

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長
<b>【提出日】</b>	平成29年1月12日
<b>【発行者名】</b>	アセットマネジメントOne株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 西 惠正
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	上野 圭子
<b>【電話番号】</b>	03-6774-5100
<b>【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】</b>	D I A M国内株式パッシブ・ファンド
<b>【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】</b>	5,000億円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

D I A M国内株式パッシブ・ファンド

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

お申込日の基準価額 とします。

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

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

#### <基準価額の照会方法等>

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

す。  
当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

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

（当ファンドの略称：パ国内株）

( 5 ) 【申込手数料】

ありません。

( 6 ) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

( 7 ) 【申込期間】

継続申込期間：平成29年1月13日から平成30年1月12日まで

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

( 8 ) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

( 9 ) 【払込期日】

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

( 1 0 ) 【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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 )

( 1 1 ) 【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

( 1 2 ) 【その他】

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

## 振替受益権について

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

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

### （参考）

#### 投資信託振替制度

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

#### <ファンドの特色>

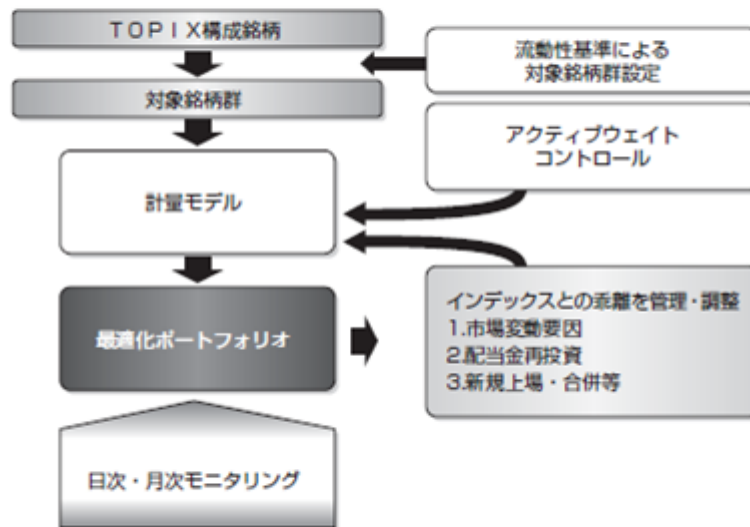
**① 主に「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」に投資を行い、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」\*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。**

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の指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「**株**東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及び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の指数値及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。D I A M国内株式パッシブ・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していますが、D I A M国内株式パッシブ・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。D I A M国内株式パッシブ・ファンド及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、D I A M国内株式パッシブ・ファンド及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、D I A M国内株式パッシブ・ファンド及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D I A M国内株式パッシブ・ファンド及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D I A M国内株式パッシブ・ファンド及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 原則として、マザーファンドの組入比率は高位を維持します。

### 分配方針

年1回の決算時(毎年10月12日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の利子配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。  
 ・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。  
 ・分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

### 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	特殊型
	内外	不動産投信	
		その他資産 ( )	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類定義

### 単位型投信・追加型投信

「追加型投信」とは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。

### 投資対象地域

「国内」とは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。

### 投資対象資産

「株式」とは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。

### 補足分類

「インデックス型」とは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

## 投資対象資産

「その他資産（投資信託証券（株式））」とは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。

## 決算頻度

「年1回」とは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。

## 投資対象地域

「日本」とは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。

## 投資形態

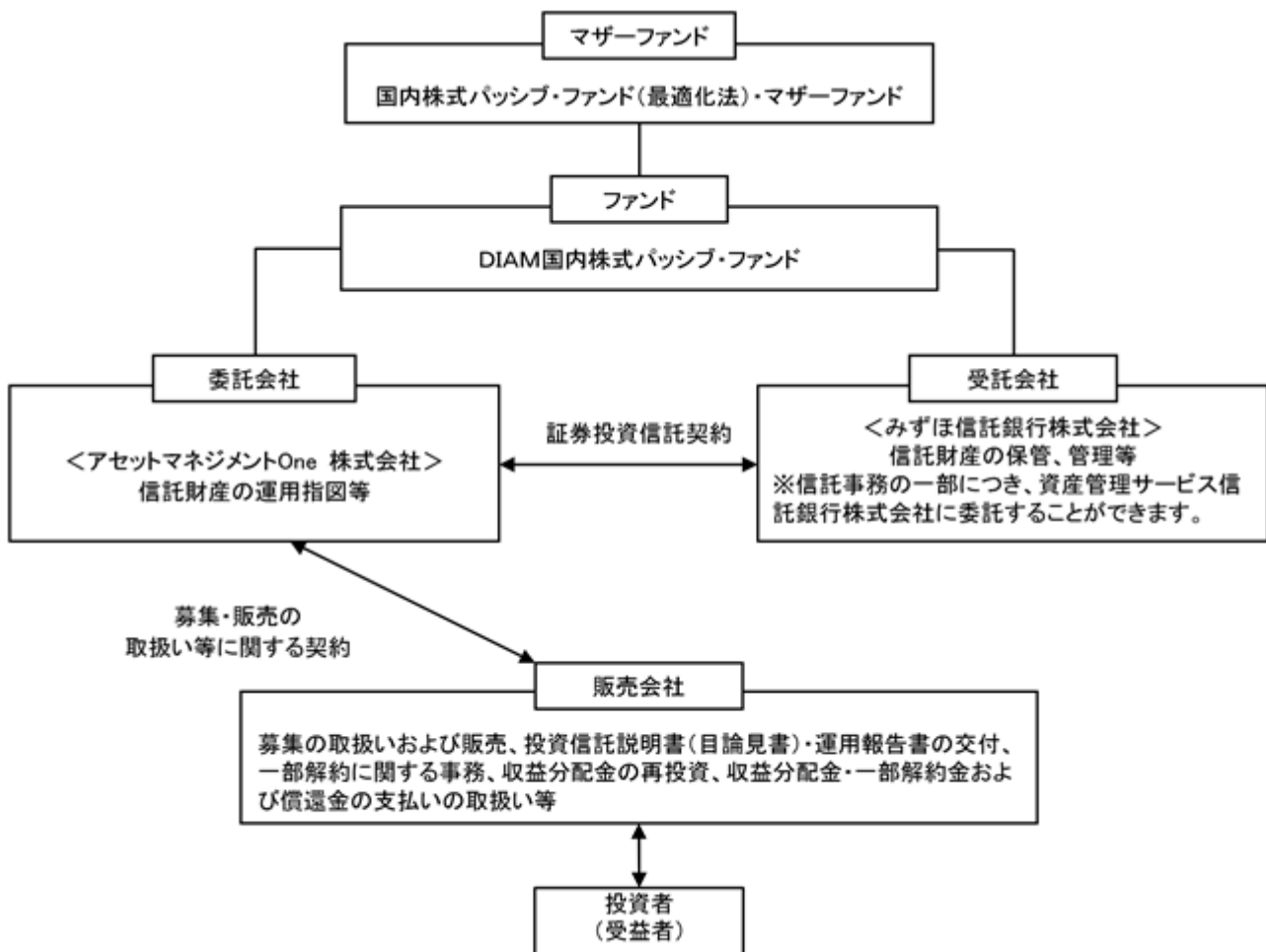
「ファミリーファンド」とは目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。

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21年1月30日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



・ 「証券投資信託契約」の概要

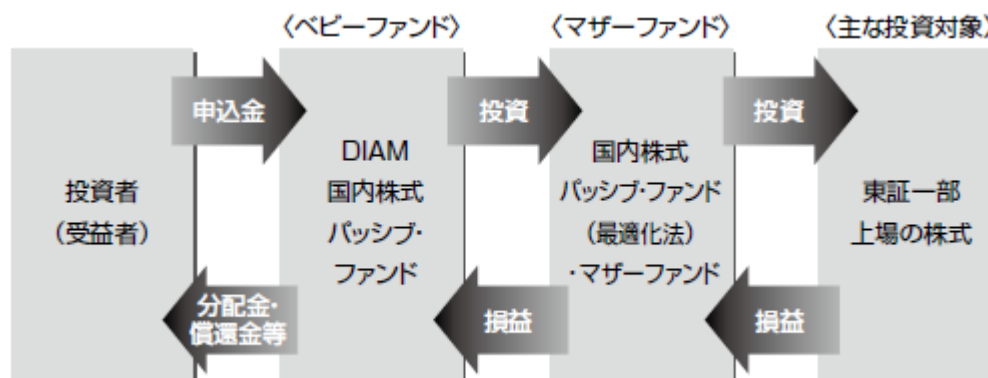
委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

ファミリーファンド方式とは

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



委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（平成28年10月31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28年10月31日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## &lt;基本方針&gt;

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

## &lt;投資対象&gt;

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

## &lt;投資態度&gt;

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

原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持します。

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

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

## (2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類（約款第15条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

## 2.次に掲げる特定資産以外の資産

## イ.為替手形

## 有価証券の指図範囲（約款第16条第1項）

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

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。）
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.～12.の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。）
15. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
16. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
17. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
18. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
21. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

## 23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、13.ならびに18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券および13.ならびに18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

## 金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

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

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

## (参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</li> <li>3. 株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li> <li>4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</li> <li>5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</li> </ol>
主な投資制限	1. 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28年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

### （4）【分配方針】

#### 収益分配方針

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

##### 1) 分配対象額の範囲

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

##### 2) 分配対象額についての分配方針

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場合があります。

##### 3) 留保益の運用方針

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

#### 収益の分配方式

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

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



- 2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、監査報酬および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
  - 3) 上記1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産に係る配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### 収益分配金の支払い

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

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

#### (5) 【投資制限】

- 1) マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。(約款「運用の基本方針」(3)投資制限)
- 2) 株式への実質投資割合には制限を設けません。(約款「運用の基本方針」(3)投資制限)
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。(約款「運用の基本方針」(3)投資制限)
- 4) 投資する株式等の範囲(約款第19条)
  - a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所等に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずるものとして市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
  - b. 上記a.の規定にかかわらず、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- 5) 信用取引の指図範囲(約款第20条)
  - a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡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.~6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.~6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
    1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
    2. 株式分割により取得する株券

3. 有償増資により取得する株券
  4. 売出しにより取得する株券
  5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。))の新株予約権に限ります。))の行使により取得可能な株券
  6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(5.に定めるものを除きます。))の行使により取得可能な株券
- 6) 先物取引等の運用指図(約款第21条)
- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。))および外国の取引所におけるわが国の有価証券にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。))。
  - b. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- 7) スワップ取引の運用指図(約款第22条)
- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。))を行うことの指図をすることができます。
  - b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
  - c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
  - d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

8) 金利先渡取引の運用指図（約款第23条）

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

9) デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第23条の2）

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

10) 有価証券の貸付の指図および範囲（約款第24条）

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

11) 資金の借入れ（約款第30条）

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入れ額は借入指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入れ額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- d. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

## 12) 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会社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>

当ファンドの基準価額は、ファンドに組入れられる有価証券の値動き等により影響を受けますが、運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、下記の変動要因により基準価額が下落し、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。

基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。

### (1) 株価変動リスク

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

### (2) 信用リスク

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。

### <分配金に関する留意点>

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。

<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。

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

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

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

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

当ファンドは、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、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された場合、その他やむを得ない事情がある場合、当初定められていた信託期間の途中で信託を終了(繰上償還)する場合があります。

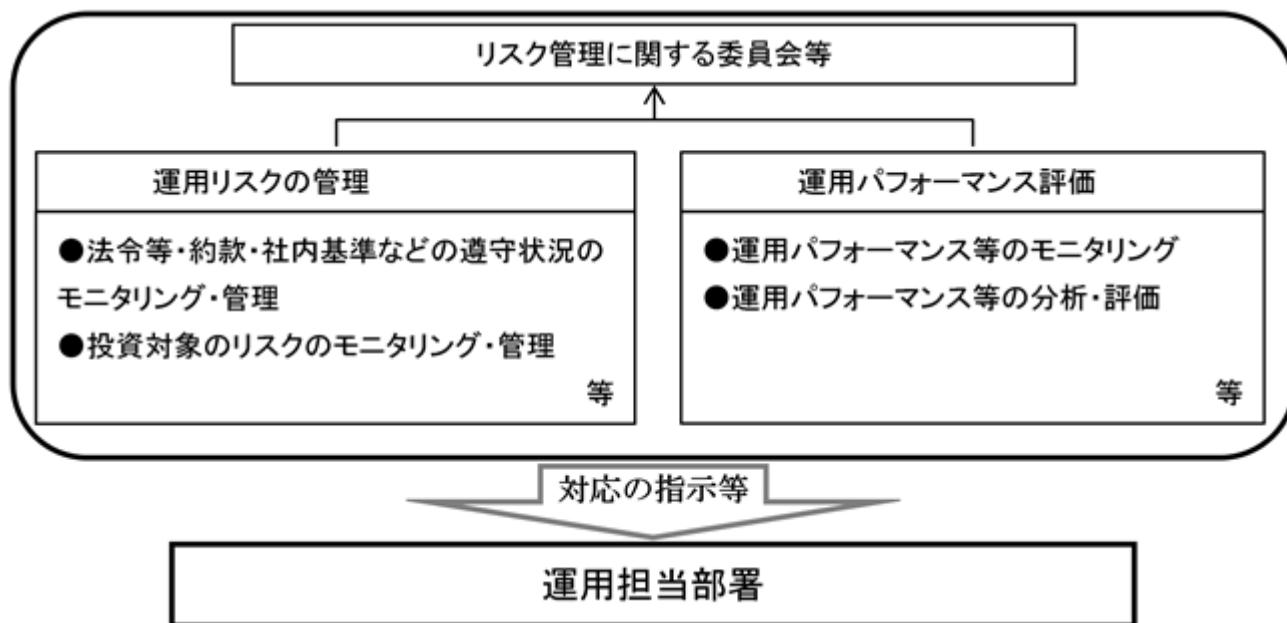
注意事項

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

< リスク管理体制 >

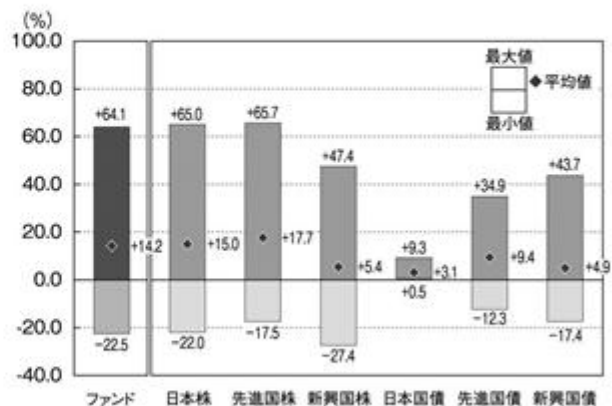
委託会社における当ファンドの投資リスクに対する管理体制については、以下の通りです。

- ・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28年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## (参考情報)

ファンドの年間騰落率及び  
分配金再投資基準価額の推移ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較

2011年11月～2016年10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(円ベース、配当込み)

新興国株……MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円ベース、配当込み)

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・ディバーシファイド(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、円ベースの指数を採用しています。

●「東証株価指数(TOPIX)」は、株式会社東京証券取引所(兼東京証券取引所)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、株式会社東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株式会社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なく、株式会社東京証券取引所は、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、責任を有しません。

●「MSCIコクサイ・インデックス」「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当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.に属しており、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公表している指数で、その知的財産権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、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

●「シティ世界国債インデックス」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・ディバーシファイド」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・エルエルシーに帰属します。

## 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0.648%（税抜0.60%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.55%	委託した資金の運用の対価
販売会社	年率0.02%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## (4)【その他の手数料等】

## 1. 信託財産留保額

ありません。

## 2. その他の費用

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

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

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

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。



## （５）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

### 個人の受益者に対する課税

#### 収益分配時

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

なお、配当控除の適用はありません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 換金（解約）時および償還時

換金（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。

特定口座（源泉徴収選択口座）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係る消費税等相当額を含みます。）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

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、一定の条件のもとで確定申告等により上場株式等の配当所得ならびに特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得等および譲渡所得等との通算が可能です。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

### 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換金（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。

上記は、平成28年10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相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

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

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

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

### < 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等には、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28年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	3,564,047,455	100.02
内 日本	3,564,047,455	100.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	634,681	0.02
純資産総額	3,563,412,774	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28年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	276,746,604,070	96.17
内 日本	276,746,604,070	96.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	11,007,958,697	3.83
純資産総額	287,754,562,767	100.00

## その他資産の投資状況

平成28年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	10,950,750,000	3.81
内 日本	10,950,750,000	3.81

(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28年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	1,732,138,149	1.9840 3,436,696,734	2.0576 3,564,047,455	- -	100.02%

(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28年10月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	100.02%
合計	100.02%

(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28年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,692,400	6,489.85 10,983,432,771	6,079.00 10,288,099,600	- -	3.58%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	10,177,000	534.86 5,443,324,724	544.60 5,542,394,200	- -	1.93%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,078,100	5,258.96 5,669,685,958	4,660.00 5,023,946,000	- -	1.75%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	659,500	5,150.50 3,396,756,184	6,602.00 4,354,019,000	- -	1.51%
5	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,328,800	3,195.64 4,246,372,329	3,192.00 4,241,529,600	- -	1.47%
6	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,075,400	3,397.39 3,653,558,049	3,653.00 3,928,436,200	- -	1.37%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,224,700	3,106.46 3,804,491,892	3,144.00 3,850,456,800	- -	1.34%
8	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	845,100	4,635.42 3,917,393,634	3,994.00 3,375,329,400	- -	1.17%
9	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	18,234,000	180.08 3,283,747,000	177.10 3,229,241,400	- -	1.12%

10	ソニー 日本	株式 電気機器	960,500	2,584.05 2,481,988,031	3,361.00 3,228,240,500	- -	1.12%
11	ファナック 日本	株式 電気機器	138,000	16,400.39 2,263,254,022	19,680.00 2,715,840,000	- -	0.94%
12	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	1,003,700	2,834.82 2,845,318,040	2,640.50 2,650,269,850	- -	0.92%
13	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	534,300	5,780.65 3,088,602,985	4,700.00 2,511,210,000	- -	0.87%
14	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	561,800	5,108.70 2,870,071,574	4,383.00 2,462,369,400	- -	0.86%
15	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	263,200	10,712.34 2,819,490,408	9,257.00 2,436,442,400	- -	0.85%
16	キーエンス 日本	株式 電気機器	30,800	58,581.30 1,804,304,306	77,060.00 2,373,448,000	- -	0.82%
17	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,007,800	1,871.62 1,886,218,703	2,291.00 2,308,869,800	- -	0.80%
18	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,456,000	1,658.53 2,414,825,911	1,559.50 2,270,632,000	- -	0.79%
19	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	544,100	3,927.24 2,136,816,532	4,149.00 2,257,470,900	- -	0.78%
20	キヤノン 日本	株式 電気機器	732,600	3,349.96 2,454,185,308	3,017.00 2,210,254,200	- -	0.77%
21	任天堂 日本	株式 その他製品	83,800	17,229.54 1,443,836,116	25,440.00 2,131,872,000	- -	0.74%
22	村田製作所 日本	株式 電気機器	142,800	13,863.72 1,979,739,230	14,670.00 2,094,876,000	- -	0.73%
23	三菱地所 日本	株式 不動産業	999,000	2,236.36 2,234,128,800	2,081.50 2,079,418,500	- -	0.72%
24	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,451,600	1,146.05 1,663,606,704	1,422.50 2,064,901,000	- -	0.72%
25	信越化学工業 日本	株式 化学	255,600	5,982.11 1,529,027,742	7,971.00 2,037,387,600	- -	0.71%
26	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	113,100	22,228.54 2,514,048,526	17,865.00 2,020,531,500	- -	0.70%
27	花王 日本	株式 化学	362,100	6,189.12 2,241,083,500	5,405.00 1,957,150,500	- -	0.68%
28	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	481,000	4,104.80 1,974,409,060	3,915.00 1,883,115,000	- -	0.65%
29	ダイキン工業 日本	株式 機械	185,800	7,741.00 1,438,278,640	10,080.00 1,872,864,000	- -	0.65%
30	日立製作所 日本	株式 電気機器	3,267,000	492.56 1,609,212,800	559.20 1,826,906,400	- -	0.63%

(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28年10月31日現在

種類	投資比率
株式	96.17%
合計	96.17%

（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28年10月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.16%
輸送用機器		9.24%
情報・通信業		7.85%
銀行業		7.33%
化学		6.27%
医薬品		4.89%
機械		4.81%
小売業		4.69%
食料品		4.66%
卸売業		4.20%
陸運業		4.04%
サービス業		3.67%
建設業		2.98%
不動産業		2.49%
保険業		2.32%
その他製品		1.86%
電気・ガス業		1.78%
精密機器		1.48%
その他金融業		1.26%
鉄鋼		1.11%
証券、商品先物取引業		1.04%
ゴム製品		0.90%
ガラス・土石製品		0.88%
非鉄金属		0.86%
繊維製品		0.71%
金属製品		0.67%
空運業		0.52%
石油・石炭製品		0.45%
鋳業		0.32%
パルプ・紙		0.24%
海運業		0.22%
倉庫・運輸関連業	0.19%	
水産・農林業	0.11%	
合計	96.17%	

（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28年10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 2812月	買建	785	10,662,306,940	10,950,750,000	3.81%

(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28年10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1計算期間末 (平成21年10月13日)	408	408	1.1504	1.1504
第2計算期間末 (平成22年10月12日)	974	974	1.0661	1.0661
第3計算期間末 (平成23年10月12日)	1,130	1,130	0.9904	0.9904
第4計算期間末 (平成24年10月12日)	1,188	1,188	0.9615	0.9615
第5計算期間末 (平成25年10月15日)	1,832	1,832	1.6235	1.6235
第6計算期間末 (平成26年10月14日)	2,347	2,347	1.6680	1.6680
第7計算期間末 (平成27年10月13日)	3,717	3,717	2.0908	2.0908
第8計算期間末 (平成28年10月12日)	3,124	3,124	1.8950	1.8950
平成27年10月末日	3,847	-	2.1670	-
11月末日	3,152	-	2.1967	-
12月末日	3,135	-	2.1522	-
平成28年1月末日	3,742	-	1.9911	-
2月末日	3,184	-	1.8030	-
3月末日	3,382	-	1.8889	-
4月末日	3,267	-	1.8780	-
5月末日	3,371	-	1.9328	-
6月末日	3,654	-	1.7466	-
7月末日	2,935	-	1.8539	-
8月末日	2,984	-	1.8629	-
9月末日	3,043	-	1.8677	-
10月末日	3,563	-	1.9660	-



## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	15.0
第2計算期間	7.3
第3計算期間	7.1
第4計算期間	2.9
第5計算期間	68.9
第6計算期間	2.7
第7計算期間	25.3
第8計算期間	9.4

(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。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円(1万口当たり)を用いております。

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1計算期間	360,818,552	5,842,198
第2計算期間	1,096,784,678	537,244,271
第3計算期間	530,173,605	303,610,533
第4計算期間	330,350,174	235,209,696
第5計算期間	548,351,616	655,828,394
第6計算期間	796,957,698	518,389,663
第7計算期間	1,112,887,322	742,283,812
第8計算期間	1,141,968,717	1,270,849,953

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

## 参考情報

データの基準日:2016年10月31日

## 基準価額・純資産の推移

《設定日(2009年1月30日)~2016年10月31日》



※基準価額(分配全再投資)は、設定当初の投資元本10,000円に設定来の税引前分配金を再投資したものと計算しておりますので、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2009年1月30日)  
 ※基準価額は信託報酬控除後です。

## 分配の推移(税引前)

第4期(2012.10.12)	0円
第5期(2013.10.15)	0円
第6期(2014.10.14)	0円
第7期(2015.10.13)	0円
第8期(2016.10.12)	0円
設定来累計	0円

(注)分配金は1万円当たりです。

## 主要な資産の状況

■組入銘柄一覧 (注)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	国内株式バッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	100.02%

## ■国内株式バッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

(注)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	96.17
内 日本	96.17
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.83
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)	3.81

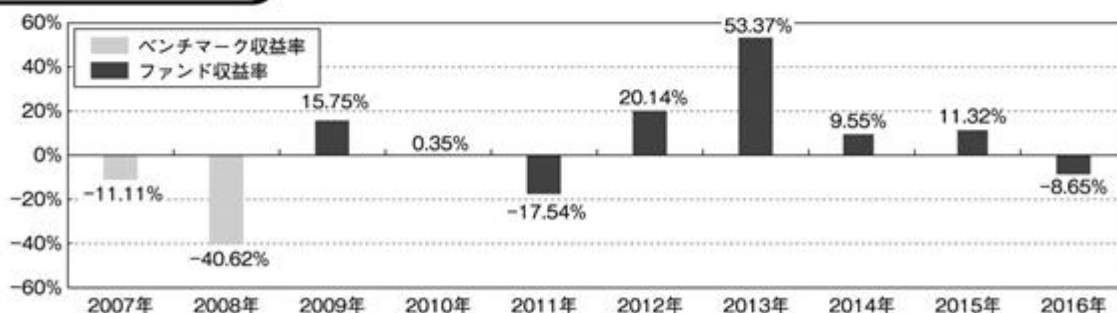
## 組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	12.16%
2	輸送用機器	9.24%
3	情報・通信業	7.85%
4	銀行業	7.33%
5	化学	6.27%

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	発行体の国/地域	業種	投資比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.58%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.93%
3	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.75%
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.51%
5	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.47%
6	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.37%
7	本田技研工業	株式	日本	輸送用機器	1.34%
8	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	1.17%
9	みずほフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.12%
10	ソニー	株式	日本	電気機器	1.12%

## 年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2009年は設定日から年末までの収益率、および2016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。

※2008年以前は、ベンチマークの収益率を暦年ベースで表示しています。当ファンドのベンチマークは「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」です。

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

○当該ベンチマークの情報はあくまでも参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

○委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

- ・お申込価額

お申込日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

・ お申込手数料

ありません。

・ 払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

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

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

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

#### ・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

#### ・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

#### ・解約代金の受渡日

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

資産	評価方法
マザーファンド	計算日における基準価額で評価します。
国内株式	原則として金融商品取引所等における計算日の最終相場で評価します。

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

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21年1月30日から原則として無期限です。ただし、下記「(5)その他 イ.償還規定」の場合には信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

イ.償還規定

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

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

#### ロ. 信託約款の変更等

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



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

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1)収益分配金受領権

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

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

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

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

### (2)償還金受領権

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、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として償還日（休業日の場合は翌営業日。）から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

### (3)一部解約請求権

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

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

なお、解約の請求を受益者がするときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

### (4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
- なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(平成27年10月14日から平成28年10月12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国内株式パッシブ・ファンド

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第7期 平成27年10月13日現在	第8期 平成28年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	12,034,479	13,463,761
親投資信託受益証券	3,716,423,397	3,123,498,488
未収入金	-	1,000,000
流動資産合計	3,728,457,876	3,137,962,249
資産合計	3,728,457,876	3,137,962,249
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	271,801	2,745,181
未払受託者報酬	544,638	509,858
未払委託者報酬	10,348,810	9,687,897
その他未払費用	86,160	33,898
流動負債合計	11,251,409	12,976,834
負債合計	11,251,409	12,976,834
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,777,915,078	1,649,033,842
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,939,291,389	1,475,951,573
(分配準備積立金)	644,479,674	358,174,396
元本等合計	3,717,206,467	3,124,985,415
純資産合計	3,717,206,467	3,124,985,415
負債純資産合計	3,728,457,876	3,137,962,249

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期		第8期	
	自	平成26年10月15日 平成27年10月13日	自	平成27年10月14日 平成28年10月12日
<b>営業収益</b>				
受取利息		3,429		1,449
有価証券売買等損益		708,450,725		309,354,909
営業収益合計		708,454,154		309,353,460
<b>営業費用</b>				
支払利息		-		7,745
受託者報酬		1,037,355		1,051,679
委託者報酬		19,711,189		19,983,496
その他費用		164,097		116,238
営業費用合計		20,912,641		21,159,158
営業利益又は営業損失（ ）		687,541,513		330,512,618
経常利益又は経常損失（ ）		687,541,513		330,512,618
当期純利益又は当期純損失（ ）		687,541,513		330,512,618
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（ ）		266,630,564		186,264,626
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		940,091,722		1,939,291,389
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,117,012,393		994,713,748
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,117,012,393		994,713,748
剰余金減少額又は欠損金増加額		538,723,675		1,313,805,572
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		538,723,675		1,313,805,572
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,939,291,389		1,475,951,573

## (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10月12日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成27年10月13日としております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第7期 平成27年10月13日現在	第8期 平成28年10月12日現在
1. 1 期首元本額	1,407,311,568円	1,777,915,078円
期中追加設定元本額	1,112,887,322円	1,141,968,717円
期中一部解約元本額	742,283,812円	1,270,849,953円
2. 受益権の総数	1,777,915,078口	1,649,033,842口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第7期 自 平成26年10月15日 至 平成27年10月13日	第8期 自 平成27年10月14日 至 平成28年10月12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(59,331,552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(361,579,397円)、信託約款に規定される収益調整金(1,294,811,715円)及び分配準備積立金(223,568,725円)より分配対象収益は1,939,291,389円(1万口当たり10,907.67円)であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(46,381,649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(1,117,777,177円)及び分配準備積立金(311,792,747円)より分配対象収益は1,475,951,573円(1万口当たり8,950.40円)であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第7期	第8期
	自 平成26年10月15日 至 平成27年10月13日	自 平成27年10月14日 至 平成28年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、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7期 平成27年10月13日現在	第8期 平成28年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左



(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第7期 平成27年10月13日現在	第8期 平成28年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	448,155,421	141,003,731
合計	448,155,421	141,003,731

(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7期 平成27年10月13日現在	第8期 平成28年10月12日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0908円 (20,908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28年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド(最適化 法)・マザーファンド	1,575,376,249	3,123,498,488	
親投資信託受益証券	合計	1,575,376,249	3,123,498,488	
合計		1,575,376,249	3,123,498,488	

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27年10月13日現在	平成28年10月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		15,699,526,390	5,889,323,978
株式	2	298,006,771,240	274,144,773,250
派生商品評価勘定		912,484,328	90,428,948
未収入金		270,897	4,319,728
未収配当金		2,254,145,788	2,350,262,725
流動資産合計		316,873,198,643	282,479,108,629
資産合計		316,873,198,643	282,479,108,629
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,777,864	182,916
前受金		1,048,336,000	136,187,200
未払解約金		95,077,000	828,535,000
流動負債合計		1,145,190,864	964,905,116
負債合計		1,145,190,864	964,905,116
純資産の部			
元本等			
元本	1	145,322,675,861	141,984,682,751
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		170,405,331,918	139,529,520,762
元本等合計		315,728,007,779	281,514,203,513
純資産合計		315,728,007,779	281,514,203,513
負債純資産合計		316,873,198,643	282,479,108,629

## 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27年10月13日現在	平成28年10月12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	172,419,018,706円	145,322,675,861円
同期中追加設定元本額	31,584,585,842円	41,084,076,109円
同期中一部解約元本額	58,680,928,687円	44,422,069,219円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	4,904,881,467円	6,549,280,589円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	1,710,587,958円	1,575,376,249円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	- 円	5,822,033円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	- 円	12,618,708円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	- 円	25,144,181円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	- 円	13,903,705円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	- 円	11,101,393円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	- 円	12,262,597円
D I A M国内株式インデックスファンド< D C年金>	37,051,819,937円	39,026,844,057円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	764,634,018円	892,175,848円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,684,633,915円	3,085,053,451円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,872,820,592円	3,110,638,487円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	373,358,353円	406,578,514円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,245,398,675円	1,299,706,406円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,086,857,834円	1,135,404,057円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	62,619,404円	63,391,188円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,203,210,489円	1,361,434,988円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	27,396,594円	29,855,862円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	23,756,350円	34,618,530円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	45,682,466円	70,908,730円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	101,283,311円	134,667,581円
投資のソムリエ	1,020,790,717円	1,532,512,647円
クルーズコントロール	155,459,929円	1,361,224,064円
投資のソムリエ<DC年金>	16,812,882円	42,045,295円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	61,807,655円	111,572,421円
DIAM DC バランス・F(成長型)	31,375,738円	107,729,591円
クルーズコントロール<DC年金>	49,425円	435,072円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	9,172,876円	16,553,351円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	21,543,025円	41,655,765円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	- 円	13,516,086円
ダイナミック・ナビゲーション	- 円	2,259,439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)	207,698,063円	249,214,122円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	118,114,707円	108,351,515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)	926,465,668円	256,516,116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)	504,047,033円	448,843,778円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	45,923,119円	32,496,190円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	188,212,246円	138,048,923円

D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	46,957,650円	35,339,487円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	68,517,010円	44,104,951円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	6,574,581,132円	2,613,101,420円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,491,550,675円	921,644,988円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,353,033,392円	1,759,630,851円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,672,753,796円	1,488,934,009円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,338,155,069円	3,941,172,402円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	338,073,544円	332,873,979円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	907,582,858円	731,561,485円
D I A M アクサ グローバルバランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,044,848,687円	937,888,973円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	4,367,379,494円	3,833,571,575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)	41,880,337円	51,147,517円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,418,624,773円	1,360,969,610円
D I A M世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	5,591,983,651円	5,436,117,474円
D I A Mグローバル分散ファンドVA(適格機関投資家限定)	3,307,217円	- 円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	21,654,420,117円	21,190,612,731円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	846,229,797円	778,556,088円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,502,748,523円	2,431,224,796円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	13,786,277,812円	13,422,317,174円
D I A Mバランス30VA(適格機関投資家限定)	35,673円	7,865,270円
D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	16,727,956円	3,381,053円

	D I A Mバランス70VA(適格 機関投資家限定)	6,456,080円	1,215,517円
	D I A M世界アセットバランス ファンド4VA(適格機関投資家 限定)	12,371,832,331円	12,044,427,017円
	D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	118,620,812円	109,073,229円
	D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	43,123,009円	38,767,272円
	D I A Mバランス20VA(適格 機関投資家限定)	25,728,391円	43,596,204円
	D I A Mバランス40VA(適格 機関投資家限定)	42,787,484円	81,496円
	D I A Mバランス60VA(適格 機関投資家限定)	120,989円	128,550円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1212)(適 格機関投資家限定)	709,042,970円	693,705,071円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1303)(適 格機関投資家限定)	1,887,540,594円	1,859,845,103円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1306)(適 格機関投資家限定)	2,485,634,300円	2,451,073,369円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1309)(適 格機関投資家限定)	99,705,292円	100,992,561円
	計	145,322,675,861円	141,984,682,751円
2.	受益権の総数	145,322,675,861口	141,984,682,751口
3.	2 差入代用有価証券	株式 3,658,000,000円	株式 2,978,500,000円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成26年10月15日 至 平成27年10月13日	自 平成27年10月14日 至 平成28年10月12日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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27年10月13日現在	平成28年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成27年10月13日現在	平成28年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	15,187,364,441	6,416,796,421
合計	15,187,364,441	6,416,796,421

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成27年2月10日から平成27年10月13日まで及び平成28年2月9日から平成28年10月12日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	平成27年10月13日 現在				平成28年10月12日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	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	18,086,804,000	-	18,997,920,000	911,116,000	7,070,301,600	-	7,160,720,000	90,418,400
合計	18,086,804,000	-	18,997,920,000	911,116,000	7,070,301,600	-	7,160,720,000	90,418,400

(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27年10月13日現在	平成28年10月12日現在
1口当たり純資産額	2.1726円	1.9827円
(1万口当たり純資産額)	(21,726円)	(19,827円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成28年10月12日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	6,600	2,712.00	17,899,200	
日本水産	197,800	444.00	87,823,200	
マルハニチロ	31,600	2,712.00	85,699,200	
ハウスイ	12,000	108.00	1,296,000	
カネコ種苗	5,400	1,466.00	7,916,400	
サカタのタネ	22,900	2,900.00	66,410,000	
ホクト	15,800	1,856.00	29,324,800	
ホクリヨウ	1,800	793.00	1,427,400	
ショーボンドホールディングス	16,200	4,855.00	78,651,000	
ミライト・ホールディングス	47,600	878.00	41,792,800	
タマホーム	11,800	523.00	6,171,400	
サンヨーホームズ	3,400	517.00	1,757,800	
住石ホールディングス	46,300	87.00	4,028,100	
日鉄鉱業	4,300	3,945.00	16,963,500	
三井松島産業	10,100	1,165.00	11,766,500	
国際石油開発帝石	814,900	992.20	808,543,780	
日本海洋掘削	4,600	2,431.00	11,182,600	
石油資源開発	24,500	2,527.00	61,911,500	
K&Oエナジーグループ	10,400	1,453.00	15,111,200	
ダイセキ環境ソリューション	3,700	1,385.00	5,124,500	
安藤・間	103,300	599.00	61,876,700	
東急建設	50,300	999.00	50,249,700	
コムシスホールディングス	66,500	1,774.00	117,971,000	
ミサワホーム	18,200	760.00	13,832,000	
ピーアールホールディングス	13,200	222.00	2,930,400	
高松コンストラクショングループ	11,700	2,368.00	27,705,600	
東建コーポレーション	6,400	7,410.00	47,424,000	
ヤマウラ	7,700	515.00	3,965,500	
大成建設	803,000	763.00	612,689,000	
大林組	464,000	985.00	457,040,000	
清水建設	473,000	895.00	423,335,000	
飛島建設	124,400	175.00	21,770,000	
長谷工コーポレーション	180,500	942.00	170,031,000	
松井建設	17,100	1,160.00	19,836,000	
銭高組	22,000	345.00	7,590,000	
鹿島建設	725,000	702.00	508,950,000	
不動テトラ	109,800	181.00	19,873,800	
大末建設	6,100	842.00	5,136,200	
鉄建建設	94,000	319.00	29,986,000	
西松建設	179,000	460.00	82,340,000	
三井住友建設	592,300	94.00	55,676,200	
大豊建設	60,000	557.00	33,420,000	
前田建設工業	95,000	860.00	81,700,000	

佐田建設	11,100	387.00	4,295,700
ナカノフドー建設	12,200	399.00	4,867,800
奥村組	147,000	565.00	83,055,000
東鉄工業	18,600	2,823.00	52,507,800
イチケン	17,000	299.00	5,083,000
浅沼組	50,000	220.00	11,000,000
戸田建設	180,000	543.00	97,740,000
熊谷組	226,000	259.00	58,534,000
青木あすなる建設	10,400	675.00	7,020,000
北野建設	33,000	262.00	8,646,000
植木組	19,000	214.00	4,066,000
三井ホーム	20,000	464.00	9,280,000
矢作建設工業	21,100	921.00	19,433,100
ピーエス三菱	18,500	351.00	6,493,500
日本ハウスホールディングス	31,600	433.00	13,682,800
大東建託	56,900	15,900.00	904,710,000
新日本建設	18,500	913.00	16,890,500
N I P P O	36,000	1,960.00	70,560,000
東亜道路工業	30,000	256.00	7,680,000
前田道路	48,000	1,810.00	86,880,000
日本道路	46,000	403.00	18,538,000
東亜建設工業	13,500	1,905.00	25,717,500
若築建設	91,000	145.00	13,195,000
東洋建設	48,800	423.00	20,642,400
五洋建設	171,800	596.00	102,392,800
大林道路	18,200	629.00	11,447,800
世紀東急工業	24,400	488.00	11,907,200
福田組	25,000	1,114.00	27,850,000
日本ドライケミカル	1,900	2,269.00	4,311,100
住友林業	106,400	1,359.00	144,597,600
日本基礎技術	17,800	334.00	5,945,200
日成ビルド工業	43,000	500.00	21,500,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	80,000	72.00	5,760,000
巴コーポレーション	19,800	330.00	6,534,000
パナホーム	58,000	786.00	45,588,000
大和ハウス工業	457,000	2,657.50	1,214,477,500
ライト工業	29,800	1,206.00	35,938,800
積水ハウス	517,200	1,623.50	839,674,200
日特建設	17,300	459.00	7,940,700
北陸電気工事	7,600	695.00	5,282,000
ユアテック	25,000	583.00	14,575,000
西部電気工業	2,400	2,000.00	4,800,000
四電工	6,000	391.00	2,346,000
中電工	22,400	2,080.00	46,592,000
関電工	62,000	945.00	58,590,000
きんでん	93,600	1,207.00	112,975,200
東京エネシス	18,000	1,031.00	18,558,000
トーエネック	22,000	510.00	11,220,000
住友電設	12,300	1,115.00	13,714,500
日本電設工業	25,300	1,909.00	48,297,700

協和エクシオ	60,600	1,482.00	89,809,200
新日本空調	13,200	1,134.00	14,968,800
日本工営	48,000	486.00	23,328,000
N D S	2,500	2,476.00	6,190,000
九電工	28,300	3,605.00	102,021,500
三機工業	34,400	905.00	31,132,000
日揮	155,400	1,834.00	285,003,600
中外炉工業	47,000	199.00	9,353,000
ヤマト	14,400	556.00	8,006,400
太平電業	23,000	981.00	22,563,000
高砂熱学工業	46,200	1,514.00	69,946,800
三晃金属工業	1,600	2,818.00	4,508,800
N E C ネットズエスアイ	17,100	1,744.00	29,822,400
朝日工業社	3,200	2,850.00	9,120,000
明星工業	28,200	472.00	13,310,400
大気社	19,000	2,541.00	48,279,000
ダイダン	20,000	798.00	15,960,000
日比谷総合設備	18,700	1,664.00	31,116,800
東芝プラントシステム	25,100	1,612.00	40,461,200
日本製粉	49,500	1,550.00	76,725,000
日清製粉グループ本社	169,700	1,542.00	261,677,400
日東富士製粉	800	3,595.00	2,876,000
昭和産業	64,000	554.00	35,456,000
鳥越製粉	12,800	727.00	9,305,600
中部飼料	14,500	754.00	10,933,000
フィード・ワン	94,500	122.00	11,529,000
東洋精糖	26,000	109.00	2,834,000
日本甜菜製糖	8,000	1,959.00	15,672,000
三井製糖	12,200	2,503.00	30,536,600
塩水港精糖	17,700	246.00	4,354,200
日新製糖	6,600	1,409.00	9,299,400
ネクスト	40,800	829.00	33,823,200
ジェイエイシーリクルートメント	8,900	1,156.00	10,288,400
日本M & A センター	45,200	3,045.00	137,634,000
ノバレーゼ	4,000	1,942.00	7,768,000
アコーディア・ゴルフ	40,000	1,023.00	40,920,000
中広	1,400	658.00	921,200
タケエイ	12,700	813.00	10,325,100
トラスト・テック	5,900	1,587.00	9,363,300
パソナグループ	12,600	792.00	9,979,200
C D S	3,500	923.00	3,230,500
リンクアンドモチベーション	29,800	274.00	8,165,200
G C A	12,900	750.00	9,675,000
エス・エム・エス	18,000	2,791.00	50,238,000
テンブホールディングス	101,200	1,749.00	176,998,800
リニカル	8,500	1,395.00	11,857,500
クックパッド	32,200	974.00	31,362,800
エスクリ	6,400	535.00	3,424,000
アイ・ケイ・ケイ	6,800	632.00	4,297,600
森永製菓	28,000	4,765.00	133,420,000

中村屋	3,500	4,660.00	16,310,000
江崎グリコ	35,700	5,830.00	208,131,000
名糖産業	7,100	1,372.00	9,741,200
不二家	89,000	203.00	18,067,000
山崎製パン	113,400	2,478.00	281,005,200
第一屋製パン	25,000	130.00	3,250,000
モロゾフ	24,000	443.00	10,632,000
亀田製菓	8,600	5,420.00	46,612,000
寿スピリッツ	11,100	2,422.00	26,884,200
カルビー	57,400	3,830.00	219,842,000
森永乳業	139,000	785.00	109,115,000
六甲バター	6,900	2,782.00	19,195,800
ヤクルト本社	83,000	4,545.00	377,235,000
明治ホールディングス	91,700	10,100.00	926,170,000
雪印メグミルク	36,400	3,510.00	127,764,000
プリマハム	98,000	375.00	36,750,000
日本ハム	114,000	2,414.00	275,196,000
林兼産業	5,200	902.00	4,690,400
丸大食品	80,000	492.00	39,360,000
S Foods	9,700	2,743.00	26,607,100
伊藤ハム米久ホールディングス	92,500	992.00	91,760,000
学情	5,500	1,117.00	6,143,500
スタジオアリス	5,900	2,132.00	12,578,800
シミックホールディングス	7,400	1,500.00	11,100,000
システナ	13,300	1,939.00	25,788,700
N J S	3,100	1,161.00	3,599,100
デジタルアーツ	6,700	2,586.00	17,326,200
新日鉄住金ソリューションズ	22,800	1,784.00	40,675,200
総合警備保障	48,100	5,260.00	253,006,000
キューブシステム	6,200	620.00	3,844,000
いちご	150,900	443.00	66,848,700
日本駐車場開発	164,500	139.00	22,865,500
コア	5,900	1,022.00	6,029,800
カカクコム	103,600	1,790.00	185,444,000
アイロムグループ	4,200	1,039.00	4,363,800
ルネサンス	7,600	1,303.00	9,902,800
ディップ	16,000	2,998.00	47,968,000
S B Sホールディングス	13,700	873.00	11,960,100
オプトホールディング	9,300	728.00	6,770,400
新日本科学	13,900	614.00	8,534,600
ツクイ	34,300	666.00	22,843,800
キャリアデザインセンター	3,100	915.00	2,836,500
エムスリー	125,000	3,505.00	438,125,000
ツカダ・グローバルホールディング	10,900	710.00	7,739,000
アウトソーシング	8,200	4,045.00	33,169,000
ウェルネット	10,900	1,270.00	13,843,000
ワールドホールディングス	3,300	1,654.00	5,458,200
ディー・エヌ・エー	64,700	3,295.00	213,186,500
博報堂D Yホールディングス	200,000	1,180.00	236,000,000
ぐるなび	16,700	2,830.00	47,261,000

エスアールジータカミヤ	15,800	556.00	8,784,800
ジャパンベストレスキューシステム	18,100	217.00	3,927,700
ファンコミュニケーションズ	36,700	753.00	27,635,100
ジェイコムホールディングス	3,000	1,902.00	5,706,000
WDBホールディングス	5,300	1,076.00	5,702,800
ティア	7,300	617.00	4,504,100
パリュコマース	13,700	351.00	4,808,700
インフォマート	30,700	1,248.00	38,313,600
サッポロホールディングス	50,700	2,901.00	147,080,700
アサヒグループホールディングス	290,300	3,672.00	1,065,981,600
麒麟ホールディングス	666,200	1,684.50	1,122,213,900
宝ホールディングス	112,100	977.00	109,521,700
オエノンホールディングス	41,000	238.00	9,758,000
養命酒製造	4,900	1,835.00	8,991,500
コカ・コーラウエスト	52,400	2,908.00	152,379,200
コカ・コーライーストジャパン	60,300	2,191.00	132,117,300
サントリー食品インターナショナル	106,000	4,425.00	469,050,000
ダイドードリンコ	7,900	5,670.00	44,793,000
伊藤園	45,900	3,640.00	167,076,000
キーコーヒー	13,700	1,905.00	26,098,500
ユニカフェ	4,500	905.00	4,072,500
ジャパンフーズ	2,300	1,155.00	2,656,500
日清オイリオグループ	82,000	479.00	39,278,000
不二製油グループ本社	41,300	2,034.00	84,004,200
J-オイルミルズ	6,500	3,635.00	23,627,500
ローソン	51,600	7,670.00	395,772,000
サンエー	9,300	5,300.00	49,290,000
カワチ薬品	10,500	2,501.00	26,260,500
エービーシー・マート	17,700	6,340.00	112,218,000
ハードオフコーポレーション	6,700	1,131.00	7,577,700
高千穂交易	5,500	903.00	4,966,500
アスクル	16,600	4,250.00	70,550,000
ゲオホールディングス	22,800	1,281.00	29,206,800
アダストリア	25,100	2,474.00	62,097,400
ジーフット	8,200	724.00	5,936,800
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,000	798.00	1,596,000
伊藤忠食品	3,300	4,080.00	13,464,000
くらコーポレーション	8,900	4,895.00	43,565,500
キャンドウ	7,200	1,652.00	11,894,400
エレマテック	6,400	1,955.00	12,512,000
パルグループホールディングス	8,000	2,213.00	17,704,000
JALUX	4,400	1,830.00	8,052,000
エディオン	57,600	884.00	50,918,400
あらた	6,100	2,335.00	14,243,500
サーラコーポレーション	17,200	608.00	10,457,600
ワッツ	5,900	1,010.00	5,959,000
トーメンデバイス	1,900	1,824.00	3,465,600
ハローズ	4,500	2,194.00	9,873,000
J Pホールディングス	36,000	263.00	9,468,000
あみやき亭	2,700	3,690.00	9,963,000

東京エレクトロン デバイス	5,000	1,493.00	7,465,000
ひらまつ	18,800	594.00	11,167,200
フィールズ	11,900	1,208.00	14,375,200
双日	858,100	264.00	226,538,400
ゲンキー	2,700	4,100.00	11,070,000
アルフレッサ ホールディングス	171,300	2,162.00	370,350,600
大黒天物産	3,300	4,630.00	15,279,000
ハニーズ	12,000	1,176.00	14,112,000
ファーマライズホールディングス	3,300	539.00	1,778,700
キッコーマン	117,000	3,295.00	385,515,000
味の素	318,700	2,287.50	729,026,250
キューピー	78,700	2,912.00	229,174,400
ハウス食品グループ本社	52,900	2,324.00	122,939,600
カゴメ	55,600	2,629.00	146,172,400
焼津水産化学工業	7,700	1,002.00	7,715,400
アリアケジャパン	12,700	5,400.00	68,580,000
ピエトロ	1,700	1,549.00	2,633,300
エバラ食品工業	3,900	1,968.00	7,675,200
ニチレイ	82,500	2,214.00	182,655,000
横浜冷凍	33,900	1,078.00	36,544,200
東洋水産	76,100	4,360.00	331,796,000
イトアンド	1,800	2,050.00	3,690,000
日清食品ホールディングス	65,500	6,070.00	397,585,000
永谷園ホールディングス	7,000	1,287.00	9,009,000
一正蒲鉾	5,500	1,116.00	6,138,000
フジッコ	15,100	2,260.00	34,126,000
ロック・フィールド	16,200	1,474.00	23,878,800
日本たばこ産業	857,400	4,165.00	3,571,071,000
ケンコーマヨネーズ	5,100	3,525.00	17,977,500
わらべや日洋ホールディングス	8,400	2,386.00	20,042,400
なとり	7,900	1,725.00	13,627,500
北の達人コーポレーション	3,100	449.00	1,391,900
ユーグレナ	49,600	1,412.00	70,035,200
片倉工業	18,100	1,255.00	22,715,500
グンゼ	117,000	328.00	38,376,000
ヒューリック	284,200	982.00	279,084,400
神栄	19,000	117.00	2,223,000
山下医科器械	1,200	1,721.00	2,065,200
ラサ商事	6,800	525.00	3,570,000
アルペン	12,200	1,880.00	22,936,000
ラクーン	5,900	522.00	3,079,800
クオール	13,900	1,502.00	20,877,800
アルコニックス	7,800	1,414.00	11,029,200
神戸物産	7,300	3,045.00	22,228,500
ジェイアイエヌ	9,300	4,975.00	46,267,500
ビックカメラ	78,200	892.00	69,754,400
DCMホールディングス	67,000	885.00	59,295,000
MonotaRO	48,200	2,760.00	133,032,000
東京一番フーズ	2,400	558.00	1,339,200
ダイヤモンドダイニング	3,000	1,040.00	3,120,000



あい ホールディングス	24,300	2,362.00	57,396,600
ディービーエックス	4,900	1,377.00	6,747,300
きちり	3,900	675.00	2,632,500
アークランドサービスホールディングス	4,300	3,130.00	13,459,000
J.フロント リテイリング	172,400	1,377.00	237,394,800
ドトール・日レスホールディングス	23,900	1,902.00	45,457,800
マツモトキヨシホールディングス	28,100	5,270.00	148,087,000
ブロンコピリー	7,100	2,991.00	21,236,100
スタートトゥデイ	124,500	1,754.00	218,373,000
トレジャー・ファクトリー	4,000	896.00	3,584,000
物語コーポレーション	3,600	4,545.00	16,362,000
ココカラファイン	14,200	3,810.00	54,102,000
三越伊勢丹ホールディングス	271,000	1,043.00	282,653,000
東洋紡	572,000	166.00	94,952,000
ユニチカ	421,000	62.00	26,102,000
富士紡ホールディングス	7,000	2,987.00	20,909,000
日清紡ホールディングス	76,600	1,021.00	78,208,600
倉敷紡績	146,000	194.00	28,324,000
ダイワボウホールディングス	124,000	242.00	30,008,000
シキボウ	90,000	112.00	10,080,000
日東紡績	96,000	343.00	32,928,000
トヨタ紡織	48,300	2,350.00	113,505,000
マクニカ・富士エレホールディングス	24,500	1,201.00	29,424,500
H a m e e	1,000	2,077.00	2,077,000
ウエルシアホールディングス	11,800	7,090.00	83,662,000
クリエイトSDホールディングス	20,100	2,165.00	43,516,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	23,700	1,065.00	25,240,500
八洲電機	10,800	560.00	6,048,000
U K Cホールディングス	8,700	1,692.00	14,720,400
丸善C H Iホールディングス	16,500	376.00	6,204,000
O C H Iホールディングス	3,300	1,047.00	3,455,100
T O K A Iホールディングス	60,100	663.00	39,846,300
ミサワ	1,800	446.00	802,800
エー・ピーカンパニー	2,300	675.00	1,552,500
三洋貿易	7,600	1,261.00	9,583,600
チムニー	3,400	2,855.00	9,707,000
シュッピン	5,200	1,079.00	5,610,800
ビューティガレージ	1,200	1,220.00	1,464,000
ウイン・パートナーズ	5,000	1,713.00	8,565,000
ネクステージ	2,200	1,827.00	4,019,400
ジョイフル本田	22,100	2,689.00	59,426,900
鳥貴族	3,400	2,671.00	9,081,400
キリン堂ホールディングス	4,600	751.00	3,454,600
ホットランド	4,900	1,000.00	4,900,000
すかいらく	58,400	1,386.00	80,942,400
綿半ホールディングス	5,100	1,748.00	8,914,800
日本毛織	40,700	739.00	30,077,300
ダイトウボウ	24,000	69.00	1,656,000

トーア紡コーポレーション	6,300	506.00	3,187,800
ダイドーリミテッド	16,700	405.00	6,763,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	45,100	942.00	42,484,200
三栄建築設計	5,600	1,399.00	7,834,400
野村不動産ホールディングス	90,400	1,596.00	144,278,400
三重交通グループホールディングス	24,400	391.00	9,540,400
サムティ	10,100	1,000.00	10,100,000
ディア・ライフ	9,600	332.00	3,187,200
エー・ディー・ワークス	130,000	38.00	4,940,000
日本商業開発	6,100	1,726.00	10,528,600
プレサンスコーポレーション	18,800	1,119.00	21,037,200
ユニゾホールディングス	8,900	2,711.00	24,127,900
THEグローバル社	4,900	438.00	2,146,200
日本管理センター	9,200	1,278.00	11,757,600
サンセイランディック	3,100	642.00	1,990,200
エストラスト	2,400	526.00	1,262,400
フージャースホールディングス	19,200	507.00	9,734,400
オープンハウス	19,700	2,030.00	39,991,000
東急不動産ホールディングス	329,500	533.00	175,623,500
飯田グループホールディングス	126,200	1,943.00	245,206,600
ムゲンエステート	4,000	732.00	2,928,000
帝国繊維	15,200	1,565.00	23,788,000
ブックオフコーポレーション	8,100	808.00	6,544,800
日本コークス工業	118,100	83.00	9,802,300
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,900	739.00	2,882,100
ミタチ産業	3,800	594.00	2,257,200
あさひ	10,200	1,219.00	12,433,800
日本調剤	3,500	4,345.00	15,207,500
コスモス薬品	6,900	21,840.00	150,696,000
シップヘルスケアホールディングス	27,700	3,030.00	83,931,000
トーエル	6,800	930.00	6,324,000
一六堂	3,600	347.00	1,249,200
ソフトクリエイトホールディングス	6,700	1,106.00	7,410,200
セブン&アイ・ホールディングス	570,000	4,423.00	2,521,110,000
薬王堂	2,600	6,570.00	17,082,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	36,600	1,035.00	37,881,000
明治電機工業	4,300	1,009.00	4,338,700
ツルハホールディングス	31,400	11,170.00	350,738,000
デリカフーズ	3,100	973.00	3,016,300
スターティア	2,600	516.00	1,341,600
サンマルクホールディングス	10,800	2,779.00	30,013,200
フェリシモ	3,900	996.00	3,884,400
トリドールホールディングス	16,700	2,475.00	41,332,500
クスリのアオキ	12,100	4,975.00	60,197,500
帝人	118,200	1,928.00	227,889,600
東レ	1,049,000	945.00	991,305,000
クラレ	243,300	1,498.00	364,463,400
旭化成	902,000	822.20	741,624,400

サカイオーベックス	3,800	1,964.00	7,463,200
稲葉製作所	7,900	1,283.00	10,135,700
宮地エンジニアリンググループ	45,000	153.00	6,885,000
トーカロ	10,200	2,229.00	22,735,800
アルファ	5,100	975.00	4,972,500
SUMCO	150,800	915.00	137,982,000
川田テクノロジーズ	2,700	4,435.00	11,974,500
シーアールイー	1,000	3,425.00	3,425,000
住江織物	37,000	234.00	8,658,000
日本フェルト	8,100	487.00	3,944,700
イチカワ	10,000	257.00	2,570,000
エコナックホールディングス	46,000	47.00	2,162,000
日東製網	16,000	161.00	2,576,000
芦森工業	32,000	157.00	5,024,000
アツギ	111,000	107.00	11,877,000
コメダホールディングス	18,300	1,690.00	30,927,000
サツドラホールディングス	1,900	1,916.00	3,640,400
ダイユー・リックホールディングス	4,400	625.00	2,750,000
ダイニック	29,000	161.00	4,669,000
共和レザー	9,600	751.00	7,209,600
セーレン	36,100	1,216.00	43,897,600
ソトー	5,500	1,160.00	6,380,000
東海染工	21,000	122.00	2,562,000
小松精練	22,400	650.00	14,560,000
ワコールホールディングス	86,000	1,147.00	98,642,000
ホギメディカル	9,100	7,090.00	64,519,000
レナウン	39,100	103.00	4,027,300
クラウドディア	3,600	485.00	1,746,000
T S Iホールディングス	64,300	579.00	37,229,700
T I S	45,200	2,714.00	122,672,800
ネオス	4,200	510.00	2,142,000
電算システム	4,800	1,632.00	7,833,600
グリー	82,900	549.00	45,512,100
コーエーテックモホールディングス	32,400	1,942.00	62,920,800
三菱総合研究所	5,300	3,215.00	17,039,500
ボルテージ	2,700	1,051.00	2,837,700
電算	1,600	1,980.00	3,168,000
A G S	2,600	1,103.00	2,867,800
ファインデックス	9,200	1,457.00	13,404,400
ヒト・コミュニケーションズ	3,100	1,546.00	4,792,600
ブレインパッド	2,100	1,092.00	2,293,200
K L a b	26,000	616.00	16,016,000
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	9,200	885.00	8,142,000
イーブックイニシアティブジャパン	3,000	915.00	2,745,000
ネクソン	149,700	1,591.00	238,172,700
アイスタイル	20,800	795.00	16,536,000
エムアップ	3,700	606.00	2,242,200
エイチーム	7,500	2,227.00	16,702,500
テクノスジャパン	4,000	2,107.00	8,428,000

e n i s h	4,200	513.00	2,154,600	
コロブラ	37,900	1,533.00	58,100,700	
モバイルクリエイト	9,300	303.00	2,817,900	
オルトプラス	5,300	334.00	1,770,200	
ブロードリーフ	16,800	1,076.00	18,076,800	
ハーツユナイテッドグループ	8,200	1,981.00	16,244,200	
メディアドゥ	2,900	1,567.00	4,544,300	
ブイキューブ	7,500	885.00	6,637,500	
サイバーリンクス	2,100	907.00	1,904,700	
ディー・エル・イー	3,800	623.00	2,367,400	
VOYAGE GROUP	4,700	994.00	4,671,800	
オブティム	1,100	5,400.00	5,940,000	
特種東海製紙	8,400	3,520.00	29,568,000	
ベリサーブ	1,600	3,480.00	5,568,000	
ティーガイア	13,600	1,530.00	20,808,000	
日本アジアグループ	15,500	386.00	5,983,000	
豆蔵ホールディングス	10,900	1,113.00	12,131,700	
テクマトリックス	5,900	2,126.00	12,543,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	317,200	237.00	75,176,400	
GMOペイメントゲートウェイ	11,200	5,250.00	58,800,000	
ザッパラス	8,100	357.00	2,891,700	
インターネットイニシアティブ	22,000	1,850.00	40,700,000	
さくらインターネット	9,000	1,029.00	9,261,000	
GMOクラウド	3,100	1,044.00	3,236,400	
SRAホールディングス	7,900	2,396.00	18,928,400	
MINORIソリューションズ	2,800	929.00	2,601,200	
システムインテグレータ	2,000	576.00	1,152,000	
朝日ネット	13,000	405.00	5,265,000	
フリービット	7,700	847.00	6,521,900	
コムチュア	2,300	3,660.00	8,418,000	
サイバーコム	1,600	884.00	1,414,400	
王子ホールディングス	565,000	410.00	231,650,000	
日本製紙	74,700	1,828.00	136,551,600	
三菱製紙	22,100	697.00	15,403,700	
北越紀州製紙	89,600	626.00	56,089,600	
中越パルプ工業	57,000	225.00	12,825,000	
巴川製紙所	23,000	255.00	5,865,000	
大王製紙	64,100	1,206.00	77,304,600	
g u m i	14,100	757.00	10,673,700	
パイブドHD	1,800	1,090.00	1,962,000	
L I N E	22,600	4,905.00	110,853,000	
レンゴー	128,000	639.00	81,792,000	
トーモク	46,000	290.00	13,340,000	
ザ・バック	10,200	2,766.00	28,213,200	
昭和電工	96,300	1,362.00	131,160,600	
住友化学	1,064,000	479.00	509,656,000	
日本化成	28,000	134.00	3,752,000	
住友精化	6,000	3,660.00	21,960,000	
日産化学工業	86,400	3,190.00	275,616,000	

ラサ工業	55,000	115.00	6,325,000
クレハ	10,900	3,820.00	41,638,000
多木化学	8,000	726.00	5,808,000
テイカ	24,000	540.00	12,960,000
石原産業	26,000	713.00	18,538,000
片倉コープアグリ	18,000	214.00	3,852,000
日東エフシー	8,600	822.00	7,069,200
日本曹達	93,000	436.00	40,548,000
東ソー	390,000	658.00	256,620,000
トクヤマ	240,000	481.00	115,440,000
セントラル硝子	157,000	406.00	63,742,000
東亜合成	90,400	1,117.00	100,976,800
大阪ソーダ	62,000	423.00	26,226,000
関東電化工業	35,000	907.00	31,745,000
デンカ	300,000	412.00	123,600,000
イビデン	84,500	1,482.00	125,229,000
信越化学工業	259,300	7,376.00	1,912,596,800
日本カーバイド工業	50,000	140.00	7,000,000
堺化学工業	58,000	339.00	19,662,000
エア・ウォーター	119,000	1,872.00	222,768,000
大陽日酸	111,400	1,050.00	116,970,000
日本化学工業	54,000	251.00	13,554,000
日本パーカライズン	73,900	1,416.00	104,642,400
高圧ガス工業	20,000	683.00	13,660,000
チタン工業	18,000	185.00	3,330,000
四国化成工業	21,000	944.00	19,824,000
戸田工業	29,000	287.00	8,323,000
ステラ ケミファ	7,400	3,765.00	27,861,000
保土谷化学工業	4,300	2,764.00	11,885,200
日本触媒	21,000	6,550.00	137,550,000
大日精化工業	56,000	521.00	29,176,000
カネカ	195,000	808.00	157,560,000
協和発酵キリン	173,000	1,578.00	272,994,000
三菱瓦斯化学	124,500	1,485.00	184,882,500
三井化学	613,000	502.00	307,726,000
J S R	135,600	1,655.00	224,418,000
東京応化工業	29,000	3,140.00	91,060,000
大阪有機化学工業	9,900	728.00	7,207,200
三菱ケミカルホールディングス	968,500	644.40	624,101,400
ダイセル	195,100	1,227.00	239,387,700
住友ベークライト	127,000	550.00	69,850,000
積水化学工業	328,200	1,483.00	486,720,600
日本ゼオン	122,000	924.00	112,728,000
アイカ工業	43,400	2,716.00	117,874,400
宇部興産	774,000	199.00	154,026,000
積水樹脂	22,400	1,661.00	37,206,400
タキロン	34,000	470.00	15,980,000
旭有機材	47,000	194.00	9,118,000
日立化成	71,400	2,413.00	172,288,200
ニチバン	14,000	835.00	11,690,000

リケンテクノス	31,400	493.00	15,480,200
大倉工業	35,000	378.00	13,230,000
積水化成成品工業	18,500	729.00	13,486,500
群栄化学工業	3,800	2,983.00	11,335,400
タイガースポリマー	7,400	678.00	5,017,200
ミライアル	5,300	707.00	3,747,100
ダイキアクシス	2,600	938.00	2,438,800
ダイキョーニシカワ	18,700	1,270.00	23,749,000
日本化薬	94,000	1,138.00	106,972,000
カーリットホールディングス	13,500	521.00	7,033,500
E P Sホールディングス	17,900	1,375.00	24,612,500
レグス	3,000	800.00	2,400,000
プレステージ・インターナショナル	24,600	792.00	19,483,200
フェイス	3,700	1,123.00	4,155,100
アミューズ	8,000	1,783.00	14,264,000
野村総合研究所	92,600	3,540.00	327,804,000
ドリームインキュベータ	4,800	2,168.00	10,406,400
サイバネットシステム	11,200	730.00	8,176,000
クイック	7,500	1,026.00	7,695,000
T A C	8,200	200.00	1,640,000
C Eホールディングス	1,800	1,002.00	1,803,600
ケネディクス	193,600	429.00	83,054,400
電通	160,700	5,110.00	821,177,000
インテージホールディングス	7,200	1,746.00	12,571,200
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,800	467.00	3,175,600
東邦システムサイエンス	4,300	600.00	2,580,000
ぴあ	4,500	2,300.00	10,350,000
イオンファンタジー	5,100	2,994.00	15,269,400
ソースネクスト	7,100	502.00	3,564,200
シーティーエス	4,700	869.00	4,084,300
ネクシィーズグループ	5,200	1,418.00	7,373,600
メディカルシステムネットワーク	15,800	463.00	7,315,400
ティー・ワイ・オー	27,800	143.00	3,975,400
日本精化	12,100	780.00	9,438,000
扶桑化学工業	9,200	2,225.00	20,470,000
A D E K A	71,100	1,418.00	100,819,800
日油	108,000	1,066.00	115,128,000
ミヨシ油脂	54,000	128.00	6,912,000
新日本理化	23,100	144.00	3,326,400
ハリマ化成グループ	12,600	530.00	6,678,000
花王	367,300	5,651.00	2,075,612,300
第一工業製薬	32,000	343.00	10,976,000
三洋化成工業	9,000	4,430.00	39,870,000
武田薬品工業	576,000	4,851.00	2,794,176,000
アステラス製薬	1,569,700	1,550.00	2,433,035,000
大日本住友製薬	102,400	1,910.00	195,584,000
塩野義製薬	210,800	5,250.00	1,106,700,000
田辺三菱製薬	168,500	2,176.00	366,656,000
わかもと製薬	7,000	236.00	1,652,000
あすか製薬	18,400	1,771.00	32,586,400

日本新薬	33,100	5,360.00	177,416,000
ビオフェルミン製薬	2,400	2,649.00	6,357,600
中外製薬	144,000	3,660.00	527,040,000
科研製薬	24,900	6,360.00	158,364,000
エーザイ	178,000	6,641.00	1,182,098,000
理研ビタミン	3,900	4,945.00	19,285,500
ロート製薬	70,800	1,713.00	121,280,400
小野薬品工業	328,400	2,814.50	924,281,800
久光製薬	44,900	5,250.00	235,725,000
有機合成薬品工業	10,400	219.00	2,277,600
持田製薬	9,900	8,080.00	79,992,000
参天製薬	266,500	1,502.00	400,283,000
扶桑薬品工業	4,900	2,713.00	13,293,700
日本ケミファ	1,800	4,385.00	7,893,000
ツムラ	45,500	2,933.00	133,451,500
日医工	33,800	1,961.00	66,281,800
テルモ	211,600	3,960.00	837,936,000
みらかホールディングス	36,800	5,090.00	187,312,000
キッセイ薬品工業	25,600	2,768.00	70,860,800
生化学工業	26,800	1,660.00	44,488,000
栄研化学	12,200	3,015.00	36,783,000
日水製薬	6,000	1,150.00	6,900,000
鳥居薬品	9,900	2,164.00	21,423,600
JCRファーマ	11,200	2,520.00	28,224,000
東和薬品	6,600	4,145.00	27,357,000
富士製薬工業	4,700	2,623.00	12,328,100
沢井製薬	24,500	7,090.00	173,705,000
ゼリア新薬工業	29,600	1,746.00	51,681,600
第一三共	486,300	2,457.50	1,195,082,250
キョーリン製薬ホールディングス	38,600	2,291.00	88,432,600
大幸薬品	7,100	1,597.00	11,338,700
ダイト	8,100	2,263.00	18,330,300
大塚ホールディングス	310,900	4,573.00	1,421,745,700
大正製薬ホールディングス	34,800	10,230.00	356,004,000
ペプチドリーム	24,200	5,340.00	129,228,000
大日本塗料	83,000	214.00	17,762,000
日本ペイントホールディングス	111,600	3,525.00	393,390,000
関西ペイント	163,600	2,205.00	360,738,000
神東塗料	11,000	198.00	2,178,000
中国塗料	41,000	719.00	29,479,000
日本特殊塗料	10,200	1,325.00	13,515,000
藤倉化成	19,800	591.00	11,701,800
太陽ホールディングス	10,600	3,650.00	38,690,000
DIC	57,100	3,240.00	185,004,000
サカタインクス	29,500	1,281.00	37,789,500
東洋インキSCホールディングス	143,000	470.00	67,210,000
T&K TOKA	10,500	944.00	9,912,000
アルプス技研	5,500	2,226.00	12,243,000
サニックス	23,400	159.00	3,720,600
ダイオーズ	2,700	960.00	2,592,000

日本空調サービス	13,000	560.00	7,280,000
オリエンタルランド	155,900	6,062.00	945,065,800
フォーカスシステムズ	5,600	507.00	2,839,200
ダスキン	37,000	1,934.00	71,558,000
パーク24	68,900	3,240.00	223,236,000
明光ネットワークジャパン	18,000	988.00	17,784,000
ファルコホールディングス	6,500	1,328.00	8,632,000
クレスコ	3,100	2,331.00	7,226,100
フジ・メディア・ホールディングス	141,800	1,410.00	199,938,000
秀英予備校	2,900	346.00	1,003,400
田谷	3,000	651.00	1,953,000
ラウンドワン	45,100	690.00	31,119,000
リゾートトラスト	60,500	1,995.00	120,697,500
オービック	47,000	5,290.00	248,630,000
ジャストシステム	24,800	897.00	22,245,600
TDCソフトウェアエンジニアリング	6,200	1,004.00	6,224,800
ヤフー	977,000	407.00	397,639,000
ビー・エム・エル	17,000	2,810.00	47,770,000
ワタベウェディング	4,300	458.00	1,969,400
トレンドマイクロ	72,200	3,540.00	255,588,000
りらいあコミュニケーションズ	23,800	933.00	22,205,400
インフォメーション・ディベロプメント	2,700	970.00	2,619,000
リソー教育	26,900	524.00	14,095,600
日本オラクル	21,900	5,500.00	120,450,000
早稲田アカデミー	2,100	851.00	1,787,100
アルファシステムズ	4,600	1,741.00	8,008,600
フューチャー	16,800	751.00	12,616,800
CAC Holdings	10,300	896.00	9,228,800
ソフトバンク・テクノロジー	3,700	3,100.00	11,470,000
トーセ	3,800	790.00	3,002,000
ユー・エス・エス	174,600	1,709.00	298,391,400
オービックビジネスコンサルタント	6,900	4,840.00	33,396,000
伊藤忠テクノソリューションズ	30,900	2,613.00	80,741,700
アイティフォー	18,000	652.00	11,736,000
東京個別指導学院	7,200	551.00	3,967,200
東計電算	2,500	1,947.00	4,867,500
サイバーエージェント	76,000	3,010.00	228,760,000
楽天	736,700	1,302.00	959,183,400
エクスネット	1,400	1,525.00	2,135,000
クリーク・アンド・リバー社	5,800	741.00	4,297,800
テー・オー・ダブリュー	11,700	652.00	7,628,400
大塚商会	36,700	4,945.00	181,481,500
総合メディカル	6,600	3,215.00	21,219,000
サイボウズ	18,400	433.00	7,967,200
ソフトブレーン	18,700	407.00	7,610,900
セントラルスポーツ	5,000	2,427.00	12,135,000
パラカ	4,000	1,741.00	6,964,000
電通国際情報サービス	8,400	1,858.00	15,607,200
デジタルガレージ	21,300	1,943.00	41,385,900



イーエムシステムズ	4,700	1,608.00	7,557,600
ウェザーニューズ	4,600	3,115.00	14,329,000
C I J	12,900	483.00	6,230,700
東洋ビジネスエンジニアリング	1,500	1,417.00	2,125,500
日本エンタープライズ	14,300	288.00	4,118,400
WOWOW	6,500	2,763.00	17,959,500
フュージョンパートナー	8,700	961.00	8,360,700
フルキャストホールディングス	13,500	876.00	11,826,000
富士フイルムホールディングス	330,900	3,874.00	1,281,906,600
コニカミノルタ	344,700	886.00	305,404,200
資生堂	274,400	2,571.50	705,619,600
ライオン	180,000	1,643.00	295,740,000
高砂香料工業	9,500	2,733.00	25,963,500
マンダム	13,500	4,640.00	62,640,000
ミルボン	7,800	4,630.00	36,114,000
ファンケル	33,500	1,711.00	57,318,500
コーセー	23,400	9,880.00	231,192,000
コタ	5,000	1,170.00	5,850,000
シーズ・ホールディングス	18,700	2,991.00	55,931,700
シーボン	1,600	2,161.00	3,457,600
ポーラ・オルビスホールディングス	14,700	8,850.00	130,095,000
ノエビアホールディングス	9,200	3,090.00	28,428,000
アジュバンコスメジャパン	3,000	859.00	2,577,000
エステー	10,000	1,202.00	12,020,000
アグロ カネショウ	5,700	1,115.00	6,355,500
コニシ	22,700	1,245.00	28,261,500
長谷川香料	18,300	1,823.00	33,360,900
星光PMC	7,900	1,114.00	8,800,600
小林製薬	43,800	5,270.00	230,826,000
荒川化学工業	12,400	1,307.00	16,206,800
メック	11,200	1,048.00	11,737,600
日本高純度化学	4,100	2,391.00	9,803,100
タカラバイオ	31,000	1,510.00	46,810,000
J C U	4,300	3,880.00	16,684,000
新田ゼラチン	9,700	730.00	7,081,000
O A T アグリオ	1,700	1,272.00	2,162,400
デクセリアルズ	43,200	873.00	37,713,600
アース製薬	10,400	4,780.00	49,712,000
イハラケミカル工業	20,100	915.00	18,391,500
北興化学工業	14,000	318.00	4,452,000
大成ラミック	4,200	2,864.00	12,028,800
クミアイ化学工業	29,900	552.00	16,504,800
日本農薬	33,100	525.00	17,377,500
昭和シェル石油	129,200	990.00	127,908,000
富士興産	5,500	420.00	2,310,000
ニチレキ	17,900	756.00	13,532,400
東燃ゼネラル石油	235,000	1,029.00	241,815,000
ユシロ化学工業	7,800	1,418.00	11,060,400
ビーピー・カストロール	6,000	1,323.00	7,938,000
富士石油	33,700	337.00	11,356,900

MORESCO	4,600	1,275.00	5,865,000
出光興産	75,400	2,310.00	174,174,000
JXホールディングス	1,710,800	414.70	709,468,760
コスモエネルギーホールディングス	43,600	1,315.00	57,334,000
横浜ゴム	87,200	1,682.00	146,670,400
東洋ゴム工業	76,300	1,494.00	113,992,200
ブリヂストン	488,000	3,884.00	1,895,392,000
住友ゴム工業	135,200	1,610.00	217,672,000
藤倉ゴム工業	12,500	600.00	7,500,000
オカモト	44,000	1,129.00	49,676,000
アキレス	11,800	1,484.00	17,511,200
フコク	5,500	802.00	4,411,000
ニッタ	15,600	2,521.00	39,327,600
クリエートメディック	4,700	922.00	4,333,400
住友理工	31,200	993.00	30,981,600
三ツ星ベルト	35,000	855.00	29,925,000
バンドー化学	26,500	990.00	26,235,000
旭硝子	712,000	661.00	470,632,000
日本板硝子	69,900	835.00	58,366,500
石塚硝子	21,000	154.00	3,234,000
有沢製作所	21,300	543.00	11,565,900
日本山村硝子	58,000	178.00	10,324,000
日本電気硝子	299,000	543.00	162,357,000
オハラ	5,700	600.00	3,420,000
住友大阪セメント	286,000	437.00	124,982,000
太平洋セメント	921,000	283.00	260,643,000
リソルホールディングス	14,000	314.00	4,396,000
日本ヒューム	14,100	629.00	8,868,900
日本コンクリート工業	30,000	366.00	10,980,000
三谷セキサン	7,300	2,381.00	17,381,300
アジアパイルホールディングス	18,100	420.00	7,602,000
東海カーボン	129,000	298.00	38,442,000
日本カーボン	71,000	201.00	14,271,000
東洋炭素	8,000	1,419.00	11,352,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,200	2,423.00	19,868,600
TOTO	106,200	3,920.00	416,304,000
日本碍子	182,600	2,145.00	391,677,000
日本特殊陶業	124,600	1,923.00	239,605,800
ダントーホールディングス	13,000	186.00	2,418,000
MARUWA	5,300	3,840.00	20,352,000
品川リフラクトリーズ	37,000	197.00	7,289,000
黒崎播磨	32,000	278.00	8,896,000
ヨータイ	8,000	296.00	2,368,000
イソライト工業	7,100	264.00	1,874,400
東京窯業	17,000	163.00	2,771,000
ニッカトー	5,500	369.00	2,029,500
フジインコーポレーテッド	12,300	1,481.00	18,216,300
エーアンドエーマテリアル	31,000	91.00	2,821,000
ニチアス	74,000	929.00	68,746,000
新日鐵住金	651,800	2,027.50	1,321,524,500

神戸製鋼所	265,400	871.00	231,163,400	
中山製鋼所	16,200	663.00	10,740,600	
合同製鐵	8,100	1,896.00	15,357,600	
ジェイ エフ イー ホールディングス	395,000	1,443.50	570,182,500	
日新製鋼	65,900	1,382.00	91,073,800	
東京製鐵	79,800	719.00	57,376,200	
共英製鋼	15,400	1,910.00	29,414,000	
大和工業	31,900	2,957.00	94,328,300	
東京鐵鋼	30,000	415.00	12,450,000	
大阪製鐵	9,100	1,757.00	15,988,700	
淀川製鋼所	21,500	2,673.00	57,469,500	
東洋鋼鈹	34,600	293.00	10,137,800	
丸一鋼管	48,400	3,300.00	159,720,000	
モリ工業	4,200	1,659.00	6,967,800	
大同特殊鋼	242,000	452.00	109,384,000	
日本高周波鋼業	58,000	73.00	4,234,000	
日本冶金工業	106,600	147.00	15,670,200	
山陽特殊製鋼	86,000	551.00	47,386,000	
愛知製鋼	8,500	5,010.00	42,585,000	
日立金属	165,500	1,254.00	207,537,000	
日本金属	3,800	1,257.00	4,776,600	
大平洋金属	101,000	304.00	30,704,000	
新日本電工	81,500	180.00	14,670,000	
栗本鐵工所	6,900	1,801.00	12,426,900	
虹 技	21,000	245.00	5,145,000	
日本鑄鉄管	16,000	160.00	2,560,000	
日本製鋼所	47,800	2,287.00	109,318,600	
三菱製鋼	100,000	177.00	17,700,000	
日亜鋼業	18,800	232.00	4,361,600	
日本精線	10,000	490.00	4,900,000	
大紀アルミニウム工業所	23,000	398.00	9,154,000	
日本軽金属ホールディングス	327,100	218.00	71,307,800	
三井金属鉱業	368,000	228.00	83,904,000	
東邦亜鉛	76,000	343.00	26,068,000	
三菱マテリアル	90,200	2,722.00	245,524,400	
住友金属鉱山	399,000	1,293.50	516,106,500	
D O W Aホールディングス	186,000	721.00	134,106,000	
古河機械金属	225,000	161.00	36,225,000	
エス・サイエンス	65,100	36.00	2,343,600	
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,200	1,422.00	20,192,400	
東邦チタニウム	24,500	719.00	17,615,500	
U A C J	202,000	311.00	62,822,000	
古河電気工業	45,400	2,962.00	134,474,800	
住友電気工業	578,500	1,504.00	870,064,000	
フジクラ	201,000	608.00	122,208,000	
昭和電線ホールディングス	174,000	71.00	12,354,000	
東京特殊電線	2,100	954.00	2,003,400	
タツタ電線	30,100	362.00	10,896,200	
沖電線	17,000	234.00	3,978,000	

カナレ電気	2,100	1,955.00	4,105,500
平河ヒューテック	7,000	892.00	6,244,000
リョービ	88,000	453.00	39,864,000
アーレスティ	16,800	1,121.00	18,832,800
アサヒホールディングス	21,800	1,771.00	38,607,800
東洋製罐グループホールディングス	102,600	1,803.00	184,987,800
ホッカンホールディングス	38,000	334.00	12,692,000
コロナ	7,600	1,025.00	7,790,000
横河ブリッジホールディングス	27,400	1,113.00	30,496,200
OSJBホールディングス	31,600	218.00	6,888,800
駒井ハルテック	2,600	1,917.00	4,984,200
高田機工	12,000	203.00	2,436,000
三和ホールディングス	143,400	967.00	138,667,800
文化シャッター	40,300	802.00	32,320,600
三協立山	18,900	1,546.00	29,219,400
アルインコ	11,100	937.00	10,400,700
東洋シャッター	3,600	578.00	2,080,800
LIXILグループ	201,300	2,268.00	456,548,400
日本ファイルコン	10,700	503.00	5,382,100
ノーリツ	28,300	2,137.00	60,477,100
長府製作所	15,500	2,662.00	41,261,000
リンナイ	26,900	9,290.00	249,901,000
ユニプレス	28,700	1,868.00	53,611,600
ダイニチ工業	7,700	647.00	4,981,900
日東精工	20,000	384.00	7,680,000
三洋工業	19,000	172.00	3,268,000
岡部	30,100	845.00	25,434,500
ジーテクト	15,100	1,938.00	29,263,800
中国工業	2,500	670.00	1,675,000
東プレ	27,800	2,152.00	59,825,600
高周波熱錬	26,900	801.00	21,546,900
東京製綱	9,800	1,674.00	16,405,200
サンコール	8,000	454.00	3,632,000
モリテックスチール	7,500	258.00	1,935,000
パイオラックス	7,300	6,520.00	47,596,000
日本発条	135,800	963.00	130,775,400
中央発條	17,000	285.00	4,845,000
アドバネクス	2,700	1,073.00	2,897,100
三浦工業	64,500	1,807.00	116,551,500
タクマ	53,000	904.00	47,912,000
テクノプロ・ホールディングス	23,400	3,635.00	85,059,000
インターワークス	2,600	1,099.00	2,857,400
KeepPer 技研	1,700	1,508.00	2,563,600
ファーストロジック	800	1,552.00	1,241,600
リブセンス	9,900	448.00	4,435,200
ジャパンマテリアル	6,000	3,600.00	21,600,000
ベクトル	13,800	957.00	13,206,600
ウチヤマホールディングス	7,700	412.00	3,172,400
サクセスホールディングス	1,200	1,205.00	1,446,000
キャリアリンク	3,900	834.00	3,252,600

I B J	11,400	709.00	8,082,600
アサンテ	5,400	1,597.00	8,623,800
N・フィールド	6,900	1,395.00	9,625,500
M&Aキャピタルパートナーズ	1,900	2,027.00	3,851,300
ライドオン・エクスプレス	3,200	991.00	3,171,200
E R Iホールディングス	4,000	775.00	3,100,000
アビスト	2,300	2,434.00	5,598,200
ウィルグループ	3,300	969.00	3,197,700
日本ビューホテル	2,100	1,317.00	2,765,700
リクルートホールディングス	290,800	4,120.00	1,198,096,000
エラン	1,700	1,244.00	2,114,800
ツガミ	42,000	576.00	24,192,000
オークマ	94,000	807.00	75,858,000
東芝機械	79,000	361.00	28,519,000
アマダホールディングス	210,600	1,089.00	229,343,400
アイダエンジニアリング	37,900	846.00	32,063,400
滝澤鉄工所	46,000	134.00	6,164,000
富士機械製造	47,100	1,254.00	59,063,400
牧野フライス製作所	72,000	644.00	46,368,000
オーエスジー	65,800	2,107.00	138,640,600
ダイジェット工業	17,000	147.00	2,499,000
旭ダイヤモンド工業	38,900	838.00	32,598,200
D M G森精機	85,500	1,102.00	94,221,000
ソディック	36,600	766.00	28,035,600
ディスコ	18,400	12,190.00	224,296,000
日東工器	8,400	2,291.00	19,244,400
パンチ工業	5,800	884.00	5,127,200
日本郵政	424,100	1,282.00	543,696,200
ベルシステム24ホールディングス	28,300	864.00	24,451,200
ソラスト	6,500	1,054.00	6,851,000
豊田自動織機	125,700	4,900.00	615,930,000
豊和工業	8,200	530.00	4,346,000
O K K	58,000	103.00	5,974,000
石川製作所	3,700	661.00	2,445,700
東洋機械金属	11,000	375.00	4,125,000
津田駒工業	32,000	161.00	5,152,000
エンシュウ	38,000	64.00	2,432,000
島精機製作所	20,400	2,862.00	58,384,800
N Cホールディングス	4,800	852.00	4,089,600
フリー	2,900	3,140.00	9,106,000
ヤマシンフィルタ	3,100	571.00	1,770,100
日阪製作所	18,300	840.00	15,372,000
やまびこ	26,500	957.00	25,360,500
ペガサスミシン製造	15,100	581.00	8,773,100
ナブテスコ	75,100	2,913.00	218,766,300
三井海洋開発	14,500	1,789.00	25,940,500
レオン自動機	12,300	708.00	8,708,400
S M C	43,300	29,360.00	1,271,288,000
新川	12,900	695.00	8,965,500
ホソカワミクロン	24,000	607.00	14,568,000

ユニオンツール	6,200	2,686.00	16,653,200
オイレス工業	18,700	1,754.00	32,799,800
日精エー・エス・ビー機械	4,600	1,782.00	8,197,200
サトーホールディングス	19,500	2,199.00	42,880,500
日本エアテック	4,800	623.00	2,990,400
日精樹脂工業	10,600	751.00	7,960,600
オカダアイヨン	3,000	785.00	2,355,000
ワイエイシイ	5,800	1,377.00	7,986,600
小松製作所	708,300	2,376.00	1,682,920,800
住友重機械工業	421,000	509.00	214,289,000
日立建機	64,500	2,070.00	133,515,000
日工	4,400	1,591.00	7,000,400
巴工業	5,900	1,582.00	9,333,800
井関農機	148,000	247.00	36,556,000
TOWA	14,000	1,177.00	16,478,000
丸山製作所	31,000	168.00	5,208,000
北川鉄工所	6,600	1,764.00	11,642,400
シンニッタン	13,400	475.00	6,365,000
ローツェ	5,100	1,985.00	10,123,500
タカキタ	3,600	508.00	1,828,800
クボタ	693,700	1,554.00	1,078,009,800
荏原実業	4,100	1,242.00	5,092,200
東洋エンジニアリング	83,000	349.00	28,967,000
三菱化工機	48,000	213.00	10,224,000
月島機械	27,400	1,121.00	30,715,400
帝国電機製作所	10,500	785.00	8,242,500
東京機械製作所	55,000	70.00	3,850,000
新東工業	32,700	917.00	29,985,900
澁谷工業	12,100	2,107.00	25,494,700
アイチコーポレーション	20,500	755.00	15,477,500
小森コーポレーション	32,000	1,322.00	42,304,000
鶴見製作所	10,800	1,559.00	16,837,200
住友精密工業	23,000	334.00	7,682,000
酒井重工業	28,000	189.00	5,292,000
荏原製作所	64,000	3,120.00	199,680,000
石井鐵工所	2,200	1,514.00	3,330,800
西島製作所	15,500	1,032.00	15,996,000
北越工業	15,700	667.00	10,471,900
千代田化工建設	111,000	890.00	98,790,000
ダイキン工業	201,000	9,718.00	1,953,318,000
オルガノ	25,000	416.00	10,400,000
トーヨーカネツ	69,000	216.00	14,904,000
栗田工業	86,800	2,421.00	210,142,800
椿本チエイン	82,000	791.00	64,862,000
大同工業	27,000	224.00	6,048,000
日機装	49,700	922.00	45,823,400
木村化工機	12,600	370.00	4,662,000
新興プランテック	31,700	754.00	23,901,800
アネスト岩田	23,300	1,044.00	24,325,200
ダイフク	74,200	1,840.00	136,528,000

サムコ	3,600	833.00	2,998,800
加藤製作所	6,600	2,156.00	14,229,600
油研工業	27,000	173.00	4,671,000
タダノ	66,600	1,182.00	78,721,200
フジテック	40,200	1,159.00	46,591,800
C K D	38,400	1,200.00	46,080,000
キトー	17,400	950.00	16,530,000
平和	42,800	2,286.00	97,840,800
理想科学工業	15,300	1,658.00	25,367,400
SANKYO	38,300	3,475.00	133,092,500
日本金銭機械	12,700	1,515.00	19,240,500
マースエンジニアリング	7,800	1,979.00	15,436,200
福島工業	8,500	3,200.00	27,200,000
オーイズミ	5,900	740.00	4,366,000
ダイコク電機	5,700	1,558.00	8,880,600
竹内製作所	27,300	1,895.00	51,733,500
アマノ	42,700	1,701.00	72,632,700
JUKI	21,000	768.00	16,128,000
サンデンホールディングス	84,000	304.00	25,536,000
蛇の目ミシン工業	13,500	604.00	8,154,000
ブラザー工業	178,400	1,823.00	325,223,200
マックス	21,000	1,236.00	25,956,000
モリタホールディングス	24,200	1,392.00	33,686,400
グローリー	47,100	3,445.00	162,259,500
新晃工業	9,700	1,250.00	12,125,000
大和冷機工業	22,100	903.00	19,956,300
セガサミーホールディングス	148,300	1,443.00	213,996,900
日本ピストンリング	5,800	1,561.00	9,053,800
リケン	6,400	3,505.00	22,432,000
T P R	17,000	2,902.00	49,334,000
ツバキ・ナカシマ	15,400	1,542.00	23,746,800
ホシザキ	30,300	9,140.00	276,942,000
大豊工業	11,100	1,171.00	12,998,100
日本精工	283,600	1,084.00	307,422,400
NTN	342,000	374.00	127,908,000
ジェイテクト	147,100	1,578.00	232,123,800
不二越	139,000	381.00	52,959,000
ミネベア	222,500	1,035.00	230,287,500
日本トムソン	47,300	383.00	18,115,900
THK	91,800	2,044.00	187,639,200
ユーシン精機	5,400	2,502.00	13,510,800
前澤給装工業	5,800	1,348.00	7,818,400
イーグル工業	17,100	1,357.00	23,204,700
前澤工業	10,200	297.00	3,029,400
日本ピラー工業	14,000	1,029.00	14,406,000
キッツ	61,400	590.00	36,226,000
日立製作所	3,522,000	518.70	1,826,861,400
東芝	2,906,000	355.30	1,032,501,800
三菱電機	1,473,000	1,304.50	1,921,528,500
富士電機	416,000	494.00	205,504,000

東洋電機製造	27,000	311.00	8,397,000
安川電機	171,500	1,571.00	269,426,500
シンフォニアテクノロジー	90,000	176.00	15,840,000
明電舎	127,000	341.00	43,307,000
オリジン電気	20,000	261.00	5,220,000
山洋電気	36,000	617.00	22,212,000
デンヨー	12,700	1,133.00	14,389,100
日立工機	36,800	852.00	31,353,600
三櫻工業	17,700	642.00	11,363,400
マキタ	90,000	7,200.00	648,000,000
東芝テック	99,000	433.00	42,867,000
芝浦メカトロニクス	23,000	255.00	5,865,000
マブチモーター	39,000	5,890.00	229,710,000
日本電産	166,200	9,484.00	1,576,240,800
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,600	2,304.00	3,686,400
東光高岳	7,700	2,033.00	15,654,100
ダブル・スコープ	12,200	1,969.00	24,021,800
宮越ホールディングス	4,900	514.00	2,518,600
ダイヘン	81,000	538.00	43,578,000
田淵電機	15,700	362.00	5,683,400
ヤーマン	1,800	3,475.00	6,255,000
JVCケンウッド	101,300	265.00	26,844,500
ミマキエンジニアリング	12,500	536.00	6,700,000
第一精工	5,900	1,093.00	6,448,700
日新電機	32,400	1,586.00	51,386,400
大崎電気工業	26,000	958.00	24,908,000
オムロン	155,900	3,705.00	577,609,500
日東工業	22,000	1,397.00	30,734,000
I D E C	18,000	944.00	16,992,000
不二電機工業	1,400	1,365.00	1,911,000
ジーエス・ユアサコーポレーション	266,000	435.00	115,710,000
サクサホールディングス	35,000	219.00	7,665,000
メルコホールディングス	7,600	2,751.00	20,907,600
テクノメディカ	3,100	1,643.00	5,093,300
日本電気	1,898,000	268.00	508,664,000
富士通	1,331,000	553.30	736,442,300
沖電気工業	59,800	1,428.00	85,394,400
岩崎通信機	66,000	71.00	4,686,000
電気興業	36,000	515.00	18,540,000
サンケン電気	75,000	341.00	25,575,000
ナカヨ	13,000	357.00	4,641,000
アイホン	7,900	1,700.00	13,430,000
ルネサスエレクトロニクス	71,500	626.00	44,759,000
セイコーエプソン	205,600	1,933.00	397,424,800
ワコム	107,200	304.00	32,588,800
アルバック	25,400	3,115.00	79,121,000
アクセル	6,300	773.00	4,869,900
E I Z O	13,600	2,905.00	39,508,000
ジャパンディスプレイ	257,800	175.00	45,115,000
日本信号	38,100	899.00	34,251,900



京三製作所	33,000	387.00	12,771,000
能美防災	15,700	1,467.00	23,031,900
ホーチキ	10,100	1,100.00	11,110,000
エレコム	12,000	2,114.00	25,368,000
日本無線	8,000	1,430.00	11,440,000
パナソニック	1,577,300	1,039.00	1,638,814,700
アンリツ	82,800	594.00	49,183,200
富士通ゼネラル	42,000	2,153.00	90,426,000
日立国際電気	31,600	1,882.00	59,471,200
ソニー	974,300	3,384.00	3,297,031,200
T D K	83,300	6,780.00	564,774,000
帝国通信工業	33,000	153.00	5,049,000
ミツミ電機	52,500	621.00	32,602,500
タムラ製作所	53,000	414.00	21,942,000
アルプス電気	119,000	2,608.00	310,352,000
池上通信機	44,000	129.00	5,676,000
パイオニア	223,400	221.00	49,371,400
日本電波工業	12,500	840.00	10,500,000
鈴木	5,700	528.00	3,009,600
日本トリム	3,700	5,480.00	20,276,000
ローランド ディー . ジー .	7,000	2,317.00	16,219,000
日本コロムビア	4,900	563.00	2,758,700
フォスター電機	17,300	1,886.00	32,627,800
クラリオン	73,000	326.00	23,798,000
S M K	39,000	349.00	13,611,000
ヨコオ	10,000	635.00	6,350,000
ティアック	101,000	38.00	3,838,000
ホシデン	41,900	720.00	30,168,000
ヒロセ電機	22,300	13,440.00	299,712,000
日本航空電子工業	40,000	1,706.00	68,240,000
T O A	16,300	932.00	15,191,600
日立マクセル	22,900	1,556.00	35,632,400
古野電気	16,400	627.00	10,282,800
ユニデンホールディングス	44,000	147.00	6,468,000
アルパイン	32,900	1,374.00	45,204,600
スミダコーポレーション	11,400	1,121.00	12,779,400
アイコム	7,700	2,021.00	15,561,700
リオン	5,300	1,413.00	7,488,900
本多通信工業	3,700	1,105.00	4,088,500
船井電機	13,900	855.00	11,884,500
横河電機	138,100	1,418.00	195,825,800
新電元工業	49,000	439.00	21,511,000
アズビル	45,000	3,050.00	137,250,000
東亜ディーケーケー	8,000	460.00	3,680,000
日本光電工業	57,700	2,529.00	145,923,300
チノー	5,100	1,008.00	5,140,800
共和電業	16,000	365.00	5,840,000
日本電子材料	5,800	543.00	3,149,400
堀場製作所	27,300	4,930.00	134,589,000
アドバンテスト	94,100	1,394.00	131,175,400

小野測器	7,000	884.00	6,188,000
エスベック	14,300	1,271.00	18,175,300
パナソニック デバイスSUNX	12,200	579.00	7,063,800
キーエンス	31,300	76,190.00	2,384,747,000
日置電機	7,200	1,909.00	13,744,800
シスメックス	107,300	7,540.00	809,042,000
日本マイクロニクス	25,800	1,353.00	34,907,400
メガチップス	13,800	1,966.00	27,130,800
OBARA GROUP	8,100	4,310.00	34,911,000
イマジカ・ロボット ホールディングス	11,500	577.00	6,635,500
澤藤電機	8,000	195.00	1,560,000
デンソー	306,400	4,280.00	1,311,392,000
コーセル	19,200	1,240.00	23,808,000
イリソ電子工業	4,400	5,430.00	23,892,000
新日本無線	10,400	346.00	3,598,400
オブテックス	10,200	2,598.00	26,499,600
千代田インテグレ	7,300	2,119.00	15,468,700
アイ・オー・データ機器	4,400	1,007.00	4,430,800
レーザーテック	16,200	1,943.00	31,476,600
スタンレー電気	98,700	2,785.00	274,879,500
岩崎電気	47,000	155.00	7,285,000
ウシオ電機	83,800	1,202.00	100,727,600
岡谷電機産業	8,000	381.00	3,048,000
ヘリオス テクノ ホールディング	12,000	390.00	4,680,000
日本セラミック	11,300	1,872.00	21,153,600
遠藤照明	7,200	810.00	5,832,000
日本デジタル研究所	11,700	1,488.00	17,409,600
古河電池	10,000	733.00	7,330,000
双信電機	6,900	278.00	1,918,200
山一電機	12,200	855.00	10,431,000
図研	10,000	1,046.00	10,460,000
日本電子	55,000	400.00	22,000,000
カシオ計算機	138,400	1,435.00	198,604,000
ファナック	140,000	19,070.00	2,669,800,000
日本シイエムケイ	29,800	544.00	16,211,200
エンプラス	7,000	3,185.00	22,295,000
大真空	5,200	1,128.00	5,865,600
ローム	66,700	5,360.00	357,512,000
浜松ホトニクス	107,700	3,135.00	337,639,500
三井ハイテック	20,000	733.00	14,660,000
新光電気工業	51,900	621.00	32,229,900
京セラ	226,600	5,011.00	1,135,492,600
協栄産業	19,000	133.00	2,527,000
太陽誘電	67,100	1,044.00	70,052,400
村田製作所	145,600	14,100.00	2,052,960,000
ユーシン	18,400	729.00	13,413,600
双葉電子工業	22,600	1,663.00	37,583,800
日東電工	111,700	6,830.00	762,911,000
北陸電気工業	57,000	123.00	7,011,000

東海理化電機製作所	40,400	2,052.00	82,900,800	
ニチコン	43,400	849.00	36,846,600	
日本ケミコン	112,000	174.00	19,488,000	
K O A	19,100	917.00	17,514,700	
三井造船	534,000	149.00	79,566,000	
日立造船	109,300	515.00	56,289,500	
三菱重工業	2,458,000	442.60	1,087,910,800	
川崎重工業	1,074,000	293.00	314,682,000	
I H I	1,061,000	292.00	309,812,000	
名村造船所	41,400	714.00	29,559,600	
サノヤスホールディングス	16,800	286.00	4,804,800	
日本車輛製造	57,000	271.00	15,447,000	
ニチュ三菱フォークリフト	16,000	594.00	9,504,000	
近畿車輛	2,100	2,350.00	4,935,000	
F P G	48,600	906.00	44,031,600	
島根銀行	3,000	1,233.00	3,699,000	
じもとホールディングス	97,500	148.00	14,430,000	
全国保証	35,400	4,250.00	150,450,000	
めぶきフィナンシャルグループ	675,540	352.00	237,790,080	
東京T Yフィナンシャルグループ	18,800	2,992.00	56,249,600	
九州フィナンシャルグループ	208,400	669.00	139,419,600	
かんぽ生命保険	55,500	2,176.00	120,768,000	
ゆうちょ銀行	349,200	1,201.00	419,389,200	
富山第一銀行	34,700	491.00	17,037,700	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	949,300	442.00	419,590,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	88,800	1,037.00	92,085,600	
日産自動車	1,882,000	980.50	1,845,301,000	
いすゞ自動車	400,000	1,209.00	483,600,000	
トヨタ自動車	1,760,000	5,957.00	10,484,320,000	*
日野自動車	196,900	1,121.00	220,724,900	
三菱自動車工業	548,100	489.00	268,020,900	
エフテック	7,300	1,304.00	9,519,200	
レシップホールディングス	4,700	889.00	4,178,300	
G M B	2,400	1,003.00	2,407,200	
ファルテック	2,600	1,173.00	3,049,800	
武蔵精密工業	14,700	2,508.00	36,867,600	
日産車体	67,300	964.00	64,877,200	
新明和工業	60,000	692.00	41,520,000	
極東開発工業	27,500	1,183.00	32,532,500	
日信工業	30,800	1,621.00	49,926,800	
トピー工業	11,400	2,223.00	25,342,200	
ティラド	53,000	226.00	11,978,000	
曙ブレーキ工業	70,200	200.00	14,040,000	
タチエス	21,900	1,642.00	35,959,800	
N O K	66,800	2,297.00	153,439,600	
フタバ産業	42,200	500.00	21,100,000	
K Y B	154,000	456.00	70,224,000	
市光工業	33,000	296.00	9,768,000	

大同メタル工業	19,300	1,079.00	20,824,700
プレス工業	73,300	471.00	34,524,300
ミクニ	17,800	324.00	5,767,200
カルソニックカンセイ	105,000	990.00	103,950,000
太平洋工業	30,700	1,181.00	36,256,700
ケーヒン	31,700	1,664.00	52,748,800
河西工業	17,000	1,138.00	19,346,000
アイシン精機	141,500	4,745.00	671,417,500
富士機工	16,100	391.00	6,295,100
マツダ	437,100	1,633.50	714,002,850
今仙電機製作所	12,600	905.00	11,403,000
本田技研工業	1,242,400	3,039.00	3,775,653,600
スズキ	252,600	3,432.00	866,923,200
富士重工業	428,700	3,861.00	1,655,210,700
安永	4,300	471.00	2,025,300
ヤマハ発動機	195,000	2,155.00	420,225,000
ショーワ	35,800	564.00	20,191,200
小糸製作所	82,700	5,180.00	428,386,000
T B K	16,600	420.00	6,972,000
エクセディ	18,700	2,701.00	50,508,700
ミツバ	23,500	1,428.00	33,558,000
豊田合成	50,100	2,452.00	122,845,200
愛三工業	24,200	842.00	20,376,400
盟和産業	1,800	1,066.00	1,918,800
ヨロズ	12,900	1,615.00	20,833,500
エフ・シー・シー	22,600	2,289.00	51,731,400
新家工業	29,000	143.00	4,147,000
シマノ	55,700	16,110.00	897,327,000
タカタ	25,000	345.00	8,625,000
テイ・エス テック	32,100	2,730.00	87,633,000
ジャムコ	8,100	2,029.00	16,434,900
小野建	11,900	1,250.00	14,875,000
はるやま商事	5,900	768.00	4,531,200
ノジマ	15,700	1,254.00	19,687,800
佐鳥電機	10,900	730.00	7,957,000
カッパ・クリエイト	19,200	1,219.00	23,404,800
エコートレーディング	3,500	649.00	2,271,500
伯東	10,400	920.00	9,568,000
コンドーテック	11,000	753.00	8,283,000
中山福	8,900	777.00	6,915,300
ライトオン	10,200	988.00	10,077,600
ナガイレーベン	19,700	2,218.00	43,694,600
ジーンズメイト	4,600	169.00	777,400
三菱食品	15,000	3,305.00	49,575,000
良品計画	15,600	22,030.00	343,668,000
三城ホールディングス	17,200	433.00	7,447,600
松田産業	10,000	1,405.00	14,050,000
第一興商	24,100	4,045.00	97,484,500
メディバルホールディングス	136,300	1,753.00	238,933,900
アドヴァン	13,900	964.00	13,399,600

S P K	3,300	2,077.00	6,854,100
萩原電気	4,700	1,859.00	8,737,300
アルビス	3,600	2,114.00	7,610,400
アズワン	10,700	4,390.00	46,973,000
スズデン	4,600	952.00	4,379,200
尾家産業	4,800	960.00	4,608,000
シモジマ	9,500	1,049.00	9,965,500
ドウシシャ	16,000	2,137.00	34,192,000
小津産業	3,100	2,077.00	6,438,700
コナカ	17,200	486.00	8,359,200
高速	8,400	970.00	8,148,000
ハウス オブ ローゼ	1,900	1,443.00	2,741,700
G - 7ホールディングス	4,100	1,379.00	5,653,900
たけびし	4,800	1,055.00	5,064,000
イオン北海道	9,300	541.00	5,031,300
コジマ	20,100	236.00	4,743,600
ヒマラヤ	4,300	807.00	3,470,100
コーナン商事	19,300	1,982.00	38,252,600
黒田電気	25,400	1,934.00	49,123,600
ネットワンシステムズ	58,900	699.00	41,171,100
エコス	5,300	1,152.00	6,105,600
ワタミ	16,100	1,079.00	17,371,900
マルシェ	3,700	817.00	3,022,900
リックス	3,100	1,198.00	3,713,800
ドンキホーテホールディングス	88,100	3,945.00	347,554,500
丸文	12,200	579.00	7,063,800
西松屋チェーン	26,900	1,482.00	39,865,800
ゼンショーホールディングス	70,100	1,854.00	129,965,400
ハビネット	12,500	1,073.00	13,412,500
幸楽苑ホールディングス	8,800	1,578.00	13,886,400
ハークスレイ	4,000	928.00	3,712,000
橋本総業ホールディングス	2,600	1,587.00	4,126,200
日本ライフライン	6,500	5,480.00	35,620,000
サイゼリヤ	22,400	2,444.00	54,745,600
エクセル	6,700	1,258.00	8,428,600
V Tホールディングス	46,200	539.00	24,901,800
マルカキカイ	4,500	1,220.00	5,490,000
アルゴグラフィックス	6,300	1,968.00	12,398,400
魚力	4,300	1,291.00	5,551,300
I D O M	36,700	579.00	21,249,300
日本エム・ディ・エム	11,400	762.00	8,686,800
ポブラ	3,500	497.00	1,739,500
ユナイテッドアローズ	19,400	2,626.00	50,944,400
進和	8,000	1,505.00	12,040,000
エスケイジャパン	3,200	303.00	969,600
ダイトエレクトロン	6,400	777.00	4,972,800
ハイデイ日高	12,400	2,511.00	31,136,400
シークス	9,700	4,075.00	39,527,500
京都きもの友禅	9,700	879.00	8,526,300
コロワイド	45,300	1,910.00	86,523,000

ピーシーデポコーポレーション	18,120	516.00	9,349,920
田中商事	4,600	671.00	3,086,600
オーハシテクニカ	7,700	1,284.00	9,886,800
壱番屋	12,300	3,615.00	44,464,500
白銅	4,000	1,205.00	4,820,000
トップカルチャー	5,400	484.00	2,613,600
P L A N T	3,200	1,181.00	3,779,200
スギホールディングス	24,400	5,530.00	134,932,000
島津製作所	178,000	1,577.00	280,706,000
J M S	24,000	269.00	6,456,000
クボテック	3,000	499.00	1,497,000
長野計器	8,500	587.00	4,989,500
ブイ・テクノロジー	3,300	12,310.00	40,623,000
スター精密	26,200	1,310.00	34,322,000
東京計器	44,000	172.00	7,568,000
愛知時計電機	1,800	3,175.00	5,715,000
オーバル	13,600	237.00	3,223,200
東京精密	26,600	2,712.00	72,139,200
マニー	18,400	2,368.00	43,571,200
ニコン	257,700	1,570.00	404,589,000
トプコン	46,400	1,508.00	69,971,200
オリンパス	205,700	3,745.00	770,346,500
理研計器	11,200	1,263.00	14,145,600
S C R E E Nホールディングス	28,400	6,700.00	190,280,000
キャノン電子	12,600	1,634.00	20,588,400
タムロン	11,400	1,696.00	19,334,400
H O Y A	306,700	4,106.00	1,259,310,200
ノーリツ鋼機	12,500	747.00	9,337,500
エー・アンド・デイ	12,900	416.00	5,366,400
キャノン	743,200	2,989.50	2,221,796,400
リコー	446,900	919.00	410,701,100
シチズン時計	169,900	557.00	94,634,300
リズム時計工業	61,000	177.00	10,797,000
大研医器	10,900	768.00	8,371,200
メニコン	9,300	2,899.00	26,960,700
スノーピーク	1,600	3,455.00	5,528,000
パラマウントベッドホールディングス	14,600	3,765.00	54,969,000
トランザクション	2,800	1,665.00	4,662,000
S H O B I	5,000	414.00	2,070,000
ニホンフラッシュ	5,400	1,164.00	6,285,600
前田工織	13,900	1,130.00	15,707,000
永大産業	19,000	436.00	8,284,000
アートネイチャー	14,900	616.00	9,178,400
ダンロップスポーツ	8,900	1,007.00	8,962,300
バンダイナムコホールディングス	142,800	3,060.00	436,968,000
アイフィスジャパン	2,400	413.00	991,200
共立印刷	23,900	300.00	7,170,000
S H O E I	6,300	1,802.00	11,352,600
フランスベッドホールディングス	19,500	873.00	17,023,500
マーベラス	23,000	797.00	18,331,000

パイロットコーポレーション	24,100	4,275.00	103,027,500
萩原工業	3,900	2,431.00	9,480,900
エイベックス・グループ・ホールディングス	25,100	1,392.00	34,939,200
トッパン・フォームズ	24,700	1,051.00	25,959,700
フジシールインターナショナル	16,800	4,100.00	68,880,000
タカラトミー	45,500	1,084.00	49,322,000
廣済堂	13,000	303.00	3,939,000
アーク	59,700	76.00	4,537,200
レック	4,600	2,533.00	11,651,800
タカノ	6,400	722.00	4,620,800
プロネクサス	13,000	1,141.00	14,833,000
ホクシン	11,900	210.00	2,499,000
ウッドワン	23,000	237.00	5,451,000
大建工業	10,800	1,966.00	21,232,800
きもと	23,700	244.00	5,782,800
凸版印刷	390,000	937.00	365,430,000
大日本印刷	398,000	1,004.00	399,592,000
図書印刷	26,000	449.00	11,674,000
共同印刷	47,000	341.00	16,027,000
日本写真印刷	23,200	2,557.00	59,322,400
光村印刷	3,000	210.00	630,000
藤森工業	12,400	2,447.00	30,342,800
宝印刷	6,800	1,356.00	9,220,800
前澤化成工業	10,300	1,008.00	10,382,400
アシックス	137,200	2,109.00	289,354,800
ツツミ	7,000	1,633.00	11,431,000
J S P	9,500	2,380.00	22,610,000
ニチハ	19,200	2,423.00	46,521,600
エフピコ	12,800	5,690.00	72,832,000
小松ウオール工業	4,800	1,686.00	8,092,800
ヤマハ	101,500	3,415.00	346,622,500
河合楽器製作所	5,200	1,857.00	9,656,400
クリナップ	16,300	842.00	13,724,600
ピジョン	78,300	2,953.00	231,219,900
天馬	10,800	1,567.00	16,923,600
兼松サステック	14,000	160.00	2,240,000
キングジム	11,600	835.00	9,686,000
リンテック	32,800	2,096.00	68,748,800
T A S A K I	2,700	1,531.00	4,133,700
信越ポリマー	28,400	671.00	19,056,400
東リ	36,000	319.00	11,484,000
イトーキ	29,200	721.00	21,053,200
任天堂	85,000	25,865.00	2,198,525,000
三菱鉛筆	11,400	5,080.00	57,912,000
松風	6,800	1,338.00	9,098,400
タカラスタンダード	28,500	1,887.00	53,779,500
コクヨ	71,800	1,460.00	104,828,000
ナカバヤシ	27,000	232.00	6,264,000
ニフコ	27,700	5,490.00	152,073,000

立川ブラインド工業	6,100	738.00	4,501,800
グローブライド	6,800	1,745.00	11,866,000
岡村製作所	48,300	1,026.00	49,555,800
日本バルカー工業	11,200	1,384.00	15,500,800
MUTOHホールディングス	17,000	227.00	3,859,000
伊藤忠商事	1,069,200	1,271.50	1,359,487,800
丸紅	1,340,700	536.30	719,017,410
スクロール	20,700	377.00	7,803,900
高島	25,000	171.00	4,275,000
ヨンドシーホールディングス	10,400	2,406.00	25,022,400
三陽商会	76,000	159.00	12,084,000
長瀬産業	81,700	1,245.00	101,716,500
ナイガイ	55,000	56.00	3,080,000
蝶理	8,700	1,487.00	12,936,900
豊田通商	151,700	2,403.00	364,535,100
オンワードホールディングス	93,000	713.00	66,309,000
三共生興	20,900	322.00	6,729,800
兼松	290,000	166.00	48,140,000
美津濃	74,000	529.00	39,146,000
ツカモトコーポレーション	25,000	108.00	2,700,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	59,900	6,430.00	385,157,000
ルック	26,000	143.00	3,718,000
三井物産	1,231,900	1,406.50	1,732,667,350
日本紙パルプ商事	71,000	340.00	24,140,000
東京エレクトロン	113,300	8,857.00	1,003,498,100
日立ハイテクノロジーズ	47,200	4,115.00	194,228,000
カメイ	17,700	919.00	16,266,300
東都水産	2,400	1,623.00	3,895,200
OUGホールディングス	20,000	261.00	5,220,000
スターゼン	4,900	5,320.00	26,068,000
セイコーホールディングス	89,000	325.00	28,925,000
山善	52,300	773.00	40,427,900
椿本興業	15,000	299.00	4,485,000
住友商事	857,600	1,198.00	1,027,404,800
日本ユニシス	37,700	1,218.00	45,918,600
内田洋行	34,000	424.00	14,416,000
三菱商事	1,022,400	2,352.50	2,405,196,000
第一実業	31,000	558.00	17,298,000
キャノンマーケティングジャパン	38,800	1,873.00	72,672,400
西華産業	44,000	279.00	12,276,000
佐藤商事	12,400	737.00	9,138,800
菱洋エレクトロ	15,300	1,273.00	19,476,900
東京産業	13,700	387.00	5,301,900
ユアサ商事	12,900	2,392.00	30,856,800
神鋼商事	3,100	1,809.00	5,607,900
小林産業	9,400	255.00	2,397,000
阪和興業	136,000	630.00	85,680,000
カナデン	13,100	993.00	13,008,300
菱電商事	22,000	646.00	14,212,000



ニプロ	102,800	1,288.00	132,406,400
フルサト工業	7,500	1,438.00	10,785,000
岩谷産業	162,000	616.00	99,792,000
すてきナイスグループ	58,000	140.00	8,120,000
昭光通商	50,000	88.00	4,400,000
ニチモウ	22,000	153.00	3,366,000
極東貿易	20,000	194.00	3,880,000
イワキ	21,000	198.00	4,158,000
兼松エレクトロニクス	8,600	1,976.00	16,993,600
三愛石油	33,600	702.00	23,587,200
稲畑産業	32,600	1,082.00	35,273,200
G S Iクレオス	36,000	114.00	4,104,000
明和産業	12,700	310.00	3,937,000
キムラタン	588,000	7.00	4,116,000
ゴールドウイン	6,100	4,690.00	28,609,000
ユニ・チャーム	292,800	2,580.50	755,570,400
デサント	33,000	1,336.00	44,088,000
キング	6,900	389.00	2,684,100
ワキタ	29,000	798.00	23,142,000
ヤマトインターナショナル	9,200	390.00	3,588,000
東邦ホールディングス	43,600	2,167.00	94,481,200
サンゲツ	47,000	1,973.00	92,731,000
ミツウロコグループホールディングス	22,200	591.00	13,120,200
シナネンホールディングス	5,600	2,092.00	11,715,200
伊藤忠エネクス	35,100	820.00	28,782,000
サンリオ	42,000	1,881.00	79,002,000
サンワ テクノス	8,700	723.00	6,290,100
リョーサン	21,600	3,140.00	67,824,000
新光商事	16,000	1,063.00	17,008,000
トーヨー	6,300	2,396.00	15,094,800
三信電気	18,900	867.00	16,386,300
東陽テクニカ	18,000	1,021.00	18,378,000
モスフードサービス	17,800	3,325.00	59,185,000
加賀電子	12,300	1,257.00	15,461,100
三益半導体工業	10,600	1,145.00	12,137,000
ソーダニッカ	14,700	469.00	6,894,300
立花エレテック	10,100	1,017.00	10,271,700
木曽路	16,700	2,305.00	38,493,500
サトレストランシステムズ	16,300	819.00	13,349,700
千趣会	24,700	704.00	17,388,800
タカキュー	10,700	177.00	1,893,900
ケーヨー	23,200	526.00	12,203,200
アデランス	24,100	491.00	11,833,100
上新電機	32,000	874.00	27,968,000
日本瓦斯	20,800	3,255.00	67,704,000
ベスト電器	44,000	121.00	5,324,000
ロイヤルホールディングス	22,600	1,754.00	39,640,400
東天紅	10,000	134.00	1,340,000
いなげや	15,200	1,415.00	21,508,000
島忠	35,200	2,665.00	93,808,000

チヨダ	16,100	2,345.00	37,754,500
ライフコーポレーション	8,600	3,195.00	27,477,000
リンガーハット	12,300	2,442.00	30,036,600
さが美	12,000	113.00	1,356,000
MR MAX	12,400	340.00	4,216,000
テンアライド	13,400	368.00	4,931,200
AOKIホールディングス	31,100	1,178.00	36,635,800
オークワ	20,000	944.00	18,880,000
コメリ	21,000	2,483.00	52,143,000
青山商事	26,100	3,550.00	92,655,000
しまむら	15,800	12,770.00	201,766,000
はせがわ	4,800	430.00	2,064,000
高島屋	198,000	819.00	162,162,000
松屋	27,400	762.00	20,878,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	69,700	1,542.00	107,477,400
近鉄百貨店	52,000	350.00	18,200,000
丸栄	29,000	80.00	2,320,000
ニッセンホールディングス	20,600	67.00	1,380,200
パルコ	12,900	946.00	12,203,400
丸井グループ	167,200	1,384.00	231,404,800
クレディセゾン	103,300	1,729.00	178,605,700
アクシアル リテイリング	10,500	3,605.00	37,852,500
井筒屋	7,400	387.00	2,863,800
イオン	560,600	1,432.50	803,059,500
イズミ	27,100	4,455.00	120,730,500
東武ストア	1,600	2,803.00	4,484,800
フォーバル	7,300	720.00	5,256,000
平和堂	27,600	2,041.00	56,331,600
フジ	15,100	2,157.00	32,570,700
ヤオコー	15,500	4,020.00	62,310,000
ゼビオホールディングス	18,400	1,576.00	28,998,400
ケースホールディングス	57,500	1,702.00	97,865,000
PALTAC	21,800	2,324.00	50,663,200
三谷産業	15,000	319.00	4,785,000
Olympicグループ	8,400	534.00	4,485,600
日産東京販売ホールディングス	22,800	226.00	5,152,800
新生銀行	1,180,000	161.00	189,980,000
あおぞら銀行	862,000	346.00	298,252,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,932,800	510.40	5,580,101,120
りそなホールディングス	1,594,300	423.50	675,186,050
三井住友トラスト・ホールディングス	284,500	3,250.00	924,625,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,091,000	3,386.00	3,694,126,000
第四銀行	173,000	410.00	70,930,000
北越銀行	14,700	2,313.00	34,001,100
千葉銀行	525,000	592.00	310,800,000
群馬銀行	302,600	470.00	142,222,000
武蔵野銀行	21,700	2,680.00	58,156,000
千葉興業銀行	37,400	420.00	15,708,000
筑波銀行	56,800	297.00	16,869,600
七十七銀行	213,000	429.00	91,377,000

青森銀行	99,000	336.00	33,264,000
秋田銀行	89,000	319.00	28,391,000
山形銀行	77,000	430.00	33,110,000
岩手銀行	9,500	4,050.00	38,475,000
東邦銀行	122,000	367.00	44,774,000
東北銀行	71,000	146.00	10,366,000
みちのく銀行	68,000	204.00	13,872,000
ふくおかフィナンシャルグループ	590,000	432.00	254,880,000
静岡銀行	399,000	827.00	329,973,000
十六銀行	170,000	297.00	50,490,000
スルガ銀行	129,300	2,424.00	313,423,200
八十二銀行	246,300	535.00	131,770,500
山梨中央銀行	84,000	474.00	39,816,000
大垣共立銀行	182,000	346.00	62,972,000
福井銀行	117,000	265.00	31,005,000
北國銀行	145,000	321.00	46,545,000
清水銀行	4,700	2,875.00	13,512,500
富山銀行	2,600	3,915.00	10,179,000
滋賀銀行	128,000	505.00	64,640,000
南都銀行	13,200	3,765.00	49,698,000
百五銀行	122,000	382.00	46,604,000
京都銀行	260,000	745.00	193,700,000
紀陽銀行	53,500	1,630.00	87,205,000
三重銀行	6,100	2,095.00	12,779,500
ほくほくフィナンシャルグループ	92,600	1,407.00	130,288,200
広島銀行	402,000	419.00	168,438,000
山陰合同銀行	81,900	707.00	57,903,300
中国銀行	96,500	1,264.00	121,976,000
鳥取銀行	4,400	1,704.00	7,497,600
伊予銀行	145,500	607.00	88,318,500
百十四銀行	149,000	324.00	48,276,000
四国銀行	106,000	232.00	24,592,000
阿波銀行	109,000	651.00	70,959,000
大分銀行	78,000	376.00	29,328,000
宮崎銀行	91,000	283.00	25,753,000
佐賀銀行	83,000	264.00	21,912,000
十八銀行	84,000	309.00	25,956,000
沖縄銀行	12,500	3,385.00	42,312,500
琉球銀行	28,100	1,266.00	35,574,600
セブン銀行	510,700	317.00	161,891,900
みずほフィナンシャルグループ	19,587,700	168.00	3,290,733,600
高知銀行	54,000	109.00	5,886,000
山口フィナンシャルグループ	127,000	1,080.00	137,160,000
アクリーティブ	11,500	374.00	4,301,000
芙蓉総合リース	15,600	5,060.00	78,936,000
興銀リース	25,600	2,083.00	53,324,800
東京センチュリー	32,000	3,515.00	112,480,000
SBIホールディングス	163,500	1,189.00	194,401,500
日本証券金融	59,800	443.00	26,491,400
アイフル	228,200	300.00	68,460,000

日本アジア投資	9,900	339.00	3,356,100
ポケットカード	13,800	498.00	6,872,400
長野銀行	4,500	1,954.00	8,793,000
名古屋銀行	11,400	3,580.00	40,812,000
北洋銀行	205,100	366.00	75,066,600
愛知銀行	4,600	5,150.00	23,690,000
第三銀行	7,800	1,719.00	13,408,200
中京銀行	5,600	2,346.00	13,137,600
大光銀行	49,000	231.00	11,319,000
愛媛銀行	16,000	1,320.00	21,120,000
トマト銀行	5,400	1,524.00	8,229,600
みなと銀行	12,300	1,741.00	21,414,300
京葉銀行	111,000	436.00	48,396,000
関西アーバン銀行	19,000	1,093.00	20,767,000
栃木銀行	70,000	454.00	31,780,000
北日本銀行	4,300	2,823.00	12,138,900
東和銀行	256,000	94.00	24,064,000
福島銀行	168,000	91.00	15,288,000
大東銀行	83,000	166.00	13,778,000
リコーリース	10,700	2,868.00	30,687,600
イオンフィナンシャルサービス	92,700	1,801.00	166,952,700
アコム	273,800	460.00	125,948,000
ジャックス	75,000	398.00	29,850,000
オリエントコーポレーション	588,500	189.00	111,226,500
日立キャピタル	32,100	2,117.00	67,955,700
アプラスフィナンシャル	65,000	102.00	6,630,000
オリックス	964,900	1,443.00	1,392,350,700
三菱UFJリース	345,600	474.00	163,814,400
ジャフコ	22,800	2,990.00	68,172,000
トモニホールディングス	104,600	498.00	52,090,800
大和証券グループ本社	1,275,000	583.00	743,325,000
野村ホールディングス	2,621,700	461.80	1,210,701,060
岡三証券グループ	116,000	525.00	60,900,000
丸三証券	40,400	847.00	34,218,800
東洋証券	53,000	188.00	9,964,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	156,300	498.00	77,837,400
光世証券	33,000	117.00	3,861,000
水戸証券	41,900	242.00	10,139,800
いちよし証券	30,500	773.00	23,576,500
松井証券	66,700	818.00	54,560,600
SOMPOホールディングス	302,700	3,289.00	995,580,300
だいこう証券ビジネス	6,800	502.00	3,413,600
日本取引所グループ	400,100	1,542.00	616,954,200
マネックスグループ	158,300	234.00	37,042,200
カブドットコム証券	116,200	331.00	38,462,200
極東証券	18,300	1,361.00	24,906,300
岩井コスモホールディングス	12,900	912.00	11,764,800
藍澤證券	25,600	563.00	14,412,800
フィデアホールディングス	111,300	168.00	18,698,400

池田泉州ホールディングス	144,500	456.00	65,892,000
アニコム ホールディングス	9,200	2,322.00	21,362,400
MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス	407,200	2,884.00	1,174,364,800
マネースクウェアHD	4,700	1,248.00	5,865,600
ソニーフィナンシャルホールディング ス	130,500	1,378.00	179,829,000
マネーパートナーズグループ	13,000	502.00	6,526,000
小林洋行	4,700	283.00	1,330,100
第一生命ホールディングス	873,100	1,448.50	1,264,685,350
東京海上ホールディングス	552,000	3,994.00	2,204,688,000
イー・ギャランティ	4,500	2,497.00	11,236,500
アサックス	2,500	1,489.00	3,722,500
NECキャピタルソリューション	5,500	1,662.00	9,141,000
T & Dホールディングス	496,600	1,180.50	586,236,300
アドバンスクリエイト	3,300	1,651.00	5,448,300
三井不動産	723,000	2,067.50	1,494,802,500
三菱地所	1,013,000	1,857.50	1,881,647,500
平和不動産	25,800	1,380.00	35,604,000
東京建物	158,200	1,172.00	185,410,400
ダイビル	35,100	890.00	31,239,000
京阪神ビルディング	23,000	526.00	12,098,000
住友不動産	327,000	2,474.50	809,161,500
太平洋興発	59,000	82.00	4,838,000
大京	253,000	188.00	47,564,000
テオーシー	53,000	869.00	46,057,000
東京楽天地	23,000	485.00	11,155,000
レオパレス21	160,500	636.00	102,078,000
スターツコーポレーション	15,700	1,831.00	28,746,700
フジ住宅	17,700	671.00	11,876,700
空港施設	16,800	505.00	8,484,000
明和地所	7,800	567.00	4,422,600
住友不動産販売	9,800	2,069.00	20,276,200
ゴールドクレスト	10,800	1,604.00	17,323,200
リログループ	5,400	16,930.00	91,422,000
日本エスリード	5,600	1,029.00	5,762,400
日神不動産	18,600	336.00	6,249,600
日本エスコン	18,600	311.00	5,784,600
タカラレーベン	59,500	708.00	42,126,000
サンヨーハウジング名古屋	7,200	881.00	6,343,200
イオンモール	88,000	1,471.00	129,448,000
ファースト住建	5,300	1,321.00	7,001,300
ランド	64,400	16.00	1,030,400
東祥	4,300	4,140.00	17,802,000
トーセイ	18,800	731.00	13,742,800
穴吹興産	16,000	242.00	3,872,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	84,800	906.00	76,828,800
サンフロンティア不動産	16,500	963.00	15,889,500
エフ・ジェー・ネクスト	12,100	547.00	6,618,700
ランドビジネス	8,600	257.00	2,210,200

グランディハウス	12,600	353.00	4,447,800
東武鉄道	737,000	503.00	370,711,000
相鉄ホールディングス	237,000	499.00	118,263,000
東京急行電鉄	804,000	747.00	600,588,000
京浜急行電鉄	378,000	1,044.00	394,632,000
小田急電鉄	221,000	2,216.00	489,736,000
京王電鉄	386,000	863.00	333,118,000
京成電鉄	103,500	2,462.00	254,817,000
富士急行	38,000	1,128.00	42,864,000
新京成電鉄	18,000	392.00	7,056,000
東日本旅客鉄道	250,400	9,138.00	2,288,155,200
西日本旅客鉄道	132,900	6,274.00	833,814,600
東海旅客鉄道	123,600	17,205.00	2,126,538,000
西武ホールディングス	146,700	1,713.00	251,297,100
鴻池運輸	19,600	1,385.00	27,146,000
西日本鉄道	179,000	480.00	85,920,000
ハマキョウレックス	10,600	1,864.00	19,758,400
サカイ引越センター	5,500	2,380.00	13,090,000
近鉄グループホールディングス	1,390,000	417.00	579,630,000
阪急阪神ホールディングス	185,300	3,420.00	633,726,000
南海電気鉄道	310,000	482.00	149,420,000
京阪ホールディングス	309,000	699.00	215,991,000
神戸電鉄	33,000	366.00	12,078,000
名古屋鉄道	503,000	542.00	272,626,000
山陽電気鉄道	50,000	506.00	25,300,000
トランコム	4,000	5,980.00	23,920,000
日本通運	534,000	486.00	259,524,000
ヤマトホールディングス	246,900	2,366.00	584,165,400
山九	182,000	589.00	107,198,000
日新	57,000	326.00	18,582,000
丸運	8,800	238.00	2,094,400
丸全昭和運輸	45,000	392.00	17,640,000
センコー	62,200	695.00	43,229,000
トナミホールディングス	29,000	264.00	7,656,000
ニッコンホールディングス	43,900	2,238.00	98,248,200
日本石油輸送	1,600	2,233.00	3,572,800
福山通運	84,000	589.00	49,476,000
セイノーホールディングス	97,900	1,084.00	106,123,600
神奈川中央交通	16,000	701.00	11,216,000
日立物流	28,800	2,020.00	58,176,000
丸和運輸機関	4,200	2,397.00	10,067,400
C & F ロジホールディングス	13,300	1,021.00	13,579,300
日本郵船	1,239,000	207.00	256,473,000
商船三井	672,000	251.00	168,672,000
川崎汽船	604,000	270.00	163,080,000
NSユナイテッド海運	62,000	150.00	9,300,000
明治海運	13,000	366.00	4,758,000
飯野海運	71,600	387.00	27,709,200
共栄タンカー	12,000	188.00	2,256,000
日本航空	264,300	2,931.00	774,663,300

ANAホールディングス	2,562,000	272.70	698,657,400
パスコ	13,000	325.00	4,225,000
三菱倉庫	98,000	1,459.00	142,982,000
三井倉庫ホールディングス	80,000	317.00	25,360,000
住友倉庫	101,000	545.00	55,045,000
澁澤倉庫	36,000	286.00	10,296,000
ヤマタネ	6,500	1,357.00	8,820,500
東陽倉庫	24,000	252.00	6,048,000
乾汽船	11,000	970.00	10,670,000
日本トランスシティ	31,000	380.00	11,780,000
ケイヒン	27,000	130.00	3,510,000
中央倉庫	7,900	966.00	7,631,400
安田倉庫	10,800	607.00	6,555,600
東洋埠頭	40,000	167.00	6,680,000
宇徳	11,400	326.00	3,716,400
上組	164,000	877.00	143,828,000
サンリツ	1,700	485.00	824,500
キムラユニティー	3,700	1,040.00	3,848,000
キューソー流通システム	3,900	2,374.00	9,258,600
郵船ロジスティクス	12,800	1,010.00	12,928,000
近鉄エクスプレス	24,800	1,339.00	33,207,200
東海運	8,300	316.00	2,622,800
エーアイティー	8,600	859.00	7,387,400
内外トランスライン	4,400	929.00	4,087,600
東京放送ホールディングス	81,600	1,602.00	130,723,200
日本テレビホールディングス	124,300	1,780.00	221,254,000
朝日放送	13,400	662.00	8,870,800
テレビ朝日ホールディングス	37,200	1,872.00	69,638,400
スカパーJ S A Tホールディングス	103,400	508.00	52,527,200
テレビ東京ホールディングス	12,300	2,317.00	28,499,100
日本BS放送	3,200	969.00	3,100,800
U-NEXT	3,700	648.00	2,397,600
ワイヤレスゲート	4,100	1,765.00	7,236,500
コネクシオ	12,000	1,349.00	16,188,000
日本通信	96,800	177.00	17,133,600
クロップス	1,400	510.00	714,000
日本電信電話	1,053,300	4,610.00	4,855,713,000
KDDI	1,348,000	3,085.00	4,158,580,000
光通信	16,400	9,230.00	151,372,000
NTTドコモ	1,018,200	2,491.50	2,536,845,300
エムティーアイ	20,900	614.00	12,832,600
GMOインターネット	49,800	1,276.00	63,544,800
カドカワ	42,500	1,477.00	62,772,500
学研ホールディングス	46,000	317.00	14,582,000
ゼンリン	18,000	1,790.00	32,220,000
昭文社	7,600	580.00	4,408,000
インプレスホールディングス	11,100	139.00	1,542,900
東京電力ホールディングス	1,171,100	411.00	481,322,100
中部電力	422,500	1,436.50	606,921,250
関西電力	563,500	916.50	516,447,750

中国電力	190,900	1,222.00	233,279,800
北陸電力	135,300	1,189.00	160,871,700
東北電力	345,000	1,264.00	436,080,000
四国電力	124,300	950.00	118,085,000
九州電力	305,000	905.00	276,025,000
北海道電力	129,300	830.00	107,319,000
沖縄電力	22,000	2,201.00	48,422,000
電源開発	117,700	2,324.00	273,534,800
エフオン	5,900	635.00	3,746,500
イーレックス	4,200	3,360.00	14,112,000
東京瓦斯	1,481,000	455.00	673,855,000
大阪瓦斯	1,429,000	420.60	601,037,400
東邦瓦斯	348,000	918.00	319,464,000
北海道瓦斯	34,000	274.00	9,316,000
広島ガス	24,400	338.00	8,247,200
西部瓦斯	156,000	246.00	38,376,000
静岡ガス	40,300	784.00	31,595,200
メタウォーター	8,900	2,805.00	24,964,500
アイネット	8,580	1,049.00	9,000,420
松竹	90,000	1,204.00	108,360,000
東宝	97,200	3,185.00	309,582,000
エイチ・アイ・エス	23,500	2,567.00	60,324,500
東映	51,000	801.00	40,851,000
AOI Pro.	7,100	800.00	5,680,000
ラックランド	2,200	1,782.00	3,920,400
エヌ・ティ・ティ・データ	84,200	5,100.00	429,420,000
共立メンテナンス	10,900	5,940.00	64,746,000
イチネンホールディングス	15,400	974.00	14,999,600
建設技術研究所	8,800	901.00	7,928,800
スペース	7,800	1,221.00	9,523,800
アインホールディングス	16,400	6,670.00	109,388,000
燦ホールディングス	2,900	1,455.00	4,219,500
ピー・シー・エー	1,900	1,160.00	2,204,000
スバル興業	3,000	408.00	1,224,000
東京テアトル	58,000	117.00	6,786,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	962.00	1,635,400
ナガワ	2,700	3,650.00	9,855,000
よみうりランド	29,000	443.00	12,847,000
東京都競馬	99,000	205.00	20,295,000
常磐興産	5,400	1,506.00	8,132,400
カナモト	20,100	2,501.00	50,270,100
東京ドーム	57,600	951.00	54,777,600
D T S	15,200	2,272.00	34,534,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	57,700	3,395.00	195,891,500
シーイーシー	8,900	1,914.00	17,034,600
カプコン	34,800	2,324.00	80,875,200
西尾レントオール	11,600	2,988.00	34,660,800
アイ・エス・ピー	2,300	835.00	1,920,500



アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	77,000	35.00	2,695,000	
日本空港ビルデング	43,500	3,770.00	163,995,000	
トランス・コスモス	16,800	2,699.00	45,343,200	
乃村工藝社	30,900	1,606.00	49,625,400	
ジャステック	8,700	1,086.00	9,448,200	
S C S K	32,400	3,870.00	125,388,000	
藤田観光	47,000	342.00	16,074,000	
K N T - C Tホールディングス	72,000	111.00	7,992,000	
日本管財	12,400	1,513.00	18,761,200	
トーカイ	6,400	3,415.00	21,856,000	
白洋舎	500	2,419.00	1,209,500	
セコム	150,000	7,534.00	1,130,100,000	
日本システムウエア	5,200	1,707.00	8,876,400	
セントラル警備保障	6,400	1,796.00	11,494,400	
アイネス	19,300	1,156.00	22,310,800	
丹青社	27,100	734.00	19,891,400	
メイテック	17,400	3,475.00	60,465,000	
T K C	12,600	2,930.00	36,918,000	
アサツー ディ・ケイ	23,500	2,769.00	65,071,500	
富士ソフト	20,200	2,779.00	56,135,800	
応用地質	13,600	1,122.00	15,259,200	
船井総研ホールディングス	18,600	1,517.00	28,216,200	
N S D	29,000	1,593.00	46,197,000	
進学会	7,200	494.00	3,556,800	
丸紅建材リース	12,000	183.00	2,196,000	
オオバ	11,000	419.00	4,609,000	
コナミホールディングス	61,500	3,990.00	245,385,000	
学究社	2,200	1,232.00	2,710,400	
ベネッセホールディングス	48,300	2,691.00	129,975,300	
イオンディライト	14,000	3,100.00	43,400,000	
ナック	9,000	851.00	7,659,000	
福井コンピュータホールディングス	4,000	2,321.00	9,284,000	
ニチイ学館	25,200	801.00	20,185,200	
ダイセキ	27,100	2,026.00	54,904,600	
ステップ	5,000	1,208.00	6,040,000	
日鉄住金物産	11,900	3,645.00	43,375,500	
元気寿司	3,900	2,049.00	7,991,100	
トラスコ中山	15,600	5,210.00	81,276,000	
ヤマダ電機	414,100	510.00	211,191,000	
オートバックスセブン	50,400	1,474.00	74,289,600	
アーランドサカモト	23,100	1,188.00	27,442,800	
ニトリホールディングス	58,900	11,920.00	702,088,000	
グルメ杵屋	9,000	989.00	8,901,000	
愛眼	10,800	200.00	2,160,000	
ケーユーホールディングス	7,200	773.00	5,565,600	
吉野家ホールディングス	50,200	1,496.00	75,099,200	
加藤産業	21,300	2,475.00	52,717,500	
イノテック	12,600	467.00	5,884,200	
イエローハット	12,800	2,171.00	27,788,800	

松屋フーズ	6,600	3,090.00	20,394,000
JBCホールディングス	11,400	663.00	7,558,200
JKホールディングス	13,900	503.00	6,991,700
サガミチェーン	18,300	1,255.00	22,966,500
日伝	5,700	2,931.00	16,706,700
関西スーパーマーケット	11,200	1,508.00	16,889,600
ミロク情報サービス	10,100	1,892.00	19,109,200
北沢産業	11,000	163.00	1,793,000
杉本商事	7,900	1,190.00	9,401,000
因幡電機産業	19,100	3,715.00	70,956,500
王将フードサービス	10,000	3,955.00	39,550,000
プレナス	15,200	1,950.00	29,640,000
ミニストップ	10,100	1,819.00	18,371,900
アークス	25,500	2,431.00	61,990,500
パローホールディングス	29,300	2,870.00	84,091,000
バイテックホールディングス	5,600	1,028.00	5,756,800
ミスミグループ本社	153,100	1,958.00	299,769,800
アルテック	12,900	136.00	1,754,400
ベルク	6,700	3,930.00	26,331,000
大 庄	7,400	1,534.00	11,351,600
タキヒヨー	22,000	421.00	9,262,000
ファーストリテイリング	22,700	33,790.00	767,033,000
ソフトバンクグループ	772,100	6,578.00	5,078,873,800
蔵王産業	2,300	1,321.00	3,038,300
スズケン	62,000	3,310.00	205,220,000
サンドラッグ	28,800	8,040.00	231,552,000
サックスパー ホールディングス	12,900	1,102.00	14,215,800
ジェコス	9,400	900.00	8,460,000
ヤマザワ	2,900	1,685.00	4,886,500
やまや	2,800	1,483.00	4,152,400
ルネサスイーストン	11,400	418.00	4,765,200
ベルーナ	34,200	656.00	22,435,200
合計	212,626,940		274,144,773,250

\*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28年10月31日現在

資産総額	3,565,758,985円
負債総額	2,346,211円
純資産総額( - )	3,563,412,774円
発行済数量	1,812,556,745口
1口当たり純資産額( / )	1.9660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28年10月31日現在

資産総額	290,566,534,387円
負債総額	2,811,971,620円
純資産総額( - )	287,754,562,767円
発行済数量	139,847,546,154口
1口当たり純資産額( / )	2.0576円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (3) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係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えない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

### (4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (5) 受益権の再分割

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

### (6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受け付け、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28年10月31日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構（平成28年10月31日現在）

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

## 2.運用計画、売買計画の決定

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成28年10月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	910,496,212,163
追加型株式投資信託	861	11,216,062,117,507
単位型公社債投資信託	57	364,642,142,940
単位型株式投資信託	96	597,823,643,427
合計	1,052	13,089,024,116,037

### 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								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金					利益剰余金 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	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	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 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	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(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。</p>
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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、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</p> <p>(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。</p>
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	第31期
	(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	1,079,828	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	第31期
	(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)
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	第31期
	(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	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
	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
								業務委託料 の支払	8,540	未払金	7,581
	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）XBRL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）
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
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
<b>流動資産合計</b>	<b>25,070,606</b>	<b>25,493,940</b>
<b>固定資産</b>		
<b>有形固定資産</b>		
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
<b>有形固定資産合計</b>	<b>1 198,434</b>	<b>1 191,474</b>
<b>無形固定資産</b>		
電話加入権	12,747	12,747
その他無形固定資産	65	35
<b>無形固定資産合計</b>	<b>12,812</b>	<b>12,782</b>
<b>投資その他の資産</b>		
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
<b>投資その他の資産合計</b>	<b>4,691,245</b>	<b>3,955,916</b>
<b>固定資産合計</b>	<b>4,902,492</b>	<b>4,160,172</b>
<b>資産合計</b>	<b>29,973,099</b>	<b>29,654,112</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	77,889	29,699
リース債務	2,648	1,202
<b>未払金</b>		
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
<b>未払金合計</b>	<b>912,009</b>	<b>851,826</b>
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
<b>流動負債合計</b>	<b>4,183,052</b>	<b>3,895,216</b>
<b>固定負債</b>		
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
<b>固定負債合計</b>	<b>428,109</b>	<b>194,716</b>
<b>負債合計</b>	<b>4,611,161</b>	<b>4,089,932</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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	4,716,474	4,716,474
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	17,872,927	19,042,177
自己株式	-	377,863
株主資本合計	24,635,002	25,426,389
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	726,935	137,791
純資産合計	25,361,937	25,564,180
負債純資産合計	29,973,099	29,654,112

## (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						
	利益準備金	利益剰余金				利益剰余金合計	株主資本合計
		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、配当の効力発効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)
<b>繰延税金資産</b>		
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
<b>繰延税金負債</b>		
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 其他有価証券」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 其他有価証券

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、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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	17,893	19,103
リース債務	345	-
<b>未払金</b>		
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
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	4,524,300	4,524,300
<b>資本剰余金</b>		
資本準備金	2,761,700	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700	2,761,700
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	360,493	360,493
<b>その他利益剰余金</b>		
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
<b>評価・換算差額等</b>		
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	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) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または金融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
水戸証券株式会社	12,272	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成28年3月末日現在

### 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙等にロゴ・マークや図案を使用し、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す。）
- (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。  
（当ファンドの略称：パ国内株）

# 独立監査人の監査報告書

平成28年5月31日

D I A M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D I A M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、D I A M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) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

平成28年11月30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国内株式パッシブ・ファンドの平成27年10月14日から平成28年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 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国内株式パッシブ・ファンドの平成28年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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、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）XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。