,078.00 | 28,260,800 |
| 朝日工業社 | 3,200 | 2,918.00 | 9,337,600 |
| 明星工業 | 25,600 | 611.00 | 15,641,600 |
| 大気社 | 18,600 | 2,804.00 | 52,154,400 |
| ダイダン | 19,000 | 942.00 | 17,898,000 |
| 日比谷総合設備 | 15,700 | 1,659.00 | 26,046,300 |
| 東芝プラントシステム | 22,800 | 1,618.00 | 36,890,400 |
| 日本製粉 | 41,900 | 1,601.00 | 67,081,900 |
| 日清製粉グループ本社 | 154,300 | 1,656.00 | 255,520,800 |
| 日東富士製粉 | 800 | 3,870.00 | 3,096,000 |
| 昭和産業 | 58,000 | 590.00 | 34,220,000 |
| 鳥越製粉 | 11,600 | 773.00 | 8,966,800 |
| 中部飼料 | 15,500 | 1,080.00 | 16,740,000 |
| フィード・ワン | 85,700 | 173.00 | 14,826,100 |
| 東洋精糖 | 23,000 | 115.00 | 2,645,000 |
| 日本甜菜製糖 | 7,300 | 2,360.00 | 17,228,000 |
| 三井製糖 | 10,000 | 2,536.00 | 25,360,000 |
| 塩水港精糖 | 16,300 | 250.00 | 4,075,000 |
| 日新製糖 | 6,000 | 1,696.00 | 10,176,000 |
| ネクスト | 32,500 | 760.00 | 24,700,000 |
| ジェイエイシーリクルートメント | 8,100 | 1,480.00 | 11,988,000 |
| 日本M&Aセンター | 37,900 | 3,320.00 | 125,828,000 |
| 中広 | 1,400 | 694.00 | 971,600 |
| タケエイ | 11,600 | 1,027.00 | 11,913,200 |
| トラスト・テック | 5,400 | 1,792.00 | 9,676,800 |
| コシダカホールディングス | 4,500 | 2,324.00 | 10,458,000 |
| パソナグループ | 11,400 | 790.00 | 9,006,000 |
| CDS | 3,200 | 1,031.00 | 3,299,200 |
| リンクアンドモチベーション | 29,800 | 467.00 | 13,916,600 |
| GCA | 11,700 | 817.00 | 9,558,900 |
| エス・エム・エス | 18,500 | 2,578.00 | 47,693,000 |
| テンブホールディングス | 101,400 | 1,987.00 | 201,481,800 |
| リニカル | 7,800 | 1,313.00 | 10,241,400 |
| クックパッド | 29,300 | 997.00 | 29,212,100 |
| エスクリ | 4,700 | 622.00 | 2,923,400 |
| アイ・ケイ・ケイ | 6,000 | 697.00 | 4,182,000 |
| 森永製菓 | 27,500 | 4,840.00 | 133,100,000 |

| | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|
| 中村屋 | 3,400 | 5,060.00 | 17,204,000 |
| 江崎グリコ | 35,200 | 5,140.00 | 180,928,000 |
| 名糖産業 | 6,300 | 1,383.00 | 8,712,900 |
| 不二家 | 81,000 | 224.00 | 18,144,000 |
| 山崎製パン | 103,100 | 2,254.00 | 232,387,400 |
| 第一屋製パン | 23,000 | 129.00 | 2,967,000 |
| モロゾフ | 22,000 | 508.00 | 11,176,000 |
| 亀田製菓 | 7,900 | 5,010.00 | 39,579,000 |
| 寿スピリッツ | 10,100 | 2,644.00 | 26,704,400 |
| カルビー | 57,400 | 3,615.00 | 207,501,000 |
| 森永乳業 | 126,000 | 791.00 | 99,666,000 |
| 六甲バター | 6,300 | 2,409.00 | 15,176,700 |
| ヤクルト本社 | 75,500 | 6,250.00 | 471,875,000 |
| 明治ホールディングス | 83,300 | 8,740.00 | 728,042,000 |
| 雪印メグミルク | 30,400 | 2,992.00 | 90,956,800 |
| プリマハム | 89,000 | 436.00 | 38,804,000 |
| 日本ハム | 95,000 | 3,050.00 | 289,750,000 |
| 林兼産業 | 4,700 | 870.00 | 4,089,000 |
| 丸大食品 | 68,000 | 483.00 | 32,844,000 |
| S Foods | 7,600 | 3,115.00 | 23,674,000 |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 81,300 | 1,065.00 | 86,584,500 |
| 学情 | 5,500 | 1,174.00 | 6,457,000 |
| スタジオアリス | 5,400 | 2,139.00 | 11,550,600 |
| シミックホールディングス | 6,700 | 1,514.00 | 10,143,800 |
| システナ | 9,900 | 1,628.00 | 16,117,200 |
| N J S | 3,000 | 1,370.00 | 4,110,000 |
| デジタルアーツ | 5,500 | 3,135.00 | 17,242,500 |
| 新日鉄住金ソリューションズ | 20,700 | 2,312.00 | 47,858,400 |
| 総合警備保障 | 47,700 | 4,400.00 | 209,880,000 |
| キューブシステム | 5,600 | 690.00 | 3,864,000 |
| いちご | 117,800 | 355.00 | 41,819,000 |
| 日本駐車場開発 | 149,600 | 152.00 | 22,739,200 |
| コア | 5,300 | 1,309.00 | 6,937,700 |
| カカクコム | 93,600 | 1,586.00 | 148,449,600 |
| アイロムグループ | 3,900 | 1,360.00 | 5,304,000 |
| ルネサンス | 6,800 | 1,524.00 | 10,363,200 |
| ディップ | 17,000 | 2,326.00 | 39,542,000 |
| S B Sホールディングス | 12,400 | 776.00 | 9,622,400 |
| オプトホールディング | 9,300 | 737.00 | 6,854,100 |
| 新日本科学 | 13,900 | 560.00 | 7,784,000 |
| ツクイ | 31,200 | 667.00 | 20,810,400 |
| キャリアデザインセンター | 2,800 | 1,155.00 | 3,234,000 |
| エムスリー | 113,600 | 2,948.00 | 334,892,800 |
| ツカダ・グローバルホールディング | 9,600 | 623.00 | 5,980,800 |
| アウトソーシング | 7,500 | 3,590.00 | 26,925,000 |
| ウェルネット | 9,900 | 1,254.00 | 12,414,600 |
| ワールドホールディングス | 3,000 | 2,000.00 | 6,000,000 |
| ディー・エヌ・エー | 58,800 | 2,472.00 | 145,353,600 |
| 博報堂D Yホールディングス | 181,800 | 1,311.00 | 238,339,800 |
| ぐるなび | 19,000 | 2,172.00 | 41,268,000 |

| | | | |
|------------------|---------|----------|---------------|
| エスアールジータカミヤ | 14,300 | 576.00 | 8,236,800 |
| ジャパンベストレスキューシステム | 17,300 | 247.00 | 4,273,100 |
| ファンコミュニケーションズ | 33,400 | 733.00 | 24,482,200 |
| ライク | 2,800 | 2,440.00 | 6,832,000 |
| WDBホールディングス | 4,800 | 1,275.00 | 6,120,000 |
| ティア | 6,500 | 703.00 | 4,569,500 |
| パリュコマース | 12,900 | 342.00 | 4,411,800 |
| インフォマート | 55,700 | 593.00 | 33,030,100 |
| サッポロホールディングス | 46,100 | 2,911.00 | 134,197,100 |
| アサヒグループホールディングス | 263,900 | 3,910.00 | 1,031,849,000 |
| 麒麟ホールディングス | 605,700 | 1,839.00 | 1,113,882,300 |
| 宝ホールディングス | 102,000 | 1,054.00 | 107,508,000 |
| オエノンホールディングス | 37,000 | 271.00 | 10,027,000 |
| 養命酒製造 | 4,500 | 1,854.00 | 8,343,000 |
| コカ・コーラウエスト | 47,700 | 3,145.00 | 150,016,500 |
| コカ・コーライーストジャパン | 54,800 | 2,338.00 | 128,122,400 |
| サントリー食品インターナショナル | 96,400 | 4,720.00 | 455,008,000 |
| ダイドーグループホールディングス | 6,500 | 5,550.00 | 36,075,000 |
| 伊藤園 | 41,800 | 3,715.00 | 155,287,000 |
| キーコーヒー | 12,500 | 2,087.00 | 26,087,500 |
| ユニカフェ | 4,200 | 963.00 | 4,044,600 |
| ジャパンプーズ | 2,100 | 1,327.00 | 2,786,700 |
| 日清オイリオグループ | 81,000 | 541.00 | 43,821,000 |
| 不二製油グループ本社 | 37,600 | 2,230.00 | 83,848,000 |
| J-オイルミルズ | 6,600 | 3,975.00 | 26,235,000 |
| ローソン | 43,000 | 8,170.00 | 351,310,000 |
| サンエー | 9,300 | 5,080.00 | 47,244,000 |
| カワチ薬品 | 9,600 | 2,911.00 | 27,945,600 |
| エービーシー・マート | 22,500 | 6,490.00 | 146,025,000 |
| ハードオフコーポレーション | 5,500 | 1,183.00 | 6,506,500 |
| 高千穂交易 | 4,900 | 1,027.00 | 5,032,300 |
| アスクル | 12,900 | 3,505.00 | 45,214,500 |
| ゲオホールディングス | 20,700 | 1,316.00 | 27,241,200 |
| アダストリア | 19,000 | 2,940.00 | 55,860,000 |
| ジーフット | 7,500 | 817.00 | 6,127,500 |
| シー・ヴィ・エス・ベイエリア | 1,900 | 710.00 | 1,349,000 |
| 伊藤忠食品 | 3,100 | 4,350.00 | 13,485,000 |
| くらコーポレーション | 8,100 | 4,560.00 | 36,936,000 |
| キャンドウ | 6,600 | 1,791.00 | 11,820,600 |
| エレマテック | 4,900 | 1,886.00 | 9,241,400 |
| パルグループホールディングス | 6,300 | 2,780.00 | 17,514,000 |
| JALUX | 4,000 | 2,182.00 | 8,728,000 |
| エディオン | 48,000 | 1,045.00 | 50,160,000 |
| あらた | 5,600 | 2,817.00 | 15,775,200 |
| サーラコーポレーション | 15,500 | 615.00 | 9,532,500 |
| ワッツ | 5,500 | 1,119.00 | 6,154,500 |
| トーメンデバイス | 1,900 | 2,063.00 | 3,919,700 |
| ハローズ | 4,100 | 2,251.00 | 9,229,100 |
| J Pホールディングス | 37,800 | 247.00 | 9,336,600 |
| あみやき亭 | 2,400 | 3,905.00 | 9,372,000 |

| | | | |
|-----------------|---------|----------|---------------|
| 東京エレクトロン デバイス | 4,600 | 1,595.00 | 7,337,000 |
| ひらまつ | 17,200 | 654.00 | 11,248,800 |
| フィールズ | 9,400 | 1,220.00 | 11,468,000 |
| 双日 | 731,200 | 288.00 | 210,585,600 |
| ゲンキー | 2,500 | 6,030.00 | 15,075,000 |
| アルフレッサ ホールディングス | 146,600 | 1,878.00 | 275,314,800 |
| 大黒天物産 | 3,000 | 5,440.00 | 16,320,000 |
| ハニーズ | 10,900 | 1,076.00 | 11,728,400 |
| ファーマライズホールディングス | 3,100 | 508.00 | 1,574,800 |
| キッコーマン | 98,000 | 3,345.00 | 327,810,000 |
| 味の素 | 289,800 | 2,288.50 | 663,207,300 |
| キューピー | 71,600 | 2,856.00 | 204,489,600 |
| ハウス食品グループ本社 | 52,100 | 2,415.00 | 125,821,500 |
| カゴメ | 50,600 | 2,916.00 | 147,549,600 |
| 焼津水産化学工業 | 7,000 | 1,168.00 | 8,176,000 |
| アリアケジャパン | 11,500 | 5,810.00 | 66,815,000 |
| ピエトロ | 1,700 | 1,633.00 | 2,776,100 |
| エバラ食品工業 | 3,600 | 2,063.00 | 7,426,800 |
| ニチレイ | 69,300 | 2,345.00 | 162,508,500 |
| 横浜冷凍 | 30,900 | 1,031.00 | 31,857,900 |
| 東洋水産 | 69,200 | 3,960.00 | 274,032,000 |
| イトアンド | 1,700 | 2,213.00 | 3,762,100 |
| 日清食品ホールディングス | 55,000 | 5,910.00 | 325,050,000 |
| 永谷園ホールディングス | 7,000 | 1,405.00 | 9,835,000 |
| 一正蒲鉾 | 5,000 | 1,137.00 | 5,685,000 |
| フジッコ | 13,700 | 2,422.00 | 33,181,400 |
| ロック・フィールド | 14,700 | 1,635.00 | 24,034,500 |
| 日本たばこ産業 | 779,500 | 3,632.00 | 2,831,144,000 |
| ケンコーマヨネーズ | 5,000 | 2,779.00 | 13,895,000 |
| わらべや日洋ホールディングス | 8,300 | 2,441.00 | 20,260,300 |
| なとり | 7,200 | 1,775.00 | 12,780,000 |
| 北の達人コーポレーション | 3,100 | 565.00 | 1,751,500 |
| ユーグレナ | 45,300 | 1,180.00 | 53,454,000 |
| 片倉工業 | 16,500 | 1,311.00 | 21,631,500 |
| グンゼ | 98,000 | 417.00 | 40,866,000 |
| ヒューリック | 258,400 | 1,106.00 | 285,790,400 |
| 神栄 | 18,000 | 177.00 | 3,186,000 |
| 山下医科器械 | 1,100 | 1,788.00 | 1,966,800 |
| ラサ商事 | 5,800 | 669.00 | 3,880,200 |
| アルペン | 9,500 | 1,986.00 | 18,867,000 |
| ラクーン | 5,600 | 503.00 | 2,816,800 |
| クオール | 14,000 | 1,485.00 | 20,790,000 |
| アルコニックス | 7,100 | 1,769.00 | 12,559,900 |
| 神戸物産 | 6,700 | 3,585.00 | 24,019,500 |
| ジェイアイエヌ | 8,400 | 5,870.00 | 49,308,000 |
| ビックカメラ | 71,100 | 1,056.00 | 75,081,600 |
| DCMホールディングス | 75,200 | 978.00 | 73,545,600 |
| MonotaRO | 43,900 | 3,100.00 | 136,090,000 |
| 東京一番フーズ | 2,400 | 573.00 | 1,375,200 |
| ダイヤモンドダイニング | 2,800 | 1,602.00 | 4,485,600 |

| | | | |
|---------------------|---------|----------|-------------|
| あい ホールディングス | 17,600 | 2,118.00 | 37,276,800 |
| ディービーエックス | 4,500 | 1,234.00 | 5,553,000 |
| きちり | 3,600 | 661.00 | 2,379,600 |
| アークランドサービスホールディングス | 3,900 | 3,010.00 | 11,739,000 |
| J.フロント リテイリング | 156,700 | 1,571.00 | 246,175,700 |
| ドトール・日レスホールディングス | 21,700 | 2,155.00 | 46,763,500 |
| マツモトキヨシホールディングス | 23,400 | 5,380.00 | 125,892,000 |
| ブロンコピリー | 6,500 | 2,672.00 | 17,368,000 |
| スタートトゥデイ | 113,100 | 2,398.00 | 271,213,800 |
| トレジャー・ファクトリー | 3,700 | 825.00 | 3,052,500 |
| 物語コーポレーション | 3,300 | 4,010.00 | 13,233,000 |
| ココカラファイン | 12,900 | 4,580.00 | 59,082,000 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 246,400 | 1,329.00 | 327,465,600 |
| 東洋紡 | 521,000 | 181.00 | 94,301,000 |
| ユニチカ | 361,000 | 83.00 | 29,963,000 |
| 富士紡ホールディングス | 6,400 | 3,240.00 | 20,736,000 |
| 日清紡ホールディングス | 69,600 | 1,049.00 | 73,010,400 |
| 倉敷紡績 | 132,000 | 231.00 | 30,492,000 |
| ダイワボウホールディングス | 105,000 | 280.00 | 29,400,000 |
| シキボウ | 72,000 | 151.00 | 10,872,000 |
| 日東紡績 | 106,000 | 487.00 | 51,622,000 |
| トヨタ紡織 | 43,900 | 2,322.00 | 101,935,800 |
| マクニカ・富士エレホールディングス | 22,900 | 1,656.00 | 37,922,400 |
| H a m e e | 1,900 | 900.00 | 1,710,000 |
| ウエルシアホールディングス | 12,300 | 6,160.00 | 75,768,000 |
| クリエイトSDホールディングス | 18,200 | 2,474.00 | 45,026,800 |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 23,300 | 1,009.00 | 23,509,700 |
| 八洲電機 | 9,800 | 633.00 | 6,203,400 |
| U K Cホールディングス | 8,000 | 2,210.00 | 17,680,000 |
| 丸善C H Iホールディングス | 14,800 | 363.00 | 5,372,400 |
| O C H Iホールディングス | 3,300 | 1,368.00 | 4,514,400 |
| T O K A Iホールディングス | 54,600 | 851.00 | 46,464,600 |
| ミサワ | 1,800 | 470.00 | 846,000 |
| エー・ピーカンパニー | 2,300 | 762.00 | 1,752,600 |
| 三洋貿易 | 6,800 | 1,659.00 | 11,281,200 |
| チムニー | 3,400 | 2,813.00 | 9,564,200 |
| シュッピン | 4,700 | 1,294.00 | 6,081,800 |
| ビューティガレージ | 1,100 | 1,126.00 | 1,238,600 |
| ウイン・パートナーズ | 9,000 | 925.00 | 8,325,000 |
| ネクステージ | 2,200 | 2,459.00 | 5,409,800 |
| ジョイフル本田 | 20,100 | 3,080.00 | 61,908,000 |
| 鳥貴族 | 3,100 | 2,283.00 | 7,077,300 |
| キリン堂ホールディングス | 4,100 | 845.00 | 3,464,500 |
| ホットランド | 4,900 | 1,062.00 | 5,203,800 |
| すかいらく | 53,200 | 1,535.00 | 81,662,000 |
| 綿半ホールディングス | 5,000 | 1,588.00 | 7,940,000 |
| 日本毛織 | 37,000 | 880.00 | 32,560,000 |
| ダイトウボウ | 20,000 | 72.00 | 1,440,000 |

| | | | |
|---------------------------|---------|-----------|---------------|
| トーア紡コーポレーション | 5,500 | 545.00 | 2,997,500 |
| ダイドーリミテッド | 15,000 | 438.00 | 6,570,000 |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 40,900 | 1,002.00 | 40,981,800 |
| 三栄建築設計 | 5,000 | 1,508.00 | 7,540,000 |
| 野村不動産ホールディングス | 82,200 | 1,884.00 | 154,864,800 |
| 三重交通グループホールディングス | 22,100 | 387.00 | 8,552,700 |
| サムティ | 10,000 | 1,127.00 | 11,270,000 |
| ディア・ライフ | 8,800 | 386.00 | 3,396,800 |
| エー・ディー・ワークス | 116,100 | 42.00 | 4,876,200 |
| 日本商業開発 | 6,900 | 1,934.00 | 13,344,600 |
| プレサンスコーポレーション | 19,300 | 1,374.00 | 26,518,200 |
| ユニゾホールディングス | 10,200 | 3,080.00 | 31,416,000 |
| THEグローバル社 | 4,900 | 454.00 | 2,224,600 |
| 日本管理センター | 8,900 | 1,265.00 | 11,258,500 |
| サンセイランディック | 2,700 | 732.00 | 1,976,400 |
| エストラスト | 2,400 | 767.00 | 1,840,800 |
| フージャースホールディングス | 16,100 | 599.00 | 9,643,900 |
| オープンハウス | 17,900 | 2,659.00 | 47,596,100 |
| 東急不動産ホールディングス | 299,500 | 653.00 | 195,573,500 |
| 飯田グループホールディングス | 103,300 | 2,019.00 | 208,562,700 |
| ムゲンエステート | 4,000 | 674.00 | 2,696,000 |
| 帝国繊維 | 13,800 | 1,523.00 | 21,017,400 |
| ブックオフコーポレーション | 7,300 | 811.00 | 5,920,300 |
| 日本コークス工業 | 107,000 | 102.00 | 10,914,000 |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 3,900 | 781.00 | 3,045,900 |
| ミタチ産業 | 3,300 | 618.00 | 2,039,400 |
| B E E N O S | 1,500 | 1,460.00 | 2,190,000 |
| あさひ | 9,200 | 1,296.00 | 11,923,200 |
| 日本調剤 | 4,400 | 3,555.00 | 15,642,000 |
| コスモス薬品 | 6,200 | 20,920.00 | 129,704,000 |
| シップヘルスケアホールディングス | 23,800 | 2,911.00 | 69,281,800 |
| トーエル | 6,200 | 922.00 | 5,716,400 |
| 一六堂 | 3,300 | 396.00 | 1,306,800 |
| ソフトクリエイトホールディングス | 6,100 | 1,334.00 | 8,137,400 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 518,500 | 4,428.00 | 2,295,918,000 |
| 薬王堂 | 6,200 | 1,919.00 | 11,897,800 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディングス | 33,300 | 999.00 | 33,266,700 |
| 明治電機工業 | 4,300 | 1,201.00 | 5,164,300 |
| ツルハホールディングス | 24,800 | 10,390.00 | 257,672,000 |
| デリカフーズ | 2,900 | 1,052.00 | 3,050,800 |
| スターティア | 2,600 | 533.00 | 1,385,800 |
| サンマルクホールディングス | 8,000 | 3,380.00 | 27,040,000 |
| フェリシモ | 3,600 | 1,017.00 | 3,661,200 |
| トリドールホールディングス | 15,200 | 2,426.00 | 36,875,200 |
| 帝人 | 107,400 | 2,218.00 | 238,213,200 |
| 東レ | 954,000 | 974.60 | 929,768,400 |
| クラレ | 221,200 | 1,781.00 | 393,957,200 |
| 旭化成 | 820,000 | 1,052.00 | 862,640,000 |

| | | | |
|------------------------|---------|----------|-------------|
| サカイオーベックス | 3,300 | 1,773.00 | 5,850,900 |
| 稲葉製作所 | 7,100 | 1,306.00 | 9,272,600 |
| 宮地エンジニアリンググループ | 38,000 | 210.00 | 7,980,000 |
| トーカロ | 8,600 | 2,724.00 | 23,426,400 |
| アルファ | 4,500 | 1,201.00 | 5,404,500 |
| SUMCO | 137,200 | 1,749.00 | 239,962,800 |
| 川田テクノロジーズ | 2,500 | 8,330.00 | 20,825,000 |
| ファーストブラザーズ | 1,300 | 1,672.00 | 2,173,600 |
| シーアールイー | 1,800 | 1,558.00 | 2,804,400 |
| 住江織物 | 33,000 | 270.00 | 8,910,000 |
| 日本フェルト | 7,900 | 515.00 | 4,068,500 |
| イチカワ | 9,000 | 299.00 | 2,691,000 |
| エコナックホールディングス | 44,000 | 48.00 | 2,112,000 |
| 日東製網 | 1,500 | 1,905.00 | 2,857,500 |
| 芦森工業 | 29,000 | 159.00 | 4,611,000 |
| アツギ | 108,000 | 125.00 | 13,500,000 |
| コメダホールディングス | 16,700 | 1,867.00 | 31,178,900 |
| サツドラホールディングス | 1,700 | 1,951.00 | 3,316,700 |
| ダイユー・リックホールディングス | 4,200 | 790.00 | 3,318,000 |
| パロックジャパンリミテッド | 7,300 | 1,541.00 | 11,249,300 |
| クスリのアオキホールディングス | 9,800 | 4,520.00 | 44,296,000 |
| ダイニック | 26,000 | 192.00 | 4,992,000 |
| 共和レザー | 7,700 | 896.00 | 6,899,200 |
| セーレン | 32,800 | 1,383.00 | 45,362,400 |
| ソトー | 5,000 | 1,157.00 | 5,785,000 |
| 東海染工 | 19,000 | 142.00 | 2,698,000 |
| 小松精練 | 18,600 | 700.00 | 13,020,000 |
| ワコールホールディングス | 78,000 | 1,400.00 | 109,200,000 |
| ホギメディカル | 8,300 | 6,640.00 | 55,112,000 |
| レナウン | 35,700 | 115.00 | 4,105,500 |
| クラウドディア | 3,400 | 533.00 | 1,812,200 |
| T S Iホールディングス | 54,100 | 816.00 | 44,145,600 |
| T I S | 41,100 | 2,668.00 | 109,654,800 |
| ネオス | 3,900 | 438.00 | 1,708,200 |
| 電算システム | 4,300 | 1,630.00 | 7,009,000 |
| グリー | 75,500 | 661.00 | 49,905,500 |
| コーエーテックモホールディングス | 29,400 | 1,971.00 | 57,947,400 |
| 三菱総合研究所 | 4,800 | 3,245.00 | 15,576,000 |
| ボルテージ | 2,500 | 1,051.00 | 2,627,500 |
| 電算 | 1,500 | 2,360.00 | 3,540,000 |
| A G S | 2,600 | 1,659.00 | 4,313,400 |
| ファインデックス | 9,200 | 925.00 | 8,510,000 |
| ヒト・コミュニケーションズ | 2,800 | 1,618.00 | 4,530,400 |
| ブレインパッド | 1,900 | 1,266.00 | 2,405,400 |
| K L a b | 23,700 | 625.00 | 14,812,500 |
| ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス | 8,900 | 1,065.00 | 9,478,500 |
| イーブクイニシアティブジャパン | 2,100 | 992.00 | 2,083,200 |
| ネクソン | 135,600 | 1,733.00 | 234,994,800 |
| アイスタイル | 26,100 | 844.00 | 22,028,400 |

| | | | |
|----------------------|---------|----------|-------------|
| エムアップ | 3,700 | 818.00 | 3,026,600 |
| エイチーム | 6,900 | 2,081.00 | 14,358,900 |
| テクノスジャパン | 9,600 | 1,202.00 | 11,539,200 |
| e n i s h | 3,800 | 527.00 | 2,002,600 |
| コロプラ | 34,500 | 989.00 | 34,120,500 |
| モバイルクリエイト | 8,600 | 433.00 | 3,723,800 |
| オルトプラス | 5,300 | 630.00 | 3,339,000 |
| ブロードリーフ | 30,600 | 696.00 | 21,297,600 |
| ハーツユナイテッドグループ | 6,600 | 1,561.00 | 10,302,600 |
| メディアドゥ | 2,700 | 1,634.00 | 4,411,800 |
| ブイキューブ | 6,900 | 652.00 | 4,498,800 |
| サイバーリンクス | 2,000 | 1,022.00 | 2,044,000 |
| ディー・エル・イー | 3,800 | 670.00 | 2,546,000 |
| フィックスターズ | 1,800 | 3,465.00 | 6,237,000 |
| VOYAGE GROUP | 4,300 | 1,700.00 | 7,310,000 |
| オブティム | 1,100 | 6,100.00 | 6,710,000 |
| セレス | 2,200 | 1,721.00 | 3,786,200 |
| 特種東海製紙 | 7,700 | 4,010.00 | 30,877,000 |
| ベリサーブ | 1,500 | 2,804.00 | 4,206,000 |
| ティーガイア | 12,400 | 1,814.00 | 22,493,600 |
| 日本アジアグループ | 14,100 | 433.00 | 6,105,300 |
| 豆蔵ホールディングス | 9,200 | 1,003.00 | 9,227,600 |
| テクマトリックス | 3,900 | 2,387.00 | 9,309,300 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 259,900 | 249.00 | 64,715,100 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 10,200 | 6,280.00 | 64,056,000 |
| ザッパラス | 7,500 | 445.00 | 3,337,500 |
| インターネットイニシアティブ | 18,300 | 1,822.00 | 33,342,600 |
| さくらインターネット | 8,800 | 1,191.00 | 10,480,800 |
| GMOクラウド | 2,800 | 1,743.00 | 4,880,400 |
| SRAホールディングス | 6,600 | 2,519.00 | 16,625,400 |
| MINORIソリューションズ | 2,700 | 1,255.00 | 3,388,500 |
| システムインテグレータ | 2,000 | 646.00 | 1,292,000 |
| 朝日ネット | 11,700 | 504.00 | 5,896,800 |
| アドソル日進 | 2,500 | 1,334.00 | 3,335,000 |
| フリービット | 6,900 | 918.00 | 6,334,200 |
| コムチュア | 2,100 | 3,530.00 | 7,413,000 |
| サイバーコム | 1,600 | 977.00 | 1,563,200 |
| 王子ホールディングス | 514,000 | 503.00 | 258,542,000 |
| 日本製紙 | 58,900 | 2,051.00 | 120,803,900 |
| 三菱製紙 | 18,900 | 769.00 | 14,534,100 |
| 北越紀州製紙 | 73,500 | 683.00 | 50,200,500 |
| 中越パルプ工業 | 52,000 | 247.00 | 12,844,000 |
| 巴川製紙所 | 21,000 | 229.00 | 4,809,000 |
| 大王製紙 | 52,500 | 1,276.00 | 66,990,000 |
| メディカル・データ・ビジョン | 2,100 | 2,904.00 | 6,098,400 |
| g u m i | 12,800 | 1,309.00 | 16,755,200 |
| PCIホールディングス | 1,500 | 2,781.00 | 4,171,500 |
| パイブドHD | 1,800 | 1,115.00 | 2,007,000 |
| オーブンドア | 1,200 | 3,465.00 | 4,158,000 |

| | | | |
|------------------|---------|----------|---------------|
| LINE | 20,700 | 3,590.00 | 74,313,000 |
| レンゴー | 127,000 | 657.00 | 83,439,000 |
| トーモク | 42,000 | 327.00 | 13,734,000 |
| ザ・バック | 9,300 | 2,955.00 | 27,481,500 |
| AOI TYO HOLDINGS | 10,200 | 868.00 | 8,853,600 |
| 昭和電工 | 87,500 | 1,859.00 | 162,662,500 |
| 住友化学 | 968,000 | 612.00 | 592,416,000 |
| 住友精化 | 5,500 | 4,640.00 | 25,520,000 |
| 日産化学工業 | 72,000 | 3,745.00 | 269,640,000 |
| ラサ工業 | 51,000 | 141.00 | 7,191,000 |
| クレハ | 9,900 | 4,715.00 | 46,678,500 |
| 多木化学 | 8,000 | 842.00 | 6,736,000 |
| テイカ | 20,000 | 664.00 | 13,280,000 |
| 石原産業 | 23,600 | 922.00 | 21,759,200 |
| 片倉コープアグリ | 17,000 | 238.00 | 4,046,000 |
| 日東エフシー | 7,700 | 918.00 | 7,068,600 |
| 日本曹達 | 79,000 | 536.00 | 42,344,000 |
| 東ソー | 380,000 | 897.00 | 340,860,000 |
| トクヤマ | 205,000 | 534.00 | 109,470,000 |
| セントラル硝子 | 134,000 | 515.00 | 69,010,000 |
| 東亜合成 | 82,200 | 1,176.00 | 96,667,200 |
| 大阪ソーダ | 57,000 | 485.00 | 27,645,000 |
| 関東電化工業 | 27,000 | 1,082.00 | 29,214,000 |
| デンカ | 272,000 | 567.00 | 154,224,000 |
| イビデン | 87,800 | 1,781.00 | 156,371,800 |
| 信越化学工業 | 235,800 | 9,505.00 | 2,241,279,000 |
| 日本カーバイド工業 | 45,000 | 151.00 | 6,795,000 |
| 堺化学工業 | 49,000 | 403.00 | 19,747,000 |
| エア・ウォーター | 108,400 | 2,079.00 | 225,363,600 |
| 大陽日酸 | 101,300 | 1,301.00 | 131,791,300 |
| 日本化学工業 | 49,000 | 239.00 | 11,711,000 |
| 日本パーカライジング | 67,100 | 1,416.00 | 95,013,600 |
| 高压ガス工業 | 19,500 | 723.00 | 14,098,500 |
| チタン工業 | 16,000 | 191.00 | 3,056,000 |
| 四国化成工業 | 19,000 | 1,098.00 | 20,862,000 |
| 戸田工業 | 26,000 | 286.00 | 7,436,000 |
| ステラ ケミファ | 6,200 | 3,475.00 | 21,545,000 |
| 保土谷化学工業 | 4,600 | 3,255.00 | 14,973,000 |
| 日本触媒 | 20,700 | 7,450.00 | 154,215,000 |
| 大日精化工業 | 54,000 | 667.00 | 36,018,000 |
| カネカ | 177,000 | 963.00 | 170,451,000 |
| 協和発酵キリン | 157,300 | 1,604.00 | 252,309,200 |
| 三菱瓦斯化学 | 122,500 | 2,259.00 | 276,727,500 |
| 三井化学 | 597,000 | 505.00 | 301,485,000 |
| J S R | 132,100 | 2,003.00 | 264,596,300 |
| 東京応化工業 | 24,600 | 3,580.00 | 88,068,000 |
| 大阪有機化学工業 | 8,700 | 883.00 | 7,682,100 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 885,600 | 774.90 | 686,251,440 |
| K Hネオケム | 16,100 | 1,366.00 | 21,992,600 |
| ダイセル | 177,300 | 1,360.00 | 241,128,000 |

| | | | |
|------------------|---------|----------|---------------|
| 住友ベークライト | 116,000 | 671.00 | 77,836,000 |
| 積水化学工業 | 298,400 | 1,848.00 | 551,443,200 |
| 日本ゼオン | 111,000 | 1,279.00 | 141,969,000 |
| アイカ工業 | 42,100 | 2,914.00 | 122,679,400 |
| 宇部興産 | 662,000 | 255.00 | 168,810,000 |
| 積水樹脂 | 20,300 | 1,773.00 | 35,991,900 |
| タキロン | 28,000 | 540.00 | 15,120,000 |
| 旭有機材 | 42,000 | 236.00 | 9,912,000 |
| 日立化成 | 73,100 | 3,205.00 | 234,285,500 |
| ニチバン | 13,000 | 867.00 | 11,271,000 |
| リケンテクノス | 28,400 | 535.00 | 15,194,000 |
| 大倉工業 | 32,000 | 545.00 | 17,440,000 |
| 積水化成品工業 | 18,200 | 808.00 | 14,705,600 |
| 群栄化学工業 | 3,100 | 3,455.00 | 10,710,500 |
| タイガースポリマー | 6,500 | 846.00 | 5,499,000 |
| ミライアル | 5,000 | 935.00 | 4,675,000 |
| ダイキアクシス | 2,200 | 1,182.00 | 2,600,400 |
| ダイキョーニシカワ | 23,100 | 1,451.00 | 33,518,100 |
| 日本化薬 | 85,000 | 1,506.00 | 128,010,000 |
| カーリットホールディングス | 12,300 | 566.00 | 6,961,800 |
| E P Sホールディングス | 16,300 | 1,476.00 | 24,058,800 |
| レグス | 3,000 | 883.00 | 2,649,000 |
| プレステージ・インターナショナル | 18,700 | 805.00 | 15,053,500 |
| フェイス | 3,400 | 1,326.00 | 4,508,400 |
| アミューズ | 7,300 | 1,771.00 | 12,928,300 |
| 野村総合研究所 | 92,600 | 3,830.00 | 354,658,000 |
| ドリームインキュベータ | 4,000 | 1,955.00 | 7,820,000 |
| サイバネットシステム | 10,200 | 653.00 | 6,660,600 |
| クイック | 6,800 | 1,172.00 | 7,969,600 |
| T A C | 7,700 | 227.00 | 1,747,900 |
| C Eホールディングス | 1,800 | 1,125.00 | 2,025,000 |
| ケネディクス | 166,200 | 415.00 | 68,973,000 |
| 電通 | 146,100 | 5,190.00 | 758,259,000 |
| インテージホールディングス | 7,100 | 2,123.00 | 15,073,300 |
| テイクアンドギヴ・ニーズ | 6,300 | 890.00 | 5,607,000 |
| 東邦システムサイエンス | 4,300 | 642.00 | 2,760,600 |
| ぴあ | 4,000 | 2,846.00 | 11,384,000 |
| イオンファンタジー | 3,900 | 3,040.00 | 11,856,000 |
| ソースネクスト | 6,800 | 671.00 | 4,562,800 |
| シーティーエス | 3,600 | 1,560.00 | 5,616,000 |
| ネクシィーズグループ | 4,700 | 1,506.00 | 7,078,200 |
| メディカルシステムネットワーク | 14,100 | 412.00 | 5,809,200 |
| 日本精化 | 11,000 | 903.00 | 9,933,000 |
| 扶桑化学工業 | 9,400 | 2,841.00 | 26,705,400 |
| A D E K A | 56,500 | 1,584.00 | 89,496,000 |
| 日油 | 106,000 | 1,166.00 | 123,596,000 |
| ミヨシ油脂 | 50,000 | 139.00 | 6,950,000 |
| 新日本理化 | 21,600 | 155.00 | 3,348,000 |
| ハリマ化成グループ | 11,300 | 776.00 | 8,768,800 |
| 花王 | 333,900 | 5,863.00 | 1,957,655,700 |

| | | | | |
|-----------------|-----------|----------|---------------|--|
| 第一工業製薬 | 29,000 | 424.00 | 12,296,000 | |
| 日華化学 | 4,100 | 1,173.00 | 4,809,300 | |
| 三洋化成工業 | 8,200 | 4,980.00 | 40,836,000 | |
| 武田薬品工業 | 492,900 | 5,021.00 | 2,474,850,900 | |
| アステラス製薬 | 1,343,100 | 1,490.50 | 2,001,890,550 | |
| 大日本住友製薬 | 93,100 | 1,934.00 | 180,055,400 | |
| 塩野義製薬 | 177,900 | 5,605.00 | 997,129,500 | |
| 田辺三菱製薬 | 153,200 | 2,321.00 | 355,577,200 | |
| わかもと製薬 | 7,000 | 259.00 | 1,813,000 | |
| あすか製薬 | 14,300 | 1,772.00 | 25,339,600 | |
| 日本新薬 | 30,100 | 5,660.00 | 170,366,000 | |
| バイオフェルミン製薬 | 2,200 | 2,977.00 | 6,549,400 | |
| 中外製薬 | 130,900 | 3,680.00 | 481,712,000 | |
| 科研製薬 | 24,500 | 5,470.00 | 134,015,000 | |
| エーザイ | 161,800 | 6,139.00 | 993,290,200 | |
| 理研ビタミン | 4,200 | 4,255.00 | 17,871,000 | |
| ロート製薬 | 64,400 | 2,035.00 | 131,054,000 | |
| 小野薬品工業 | 298,600 | 2,446.00 | 730,375,600 | |
| 久光製薬 | 37,100 | 5,930.00 | 220,003,000 | |
| 有機合成薬品工業 | 9,400 | 269.00 | 2,528,600 | |
| 持田製薬 | 9,000 | 8,210.00 | 73,890,000 | |
| 参天製薬 | 237,300 | 1,510.00 | 358,323,000 | |
| 扶桑薬品工業 | 4,500 | 2,836.00 | 12,762,000 | |
| 日本ケミファ | 1,800 | 5,530.00 | 9,954,000 | |
| ツムラ | 44,100 | 3,300.00 | 145,530,000 | |
| 日医工 | 30,700 | 1,619.00 | 49,703,300 | |
| テルモ | 192,400 | 4,065.00 | 782,106,000 | |
| みらかホールディングス | 33,500 | 5,140.00 | 172,190,000 | |
| キッセイ薬品工業 | 23,300 | 2,726.00 | 63,515,800 | |
| 生化学工業 | 24,400 | 1,626.00 | 39,674,400 | |
| 栄研化学 | 11,000 | 2,923.00 | 32,153,000 | |
| 日水製薬 | 5,300 | 1,296.00 | 6,868,800 | |
| 鳥居薬品 | 9,000 | 2,686.00 | 24,174,000 | |
| JCRファーマ | 10,100 | 2,723.00 | 27,502,300 | |
| 東和薬品 | 6,000 | 4,325.00 | 25,950,000 | |
| 富士製薬工業 | 4,300 | 2,796.00 | 12,022,800 | |
| 沢井製薬 | 22,300 | 5,840.00 | 130,232,000 | |
| ゼリア新薬工業 | 26,900 | 1,787.00 | 48,070,300 | |
| 第一三共 | 386,900 | 2,564.50 | 992,205,050 | |
| キョーリン製薬ホールディングス | 32,100 | 2,315.00 | 74,311,500 | |
| 大幸薬品 | 6,600 | 1,825.00 | 12,045,000 | |
| ダイト | 7,400 | 2,204.00 | 16,309,600 | |
| 大塚ホールディングス | 282,700 | 5,243.00 | 1,482,196,100 | |
| 大正製薬ホールディングス | 28,100 | 9,380.00 | 263,578,000 | |
| ペプチドリーム | 24,600 | 5,650.00 | 138,990,000 | |
| 大日本塗料 | 75,000 | 232.00 | 17,400,000 | |
| 日本ペイントホールディングス | 101,500 | 3,375.00 | 342,562,500 | |
| 関西ペイント | 138,100 | 2,306.00 | 318,458,600 | |
| 神東塗料 | 10,000 | 213.00 | 2,130,000 | |
| 中国塗料 | 37,700 | 830.00 | 31,291,000 | |

| | | | |
|-----------------------|---------|----------|-------------|
| 日本特殊塗料 | 9,200 | 1,753.00 | 16,127,600 |
| 藤倉化成 | 17,900 | 657.00 | 11,760,300 |
| 太陽ホールディングス | 10,700 | 4,605.00 | 49,273,500 |
| D I C | 51,900 | 3,560.00 | 184,764,000 |
| サカタインクス | 26,800 | 1,443.00 | 38,672,400 |
| 東洋インキ S C ホールディングス | 130,000 | 545.00 | 70,850,000 |
| T & K T O K A | 9,500 | 1,042.00 | 9,899,000 |
| アルプス技研 | 5,300 | 2,650.00 | 14,045,000 |
| サニックス | 22,000 | 176.00 | 3,872,000 |
| ダイオーズ | 2,600 | 1,072.00 | 2,787,200 |
| 日本空調サービス | 12,800 | 635.00 | 8,128,000 |
| オリエンタルランド | 141,700 | 6,150.00 | 871,455,000 |
| フォーカスシステムズ | 5,100 | 588.00 | 2,998,800 |
| ダスキン | 33,600 | 2,509.00 | 84,302,400 |
| パーク 2 4 | 62,800 | 3,075.00 | 193,110,000 |
| 明光ネットワークジャパン | 16,300 | 1,221.00 | 19,902,300 |
| ファルコホールディングス | 6,300 | 1,469.00 | 9,254,700 |
| クレスコ | 2,900 | 2,414.00 | 7,000,600 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 128,900 | 1,537.00 | 198,119,300 |
| 秀英予備校 | 2,900 | 474.00 | 1,374,600 |
| 田谷 | 2,600 | 652.00 | 1,695,200 |
| ラウンドワン | 41,000 | 805.00 | 33,005,000 |
| リゾートトラスト | 50,800 | 2,056.00 | 104,444,800 |
| オービック | 42,700 | 5,280.00 | 225,456,000 |
| ジャストシステム | 20,100 | 1,129.00 | 22,692,900 |
| T D C ソフトウェアエンジニアリング | 5,500 | 1,285.00 | 7,067,500 |
| ヤフー | 888,500 | 530.00 | 470,905,000 |
| ビー・エム・エル | 17,200 | 2,683.00 | 46,147,600 |
| ワタベウェディング | 2,100 | 516.00 | 1,083,600 |
| トレンドマイクロ | 65,600 | 4,360.00 | 286,016,000 |
| りらいあコミュニケーションズ | 21,700 | 1,078.00 | 23,392,600 |
| インフォメーション・ディベロプメント | 3,700 | 1,123.00 | 4,155,100 |
| リソー教育 | 22,400 | 604.00 | 13,529,600 |
| 日本オラクル | 19,900 | 6,420.00 | 127,758,000 |
| 早稲田アカデミー | 1,900 | 1,106.00 | 2,101,400 |
| アルファシステムズ | 4,100 | 1,918.00 | 7,863,800 |
| フューチャー | 16,800 | 814.00 | 13,675,200 |
| C A C H o l d i n g s | 9,300 | 957.00 | 8,900,100 |
| ソフトバンク・テクノロジー | 3,000 | 4,110.00 | 12,330,000 |
| トーセ | 3,600 | 819.00 | 2,948,400 |
| ユー・エス・エス | 158,700 | 1,960.00 | 311,052,000 |
| オービックビジネスコンサルタント | 6,300 | 5,570.00 | 35,091,000 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 28,100 | 3,185.00 | 89,498,500 |
| アイティフォー | 16,400 | 621.00 | 10,184,400 |
| 東京個別指導学院 | 4,400 | 926.00 | 4,074,400 |
| 東計電算 | 2,300 | 2,233.00 | 5,135,900 |
| サイバーエージェント | 69,000 | 2,922.00 | 201,618,000 |
| 楽天 | 670,000 | 1,090.00 | 730,300,000 |
| エクスネット | 1,300 | 2,147.00 | 2,791,100 |

| | | | |
|------------------|---------|-----------|---------------|
| クリーク・アンド・リバー社 | 4,700 | 1,036.00 | 4,869,200 |
| テー・オー・ダブリュー | 10,600 | 655.00 | 6,943,000 |
| 大塚商会 | 33,300 | 5,890.00 | 196,137,000 |
| 総合メディカル | 6,000 | 3,880.00 | 23,280,000 |
| サイボウズ | 16,800 | 466.00 | 7,828,800 |
| ソフトブレーン | 17,100 | 438.00 | 7,489,800 |
| セントラルスポーツ | 4,500 | 3,085.00 | 13,882,500 |
| パラカ | 3,600 | 1,824.00 | 6,566,400 |
| 電通国際情報サービス | 7,700 | 2,080.00 | 16,016,000 |
| デジタルガレージ | 18,000 | 1,896.00 | 34,128,000 |
| イーエムシステムズ | 4,300 | 1,641.00 | 7,056,300 |
| ウェザーニューズ | 4,200 | 3,445.00 | 14,469,000 |
| C I J | 11,600 | 523.00 | 6,066,800 |
| 東洋ビジネスエンジニアリング | 1,400 | 1,537.00 | 2,151,800 |
| 日本エンタープライズ | 13,400 | 278.00 | 3,725,200 |
| WOWOW | 5,900 | 3,620.00 | 21,358,000 |
| スカラ | 7,800 | 813.00 | 6,341,400 |
| フルキャストホールディングス | 13,500 | 935.00 | 12,622,500 |
| 富士フイルムホールディングス | 260,700 | 4,252.00 | 1,108,496,400 |
| コニカミノルタ | 293,800 | 1,052.00 | 309,077,600 |
| 資生堂 | 249,500 | 3,146.00 | 784,927,000 |
| ライオン | 163,000 | 2,038.00 | 332,194,000 |
| 高砂香料工業 | 8,600 | 3,020.00 | 25,972,000 |
| マンダム | 13,200 | 5,230.00 | 69,036,000 |
| ミルボン | 7,100 | 5,040.00 | 35,784,000 |
| ファンケル | 28,000 | 1,553.00 | 43,484,000 |
| コーセー | 21,300 | 9,300.00 | 198,090,000 |
| コタ | 5,000 | 1,343.00 | 6,715,000 |
| シーズ・ホールディングス | 17,100 | 3,220.00 | 55,062,000 |
| シーボン | 1,600 | 2,497.00 | 3,995,200 |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 13,400 | 10,820.00 | 144,988,000 |
| ノエビアホールディングス | 8,300 | 4,035.00 | 33,490,500 |
| アジュバンコスメジャパン | 2,800 | 959.00 | 2,685,200 |
| エステー | 9,100 | 1,793.00 | 16,316,300 |
| アグロ カネショウ | 5,200 | 1,260.00 | 6,552,000 |
| コニシ | 20,600 | 1,298.00 | 26,738,800 |
| 長谷川香料 | 16,600 | 1,970.00 | 32,702,000 |
| 星光P M C | 7,200 | 1,184.00 | 8,524,800 |
| 小林製薬 | 36,500 | 5,200.00 | 189,800,000 |
| 荒川化学工業 | 11,300 | 1,905.00 | 21,526,500 |
| メック | 10,200 | 1,050.00 | 10,710,000 |
| 日本高純度化学 | 3,800 | 2,493.00 | 9,473,400 |
| タカラバイオ | 28,200 | 1,557.00 | 43,907,400 |
| J C U | 4,100 | 6,220.00 | 25,502,000 |
| 新田ゼラチン | 8,200 | 744.00 | 6,100,800 |
| O A T アグリオ | 1,600 | 1,326.00 | 2,121,600 |
| デクセリアルズ | 34,400 | 1,234.00 | 42,449,600 |
| アース製薬 | 9,500 | 4,830.00 | 45,885,000 |
| イハラケミカル工業 | 18,200 | 1,018.00 | 18,527,600 |
| 北興化学工業 | 13,000 | 470.00 | 6,110,000 |

| | | | |
|------------------|-----------|----------|---------------|
| 大成ラミック | 3,800 | 3,070.00 | 11,666,000 |
| クミアイ化学工業 | 27,200 | 649.00 | 17,652,800 |
| 日本農薬 | 30,000 | 602.00 | 18,060,000 |
| 昭和シェル石油 | 117,500 | 1,058.00 | 124,315,000 |
| 富士興産 | 4,600 | 462.00 | 2,125,200 |
| ニチレキ | 16,100 | 917.00 | 14,763,700 |
| 東燃ゼネラル石油 | 214,000 | 1,324.00 | 283,336,000 |
| ユシロ化学工業 | 7,100 | 1,400.00 | 9,940,000 |
| ピーピー・カストロール | 5,400 | 1,662.00 | 8,974,800 |
| 富士石油 | 30,600 | 385.00 | 11,781,000 |
| MORESCO | 4,500 | 1,720.00 | 7,740,000 |
| 出光興産 | 62,400 | 3,520.00 | 219,648,000 |
| JXホールディングス | 1,458,200 | 530.90 | 774,158,380 |
| コスモエネルギーホールディングス | 39,700 | 1,881.00 | 74,675,700 |
| 横浜ゴム | 79,300 | 1,974.00 | 156,538,200 |
| 東洋ゴム工業 | 69,400 | 1,308.00 | 90,775,200 |
| ブリヂストン | 443,600 | 4,054.00 | 1,798,354,400 |
| 住友ゴム工業 | 123,000 | 1,758.00 | 216,234,000 |
| 藤倉ゴム工業 | 11,100 | 658.00 | 7,303,800 |
| オカモト | 40,000 | 1,074.00 | 42,960,000 |
| アキレス | 10,700 | 1,652.00 | 17,676,400 |
| フコク | 5,300 | 907.00 | 4,807,100 |
| ニッタ | 11,800 | 3,015.00 | 35,577,000 |
| クリエートメディック | 4,400 | 940.00 | 4,136,000 |
| 住友理工 | 24,300 | 1,126.00 | 27,361,800 |
| 三ツ星ベルト | 32,000 | 979.00 | 31,328,000 |
| バンドー化学 | 23,800 | 992.00 | 23,609,600 |
| 旭硝子 | 647,000 | 832.00 | 538,304,000 |
| 日本板硝子 | 59,900 | 805.00 | 48,219,500 |
| 石塚硝子 | 19,000 | 252.00 | 4,788,000 |
| 有沢製作所 | 22,000 | 718.00 | 15,796,000 |
| 日本山村硝子 | 52,000 | 217.00 | 11,284,000 |
| 日本電気硝子 | 271,000 | 698.00 | 189,158,000 |
| オハラ | 5,200 | 868.00 | 4,513,600 |
| 住友大阪セメント | 244,000 | 456.00 | 111,264,000 |
| 太平洋セメント | 793,000 | 404.00 | 320,372,000 |
| リソルホールディングス | 13,000 | 343.00 | 4,459,000 |
| 日本ヒューム | 12,700 | 699.00 | 8,877,300 |
| 日本コンクリート工業 | 29,500 | 335.00 | 9,882,500 |
| 三谷セキサン | 6,600 | 2,707.00 | 17,866,200 |
| アジアパイルホールディングス | 16,300 | 574.00 | 9,356,200 |
| 東海カーボン | 122,800 | 417.00 | 51,207,600 |
| 日本カーボン | 65,000 | 302.00 | 19,630,000 |
| 東洋炭素 | 7,300 | 1,856.00 | 13,548,800 |
| ノリタケカンパニーリミテド | 7,400 | 2,882.00 | 21,326,800 |
| TOTO | 96,600 | 4,235.00 | 409,101,000 |
| 日本碍子 | 165,900 | 2,323.00 | 385,385,700 |
| 日本特殊陶業 | 113,300 | 2,467.00 | 279,511,100 |
| ダントーホールディングス | 11,000 | 190.00 | 2,090,000 |
| MARUWA | 4,800 | 3,715.00 | 17,832,000 |

| | | | |
|--------------------|---------|----------|---------------|
| 品川リフラクトリーズ | 33,000 | 292.00 | 9,636,000 |
| 黒崎播磨 | 28,000 | 422.00 | 11,816,000 |
| ヨータイ | 7,000 | 367.00 | 2,569,000 |
| イソライト工業 | 6,800 | 420.00 | 2,856,000 |
| 東京窯業 | 16,000 | 197.00 | 3,152,000 |
| ニッカトー | 4,800 | 419.00 | 2,011,200 |
| フジインコーポレーテッド | 11,200 | 2,568.00 | 28,761,600 |
| エーアンドエーマテリアル | 28,000 | 132.00 | 3,696,000 |
| ニチアス | 69,000 | 1,166.00 | 80,454,000 |
| 新日鐵住金 | 592,600 | 2,750.00 | 1,629,650,000 |
| 神戸製鋼所 | 227,100 | 1,018.00 | 231,187,800 |
| 中山製鋼所 | 14,700 | 786.00 | 11,554,200 |
| 合同製鐵 | 7,300 | 1,846.00 | 13,475,800 |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 359,200 | 2,090.50 | 750,907,600 |
| 日新製鋼 | 59,900 | 1,550.00 | 92,845,000 |
| 東京製鐵 | 66,500 | 1,020.00 | 67,830,000 |
| 共英製鋼 | 14,000 | 2,246.00 | 31,444,000 |
| 大和工業 | 26,400 | 3,265.00 | 86,196,000 |
| 東京鐵鋼 | 27,000 | 448.00 | 12,096,000 |
| 大阪製鐵 | 8,200 | 2,122.00 | 17,400,400 |
| 淀川製鋼所 | 18,100 | 3,350.00 | 60,635,000 |
| 東洋鋼鈑 | 31,400 | 421.00 | 13,219,400 |
| 丸一鋼管 | 43,900 | 3,770.00 | 165,503,000 |
| モリ工業 | 4,200 | 2,440.00 | 10,248,000 |
| 大同特殊鋼 | 220,000 | 560.00 | 123,200,000 |
| 日本高周波鋼業 | 46,000 | 84.00 | 3,864,000 |
| 日本冶金工業 | 108,800 | 204.00 | 22,195,200 |
| 山陽特殊製鋼 | 78,000 | 610.00 | 47,580,000 |
| 愛知製鋼 | 7,700 | 4,760.00 | 36,652,000 |
| 日立金属 | 133,700 | 1,612.00 | 215,524,400 |
| 日本金属 | 3,200 | 1,264.00 | 4,044,800 |
| 大平洋金属 | 84,000 | 376.00 | 31,584,000 |
| 新日本電工 | 74,400 | 307.00 | 22,840,800 |
| 栗本鐵工所 | 6,300 | 2,385.00 | 15,025,500 |
| 虹 技 | 19,000 | 261.00 | 4,959,000 |
| 日本鑄鉄管 | 14,000 | 192.00 | 2,688,000 |
| 日本製鋼所 | 43,400 | 2,029.00 | 88,058,600 |
| 三菱製鋼 | 91,000 | 252.00 | 22,932,000 |
| 日垂鋼業 | 18,400 | 280.00 | 5,152,000 |
| 日本精線 | 9,000 | 621.00 | 5,589,000 |
| 大紀アルミニウム工業所 | 22,000 | 493.00 | 10,846,000 |
| 日本軽金属ホールディングス | 320,300 | 273.00 | 87,441,900 |
| 三井金属鉱業 | 357,000 | 318.00 | 113,526,000 |
| 東邦亜鉛 | 74,000 | 548.00 | 40,552,000 |
| 三菱マテリアル | 82,000 | 3,815.00 | 312,830,000 |
| 住友金属鉱山 | 340,000 | 1,626.00 | 552,840,000 |
| DOWAホールディングス | 145,000 | 909.00 | 131,805,000 |
| 古河機械金属 | 205,000 | 232.00 | 47,560,000 |
| エス・サイエンス | 65,100 | 38.00 | 2,473,800 |

| | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 14,400 | 1,836.00 | 26,438,400 |
| 東邦チタニウム | 22,200 | 884.00 | 19,624,800 |
| U A C J | 167,000 | 302.00 | 50,434,000 |
| 古河電気工業 | 44,100 | 3,990.00 | 175,959,000 |
| 住友電気工業 | 495,000 | 1,769.50 | 875,902,500 |
| フジクラ | 172,900 | 820.00 | 141,778,000 |
| 昭和電線ホールディングス | 157,000 | 90.00 | 14,130,000 |
| 東京特殊電線 | 1,900 | 1,503.00 | 2,855,700 |
| タツタ電線 | 24,700 | 450.00 | 11,115,000 |
| 沖電線 | 14,000 | 242.00 | 3,388,000 |
| カナレ電気 | 1,900 | 2,256.00 | 4,286,400 |
| 平河ヒューテック | 6,200 | 1,150.00 | 7,130,000 |
| リョービ | 80,000 | 483.00 | 38,640,000 |
| アーレスティ | 15,200 | 1,186.00 | 18,027,200 |
| アサヒホールディングス | 19,800 | 1,995.00 | 39,501,000 |
| 東洋製罐グループホールディングス | 93,300 | 2,106.00 | 196,489,800 |
| ホッカフホールディングス | 34,000 | 489.00 | 16,626,000 |
| コロナ | 6,900 | 1,151.00 | 7,941,900 |
| 横河ブリッジホールディングス | 23,100 | 1,404.00 | 32,432,400 |
| OSJBホールディングス | 43,300 | 243.00 | 10,521,900 |
| 駒井ハルテック | 2,500 | 2,089.00 | 5,222,500 |
| 高田機工 | 12,000 | 233.00 | 2,796,000 |
| 三和ホールディングス | 130,400 | 1,034.00 | 134,833,600 |
| 文化シャッター | 36,600 | 849.00 | 31,073,400 |
| 三協立山 | 17,200 | 1,719.00 | 29,566,800 |
| アルインコ | 9,100 | 1,025.00 | 9,327,500 |
| 東洋シャッター | 3,400 | 640.00 | 2,176,000 |
| L I X I Lグループ | 183,000 | 2,854.00 | 522,282,000 |
| 日本フィルコン | 9,800 | 569.00 | 5,576,200 |
| ノーリツ | 25,700 | 1,953.00 | 50,192,100 |
| 長府製作所 | 14,000 | 2,552.00 | 35,728,000 |
| リンナイ | 22,400 | 9,550.00 | 213,920,000 |
| ユニプレス | 24,200 | 2,269.00 | 54,909,800 |
| ダイニチ工業 | 7,000 | 719.00 | 5,033,000 |
| 日東精工 | 19,000 | 404.00 | 7,676,000 |
| 三洋工業 | 17,000 | 198.00 | 3,366,000 |
| 岡部 | 27,300 | 939.00 | 25,634,700 |
| ジーテクト | 13,700 | 2,065.00 | 28,290,500 |
| 中国工業 | 2,300 | 688.00 | 1,582,400 |
| 東プレ | 25,300 | 2,790.00 | 70,587,000 |
| 高周波熱錬 | 24,400 | 907.00 | 22,130,800 |
| 東京製綱 | 8,900 | 1,926.00 | 17,141,400 |
| サンコール | 7,100 | 540.00 | 3,834,000 |
| モリテックスチール | 7,200 | 286.00 | 2,059,200 |
| パイオラックス | 6,600 | 7,080.00 | 46,728,000 |
| 日本発条 | 123,500 | 1,209.00 | 149,311,500 |
| 中央発條 | 15,000 | 333.00 | 4,995,000 |
| アドパネクス | 2,300 | 1,970.00 | 4,531,000 |
| 三浦工業 | 53,700 | 1,760.00 | 94,512,000 |
| タクマ | 42,100 | 963.00 | 40,542,300 |

| | | | |
|------------------|---------|-----------|---------------|
| テクノプロ・ホールディングス | 21,300 | 3,930.00 | 83,709,000 |
| インターワークス | 2,600 | 1,160.00 | 3,016,000 |
| Keepers 技研 | 1,500 | 1,939.00 | 2,908,500 |
| ファーストロジック | 700 | 2,222.00 | 1,555,400 |
| イー・ガーディアン | 4,300 | 1,921.00 | 8,260,300 |
| リブセンス | 9,300 | 452.00 | 4,203,600 |
| ジャパンマテリアル | 9,600 | 1,643.00 | 15,772,800 |
| ベクトル | 10,700 | 1,169.00 | 12,508,300 |
| ウチヤマホールディングス | 6,300 | 432.00 | 2,721,600 |
| サクセスホールディングス | 1,100 | 1,408.00 | 1,548,800 |
| キャリアリンク | 3,100 | 752.00 | 2,331,200 |
| I B J | 10,300 | 569.00 | 5,860,700 |
| アサンテ | 4,900 | 1,697.00 | 8,315,300 |
| N・フィールド | 6,200 | 1,454.00 | 9,014,800 |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 1,700 | 4,155.00 | 7,063,500 |
| ライドオン・エクスプレス | 3,100 | 857.00 | 2,656,700 |
| E R Iホールディングス | 3,700 | 799.00 | 2,956,300 |
| アビスト | 2,100 | 3,750.00 | 7,875,000 |
| ウィルグループ | 5,400 | 726.00 | 3,920,400 |
| 日本ビューホテル | 1,900 | 1,358.00 | 2,580,200 |
| リクルートホールディングス | 286,500 | 5,110.00 | 1,464,015,000 |
| エラン | 1,700 | 1,250.00 | 2,125,000 |
| ツガミ | 35,000 | 689.00 | 24,115,000 |
| オークマ | 85,000 | 1,144.00 | 97,240,000 |
| 東芝機械 | 78,000 | 485.00 | 37,830,000 |
| アマダホールディングス | 176,700 | 1,310.00 | 231,477,000 |
| アイダエンジニアリング | 37,300 | 1,085.00 | 40,470,500 |
| 滝澤鉄工所 | 39,000 | 165.00 | 6,435,000 |
| 富士機械製造 | 40,000 | 1,442.00 | 57,680,000 |
| 牧野フライス製作所 | 65,000 | 997.00 | 64,805,000 |
| オーエスジー | 59,800 | 2,333.00 | 139,513,400 |
| ダイジェット工業 | 17,000 | 176.00 | 2,992,000 |
| 旭ダイヤモンド工業 | 37,600 | 840.00 | 31,584,000 |
| D M G 森精機 | 77,700 | 1,497.00 | 116,316,900 |
| ソディック | 33,300 | 987.00 | 32,867,100 |
| ディスコ | 15,400 | 16,220.00 | 249,788,000 |
| 日東工器 | 7,600 | 2,470.00 | 18,772,000 |
| パンチ工業 | 4,800 | 940.00 | 4,512,000 |
| 日本郵政 | 341,900 | 1,431.00 | 489,258,900 |
| ベルシステム24ホールディングス | 20,000 | 978.00 | 19,560,000 |
| ソラスト | 6,000 | 1,370.00 | 8,220,000 |
| 豊田自動織機 | 114,300 | 5,210.00 | 595,503,000 |
| 豊和工業 | 7,600 | 683.00 | 5,190,800 |
| O K K | 48,000 | 124.00 | 5,952,000 |
| 石川製作所 | 3,500 | 775.00 | 2,712,500 |
| 東洋機械金属 | 8,900 | 566.00 | 5,037,400 |
| 津田駒工業 | 30,000 | 180.00 | 5,400,000 |
| エンシュウ | 34,000 | 99.00 | 3,366,000 |
| 島精機製作所 | 17,100 | 3,740.00 | 63,954,000 |
| N Cホールディングス | 4,400 | 927.00 | 4,078,800 |

| | | | |
|--------------|---------|-----------|---------------|
| フリー | 2,600 | 4,925.00 | 12,805,000 |
| ヤマシンフィルタ | 2,600 | 1,685.00 | 4,381,000 |
| 日阪製作所 | 17,800 | 925.00 | 16,465,000 |
| やまびこ | 24,100 | 1,547.00 | 37,282,700 |
| ペガサスミシン製造 | 12,700 | 791.00 | 10,045,700 |
| ナプテスコ | 68,300 | 2,925.00 | 199,777,500 |
| 三井海洋開発 | 13,200 | 1,828.00 | 24,129,600 |
| レオン自動機 | 11,100 | 1,089.00 | 12,087,900 |
| S M C | 39,400 | 30,880.00 | 1,216,672,000 |
| 新川 | 11,000 | 822.00 | 9,042,000 |
| ホソカワミクロン | 22,000 | 791.00 | 17,402,000 |
| ユニオンツール | 5,700 | 3,110.00 | 17,727,000 |
| オイレス工業 | 16,900 | 2,041.00 | 34,492,900 |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 4,200 | 2,131.00 | 8,950,200 |
| サトーホールディングス | 16,300 | 2,425.00 | 39,527,500 |
| 日本エアーテック | 4,400 | 655.00 | 2,882,000 |
| 日精樹脂工業 | 10,400 | 1,025.00 | 10,660,000 |
| オカダアイオン | 2,800 | 1,094.00 | 3,063,200 |
| ワイエイシイ | 5,000 | 1,546.00 | 7,730,000 |
| 小松製作所 | 606,100 | 2,770.50 | 1,679,200,050 |
| 住友重機械工業 | 383,000 | 788.00 | 301,804,000 |
| 日立建機 | 58,700 | 2,606.00 | 152,972,200 |
| 日工 | 4,000 | 2,148.00 | 8,592,000 |
| 巴工業 | 5,400 | 1,893.00 | 10,222,200 |
| 井関農機 | 134,000 | 225.00 | 30,150,000 |
| T O W A | 10,800 | 1,615.00 | 17,442,000 |
| 丸山製作所 | 28,000 | 196.00 | 5,488,000 |
| 北川鉄工所 | 6,000 | 2,459.00 | 14,754,000 |
| シンニッタン | 10,800 | 695.00 | 7,506,000 |
| ローツェ | 4,700 | 2,136.00 | 10,039,200 |
| タカキタ | 3,600 | 551.00 | 1,983,600 |
| クボタ | 628,700 | 1,822.00 | 1,145,491,400 |
| 荏原実業 | 3,700 | 1,343.00 | 4,969,100 |
| 東洋エンジニアリング | 83,000 | 304.00 | 25,232,000 |
| 三菱化工機 | 43,000 | 215.00 | 9,245,000 |
| 月島機械 | 24,900 | 1,216.00 | 30,278,400 |
| 帝国電機製作所 | 9,600 | 996.00 | 9,561,600 |
| 東京機械製作所 | 50,000 | 76.00 | 3,800,000 |
| 新東工業 | 29,700 | 1,012.00 | 30,056,400 |
| 澁谷工業 | 11,000 | 2,324.00 | 25,564,000 |
| アイチコーポレーション | 18,600 | 900.00 | 16,740,000 |
| 小森コーポレーション | 31,500 | 1,520.00 | 47,880,000 |
| 鶴見製作所 | 9,800 | 1,478.00 | 14,484,400 |
| 住友精密工業 | 21,000 | 353.00 | 7,413,000 |
| 酒井重工業 | 25,000 | 337.00 | 8,425,000 |
| 荏原製作所 | 59,500 | 3,485.00 | 207,357,500 |
| 石井鐵工所 | 2,000 | 1,785.00 | 3,570,000 |
| 西島製作所 | 12,900 | 1,110.00 | 14,319,000 |
| 北越工業 | 14,100 | 886.00 | 12,492,600 |
| 千代田化工建設 | 101,000 | 738.00 | 74,538,000 |

| | | | |
|---------------|---------|-----------|---------------|
| ダイキン工業 | 171,400 | 11,245.00 | 1,927,393,000 |
| オルガノ | 25,000 | 479.00 | 11,975,000 |
| トーヨーカネツ | 60,000 | 343.00 | 20,580,000 |
| 栗田工業 | 74,300 | 2,668.00 | 198,232,400 |
| 椿本チエイン | 75,000 | 875.00 | 65,625,000 |
| 大同工業 | 26,000 | 273.00 | 7,098,000 |
| 日機装 | 43,400 | 1,044.00 | 45,309,600 |
| 木村化工機 | 11,500 | 342.00 | 3,933,000 |
| 新興プランテック | 28,800 | 880.00 | 25,344,000 |
| アネスト岩田 | 22,800 | 1,061.00 | 24,190,800 |
| ダイフク | 62,700 | 2,494.00 | 156,373,800 |
| サムコ | 3,300 | 1,049.00 | 3,461,700 |
| 加藤製作所 | 6,900 | 3,005.00 | 20,734,500 |
| 油研工業 | 24,000 | 219.00 | 5,256,000 |
| タダノ | 65,600 | 1,416.00 | 92,889,600 |
| フジテック | 36,500 | 1,310.00 | 47,815,000 |
| C K D | 37,600 | 1,475.00 | 55,460,000 |
| キトー | 15,800 | 1,209.00 | 19,102,200 |
| 平和 | 38,900 | 2,695.00 | 104,835,500 |
| 理想科学工業 | 12,500 | 2,007.00 | 25,087,500 |
| SANKYO | 34,800 | 3,905.00 | 135,894,000 |
| 日本金銭機械 | 11,600 | 1,489.00 | 17,272,400 |
| マースエンジニアリング | 7,100 | 2,263.00 | 16,067,300 |
| 福島工業 | 7,800 | 3,500.00 | 27,300,000 |
| オーイズミ | 5,500 | 683.00 | 3,756,500 |
| ダイコク電機 | 5,200 | 1,736.00 | 9,027,200 |
| 竹内製作所 | 22,900 | 2,296.00 | 52,578,400 |
| アマノ | 38,900 | 2,115.00 | 82,273,500 |
| JUKI | 19,800 | 1,193.00 | 23,621,400 |
| サンデンホールディングス | 77,000 | 341.00 | 26,257,000 |
| 蛇の目ミシン工業 | 12,200 | 823.00 | 10,040,600 |
| ブラザー工業 | 162,300 | 2,094.00 | 339,856,200 |
| マックス | 19,000 | 1,497.00 | 28,443,000 |
| モリタホールディングス | 22,000 | 1,590.00 | 34,980,000 |
| グローリー | 40,100 | 3,660.00 | 146,766,000 |
| 新晃工業 | 8,800 | 1,419.00 | 12,487,200 |
| 大和冷機工業 | 20,100 | 982.00 | 19,738,200 |
| セガサミーホールディングス | 124,500 | 1,680.00 | 209,160,000 |
| 日本ピストンリング | 4,900 | 2,014.00 | 9,868,600 |
| リケン | 5,800 | 4,215.00 | 24,447,000 |
| T P R | 14,100 | 3,085.00 | 43,498,500 |
| ツバキ・ナカシマ | 14,100 | 1,895.00 | 26,719,500 |
| ホシザキ | 27,500 | 8,950.00 | 246,125,000 |
| 大豊工業 | 10,200 | 1,515.00 | 15,453,000 |
| 日本精工 | 257,800 | 1,451.00 | 374,067,800 |
| NTN | 290,000 | 512.00 | 148,480,000 |
| ジェイテクト | 133,700 | 1,764.00 | 235,846,800 |
| 不二越 | 126,000 | 551.00 | 69,426,000 |
| ミネベアミツミ | 228,345 | 1,152.00 | 263,053,440 |
| 日本トムソン | 40,100 | 522.00 | 20,932,200 |

| | | | |
|-------------------|-----------|-----------|---------------|
| THK | 88,700 | 2,746.00 | 243,570,200 |
| ユーシン精機 | 5,600 | 2,791.00 | 15,629,600 |
| 前澤給装工業 | 4,800 | 1,515.00 | 7,272,000 |
| イーグル工業 | 13,600 | 1,514.00 | 20,590,400 |
| 前澤工業 | 9,300 | 358.00 | 3,329,400 |
| 日本ピラー工業 | 12,700 | 1,574.00 | 19,989,800 |
| キッツ | 60,100 | 660.00 | 39,666,000 |
| 日立製作所 | 3,014,000 | 672.30 | 2,026,312,200 |
| 東芝 | 2,808,000 | 240.50 | 675,324,000 |
| 三菱電機 | 1,338,900 | 1,608.50 | 2,153,620,650 |
| 富士電機 | 378,000 | 668.00 | 252,504,000 |
| 東洋電機製造 | 5,000 | 1,605.00 | 8,025,000 |
| 安川電機 | 145,500 | 2,055.00 | 299,002,500 |
| シンフォニアテクノロジー | 81,000 | 300.00 | 24,300,000 |
| 明電舎 | 115,000 | 357.00 | 41,055,000 |
| オリジン電気 | 18,000 | 308.00 | 5,544,000 |
| 山洋電気 | 33,000 | 826.00 | 27,258,000 |
| デンヨー | 11,600 | 1,622.00 | 18,815,200 |
| 日立工機 | 33,600 | 867.00 | 29,131,200 |
| 三櫻工業 | 16,100 | 861.00 | 13,862,100 |
| マキタ | 81,800 | 7,390.00 | 604,502,000 |
| 東芝テック | 79,000 | 620.00 | 48,980,000 |
| 芝浦メカトロニクス | 21,000 | 276.00 | 5,796,000 |
| マブチモーター | 35,400 | 5,740.00 | 203,196,000 |
| 日本電産 | 162,700 | 10,405.00 | 1,692,893,500 |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス | 1,500 | 2,951.00 | 4,426,500 |
| 東光高岳 | 6,400 | 2,210.00 | 14,144,000 |
| ダブル・スコープ | 12,100 | 1,835.00 | 22,203,500 |
| 宮越ホールディングス | 4,500 | 490.00 | 2,205,000 |
| ダイヘン | 69,000 | 703.00 | 48,507,000 |
| 田淵電機 | 19,100 | 400.00 | 7,640,000 |
| ヤーマン | 1,600 | 6,160.00 | 9,856,000 |
| JVCケンウッド | 92,200 | 304.00 | 28,028,800 |
| ミマキエンジニアリング | 11,300 | 667.00 | 7,537,100 |
| 第一精工 | 5,900 | 1,319.00 | 7,782,100 |
| 日新電機 | 25,200 | 1,323.00 | 33,339,600 |
| 大崎電気工業 | 25,000 | 1,078.00 | 26,950,000 |
| オムロン | 133,400 | 4,835.00 | 644,989,000 |
| 日東工業 | 18,400 | 1,514.00 | 27,857,600 |
| I D E C | 16,400 | 1,119.00 | 18,351,600 |
| 不二電機工業 | 1,400 | 1,409.00 | 1,972,600 |
| ジーエス・ユアサコーポレーション | 242,000 | 469.00 | 113,498,000 |
| サクサホールディングス | 32,000 | 225.00 | 7,200,000 |
| メルコホールディングス | 7,000 | 3,255.00 | 22,785,000 |
| テクノメディカ | 2,900 | 2,094.00 | 6,072,600 |
| 日本電気 | 1,725,000 | 265.00 | 457,125,000 |
| 富士通 | 1,210,000 | 677.30 | 819,533,000 |
| 沖電気工業 | 54,300 | 1,547.00 | 84,002,100 |
| 岩崎通信機 | 56,000 | 87.00 | 4,872,000 |
| 電気興業 | 36,000 | 567.00 | 20,412,000 |

| | | | |
|------------------|-----------|-----------|---------------|
| サンケン電気 | 73,000 | 494.00 | 36,062,000 |
| ナカヨ | 13,000 | 416.00 | 5,408,000 |
| アイホン | 7,200 | 1,817.00 | 13,082,400 |
| ルネサスエレクトロニクス | 65,100 | 993.00 | 64,644,300 |
| セイコーエプソン | 186,900 | 2,419.00 | 452,111,100 |
| ワコム | 97,500 | 340.00 | 33,150,000 |
| アルバック | 21,200 | 3,965.00 | 84,058,000 |
| アクセル | 5,300 | 815.00 | 4,319,500 |
| E I Z O | 12,400 | 3,215.00 | 39,866,000 |
| ジャパンディスプレイ | 234,500 | 322.00 | 75,509,000 |
| 日本信号 | 34,600 | 1,063.00 | 36,779,800 |
| 京三製作所 | 29,000 | 391.00 | 11,339,000 |
| 能美防災 | 14,200 | 1,667.00 | 23,671,400 |
| ホーチキ | 9,100 | 1,384.00 | 12,594,400 |
| エレコム | 10,900 | 1,928.00 | 21,015,200 |
| 日本無線 | 7,700 | 1,395.00 | 10,741,500 |
| パナソニック | 1,434,000 | 1,175.50 | 1,685,667,000 |
| アンリツ | 91,400 | 810.00 | 74,034,000 |
| 富士通ゼネラル | 43,000 | 2,110.00 | 90,730,000 |
| 日立国際電気 | 32,900 | 2,487.00 | 81,822,300 |
| ソニー | 886,200 | 3,599.00 | 3,189,433,800 |
| T D K | 70,700 | 7,560.00 | 534,492,000 |
| 帝国通信工業 | 27,000 | 176.00 | 4,752,000 |
| タムラ製作所 | 48,000 | 457.00 | 21,936,000 |
| アルプス電気 | 115,900 | 3,105.00 | 359,869,500 |
| 池上通信機 | 40,000 | 148.00 | 5,920,000 |
| パイオニア | 188,700 | 249.00 | 46,986,300 |
| 日本電波工業 | 12,200 | 846.00 | 10,321,200 |
| 鈴木 | 4,900 | 519.00 | 2,543,100 |
| 日本トリム | 3,100 | 3,920.00 | 12,152,000 |
| ローランド ディー . ジー . | 6,400 | 3,355.00 | 21,472,000 |
| 日本コロムビア | 3,900 | 671.00 | 2,616,900 |
| フォスター電機 | 14,700 | 1,739.00 | 25,563,300 |
| クラリオン | 66,000 | 430.00 | 28,380,000 |
| S M K | 32,000 | 409.00 | 13,088,000 |
| ヨコオ | 9,000 | 1,071.00 | 9,639,000 |
| ティアック | 92,000 | 45.00 | 4,140,000 |
| ホシデン | 38,100 | 1,009.00 | 38,442,900 |
| ヒロセ電機 | 20,300 | 14,510.00 | 294,553,000 |
| 日本航空電子工業 | 36,000 | 1,455.00 | 52,380,000 |
| T O A | 14,800 | 1,021.00 | 15,110,800 |
| 日立マクセル | 18,700 | 2,221.00 | 41,532,700 |
| 古野電気 | 16,200 | 739.00 | 11,971,800 |
| ユニデンホールディングス | 37,000 | 165.00 | 6,105,000 |
| アルパイン | 29,900 | 1,709.00 | 51,099,100 |
| スミダコーポレーション | 10,300 | 1,227.00 | 12,638,100 |
| アイコム | 6,900 | 2,227.00 | 15,366,300 |
| リオン | 4,900 | 1,564.00 | 7,663,600 |
| 本多通信工業 | 3,600 | 1,211.00 | 4,359,600 |
| 船井電機 | 13,800 | 889.00 | 12,268,200 |

| | | | |
|--------------------|---------|-----------|---------------|
| 横河電機 | 136,100 | 1,779.00 | 242,121,900 |
| 新電元工業 | 48,000 | 424.00 | 20,352,000 |
| アズビル | 38,000 | 3,560.00 | 135,280,000 |
| 東亜ディーケーケー | 6,400 | 543.00 | 3,475,200 |
| 日本光電工業 | 52,500 | 2,348.00 | 123,270,000 |
| チノー | 4,600 | 1,201.00 | 5,524,600 |
| 共和電業 | 14,400 | 402.00 | 5,788,800 |
| 日本電子材料 | 5,100 | 651.00 | 3,320,100 |
| 堀場製作所 | 24,900 | 5,840.00 | 145,416,000 |
| アドバンテスト | 85,600 | 2,024.00 | 173,254,400 |
| 小野測器 | 6,300 | 866.00 | 5,455,800 |
| エスベック | 11,100 | 1,268.00 | 14,074,800 |
| パナソニック デバイスSUNX | 11,100 | 800.00 | 8,880,000 |
| キーエンス | 56,900 | 43,880.00 | 2,496,772,000 |
| 日置電機 | 6,600 | 2,172.00 | 14,335,200 |
| シスメックス | 97,500 | 6,190.00 | 603,525,000 |
| 日本マイクロニクス | 23,400 | 936.00 | 21,902,400 |
| メガチップス | 11,700 | 2,883.00 | 33,731,100 |
| OBARA GROUP | 7,300 | 5,200.00 | 37,960,000 |
| イマジカ・ロボット ホールディングス | 10,500 | 748.00 | 7,854,000 |
| 澤藤電機 | 8,000 | 221.00 | 1,768,000 |
| デンソー | 309,500 | 4,867.00 | 1,506,336,500 |
| コーセル | 17,400 | 1,312.00 | 22,828,800 |
| イリソ電子工業 | 4,000 | 6,680.00 | 26,720,000 |
| 新日本無線 | 9,900 | 411.00 | 4,068,900 |
| オブテックスグループ | 9,500 | 2,836.00 | 26,942,000 |
| 千代田インテグレ | 6,600 | 2,398.00 | 15,826,800 |
| アイ・オー・データ機器 | 4,000 | 1,251.00 | 5,004,000 |
| レーザーテック | 13,800 | 2,673.00 | 36,887,400 |
| スタンレー電気 | 89,500 | 3,045.00 | 272,527,500 |
| 岩崎電気 | 46,000 | 178.00 | 8,188,000 |
| ウシオ電機 | 76,200 | 1,438.00 | 109,575,600 |
| 岡谷電機産業 | 7,000 | 409.00 | 2,863,000 |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 11,800 | 580.00 | 6,844,000 |
| 日本セラミック | 10,300 | 2,059.00 | 21,207,700 |
| 遠藤照明 | 6,400 | 930.00 | 5,952,000 |
| 古河電池 | 9,000 | 741.00 | 6,669,000 |
| 双信電機 | 6,500 | 293.00 | 1,904,500 |
| 山一電機 | 11,800 | 1,205.00 | 14,219,000 |
| 図研 | 8,200 | 1,257.00 | 10,307,400 |
| 日本電子 | 46,000 | 556.00 | 25,576,000 |
| カシオ計算機 | 101,000 | 1,483.00 | 149,783,000 |
| ファナック | 127,300 | 21,565.00 | 2,745,224,500 |
| 日本シイエムケイ | 27,100 | 660.00 | 17,886,000 |
| エンプラス | 5,700 | 3,310.00 | 18,867,000 |
| 大真空 | 4,600 | 1,369.00 | 6,297,400 |
| ローム | 60,700 | 7,470.00 | 453,429,000 |
| 浜松ホトニクス | 97,900 | 3,170.00 | 310,343,000 |
| 三井ハイテック | 16,600 | 850.00 | 14,110,000 |

| | | | | |
|---------------------|-----------|-----------|---------------|---|
| 新光電気工業 | 47,400 | 732.00 | 34,696,800 | |
| 京セラ | 206,000 | 6,037.00 | 1,243,622,000 | |
| 協栄産業 | 16,000 | 167.00 | 2,672,000 | |
| 太陽誘電 | 61,000 | 1,391.00 | 84,851,000 | |
| 村田製作所 | 131,700 | 15,385.00 | 2,026,204,500 | |
| ユーシン | 16,800 | 836.00 | 14,044,800 | |
| 双葉電子工業 | 20,500 | 1,949.00 | 39,954,500 | |
| 日東電工 | 94,800 | 9,259.00 | 877,753,200 | |
| 北陸電気工業 | 51,000 | 138.00 | 7,038,000 | |
| 東海理化電機製作所 | 33,000 | 2,112.00 | 69,696,000 | |
| ニチコン | 39,500 | 946.00 | 37,367,000 | |
| 日本ケミコン | 108,000 | 290.00 | 31,320,000 | |
| K O A | 17,400 | 1,294.00 | 22,515,600 | |
| 三井造船 | 453,000 | 181.00 | 81,993,000 | |
| 日立造船 | 99,300 | 606.00 | 60,175,800 | |
| 三菱重工業 | 2,103,000 | 468.40 | 985,045,200 | |
| 川崎重工業 | 977,000 | 351.00 | 342,927,000 | |
| I H I | 965,000 | 321.00 | 309,765,000 | |
| 名村造船所 | 37,600 | 774.00 | 29,102,400 | |
| サノヤスホールディングス | 15,300 | 288.00 | 4,406,400 | |
| 日本車輛製造 | 46,000 | 279.00 | 12,834,000 | |
| ニチユ三菱フォークリフト | 14,500 | 687.00 | 9,961,500 | |
| 近畿車輛 | 1,900 | 2,547.00 | 4,839,300 | |
| F P G | 44,200 | 983.00 | 43,448,600 | |
| 島根銀行 | 2,800 | 1,387.00 | 3,883,600 | |
| じもとホールディングス | 89,200 | 193.00 | 17,215,600 | |
| 全国保証 | 34,900 | 3,585.00 | 125,116,500 | |
| めぶきフィナンシャルグループ | 597,300 | 446.00 | 266,395,800 | |
| 東京ＴＹフィナンシャルグループ | 17,900 | 3,905.00 | 69,899,500 | |
| 九州フィナンシャルグループ | 203,100 | 796.00 | 161,667,600 | |
| かんぽ生命保険 | 46,800 | 2,672.00 | 125,049,600 | |
| ゆうちょ銀行 | 350,800 | 1,402.00 | 491,821,600 | |
| 富山第一銀行 | 31,600 | 529.00 | 16,716,400 | |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 811,100 | 605.10 | 490,796,610 | |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 84,000 | 1,212.00 | 101,808,000 | |
| 日産自動車 | 1,480,300 | 1,123.00 | 1,662,376,900 | |
| いすゞ自動車 | 363,700 | 1,466.00 | 533,184,200 | |
| トヨタ自動車 | 1,526,000 | 6,346.00 | 9,683,996,000 | * |
| 日野自動車 | 179,100 | 1,264.00 | 226,382,400 | |
| 三菱自動車工業 | 460,100 | 669.00 | 307,806,900 | |
| エフテック | 6,700 | 1,345.00 | 9,011,500 | |
| レシップホールディングス | 4,300 | 895.00 | 3,848,500 | |
| G M B | 2,100 | 1,254.00 | 2,633,400 | |
| ファルテック | 2,300 | 1,383.00 | 3,180,900 | |
| 武蔵精密工業 | 14,600 | 3,015.00 | 44,019,000 | |
| 日産車体 | 55,100 | 1,060.00 | 58,406,000 | |
| 新明和工業 | 51,000 | 1,174.00 | 59,874,000 | |
| 極東開発工業 | 25,000 | 1,695.00 | 42,375,000 | |

| | | | |
|--------------|-----------|-----------|---------------|
| 日信工業 | 28,000 | 1,921.00 | 53,788,000 |
| トビー工業 | 10,300 | 3,265.00 | 33,629,500 |
| ティラド | 49,000 | 295.00 | 14,455,000 |
| 曙ブレーキ工業 | 58,500 | 266.00 | 15,561,000 |
| タチエス | 21,300 | 1,813.00 | 38,616,900 |
| NOK | 60,700 | 2,450.00 | 148,715,000 |
| フタバ産業 | 38,300 | 699.00 | 26,771,700 |
| KYB | 140,000 | 538.00 | 75,320,000 |
| 市光工業 | 26,000 | 412.00 | 10,712,000 |
| 大同メタル工業 | 15,800 | 1,030.00 | 16,274,000 |
| プレス工業 | 66,600 | 512.00 | 34,099,200 |
| ミクニ | 16,000 | 392.00 | 6,272,000 |
| カルソニックカンセイ | 85,000 | 1,805.00 | 153,425,000 |
| 太平洋工業 | 25,800 | 1,411.00 | 36,403,800 |
| ケーヒン | 28,800 | 1,806.00 | 52,012,800 |
| 河西工業 | 16,700 | 1,276.00 | 21,309,200 |
| アイシン精機 | 114,800 | 5,350.00 | 614,180,000 |
| 富士機工 | 12,500 | 498.00 | 6,225,000 |
| マツダ | 397,400 | 1,556.00 | 618,354,400 |
| 今仙電機製作所 | 11,500 | 991.00 | 11,396,500 |
| 本田技研工業 | 1,129,500 | 3,541.00 | 3,999,559,500 |
| スズキ | 248,800 | 4,400.00 | 1,094,720,000 |
| 富士重工業 | 389,700 | 4,329.00 | 1,687,011,300 |
| 安永 | 4,300 | 1,650.00 | 7,095,000 |
| ヤマハ発動機 | 177,300 | 2,323.00 | 411,867,900 |
| ショーワ | 32,700 | 937.00 | 30,639,900 |
| 小糸製作所 | 75,200 | 5,790.00 | 435,408,000 |
| TBK | 16,300 | 491.00 | 8,003,300 |
| エクセディ | 17,000 | 3,090.00 | 52,530,000 |
| ミツバ | 23,100 | 1,896.00 | 43,797,600 |
| 豊田合成 | 40,500 | 2,699.00 | 109,309,500 |
| 愛三工業 | 22,000 | 924.00 | 20,328,000 |
| 盟和産業 | 1,800 | 1,202.00 | 2,163,600 |
| ヨロズ | 11,700 | 1,553.00 | 18,170,100 |
| エフ・シー・シー | 20,500 | 2,127.00 | 43,603,500 |
| 新家工業 | 29,000 | 164.00 | 4,756,000 |
| シマノ | 50,600 | 17,260.00 | 873,356,000 |
| タカタ | 22,700 | 465.00 | 10,555,500 |
| テイ・エス テック | 29,100 | 2,753.00 | 80,112,300 |
| ジャムコ | 7,400 | 2,457.00 | 18,181,800 |
| 小野建 | 10,800 | 1,378.00 | 14,882,400 |
| はるやまホールディングス | 5,700 | 917.00 | 5,226,900 |
| ノジマ | 14,400 | 1,244.00 | 17,913,600 |
| 佐島電機 | 9,800 | 740.00 | 7,252,000 |
| カップ・クリエイト | 17,500 | 1,321.00 | 23,117,500 |
| エコトレーディング | 3,200 | 702.00 | 2,246,400 |
| 伯東 | 8,400 | 1,022.00 | 8,584,800 |
| コンドーテック | 9,900 | 861.00 | 8,523,900 |
| 中山福 | 7,500 | 820.00 | 6,150,000 |
| ライトオン | 9,300 | 979.00 | 9,104,700 |

| | | | |
|----------------|---------|-----------|-------------|
| ナガイレーベン | 17,900 | 2,526.00 | 45,215,400 |
| ジーンズメイト | 4,600 | 253.00 | 1,163,800 |
| 三菱食品 | 13,600 | 3,335.00 | 45,356,000 |
| 良品計画 | 16,400 | 20,230.00 | 331,772,000 |
| 三城ホールディングス | 15,500 | 458.00 | 7,099,000 |
| 松田産業 | 9,000 | 1,524.00 | 13,716,000 |
| 第一興商 | 20,100 | 4,400.00 | 88,440,000 |
| メディバルホールディングス | 123,900 | 1,880.00 | 232,932,000 |
| アドヴァン | 12,600 | 1,082.00 | 13,633,200 |
| S P K | 2,800 | 2,436.00 | 6,820,800 |
| 萩原電気 | 4,200 | 2,114.00 | 8,878,800 |
| アルビス | 3,300 | 3,160.00 | 10,428,000 |
| アズワン | 9,700 | 4,990.00 | 48,403,000 |
| スズデン | 4,400 | 1,052.00 | 4,628,800 |
| 尾家産業 | 4,400 | 1,120.00 | 4,928,000 |
| シモジマ | 7,700 | 1,160.00 | 8,932,000 |
| ドウシシャ | 14,600 | 2,063.00 | 30,119,800 |
| 小津産業 | 2,800 | 2,168.00 | 6,070,400 |
| コナカ | 15,700 | 582.00 | 9,137,400 |
| 高速 | 7,500 | 1,080.00 | 8,100,000 |
| ハウス オブ ローゼ | 1,700 | 1,552.00 | 2,638,400 |
| G - 7ホールディングス | 3,700 | 2,063.00 | 7,633,100 |
| たけびし | 4,300 | 1,333.00 | 5,731,900 |
| イオン北海道 | 12,400 | 607.00 | 7,526,800 |
| コジマ | 18,400 | 271.00 | 4,986,400 |
| ヒマラヤ | 3,900 | 855.00 | 3,334,500 |
| コーナン商事 | 17,600 | 2,115.00 | 37,224,000 |
| 黒田電気 | 16,900 | 2,257.00 | 38,143,300 |
| ネットワークシステムズ | 53,500 | 881.00 | 47,133,500 |
| エコス | 4,800 | 1,211.00 | 5,812,800 |
| ワタミ | 14,700 | 1,126.00 | 16,552,200 |
| マルシェ | 3,100 | 827.00 | 2,563,700 |
| リックス | 2,900 | 1,625.00 | 4,712,500 |
| システムソフト | 22,800 | 150.00 | 3,420,000 |
| ドンキホーテホールディングス | 80,100 | 3,805.00 | 304,780,500 |
| 丸文 | 11,000 | 681.00 | 7,491,000 |
| 西松屋チェーン | 21,700 | 1,317.00 | 28,578,900 |
| ゼンショーホールディングス | 64,200 | 1,934.00 | 124,162,800 |
| ハビネット | 10,400 | 1,284.00 | 13,353,600 |
| 幸楽苑ホールディングス | 8,000 | 1,620.00 | 12,960,000 |
| ハークスレイ | 3,000 | 1,095.00 | 3,285,000 |
| 橋本総業ホールディングス | 2,600 | 1,504.00 | 3,910,400 |
| 日本ライフライン | 10,600 | 1,860.00 | 19,716,000 |
| サイゼリヤ | 20,400 | 2,576.00 | 52,550,400 |
| エクセル | 5,300 | 1,483.00 | 7,859,900 |
| V Tホールディングス | 42,000 | 547.00 | 22,974,000 |
| マルカキカイ | 4,000 | 1,850.00 | 7,400,000 |
| アルゴグラフィックス | 5,700 | 2,443.00 | 13,925,100 |
| 魚力 | 3,900 | 1,296.00 | 5,054,400 |
| I D O M | 33,400 | 731.00 | 24,415,400 |

| | | | |
|---------------------|---------|-----------|---------------|
| 日本エム・ディ・エム | 9,400 | 812.00 | 7,632,800 |
| ポプラ | 3,500 | 516.00 | 1,806,000 |
| フジ・コーポレーション | 1,900 | 1,972.00 | 3,746,800 |
| ユナイテッドアローズ | 16,500 | 3,370.00 | 55,605,000 |
| 進和 | 7,300 | 1,763.00 | 12,869,900 |
| エスケイジャパン | 2,700 | 305.00 | 823,500 |
| ダイترون | 5,700 | 1,035.00 | 5,899,500 |
| ハイデイ日高 | 11,300 | 2,689.00 | 30,385,700 |
| シークス | 8,800 | 4,045.00 | 35,596,000 |
| 京都きもの友禅 | 8,100 | 978.00 | 7,921,800 |
| コロワイド | 41,100 | 1,901.00 | 78,131,100 |
| ピーシーデポコーポレーション | 16,500 | 620.00 | 10,230,000 |
| 田中商事 | 3,900 | 695.00 | 2,710,500 |
| オーハシテクニカ | 7,000 | 1,406.00 | 9,842,000 |
| 壱番屋 | 8,700 | 3,750.00 | 32,625,000 |
| 白銅 | 3,100 | 1,667.00 | 5,167,700 |
| トップカルチャー | 5,000 | 479.00 | 2,395,000 |
| P L A N T | 2,800 | 1,192.00 | 3,337,600 |
| スギホールディングス | 27,100 | 5,150.00 | 139,565,000 |
| 島津製作所 | 161,500 | 1,900.00 | 306,850,000 |
| J M S | 23,000 | 322.00 | 7,406,000 |
| クボテック | 2,800 | 568.00 | 1,590,400 |
| 長野計器 | 8,500 | 688.00 | 5,848,000 |
| ブイ・テクノロジー | 2,500 | 18,510.00 | 46,275,000 |
| スター精密 | 22,000 | 1,681.00 | 36,982,000 |
| 東京計器 | 43,000 | 247.00 | 10,621,000 |
| 愛知時計電機 | 1,700 | 3,760.00 | 6,392,000 |
| オーバル | 12,500 | 295.00 | 3,687,500 |
| 東京精密 | 24,200 | 3,755.00 | 90,871,000 |
| マニー | 16,700 | 2,695.00 | 45,006,500 |
| ニコン | 218,700 | 1,804.00 | 394,534,800 |
| トプコン | 63,200 | 1,912.00 | 120,838,400 |
| オリンパス | 200,300 | 3,885.00 | 778,165,500 |
| 理研計器 | 11,000 | 1,646.00 | 18,106,000 |
| S C R E E Nホールディングス | 25,700 | 7,050.00 | 181,185,000 |
| キヤノン電子 | 11,400 | 1,738.00 | 19,813,200 |
| タムロン | 11,100 | 2,026.00 | 22,488,600 |
| H O Y A | 258,200 | 4,879.00 | 1,259,757,800 |
| ノーリツ鋼機 | 12,300 | 1,020.00 | 12,546,000 |
| エー・アンド・デイ | 11,600 | 476.00 | 5,521,600 |
| キヤノン | 675,700 | 3,252.00 | 2,197,376,400 |
| リコー | 377,300 | 958.00 | 361,453,400 |
| シチズン時計 | 137,200 | 703.00 | 96,451,600 |
| リズム時計工業 | 51,000 | 181.00 | 9,231,000 |
| 大研医器 | 10,800 | 796.00 | 8,596,800 |
| メニコン | 8,600 | 3,280.00 | 28,208,000 |
| スノーピーク | 1,600 | 2,867.00 | 4,587,200 |
| パラマウントベッドホールディングス | 12,000 | 4,420.00 | 53,040,000 |
| トランザクション | 2,800 | 1,952.00 | 5,465,600 |
| S H O B I | 5,000 | 415.00 | 2,075,000 |

| | | | |
|----------------------|---------|----------|-------------|
| ニホンフラッシュ | 5,300 | 1,253.00 | 6,640,900 |
| 前田工織 | 12,600 | 1,296.00 | 16,329,600 |
| 永大産業 | 16,000 | 505.00 | 8,080,000 |
| アートネイチャー | 13,400 | 749.00 | 10,036,600 |
| ダンロップスポーツ | 8,000 | 1,025.00 | 8,200,000 |
| バンダイナムコホールディングス | 138,400 | 3,015.00 | 417,276,000 |
| アイフィスジャパン | 2,400 | 416.00 | 998,400 |
| 共立印刷 | 21,600 | 327.00 | 7,063,200 |
| S H O E I | 5,700 | 2,692.00 | 15,344,400 |
| フランスベッドホールディングス | 15,800 | 916.00 | 14,472,800 |
| マーベラス | 20,900 | 910.00 | 19,019,000 |
| パイロットコーポレーション | 21,900 | 4,390.00 | 96,141,000 |
| 萩原工業 | 3,500 | 2,559.00 | 8,956,500 |
| エイベックス・グループ・ホールディングス | 22,800 | 1,688.00 | 38,486,400 |
| トッパン・フォームズ | 22,400 | 1,078.00 | 24,147,200 |
| フジシールインターナショナル | 28,200 | 2,339.00 | 65,959,800 |
| タカラトミー | 48,900 | 1,185.00 | 57,946,500 |
| 廣済堂 | 12,700 | 418.00 | 5,308,600 |
| アーク | 53,500 | 112.00 | 5,992,000 |
| レック | 4,100 | 4,965.00 | 20,356,500 |
| タカノ | 5,700 | 908.00 | 5,175,600 |
| プロネクサス | 11,800 | 1,261.00 | 14,879,800 |
| ホクシン | 9,700 | 218.00 | 2,114,600 |
| ウッドワン | 22,000 | 283.00 | 6,226,000 |
| 大建工業 | 8,900 | 2,102.00 | 18,707,800 |
| きもと | 23,400 | 231.00 | 5,405,400 |
| 凸版印刷 | 354,000 | 1,093.00 | 386,922,000 |
| 大日本印刷 | 362,000 | 1,146.00 | 414,852,000 |
| 図書印刷 | 17,000 | 462.00 | 7,854,000 |
| 共同印刷 | 39,000 | 401.00 | 15,639,000 |
| 日本写真印刷 | 21,100 | 3,045.00 | 64,249,500 |
| 光村印刷 | 3,000 | 265.00 | 795,000 |
| 藤森工業 | 9,800 | 2,915.00 | 28,567,000 |
| ヴィア・ホールディングス | 9,400 | 1,097.00 | 10,311,800 |
| 宝印刷 | 6,200 | 1,494.00 | 9,262,800 |
| 前澤化成工業 | 8,700 | 1,160.00 | 10,092,000 |
| アシックス | 124,700 | 2,053.00 | 256,009,100 |
| ツツミ | 4,700 | 1,922.00 | 9,033,400 |
| J S P | 6,100 | 2,507.00 | 15,292,700 |
| ニチハ | 17,500 | 3,035.00 | 53,112,500 |
| エフピコ | 11,700 | 5,140.00 | 60,138,000 |
| 小松ウオール工業 | 4,300 | 1,941.00 | 8,346,300 |
| ヤマハ | 84,600 | 2,939.00 | 248,639,400 |
| 河合楽器製作所 | 5,000 | 2,117.00 | 10,585,000 |
| クリナップ | 14,800 | 822.00 | 12,165,600 |
| ピジョン | 75,900 | 3,055.00 | 231,874,500 |
| 天馬 | 8,700 | 1,997.00 | 17,373,900 |
| 兼松サステック | 14,000 | 205.00 | 2,870,000 |
| キングジム | 10,600 | 843.00 | 8,935,800 |

| | | | |
|----------------------|-----------|-----------|---------------|
| リンテック | 29,800 | 2,497.00 | 74,410,600 |
| T A S A K I | 2,700 | 1,536.00 | 4,147,200 |
| 信越ポリマー | 25,800 | 831.00 | 21,439,800 |
| 東リ | 31,500 | 395.00 | 12,442,500 |
| イトーキ | 26,500 | 712.00 | 18,868,000 |
| 任天堂 | 77,300 | 23,230.00 | 1,795,679,000 |
| 三菱鉛筆 | 10,300 | 5,890.00 | 60,667,000 |
| 松風 | 6,600 | 1,342.00 | 8,857,200 |
| タカラスタンダード | 25,900 | 1,782.00 | 46,153,800 |
| コクヨ | 65,200 | 1,336.00 | 87,107,200 |
| ナカバヤシ | 23,000 | 268.00 | 6,164,000 |
| ニフコ | 23,000 | 5,550.00 | 127,650,000 |
| 立川ブラインド工業 | 5,500 | 917.00 | 5,043,500 |
| グロープライド | 6,200 | 1,809.00 | 11,215,800 |
| 岡村製作所 | 43,900 | 1,017.00 | 44,646,300 |
| 日本バルカー工業 | 10,100 | 1,828.00 | 18,462,800 |
| M U T O Hホールディングス | 16,000 | 257.00 | 4,112,000 |
| 伊藤忠商事 | 907,300 | 1,583.50 | 1,436,709,550 |
| 丸紅 | 1,219,100 | 695.40 | 847,762,140 |
| スクロール | 18,800 | 345.00 | 6,486,000 |
| 高島 | 21,000 | 199.00 | 4,179,000 |
| ヨンドシーホールディングス | 9,400 | 2,453.00 | 23,058,200 |
| 三陽商会 | 69,000 | 168.00 | 11,592,000 |
| 長瀬産業 | 74,200 | 1,583.00 | 117,458,600 |
| ナイガイ | 49,000 | 63.00 | 3,087,000 |
| 蝶理 | 7,900 | 1,961.00 | 15,491,900 |
| 豊田通商 | 137,900 | 3,245.00 | 447,485,500 |
| オンワードホールディングス | 85,000 | 832.00 | 70,720,000 |
| 三共生興 | 18,800 | 414.00 | 7,783,200 |
| 兼松 | 263,000 | 191.00 | 50,233,000 |
| 美津濃 | 68,000 | 590.00 | 40,120,000 |
| ツカモトコーポレーション | 23,000 | 126.00 | 2,898,000 |
| ユニー・ファミリーマートホールディングス | 54,300 | 7,140.00 | 387,702,000 |
| ルック | 24,000 | 176.00 | 4,224,000 |
| 三井物産 | 1,120,100 | 1,654.00 | 1,852,645,400 |
| 日本紙パルプ商事 | 65,000 | 363.00 | 23,595,000 |
| 東京エレクトロン | 83,700 | 11,290.00 | 944,973,000 |
| 日立ハイテクノロジーズ | 43,000 | 4,865.00 | 209,195,000 |
| カメイ | 16,100 | 1,256.00 | 20,221,600 |
| 東都水産 | 2,000 | 1,918.00 | 3,836,000 |
| O U Gホールディングス | 20,000 | 259.00 | 5,180,000 |
| スターゼン | 5,200 | 4,760.00 | 24,752,000 |
| セイコーホールディングス | 89,000 | 403.00 | 35,867,000 |
| 山善 | 47,500 | 964.00 | 45,790,000 |
| 椿本興業 | 14,000 | 380.00 | 5,320,000 |
| 住友商事 | 779,800 | 1,444.00 | 1,126,031,200 |
| 日本ユニシス | 34,200 | 1,509.00 | 51,607,800 |
| 内田洋行 | 6,100 | 2,556.00 | 15,591,600 |
| 三菱商事 | 929,600 | 2,541.00 | 2,362,113,600 |

| | | | |
|-------------------|---------|----------|-------------|
| 第一実業 | 28,000 | 723.00 | 20,244,000 |
| キヤノンマーケティングジャパン | 35,300 | 2,226.00 | 78,577,800 |
| 西華産業 | 39,000 | 371.00 | 14,469,000 |
| 佐藤商事 | 11,100 | 864.00 | 9,590,400 |
| 菱洋エレクトロ | 11,800 | 1,480.00 | 17,464,000 |
| 東京産業 | 12,500 | 460.00 | 5,750,000 |
| ユアサ商事 | 11,700 | 3,015.00 | 35,275,500 |
| 神鋼商事 | 3,100 | 2,443.00 | 7,573,300 |
| 小林産業 | 9,400 | 269.00 | 2,528,600 |
| 阪和興業 | 124,000 | 764.00 | 94,736,000 |
| カナデン | 11,900 | 1,012.00 | 12,042,800 |
| 菱電商事 | 20,000 | 723.00 | 14,460,000 |
| ニプロ | 86,800 | 1,235.00 | 107,198,000 |
| フルサト工業 | 6,800 | 1,685.00 | 11,458,000 |
| 岩谷産業 | 137,000 | 638.00 | 87,406,000 |
| すてきナイスグループ | 53,000 | 150.00 | 7,950,000 |
| 昭光通商 | 46,000 | 102.00 | 4,692,000 |
| ニチモウ | 18,000 | 175.00 | 3,150,000 |
| 極東貿易 | 19,000 | 240.00 | 4,560,000 |
| イワキ | 19,000 | 301.00 | 5,719,000 |
| 兼松エレクトロニクス | 7,800 | 2,581.00 | 20,131,800 |
| 三愛石油 | 33,200 | 850.00 | 28,220,000 |
| 稲畑産業 | 29,600 | 1,310.00 | 38,776,000 |
| G S Iクレオス | 31,000 | 139.00 | 4,309,000 |
| 明和産業 | 11,600 | 385.00 | 4,466,000 |
| キムラタン | 566,000 | 7.00 | 3,962,000 |
| ゴールドウイン | 5,600 | 5,590.00 | 31,304,000 |
| ユニ・チャーム | 266,200 | 2,582.50 | 687,461,500 |
| デサント | 30,000 | 1,189.00 | 35,670,000 |
| キング | 6,600 | 407.00 | 2,686,200 |
| ワキタ | 26,300 | 1,032.00 | 27,141,600 |
| ヤマトインターナショナル | 8,300 | 408.00 | 3,386,400 |
| 東邦ホールディングス | 39,600 | 2,453.00 | 97,138,800 |
| サンゲツ | 42,400 | 1,901.00 | 80,602,400 |
| ミツウロコグループホールディングス | 20,000 | 717.00 | 14,340,000 |
| シナネンホールディングス | 5,300 | 2,243.00 | 11,887,900 |
| 伊藤忠エネクス | 27,300 | 914.00 | 24,952,200 |
| サンリオ | 38,200 | 2,260.00 | 86,332,000 |
| サンワテクノス | 7,300 | 990.00 | 7,227,000 |
| リョーサン | 18,400 | 3,500.00 | 64,400,000 |
| 新光商事 | 13,500 | 1,263.00 | 17,050,500 |
| トーヨー | 5,700 | 2,478.00 | 14,124,600 |
| 三信電気 | 13,700 | 1,279.00 | 17,522,300 |
| 東陽テクニカ | 16,400 | 988.00 | 16,203,200 |
| モスフードサービス | 16,200 | 3,315.00 | 53,703,000 |
| 加賀電子 | 11,200 | 1,982.00 | 22,198,400 |
| 三益半導体工業 | 9,700 | 1,748.00 | 16,955,600 |
| ソーダニッカ | 13,100 | 509.00 | 6,667,900 |
| 立花エレテック | 8,400 | 1,289.00 | 10,827,600 |
| 木曽路 | 15,200 | 2,355.00 | 35,796,000 |

| | | | |
|-------------------|-----------|-----------|---------------|
| サトレストランシステムズ | 14,800 | 849.00 | 12,565,200 |
| 千趣会 | 22,300 | 754.00 | 16,814,200 |
| タカキュー | 10,700 | 212.00 | 2,268,400 |
| ケーヨー | 21,000 | 574.00 | 12,054,000 |
| 上新電機 | 29,000 | 1,085.00 | 31,465,000 |
| 日本瓦斯 | 22,700 | 3,340.00 | 75,818,000 |
| ベスト電器 | 40,300 | 141.00 | 5,682,300 |
| ロイヤルホールディングス | 20,500 | 1,904.00 | 39,032,000 |
| 東天紅 | 10,000 | 164.00 | 1,640,000 |
| いなげや | 13,800 | 1,533.00 | 21,155,400 |
| 島忠 | 32,000 | 2,733.00 | 87,456,000 |
| チヨダ | 14,600 | 2,675.00 | 39,055,000 |
| ライフコーポレーション | 9,400 | 3,280.00 | 30,832,000 |
| リンガーハット | 13,100 | 2,330.00 | 30,523,000 |
| さが美 | 11,000 | 124.00 | 1,364,000 |
| MR MAX | 15,600 | 391.00 | 6,099,600 |
| テンアライド | 12,500 | 390.00 | 4,875,000 |
| AOKIホールディングス | 24,700 | 1,360.00 | 33,592,000 |
| オークワ | 18,000 | 1,144.00 | 20,592,000 |
| コメリ | 19,100 | 2,596.00 | 49,583,600 |
| 青山商事 | 25,900 | 3,870.00 | 100,233,000 |
| しまむら | 14,400 | 14,300.00 | 205,920,000 |
| はせがわ | 4,800 | 443.00 | 2,126,400 |
| 高島屋 | 208,000 | 951.00 | 197,808,000 |
| 松屋 | 27,000 | 981.00 | 26,487,000 |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 63,400 | 1,821.00 | 115,451,400 |
| 近鉄百貨店 | 47,000 | 356.00 | 16,732,000 |
| 丸栄 | 26,000 | 87.00 | 2,262,000 |
| パルコ | 11,800 | 1,104.00 | 13,027,200 |
| 丸井グループ | 130,300 | 1,523.00 | 198,446,900 |
| クレディセゾン | 93,900 | 2,043.00 | 191,837,700 |
| アクシアル リテイリング | 9,600 | 4,450.00 | 42,720,000 |
| 井筒屋 | 7,000 | 387.00 | 2,709,000 |
| イオン | 509,600 | 1,624.50 | 827,845,200 |
| イズミ | 24,600 | 4,720.00 | 116,112,000 |
| 東武ストア | 1,500 | 2,899.00 | 4,348,500 |
| フォーバル | 5,500 | 711.00 | 3,910,500 |
| 平和堂 | 25,100 | 2,586.00 | 64,908,600 |
| フジ | 13,800 | 2,328.00 | 32,126,400 |
| ヤオコー | 14,000 | 4,420.00 | 61,880,000 |
| ゼビオホールディングス | 16,800 | 1,689.00 | 28,375,200 |
| ケーズホールディングス | 57,100 | 2,034.00 | 116,141,400 |
| PALTAC | 19,800 | 3,035.00 | 60,093,000 |
| 三谷産業 | 13,300 | 375.00 | 4,987,500 |
| Olympicグループ | 7,400 | 614.00 | 4,543,600 |
| 日産東京販売ホールディングス | 18,300 | 328.00 | 6,002,400 |
| 新生銀行 | 1,179,000 | 201.00 | 236,979,000 |
| あおぞら銀行 | 784,000 | 406.00 | 318,304,000 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 9,387,800 | 751.20 | 7,052,115,360 |
| りそなホールディングス | 1,449,400 | 593.20 | 859,784,080 |

| | | | |
|-------------------|---------|----------|---------------|
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 258,600 | 4,052.00 | 1,047,847,200 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 992,000 | 4,479.00 | 4,443,168,000 |
| 第四銀行 | 152,000 | 513.00 | 77,976,000 |
| 北越銀行 | 13,400 | 2,695.00 | 36,113,000 |
| 千葉銀行 | 478,000 | 777.00 | 371,406,000 |
| 群馬銀行 | 275,200 | 646.00 | 177,779,200 |
| 武蔵野銀行 | 19,700 | 3,420.00 | 67,374,000 |
| 千葉興業銀行 | 34,100 | 598.00 | 20,391,800 |
| 筑波銀行 | 51,600 | 348.00 | 17,956,800 |
| 七十七銀行 | 194,000 | 531.00 | 103,014,000 |
| 青森銀行 | 96,000 | 385.00 | 36,960,000 |
| 秋田銀行 | 81,000 | 364.00 | 29,484,000 |
| 山形銀行 | 70,000 | 494.00 | 34,580,000 |
| 岩手銀行 | 8,100 | 4,585.00 | 37,138,500 |
| 東邦銀行 | 111,000 | 438.00 | 48,618,000 |
| 東北銀行 | 65,000 | 156.00 | 10,140,000 |
| みちのく銀行 | 63,000 | 190.00 | 11,970,000 |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 503,000 | 501.00 | 252,003,000 |
| 静岡銀行 | 337,000 | 964.00 | 324,868,000 |
| 十六銀行 | 166,000 | 393.00 | 65,238,000 |
| スルガ銀行 | 126,700 | 2,664.00 | 337,528,800 |
| 八十二銀行 | 238,900 | 689.00 | 164,602,100 |
| 山梨中央銀行 | 77,000 | 532.00 | 40,964,000 |
| 大垣共立銀行 | 165,000 | 452.00 | 74,580,000 |
| 福井銀行 | 106,000 | 287.00 | 30,422,000 |
| 北國銀行 | 131,000 | 455.00 | 59,605,000 |
| 清水銀行 | 4,200 | 3,625.00 | 15,225,000 |
| 富山銀行 | 2,400 | 4,210.00 | 10,104,000 |
| 滋賀銀行 | 116,000 | 641.00 | 74,356,000 |
| 南都銀行 | 12,000 | 4,665.00 | 55,980,000 |
| 百五銀行 | 111,000 | 478.00 | 53,058,000 |
| 京都銀行 | 222,000 | 930.00 | 206,460,000 |
| 紀陽銀行 | 46,500 | 1,859.00 | 86,443,500 |
| 三重銀行 | 5,600 | 2,410.00 | 13,496,000 |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 82,400 | 1,996.00 | 164,470,400 |
| 広島銀行 | 365,000 | 538.00 | 196,370,000 |
| 山陰合同銀行 | 74,400 | 994.00 | 73,953,600 |
| 中国銀行 | 87,800 | 1,748.00 | 153,474,400 |
| 鳥取銀行 | 4,000 | 1,868.00 | 7,472,000 |
| 伊予銀行 | 132,400 | 772.00 | 102,212,800 |
| 百十四銀行 | 136,000 | 394.00 | 53,584,000 |
| 四国銀行 | 96,000 | 295.00 | 28,320,000 |
| 阿波銀行 | 106,000 | 731.00 | 77,486,000 |
| 大分銀行 | 71,000 | 435.00 | 30,885,000 |
| 宮崎銀行 | 83,000 | 385.00 | 31,955,000 |
| 佐賀銀行 | 75,000 | 298.00 | 22,350,000 |
| 十八銀行 | 76,000 | 351.00 | 26,676,000 |
| 沖縄銀行 | 12,000 | 4,140.00 | 49,680,000 |
| 琉球銀行 | 25,500 | 1,543.00 | 39,346,500 |
| セブン銀行 | 464,400 | 321.00 | 149,072,400 |

| | | | | |
|----------------------|------------|----------|---------------|--|
| みずほフィナンシャルグループ | 16,819,100 | 208.50 | 3,506,782,350 | |
| 高知銀行 | 47,000 | 135.00 | 6,345,000 | |
| 山口フィナンシャルグループ | 116,000 | 1,273.00 | 147,668,000 | |
| アクリーティブ | 10,600 | 395.00 | 4,187,000 | |
| 芙蓉総合リース | 14,200 | 5,190.00 | 73,698,000 | |
| 興銀リース | 23,300 | 2,458.00 | 57,271,400 | |
| 東京センチュリー | 24,900 | 3,685.00 | 91,756,500 | |
| SBIホールディングス | 140,000 | 1,555.00 | 217,700,000 | |
| 日本証券金融 | 54,300 | 612.00 | 33,231,600 | |
| アイフル | 207,700 | 329.00 | 68,333,300 | |
| 日本アジア投資 | 12,200 | 451.00 | 5,502,200 | |
| ポケットカード | 9,400 | 601.00 | 5,649,400 | |
| 長野銀行 | 4,100 | 2,020.00 | 8,282,000 | |
| 名古屋銀行 | 10,400 | 4,215.00 | 43,836,000 | |
| 北洋銀行 | 202,000 | 467.00 | 94,334,000 | |
| 愛知銀行 | 4,200 | 6,760.00 | 28,392,000 | |
| 第三銀行 | 7,100 | 1,730.00 | 12,283,000 | |
| 中京銀行 | 5,100 | 2,293.00 | 11,694,300 | |
| 大光銀行 | 44,000 | 249.00 | 10,956,000 | |
| 愛媛銀行 | 14,700 | 1,412.00 | 20,756,400 | |
| トマト銀行 | 4,900 | 1,587.00 | 7,776,300 | |
| みなと銀行 | 11,200 | 2,111.00 | 23,643,200 | |
| 京葉銀行 | 101,000 | 527.00 | 53,227,000 | |
| 関西アーバン銀行 | 17,300 | 1,487.00 | 25,725,100 | |
| 栃木銀行 | 68,300 | 595.00 | 40,638,500 | |
| 北日本銀行 | 3,900 | 3,145.00 | 12,265,500 | |
| 東和銀行 | 233,000 | 119.00 | 27,727,000 | |
| 福島銀行 | 136,000 | 97.00 | 13,192,000 | |
| 大東銀行 | 65,000 | 170.00 | 11,050,000 | |
| リコーリース | 9,700 | 3,415.00 | 33,125,500 | |
| イオンフィナンシャルサービス | 79,100 | 2,007.00 | 158,753,700 | |
| アコム | 249,000 | 470.00 | 117,030,000 | |
| ジャックス | 68,000 | 493.00 | 33,524,000 | |
| オリエントコーポレーション | 267,600 | 211.00 | 56,463,600 | |
| 日立キャピタル | 29,200 | 2,819.00 | 82,314,800 | |
| アプラスフィナンシャル | 60,100 | 118.00 | 7,091,800 | |
| オリックス | 877,300 | 1,707.50 | 1,497,989,750 | |
| 三菱UFJリース | 314,200 | 576.00 | 180,979,200 | |
| ジャフコ | 20,700 | 3,770.00 | 78,039,000 | |
| トモニホールディングス | 102,200 | 621.00 | 63,466,200 | |
| 大和証券グループ本社 | 1,159,000 | 706.50 | 818,833,500 | |
| 野村ホールディングス | 2,532,800 | 737.10 | 1,866,926,880 | |
| 岡三証券グループ | 105,000 | 735.00 | 77,175,000 | |
| 丸三証券 | 39,400 | 944.00 | 37,193,600 | |
| 東洋証券 | 44,000 | 265.00 | 11,660,000 | |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 142,000 | 617.00 | 87,614,000 | |
| 光世証券 | 30,000 | 185.00 | 5,550,000 | |
| 水戸証券 | 38,500 | 305.00 | 11,742,500 | |
| いちよし証券 | 27,700 | 878.00 | 24,320,600 | |

| | | | |
|-------------------------------|---------|-----------|---------------|
| 松井証券 | 70,600 | 942.00 | 66,505,200 |
| SOMPOホールディングス | 259,000 | 4,021.00 | 1,041,439,000 |
| だいに証券ビジネス | 6,200 | 606.00 | 3,757,200 |
| 日本取引所グループ | 385,200 | 1,629.00 | 627,490,800 |
| マネックスグループ | 132,900 | 300.00 | 39,870,000 |
| カブドットコム証券 | 92,300 | 381.00 | 35,166,300 |
| 極東証券 | 16,600 | 1,620.00 | 26,892,000 |
| 岩井コスモホールディングス | 11,700 | 1,065.00 | 12,460,500 |
| 藍澤証券 | 23,200 | 639.00 | 14,824,800 |
| フィデアホールディングス | 120,400 | 209.00 | 25,163,600 |
| 池田泉州ホールディングス | 131,400 | 514.00 | 67,539,600 |
| アニコムホールディングス | 8,400 | 2,351.00 | 19,748,400 |
| MS&ADインシュアランスグループ ホールディングス | 370,200 | 3,773.00 | 1,396,764,600 |
| ソニーフィナンシャルホールディング ス | 118,700 | 1,944.00 | 230,752,800 |
| マネーパートナーズグループ | 15,900 | 522.00 | 8,299,800 |
| 小林洋行 | 4,300 | 289.00 | 1,242,700 |
| 第一生命ホールディングス | 747,100 | 2,092.00 | 1,562,933,200 |
| 東京海上ホールディングス | 501,900 | 4,705.00 | 2,361,439,500 |
| イー・ギャランティ | 3,700 | 2,795.00 | 10,341,500 |
| アサックス | 2,300 | 1,610.00 | 3,703,000 |
| NECキャピタルソリューション | 5,000 | 1,734.00 | 8,670,000 |
| T&Dホールディングス | 451,500 | 1,702.50 | 768,678,750 |
| アドバンスクリエイト | 3,000 | 2,001.00 | 6,003,000 |
| 三井不動産 | 657,000 | 2,595.00 | 1,704,915,000 |
| 三菱地所 | 921,000 | 2,194.50 | 2,021,134,500 |
| 平和不動産 | 23,400 | 1,542.00 | 36,082,800 |
| 東京建物 | 143,700 | 1,534.00 | 220,435,800 |
| ダイビル | 31,900 | 1,059.00 | 33,782,100 |
| 京阪神ビルディング | 20,600 | 610.00 | 12,566,000 |
| 住友不動産 | 297,000 | 3,034.00 | 901,098,000 |
| 太平洋興発 | 53,000 | 105.00 | 5,565,000 |
| 大京 | 230,000 | 224.00 | 51,520,000 |
| テーオーシー | 48,100 | 911.00 | 43,819,100 |
| 東京楽天地 | 21,000 | 516.00 | 10,836,000 |
| レオパレス21 | 156,300 | 641.00 | 100,188,300 |
| スターツコーポレーション | 12,600 | 1,939.00 | 24,431,400 |
| フジ住宅 | 15,800 | 738.00 | 11,660,400 |
| 空港施設 | 15,100 | 584.00 | 8,818,400 |
| 明和地所 | 7,000 | 724.00 | 5,068,000 |
| 住友不動産販売 | 11,100 | 2,538.00 | 28,171,800 |
| ゴールドクレスト | 11,200 | 2,026.00 | 22,691,200 |
| リログループ | 4,900 | 16,620.00 | 81,438,000 |
| 日本エスリード | 4,900 | 1,388.00 | 6,801,200 |
| 日神不動産 | 14,700 | 532.00 | 7,820,400 |
| 日本エスコン | 16,700 | 375.00 | 6,262,500 |
| タカラレーベン | 54,100 | 564.00 | 30,512,400 |
| サンヨーハウジング名古屋 | 6,400 | 1,003.00 | 6,419,200 |
| イオンモール | 79,700 | 1,632.00 | 130,070,400 |

| | | | |
|----------------|-----------|-----------|---------------|
| ファースト住建 | 4,700 | 1,387.00 | 6,518,900 |
| ランド | 64,400 | 17.00 | 1,094,800 |
| 東祥 | 2,800 | 4,960.00 | 13,888,000 |
| トーセイ | 17,000 | 746.00 | 12,682,000 |
| 穴吹興産 | 1,400 | 2,632.00 | 3,684,800 |
| エヌ・ティ・ティ都市開発 | 76,900 | 1,018.00 | 78,284,200 |
| サンフロンティア不動産 | 13,300 | 1,006.00 | 13,379,800 |
| エフ・ジェー・ネクスト | 10,900 | 768.00 | 8,371,200 |
| ランドビジネス | 8,000 | 285.00 | 2,280,000 |
| グランディハウス | 11,100 | 414.00 | 4,595,400 |
| 東武鉄道 | 670,000 | 562.00 | 376,540,000 |
| 相鉄ホールディングス | 201,000 | 562.00 | 112,962,000 |
| 東京急行電鉄 | 682,000 | 809.00 | 551,738,000 |
| 京浜急行電鉄 | 344,000 | 1,271.00 | 437,224,000 |
| 小田急電鉄 | 201,100 | 2,191.00 | 440,610,100 |
| 京王電鉄 | 351,000 | 872.00 | 306,072,000 |
| 京成電鉄 | 94,100 | 2,589.00 | 243,624,900 |
| 富士急行 | 34,000 | 1,041.00 | 35,394,000 |
| 新京成電鉄 | 16,000 | 410.00 | 6,560,000 |
| 東日本旅客鉄道 | 242,800 | 9,995.00 | 2,426,786,000 |
| 西日本旅客鉄道 | 120,800 | 7,159.00 | 864,807,200 |
| 東海旅客鉄道 | 104,400 | 17,995.00 | 1,878,678,000 |
| 西武ホールディングス | 173,300 | 1,821.00 | 315,579,300 |
| 鴻池運輸 | 17,700 | 1,438.00 | 25,452,600 |
| 西日本鉄道 | 151,000 | 479.00 | 72,329,000 |
| ハマキョウレックス | 8,200 | 2,018.00 | 16,547,600 |
| サカイ引越センター | 4,300 | 3,015.00 | 12,964,500 |
| 近鉄グループホールディングス | 1,263,000 | 422.00 | 532,986,000 |
| 阪急阪神ホールディングス | 158,500 | 3,725.00 | 590,412,500 |
| 南海電気鉄道 | 265,000 | 540.00 | 143,100,000 |
| 京阪ホールディングス | 281,000 | 739.00 | 207,659,000 |
| 神戸電鉄 | 31,000 | 377.00 | 11,687,000 |
| 名古屋鉄道 | 457,000 | 542.00 | 247,694,000 |
| 山陽電気鉄道 | 46,000 | 606.00 | 27,876,000 |
| トランコム | 3,600 | 5,400.00 | 19,440,000 |
| 日本通運 | 485,000 | 581.00 | 281,785,000 |
| ヤマトホールディングス | 224,400 | 2,253.50 | 505,685,400 |
| 山九 | 165,000 | 692.00 | 114,180,000 |
| 日新 | 51,000 | 332.00 | 16,932,000 |
| 丸運 | 7,100 | 252.00 | 1,789,200 |
| 丸全昭和運輸 | 42,000 | 450.00 | 18,900,000 |
| センコー | 56,400 | 729.00 | 41,115,600 |
| トナミホールディングス | 26,000 | 366.00 | 9,516,000 |
| ニッコンホールディングス | 42,500 | 2,279.00 | 96,857,500 |
| 日本石油輸送 | 1,400 | 2,452.00 | 3,432,800 |
| 福山通運 | 76,000 | 640.00 | 48,640,000 |
| セイノーホールディングス | 88,900 | 1,263.00 | 112,280,700 |
| 神奈川中央交通 | 15,000 | 715.00 | 10,725,000 |
| 日立物流 | 26,100 | 2,194.00 | 57,263,400 |
| 丸和運輸機関 | 3,200 | 2,543.00 | 8,137,600 |

| | | | |
|---------------------|-----------|-----------|---------------|
| C & F ロジホールディングス | 13,100 | 1,254.00 | 16,427,400 |
| 日本郵船 | 1,060,000 | 233.00 | 246,980,000 |
| 商船三井 | 658,000 | 343.00 | 225,694,000 |
| 川崎汽船 | 476,000 | 279.00 | 132,804,000 |
| NSユニテッド海運 | 56,000 | 213.00 | 11,928,000 |
| 明治海運 | 11,400 | 420.00 | 4,788,000 |
| 飯野海運 | 64,900 | 469.00 | 30,438,100 |
| 共栄タンカー | 11,000 | 228.00 | 2,508,000 |
| 九州旅客鉄道 | 93,500 | 3,095.00 | 289,382,500 |
| 日本航空 | 226,100 | 3,525.00 | 797,002,500 |
| ANAホールディングス | 2,330,000 | 332.60 | 774,958,000 |
| パスコ | 12,000 | 427.00 | 5,124,000 |
| 三菱倉庫 | 82,000 | 1,574.00 | 129,068,000 |
| 三井倉庫ホールディングス | 73,000 | 330.00 | 24,090,000 |
| 住友倉庫 | 91,000 | 590.00 | 53,690,000 |
| 澁澤倉庫 | 33,000 | 341.00 | 11,253,000 |
| ヤマタネ | 6,300 | 1,604.00 | 10,105,200 |
| 東陽倉庫 | 22,200 | 294.00 | 6,526,800 |
| 乾汽船 | 9,200 | 939.00 | 8,638,800 |
| 日本トランスシティ | 29,000 | 425.00 | 12,325,000 |
| ケイヒン | 23,000 | 151.00 | 3,473,000 |
| 中央倉庫 | 7,400 | 1,059.00 | 7,836,600 |
| 安田倉庫 | 9,700 | 742.00 | 7,197,400 |
| 東洋埠頭 | 37,000 | 183.00 | 6,771,000 |
| 宇徳 | 10,400 | 400.00 | 4,160,000 |
| 上組 | 150,000 | 1,068.00 | 160,200,000 |
| サンリツ | 1,700 | 516.00 | 877,200 |
| キムラユニティー | 3,300 | 1,196.00 | 3,946,800 |
| キューソー流通システム | 3,900 | 2,423.00 | 9,449,700 |
| 郵船ロジスティクス | 11,500 | 1,135.00 | 13,052,500 |
| 近鉄エクスプレス | 22,500 | 1,496.00 | 33,660,000 |
| 東海運 | 7,200 | 456.00 | 3,283,200 |
| エーアイティー | 7,700 | 1,093.00 | 8,416,100 |
| 内外トランスライン | 3,800 | 1,065.00 | 4,047,000 |
| 東京放送ホールディングス | 81,600 | 1,994.00 | 162,710,400 |
| 日本テレビホールディングス | 113,000 | 2,043.00 | 230,859,000 |
| 朝日放送 | 12,100 | 749.00 | 9,062,900 |
| テレビ朝日ホールディングス | 33,800 | 2,266.00 | 76,590,800 |
| スカパーJ S A Tホールディングス | 80,400 | 476.00 | 38,270,400 |
| テレビ東京ホールディングス | 10,100 | 2,512.00 | 25,371,200 |
| 日本BS放送 | 2,800 | 1,066.00 | 2,984,800 |
| ビジョン | 1,400 | 3,465.00 | 4,851,000 |
| U - N E X T | 3,400 | 721.00 | 2,451,400 |
| ワイヤレスゲート | 4,100 | 1,686.00 | 6,912,600 |
| コネクシオ | 10,900 | 1,443.00 | 15,728,700 |
| 日本通信 | 104,200 | 178.00 | 18,547,600 |
| クロップス | 1,400 | 611.00 | 855,400 |
| 日本電信電話 | 994,500 | 4,874.00 | 4,847,193,000 |
| K D D I | 1,225,600 | 2,947.00 | 3,611,843,200 |
| 光通信 | 14,900 | 10,440.00 | 155,556,000 |

| | | | |
|---------------|-----------|----------|---------------|
| NTTドコモ | 925,700 | 2,690.00 | 2,490,133,000 |
| エムティーアイ | 19,000 | 708.00 | 13,452,000 |
| GMOインターネット | 45,300 | 1,517.00 | 68,720,100 |
| カドカワ | 35,900 | 1,713.00 | 61,496,700 |
| 学研ホールディングス | 41,000 | 304.00 | 12,464,000 |
| ゼンリン | 16,400 | 2,178.00 | 35,719,200 |
| 昭文社 | 6,900 | 695.00 | 4,795,500 |
| インプレスホールディングス | 11,100 | 149.00 | 1,653,900 |
| 東京電力ホールディングス | 1,064,800 | 423.00 | 450,410,400 |
| 中部電力 | 413,500 | 1,500.00 | 620,250,000 |
| 関西電力 | 512,300 | 1,198.50 | 613,991,550 |
| 中国電力 | 173,400 | 1,235.00 | 214,149,000 |
| 北陸電力 | 122,800 | 1,137.00 | 139,623,600 |
| 東北電力 | 313,500 | 1,389.00 | 435,451,500 |
| 四国電力 | 113,000 | 1,073.00 | 121,249,000 |
| 九州電力 | 277,300 | 1,213.00 | 336,364,900 |
| 北海道電力 | 117,500 | 807.00 | 94,822,500 |
| 沖縄電力 | 18,500 | 2,606.00 | 48,211,000 |
| 電源開発 | 99,800 | 2,730.00 | 272,454,000 |
| エフオン | 5,300 | 976.00 | 5,172,800 |
| イーレックス | 5,300 | 3,340.00 | 17,702,000 |
| 東京瓦斯 | 1,346,000 | 498.30 | 670,711,800 |
| 大阪瓦斯 | 1,218,000 | 431.10 | 525,079,800 |
| 東邦瓦斯 | 316,000 | 816.00 | 257,856,000 |
| 北海道瓦斯 | 31,000 | 276.00 | 8,556,000 |
| 広島ガス | 26,000 | 362.00 | 9,412,000 |
| 西部瓦斯 | 142,000 | 256.00 | 36,352,000 |
| 静岡ガス | 38,600 | 722.00 | 27,869,200 |
| メタウォーター | 7,100 | 2,879.00 | 20,440,900 |
| アイネット | 7,100 | 1,226.00 | 8,704,600 |
| 松竹 | 82,000 | 1,328.00 | 108,896,000 |
| 東宝 | 81,000 | 3,180.00 | 257,580,000 |
| エイチ・アイ・エス | 21,400 | 2,855.00 | 61,097,000 |
| 東映 | 46,000 | 946.00 | 43,516,000 |
| ラックランド | 2,200 | 1,893.00 | 4,164,600 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 76,500 | 5,770.00 | 441,405,000 |
| 共立メンテナンス | 10,600 | 7,110.00 | 75,366,000 |
| イチネンホールディングス | 13,900 | 1,156.00 | 16,068,400 |
| 建設技術研究所 | 8,400 | 1,017.00 | 8,542,800 |
| スペース | 7,000 | 1,239.00 | 8,673,000 |
| アインホールディングス | 16,200 | 8,060.00 | 130,572,000 |
| 燦ホールディングス | 2,600 | 1,569.00 | 4,079,400 |
| ピー・シー・エー | 1,800 | 1,571.00 | 2,827,800 |
| スバル興業 | 10,000 | 527.00 | 5,270,000 |
| 東京テアトル | 52,000 | 167.00 | 8,684,000 |
| タナベ経営 | 2,700 | 1,302.00 | 3,515,400 |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 1,700 | 1,041.00 | 1,769,700 |
| ナガワ | 2,400 | 4,420.00 | 10,608,000 |
| よみうりランド | 26,000 | 451.00 | 11,726,000 |
| 東京都競馬 | 90,000 | 258.00 | 23,220,000 |

| | | | |
|----------------------|---------|----------|---------------|
| 常磐興産 | 5,000 | 1,601.00 | 8,005,000 |
| カナモト | 18,300 | 2,912.00 | 53,289,600 |
| 東京ドーム | 52,300 | 1,049.00 | 54,862,700 |
| D T S | 12,800 | 2,538.00 | 32,486,400 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 47,700 | 3,105.00 | 148,108,500 |
| シーイーシー | 7,400 | 1,773.00 | 13,120,200 |
| カブコン | 29,000 | 2,226.00 | 64,554,000 |
| 西尾レントオール | 10,600 | 3,255.00 | 34,503,000 |
| アイ・エス・ビー | 2,300 | 877.00 | 2,017,100 |
| アゴラ・ホスピタリティ・グループ | 72,000 | 37.00 | 2,664,000 |
| 日本空港ビルディング | 39,500 | 3,945.00 | 155,827,500 |
| トランス・コスモス | 15,200 | 2,577.00 | 39,170,400 |
| 乃村工藝社 | 28,100 | 1,899.00 | 53,361,900 |
| ジャステック | 7,900 | 1,035.00 | 8,176,500 |
| S C S K | 33,700 | 4,210.00 | 141,877,000 |
| 藤田観光 | 43,000 | 344.00 | 14,792,000 |
| K N T - C Tホールディングス | 72,000 | 149.00 | 10,728,000 |
| 日本管財 | 11,300 | 1,775.00 | 20,057,500 |
| トーカイ | 5,800 | 3,860.00 | 22,388,000 |
| 白洋舎 | 500 | 2,691.00 | 1,345,500 |
| セコム | 136,400 | 8,149.00 | 1,111,523,600 |
| 日本システムウエア | 4,100 | 1,617.00 | 6,629,700 |
| セントラル警備保障 | 5,800 | 1,923.00 | 11,153,400 |
| アイネス | 15,600 | 1,132.00 | 17,659,200 |
| 丹青社 | 22,700 | 848.00 | 19,249,600 |
| メイテック | 15,900 | 4,195.00 | 66,700,500 |
| T K C | 11,500 | 3,490.00 | 40,135,000 |
| アサツー ディ・ケイ | 21,400 | 2,923.00 | 62,552,200 |
| 富士ソフト | 18,400 | 2,769.00 | 50,949,600 |
| 応用地質 | 12,400 | 1,419.00 | 17,595,600 |
| 船井総研ホールディングス | 16,900 | 1,838.00 | 31,062,200 |
| N S D | 26,300 | 1,765.00 | 46,419,500 |
| 進学会 | 5,500 | 565.00 | 3,107,500 |
| 丸紅建材リース | 12,000 | 227.00 | 2,724,000 |
| オオバ | 9,700 | 466.00 | 4,520,200 |
| コナミホールディングス | 55,900 | 4,490.00 | 250,991,000 |
| 学究社 | 3,500 | 1,508.00 | 5,278,000 |
| ベネッセホールディングス | 43,900 | 3,160.00 | 138,724,000 |
| イオンディライト | 14,800 | 3,270.00 | 48,396,000 |
| ナック | 8,100 | 960.00 | 7,776,000 |
| 福井コンピュータホールディングス | 3,600 | 3,035.00 | 10,926,000 |
| ニチイ学館 | 22,800 | 797.00 | 18,171,600 |
| ダイセキ | 22,900 | 2,209.00 | 50,586,100 |
| ステップ | 4,500 | 1,375.00 | 6,187,500 |
| 日鉄住金物産 | 10,800 | 4,755.00 | 51,354,000 |
| 元気寿司 | 3,200 | 2,206.00 | 7,059,200 |
| トラスコ中山 | 28,300 | 2,644.00 | 74,825,200 |
| ヤマダ電機 | 414,300 | 575.00 | 238,222,500 |

| | | | |
|-----------------|-------------|-----------|-----------------|
| オートバックスセブン | 45,800 | 1,751.00 | 80,195,800 |
| モリト | 9,900 | 960.00 | 9,504,000 |
| アークランドサカモト | 21,000 | 1,330.00 | 27,930,000 |
| ニトリホールディングス | 53,500 | 12,340.00 | 660,190,000 |
| グルメ杵屋 | 9,000 | 1,019.00 | 9,171,000 |
| 愛眼 | 9,700 | 195.00 | 1,891,500 |
| ケーユーホールディングス | 6,500 | 861.00 | 5,596,500 |
| 吉野家ホールディングス | 43,100 | 1,630.00 | 70,253,000 |
| 加藤産業 | 19,400 | 2,704.00 | 52,457,600 |
| イノテック | 10,800 | 615.00 | 6,642,000 |
| イエローハット | 11,700 | 2,702.00 | 31,613,400 |
| 松屋フーズ | 6,000 | 4,165.00 | 24,990,000 |
| JBCホールディングス | 10,500 | 794.00 | 8,337,000 |
| JKホールディングス | 12,400 | 590.00 | 7,316,000 |
| サガミチェーン | 15,600 | 1,313.00 | 20,482,800 |
| 日伝 | 5,100 | 3,245.00 | 16,549,500 |
| 関西スーパーマーケット | 10,200 | 1,510.00 | 15,402,000 |
| ミロク情報サービス | 9,200 | 1,798.00 | 16,541,600 |
| 北沢産業 | 11,000 | 221.00 | 2,431,000 |
| 杉本商事 | 7,200 | 1,544.00 | 11,116,800 |
| 因幡電機産業 | 17,300 | 3,975.00 | 68,767,500 |
| 王将フードサービス | 9,100 | 4,280.00 | 38,948,000 |
| プレナス | 13,900 | 2,445.00 | 33,985,500 |
| ミニストップ | 9,100 | 2,076.00 | 18,891,600 |
| アークス | 23,200 | 2,539.00 | 58,904,800 |
| パローホールディングス | 26,700 | 2,744.00 | 73,264,800 |
| バイテックホールディングス | 5,100 | 1,268.00 | 6,466,800 |
| ミスミグループ本社 | 139,200 | 2,055.00 | 286,056,000 |
| アルテック | 11,200 | 215.00 | 2,408,000 |
| ベルク | 5,500 | 4,285.00 | 23,567,500 |
| 大 庄 | 6,700 | 1,556.00 | 10,425,200 |
| タキヒヨー | 19,000 | 474.00 | 9,006,000 |
| ファーストリテイリング | 20,700 | 35,290.00 | 730,503,000 |
| ソフトバンクグループ | 557,700 | 8,664.00 | 4,831,912,800 |
| 蔵王産業 | 2,000 | 1,494.00 | 2,988,000 |
| スズケン | 56,400 | 3,720.00 | 209,808,000 |
| サンドラッグ | 23,600 | 7,590.00 | 179,124,000 |
| サックスパー ホールディングス | 11,700 | 1,197.00 | 14,004,900 |
| ジェコス | 8,600 | 1,156.00 | 9,941,600 |
| ヤマザワ | 2,600 | 1,824.00 | 4,742,400 |
| やまや | 2,600 | 1,687.00 | 4,386,200 |
| ルネサスイーストン | 11,200 | 576.00 | 6,451,200 |
| ペルーナ | 31,000 | 847.00 | 26,257,000 |
| 合計 | 189,859,445 | | 277,454,420,930 |

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

| 銘柄 | 株式数 |
|--------|---------|
| トヨタ自動車 | 500,000 |

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成29年2月28日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 83,423,103,507円 |
| 負債総額 | 197,002,141円 |
| 純資産総額(-) | 83,226,101,366円 |
| 発行済数量 | 36,035,566,548口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 2.3096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

平成29年2月28日現在

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 285,751,486,377円 |
| 負債総額 | 145,698,012円 |
| 純資産総額(-) | 285,605,788,365円 |
| 発行済数量 | 125,683,153,541口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 2.2724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（平成29年2月28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（平成29年2月28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。

平成29年2月28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 | 38 | 1,159,521,637,173 |
| 追加型株式投資信託 | 864 | 11,794,936,154,039 |
| 単位型公社債投資信託 | 56 | 310,769,912,650 |
| 単位型株式投資信託 | 107 | 760,943,242,478 |
| 合計 | 1,065 | 14,026,170,946,340 |

3【委託会社等の経理状況】

1．委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

3．委託会社は、第31期事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

D I A Mアセットマネジメント株式会社は、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社及びみずほ信託銀行株式会社の資産運用部門と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に更改いたしました。

委託会社の財務諸表及び中間財務諸表に引き続き、みずほ投信投資顧問株式会社の第53期事業年度の財務諸表及び第54期中間会計期間の中間財務諸表並びに新光投信株式会社の第56期事業年度の財務諸表及び第57期中間会計期間の中間財務諸表を参考として添付しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

| | 第30期 (平成27年3月31日現在) | 第31期 (平成28年3月31日現在) |
|-------------|------------------------|------------------------|
| (資産の部) | | |
| 流動資産 | | |
| 現金・預金 | 12,051,921 | 12,951,736 |
| 金銭の信託 | 14,169,657 | 13,094,914 |
| 前払費用 | 57,309 | 44,951 |
| 未収委託者報酬 | 4,622,292 | 4,460,404 |
| 未収運用受託報酬 | 1,737,052 | 1,859,778 |
| 未収投資助言報酬 | 2 312,206 | 2 277,603 |
| 未収収益 | 260,845 | 205,097 |
| 繰延税金資産 | 411,797 | 341,078 |
| その他 | 46,782 | 40,689 |
| 流動資産計 | 33,669,865 | 33,276,255 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | | |
| 建物 | 1 138,967 | 1 29,219 |
| 車両運搬具 | 1 941 | 1 549 |
| 器具備品 | 1 243,908 | 1 184,683 |
| 建設仮勘定 | 49,116 | 444,155 |
| 無形固定資産 | | |
| 商標権 | 1 101 | 1 7 |
| ソフトウェア | 1 1,702,633 | 1 1,645,861 |
| ソフトウェア仮勘定 | 202,399 | 53,036 |
| 電話加入権 | 7,148 | 7,148 |
| 電信電話専用施設利用権 | 1 188 | 1 146 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | 4,343,365 | 6,497,772 |
| 関係会社株式 | 613,137 | 458,701 |
| 関係会社株式 | 2,316,596 | 3,229,196 |
| 繰延税金資産 | 582,861 | 679,092 |
| 差入保証金 | 733,907 | 2,040,945 |
| その他 | 96,862 | 89,835 |
| 固定資産計 | 6,688,771 | 8,862,580 |
| 資産合計 | 40,358,637 | 42,138,836 |

（単位：千円）

| | 第30期 （平成27年3月31日現在） | 第31期 （平成28年3月31日現在） |
|--------------|------------------------|------------------------|
| （負債の部） | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 1,605,579 | 966,681 |
| 未払金 | 2,515,377 | 2,055,332 |
| 未払償還金 | 49,873 | 49,873 |
| 未払手数料 | 1,836,651 | 1,744,274 |
| その他未払金 | 628,852 | 261,185 |
| 未払費用 | 2 2,196,267 | 2 3,076,566 |
| 未払法人税等 | 1,539,263 | 1,223,957 |
| 未払消費税等 | 671,243 | 352,820 |
| 賞与引当金 | 722,343 | 728,769 |
| その他 | 30,000 | - |
| 流動負債計 | 9,280,074 | 8,404,128 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | 868,928 | 997,396 |
| 役員退職慰労引当金 | 110,465 | 154,535 |
| 固定負債計 | 979,394 | 1,151,932 |
| 負債合計 | 10,259,468 | 9,556,060 |
| （純資産の部） | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 2,000,000 | 2,000,000 |
| 資本剰余金 | 2,428,478 | 2,428,478 |
| 資本準備金 | 2,428,478 | 2,428,478 |
| 利益剰余金 | 25,417,784 | 28,000,340 |
| 利益準備金 | 123,293 | 123,293 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | 19,480,000 | 22,030,000 |
| 研究開発積立金 | 300,000 | 300,000 |
| 運用責任準備積立金 | 200,000 | 200,000 |
| 繰越利益剰余金 | 5,314,491 | 5,347,047 |
| 株主資本計 | 29,846,262 | 32,428,818 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 252,905 | 153,956 |
| 評価・換算差額等計 | 252,905 | 153,956 |
| 純資産合計 | 30,099,168 | 32,582,775 |
| 負債・純資産合計 | 40,358,637 | 42,138,836 |

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

| | 第30期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) | | 第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) | |
|--------------|---------------------------------------|------------|---------------------------------------|------------|
| | 営業収益 | | | |
| 委託者報酬 | 28,170,831 | | 30,188,445 | |
| 運用受託報酬 | 7,064,021 | | 7,595,678 | |
| 投資助言報酬 | 1,032,659 | | 993,027 | |
| その他営業収益 | 828,240 | | 724,211 | |
| 営業収益計 | | 37,095,752 | | 39,501,363 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払手数料 | 12,416,659 | | 12,946,176 | |
| 広告宣伝費 | 527,620 | | 468,931 | |
| 公告費 | 288 | | 258 | |
| 調査費 | 6,317,052 | | 7,616,390 | |
| 調査費 | 4,129,778 | | 4,969,812 | |
| 委託調査費 | 2,187,273 | | 2,646,578 | |
| 委託計算費 | 385,121 | | 412,257 | |
| 営業雑経費 | 488,963 | | 548,183 | |
| 通信費 | 34,089 | | 34,855 | |
| 印刷費 | 414,215 | | 436,756 | |
| 協会費 | 24,177 | | 23,698 | |
| 諸会費 | 37 | | 40 | |
| 支払販売手数料 | 16,443 | | 52,833 | |
| 営業費用計 | | 20,135,705 | | 21,992,198 |
| 一般管理費 | | | | |
| 給料 | 5,260,910 | | 5,382,757 | |
| 役員報酬 | 242,666 | | 242,446 | |
| 給料・手当 | 4,378,307 | | 4,431,015 | |
| 賞与 | 639,936 | | 709,295 | |
| 交際費 | 37,625 | | 43,975 | |
| 寄付金 | 2,697 | | 2,628 | |
| 旅費交通費 | 242,164 | | 254,276 | |
| 租税公課 | 127,947 | | 180,892 | |
| 不動産賃借料 | 686,770 | | 1,128,367 | |
| 退職給付費用 | 218,863 | | 226,460 | |
| 固定資産減価償却費 | 628,056 | | 902,248 | |
| 福利厚生費 | 33,310 | | 36,173 | |
| 修繕費 | 13,807 | | 31,617 | |
| 賞与引当金繰入額 | 722,343 | | 728,769 | |
| 役員退職慰労引当金繰入額 | 50,327 | | 49,320 | |
| 役員退職慰労金 | 25,501 | | 5,250 | |
| 機器リース料 | 87 | | 140 | |
| 事務委託費 | 231,303 | | 251,913 | |
| 事務用消耗品費 | 67,208 | | 70,839 | |
| 器具備品費 | 5,869 | | 14,182 | |
| 諸経費 | 135,032 | | 214,532 | |
| 一般管理費計 | | 8,489,827 | | 9,524,346 |
| 営業利益 | | 8,470,220 | | 7,984,819 |

（単位：千円）

| | 第30期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日） | | 第31期 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日） | |
|----------------|---------------------------------------|-----------|---------------------------------------|-----------|
| | | | | |
| 営業外収益 | | | | |
| 受取配当金 | | 17,346 | | 25,274 |
| 受取利息 | | 2,404 | | 2,079 |
| 時効成立分配金・償還金 | | 974 | | - |
| 為替差益 | | 652 | | 3,996 |
| 雑収入 | | 1,822 | | 6,693 |
| 営業外収益計 | | 23,200 | | 38,044 |
| 営業外費用 | | | | |
| 金銭の信託運用損 | | 163,033 | | 305,368 |
| 時効成立後支払分配金・償還金 | | 65 | | - |
| 外国税支払損失 | | 47,515 | | - |
| 営業外費用計 | | 210,614 | | 305,368 |
| 経常利益 | | 8,282,806 | | 7,717,494 |
| 特別利益 | | | | |
| 投資有価証券売却益 | | - | | 3,377 |
| 特別利益計 | | - | | 3,377 |
| 特別損失 | | | | |
| 固定資産除却損 | 1 | 12,988 | 1 | 624 |
| 固定資産売却損 | 2 | - | 2 | 2,653 |
| ゴルフ会員権売却損 | | 1,080 | | - |
| ゴルフ会員権評価損 | | - | | 6,307 |
| 関係会社株式評価損 | | 202,477 | | - |
| 特別損失計 | | 216,547 | | 9,584 |
| 税引前当期純利益 | | 8,066,259 | | 7,711,286 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 2,969,684 | | 2,557,305 |
| 法人税等調整額 | | 29,428 | | 27,424 |
| 法人税等合計 | | 2,940,256 | | 2,584,730 |
| 当期純利益 | | 5,126,003 | | 5,126,556 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

第30期(自平成26年4月1日至平成27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 | 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 | 研究開発 積立金 | 運用責 任準備 積立金 | 繰越利益 剰余金 | | |
| 当期首残高 | 2,000,000 | 2,428,478 | 123,293 | 17,130,000 | 300,000 | 200,000 | 4,735,451 | 22,488,744 | 26,917,222 |
| 会計方針の変 更による累積 的影響額 | | | | | | | 131,037 | 131,037 | 131,037 |
| 会計方針の変更 を反映した当期 首残高 | 2,000,000 | 2,428,478 | 123,293 | 17,130,000 | 300,000 | 200,000 | 4,866,488 | 22,619,781 | 27,048,259 |
| 当期変動額 | | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | 2,328,000 | 2,328,000 | 2,328,000 |
| 別途積立金の 積立 | | | | 2,350,000 | | | 2,350,000 | - | - |
| 当期純利益 | | | | | | | 5,126,003 | 5,126,003 | 5,126,003 |
| 株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額) | | | | | | | | | |
| 当期変動額合計 | - | - | - | 2,350,000 | - | - | 448,003 | 2,798,003 | 2,798,003 |
| 当期末残高 | 2,000,000 | 2,428,478 | 123,293 | 19,480,000 | 300,000 | 200,000 | 5,314,491 | 25,417,784 | 29,846,262 |

| | 評価・換算 差額等 | 純資産 合計 |
|-----------------------------|----------------------|------------|
| | その他 有価証券 評価差額金 | |
| 当期首残高 | 243,159 | 27,160,381 |
| 会計方針の変 更による累積 的影響額 | | 131,037 |
| 会計方針の変更 を反映した当期 首残高 | 243,159 | 27,291,419 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | | 2,328,000 |
| 別途積立金の 積立 | | - |
| 当期純利益 | | 5,126,003 |
| 株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額) | 9,746 | 9,746 |
| 当期変動額合計 | 9,746 | 2,807,749 |
| 当期末残高 | 252,905 | 30,099,168 |

第31期（自平成27年4月1日至平成28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 | | | | 利益剰余金 合計 | 株主資本 合計 |
| | | 資本準備金 | 利益 準備金 | その他利益剰余金 | | | | | |
| | | | | 別途積立金 | 研究開発 積立金 | 運用責 任準備 積立金 | 繰越利益 剰余金 | | |
| 当期首残高 | 2,000,000 | 2,428,478 | 123,293 | 19,480,000 | 300,000 | 200,000 | 5,314,491 | 25,417,784 | 29,846,262 |
| 会計方針の変更による累積的影響額 | | | | | | | | | |
| 会計方針の変更を反映した当期首残高 | 2,000,000 | 2,428,478 | 123,293 | 19,480,000 | 300,000 | 200,000 | 5,314,491 | 25,417,784 | 29,846,262 |
| 当期変動額 | | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | 2,544,000 | 2,544,000 | 2,544,000 |
| 別途積立金の積立 | | | | 2,550,000 | | | 2,550,000 | - | - |
| 当期純利益 | | | | | | | 5,126,556 | 5,126,556 | 5,126,556 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | | | | | | | | | |
| 当期変動額合計 | - | - | - | 2,550,000 | - | - | 32,556 | 2,582,556 | 2,582,556 |
| 当期末残高 | 2,000,000 | 2,428,478 | 123,293 | 22,030,000 | 300,000 | 200,000 | 5,347,047 | 28,000,340 | 32,428,818 |

| | 評価・換算 差額等 | 純資産 合計 |
|---------------------|----------------------|------------|
| | その他 有価証券 評価差額金 | |
| 当期首残高 | 252,905 | 30,099,168 |
| 会計方針の変更による累積的影響額 | | |
| 会計方針の変更を反映した当期首残高 | 252,905 | 30,099,168 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | | 2,544,000 |
| 別途積立金の積立 | | - |
| 当期純利益 | | 5,126,556 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | 98,949 | 98,949 |
| 当期変動額合計 | 98,949 | 2,483,607 |
| 当期末残高 | 153,956 | 32,582,775 |

重要な会計方針

| 項目 | 第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日) |
|--------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | (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 (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 |
| 2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 | 時価法 |
| 3. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 時価法 |
| 4. 固定資産の減価償却の方法 | (1) 有形固定資産 定率法によっております。 (2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。 |
| 5. 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。 |
| 6. 引当金の計上基準 | (1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 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、将来支給見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。また、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。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。 |
| 7. 消費税等の処理方法 | 税抜方式によっております。 |

未適用の会計基準等

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

（1）概要

本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。

（2）適用予定日

平成28年4月1日以後に開始する事業年度の期首から適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

会計上の見積りの変更

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

当社は、追加情報に記載のとおり、当社、みずほ信託銀行株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社及び新光投信株式会社間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めております。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産及び無形固定資産の見積り耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。

また、本社オフィスの不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務として資産除去債務の合理的な見積りが可能となったため、見積額の変更を行っております。なお、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する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、当事業年度の負担に属する金額を費用計上する方法によっております。

これにより、従来の方と比べて、当事業年度の減価償却費が161,916千円、不動産賃借料が42,917千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ204,834千円減少しております。

追加情報

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

当社は、平成27年9月30日付で締結した当社、みずほ信託銀行株式会社（取締役社長 中野 武夫）、みずほ投信投資顧問株式会社（取締役社長 中村 英剛）及び新光投信株式会社（取締役社長 後藤 修一）間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日付で新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

1. 商号 : アセットマネジメントOne 株式会社
2. 代表者 : 西 恵正（現 D I A Mアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長）
3. 本店所在地 : 東京都千代田区丸の内1 8 2
4. 統合日 : 平成28年10月1日

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 固定資産の減価償却累計額

(千円)

| | 第30期 (平成27年3月31日現在) | 第31期 (平成28年3月31日現在) |
|-------------|------------------------|------------------------|
| 建物 | 582,075 | 767,802 |
| 車両運搬具 | 3,981 | 4,374 |
| 器具備品 | 735,461 | 562,853 |
| 商標権 | 836 | 930 |
| ソフトウェア | 2,015,473 | 2,613,791 |
| 電信電話専用施設利用権 | 1,408 | 1,451 |

2. 関係会社項目

関係会社に関する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものが含まれております。

(千円)

| | | 第30期 (平成27年3月31日現在) | 第31期 (平成28年3月31日現在) |
|------|----------|------------------------|------------------------|
| 流動資産 | 未収投資助言報酬 | 311,994 | 276,211 |
| 流動負債 | 未払費用 | 492,035 | 622,004 |

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

| | 第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日) | 第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日) |
|--------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 器具備品 | 0 | 182 |
| ソフトウェア | 12,988 | 442 |

2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

| | 第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日) | 第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日) |
|------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 器具備品 | - | 2,653 |

(株主資本等変動計算書関係)

第30期(自平成26年4月1日 至平成27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 | 24,000 | - | - | 24,000 |
| 合計 | 24,000 | - | - | 24,000 |

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 |
|----------------------|-----------|--------------------|---------------------|------------|-----------|
| 平成26年6月30日 定時株主総会 | 普通 株式 | 2,328,000 | 97,000 | 平成26年3月31日 | 平成26年7月1日 |

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

| 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 |
|----------------------|-----------|-----------|--------------------|---------------------|------------|------------|
| 平成27年6月29日 定時株主総会 | 普通 株式 | 利益剰 余金 | 2,544,000 | 106,000 | 平成27年3月31日 | 平成27年6月30日 |

第31期(自平成27年4月1日 至平成28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 | 24,000 | - | - | 24,000 |
| 合計 | 24,000 | - | - | 24,000 |

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 |
|----------------------|-----------|--------------------|---------------------|------------|------------|
| 平成27年6月29日 定時株主総会 | 普通 株式 | 2,544,000 | 106,000 | 平成27年3月31日 | 平成27年6月30日 |

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成28年6月29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 |
|----------------------|----------|-----------|----------------|---------------------|------------|------------|
| 平成28年6月29日 定時株主総会 | 普通 株式 | 利益剰 余金 | 2,544,000 | 106,000 | 平成28年3月31日 | 平成28年6月30日 |

(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

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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。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。

取引の方針については社内会議で審議のうえ個別決裁により決定し、取引の実行とその内容の確認についてはそれぞれ担当所管を分離して実行しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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、デリバティブ取引を利用して一部リスクを低減しております。

長期差入保証金の主な内容は、本社オフィス等の不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等でありませ

ず。金銭の信託に含まれるデリバティブ取引は為替予約取引、株価指数先物取引及び債券先物取引であり、金銭の信託に含まれる投資信託に係る為替及び市場価格の変動リスクを低減する目的で行っております。

(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

為替相場及び株式相場の変動によるリスクを有しておりますが、取引先は信用度の高い金融機関に限定しているため、相手方の契約不履行によるリスクはほとんどないと認識しております。

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計画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30期（平成27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 | 12,051,921 | 12,051,921 | - |
| (2) 金銭の信託 | 14,169,657 | 14,169,657 | - |
| (3) 投資有価証券 その他有価証券 | 532,891 | 532,891 | - |
| 資産計 | 26,754,470 | 26,754,470 | - |
| (1) 未払法人税等 | 1,539,263 | 1,539,263 | - |
| 負債計 | 1,539,263 | 1,539,263 | - |

第31期（平成28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 | 12,951,736 | 12,951,736 | - |
| (2) 金銭の信託 | 13,094,914 | 13,094,914 | - |
| (3) 投資有価証券 その他有価証券 | 381,005 | 381,005 | - |
| 資産計 | 26,427,656 | 26,427,656 | - |
| (1) 未払法人税等 | 1,223,957 | 1,223,957 | - |
| 負債計 | 1,223,957 | 1,223,957 | - |

（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) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払法人税等

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30期 (平成27年3月31日現在) | 第31期 (平成28年3月31日現在) |
|--------|------------------------|------------------------|
| 非上場株式 | 80,246 | 77,696 |
| 関係会社株式 | 2,316,596 | 3,229,196 |
| 差入保証金 | 733,907 | 2,040,945 |

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、「(3)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。

前事業年度において、関係会社株式について202,477千円の減損処理を行っております。

差入保証金は、本社オフィス等の不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等であり、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30期(平成27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) 預金 | 12,051,921 | - | - | - |
| 合計 | 12,051,921 | - | - | - |

第31期(平成28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) 預金 | 12,951,736 | - | - | - |
| 合計 | 12,951,736 | - | - | - |

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

(有価証券関係)

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第30期の貸借対照表計上額2,316,596千円、第31期の貸借対照表計上額3,229,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

4. その他有価証券

第30期（平成27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 | 516,710 | 146,101 | 370,608 |
| 債券 | - | - | - |
| その他（投資信託） | 16,181 | 13,000 | 3,181 |
| 小計 | 532,891 | 159,101 | 373,789 |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの | | | |
| 株式 | - | - | - |
| 債券 | - | - | - |
| その他（投資信託） | - | - | - |
| 小計 | - | - | - |
| 合計 | 532,891 | 159,101 | 373,789 |

（注）非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）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31期（平成28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 | 365,683 | 146,101 | 219,581 |
| 債券 | - | - | - |
| その他（投資信託） | 15,322 | 13,000 | 2,322 |
| 小計 | 381,005 | 159,101 | 221,903 |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの | | | |
| 株式 | - | - | - |
| 債券 | - | - | - |
| その他（投資信託） | - | - | - |
| 小計 | - | - | - |
| 合計 | 381,005 | 159,101 | 221,903 |

（注）非上場株式（貸借対照表計上額77,696千円）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。

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券
 該当事項はありません。

6. 当該事業年度中に売却したその他有価証券
 第30期(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)
 該当事項はありません。

第31期(自平成27年4月1日 至平成28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) |
|---------|-------------|-----------------|-----------------|
| その他有価証券 | 5,927 | 3,377 | - |

7. 減損処理を行った有価証券
 該当事項はありません。

(金銭の信託関係)

1. 運用目的の金銭の信託

第30期(平成27年3月31日現在)

| | 貸借対照表日における 貸借対照表計上額(千円) | 当事業年度の損益に含まれた 評価差額(千円) |
|------------|----------------------------|---------------------------|
| 運用目的の金銭の信託 | 14,169,657 | 2,544,066 |

第31期(平成28年3月31日現在)

| | 貸借対照表日における 貸借対照表計上額(千円) | 当事業年度の損益に含まれた 評価差額(千円) |
|------------|----------------------------|---------------------------|
| 運用目的の金銭の信託 | 13,094,914 | 825,986 |

2. 満期保有目的の金銭の信託
 該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託
 該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
 該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
 該当事項はありません。

(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、また、確定拠出型の制度として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30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日) | 第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日) |
|------------------|--|--|
| 退職給付債務の期首残高 | 1,079,828 | 973,035 |
| 会計方針の変更による累積的影響額 | 203,600 | - |
| 会計方針の変更を反映した期首残高 | 876,227 | 973,035 |
| 勤務費用 | 128,297 | 134,944 |
| 利息費用 | 7,798 | 8,660 |
| 数理計算上の差異の発生額 | 10,345 | 21,441 |
| 退職給付の支払額 | 49,633 | 51,531 |
| 過去勤務費用の発生額 | - | - |
| 退職給付債務の期末残高 | 973,035 | 1,086,550 |

(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30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日) | 第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日) |
|---------------------|--|--|
| 非積立型制度の退職給付債務 | 973,035 | 1,086,550 |
| 未積立退職給付債務 | 973,035 | 1,086,550 |
| 未認識数理計算上の差異 | 89,550 | 79,449 |
| 未認識過去勤務費用 | 14,556 | 9,704 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 868,928 | 997,396 |
| 退職給付引当金 | 868,928 | 997,396 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 868,928 | 997,396 |

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

| | 第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日) | 第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日) |
|-----------------|--|--|
| 勤務費用 | 128,297 | 134,944 |
| 利息費用 | 7,798 | 8,660 |
| 数理計算上の差異の費用処理額 | 33,455 | 31,542 |
| 過去勤務費用の費用処理額 | 4,852 | 4,852 |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 174,402 | 179,999 |

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項
 当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

| | 第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日) | 第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日) |
|-----|--|--|
| 割引率 | 0.89% | 0.89% |

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第30期事業年度43,461千円、第31期事業年度44,193千円であります。

(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30期 (平成27年3月31日現在) | 第31期 (平成28年3月31日現在) |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| | (千円) | (千円) |
| 繰延税金資産 | | |
| 未払事業税 | 118,238 | 79,702 |
| 未払事業所税 | 5,527 | 5,581 |
| 賞与引当金 | 239,095 | 224,898 |
| 未払法定福利費 | 30,557 | 28,395 |
| 未払確定拠出年金掛金 | 2,650 | 2,500 |
| 外国税支払損失 | 15,727 | - |
| 資産除去債務 | - | 13,244 |
| 減価償却超過額（一括償却資産） | 2,158 | 3,389 |
| 減価償却超過額 | 130,844 | 136,503 |
| 繰延資産償却超過額（税法上） | 2,710 | 1,339 |
| 退職給付引当金 | 281,232 | 305,591 |
| 役員退職慰労引当金 | 35,724 | 47,318 |
| ゴルフ会員権評価損 | 1,940 | 3,768 |
| 関係会社株式評価損 | 176,106 | 166,740 |
| その他有価証券評価差額金 | - | 1,196 |
| 繰延税金資産合計 | 1,042,515 | 1,020,171 |
| 繰延税金負債 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 47,855 | - |
| 繰延税金負債合計 | 47,855 | - |
| 差引繰延税金資産の純額 | 994,659 | 1,020,171 |

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。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月31日に公布され、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げが行われることになりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.34%から、平成28年4月1日に開始する事業年度から平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。

この変更により、当事業年度末の繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は53,300千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額は57,117千円増加し、その他有価証券評価差額金は3,816千円増加しております。

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

当社は、投資信託及び投資顧問を主とした資産運用業の単一事業であるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

（1）サービスごとの情報

| | 投資信託 （千円） | 投資顧問 （千円） | その他 （千円） | 合計 （千円） |
|------|--------------|--------------|-------------|------------|
| 営業収益 | 28,170,831 | 8,096,680 | 828,240 | 37,095,752 |

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

当社は、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

当社は、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%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

(1) サービスごとの情報

| | 投資信託 (千円) | 投資顧問 (千円) | その他 (千円) | 合計 (千円) |
|------|--------------|--------------|-------------|------------|
| 営業収益 | 30,188,445 | 8,588,706 | 724,211 | 39,501,363 |

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

当社は、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

当社は、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%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第30期(自平成26年4月1日 至平成27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 | | | | |
| その他 の関係 会社 | 第一生命 保険株式 会社 | 東京都 千代田 区 | 3,431 億円 | 生命保 険業 | (被所有) 直接50% | 兼務2名, 出向3名, 転籍2名 | 資産運用 の助言 | 資産運用の 助言の顧問 料の受入 | 862,448 | 未収投資 助言報酬 | 237,575 |

第31期（自平成27年4月1日 至平成28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 | | | | |
| その他の関係会社 | 第一生命保険株式会社 | 東京都千代田区 | 3,431億円 | 生命保険業 | (被所有)直接50% | 兼務2名, 出向3名, 転籍2名 | 資産運用の助言 | 資産運用の助言の顧問料の受入 | 795,405 | 未収投資助言報酬 | 207,235 |

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく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)子会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27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 | | | | |
| 子会社 | DIAM International Ltd | London United kingdom | 4,000千GBP | 資産の運用 | (所有)直接100% | 兼務2名 | 当社預り資産の運用 | 当社預り資産の運用の顧問料の支払 | 658,756 | 未払費用 | 235,583 |
| | DIAM U.S.A., Inc. | New York U.S.A. | 4,000千USD | 資産の運用 | (所有)直接100% | 兼務2名 | 当社預り資産の運用 | 当社預り資産の運用の顧問料の支払 | 383,980 | 未払費用 | 173,074 |
| | DIAM SINGAPORE PTE.LTD. | Central Singapore | 1,100,000千円 | 資産の運用 | (所有)直接100% | 兼務2名 | 当社預り資産の運用 | 増資の引受 | 400,000 | - | - |

第31期(自平成27年4月1日 至平成28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 | | | | |
| 子 会 社 | DIAM International Ltd | London United Kingdom | 9,000 千GBP | 資産の 運用 | (所有) 直接 100% | 兼務 2名 | 当社預 り資産 の運用 | 当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払 増資の引受 | 800,617 912,600 | 未払 費用 - | 308,974 - |
| | DIAM U.S.A., Inc. | New York U.S.A. | 4,000 千USD | 資産の 運用 | (所有) 直接 100% | 兼務 2名 | 当社預 り資産 の運用 | 当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払 | 473,948 | 未払 費用 | 157,130 |

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の顧問料は、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) 上記の取引金額及び期末残高には免税取引のため、消費税等は含まれておりません。

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27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 | | | | |
| その他の 関係会 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、預金取 引 | 投資信託の 販売代行手 数料 | 2,217,439 | 未払 手数料 | 306,365 |
| | | | | | | | | 預金の預入 (純額) | 551,351 | 現金・ 預金 | 11,276,198 |
| | | | | | | | | 受取利息 | 2,139 | 未収 収益 | 71 |
| | みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社 | 東京都 千代田 区 | 2億円 | 金融 技術 研究等 | - | 兼務 1名 | 当社預り資 産の助言 | 当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 | 407,531 | 未払 費用 | 240,725 |
| | | | | | | | | 業務委託料 の支払 | 8,540 | 未払金 | 6,501 |
| | 資産管理 サービス 信託銀行 株式会社 | 東京都 中央区 | 500 億円 | 資産管 理等 | - | - | 当社信託財 産の運用 | 信託元本の 追加 (純額) | 3,500,000 | 金銭の 信託 | 14,169,657 |
| | | | | | | | | 信託報酬の 支払 | 8,254 | | |

第31期(自平成27年4月1日 至平成28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 | | | | |
| その他の 関係会 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 | - | 兼務 1名 | 当社設定投 資信託の販 売、預金取 引 | 投資信託の 販売代行手 数料 | 3,023,040 | 未払 手数料 | 372,837 |
| | | | | | | | | 預金の預入 (純額) | 879,733 | 現金・ 預金 | 12,155,931 |
| | | | | | | | | 受取利息 | 1,787 | 未収 収益 | 123 |
| その他の 関係会 社の子 会社 | みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社 | 東京都 千代田 区 | 2億円 | 金融 技術 研究等 | - | 兼務 1名 | 当社預り資 産の助言 | 当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 | 557,013 | 未払 費用 | 292,861 |
| | 資産管理 サービス 信託銀行 株式会社 | 東京都 中央区 | 500 億円 | 資産管 理等 | - | - | 当社信託財 産の運用 | 信託元本の 払戻 (純額) | 700,000 | 金銭の 信託 | 13,094,914 |
| | | | | | | | | 信託報酬の 支払 | 8,336 | | |

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) 資産の助言の顧問料は、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3) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(注4) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注5) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

(1株当たり情報)

| | 第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日) | 第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日) |
|--------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 1株当たり純資産額 | 1,254,132円02銭 | 1,357,615円66銭 |
| 1株当たり当期純利益金額 | 213,583円46銭 | 213,606円51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30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日) | 第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日) |
|--------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 当期純利益 | 5,126,003千円 | 5,126,556千円 |
| 普通株主に帰属しない金額 | - | - |
| 普通株式に係る当期純利益 | 5,126,003千円 | 5,126,556千円 |
| 期中平均株式数 | 24,000株 | 24,000株 |

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

| | 第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在) | |
|-------------|-------------------------------|------------|
| (資産の部) | | |
| 流動資産 | | |
| 現金・預金 | | 11,605,537 |
| 金銭の信託 | | 11,792,364 |
| 前払費用 | | 122,161 |
| 未収委託者報酬 | | 4,755,701 |
| 未収運用受託報酬 | | 2,465,934 |
| 未収投資助言報酬 | | 261,221 |
| 未収収益 | | 181,959 |
| 繰延税金資産 | | 329,236 |
| その他 | | 122,804 |
| | 流動資産計 | 31,636,922 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | | |
| 建物 | 1 | 6,517 |
| 器具備品 | 1 | 152,176 |
| 建設仮勘定 | | 1,383,196 |
| 無形固定資産 | | |
| ソフトウェア | | 1,421,245 |
| ソフトウェア仮勘定 | | 184,656 |
| 電話加入権 | | 7,148 |
| 電信電話専用施設利用権 | | 124 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | | 441,519 |
| 関係会社株式 | | 3,229,196 |
| 繰延税金資産 | | 713,716 |
| 差入保証金 | | 1,808,323 |
| その他 | | 89,010 |
| | 固定資産計 | 9,436,830 |
| | 資産合計 | 41,073,753 |

(単位:千円)

| | 第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在) |
|--------------|-------------------------------|
| (負債の部) | |
| 流動負債 | |
| 預り金 | 1,080,224 |
| 未払金 | 2,651,649 |
| 未払償還金 | 49,873 |
| 未払手数料 | 1,865,871 |
| その他未払金 | 735,905 |
| 未払費用 | 2,673,720 |
| 未払法人税等 | 907,554 |
| 未払消費税等 | 69,484 |
| 賞与引当金 | 724,711 |
| 訴訟損失引当金 | 30,000 |
| その他 | 21,000 |
| 流動負債計 | 8,158,344 |
| 固定負債 | |
| 退職給付引当金 | 1,027,049 |
| 固定負債計 | 1,027,049 |
| 負債合計 | 9,185,394 |
| (純資産の部) | |
| 株主資本 | |
| 資本金 | 2,000,000 |
| 資本剰余金 | 2,428,478 |
| 資本準備金 | 2,428,478 |
| 利益剰余金 | 27,317,845 |
| 利益準備金 | 123,293 |
| その他利益剰余金 | |
| 別途積立金 | 24,580,000 |
| 研究開発積立金 | 300,000 |
| 運用責任準備積立金 | 200,000 |
| 繰越利益剰余金 | 2,114,551 |
| 株主資本計 | 31,746,323 |
| 評価・換算差額等 | |
| その他有価証券評価差額金 | 142,035 |
| 評価・換算差額等計 | 142,035 |
| 純資産合計 | 31,888,358 |
| 負債・純資産合計 | 41,073,753 |

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

| | 第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日至平成28年9月30日) | |
|-----------|---------------------------------------|------------|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 14,454,974 | |
| 運用受託報酬 | 3,732,759 | |
| 投資助言報酬 | 456,986 | |
| その他営業収益 | 323,793 | |
| | 営業収益計 | 18,968,513 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | 6,111,449 | |
| 広告宣伝費 | 108,789 | |
| 公告費 | 428 | |
| 調査費 | 3,764,163 | |
| 調査費 | 2,639,714 | |
| 委託調査費 | 1,124,449 | |
| 委託計算費 | 216,712 | |
| 営業雑経費 | 278,529 | |
| 通信費 | 17,844 | |
| 印刷費 | 212,004 | |
| 協会費 | 11,277 | |
| 諸会費 | 18 | |
| 支払販売手数料 | 37,384 | |
| | 営業費用計 | 10,480,072 |
| 一般管理費 | | |
| 給料 | 2,330,263 | |
| 役員報酬 | 124,419 | |
| 給料・手当 | 2,205,843 | |
| 交際費 | 16,973 | |
| 寄付金 | 13,268 | |
| 旅費交通費 | 100,973 | |
| 租税公課 | 148,041 | |
| 不動産賃借料 | 1,329,821 | |
| 退職給付費用 | 121,590 | |
| 固定資産減価償却費 | 1 353,322 | |
| 福利厚生費 | 11,020 | |
| 修繕費 | 10,082 | |
| 賞与引当金繰入額 | 724,711 | |
| 役員退職慰労金 | 63,072 | |
| 機器リース料 | 146 | |
| 事務委託費 | 182,857 | |
| 事務用消耗品費 | 37,442 | |
| 器具備品費 | 236,524 | |
| 諸経費 | 58,359 | |
| | 一般管理費計 | 5,738,473 |
| 営業利益 | | 2,749,968 |

(単位:千円)

| | 第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日至平成28年9月30日) | |
|--------------|---------------------------------------|-----------|
| 営業外収益 | | |
| 受取配当金 | 7,882 | |
| 受取利息 | 341 | |
| 為替差益 | 32,301 | |
| 雑収入 | 4,836 | |
| | 営業外収益計 | 45,361 |
| 営業外費用 | | |
| 金銭の信託運用損 | 59,768 | |
| | 営業外費用計 | 59,768 |
| 経常利益 | | 2,735,561 |
| 特別損失 | | |
| 固定資産除却損 | 2,820 | |
| 固定資産売却損 | 1,780 | |
| 訴訟損失引当金繰入額 | 30,000 | |
| | 特別損失計 | 34,601 |
| 税引前中間純利益 | | 2,700,960 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 856,976 |
| 法人税等調整額 | | 17,520 |
| 法人税等合計 | | 839,455 |
| 中間純利益 | | 1,861,504 |

(3) 中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30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 | 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 | 研究開発積 立金 | 運用責 任準備 積立金 | 繰越利益 剰余金 | | |
| 当期首残高 | 2,000,000 | 2,428,478 | 123,293 | 22,030,000 | 300,000 | 200,000 | 5,347,047 | 28,000,340 | 32,428,818 |
| 当中間期変動額 | | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | 2,544,000 | 2,544,000 | 2,544,000 |
| 別途積立金の 積立 | | | | 2,550,000 | | | 2,550,000 | - | - |
| 中間純利益 | | | | | | | 1,861,504 | 1,861,504 | 1,861,504 |
| 株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額) | | | | | | | | | |
| 当中間期変動額 合計 | - | - | - | 2,550,000 | - | - | 3,232,495 | 682,495 | 682,495 |
| 当中間期末残高 | 2,000,000 | 2,428,478 | 123,293 | 24,580,000 | 300,000 | 200,000 | 2,114,551 | 27,317,845 | 31,746,323 |

| | 評価・換算差額等 | 純資産 合計 |
|-----------------------------------|------------------|------------|
| | その他有価証 券評価差額金 | |
| 当期首残高 | 153,956 | 32,582,775 |
| 当中間期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | | 2,544,000 |
| 別途積立金の 積立 | | - |
| 中間純利益 | | 1,861,504 |
| 株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額) | 11,921 | 11,921 |
| 当中間期変動額 合計 | 11,921 | 694,416 |
| 当中間期末残高 | 142,035 | 31,888,358 |

重要な会計方針

| 項目 | 第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日) |
|------------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | (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 (2)その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法 |
| 2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 | 時価法 |
| 3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 時価法 |
| 4. 固定資産の減価償却の方法 | (1)有形固定資産：定率法 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 車両運搬具 … 6年 器具備品 … 3～20年 (2)無形固定資産：定額法 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。 |
| 5. 引当金の計上基準 | (1)貸倒引当金：一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (2)賞与引当金：従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。 (3)退職給付引当金：従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：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）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌会計期間から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理 (4)訴訟損失引当金：訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積り、必要と認められる額を計上しております。 |
| 6. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準 | 外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物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。 |
| 7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 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方式によっております。 |

会計方針の変更

| |
|--|
| <p>第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）</p> |
| <p>法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。</p> <p>なお、当中間会計期間において、中間財務諸表への影響額はありません。</p> |

追加情報

| |
|--|
| <p>第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）</p> |
| <p>1. 「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当中間会計期間から適用しております。</p> <p>2. 当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。</p> <p>これに伴い、当中間会計期間末日までに217,608千円を支給し、役員退職慰労引当金全額を取り崩しております。</p> |

注記事項

（中間貸借対照表関係）

| 項目 | 第32期中間会計期間末 （平成28年9月30日現在） | | |
|-------------------|-------------------------------|-----|-----------|
| 1. 有形固定資産の減価償却累計額 | 建物 | ... | 790,504千円 |
| | 器具備品 | ... | 596,199千円 |

（中間損益計算書関係）

| 項目 | 第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日 至平成28年9月30日） | | |
|------------|--|-----|-----------|
| 1. 減価償却実施額 | 有形固定資産 | ... | 57,752千円 |
| | 無形固定資産 | ... | 295,570千円 |

(中間株主資本等変動計算書関係)

第32期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

| 発行済株式の種類 | 当事業年度期首 株式数(株) | 当中間会計期間 増加株式数(株) | 当中間会計期間 減少株式数(株) | 当中間会計期間末 株式数(株) |
|----------|-------------------|---------------------|---------------------|--------------------|
| 普通株式 | 24,000 | - | - | 24,000 |
| 合計 | 24,000 | - | - | 24,000 |

2. 配当に関する事項

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 |
|----------------------|-----------|--------------------|---------------------|------------|------------|
| 平成28年6月29日 定時株主総会 | 普通株式 | 2,544,000 | 106,000 | 平成28年3月31日 | 平成28年6月30日 |

(金融商品関係)

第32期中間会計期間末(平成28年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成28年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

| | 中間貸借対照表計上額 (千円) | 時価 (千円) | 差額 (千円) |
|-----------------------|--------------------|------------|------------|
| (1) 現金・預金 | 11,605,537 | 11,605,537 | - |
| (2) 金銭の信託 | 11,792,364 | 11,792,364 | - |
| (3) 投資有価証券 その他有価証券 | 363,823 | 363,823 | - |
| 資産計 | 23,761,725 | 23,761,725 | - |
| (1) 未払法人税等 | 907,554 | 907,554 | - |
| 負債計 | 907,554 | 907,554 | - |

(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）投資有価証券

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

負 債

（1）未払法人税等

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

| 区分 | 中間貸借対照表計上額 (千円) |
|--------|--------------------|
| 非上場株式 | 77,696 |
| 関係会社株式 | 3,229,196 |
| 差入保証金 | 1,808,323 |

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、「(3)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、時価開示の対象としておりません。

差入保証金は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等であり、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ため、時価開示の対象としておりません。

(有価証券関係)

第32期中間会計期間末
(平成28年9月30日現在)

1. 満期保有目的の債券
該当事項はありません。
2. 子会社株式及び関連会社株式
関係会社株式(中間貸借対照表計上額3,229,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。
3. その他有価証券

| 区 分 | 中間貸借対照表 計上額(千円) | 取得原価 (千円) | 差額 (千円) |
|----------------------------|--------------------|--------------|------------|
| 中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの | | | |
| 株式 | 349,644 | 146,101 | 203,542 |
| 債券 | - | - | - |
| その他(投資信託) | 14,179 | 13,000 | 1,179 |
| 小計 | 363,823 | 159,101 | 204,721 |
| 中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの | | | |
| 株式 | - | - | - |
| 債券 | - | - | - |
| その他(投資信託) | - | - | - |
| 小計 | - | - | - |
| 合計 | 363,823 | 159,101 | 204,721 |

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額77,696千円)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。

(金銭の信託関係)

第32期中間会計期間末
(平成28年9月30日現在)

1. 満期保有目的の金銭の信託
該当事項はありません。
2. その他の金銭の信託(運用目的及び満期保有目的以外)
該当事項はありません。

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

第32期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

1. セグメント情報

当社は、投資信託及び投資顧問を主とした資産運用業の単一事業であるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) サービスごとの情報

| | 投資信託 (千円) | 投資顧問 (千円) | その他 (千円) | 合計 (千円) |
|------|--------------|--------------|-------------|------------|
| 営業収益 | 14,454,974 | 4,189,745 | 323,793 | 18,968,513 |

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が中間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

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が中間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

| 顧客の名称又は氏名 | 営業収益 (千円) |
|-----------|--------------|
| 第一生命グループ | 1,928,739 |

(注) 第一生命グループには、第一生命保険株式会社及び第一フロンティア生命保険株式会社が含まれております。

（1株当たり情報）

| 第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日 至平成28年9月30日） | | |
|--|------------|-----|
| 1株当たり純資産額 | 1,328,681円 | 62銭 |
| 1株当たり中間純利益金額 | 77,562円 | 67銭 |
| なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 | | |

（注）1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 第32期中間会計期間 （自平成28年4月1日 至平成28年9月30日） |
|--------------|--|
| 中間純利益 | 1,861,504千円 |
| 普通株主に帰属しない金額 | - |
| 普通株式に係る中間純利益 | 1,861,504千円 |
| 期中平均株式数 | 24,000株 |

（重要な後発事象）

第32期中間会計期間
（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

当社（以下「DIAM」という）は、平成28年7月13日付で締結した、DIAM、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、平成28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

平成28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。

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．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の親会社である株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「みずほフィナンシャルグループ」という）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A種種類株式15,510株を交付しました。

6．企業結合の主な目的

当社は、みずほフィナンシャルグループ及び第一生命保険株式会社（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、みずほフィナンシャルグループ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。

7．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の親会社であるみずほフィナンシャルグループが、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。

8．実施予定の会計処理

「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することをそれぞれ予定しております。

(参考)みずほ投信投資顧問株式会社の経理状況

当該(参考)において、みずほ投信投資顧問株式会社を「当社」という。

1 当社の財務諸表は、「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条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

当社の中間財務諸表は、「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条及び第57条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

2 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第53期事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第54期中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

みずほ投信投資顧問株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

| | | |
|--------------------|-------|---------|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 江見 睦生 印 |
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 亀井 純子 印 |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているみずほ投信投資顧問株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第53期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、みずほ投信投資顧問株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日付の「統合基本合意書」に基づき、平成28年3月3日付で新会社に係わる一部主要事項を内定している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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、当社が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。

2.XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているみずほ投信投資顧問株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第54期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、みずほ投信投資顧問株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、みずほ投信投資顧問株式会社は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にDIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社と統合した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

(1)貸借対照表

| | （単位： 千円） | |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|
| | 前事業年度 （平成27年3月31日） | 当事業年度 （平成28年3月31日） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 現金及び預金 | 20,801,864 | 20,903,257 |
| 有価証券 | 127,840 | 82,540 |
| 前払費用 | 156,891 | 157,231 |
| 未収委託者報酬 | 1,827,951 | 2,183,032 |
| 未収運用受託報酬 | 1,812,198 | 1,713,643 |
| 繰延税金資産 | 185,882 | 162,369 |
| その他流動資産 | 159,069 | 293,051 |
| 貸倒引当金 | 1,092 | 1,185 |
| 流動資産合計 | 25,070,606 | 25,493,940 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | | |
| 建物（純額） | 124,850 | 100,000 |
| 工具、器具及び備品（純額） | 71,443 | 90,655 |
| リース資産（純額） | 2,140 | 818 |
| 有形固定資産合計 | 1 | 1 |
| 無形固定資産 | | |
| 電話加入権 | 12,747 | 12,747 |
| その他無形固定資産 | 65 | 35 |
| 無形固定資産合計 | 12,812 | 12,782 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | 3,987,168 | 3,260,206 |
| 長期差入保証金 | 360,258 | 340,503 |
| 前払年金費用 | 331,766 | 346,659 |
| 会員権 | 8,400 | 8,400 |
| その他 | 23,186 | 19,551 |
| 貸倒引当金 | 19,534 | 19,404 |
| 投資その他の資産合計 | 4,691,245 | 3,955,916 |
| 固定資産合計 | 4,902,492 | 4,160,172 |
| 資産合計 | 29,973,099 | 29,654,112 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 77,889 | 29,699 |
| リース債務 | 2,648 | 1,202 |
| 未払金 | | |
| 未払収益分配金 | 746 | 833 |
| 未払償還金 | 5,716 | 3,906 |
| 未払手数料 | 819,341 | 838,064 |
| その他未払金 | 86,205 | 9,022 |
| 未払金合計 | 912,009 | 851,826 |
| 未払費用 | 2,038,097 | 1,896,033 |
| 未払法人税等 | 393,574 | 570,376 |
| 未払消費税等 | 426,857 | 227,078 |
| 賞与引当金 | 328,900 | 318,000 |
| その他流動負債 | 3,075 | 999 |
| 流動負債合計 | 4,183,052 | 3,895,216 |
| 固定負債 | | |
| リース債務 | 2,088 | 886 |
| 役員退職慰労引当金 | 104,240 | 147,427 |
| 時効後支払損引当金 | 8,128 | 6,471 |
| 繰延税金負債 | 306,725 | 38,000 |
| その他固定負債 | 6,926 | 1,931 |
| 固定負債合計 | 428,109 | 194,716 |
| 負債合計 | 4,611,161 | 4,089,932 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 2,045,600 | 2,045,600 |

| | | |
|--------------|-------------------|-------------------|
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | 2,266,400 | 2,266,400 |
| その他資本剰余金 | 2,450,074 | 2,450,074 |
| 資本剰余金合計 | <u>4,716,474</u> | <u>4,716,474</u> |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 128,584 | 128,584 |
| その他利益剰余金 | | |
| 配当準備積立金 | 104,600 | 104,600 |
| 退職慰労積立金 | 100,000 | 100,000 |
| 別途積立金 | 9,800,000 | 9,800,000 |
| 繰越利益剰余金 | 7,739,742 | 8,908,993 |
| 利益剰余金合計 | <u>17,872,927</u> | <u>19,042,177</u> |
| 自己株式 | - | 377,863 |
| 株主資本合計 | <u>24,635,002</u> | <u>25,426,389</u> |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 726,935 | 137,791 |
| 評価・換算差額等合計 | <u>726,935</u> | <u>137,791</u> |
| 純資産合計 | <u>25,361,937</u> | <u>25,564,180</u> |
| 負債純資産合計 | <u>29,973,099</u> | <u>29,654,112</u> |

(2)損益計算書

| | （単位： 千円） | |
|--------------|---|---|
| | 前事業年度 （自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日） | 当事業年度 （自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日） |
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 17,538,139 | 17,358,667 |
| 運用受託報酬 | 4,463,429 | 5,050,661 |
| 営業収益合計 | 22,001,569 | 22,409,329 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | 8,480,510 | 7,999,728 |
| 広告宣伝費 | 247,790 | 205,521 |
| 公告費 | 1,140 | 152 |
| 調査費 | | |
| 調査費 | 1,259,067 | 1,312,466 |
| 委託調査費 | 4,883,037 | 5,299,598 |
| 図書費 | 4,308 | 3,703 |
| 調査費合計 | 6,146,412 | 6,615,769 |
| 委託計算費 | 101,919 | 116,405 |
| 営業雑経費 | | |
| 通信費 | 59,454 | 46,151 |
| 印刷費 | 128,143 | 246 |
| 協会費 | 18,777 | 20,221 |
| 諸会費 | 2,540 | 2,317 |
| その他 | 855,319 | 958,635 |
| 営業雑経費合計 | 1,064,234 | 1,027,572 |
| 営業費用合計 | 16,042,008 | 15,965,148 |
| 一般管理費 | | |
| 給料 | | |
| 役員報酬 | 142,983 | 143,812 |
| 給料手当 | 1,832,723 | 1,905,880 |
| 賞与 | 295,180 | 304,122 |
| 給料合計 | 2,270,886 | 2,353,814 |
| 交際費 | 775 | 775 |
| 寄付金 | - | 221 |
| 旅費交通費 | 91,851 | 87,228 |
| 租税公課 | 51,783 | 76,075 |
| 不動産賃借料 | 339,964 | 305,351 |
| 退職給付費用 | 126,451 | 119,608 |
| 福利厚生費 | 368,622 | 370,689 |
| 貸倒引当金繰入 | - | 93 |
| 賞与引当金繰入 | 319,122 | 301,698 |
| 役員退職慰労引当金繰入 | 27,249 | 47,768 |
| 固定資産減価償却費 | 31,216 | 44,257 |
| 諸経費 | 358,817 | 269,502 |
| 一般管理費合計 | 3,986,740 | 3,977,085 |
| 営業利益 | 1,972,819 | 2,467,095 |
| 営業外収益 | | |
| 受取配当金 | 7,027 | 4,242 |
| 受取利息 | 7,340 | 7,633 |
| 有価証券解約益 | 953 | 50,674 |
| 有価証券償還益 | - | 56,303 |
| 時効到来償還金等 | 21,856 | 1,962 |
| 時効後支払損引当金戻入額 | - | 1,311 |
| 雑収入 | 51,171 | 20,993 |
| 営業外収益合計 | 88,349 | 143,121 |
| 営業外費用 | | |
| 有価証券解約損 | - | 278 |
| 有価証券償還損 | 2,197 | 2,641 |
| ヘッジ会計に係る損失 | 2,240 | - |
| 時効後支払損引当金繰入額 | 17,685 | - |
| 雑損失 | 63,198 | 6,767 |

| | | | |
|--------------|---|-----------|-----------|
| 営業外費用合計 | | 85,321 | 9,688 |
| 経常利益 | | 1,975,847 | 2,600,528 |
| 特別利益 | | | |
| 投資有価証券売却益 | | 10,500 | - |
| 特別利益合計 | | 10,500 | - |
| 特別損失 | | | |
| 減損損失 | 1 | 51,292 | - |
| 事業再構築費用 | 2 | 125,173 | - |
| 外国税負担損失 | 3 | 53,547 | - |
| 貸倒引当金繰入 | | 19,534 | - |
| 特別損失合計 | | 249,548 | - |
| 税引前当期純利益 | | 1,736,799 | 2,600,528 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 616,760 | 839,827 |
| 法人税等調整額 | | 16,247 | 40,166 |
| 法人税等合計 | | 633,008 | 879,993 |
| 当期純利益 | | 1,103,790 | 1,720,534 |

(3)株主資本等変動計算書

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位: 千円)

| | 株主資本 | | | |
|---------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | |
| | | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 |
| 当期首残高 | 2,045,600 | 2,266,400 | 2,450,074 | 4,716,474 |
| 当期変動額 | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | |
| 当期純利益 | | | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | | | | |
| 当期変動額合計 | | | | |
| 当期末残高 | 2,045,600 | 2,266,400 | 2,450,074 | 4,716,474 |

| | 株主資本 | | | | | | 株主資本合計 |
|---------------------|---------|----------|---------|-----------|-----------|------------|------------|
| | 利益準備金 | 利益剰余金 | | | | 利益剰余金合計 | |
| | | その他利益剰余金 | | | | | |
| | 配当準備積立金 | 退職慰労積立金 | 別途積立金 | 繰越利益剰余金 | | | |
| 当期首残高 | 128,584 | 104,600 | 100,000 | 9,800,000 | 6,988,395 | 17,121,579 | 23,883,654 |
| 当期変動額 | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | 352,443 | 352,443 | 352,443 |
| 当期純利益 | | | | | 1,103,790 | 1,103,790 | 1,103,790 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | | | | | | | |
| 当期変動額合計 | | | | | 751,347 | 751,347 | 751,347 |
| 当期末残高 | 128,584 | 104,600 | 100,000 | 9,800,000 | 7,739,742 | 17,872,927 | 24,635,002 |

| | 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 | 41,248 | 41,248 | 23,842,406 |
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 352,443 |
| 当期純利益 | | | 1,103,790 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | 768,183 | 768,183 | 768,183 |
| 当期変動額合計 | 768,183 | 768,183 | 1,519,530 |
| 当期末残高 | 726,935 | 726,935 | 25,361,937 |

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位: 千円)

| | 株主資本 | | | |
|---------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | |
| | | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 |
| 当期首残高 | 2,045,600 | 2,266,400 | 2,450,074 | 4,716,474 |
| 当期変動額 | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | |
| 当期純利益 | | | | |
| 自己株式の取得 | | | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | | | | |
| 当期変動額合計 | | | | |
| 当期末残高 | 2,045,600 | 2,266,400 | 2,450,074 | 4,716,474 |

| | 株主資本 | | | | | | | 自己株式 | 株主資本合計 |
|---------------------|---------|----------|---------|-----------|-----------|------------|---------|------------|--------|
| | 利益剰余金 | | | | | | 利益剰余金合計 | | |
| | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | | | 利益剰余金合計 | | | |
| | | 配当準備積立金 | 退職慰労積立金 | 別途積立金 | 繰越利益剰余金 | | | | |
| 当期首残高 | 128,584 | 104,600 | 100,000 | 9,800,000 | 7,739,742 | 17,872,927 | - | 24,635,002 | |
| 当期変動額 | | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | 551,284 | 551,284 | | 551,284 | |
| 当期純利益 | | | | | 1,720,534 | 1,720,534 | | 1,720,534 | |
| 自己株式の取得 | | | | | | | 377,863 | 377,863 | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | | | | | | | | | |
| 当期変動額合計 | | | | | 1,169,250 | 1,169,250 | 377,863 | 791,386 | |
| 当期末残高 | 128,584 | 104,600 | 100,000 | 9,800,000 | 8,908,993 | 19,042,177 | 377,863 | 25,426,389 | |

| | 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 | 726,935 | 726,935 | 25,361,937 |
| 当期変動額 | | | |
| 剰余金の配当 | | | 551,284 |
| 当期純利益 | | | 1,720,534 |
| 自己株式の取得 | | | 377,863 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | 589,143 | 589,143 | 589,143 |
| 当期変動額合計 | 589,143 | 589,143 | 202,242 |
| 当期末残高 | 137,791 | 137,791 | 25,564,180 |

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

決算期末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）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法（ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（附属設備を除く）については定額法）を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

(3) リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定率法を採用しております。

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

当社の自己査定基準に基づき、一般債権については予想損失率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、将来の支給見込額のうち当期の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金（前払年金費用）

従業員に対する退職給付に備えるため、決算日における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、決算日において発生していると認められる額を計上しております。

(4) 役員退職慰労引当金

役員退職慰労金の支給に備えて、内規に基づく期末要支給額を計上しております。（執行役員に対する退職慰労引当金を含む。）

(5) 時効後支払損引当金

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。

5. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物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。

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

時価ヘッジによっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段...株価指数先物取引

ヘッジ対象...有価証券

(3) ヘッジ方針

当社が保有する有価証券の投資リスクを低減させるためにヘッジ取引を行っております。

(4) ヘッジの有効性評価の方法

ヘッジ対象とヘッジ手段の価格変動の相関関係を継続的に計測してヘッジの有効性を評価しております。

7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

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、税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

1. 概要

本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。

2. 適用予定日

当社は、当該適用指針を平成28年4月1日に開始する事業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

当該適用指針の適用による影響は、軽微であります。

会計上の見積りの変更に関する注記

当社は、「追加情報」に記載のとおり、当社、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社間の統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めております。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産の見積り耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。また、本社オフィスの不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務として認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積りの変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ27,598千円減少しております。

追加情報

DIAMアセットマネジメント株式会社（代表取締役社長 西 恵正）、みずほ信託銀行株式会社（取締役社長 中野 武夫）、みずほ投信投資顧問株式会社（取締役社長 中村 英剛）及び新光投信株式会社（取締役社長 後藤 修一）間での平成27年9月30日付統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日付で新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

1. 商号 : アセットマネジメントOne株式会社
2. 代表者 : 西 恵正（現 DIAMアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長）
3. 本店所在地 : 東京都千代田区丸の内1 - 8 - 2
4. 統合日 : 平成28年10月1日

注記事項

（貸借対照表関係）

| 前事業年度 (平成27年3月31日) | | 当事業年度 (平成28年3月31日) | |
|-----------------------|---------------------|-----------------------|---------------------|
| 1 | 有形固定資産の減価償却累計額 | 1 | 有形固定資産の減価償却累計額 |
| | 建物 111,156千円 | | 建物 136,006千円 |
| | 工具、器具及び備品 277,249千円 | | 工具、器具及び備品 226,657千円 |
| | リース資産 16,185千円 | | リース資産 17,508千円 |

（損益計算書関係）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1 減損損失

当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

| 場所 | 用途 | 種類 | 金額（千円） |
|-----------|--------|--------|--------|
| 本社（東京都港区） | 除却対象資産 | 建物 | 23,139 |
| 本社（東京都港区） | 除却対象資産 | 工具器具備品 | 4,253 |
| 本社（東京都港区） | 除却対象資産 | 原状回復費用 | 23,900 |

レイアウト変更により現行オフィス内部造作等の除却が決定した資産につき、「除却対象資産」としてグルーピングを行い、平成27年3月31日時点の帳簿価額および原状回復費用を減損損失（51,292千円）として特別損失に計上しました。

2 事業再構築費用

事業再構築に伴うグループ会社への転籍関連費用であります。

3 外国税負担損失

証券投資信託に係る外国税負担額であります。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当するものはありません。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1 発行済株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|---------|-----------|----|----|-----------|
| 普通株式（株） | 1,052,070 | - | - | 1,052,070 |

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（円） | 1株当たり配当額（円） | 基準日 | 効力発効日 |
|--------------------------|-------|-------------|-------------|------------|------------|
| 平成26年6月11日 第51回定時株主総会 | 普通株式 | 352,443,450 | 335 | 平成26年3月31日 | 平成26年6月12日 |

（2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額（円） | 配当の原資 | 1株当たり配当額（円） | 基準日 | 効力発効日 |
|--------------------------|-------|-------------|-------|-------------|------------|------------|
| 平成27年6月11日 第52回定時株主総会 | 普通株式 | 551,284,680 | 利益剰余金 | 524 | 平成27年3月31日 | 平成27年6月12日 |

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1 発行済株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|---------|-----------|----|----|-----------|
| 普通株式（株） | 1,052,070 | - | - | 1,052,070 |

2 自己株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|---------|---------|--------|----|--------|
| 普通株式（株） | - | 13,662 | - | 13,662 |

（変動事由の概要）

平成28年1月6日の株主総会決議による自己株式の取得 13,662株

3. 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 (円) | 1株当たり 配当額 (円) | 基準日 | 効力発効日 |
|--------------------------|-------|---------------|---------------------|------------|------------|
| 平成27年6月11日 第52回定時株主総会 | 普通株式 | 551,284,680 | 524 | 平成27年3月31日 | 平成27年6月12日 |

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額 (円) | 配当の原資 | 1株当たり 配当額 (円) | 基準日 | 効力発効日 |
|--------------------------|-------|----------------|-------|---------------------|------------|------------|
| 平成28年6月10日 第53回定時株主総会 | 普通株式 | 17,652,936,000 | 利益剰余金 | 17,000 | 平成28年3月31日 | 平成28年6月13日 |
| | | 1,346,815,176 | 資本剰余金 | 1,297 | 平成28年3月31日 | 平成28年6月13日 |
| | 合計 | 18,999,751,176 | | 18,297 | | |

(リース取引関係)

1. ファイナンス・リース取引（借主側）

所有権移転外ファイナンス・リース取引

リース資産の内容

有形固定資産

主として、事務用機器及び車両運搬具であります。

リース資産の減価償却の方法

重要な会計方針「3. 固定資産の減価償却方法」に記載のとおりであります。

(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、投資助言・代理業、第二種金融商品取引業を行っており、余資運用については、安全性の高い金融資産で運用しております。

デリバティブは、当社が保有する特定の有価証券の投資リスクを低減させる目的で利用しており、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

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、相手先の信用リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券は、当社業務運営に関連する株式、投資信託であります。これらは、それぞれ発行体の信用リスク及び市場価格の変動リスクに晒されております。営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

デリバティブ取引には株価指数先物取引があり、その他有価証券で保有する投資信託の価格変動を相殺する目的で行い、ヘッジ対象に係る損益を認識する方法（時価ヘッジ）を適用しています。なお、ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間においてヘッジ手段とヘッジ対象の価格変動の相関関係を継続的に計測する事によりヘッジの有効性を評価しております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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半期ごとに把握する体制としております。

有価証券の発行体の信用リスク及びデリバティブ取引のカウンターパーティーリスクに関しては、信用情報や時価の把握を定期的に行うことで管理しています。

市場リスクの管理

有価証券を含む金融商品の保有については、当社の市場リスク管理の基本方針（自己資金運用）に従い、定期的な時価や発行体の財務状況を把握し、価格変動リスクの軽減を図っております。デリバティブ取引に関しては、取引の執行、ヘッジの有効性の評価に関する部門を分離し、内部統制を確立しております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価は、市場価格に基づく価額によっております。また、注記事項「デリバティブ取引関係」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

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、次表には含まれておりません。（（注2）を参照ください。）

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|----------------------------|------------|------------|----|
| (1) 現金及び預金 | 20,801,864 | 20,801,864 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 1,827,951 | 1,827,951 | - |
| (3) 未収運用受託報酬 | 1,812,198 | 1,812,198 | - |
| (4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券 | 4,054,289 | 4,054,289 | - |
| 資産計 | 28,496,304 | 28,496,304 | - |
| (1) 未払手数料 | 819,341 | 819,341 | - |
| 負債計 | 819,341 | 819,341 | - |
| デリバティブ取引（1） | | | |
| ヘッジ会計が適用されていないもの | (3,601) | (3,601) | - |
| ヘッジ会計が適用されているもの | 327 | 327 | - |
| デリバティブ取引計 | (3,274) | (3,274) | - |

（1）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（ ）で示しております。

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|----------------------------|------------|------------|----|
| (1) 現金及び預金 | 20,903,257 | 20,903,257 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 2,183,032 | 2,183,032 | - |
| (3) 未収運用受託報酬 | 1,713,643 | 1,713,643 | - |
| (4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券 | 3,282,026 | 3,282,026 | - |
| 資産計 | 28,081,960 | 28,081,960 | - |
| (1) 未払手数料 | 838,064 | 838,064 | - |
| 負債計 | 838,064 | 838,064 | - |
| デリバティブ取引（1） | | | |
| ヘッジ会計が適用されていないもの | (220) | (220) | - |
| ヘッジ会計が適用されているもの | (1,564) | (1,564) | - |
| デリバティブ取引計 | (1,784) | (1,784) | - |

（1）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、（ ）で示しております。

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資 産

(1) 現金及び預金

預金については、すべて短期であるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2) 未収委託者報酬及び(3) 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。

(4) 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。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」を参照ください。

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。

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」を参照ください。

(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の貸借対照表計上額

(単位:千円)

| 区分 | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|-------|-----------------------|-----------------------|
| 非上場株式 | 60,720 | 60,720 |

上記については、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ため、「(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(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

前事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

| | 1年以内 | 1年超 2年以内 | 2年超 3年以内 | 3年超 4年以内 | 4年超 5年以内 | 5年超 |
|---|------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------|
| 預金 | 20,800,853 | - | - | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 1,827,951 | - | - | - | - | - |
| 未収運用受託報酬 | 1,812,198 | - | - | - | - | - |
| 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの 証券投資信託 | 127,840 | - | - | - | - | 3,300,657 |
| 合計 | 24,568,844 | - | - | - | - | 3,300,657 |

当事業年度(平成28年3月31日)

(単位:千円)

| | 1年以内 | 1年超 2年以内 | 2年超 3年以内 | 3年超 4年以内 | 4年超 5年以内 | 5年超 |
|---|------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------|
| 預金 | 20,902,546 | - | - | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 2,183,032 | - | - | - | - | - |
| 未収運用受託報酬 | 1,713,643 | - | - | - | - | - |
| 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの 証券投資信託 | 82,540 | - | - | - | - | 2,395,185 |
| 合計 | 24,881,762 | - | - | - | - | 2,395,185 |

(有価証券関係)

1 その他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

| 種類 | 貸借対照表計上額 (千円) | 取得原価(千円) | 差額(千円) |
|------------------------------------|------------------|-----------|-----------|
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 証券投資信託 | 3,740,183 | 2,664,442 | 1,075,740 |
| 小計 | 3,740,183 | 2,664,442 | 1,075,740 |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 証券投資信託 | 314,105 | 316,720 | 2,615 |
| 小計 | 314,105 | 316,720 | 2,615 |
| 合計 | 4,054,289 | 2,981,163 | 1,073,125 |

当事業年度(平成28年3月31日)

| 種類 | 貸借対照表計上額 (千円) | 取得原価(千円) | 差額(千円) |
|------------------------------------|------------------|-----------|---------|
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 証券投資信託 | 2,698,875 | 2,500,000 | 198,875 |
| 小計 | 2,698,875 | 2,500,000 | 198,875 |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 証券投資信託 | 583,151 | 583,423 | 271 |
| 小計 | 583,151 | 583,423 | 271 |
| 合計 | 3,282,026 | 3,083,423 | 198,603 |

2 当事業年度中に売却したその他有価証券
該当するものではありません。

3 当事業年度中に解約・償還したその他有価証券
前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

| 種類 | 解約・償還額(千円) | 解約・償還益の合計額 (千円) | 解約・償還損の合計額 (千円) |
|--------|------------|--------------------|--------------------|
| 証券投資信託 | 102,729 | 953 | 2,197 |
| 合計 | 102,729 | 953 | 2,197 |

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

| 種類 | 解約・償還額(千円) | 解約・償還益の合計額 (千円) | 解約・償還損の合計額 (千円) |
|--------|------------|--------------------|--------------------|
| 証券投資信託 | 738,178 | 106,977 | 2,920 |
| 合計 | 738,178 | 106,977 | 2,920 |

(デリバティブ取引関係)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
株式関連
前事業年度(平成27年3月31日)

| 区分 | 取引の種類 | 契約額等 (千円) | 契約額のうち 1年超 (千円) | 時価 (千円) | 評価損益 (千円) |
|------|----------------|--------------|-----------------------|------------|--------------|
| 市場取引 | 株価指数先物取引 売建 | 197,054 | - | 3,601 | 3,601 |
| | 合計 | 197,054 | - | 3,601 | 3,601 |

当事業年度(平成28年3月31日)

| 区分 | 取引の種類 | 契約額等 (千円) | 契約額のうち 1年超 (千円) | 時価 (千円) | 評価損益 (千円) |
|------|----------------|--------------|-----------------------|------------|--------------|
| 市場取引 | 株価指数先物取引 売建 | 148,005 | - | 220 | 220 |
| | 合計 | 148,005 | - | 220 | 220 |

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

株式関連

前事業年度(平成27年3月31日)

| ヘッジ会計の方法 | 取引の種類 | 主なヘッジ対象 | 契約額等 (千円) | 契約額のうち 1年超 (千円) | 時価 (千円) |
|-------------------|----------|---------|--------------|-----------------------|------------|
| ヘッジ対象に係る損益を認識する方法 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 売建 | 投資有価証券 | 131,145 | - | 3,325 |
| | 買建 | 投資有価証券 | 277,953 | - | 3,652 |
| 合計 | | | 409,098 | - | 327 |

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

当事業年度(平成28年3月31日)

| ヘッジ会計の方法 | 取引の種類 | 主なヘッジ対象 | 契約額等 (千円) | 契約額のうち 1年超 (千円) | 時価 (千円) |
|-------------------|----------|---------|--------------|-----------------------|------------|
| ヘッジ対象に係る損益を認識する方法 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 売建 | 投資有価証券 | 117,467 | - | 147 |
| | 買建 | 投資有価証券 | 179,836 | - | 1,711 |
| 合計 | | | 297,303 | - | 1,564 |

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

(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、確定給付企業年金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として企業型確定拠出年金制度を設けております。

当社が有する確定給付企業年金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

| | 前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) | 当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) |
|--------------|--|--|
| 退職給付引当金の期首残高 | 357,258千円 | 331,766千円 |
| 退職給付費用 | 150,018 | 51,208 |
| 退職給付の支払額 | 21,349 | - |
| 制度への拠出額 | 103,177 | 66,102 |
| 退職給付引当金の期末残高 | 331,766 | 346,659 |

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

| | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|
| 積立型制度の退職給付債務 | 669,318千円 | 727,842千円 |
| 年金資産 | 1,001,084 | 1,074,502 |
| 貸借対照表に計上された前払年金費用 | 331,766 | 346,659 |

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度58,362千円 当事業年度51,208千円

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17,436千円、当事業年度17,574千円であります。

(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

| | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
| 繰延税金資産 | | |
| 有価証券償却超過額 | 4,795千円 | 4,551千円 |
| ソフトウェア償却超過額 | 69,263 | 52,651 |
| 賞与引当金損金算入限度超過額 | 108,734 | 98,134 |
| 社会保険料損金不算入額 | 15,665 | 14,233 |
| 役員退職慰労引当金 | 34,461 | 45,488 |
| 未払事業税 | 30,421 | 39,817 |
| その他 | 93,137 | 58,782 |
| 繰延税金資産小計 | 356,479 | 313,659 |
| 評価性引当額 | 24,103 | 22,331 |
| 繰延税金資産合計 | 332,375 | 291,328 |
| 繰延税金負債 | | |
| 前払年金費用 | 107,027 | 106,147 |
| その他有価証券評価差額金 | 346,190 | 60,812 |
| 繰延税金負債合計 | 453,218 | 166,959 |
| 繰延税金資産の純額 | 120,843 | 124,368 |

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。

3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」が平成28年3月29日に国会で成立したことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰越税金負債の計算（ただし、平成28年4月1日以降解消されるものに限る）に使用した法定実効税率は、前事業年度の32.26%から、回収又は支払が見込まれる期間が平成28年4月1日から平成30年3月31日までのものは30.86%、平成30年4月1日以降のものについては30.62%にそれぞれ変更されております。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が4,569千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額が7,826千円、その他有価証券評価差額金が3,257千円それぞれ増加しております。

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）及び当事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

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。

[関連情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及び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

(1) 売上高

本邦の外部顧客からの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、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 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

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

| 顧客の種類等 | 営業収益（千円） | 関連するセグメント名 |
|-----------|-----------|------------|
| 適格機関投資家 A | 2,629,803 | 資産運用業 |

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及び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

(1) 売上高

本邦の外部顧客からの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、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 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

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

| 顧客の種類等 | 営業収益（千円） | 関連するセグメント名 |
|-----------|-----------|------------|
| 適格機関投資家 A | 3,061,207 | 資産運用業 |

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当するものはありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 又は 出資金 | 事業の 内容 | 議決権等 の所有 (被所有) 割合 | 関連当事者 との関係 | 取引の内容 | 取引金額 (千円) | 科目 | 期末残高 (千円) |
|-------------|-------------|---------|------------------|-----------|----------------------------|---------------|-------|--------------|---------|--------------|
| 同一の親会社をもつ会社 | 株式会社みずほ銀行 | 東京都千代田区 | 14,040億円 | 銀行業 | なし | 投資信託の販売 | 支払手数料 | 3,833,692 | 未払手数料 | 361,219 |
| 同一の親会社をもつ会社 | みずほ信託銀行株式会社 | 東京都中央区 | 2,473億円 | 信託銀行業 | なし | 信託財産の管理 | 委託者報酬 | 13,851,610 | 未収委託者報酬 | 1,661,682 |

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 又は 出資金 | 事業の 内容 | 議決権等 の所有 (被所有) 割合 | 関連当事者 との関係 | 取引の内容 | 取引金額 (千円) | 科目 | 期末残高 (千円) |
|-------------|-------------|---------|------------------|-----------|----------------------------|---------------|-------|--------------|---------|--------------|
| 同一の親会社をもつ会社 | 株式会社みずほ銀行 | 東京都千代田区 | 14,040億円 | 銀行業 | なし | 投資信託の販売 | 支払手数料 | 3,542,264 | 未払手数料 | 336,556 |
| 同一の親会社をもつ会社 | みずほ信託銀行株式会社 | 東京都中央区 | 2,473億円 | 信託銀行業 | なし | 信託財産の管理 | 委託者報酬 | 14,108,529 | 未収委託者報酬 | 2,053,638 |

(注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

上記の取引については、一般取引条件と同様に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

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)

(1株当たり情報)

| | 前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) | 当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) |
|--------------|--|--|
| 1株当たり純資産額 | 24,106.70円 | 24,618.62円 |
| 1株当たり当期純利益金額 | 1,049.16円 | 1,639.16円 |

(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、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

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。

| | 前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) | 当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) |
|------------------|--|--|
| 1株当たり当期純利益金額 | | |
| 当期純利益(千円) | 1,103,790 | 1,720,534 |
| 普通株式に帰属しない金額(千円) | - | - |
| 普通株式に係る当期純利益(千円) | 1,103,790 | 1,720,534 |
| 期中平均株式数(株) | 1,052,070 | 1,049,643 |

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位: 千円)

第54期中間会計期間
(平成28年9月30日)

| | |
|---------------|------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 現金及び預金 | 4,120,018 |
| 未収委託者報酬 | 2,064,997 |
| 未収運用受託報酬 | 1,959,028 |
| 繰延税金資産 | 140,728 |
| その他 | 398,383 |
| 貸倒引当金 | 1,207 |
| 流動資産合計 | 8,681,950 |
| 固定資産 | |
| 有形固定資産 | |
| 工具、器具及び備品(純額) | 62,971 |
| 有形固定資産合計 | 1 62,971 |
| 無形固定資産 | |
| 投資その他の資産 | 12,767 |
| 投資有価証券 | 815,525 |
| 繰延税金資産 | 73,719 |
| その他 | 638,830 |
| 貸倒引当金 | 19,404 |
| 投資その他の資産合計 | 1,508,671 |
| 固定資産合計 | 1,584,410 |
| 資産合計 | 10,266,360 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 793,859 |
| 未払費用 | 1,675,771 |
| 未払法人税等 | 253,697 |
| 賞与引当金 | 319,200 |
| その他 | 221,869 |
| 流動負債合計 | 3,264,398 |
| 固定負債 | |
| 役員退職慰労引当金 | 57,860 |
| 時効後支払損引当金 | 7,256 |
| 固定負債合計 | 65,116 |
| 負債合計 | 3,329,515 |
| 純資産の部 | |
| 株主資本 | |
| 資本金 | 2,045,600 |
| 資本剰余金 | |
| 資本準備金 | 2,266,400 |
| その他資本剰余金 | 1,103,259 |
| 資本剰余金合計 | 3,369,659 |
| 利益剰余金 | |
| 利益準備金 | 128,584 |
| その他利益剰余金 | |
| 繰越利益剰余金 | 1,777,567 |
| 利益剰余金合計 | 1,906,152 |
| 自己株式 | 377,863 |
| 株主資本合計 | 6,943,548 |
| 評価・換算差額等 | |
| その他有価証券評価差額金 | 6,703 |
| 評価・換算差額等合計 | 6,703 |
| 純資産合計 | 6,936,845 |
| 負債純資産合計 | 10,266,360 |

(2) 中間損益計算書

(単位: 千円)

| | 第54期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日) | |
|--------------|---|------------|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | | 7,935,613 |
| 運用受託報酬 | | 2,105,866 |
| 営業収益合計 | | 10,041,479 |
| 営業費用及び一般管理費 | 1 | 9,415,997 |
| 営業利益 | | 625,482 |
| 営業外収益 | | |
| 受取配当金 | | 19,694 |
| 受取利息 | | 439 |
| 有価証券解約益 | | 76,483 |
| 有価証券償還益 | | 3,474 |
| 時効到来償還金等 | | 727 |
| 雑収入 | | 17,708 |
| 営業外収益合計 | | 118,528 |
| 営業外費用 | | |
| 有価証券解約損 | | 96 |
| 有価証券償還損 | | 12 |
| 雑損失 | | 6,303 |
| 営業外費用合計 | | 6,412 |
| 経常利益 | | 737,598 |
| 特別利益 | | 700 |
| 特別損失 | | 11,641 |
| 税引前中間純利益 | | 726,657 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 236,054 |
| 法人税等調整額 | | 26,308 |
| 法人税等合計 | | 209,746 |
| 中間純利益 | | 516,910 |

(3) 中間株主資本等変動計算書

第54期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

(単位： 千円)

| | 株主資本 | | | |
|---------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | |
| | | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 |
| 当期首残高 | 2,045,600 | 2,266,400 | 2,450,074 | 4,716,474 |
| 当中間期変動額 | | | | |
| 積立金取崩 | | | | |
| 剰余金の配当 | | | 1,346,815 | 1,346,815 |
| 中間純利益 | | | | |
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額） | | | | |
| 当中間期変動額合計 | | | 1,346,815 | 1,346,815 |
| 当中間期末残高 | 2,045,600 | 2,266,400 | 1,103,259 | 3,369,659 |

| | 株主資本 | | | | | |
|---------------------------|---------|----------|---------|-----------|------------|------------|
| | 利益準備金 | 利益剰余金 | | | | 利益剰余金合計 |
| | | その他利益剰余金 | | | | |
| | 配当準備積立金 | 退職慰労積立金 | 別途積立金 | 繰越利益剰余金 | | |
| 当期首残高 | 128,584 | 104,600 | 100,000 | 9,800,000 | 8,908,993 | 19,042,177 |
| 当中間期変動額 | | | | | | |
| 積立金取崩 | | 104,600 | 100,000 | 9,800,000 | 10,004,600 | - |
| 剰余金の配当 | | | | | 17,652,936 | 17,652,936 |
| 中間純利益 | | | | | 516,910 | 516,910 |
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額） | | | | | | |
| 当中間期変動額合計 | | 104,600 | 100,000 | 9,800,000 | 7,131,425 | 17,136,025 |
| 当中間期末残高 | 128,584 | - | - | - | 1,777,567 | 1,906,152 |

| | 株主資本 | | 評価・換算差額等 | | 純資産合計 |
|---------------------------|---------|------------|------------------|----------------|------------|
| | 自己株式 | 株主資本合計 | その他有価証券 評価差額金 | 評価・換算差額 等合計 | |
| 当期首残高 | 377,863 | 25,426,389 | 137,791 | 137,791 | 25,564,180 |
| 当中間期変動額 | | | | | |
| 積立金取崩 | | - | | | - |
| 剰余金の配当 | | 18,999,751 | | | 18,999,751 |
| 中間純利益 | | 516,910 | | | 516,910 |
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額） | | | 144,494 | 144,494 | 144,494 |
| 当中間期変動額合計 | | 18,482,840 | 144,494 | 144,494 | 18,627,334 |
| 当中間期末残高 | 377,863 | 6,943,548 | 6,703 | 6,703 | 6,936,845 |

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

当社の自己査定基準に基づき、一般債権については予想損失率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3) 退職給付引当金（前払年金費用）

従業員に対する退職給付に備えるため、中間決算日における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、中間決算日において発生していると認められる額を計上しております。

(4) 役員退職慰労引当金（執行役員に対する退職慰労引当金）

役員退職慰労金の支給に備えて、内規に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

(5) 時効後支払損引当金

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。

4. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物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. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

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、税抜方式によっております。

追加情報

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当中間会計期間から適用しております。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

| | 第54期中間会計期間 (平成28年9月30日) |
|------------------|----------------------------|
| 1 有形固定資産の減価償却累計額 | 476,786千円 |

(中間損益計算書関係)

| | 第54期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日) |
|-----------|---|
| 1 減価償却実施額 | 有形固定資産 114,327千円 無形固定資産 15千円 |

(中間株主資本等変動計算書関係)

第54期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

1 発行済株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当中間会計期間末 |
|---------|-----------|----|----|-----------|
| 普通株式(株) | 1,052,070 | - | - | 1,052,070 |

2. 自己株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当中間会計期間末 |
|---------|---------|----|----|----------|
| 普通株式(株) | 13,662 | - | - | 13,662 |

3 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 (円) | 配当の原資 | 1株当たり 配当額 (円) | 基準日 | 効力発効日 |
|--------------------------|-------|----------------|-------|---------------------|------------|------------|
| 平成28年6月10日 第53回定時株主総会 | 普通株式 | 17,652,936,000 | 利益剰余金 | 17,000 | 平成28年3月31日 | 平成28年6月13日 |
| | | 1,346,815,176 | 資本剰余金 | 1,297 | 平成28年3月31日 | 平成28年6月13日 |
| | 合計 | 18,999,751,176 | | 18,297 | | |

(金融商品関係)

第54期中間会計期間(平成28年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません。(注2)を参照ください。)

(単位： 千円)

| | 中間貸借対照表計 上額 | 時価 | 差額 |
|----------------------|----------------|-----------|----|
| (1) 現金及び預金 | 4,120,018 | 4,120,018 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 2,064,997 | 2,064,997 | - |
| (3) 未収運用受託報酬 | 1,959,028 | 1,959,028 | - |
| (4) 投資有価証券 其他有価証券 | 754,805 | 754,805 | - |
| 資産計 | 8,898,851 | 8,898,851 | - |
| (1) 未払手数料 | 785,089 | 785,089 | - |
| 負債計 | 785,089 | 785,089 | - |

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資 産

(1) 現金及び預金

預金については、すべて短期であるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2) 未収委託者報酬及び(3) 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。

(4) 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。

また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照ください。

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の中間貸借対照表計上額

| 区分 | 中間貸借対照表計上額（千円） |
|-------|----------------|
| 非上場株式 | 60,720 |

上記については、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ため、「(4) 投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(有価証券関係)

第54期中間会計期間（平成28年9月30日）

1 その他有価証券

| 種類 | 中間貸借対照表計上額 （千円） | 取得原価（千円） | 差額（千円） |
|----------------------------|--------------------|----------|--------|
| 中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの | | | |
| 証券投資信託 | 151,830 | 150,000 | 1,830 |
| 小計 | 151,830 | 150,000 | 1,830 |
| 中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの | | | |
| 証券投資信託 | 602,975 | 614,467 | 11,491 |
| 小計 | 602,975 | 614,467 | 11,491 |
| 合計 | 754,805 | 764,467 | 9,661 |

(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)

[セグメント情報]

第54期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

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。

[関連情報]

第54期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及び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

(1) 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

有形固定資産はすべて本邦に所在しております。

3 主要な顧客ごとの情報

委託者報酬については、当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する受益者は不特定多数であるため、記載を省略しております。

運用受託報酬については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める投資一任報酬がありますが、守秘義務によりその顧客の名称に代えて種類と顧客を区別するための記号を記載しております。

| 顧客の種類等 | 営業収益(千円) | 関連するセグメント名 |
|----------|-----------|------------|
| 適格機関投資家A | 1,177,474 | 資産運用業 |

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額は、以下のとおりであります。

| 第54期中間会計期間 (平成28年9月30日) | |
|----------------------------|-----------|
| 1株当たり純資産額 | 6,680.26円 |

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| 第54期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日) | |
|---|-----------|
| 1株当たり中間純利益金額 | 497.79円 |
| (算定上の基礎) | |
| 中間純利益金額(千円) | 516,910 |
| 普通株主に帰属しない金額(千円) | - |
| 普通株式に係る中間純利益金額(千円) | 516,910 |
| 普通株式の期中平均株式数(株) | 1,038,408 |

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

(重要な後発事象)

当社(以下「MHAM」という)は、平成28年7月13日付で締結した、MHAM、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」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、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 企業結合日
平成28年10月1日

2. 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。

（参考）新光投信株式会社の経理状況

1．財務諸表の作成方法について

委託会社である新光投信株式会社（以下「当社」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。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第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。

当社の中間財務諸表は、「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条および第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第56期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

第57期事業年度（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

新光投信株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 伊藤 志保

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 福村 寛

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」に掲げられている新光投信株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第56期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、新光投信株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日付の統合基本合意書に基づき、平成28年3月3日付で新会社に係わる主要事項を内定している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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

- () 1 . 上記は、当社が、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。
2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第57期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、新光投信株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、新光投信株式会社は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にDIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及びみずほ投信投資顧問株式会社と統合した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

(1) 貸借対照表

(単位：千円)

| | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 現金及び預金 | 13,427,042 | 14,861,160 |
| 有価証券 | 3,200,000 | 3,500,000 |
| 貯蔵品 | 5,117 | 4,282 |
| 立替金 | 23,184 | 14,857 |
| 前払金 | 64,821 | 67,307 |
| 前払費用 | 18,242 | 17,989 |
| 未収入金 | 872 | 153 |
| 未収委託者報酬 | 3,187,770 | 2,884,368 |
| 未収運用受託報酬 | 99,054 | 82,656 |
| 未収収益 | 6,338 | 8,528 |
| 繰延税金資産 | 372,215 | 326,063 |
| 流動資産合計 | 20,404,659 | 21,767,367 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | | |
| 建物（純額） | 2 12,687 | 2 0 |
| 構築物（純額） | 2 1,444 | 2 0 |
| 器具・備品（純額） | 2 86,688 | 2 44,868 |
| 有形固定資産合計 | 100,820 | 44,868 |
| 無形固定資産 | | |
| 電話加入権 | 91 | 91 |
| ソフトウェア | 85,517 | 55,116 |
| ソフトウェア仮勘定 | 669 | 1,944 |
| 無形固定資産合計 | 86,278 | 57,152 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | 5,101,854 | 2,858,652 |
| 関係会社株式 | 77,100 | 77,100 |
| 長期差入保証金 | 124,246 | 23,339 |
| 長期繰延税金資産 | - | 29,604 |
| 前払年金費用 | 396,211 | 378,381 |
| その他 | 6,632 | 6,632 |
| 投資その他の資産合計 | 5,706,044 | 3,373,710 |
| 固定資産合計 | 5,893,143 | 3,475,731 |
| 資産合計 | 26,297,802 | 25,243,098 |

(単位：千円)

| | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 17,893 | 19,103 |
| リース債務 | 345 | - |
| 未払金 | | |
| 未払収益分配金 | 160 | 152 |
| 未払償還金 | 5,083 | 4,216 |
| 未払手数料 | 1 1,558,682 | 1 1,360,372 |
| その他未払金 | 952,018 | 516,568 |
| 未払金合計 | 2,515,945 | 1,881,309 |
| 未払費用 | 722,806 | 746,430 |
| 未払法人税等 | 1,222,883 | 857,031 |
| 賞与引当金 | 451,000 | 547,750 |
| 役員賞与引当金 | 66,000 | 44,000 |
| 外国税支払損失引当金 | 184,111 | - |
| 訴訟損失引当金 | 30,000 | 40,000 |
| 流動負債合計 | 5,210,985 | 4,135,625 |
| 固定負債 | | |
| 繰延税金負債 | 89,752 | - |
| 退職給付引当金 | 155,806 | 146,617 |
| 役員退職慰労引当金 | 39,333 | 48,333 |
| 執行役員退職慰労引当金 | 63,916 | 85,916 |
| 固定負債合計 | 348,809 | 280,867 |
| 負債合計 | 5,559,794 | 4,416,492 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 4,524,300 | 4,524,300 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | 2,761,700 | 2,761,700 |
| 資本剰余金合計 | 2,761,700 | 2,761,700 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 360,493 | 360,493 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | 8,900,000 | 8,900,000 |
| 繰越利益剰余金 | 3,981,245 | 4,185,368 |
| 利益剰余金合計 | 13,241,738 | 13,445,861 |
| 自己株式 | 72,415 | - |
| 株主資本合計 | 20,455,322 | 20,731,861 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 282,685 | 94,744 |

| | | |
|------------|------------|------------|
| 評価・換算差額等合計 | 282,685 | 94,744 |
| 純資産合計 | 20,738,008 | 20,826,605 |
| 負債純資産合計 | 26,297,802 | 25,243,098 |

(2) 損益計算書

(単位：千円)

| | 前事業年度 | | 当事業年度 | |
|-------------|--------------------------------|------------|--------------------------------|------------|
| | (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日) | | (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日) | |
| 営業収益 | | | | |
| 委託者報酬 | | 35,876,795 | | 39,283,623 |
| 運用受託報酬 | | 238,412 | | 232,145 |
| 営業収益合計 | | 36,115,207 | | 39,515,769 |
| 営業費用 | | | | |
| 支払手数料 | 1 | 18,252,669 | 1 | 19,472,734 |
| 広告宣伝費 | | 456,430 | | 507,020 |
| 公告費 | | 548 | | 469 |
| 調査費 | | | | |
| 調査費 | | 623,792 | | 841,825 |
| 委託調査費 | | 5,966,340 | | 7,419,125 |
| 図書費 | | 5,254 | | 4,879 |
| 調査費合計 | | 6,595,388 | | 8,265,830 |
| 委託計算費 | | 1,352,318 | | 1,711,366 |
| 営業雑経費 | | | | |
| 通信費 | | 32,335 | | 30,454 |
| 印刷費 | | 103,093 | | 1,022 |
| 協会費 | | 18,150 | | 19,367 |
| 諸会費 | | 3,300 | | 3,117 |
| その他 | | 41,594 | | 44,518 |
| 営業雑経費合計 | | 198,475 | | 98,480 |
| 営業費用合計 | | 26,855,830 | | 30,055,901 |
| 一般管理費 | | | | |
| 給料 | | | | |
| 役員報酬 | | 96,445 | | 91,205 |
| 給料・手当 | | 1,368,552 | | 1,480,875 |
| 賞与 | | 336,076 | | 428,776 |
| 給料合計 | | 1,801,073 | | 2,000,857 |
| 交際費 | | 11,426 | | 10,708 |
| 寄付金 | | 3,198 | | 2,346 |
| 旅費交通費 | | 100,386 | | 109,240 |
| 租税公課 | | 68,508 | | 90,795 |
| 不動産賃借料 | | 206,753 | | 205,671 |
| 賞与引当金繰入 | | 451,000 | | 547,750 |
| 役員賞与引当金繰入 | | 66,000 | | 22,000 |
| 役員退職慰労引当金繰入 | | 24,930 | | 22,210 |
| 退職給付費用 | | 191,900 | | 169,238 |
| 減価償却費 | | 70,676 | | 102,532 |

| | | |
|---------|-----------|-----------|
| 諸経費 | 573,824 | 647,510 |
| 一般管理費合計 | 3,569,678 | 3,930,859 |
| 営業利益 | 5,689,698 | 5,529,008 |

(単位：千円)

| | 前事業年度 | | 当事業年度 | |
|----------------|--------------------------------|-----------|--------------------------------|-----------|
| | (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日) | | (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日) | |
| 営業外収益 | | | | |
| 受取配当金 | | 163,006 | | 65,772 |
| 有価証券利息 | | 3,853 | | 3,333 |
| 受取利息 | | 10,741 | | 10,751 |
| 時効成立分配金・償還金 | | 5,080 | | 923 |
| 受取保険金 | | - | | 10,300 |
| 雑益 | | 487 | | 2,845 |
| 営業外収益合計 | | 183,170 | | 93,926 |
| 営業外費用 | | | | |
| 支払利息 | | 26 | | 3 |
| 時効成立後支払分配金・償還金 | | 3,083 | | 5,532 |
| 雑損 | | 3,261 | | 556 |
| 営業外費用合計 | | 6,371 | | 6,092 |
| 経常利益 | | 5,866,496 | | 5,616,842 |
| 特別利益 | | | | |
| 投資有価証券売却益 | | 68,179 | | 225,965 |
| 外国税支払損失引当金戻入益 | | - | | 43,200 |
| 特別利益合計 | | 68,179 | | 269,166 |
| 特別損失 | | | | |
| 固定資産除却損 | | 3,177 | | 13,017 |
| 投資有価証券売却損 | | 54,613 | | 60,150 |
| 投資有価証券評価損 | | 10,952 | | 62,800 |
| 外国税支払損失引当金繰入額 | | 184,111 | | - |
| 訴訟損失引当金繰入額 | | 30,000 | | 10,000 |
| 合併関連費用 | 2 | - | 2 | 164,657 |
| その他特別損失 | | 22,227 | | - |
| 特別損失合計 | | 305,082 | | 310,625 |
| 税引前当期純利益 | | 5,629,593 | | 5,575,383 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 2,111,379 | | 1,832,729 |
| 法人税等調整額 | | 66,999 | | 19,773 |
| 法人税等合計 | | 2,044,380 | | 1,852,503 |
| 当期純利益 | | 3,585,212 | | 3,722,880 |

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | |
|-------------------------|-----------|-----------|-----------|------------|-------------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | 利益剰余金 | |
| | | 資本 準備金 | 利益 準備金 | その他利益剰余金 | |
| | | | | 別 途 積立金 | 繰 越 利 益 剰余金 |
| 当期首残高 | 4,524,300 | 2,761,700 | 360,493 | 8,900,000 | 2,889,165 |
| 会計方針の変更による累積的影響額 | | | | | 46,276 |
| 会計方針の変更を反映した当期首残高 | 4,524,300 | 2,761,700 | 360,493 | 8,900,000 | 2,935,441 |
| 当期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | 2,539,409 |
| 当期純利益 | | | | | 3,585,212 |
| 株主資本以外の項目の 当期変動額（純額） | | | | | |
| 当期変動額合計 | - | - | - | - | 1,045,803 |
| 当期末残高 | 4,524,300 | 2,761,700 | 360,493 | 8,900,000 | 3,981,245 |

| | 株主資本 | | | 評価・換算差額等 | 純資産合計 |
|-------------------------|-------------------|------------|-------------------|------------------|------------|
| | 利益剰余金 | 自 己 株 式 | 株 主 資 本 合 計 | その他有価証 券評価差額金 | |
| | 利 益 剰余金 合 計 | | | | |
| 当期首残高 | 12,149,658 | 72,415 | 19,363,242 | 50,874 | 19,414,117 |
| 会計方針の変更による累積的影響額 | 46,276 | | 46,276 | | 46,276 |
| 会計方針の変更を反映した当期首残高 | 12,195,935 | 72,415 | 19,409,519 | 50,874 | 19,460,393 |
| 当期変動額 | | | | | |
| 剰余金の配当 | 2,539,409 | | 2,539,409 | | 2,539,409 |
| 当期純利益 | 3,585,212 | | 3,585,212 | | 3,585,212 |
| 株主資本以外の項目の当期 変動額（純額） | | | | 231,810 | 231,810 |
| 当期変動額合計 | 1,045,803 | - | 1,045,803 | 231,810 | 1,277,614 |
| 当期末残高 | 13,241,738 | 72,415 | 20,455,322 | 282,685 | 20,738,008 |

当事業年度（自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | | |
|----------------------|-----------|-----------|----------|-----------|---------|-------------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | | 利益剰余金 | |
| | | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 | 利益準備金 | その他利益剰余金 別途積立金 |
| 当期首残高 | 4,524,300 | 2,761,700 | - | 2,761,700 | 360,493 | 8,900,000 |
| 当期変動額 | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | |
| 当期純利益 | | | | | | |
| 自己株式の消却 | | | 72,415 | 72,415 | | |
| 利益剰余金から 資本剰余金への振替 | | | 72,415 | 72,415 | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | | | | | | |
| 当期変動額合計 | - | - | - | - | - | - |
| 当期末残高 | 4,524,300 | 2,761,700 | - | 2,761,700 | 360,493 | 8,900,000 |

| | 株主資本 | | | | 評価・換算 差額等 | 純資産合計 |
|---------------------|---------------------|------------|--------|------------|--------------|------------|
| | 利益剰余金 | | 自己株式 | 株主資本合計 | その他有価証券評価差額金 | |
| | その他利益剰余金 繰越利益剰余金 | 利益剰余金合計 | | | | |
| 当期首残高 | 3,981,245 | 13,241,738 | 72,415 | 20,455,322 | 282,685 | 20,738,008 |
| 当期変動額 | | | | | | |
| 剰余金の配当 | 3,446,341 | 3,446,341 | | 3,446,341 | | 3,446,341 |
| 当期純利益 | 3,722,880 | 3,722,880 | | 3,722,880 | | 3,722,880 |
| 自己株式の消却 | | | 72,415 | - | | - |
| 利益剰余金から資本剰余金への振替 | 72,415 | 72,415 | | - | | - |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | | | | - | 187,941 | 187,941 |
| 当期変動額合計 | 204,122 | 204,122 | 72,415 | 276,538 | 187,941 | 88,597 |
| 当期末残高 | 4,185,368 | 13,445,861 | - | 20,731,861 | 94,744 | 20,826,605 |

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 関連会社株式

総平均法による原価法

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算期末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、総平均法により算定）

時価のないもの

総平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法。但し、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）については定額法。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8～18年

構築物 20年

器具備品 2～20年

(2) 無形固定資産

定額法。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法により償却しております。

3．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

(2) 役員賞与引当金

役員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当事業年度対応分を計上しております。

(3) 外国税支払損失引当金

証券投資信託の中国株式投資に対する課税規定が明確化されたことに伴い、将来支払う可能性がある金額を見積もり、計上しております。

(4) 訴訟損失引当金

訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積もり、必要と認められる額を計上しております。

(5) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当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。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれの発生の翌事業年度末から費用処理しております。

（6）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

（7）執行役員退職慰労引当金

執行役員の退職慰労金の支払いに備えるため、規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

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、決算日の直物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．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（1）消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当事業年度の費用として処理しております。

（未適用の会計基準）

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

（1）概要

本適用指針は、主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について基本的にその内容を引き継いだ上で、一部見直しが行われたものです。

（2）適用予定日

当社は、当該適用指針を平成28年4月1日に開始する事業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

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

（追加情報）

当社は、DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ信託銀行株式会社及びみずほ投信投資顧問株式会社間での平成27年9月30日付統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日に、新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

- 1．商号 アセットマネジメントOne株式会社
- 2．代表者 西 恵正（現 DIAMアセットマネジメント株式会社 代表取締役社長）
- 3．本店所在地 東京都千代田区丸の内1-8-2
- 4．統合日 平成28年10月1日

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

| | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|-------|-----------------------|-----------------------|
| 未払手数料 | 777,631千円 | 570,839千円 |

2. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

| | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
| 有形固定資産の減価償却累計額 | 573,602千円 | 657,201千円 |

(損益計算書関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

| | 前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日) | 当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日) |
|-------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 支払手数料 | 9,189,399千円 | 8,452,937千円 |

2. 特別損失における合併関連費用の内訳は次のとおりであります。

| | 前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日) | 当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日) |
|------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 固定資産・敷金の償却 | -千円 | 140,257千円 |
| その他 | -千円 | 24,400千円 |
| 合計 | -千円 | 164,657千円 |

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

1.発行済株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|---------|-----------|----|----|-----------|
| 普通株式(株) | 1,823,250 | - | - | 1,823,250 |

2.自己株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|---------|---------|----|----|--------|
| 普通株式(株) | 9,386 | - | - | 9,386 |

3.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 |
|-----------------------|-------|------------|-------------|-------------|-------------|
| 平成26年12月24日 臨時株主総会 | 普通株式 | 2,539,409 | 1,400 | 平成26年11月26日 | 平成26年12月25日 |

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

1.発行済株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|---------|-----------|----|-------|-----------|
| 普通株式(株) | 1,823,250 | - | 9,386 | 1,813,864 |

(変動事由の概要)

自己株式の消却

2.自己株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|---------|---------|----|-------|--------|
| 普通株式(株) | 9,386 | - | 9,386 | - |

(変動事由の概要)

自己株式の消却

3.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 |
|---------------------|-------|------------|-------------|------------|-------------|
| 平成27年11月17日 取締役会 | 普通株式 | 3,446,341 | 1,900 | 平成27年12月8日 | 平成27年12月17日 |

（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、一時的な余資は有金利預金や有価証券などにより、通常取引条件から著しく乖離していないことを検証した上で行ってまいります。また現先取引などの引合いを要する取引については、原則として複数の提示条件を参考に最も有利と判断する条件で、適切かつ効率的に行っております。

なお、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の取得など、投資信託協会の規則に定める範囲において投資信託の取得及び処分を行っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

また営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産より受け入れる委託者報酬のうち、信託財産に未払委託者報酬として計上された金額であり、信託財産は受託銀行において分別管理されていることから、当社の債権としてのリスクは、認識しておりません。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（預金の預入先の信用リスク）の管理

預金の預入先については、資金管理規程に従い、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。

また経営企画部が定期的に格付けをモニタリングし、それが資金管理規程に定める基準以下となった場合には、速やかに経営会議を開催し、残存期間などを総合的に勘案し、対処方法について決議を得る体制となっております。

市場リスク（価格変動リスク及び為替変動リスク）の管理

保有している投資信託、株式の毎月末の時価など資金運用の状況については、資金管理規程に従い、経営企画部長が毎月の定例取締役会において報告をしております。

また市場における価格変動リスクおよび為替変動リスクについては、資金管理規程に従い、経営企画部が定期的に時価をモニタリングし、その中で時価が基準を超える下落となった場合には、速やかに経営会議を開催し、対処方法について決議を得る体制となっております。

流動性リスクの管理

資金繰りについては、資金運用スケジュールを作成し、それに基づいた管理を行っております。また手元流動性を一定額以上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ることがあります。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件などを採用することにより、当該価額が変動することもあります。

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）。

前事業年度（平成27年3月31日）

| | 貸借対照表計上額 （千円） | 時価 （千円） | 差額 （千円） |
|-----------------------------|------------------|------------|------------|
| (1) 現金及び預金 | 13,427,042 | 13,427,042 | - |
| (2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券 | 8,102,802 | 8,102,802 | - |
| (3) 未収委託者報酬 | 3,187,770 | 3,187,770 | - |

当事業年度（平成28年3月31日）

| | 貸借対照表計上額 （千円） | 時価 （千円） | 差額 （千円） |
|-----------------------------|------------------|------------|------------|
| (1) 現金及び預金 | 14,861,160 | 14,861,160 | - |
| (2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券 | 6,159,600 | 6,159,600 | - |
| (3) 未収委託者報酬 | 2,884,368 | 2,884,368 | - |

（注）1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金

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) 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。また譲渡性預金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。

(3) 未収委託者報酬

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。

（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（単位：千円）

| 区分 | 前事業年度 （平成27年3月31日） | 当事業年度 （平成28年3月31日） |
|-------|-----------------------|-----------------------|
| 非上場株式 | 276,151 | 276,151 |

これらについては、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ため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

(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

前事業年度(平成27年3月31日)

| | 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) 預金 | 13,426,934 | - | - | - |
| (2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券 | 3,200,000 | 2,060,328 | 1,537,061 | 63,735 |
| (3) 未収委託者報酬 | 3,187,770 | - | - | - |

当事業年度(平成28年3月31日)

| | 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) 預金 | 14,861,112 | - | - | - |
| (2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券 | 3,500,000 | 529,761 | 1,249,513 | 11,916 |
| (3) 未収委託者報酬 | 2,884,368 | - | - | - |

(有価証券関係)

1. 関連会社株式

関連会社株式(当事業年度の貸借対照表計上額 77,100千円、前事業年度の貸借対照表計上額 77,100千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

| | 種類 | 貸借対照表計上額 (千円) | 取得原価 (千円) | 差額 (千円) |
|----------------------|---------|------------------|--------------|------------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | (1)株式 | - | - | - |
| | (2)債券 | | | |
| | 国債・地方債等 | - | - | - |
| | 社債 | - | - | - |
| | その他 | - | - | - |
| | (3)その他 | 2,787,026 | 2,215,104 | 571,921 |
| | 小計 | 2,787,026 | 2,215,104 | 571,921 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | (1)株式 | - | - | - |
| | (2)債券 | | | |
| | 国債・地方債等 | - | - | - |
| | 社債 | - | - | - |
| | その他 | - | - | - |
| | (3)その他 | 5,315,776 | 5,470,388 | 154,612 |
| | 小計 | 5,315,776 | 5,470,388 | 154,612 |
| 合計 | | 8,102,802 | 7,685,493 | 417,309 |

(注)非上場株式(貸借対照表計上額199,051千円)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。

当事業年度(平成28年3月31日)

| | 種類 | 貸借対照表計上額 (千円) | 取得原価 (千円) | 差額 (千円) |
|----------------------|---------|------------------|--------------|------------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | (1)株式 | - | - | - |
| | (2)債券 | | | |
| | 国債・地方債等 | - | - | - |
| | 社債 | - | - | - |
| | その他 | - | - | - |
| | (3)その他 | 1,119,150 | 869,274 | 249,875 |
| | 小計 | 1,119,150 | 869,274 | 249,875 |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの | (1)株式 | - | - | - |
| | (2)債券 | | | |
| | 国債・地方債等 | - | - | - |
| | 社債 | - | - | - |
| | その他 | - | - | - |
| | (3)その他 | 5,040,450 | 5,153,936 | 113,485 |
| | 小計 | 5,040,450 | 5,153,936 | 113,485 |
| 合計 | | 6,159,600 | 6,023,210 | 136,389 |

(注)非上場株式(貸借対照表計上額199,051千円)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.売却したその他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

| | 売却額 (千円) | 売却益の合計額 (千円) | 売却損の合計額 (千円) |
|---------|-------------|-----------------|-----------------|
| (1)株式 | - | - | - |
| (2)債券 | | | |
| 国債・地方債等 | - | - | - |
| 社債 | - | - | - |
| その他 | - | - | - |
| (3)その他 | 503,565 | 68,179 | 54,613 |
| 合計 | 503,565 | 68,179 | 54,613 |

当事業年度(平成28年3月31日)

| | 売却額 (千円) | 売却益の合計額 (千円) | 売却損の合計額 (千円) |
|---------|-------------|-----------------|-----------------|
| (1)株式 | - | - | - |
| (2)債券 | | | |
| 国債・地方債等 | - | - | - |
| 社債 | - | - | - |
| その他 | - | - | - |
| (3)その他 | 2,209,763 | 225,965 | 60,150 |
| 合計 | 2,209,763 | 225,965 | 60,150 |

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について10,952千円(その他有価証券)減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について62,800千円(その他有価証券)減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合には全て減損処理を行い、30~50%程度下落した場合には、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

(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、確定給付企業年金制度(キャッシュバランス型)、確定拠出企業年金制度および退職一時金制度を設けております。

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

(単位:千円)

| | 前事業年度 | 当事業年度 |
|------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| | (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) | (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) |
| 退職給付債務の期首残高 | 1,424,739 | 1,348,083 |
| 会計方針の変更による累積的影響額 | 71,902 | - |
| 会計方針の変更を反映した期首残高 | 1,352,836 | 1,348,083 |
| 勤務費用 | 90,967 | 91,804 |
| 利息費用 | 9,476 | 6,074 |
| 数理計算上の差異の発生額 | 31,927 | 53,747 |
| 退職給付の支払額 | 73,269 | 60,817 |
| 過去勤務費用の発生額 | - | - |
| 退職給付債務の期末残高 | 1,348,083 | 1,438,892 |

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

| | 前事業年度 | 当事業年度 |
|--------------|-------------------------------|-------------------------------|
| | (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) | (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) |
| 年金資産の期首残高 | 1,157,054 | 1,329,170 |
| 期待運用収益 | 23,141 | 33,229 |
| 数理計算上の差異の発生額 | 108,961 | 128,633 |
| 事業主からの拠出額 | 78,464 | 77,164 |
| 退職給付の支払額 | 38,450 | 28,253 |
| 年金資産の期末残高 | 1,329,170 | 1,282,678 |

(3)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(単位：千円)

| | 前事業年度 | 当事業年度 |
|---------------------|--------------|--------------|
| | (平成27年3月31日) | (平成28年3月31日) |
| 積立型制度の退職給付債務 | 1,111,797 | 1,185,792 |
| 年金資産 | 1,329,170 | 1,282,678 |
| | 217,373 | 96,885 |
| 非積立型制度の退職給付債務 | 236,285 | 253,099 |
| 未積立退職給付債務 | 18,912 | 156,213 |
| 未認識数理計算上の差異 | 270,020 | 387,977 |
| 未認識過去勤務費用 | 10,703 | - |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 240,404 | 231,764 |
| 退職給付引当金 | 155,806 | 146,617 |
| 前払年金費用 | 396,211 | 378,381 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 240,404 | 231,764 |

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

| | 前事業年度 | 当事業年度 |
|-----------------|-------------------------------|-------------------------------|
| | (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) | (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) |
| 勤務費用(注1) | 119,135 | 124,139 |
| 利息費用 | 9,476 | 6,074 |
| 期待運用収益 | 23,141 | 33,229 |
| 数理計算上の差異の費用処理額 | 85,138 | 64,424 |
| 過去勤務費用の費用処理額 | 16,055 | 10,703 |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 174,553 | 150,705 |

(注) 1. 執行役員の退職慰労金に係る退職給付引当金繰入額(前事業年度28,168千円、当事業年度32,335千円)については「(1)勤務費用」に含めて記載しております。

(5)年金資産に関する事項

| | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|----------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 年金資産の主な内訳 | | |
| 年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。 | | |
| 株式 | 39.4% | 33.8% |
| 債券 | 27.3% | 27.3% |
| 共同運用資産 | 21.0% | 24.5% |
| 生命保険一般勘定 | 10.6% | 11.1% |
| 現金及び預金 | 1.4% | 3.2% |
| 合計 | 100% | 100% |

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

| | 前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日) | 当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日) |
|-----------|--|--|
| 割引率 | 0.0720% ~ 1.625% | 0.0120% ~ 0.8060% |
| 長期期待運用収益率 | 2.0% | 2.5% |
| 予想昇給率(平均) | 2.6% | 2.6% |

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17,347千円 当事業年度16,733千円であります。

(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

| | 前事業年度 (平成27年3月31日) | 当事業年度 (平成28年3月31日) |
|--------------|-----------------------|-----------------------|
| 繰延税金資産 | | |
| 賞与引当金 | 170,920千円 | 182,614千円 |
| 減価償却超過額 | 896 | 25,871 |
| 退職給付引当金 | 70,882 | 71,201 |
| 役員退職慰労引当金 | 12,688 | 14,799 |
| 投資有価証券評価損 | 15,033 | 19,229 |
| 非上場株式評価損 | 25,733 | 24,425 |
| 未払事業税 | 90,342 | 57,445 |
| 外国税支払損失引当金 | 60,867 | - |
| 訴訟損失引当金 | 9,918 | 12,344 |
| その他 | 87,621 | 120,305 |
| 繰延税金資産小計 | 544,905 | 528,236 |
| 評価性引当額 | - | - |
| 繰延税金資産合計 | 544,905 | 528,236 |
| 繰延税金負債 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 134,624 | 56,708 |
| 前払年金費用 | 127,817 | 115,860 |
| 繰延税金負債合計 | 262,442 | 172,568 |
| 繰延税金資産の純額 | 282,463 | 355,668 |

(注) 繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

| | | |
|-----------------|-----------|-----------|
| 流動資産 - 繰延税金資産 | 372,215千円 | 326,063千円 |
| 固定資産 - 長期繰延税金資産 | - | 29,604 |
| 固定負債 - 長期繰延税金負債 | 89,752 | - |

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。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来32.26%から、平成28年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異等については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等については30.62%となります。

その結果、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）が16,360千円減少し、その他有価証券評価差額金が1,963千円、法人税等調整額が18,324千円、それぞれ増加しております。

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)及び

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)及び

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの売上高の記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額は、貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

関連当事者情報

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る）等

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金（千円） | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（千円） | 科目 | 期末残高（千円） |
|-----|------------|---------|--------------|-----------|-----------------------------|-----------------------------|--------------------------------|-----------|-------|----------|
| 親会社 | みずほ証券株式会社 | 東京都千代田区 | 125,167,284 | 金融商品取引業 | (被所有) 直接77.05 間接 7.74 | 当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任 | 当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い | 9,189,399 | 未払手数料 | 777,631 |

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金（千円） | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額（千円） | 科目 | 期末残高（千円） |
|-----|------------|---------|--------------|-----------|-----------------------------|-----------------------------|--------------------------------|-----------|-------|----------|
| 親会社 | みずほ証券株式会社 | 東京都千代田区 | 125,167,284 | 金融商品取引業 | (被所有) 直接76.98 間接 7.73 | 当社設定の投資信託受益権の募集・販売 役員の兼任 | 当社設定の投資信託受益権の募集・販売に係る代行手数料の支払い | 8,452,937 | 未払手数料 | 570,839 |

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金(千円) | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(千円) | 科目 | 期末残高(千円) |
|-------------|----------------------|--------|--------------|-----------|-------------------|-----------|----------------|----------|---------|----------|
| 同一の親会社を持つ会社 | みずほ証券プロパティマネジメント株式会社 | 東京都中央区 | 4,110,000 | 不動産賃貸業 | 直接 4.05 | 事務所の賃借 | 事務所の賃借 | 175,210 | 長期差入保証金 | 116,378 |
| 同一の親会社を持つ会社 | 日本証券テクノロジー株式会社 | 東京都中央区 | 228,000 | 情報サービス業 | なし | 計算業務の委託 | 計算委託料支払 | 92,974 | その他未払金 | 8,479 |
| | | | | | | | ハウジングサービス料支払 | 16,824 | その他未払金 | 1,514 |
| | | | | | | | メールシステムサービス料支払 | 36,923 | その他未払金 | 3,323 |
| | | | | | | | IT関連業務支援 | 18,002 | その他未払金 | 1,736 |

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金又は出資金(千円) | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合(%) | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(千円) | 科目 | 期末残高(千円) |
|-------------|----------------------|--------|--------------|-----------|-------------------|-----------|----------------|----------|---------|----------|
| 同一の親会社を持つ会社 | みずほ証券プロパティマネジメント株式会社 | 東京都中央区 | 4,110,000 | 不動産賃貸業 | 直接 4.05 | 事務所の賃借 | 事務所の賃借 | 175,210 | 長期差入保証金 | 16,314 |
| 同一の親会社を持つ会社 | 日本証券テクノロジー株式会社 | 東京都中央区 | 228,000 | 情報サービス業 | なし | 計算業務の委託 | 計算委託料支払 | 96,300 | その他未払金 | 8,725 |
| | | | | | | | ハウジングサービス料支払 | 16,824 | その他未払金 | 1,514 |
| | | | | | | | メールシステムサービス料支払 | 36,923 | その他未払金 | 3,323 |
| | | | | | | | IT関連業務支援 | 18,163 | その他未払金 | 1,728 |

(注) 1. 上記(ア)~(イ)の金額のうち、取引金額と長期差入保証金の期末残高には消費税等が含まれておらず、未払手数料とその他未払金の期末残高には消費税等が含まれております。

(注) 2. 取引条件及び取引条件の決定方法等

- (1) 代行手数料については、投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から支払われます。委託者報酬の配分は両社協議のうえ合理的に決定しております。
- (2) 事務所の賃借料の支払については、差入保証金の総額及び近隣の賃借料を勘案し、協議のうえ決定しております。
なお、期末残高については、当事業年度より原状回復費100,064千円を差引いた金額になっております。
- (3) 計算委託料、ハウジングサービス料及びメールシステムサービス料の支払は、協議のうえ合理的に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

みずほ証券株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

| | 前事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日） | 当事業年度 （自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日） |
|--------------|---|---|
| 1株当たり純資産額 | 11,433円05銭 | 11,481円90銭 |
| 1株当たり当期純利益金額 | 1,976円56銭 | 2,052円45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、潜在株式が存在しないため記載していません。

（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。

| | 前事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日） | 当事業年度 （自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日） |
|--------------------|---|---|
| 当期純利益金額（千円） | 3,585,212 | 3,722,880 |
| 普通株主に帰属しない金額（千円） | - | - |
| 普通株式に係る当期純利益金額（千円） | 3,585,212 | 3,722,880 |
| 期中平均株式数（千株） | 1,813 | 1,813 |

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

| 当中間会計期間 (平成28年9月30日) | |
|-------------------------|------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 現金及び預金 | 7,314,360 |
| 有価証券 | 101,520 |
| 未収委託者報酬 | 3,004,856 |
| 未収運用受託報酬 | 74,687 |
| 繰延税金資産 | 281,201 |
| その他 | 334,195 |
| 流動資産合計 | 11,110,820 |
| 固定資産 | |
| 有形固定資産 | |
| 器具・備品(純額) | 31,241 |
| 建設仮勘定 | 3,819 |
| 有形固定資産合計 | 35,061 |
| 無形固定資産 | |
| ソフトウェア | 52,424 |
| ソフトウェア仮勘定 | 20,936 |
| その他 | 91 |
| 無形固定資産合計 | 73,452 |
| 投資その他の資産 | |
| 投資有価証券 | 2,589,863 |
| 長期繰延税金資産 | 22,056 |
| 前払年金費用 | 352,195 |
| その他 | 29,332 |
| 投資その他の資産合計 | 2,993,448 |
| 固定資産合計 | 3,101,961 |
| 資産合計 | 14,212,782 |

(単位：千円)

当中間会計期間
(平成28年9月30日)

| | |
|--------------|------------|
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | |
| 未払収益分配金 | 153 |
| 未払償還金 | 4,216 |
| 未払手数料 | 1,406,798 |
| その他未払金 | 284,198 |
| 未払金合計 | 1,695,367 |
| 未払費用 | 801,111 |
| 未払法人税等 | 850,492 |
| 未払消費税等 | 2 113,638 |
| 賞与引当金 | 382,000 |
| 訴訟損失引当金 | 70,000 |
| 流動負債合計 | 3,912,609 |
| 固定負債 | |
| 退職給付引当金 | 160,185 |
| 固定負債合計 | 160,185 |
| 負債合計 | 4,072,794 |
| 純資産の部 | |
| 株主資本 | |
| 資本金 | |
| 資本金 | 4,524,300 |
| 資本剰余金 | |
| 資本準備金 | 2,761,700 |
| 資本剰余金合計 | 2,761,700 |
| 利益剰余金 | |
| 利益準備金 | 360,493 |
| その他利益剰余金 | |
| 繰越利益剰余金 | 2,473,372 |
| 利益剰余金合計 | 2,833,866 |
| 株主資本合計 | 10,119,866 |
| 評価・換算差額等 | |
| その他有価証券評価差額金 | 20,122 |
| 評価・換算差額等合計 | 20,122 |
| 純資産合計 | 10,139,988 |
| 負債純資産合計 | 14,212,782 |

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

| | 当中間会計期間 | |
|--------------|---------------|------------|
| | (自 平成28年4月 1日 | |
| | 至 平成28年9月30日) | |
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | | 19,468,460 |
| 運用受託報酬 | | 95,090 |
| 営業収益合計 | | 19,563,551 |
| 営業費用及び一般管理費 | 1 | 16,721,767 |
| 営業利益 | | 2,841,783 |
| 営業外収益 | | |
| 受取配当金 | | 32,758 |
| 有価証券利息 | | 522 |
| 受取利息 | | 2,296 |
| 時効成立分配金・償還金 | | 10 |
| その他 | | 531 |
| 営業外収益合計 | | 36,119 |
| 営業外費用 | | |
| その他 | | 34 |
| 営業外費用合計 | | 34 |
| 経常利益 | | 2,877,868 |
| 特別利益 | | |
| 固定資産売却益 | | 1,354 |
| 投資有価証券売却益 | | 9,179 |
| 特別利益合計 | | 10,533 |
| 特別損失 | | |
| 固定資産売却損 | | 3,996 |
| 投資有価証券評価損 | | 58,055 |
| 固定資産除却損 | | 50 |
| 訴訟損失引当金繰入額 | | 30,000 |
| 合併関連費用 | | 11,926 |
| 特別損失合計 | | 104,028 |
| 税引前中間純利益 | | 2,784,373 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 795,495 |
| 法人税等調整額 | | 85,212 |
| 法人税等合計 | | 880,707 |
| 中間純利益 | | 1,903,666 |

(3)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年4月 1日 至 平成28年9月30日）

（単位：千円）

| | 株主資本 | | | | |
|---------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | 利益剰余金 | |
| | | 資本 準備金 | 利益 準備金 | その他利益剰余金 | |
| | | | | 別途 積立金 | 繰越 利益 剰余金 |
| 当期首残高 | 4,524,300 | 2,761,700 | 360,493 | 8,900,000 | 4,185,368 |
| 当中間期変動額 | | | | | |
| 別途積立金取崩 | | | | 8,900,000 | 8,900,000 |
| 剰余金の配当 | | | | | 12,515,661 |
| 中間純利益 | | | | | 1,903,666 |
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額） | | | | | |
| 当中間期変動額合計 | - | - | - | 8,900,000 | 1,711,995 |
| 当中間期末残高 | 4,524,300 | 2,761,700 | 360,493 | - | 2,473,372 |

| | 株主資本 | | 評価・換算差額等 | 純資産合計 |
|---------------------------|-----------------|----------------|------------------|------------|
| | 利益剰余金 | 株主 資本 合計 | その他有価証 券評価差額金 | |
| | 利益 剰余金 合計 | | | |
| 当期首残高 | 13,445,861 | 20,731,861 | 94,744 | 20,826,605 |
| 当中間期変動額 | | | | |
| 別途積立金取崩 | - | - | | - |
| 剰余金の配当 | 12,515,661 | 12,515,661 | | 12,515,661 |
| 中間純利益 | 1,903,666 | 1,903,666 | | 1,903,666 |
| 株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額） | | | 74,622 | 74,622 |
| 当中間期変動額合計 | 10,611,995 | 10,611,995 | 74,622 | 10,686,617 |
| 当中間期末残高 | 2,833,866 | 10,119,866 | 20,122 | 10,139,988 |

[注記事項]

（重要な会計方針）

1．資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

関連会社株式

総平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

当中間会計期間末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、総平均法により算定）

時価のないもの

総平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

器具備品

定率法

なお、主な耐用年数は2～20年であります。

(2) 無形固定資産

定額法。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法により償却しております。

3．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対する賞与の支払いに備えるため、支給見込額の当中間会計期間末日対応分を計上しております。

(2) 訴訟損失引当金

訴訟に対する損失に備えるため、将来発生する可能性のある金額を見積もり、必要と認められる額を計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末日において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により翌期から費用処理することとしております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっており、控除対象外消費税等は、当中間会計期間の費用として処理しております。

(中間貸借対照表関係)

1. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

| | 当中間会計期間 (平成28年9月30日) |
|----------------|-------------------------|
| 有形固定資産の減価償却累計額 | 498,091千円 |

2. 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

1. 減価償却実施額は、次のとおりであります。

| | 当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日) |
|--------|--|
| 有形固定資産 | 9,695千円 |
| 無形固定資産 | 9,425千円 |

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

1. 発行済株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当中間会計期間末 |
|---------|-----------|----|----|-----------|
| 普通株式(株) | 1,813,864 | - | - | 1,813,864 |

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 |
|--------------------|----------|------------|-------------|-----------|------------|
| 平成28年6月15日 取締役会 | 普通 株式 | 12,515,661 | 6,900 | 平成28年7月5日 | 平成28年7月27日 |

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの該当事項はありません。

（金融商品関係）

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、含まれておりません（（注）2．参照）。

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

| | 中間貸借対照表計上額 (千円) | 時価 (千円) | 差額 (千円) |
|----------------------------|--------------------|------------|------------|
| (1) 現金及び預金 | 7,314,360 | 7,314,360 | - |
| (2) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券 | 2,415,231 | 2,415,231 | - |
| (3) 未収委託者報酬 | 3,004,856 | 3,004,856 | - |
| (4) 未払手数料 | 1,406,798 | 1,406,798 | - |

（注）1．金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金及び預金

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) 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。

(3) 未収委託者報酬

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。

(4) 未払手数料

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

（注）2．時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

| 区分 | 中間貸借対照表計上額（千円） |
|-------|----------------|
| 非上場株式 | 276,151 |

これらについては、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ため、「(2) 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。

（有価証券関係）

当中間会計期間（平成28年9月30日）

1．関連会社株式

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 77,100千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

| | 種類 | 中間貸借対照表 計上額(千円) | 取得原価 (千円) | 差額 (千円) |
|----------------------------|------------------|--------------------|--------------|------------|
| 中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えるもの | (1)株式 | - | - | - |
| | (2)債券 国債・地方債等 | - | - | - |
| | 社債 | - | - | - |
| | その他 | - | - | - |
| | (3)その他 | 921,189 | 730,244 | 190,944 |
| | 小計 | 921,189 | 730,244 | 190,944 |
| 中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの | (1)株式 | - | - | - |
| | (2)債券 国債・地方債等 | - | - | - |
| | 社債 | - | - | - |
| | その他 | - | - | - |
| | (3)その他 | 1,494,041 | 1,656,021 | 161,979 |
| | 小計 | 1,494,041 | 1,656,021 | 161,979 |
| | 合計 | 2,415,231 | 2,386,265 | 28,965 |

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額199,051千円)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。

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

当中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益各項目の区分と同一であることから、製品及びサービスごとの売上高の記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額は、中間貸借対照表の有形固定資産の金額と同一であることから、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

当社が運用している投資信託は大半が公募投信であり、委託者報酬を最終的に負担する主要な受益者の情報は制度上、把握し得ないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額及び算定上の基礎並びに1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| 項目 | 当中間会計期間 (平成28年9月30日) |
|-------------------------------------|-------------------------|
| (1) 1株当たり純資産額 | 5,590円26銭 |
| (算定上の基礎) | |
| 純資産の部の合計額(千円) | 10,139,988 |
| 普通株式に係る中間期末の純資産額(千円) | 10,139,988 |
| 普通株式の発行済株式数(株) | 1,813,864 |
| 普通株式の自己株式数(株) | - |
| 1株当たり純資産の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株) | 1,813,864 |

| 項目 | 当中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28年9月30日) |
|--------------------|--|
| (2) 1株当たり中間純利益金額 | 1,049円50銭 |
| (算定上の基礎) | |
| 中間純利益金額(千円) | 1,903,666 |
| 普通株主に帰属しない金額(千円) | - |
| 普通株式に係る中間純利益金額(千円) | 1,903,666 |
| 普通株式の期中平均株式数(株) | 1,813,864 |

(注) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式は存在しないため、記載していません。

(追加情報)

役員賞与引当金

当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、当中間会計期間中の業績等を勘案し役員に対して賞与を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間末における役員賞与引当金20,525千円は「その他未払金」に振替えて表示しております。

役員退職慰労引当金

当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、みずほ投信投資顧問株式会社との間の吸収合併契約に従い、当会社が当該吸収合併により消滅する時をもって退任となる全取締役及び全監査役に対して、在任中の労に報いるため、当会社所定の基準による相当額の範囲で退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間において74,853千円を支給し、引当金全額の取崩しを行っております。

執行役員退職慰労引当金

当社は、平成28年9月14日開催の取締役会において、みずほ投信投資顧問株式会社との間の吸収合併契約に従い、当社が当該吸収合併により消滅する時をもって退任となる全執行役員に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲で退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当中間会計期間において101,916千円を支給し、引当金全額の取崩しを行っております。

繰延税金資産

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日)を当中間会計期間から適用しております。

(重要な後発事象)

当社(以下「新光投信」という)は、平成28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)、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」という)及びみずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」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、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 企業結合日
平成28年10月1日

2. 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。

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) 定款の変更等

平成28年9月7日付で、株式に関する事項等の定款の変更を行いました。

平成28年10月1日に、DIAMアセットマネジメント株式会社は、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)と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更しました。なお、当該統合に伴い、監査等委員会設置会社に移行しました。

(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

平成28年3月末日現在 247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

| 名 称 | 資本金の額 (単位:百万円) | 事 業 の 内 容 |
|--------------------|-------------------|----------------------------------|
| 株式会社みずほ銀行 | 1,404,065 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社千葉銀行 | 145,069 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社百五銀行 | 20,000 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社中国銀行 | 15,149 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 株式会社西日本シティ銀行 | 85,745 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |
| 第一生命保険株式会社 | (1) 60,000 | 日本において保険業務を営んでおります。 |
| 損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社 | 3,000 | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。 |

(注) 資本金の額は平成28年3月末日現在

(1) 平成28年10月1日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

- (1)目論見書の表紙等にロゴ・マークや図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載することがあります。また目論見書には「目論見書の使用開始日」、「委託会社の金融商品取引業者登録番号」、「金融商品取引法の規定に基づく目論見書である旨」、「投資信託の取引はクーリングオフ適用外である旨」、「請求目論見書の内容やその照会先と請求方法」、「信託財産の管理方法」、「投資信託運用による損益は全て投資家に帰属する旨」、「投資信託の元本は保証されていない旨」等を記載することがあります。
- (2)目論見書には有価証券届出書の第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の主要内容を要約し記載することがあります。第二部「ファンド情報」第1 ファンドの状況 5 運用状況 には、参考情報として 基準価額・純資産の推移 分配の推移 主要な資産の状況 年間収益率の推移等（ベンチマークを含む）を記載することがあります。（表示されるデータは適宜更新されま
- (3)請求目論見書の巻末に用語説明を掲載する場合があります。
なお、請求目論見書の巻末に信託約款を掲載し参照することで、有価証券届出書の内容の記載とすることがあります。
- (4)ファンドの特色やリスク等について投資者に開示すべき情報のあるファンドは、交付目論見書に「追加的記載事項」と明記して当該情報の内容等を有価証券届出書の記載に従い記載することがあります。
- (5)交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。
基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。
もしくは、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

独立監査人の監査報告書

平成28年5月31日

DIAMアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

| | | |
|--------------------|-------|---------|
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 山内 正彦 印 |
| 指定有限責任社員 業務執行社員 | 公認会計士 | 山野 浩 印 |

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているDIAMアセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第31期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DIAMアセットマネジメント株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成27年9月30日付の「統合基本合意書」に基づき、平成28年3月3日付で新会社に係わる一部主要事項を内定している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成29年3月23日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐々木 貴司 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>の平成28年2月9日から平成29年2月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M国内株式インデックスファンド<DC年金>の平成29年2月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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。

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、アセットマネジメントOne株式会社（旧社名：DIAMアセットマネジメント株式会社）は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社と統合した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

（注2）X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。