

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成28年10月7日
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 西 恵正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	DIAM ETF トピックス
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	株式会社東京証券取引所 (東京都中央区日本橋兜町2番1号)

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DIAM ETF トピックス（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。）

当初元本は1口当たり1,475円とします。

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額 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。当ファンドの基準価額は100口当たりで表示されます。

< 基準価額の照会方法等 >

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

（５）【申込手数料】

販売会社が定める額とします。

消費税および地方消費税に相当する金額（「消費税等相当額」といいます。）がかかります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(6) 【申込単位】

1ユニット以上1ユニット単位とします。

「ユニット」とは、対象指数に連動すると委託会社が想定する現物株式ポートフォリオの1単位に相当する口数の受益権をいいます。

取得申込口数は、100口の整数倍とし、現物株式ポートフォリオ1単位の評価額を取得申込受付日の基準価額で除して得た口数をもとに、取得申込受付日に委託会社が定めます。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：平成28年10月8日から平成29年10月6日まで

(12) その他の記載に該当する場合には、取得申込の受付を行わない場合等があります。

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

(8) 【申込取扱場所】

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、原則としてその保有する現物株式ポートフォリオ等を販売会社に引き渡すものとします。

振替受益権にかかる各取得申込受付日の発行価額の総額に相当する現物株式ポートフォリオ等は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、受託会社の指定するファンド口座に移管されます。

現物株式ポートフォリオ等に金銭が含まれる場合は、当該金銭については、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に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社所定の方法により、その保有する現物株式ポートフォリオ等を販売会社に引き渡すものとします。

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

・株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

・お申込の受付

取得申込みの受付は原則として販売会社の毎営業日に行われます。

取得申込みの受付は原則として正午までにお申込みが行われ、かつ、取得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て取扱います。

原則として、以下の日を取得申込受付日とする申込みはできません。ただし、下記1.から4.に該当する場合であっても、委託会社の判断により、受益権の取得申込みを受け付けることがあります。

- 1.対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内
- 2.対象指数の銘柄変更実施日および銘柄株数変更実施日の各々3営業日前から起算して4営業日以内
- 3.計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内）
- 4.ファンドが終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
- 5.上記1.から4.のほか、委託会社が、運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めるとき

・お申込方法

- ・受益権の取得は、原則として委託会社が事前に提示する現物株式ポートフォリオによる設定に限定します。
- ・委託会社は、取得申込受付日の3営業日前までに、取得申込日に適用される現物株式ポートフォリオの銘柄および数量を申込みユニット数に応じて決定し提示します。
- ・現物株式ポートフォリオの評価額が、取得申込口数に取得申込受付日の基準価額を乗じて得た額に満たない場合は、その差額に相当する金額について金銭を充当するものとします。
- ・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、原則として取得申込のユニット数に応じた現物株式ポートフォリオおよび金銭（「現物株式ポートフォリオ等」という場合があります。）を販売会社に引き渡すものとします。

対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内に該当する日において、委託会社の判断により取得申込みを受け付けるときには、当該取得申込みにかかる有価証券のうち、配当落または権利落対象銘柄の株式の個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを受け付けることができるものとします。この場合において、委託会社は、配当落または権利落対象銘柄の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額として委託会社が定める金額（当該時価総額の0.05%）を徴することができるものとします。

取得申込者が対象指数に採用されている銘柄の株式の発行会社またはその子会社（会社法第2条第3号に規定する子会社をいい、当該発行会社を含めて以下「発行会社等」といいます。）である場合には、取得申込みにかかる有価証券のうち当該発行会社等の株式の個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを受け付けることができるものとします。この場合において、委託会社は、当該発行会社の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額として委託会社が定める金額（当該時価総額の0.05%）を徴することができるものとします。また、取得申込みを当該取得申込者から受け付けた販売会社は、取得申込みを取り次ぐ際に委託会社にその旨を書面をもって通知するものとします。この通知が取得申込みの取次ぎの際に行われなかった場合において、そのことによって信託財産その他に損害が生じたときには、取得申込みを取り次いだ販売会社はその責を負うものとします。

・その他

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、取得のお申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたファンドのお申込みの受付を取り消すことがあります。

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あらかじめ、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、当該取得申込みにかかる現物株式ポートフォリオ等の受渡または支払いと引換えに、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、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、追加信託にかかる現物株式ポートフォリオ等について受入れまたは振替済の通知を受けた場合には、振替機関に対し追加信託が行われた旨を通知するものとし、

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、

ファンドの収益分配金、交換有価証券は、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い、交付されます。

(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、交換等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行われますので、受益証券は発行されません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、東証株価指数(TOPIX)(以下、「対象指数」という場合があります。)に連動する投資成果をめざして運用を行います。

信託財産の1口当たりの純資産額の変動率をTOPIXの変動率に一致させることを目的として、TOPIXに採用されている銘柄(採用予定の銘柄を含む。)の株式に対する投資として運用を行います。

信託財産中に占める個別銘柄の株数の比率は、TOPIXにおける個別銘柄の時価総額構成比率から算出される株数の比率程度を維持することを原則とします。

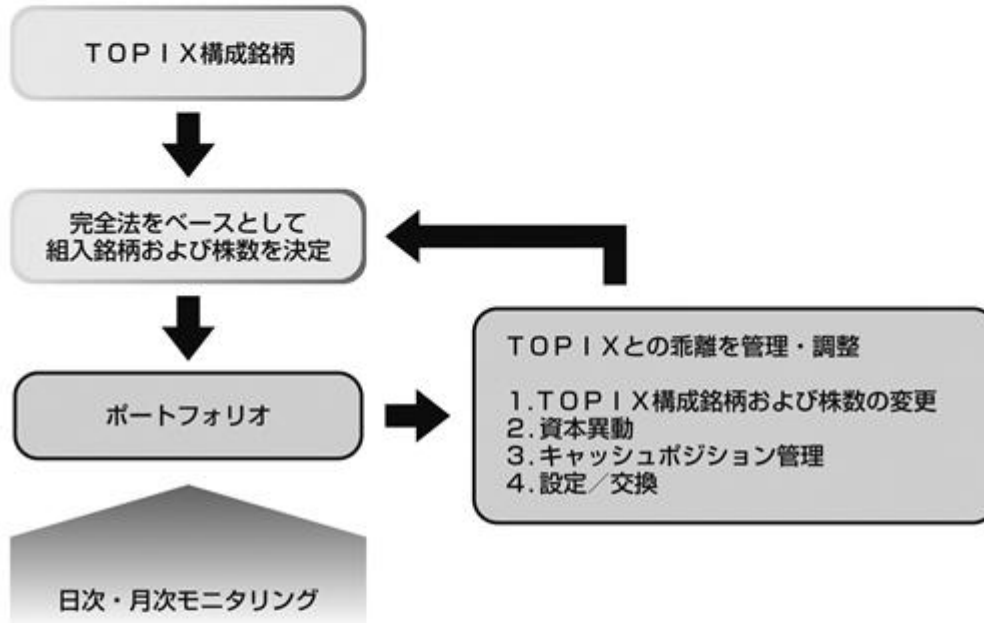
当ファンドの信託の限度額は、10兆円相当額とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1

東証株価指数(TOPIX) (以下、「対象指数」という場合があります。)に連動する投資成果をめざして運用を行います。

- ◆ 信託財産の1口当たりの純資産額の変動率をTOPIXの変動率に一致させることを目的として、TOPIXに採用されている銘柄(採用予定の銘柄を含む。)の株式に対する投資として運用を行います。
- ◆ 信託財産中に占める個別銘柄の株数の比率は、TOPIXにおける個別銘柄の時価総額構成比率から算出される株数の比率程度を維持することを原則とします。



- ・ 対象指数から除外された銘柄は、市場動向等を勘案し速やかに売却することを基本としますが、当該銘柄の流動性等によっては、速やかに売却できない場合があります。
- ・ 対象指数に連動する投資成果を目指すため、信託財産の構成を調整するための指図を行うこと、および補完的に有価証券指数等先物取引等を行うことができます。有価証券先物取引等の利用はヘッジ目的に限定します。

2

当ファンドは投資信託及び投資法人に関する法律により定められる投資信託ですが、通常の投資信託とは異なる仕組みを有しています。

- ◆ 当ファンドの受益権は東京証券取引所に上場され、市場価格で売買することができます。
 - ・ 売買単位は10口単位です。
 - ・ 取引方法は原則として株式と同様です。
 - ・ 売買手数料等詳しくは第一種金融商品取引業者にお問い合わせください。
- ◆ 取得申込み(追加設定)は株式によって行われます。
 - ・ 委託会社は、あらかじめ取得申込みに必要な株式の銘柄およびそれぞれの株数を指定します。取得申込者はこれらの株式を提供することで、引換えに受益権を取得することができます。
 - ・ 所定の条件に該当する場合を除き、金銭による取得申込みを行うことはできません。
- ◆ 受益権を株式と交換することができます。
 - ・ 一定口数以上の受益権を保有する受益者は、それに相当する信託財産中の株式と交換することができます。
 - ・ 通常の投資信託における換金手続きの「解約請求」は、当ファンドでは行うことができません。

東証株価指数(TOPIX)について

- ・ 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」という。)の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び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の指数値及びTOPIXの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ・ 株東京証券取引所は、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。
- ・ 当ファンドは、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、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ・ 株東京証券取引所は、当社又は本件商品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当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

分配方針

年2回の決算時(毎年1月、7月の8日)に収益分配を行います。

分配金額は、経費控除後の配当等収益の全額を原則とします。

- ・ 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)	独立区分	補足分類
単位型投信	国内	株式	MMF	インデックス型
	海外	債券	MRF	
追加型投信	内外	不動産投信		特殊型
		その他資産 ()	ETF	
		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。

独立区分

「ETF」とは投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。

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	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル ()	
大型株 中小型株	年2回	日本	日経225
債券 一般	年4回	北米	
公債 社債	年6回 (隔月)	欧州	
その他債券 クレジット属性 ()	年12回 (毎月)	アジア オセアニア	TOPIX
不動産投信	日々	中南米	
その他資産 ()	その他 ()	アフリカ 中近東 (中東)	その他 ()
資産複合 ()		エマージング	
資産配分固定型 資産配分変更型			

(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

「株式・一般」とは、大型株、中小型株の属性にあてはまらない全てのものをいいます。

決算頻度

「年2回」とは目論見書または投資信託約款において、年2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。

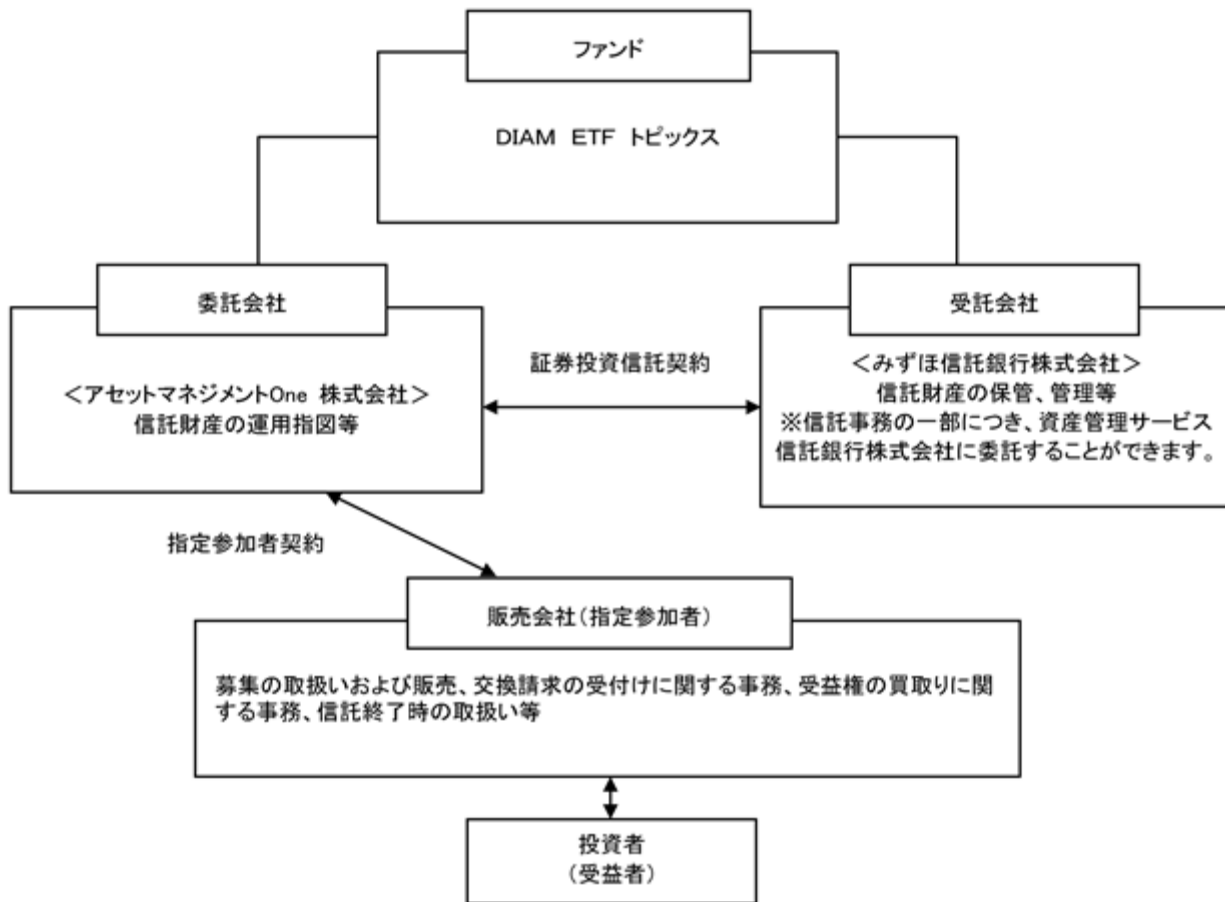
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) でご覧いただけます。

(2) 【ファンドの沿革】

平成27年9月4日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

平成27年9月7日 ファンドの受益権を東京証券取引所へ上場

(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、当ファンドにかかる証券投資信託契約を締結します。

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

- ・「指定参加者契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、指定参加者契約を締結します。

募集の取扱いおよび販売、交換請求の受付、受益権の買取りに関する事務、信託終了時の取扱いにかかる事務の内容等が定められています。

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1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1日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

委託会社は、信託財産の運用にあたっては、以下に掲げる運用の基本方針にしたがって、その指図を行います。

- この信託は、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象指数の変動率に一致させることを目的として、対象指数に採用されている銘柄（採用予定の銘柄を含みます。）の株式に対する投資として運用を行います。
- 信託財産中に占める個別銘柄の株数の比率は、対象指数における個別銘柄の時価総額構成比率から算出される株数の比率程度を維持することを原則とします。なお、対象指数から除外された銘柄は、市場動向等を勘案し速やかに売却することを基本としますが、当該銘柄の流動性等によっては、速やかに売却できない場合があります。
- 1.の方針に沿うよう、信託財産の構成を調整するための指図を行うこと、および補完的に有価証券指数等先物取引等を行うことができます。有価証券先物取引等の利用はヘッジ目的に限定します。
- 市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
- 株式への投資割合には、制限を設けません。
- 外貨建資産への投資は、行いません。

7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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、前記ファンド情報 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 <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18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項に定めるものをいいます。以下同じ。)とします。

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引にかかる権利(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24条に定めるものに限ります。)

ハ. 金銭債権

運用の指図範囲等(約款第19条第1項)

委託会社は信託財産を主として株式に投資することを指図します。

運用の指図範囲等(約款第19条第2項)

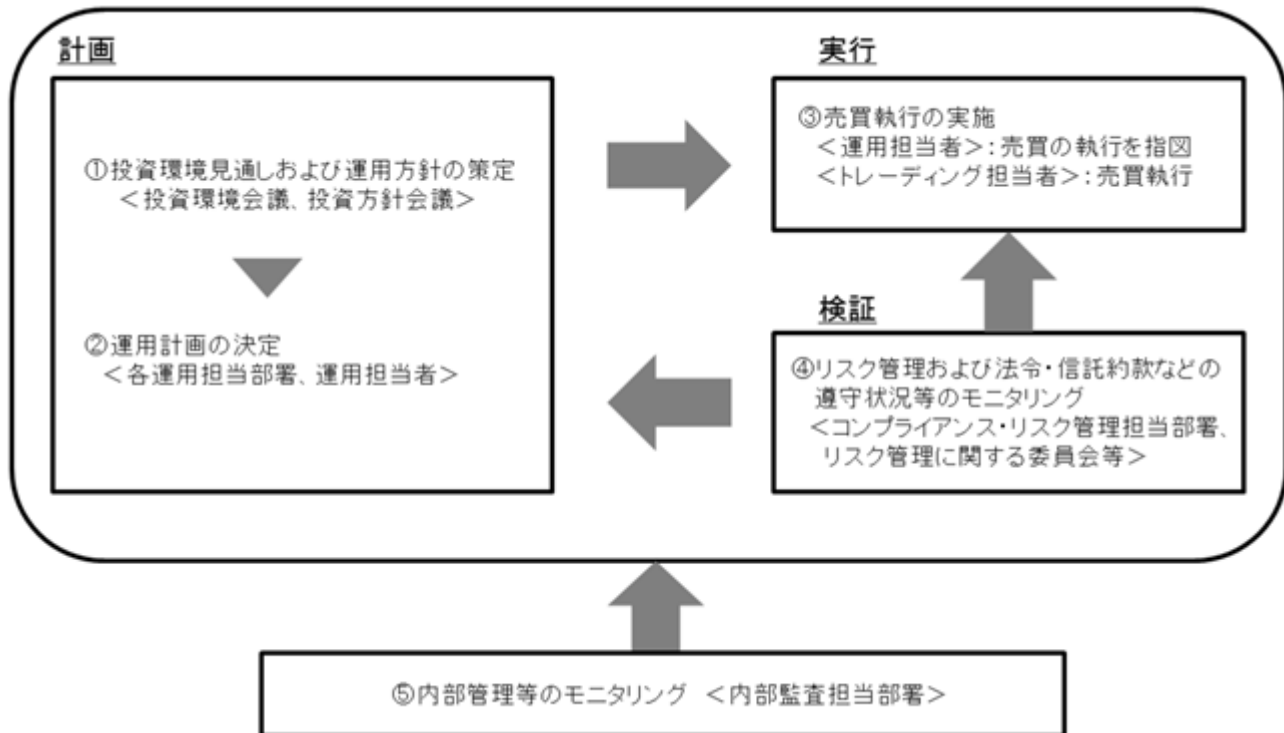
上記の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託財産を、上記に掲げる株式のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することの指図ができます。

1. 預金

2. コール・ローン

(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1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

1 収益分配方針

毎決算時（毎年1月、7月の8日。）に、以下の方針に基づき収益分配を行います。

経費控除後の配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかか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。）の全額を分配することを原則とします。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

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。

2 収益分配方式

(1) 信託財産から生じる配当等収益と前期から繰り越した分配準備積立金は、諸費用および監査費用等ならびに当該諸費用および監査費用等にかかる消費税および地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等相当額を控除し、前期から繰り越した負数の分配準備積立金があるときはその全額を補てんした後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、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。また、収益分配金額の調整のためその一部または全部を信託財産内に留保したときは分配準備積立金として積み立て、次期以降の分配にあてることができます。なお、諸費用および監査費用等ならびに当該諸費用および監査費用等にかかる消費税等相当額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等相当額を控除しきれないときは、その差額を負数の分配準備積立金として次期に繰り越します。

(2) 毎計算期末に信託財産から生じた1. に掲げる利益の合計額は、2. に掲げる損失を控除し、繰越欠損金があるときは、その全額を補てんした後、次期に繰り越します。

1. 有価証券売買益(評価益を含みます。)、先物取引等取引益(評価益を含みます。)、交換(解約)差益金、追加信託差益金
2. 有価証券売買損(評価損を含みます。)、先物取引等取引損(評価損を含みます。)、交換(解約)差損金、追加信託差損金

3 収益分配金の支払い

- (1) 受託会社は、計算期間終了日において受益者名簿に名義登録されている者を計算期間終了日における受益者(以下「名義登録受益者」といいます。)として、当該名義登録受益者に収益分配金を支払います。
- (2) 受託会社は、収益分配金の支払いについて、受益者名簿の作成を委託した者にこれを委託することができます。
- (3) 上記(1)に規定する収益分配金の支払いは、原則として、毎計算期間終了日から起算して40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定する預金口座等に当該収益分配金を振り込む方式または同日から分配金領収証等により行うものとします。なお、名義登録受益者が金融商品取引所の会員と別途収益分配金の取扱いにかかる契約を締結している場合は、当該契約にしたがい支払われるものとします。

(5) 【投資制限】

株式への投資割合には、制限を設けません。(約款第21条)

外貨建資産への投資は、行いません。(約款第21条)

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。(約款第21条)

投資する株式等の範囲(約款第23条)

1) 委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。

2) 上記1)の規定にかかわらず、上場予定の株式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ます。

先物取引等の運用指図(約款第24条)

委託会社は、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。)、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。)、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。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第25条)

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。

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第26条)

- 1) 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を貸付時点において、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範囲内で貸付の指図をすることができます。
- 2) 上記1)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。
- 3) 委託会社は、株式の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

取引相手（約款第58条）

- 1) 委託会社は、当ファンドに関して米国事業体との取引指図を行いません。米国事業体とは、次に掲げる要件のいずれかを満たす事業体をいいます。
 1. 米国法・州法に基づき設立された事業体
 2. 米国法・州法に基づき設立された事業体に、直接的または間接的に支配されている事業体
 3. 米国に所在している事業体
 4. 上記1.から3.のいずれかにあてはまる事業体の代理として、または指示のもと活動している事業体
- 2) 上記1)の規定にかかわらず、次に掲げる場合は、米国事業体を相手とする、または米国事業体を通じた取引を行う場合があります。
 1. 取引が米国事業体の米国外オペレーションとして行われ、当該米国事業体において米国内に所在する従業員が、その購入または売却のアレンジ、交渉、執行に関与していない場合
 2. 取引が関係会社でない市場仲介者の勘定を相手として行われ、その購入または売却が、中央清算機関としての業務を行う清算機関やデリバティブ清算機関を通じて速やかに清算される場合
 3. 取引が代理人として業務を行う関係会社でない市場仲介者を通じて行われ、その購入または売却が取引所や類似の取引システムで匿名で実行され、かつ、中央清算機関としての業務を行う清算機関やデリバティブ清算機関を通じて速やかに清算される場合

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

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

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。

株価変動リスク

当ファンドは株式に投資をしますので、株式市場が下落した場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

信用リスク

当ファンドが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。

流動性リスク

当ファンドにおいて有価証券等を売却または取得する際に、市場規模、取引量、取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。

<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、基準価額が対象指数と連動する投資成果を目指しますが、主として次のような要因があるため、対象指数と一致した推移をすることを運用上お約束できるものではありません。

- ・対象指数の構成銘柄について、指数の算出方法どおりの評価価格若しくは構成銘柄異動のタイミングで取引できない場合があること
- ・当ファンドと対象指数の個別銘柄毎の構成比率が完全に一致しないこと
- ・追加設定の一部が金銭にて行なわれた場合、または組入銘柄の配当金や権利処理等によって、信託財産に現金が発生すること
- ・先物を利用した場合、先物価格と同指数との間に価格差があること
- ・信託報酬等のコスト負担があること

当ファンドの市場価格は、取引所における競争売買を通じ、需給を反映して決まります。したがって、市場価格は基準価額とは必ずしも一致するものではありません。

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、取得申込の受付または交換請求の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付または交換請求の受付を取り消すことができます。

当ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権の口数が200万口を下回ることとなった場合、または、やむを得ない事情が発生した場合は、信託を終了（繰上償還）する場合があります。

委託会社は、信託期間中において下記に該当することとなった場合は、受託会社と合意のうえ、信託を終了（繰上償還）させます。

1. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合
2. 対象指数が廃止された場合
3. 対象指数の計算方法の変更等に伴って委託会社または受託会社が必要と認めた約款の変更が書面決議により否決された場合

なお、1.に掲げる事由によりこの信託契約を解約する場合には、その廃止された日に信託を終了(繰上償還)するための手続きを開始するものとします。

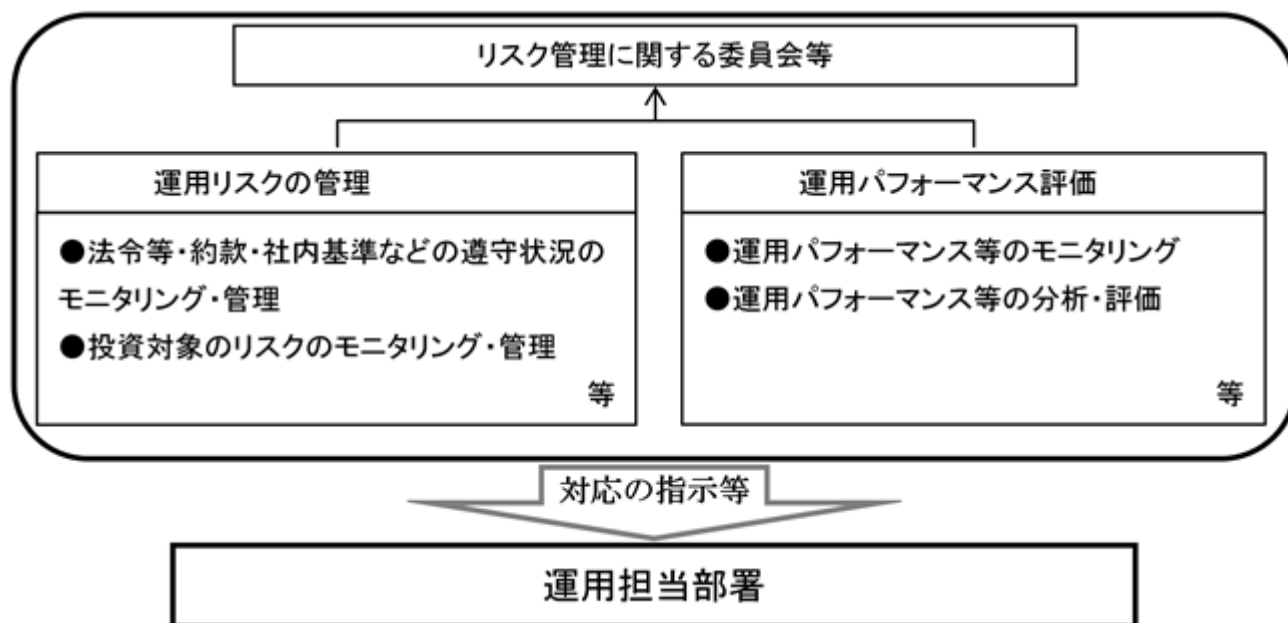
・注意事項

- イ.当ファンドは、株式など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、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。



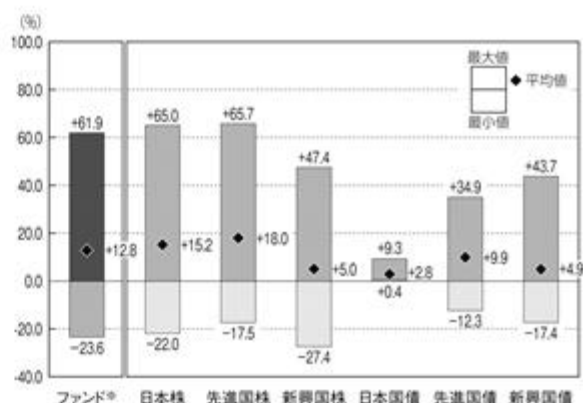
上記体制は平成28年10月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（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8月～2016年7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がない期間については、連動する投資成果を目指す対象指数の年間騰落率を表示しており、ファンドの実績ではありません。

*ファンドの対象指数は東証株価指数(TOPIX)です。

*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。

*ファンドは2016年7月末現在、設定後1年を経過していないため、ファンドの年間騰落率に代えて対象指数の年間騰落率を用いて算出・表示しています。

*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・ディバースィファイド(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(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、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なく、株東京証券取引所は、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・ディバースィファイド」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・セキュリティーズ・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】

販売会社が定める額とします。

消費税等相当額がかかります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。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）

お申込手数料は、商品や投資環境の説明および情報提供等、ならびに取得に関する事務手続き等にかかる費用の対価として、販売会社に支払われます。

(2)【換金（解約）手数料】

販売会社が定める額とします。

消費税等相当額がかかります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。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）

交換手数料は、受益権の交換または受益権の買取りに関する事務手続き等にかかる費用の対価として、販売会社に支払われます。

(3)【信託報酬等】

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、以下により計算される と の合計額とします。

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.08424%（税抜0.078%）以内の率を乗じて得た額
平成28年10月7日現在は、年率0.08424%（税抜0.078%）になります。配分は以下の通りです。

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.050%	委託した資金の運用の対価
受託会社	年率0.028%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行、名義登録事務・分配金支払関係事務等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

株式の貸付の指図を行った場合は、その品貸料に54%（税抜 50%）以内の率を乗じた額につき、委託会社と受託会社で折半します。

信託報酬は、毎日計上され、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】

信託財産留保額

ありません。

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。

受益権の上場にかかる費用(年間上場料(毎年末の純資産総額に対して0.0081%(税抜0.0075%))、追加上場料(追加上場時の増加額(毎年末の純資産総額について、新規上場時および新規上場した年から前年までの各年末の純資産総額のうち最大のものからの増加額)に対して0.0081%(税抜0.0075%))は、信託財産から支払うことができるものとします。

対象指数についての商標(これに類する商標を含みます。)の使用料(信託財産の純資産総額に対して最大年率0.0324%(税抜0.0300%)、ただし162万円(税抜150万円)を下回る場合は162万円(税抜150万円))は、信託財産から支払うことができるものとします。

お申込時に要するその他の費用

- ・対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内に該当する日において、委託会社の判断により取得申込みを受け付けるときには、配当落または権利落対象銘柄の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額として委託会社が定める金額(当該時価総額の0.05%)を徴することができるものとします。
- ・取得申込者が現物株式ポートフォリオに含まれる株式の発行会社等である場合には、原則として当該株式の時価総額に相当する金額を金銭にて支払います。この場合、当該株式を取得するために必要な経費に相当する金額(当該時価総額の0.05%)を金銭にて支払うものとします。

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。

平成28年10月7日現在。

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上特定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

受益権の売却時

売却時の差益（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。

売却価額から取得費用（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

収益分配時

収益分配金は配当所得として課税されます。

原則として、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（申告不要）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、配当控除を適用することができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記と同様の取扱いとなります。

売却時および交換時の差損（譲渡損失）については、一定の条件のもとで確定申告により上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）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ETF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。なお、分配金の受取方法によっては非課税とならない場合があります。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

受益権の売却時

通常の株式の売却時と同様に、譲渡益について、他の法人所得と合算して課税されます。

収益分配金の受取り時

15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率で源泉徴収されます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。なお、当ファンドは、原則として、益金不算入制度の適用が可能です。益金不算入の取扱いは、株式の配当金と同様となります。

受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記と同様の取扱いとなります。

上記は平成28年7月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成28年7月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	45,960,049,610	98.90
内 日本	45,960,049,610	98.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	508,923,158	1.10
純資産総額	46,468,972,768	100.00

その他資産の投資状況

平成28年7月29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)	504,830,000	1.09
内 日本	504,830,000	1.09

(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7月29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	292,000	5,055.24 1,476,132,900	5,894.00 1,721,048,000	- -	3.70%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	1,859,200	428.73 797,104,350	522.00 970,502,400	- -	2.09%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	179,100	4,829.09 864,890,900	4,881.00 874,187,100	- -	1.88%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	131,300	5,398.99 708,887,500	5,703.00 748,803,900	- -	1.61%
5	KDDI 日本	株式 情報・通信業	229,200	3,134.02 718,318,800	3,145.00 720,834,000	- -	1.55%
6	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	185,500	2,775.00 514,762,500	3,308.00 613,634,000	- -	1.32%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	211,300	2,476.66 523,319,200	2,841.50 600,408,950	- -	1.29%
8	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	145,800	4,289.00 625,336,200	4,025.00 586,845,000	- -	1.26%
9	みずほフィナンシャルグルー プ 日本	株式 銀行業	3,296,200	142.05 468,247,800	167.10 550,795,020	- -	1.19%
10	ソニー 日本	株式 電気機器	165,700	3,013.13 499,276,400	3,282.00 543,827,400	- -	1.17%
11	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	173,100	2,795.04 483,821,500	2,749.50 475,938,450	- -	1.02%
12	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	266,900	1,603.50 427,974,150	1,721.50 459,468,350	- -	0.99%
13	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	97,900	4,253.00 416,368,700	4,588.00 449,165,200	- -	0.97%
14	セブン&アイ・ホールディン グス 日本	株式 小売業	96,900	4,078.00 395,158,200	4,303.00 416,960,700	- -	0.90%
15	ファナック 日本	株式 電気機器	23,800	15,500.00 368,900,000	17,325.00 412,335,000	- -	0.89%
16	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	42,900	9,339.00 400,643,100	9,485.00 406,906,500	- -	0.88%
17	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	21,000	18,065.00 379,365,000	19,220.00 403,620,000	- -	0.87%
18	キーエンス 日本	株式 電気機器	5,300	70,710.00 374,763,000	72,920.00 386,476,000	- -	0.83%
19	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	93,900	3,252.66 305,425,600	4,040.00 379,356,000	- -	0.82%
20	キャノン 日本	株式 電気機器	126,400	2,802.65 354,255,350	2,935.00 370,984,000	- -	0.80%

21	花王 日本	株式 化学	62,500	5,827.00 364,187,500	5,553.00 347,062,500	- -	0.75%
22	三菱地所 日本	株式 不動産業	172,000	1,727.50 297,130,000	1,929.00 331,788,000	- -	0.71%
23	日産自動車 日本	株式 輸送用機器	320,100	918.97 294,164,178	1,012.00 323,941,200	- -	0.70%
24	村田製作所 日本	株式 電気機器	24,800	10,475.00 259,780,000	12,825.00 318,060,000	- -	0.68%
25	任天堂 日本	株式 その他製品	14,500	16,270.00 235,915,000	21,505.00 311,822,500	- -	0.67%
26	信越化学工業 日本	株式 化学	44,100	5,901.00 260,234,100	7,064.00 311,522,400	- -	0.67%
27	三菱商事 日本	株式 卸売業	173,900	1,748.10 303,995,900	1,778.50 309,281,150	- -	0.67%
28	ダイキン工業 日本	株式 機械	34,200	8,032.65 274,716,700	9,012.00 308,210,400	- -	0.66%
29	三菱電機 日本	株式 電気機器	250,000	1,108.00 277,000,000	1,217.50 304,375,000	- -	0.66%
30	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	83,000	3,140.48 260,660,000	3,601.00 298,883,000	- -	0.64%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成28年7月29日現在

種類	投資比率
株式	98.90%
合計	98.90%

(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7月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	11.84%
輸送用機器		9.48%
情報・通信業		8.33%
銀行業		7.44%
化学		6.18%
医薬品		5.70%
食料品		5.04%
小売業		4.84%
機械		4.77%
陸運業		4.53%
卸売業		4.01%
サービス業		3.82%
建設業		3.28%
不動産業		2.59%
保険業		2.38%
電気・ガス業		1.86%
その他製品		1.77%
精密機器		1.50%
その他金融業		1.26%
鉄鋼		1.14%
証券、商品先物取引業		0.99%
ガラス・土石製品		0.92%
非鉄金属		0.86%
ゴム製品		0.86%
繊維製品		0.73%
金属製品		0.65%
空運業		0.59%
石油・石炭製品		0.46%
鉱業		0.28%
パルプ・紙		0.26%
海運業	0.21%	
倉庫・運輸関連業	0.20%	
水産・農林業	0.11%	
合計		98.90%

(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】

平成28年7月29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 2809月	買建	38	462,380,648	504,830,000	1.09%

(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7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)	東京証券取引所 市場相場
第1計算期間末 (平成28年1月8日)	40,584	40,937	1,447.21	1,459.81	1,450
第2計算期間末 (平成28年7月8日)	44,899	45,464	1,208.07	1,223.27	-
平成27年9月末日	41,081	-	1,421.97	-	1,407
10月末日	56,298	-	1,570.04	-	-
11月末日	57,095	-	1,592.25	-	1,594
12月末日	43,766	-	1,560.67	-	-
平成28年1月末日	44,435	-	1,432.06	-	1,437
2月末日	33,925	-	1,297.95	-	-
3月末日	51,823	-	1,360.00	-	-
4月末日	51,553	-	1,352.92	-	1,355
5月末日	51,720	-	1,393.13	-	-
6月末日	46,816	-	1,259.66	-	1,269
7月末日	46,468	-	1,320.78	-	1,332

(注) 計算期間末日が休業日の場合は、前営業日の市場相場を記載しております。

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	12.60
第2計算期間	15.20

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.0
第2計算期間	15.5

(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147,500円(100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	35,858,160	7,815,108
第2計算期間	24,924,100	15,800,837

(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。

(注3) 解約口数は交換口数を表示しております。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2016年7月29日

基準価額・純資産の推移

(設定日(2015年9月4日)~2016年7月29日)



※基準価額(分配金再投資)は、設定当初の投資元本147,500円(100口当たり)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:2015年9月4日)

※基準価額は信託報酬控除後です。

分配の推移(税引前)

第1期 (2016.01.08)	1,260円
第2期 (2016.07.08)	1,520円
設定来累計	2,780円

(注)分配金は100口当たりです。

主要な資産の状況

(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。資産の種類の内書は、当該資産の発行体の国または地域別です。

ポートフォリオの状況

資産の種類	投資比率(%)
株式	98.90
内 日本	98.90
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.10
純資産総額	100.00

その他資産の投資状況

資産の種類	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1.09

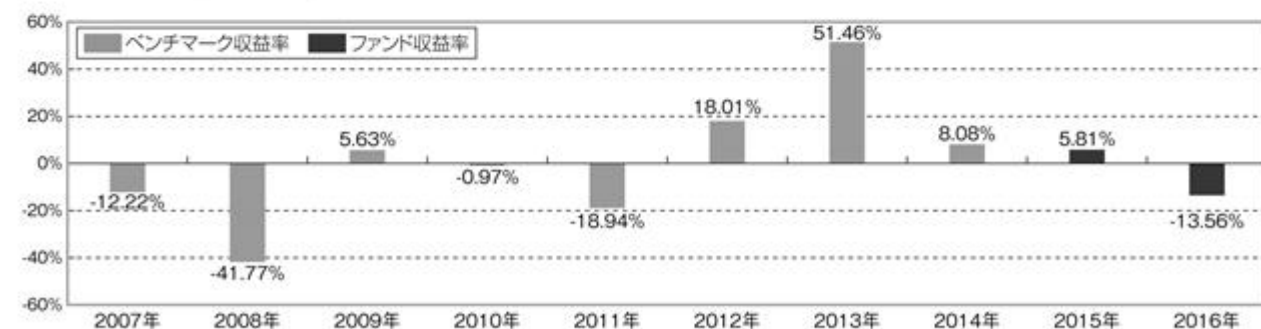
組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	11.84%
2	輸送用機器	9.48%
3	情報・通信業	8.33%
4	銀行業	7.44%
5	化学	6.18%

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	3.70%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.09%
3	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.88%
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.61%
5	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.55%
6	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.32%
7	本田技研工業	株式	日本	輸送用機器	1.29%
8	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	1.26%
9	みずほフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.19%
10	ソニー	株式	日本	電気機器	1.17%

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あります。

※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、2015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。

※2014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)」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】

・お申込の受付

取得申込みの受付は原則として販売会社の毎営業日に行われます。

取得申込みの受付は原則として正午までにお申込みが行われ、かつ、取得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て取扱います。

原則として、以下の日を取得申込受付日とする申込みはできません。ただし、下記1.から4.に該当する場合であっても、委託会社の判断により、受益権の取得申込みを受け付けることがあります。

- 1.対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内
- 2.対象指数の銘柄変更実施日および銘柄株数変更実施日の各々3営業日前から起算して4営業日以内
- 3.計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内）
- 4.ファンドが終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
- 5.上記1.から4.のほか、委託会社が、運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めるとき

・お申込単位

1ユニット以上1ユニット単位とします。

「ユニット」とは、対象指数に連動すると委託会社が想定する現物株式ポートフォリオの1単位に相当する口数の受益権をいいます。

取得申込口数は、100口の整数倍とし、現物株式ポートフォリオ1単位の評価額を取得申込受付日の基準価額で除して得た口数をもとに、取得申込受付日に委託会社が定めます。

・お申込価額

取得申込受付日の基準価額 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。当ファンドの基準価額は100口当たりで表示されます。

< 基準価額の照会方法等 >

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）

・お申込方法

受益権の取得は、原則として委託会社が事前に提示する現物株式ポートフォリオによる設定に限定します。

委託会社は、取得申込受付日の3営業日前までに、取得申込日に適用される現物株式ポートフォリオの銘柄および数量を申込みユニット数に応じて決定し、提示します。

現物株式ポートフォリオの評価額が、取得申込口数に取得申込受付日の基準価額を乗じて得た額に満たない場合は、その差額に相当する金額について金銭を充当するものとします。

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、原則として取得申込のユニット数に応じた現物株式ポートフォリオおよび金銭(現物株式ポートフォリオ等)を販売会社に引き渡すものとします。

対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日から起算して3営業日以内に該当する日において、委託会社の判断により取得申込みを受け付けるときには、当該取得申込みにかかる有価証券のうち、配当落または権利落対象銘柄の株式の個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを受け付けることができるものとします。この場合において、委託会社は、配当落または権利落対象銘柄の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額として委託会社が定める金額(当該時価総額の0.05%)を徴することができるものとします。

取得申込者が対象指数に採用されている銘柄の株式の発行会社またはその子会社(会社法第2条第3号に規定する子会社をいい、当該発行会社を含めて以下「発行会社等」といいます。)である場合には、取得申込みにかかる有価証券のうち当該発行会社等の株式の個別銘柄時価総額に相当する金額については、金銭をもって取得申込みを受け付けることができるものとします。この場合において、委託会社は、当該発行会社の株式を信託財産において取得するために必要な経費に相当する金額として委託会社が定める金額(当該時価総額の0.05%)を徴することができるものとします。また、取得申込みを当該取得申込者から受け付けた販売会社は、取得申込みを取り次ぐ際に委託会社にその旨を書面をもって通知するものとします。この通知が取得申込みの取次ぎの際に行われなかった場合において、そのことによって信託財産その他に損害が生じたときには、取得申込みを取り次いだ販売会社がその責を負うものとします。

・申込手数料

販売会社が定める額とします。

消費税等相当額がかかります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。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)

・その他

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、取得申込みの受け付けを中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受け付けを取り消すことができます。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、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、当該取得申込みにかかる現物株式ポートフォリオ等の受渡または支払いと引換えに、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、追加信託にかかる現物株式ポートフォリオ等について受入れまたは振替済の通知を受けた場合には、振替機関に対し追加信託が行われた旨を通知するものとします。

2【換金（解約）手続等】

・解約の受付

解約の請求はできません。

・交換の受付

受益者は、毎営業日、自己に帰属する受益権と信託財産に属する有価証券との交換（「交換」といいます。）を請求できます。受益者が交換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。

交換請求の受付は、原則として正午までに交換請求が行われ、かつ、交換請求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該交換請求受付日の請求として取扱います。

原則として、以下の日を交換請求受付日とする請求はできません。ただし、下記1.から4.に該当する場合であっても、委託会社の判断により、受益権の交換請求を受け付けることがあります。

- 1.対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日
 - 2.対象指数の銘柄変更実施日および銘柄株数変更実施日の各々3営業日前から起算して6営業日以内
 - 3.計算期間終了日の4営業日前から起算して4営業日以内（ただし、計算期間終了日が休業日の場合は、当該計算期間終了日の5営業日前から起算して5営業日以内）
 - 4.ファンドが終了することとなる場合において、信託終了日の直前5営業日間
 - 5.上記1.から4.のほか、委託会社が、約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合その他やむを得ない事情があると認めたとき
- また、委託会社は約款に定める運用の基本方針に沿った運用に支障をきたすおそれがあると判断した場合に、大口の交換請求に制限を設ける場合があります。

・交換単位

委託会社が定める口数（最小交換口数）の整数倍とします。

「最小交換口数」は、委託会社が交換請求受付日の3営業日前までに提示します。

・交換価額

交換にかかる受益権の評価額は交換請求受付日の基準価額 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。

< 基準価額の照会方法等 >

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)

・交換の方法

委託会社は、交換の請求を受け付けた場合には、受益者から提示された口数から受益者が取得できる個別銘柄の有価証券の数と、交換に要する受益権の口数を計算します。

委託会社は、受託会社に対し、上記により計算された口数の受益権と信託財産に属する有価証券のうち取引所売買単位(金融商品取引所が定める一売買単位をいいます。)の整数倍となる有価証券を交換するよう指図します。

受益者への交換有価証券の交付に際しては、原則として交換請求受付日から起算して4営業日目から振替機関等の口座に交換請求を行った受益者にかかる有価証券の増加の記載または記録が行われます。

交換の請求を行った受益者が対象指数に採用されている銘柄の株式の発行会社等である場合には、原則として、委託会社は、交換に要する受益権の口数から当該発行会社の株式の個別銘柄時価総額に相当する口数を除いた口数の受益権と、取引所売買単位の整数倍となる有価証券(当該発行会社の株式を除きます。)を交換するよう指図するものとします。なお、この場合、当該交換の請求を受益者から受け付けた販売会社は、交換の請求を取り次ぐ際に委託会社にその旨を書面をもって通知するものとします。この通知が交換の請求の取次ぎの際に行われなかった場合において、そのことによって信託財産その他に損害が生じたときには、交換の請求を取り次いだ販売会社がその責を負うものとします。

対象指数の構成銘柄の配当落日および権利落日の各々前営業日に該当する日において、委託会社の判断により、受益権の交換請求を受け付けた場合には、交換に要する受益権の口数と信託財産に属する有価証券のうち取引所売買単位の整数倍となる有価証券(当該配当落または権利落対象銘柄(以下、「対象銘柄」という場合があります。))を除きます。)および当該対象銘柄の個別銘柄時価総額に相当する金銭を交換するよう指図します。

・交換手数料

販売会社が定める額とします。

消費税等相当額がかかります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。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)

・その他

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、交換請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた交換請求の受付を取り消すことがあります。交換請求の受付を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交換請求を撤回できます。ただし、受益者がその交換請求を撤回しない場合には、当該受益権の交換価額は、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交換請求を受け付けたものとして計算した価額とします。

販売会社は、振替機関の定める方法により、振替受益権の抹消にかかる手続きを行うものとします。当該抹消にかかる手続きおよび交換有価証券にかかる振替の請求が行われた後に、振替機関は、当該交換にかかる受益権の口数と同口数の振替受益権を抹消するものとし、社振法の規定にしたがい振替機関等の口座に交換の請求を行った受益者にかかる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、交換請求の受付日の翌営業日以降、交換によって抹消されることとなる振替受益権と同口数の受益権を失効したのものとして取り扱うこととし、受託会社は委託会社の交換の指図に基づいて、交換にかかる振替受益権については、振替口座簿における抹消の手続きおよび交換有価証券の振替日における抹消の確認をもって、当該振替受益権を受入れ抹消したのものとして取り扱います。

・買取り

販売会社は、次に該当する場合で受益者の請求があるときは、受益権を買い取ります。

買取請求の受付は、原則として販売会社の定める時刻までに買取請求が行われ、かつ、買取請求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買取請求受付分とします。

ただし、2.の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。

1. 交換により生じた取引所売買単位未満の振替受益権
2. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止になったとき

受益権の買取価額は、買取請求の受付日の基準価額とします。

販売会社は、受益権の買取りを行うときは、販売会社が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を徴することができるものとします。

販売会社は、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、委託会社との協議に基づいて受益権の買取りを停止することおよびすでに受け付けた受益権の買取りを取り消すことができます。

受益権の買取りが停止された場合には、受益者は買取停止以前に行った当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、買取停止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取請求を受け付けたものとします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

なお、当ファンドの基準価額は100口当たりで表示されます。

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27年9月4日から無期限です。

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】

計算期間は、原則として毎年1月9日から7月8日まで、および7月9日から翌年1月8日までとすることを原則とし、最終計算期間の終了日は信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、信託財産の一部を受益権と交換することにより受益権の口数が200万口を下回ることとなった場合、または、やむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、信託期間中において次の1.から3.に該当することとなった場合は、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出るものとします。
 1. 受益権を上場したすべての金融商品取引所において上場廃止となった場合
 2. 対象指数が廃止された場合
 3. 対象指数の計算方法の変更等に伴って委託会社または受託会社が必要と認めた約款の変更が書面決議により否決された場合

なお、1.に掲げる事由によりこの信託契約を解約する場合には、その廃止された日に信託を終了するための手続きを開始するものとします。

- c. 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、信託契約にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- d. 上記c.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。以下本d.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。
- e. 上記c.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。
- f. 上記c.からe.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、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c.からe.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- g. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- h. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、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、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。
- i. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に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、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- j. 信託契約の解約を行う場合には、書面決議において当該解約に反対した受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続きに関する事項は、上記c.に規定する書面に付記します。

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、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合(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、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.の変更事項にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及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、約款にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本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. 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、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、この信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、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、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがい約款を変更します。
- i. 重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続に関する事項は、上記b.に規定する書面に付記します。

八．関係法人との契約の更改

証券投資信託の指定参加者契約について、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。

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金に対する請求権および名義登録

受益者(計算期間終了日において受益者名簿に名義登録されている受益者(「名義登録受益者」といいます。))とします。)は、収益分配金を持分にに応じて請求する権利を有します。

受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。

収益分配金は、原則として、毎計算期間終了日から起算して40日以内の委託会社の指定する日に、名義登録受益者があらかじめ指定する預金口座等に当該収益分配金を振り込む方式または同日から分配金領収証等により支払われます。

(注) 受託会社は、ファンドにかかる受益者名簿を作成し、受益者について、その氏名または名称、住所および個人番号(行政手続における特定の個人を識別するための番号の利用等に関する法律(平成二十五年法律第二十七号)第二条第五項に規定する個人番号をいう。以下同じ。)または法人番号(同条第十五項に規定する法人番号をいう。以下同じ。)(個人番号または法人番号を有しない者にあつては、氏名または名称および住所。)、その他受託会社が定める事項を、受益者名簿に名義登録するものとします。また、計算期間終了日において、社振法等関係法令、諸規則等に基づき、振替機関より通知を受けた受益権の帰属者を振替機関等の振替口座簿に記載または記録された受益権にかかる受益者として、その氏名または名称、住所および個人番号または法人番号(個人番号もしくは法人番号を有しない者または収益の分配につき租税特別措置法第9条の3の2第1項に規定する支払の取扱者を通じて交付を受ける者にあつては、氏名または名称および住所。)、その他受託会社の定める事項を受益者名簿に登録するものとします。なお、受託会社は他の証券代行会社等、受託会社が適当と認める者と委託契約を締結し、受益者名簿の作成および受益者名簿への名義登録を委託することができます。

受益者は、ファンドの受益権が上場されている金融商品取引所の会員(口座管理機関であるものに限り、)を経由して受益者名簿の名義登録を請求することができます。この場合、当該会員は、当該会員が定める手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を徴することができるものとします。ただし、証券金融会社等は登録を受託会社(受託会社が受益者名簿の作成を委託した場合は、その委託をした者)に対して直接に行うことができます。

名義登録は、毎計算期間の末日の翌日から15日間停止するものとします。また、ファンドが終了することとなる場合は、信託終了日の直前5営業日間において名義登録を停止するものとします。

(2) 信託終了時の交換請求権

受益者は、信託が終了するときは、持ち分に応じて交換を請求する権利を有します。

委託会社は、この信託が終了するときは、委託会社が別に定める一定口数以上の受益権を有する受益者に対しては、信託財産に属する有価証券を当該受益権として振替口座簿に記載または記録されている振替受益権と引換えに交換するものとします。この場合、受益者が取得する個別銘柄の株数は、信託終了日の5営業日前の日の基準価額に基づいて計算された株数とし、取引所売買単位の整数倍とします。その他の事項については、「2 換金(解約)手続等」の規定に準じるものとします。

販売会社は、委託会社が別に定める一定口数未満の受益権について買取るものとします。この場合には、当該販売会社が別に定める手数料および当該手数料に対する消費税等相当額を徴することができるものとします。

この信託が終了するときは、販売会社は、その所有にかかるすべての受益権を交換請求するものとします。交換により引渡される株式に当該販売会社の発行する株式または当該販売会社が子会社となる株式が含まれる場合には、委託会社は、受託会社に対しこれを売却する指図をするとともに、当該株式等の評価額に相当する口数の受益権を、受託会社は信託財産をもって買取るものとします。

受益者が、信託終了時における交換による有価証券、信託終了にかかる金銭および買取りにかかる金銭について信託終了日から10年間その受渡しを請求しないときは、その権利を失います。

(3) 交換請求権および買取請求権

受益者は、保有する受益権について、交換または買取りを請求する権利を有します。権利行使の方法等については、「2 換金(解約)手続等」をご参照下さい。

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) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。

(3) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、平成27年9月4日から平成28年1月8日までとなっております。

(4) 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2期計算期間(平成28年1月9日から平成28年7月8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】

DIAM ETF トピックス

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 平成28年1月8日現在	第2期 平成28年7月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	771,398,190	932,976,558
株式	40,111,813,010	44,457,897,740
派生商品評価勘定	-	328,056
未収配当金	53,885,600	73,957,419
前払金	61,394,144	79,863,892
差入委託証拠金	27,701,856	47,283,108
流動資産合計	41,026,192,800	45,592,306,773
資産合計	41,026,192,800	45,592,306,773
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	35,426,368	33,203,720
未払金	29,682,552	59,118,456
未払収益分配金	353,342,455	564,927,988
未払受託者報酬	5,018,328	7,105,152
未払委託者報酬	8,961,319	12,687,803
その他未払費用	9,517,898	15,887,157
流動負債合計	441,948,920	692,930,276
負債合計	441,948,920	692,930,276
純資産の部		
元本等		
元本	1 41,363,501,700	1 54,820,314,625
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2 779,257,820	2 9,920,938,128
(分配準備積立金)	1,222,724	3,404,514
元本等合計	40,584,243,880	44,899,376,497
純資産合計	40,584,243,880	44,899,376,497
負債純資産合計	41,026,192,800	45,592,306,773

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	平成27年9月4日 平成28年1月8日	自	平成28年1月9日 平成28年7月8日
営業収益				
受取配当金		377,593,330		597,391,033
受取利息		65,320		41,568
有価証券売買等損益		6,785,784		8,708,628,279
派生商品取引等損益		21,846,544		131,931,736
その他収益		404,074		537,593
営業収益合計		349,430,396		8,242,589,821
営業費用				
支払利息		-		101,232
受託者報酬		5,018,328		7,105,152
委託者報酬		8,961,319		12,687,803
その他費用		19,517,898		110,966,229
営業費用合計		23,497,545		30,860,416
営業利益又は営業損失()		325,932,851		8,273,450,237
経常利益又は経常損失()		325,932,851		8,273,450,237
当期純利益又は当期純損失()		325,932,851		8,273,450,237
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額()		-		-
期首剰余金又は期首欠損金()		-		779,257,820
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		2,908,657,625
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		2,908,657,625
剰余金減少額又は欠損金増加額		751,848,216		3,211,959,708
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		749,927,790		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,920,426		3,211,959,708
分配金		2353,342,455		2564,927,988
期末剰余金又は期末欠損金()		779,257,820		9,920,938,128

(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	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	第1期 平成28年1月8日現在	第2期 平成28年7月8日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部交換元本額	20,565,128,500円 32,325,657,500円 11,527,284,300円	41,363,501,700円 36,763,047,500円 23,306,234,575円
2. 受益権の総数	28,043,052口	37,166,315口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は779,257,820円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は9,920,938,128円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期	第2期
	自 平成27年9月4日 至 平成28年1月8日	自 平成28年1月9日 至 平成28年7月8日
1. 1 その他費用	その他費用の内訳は、監査費用(358,384円)、ライセンス料(5,209,106円)、その他(3,950,408円)となっております。	その他費用の内訳は、監査費用(357,951円)、ライセンス料(7,754,146円)、その他(2,854,132円)となっております。
2. 2 分配金の計算過程	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当金等収益額(378,062,724円)及び分配準備積立金(0円)の合計額から、経費(23,497,545円)を控除して計算される分配対象額は354,565,179円(100口当たり1,264円)であり、うち353,342,455円(100口当たり1,260円)を分配金額としております。	当計算期間中に計上した受取配当金、配当株式、受取利息及びその他収益金から支払利息を控除した当期配当金等収益額(597,868,962円)及び分配準備積立金(1,222,724円)の合計額から、経費(30,759,184円)を控除して計算される分配対象額は568,332,502円(100口当たり1,529円)であり、うち564,927,988円(100口当たり1,520円)を分配金額としております。

(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1期 自 平成27年9月4日 至 平成28年1月8日	第2期 自 平成28年1月9日 至 平成28年7月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。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	運用部門から独立した運用リスク管理を所管するグループがリスクを把握、管理し、運用部門への是正指示を行うなど、適切な管理を行っております。また運用リスク管理の結果については月次でリスク管理に関する委員会に報告しております。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成28年1月8日現在	第2期 平成28年7月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(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	第1期 平成28年1月8日現在	第2期 平成28年7月8日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	760,650,021	6,505,380,154
合計	760,650,021	6,505,380,154

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	第1期 平成28年1月8日 現在				第2期 平成28年7月8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	498,456,000	-	463,040,000	35,416,000	468,824,000	-	435,960,000	32,864,000
合計	498,456,000	-	463,040,000	35,416,000	468,824,000	-	435,960,000	32,864,000

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 平成28年1月8日現在	第2期 平成28年7月8日現在
	1口当たり純資産額 （100口当たり純資産額）	1,447.21円 (144,721円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成28年7月8日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	12,000	257.00	3,084,000	
日本水産	32,000	500.00	16,000,000	
マルハニチロ	5,700	2,698.00	15,378,600	
ハウスイ	2,000	106.00	212,000	
カネコ種苗	1,000	1,318.00	1,318,000	
サカタのタネ	4,100	2,142.00	8,782,200	
ホクト	2,800	1,845.00	5,166,000	
ホクリヨウ	300	844.00	253,200	
ショーボンドホールディングス	2,900	4,480.00	12,992,000	
ミライト・ホールディングス	8,600	1,072.00	9,219,200	
タマホーム	2,100	423.00	888,300	
サンヨーホームズ	600	473.00	283,800	
住石ホールディングス	8,200	79.00	647,800	
日鉄鉱業	8,000	312.00	2,496,000	
三井松島産業	18,000	95.00	1,710,000	
国際石油開発帝石	146,500	741.50	108,629,750	
日本海洋掘削	800	2,108.00	1,686,400	
石油資源開発	4,400	1,948.00	8,571,200	
K&Oエナジーグループ	1,900	1,252.00	2,378,800	
ダイセキ環境ソリューション	600	987.00	592,200	
安藤・間	18,600	547.00	10,174,200	
東急建設	9,100	929.00	8,453,900	
コムシスホールディングス	12,000	1,636.00	19,632,000	
ミサワホーム	3,300	672.00	2,217,600	
ビーアールホールディングス	1,100	393.00	432,300	
高松コンストラクショングループ	2,100	2,361.00	4,958,100	
東建コーポレーション	1,100	8,000.00	8,800,000	
ソネック	300	581.00	174,300	
ヤマウラ	1,300	520.00	676,000	
大成建設	144,000	811.00	116,784,000	
大林組	83,400	1,045.00	87,153,000	
清水建設	85,000	931.00	79,135,000	
飛島建設	22,300	160.00	3,568,000	
長谷工コーポレーション	32,500	928.00	30,160,000	
松井建設	3,100	1,067.00	3,307,700	
銭高組	4,000	296.00	1,184,000	
鹿島建設	130,000	694.00	90,220,000	
不動テトラ	19,600	154.00	3,018,400	
大末建設	1,100	880.00	968,000	
鉄建建設	17,000	275.00	4,675,000	
西松建設	32,000	480.00	15,360,000	
三井住友建設	106,600	84.00	8,954,400	
大豊建設	11,000	462.00	5,082,000	

前田建設工業	17,000	785.00	13,345,000
佐田建設	1,900	351.00	666,900
ナカノフード建設	2,100	382.00	802,200
奥村組	26,000	546.00	14,196,000
東鉄工業	3,300	2,857.00	9,428,100
イチケン	3,000	245.00	735,000
浅沼組	9,000	198.00	1,782,000
戸田建設	32,000	436.00	13,952,000
熊谷組	41,000	280.00	11,480,000
青木あすなろ建設	1,800	617.00	1,110,600
北野建設	6,000	239.00	1,434,000
植木組	3,000	205.00	615,000
三井ホーム	4,000	419.00	1,676,000
矢作建設工業	3,800	800.00	3,040,000
ピーエス三菱	3,300	353.00	1,164,900
日本ハウスホールディングス	5,700	307.00	1,749,900
大東建託	10,200	16,255.00	165,801,000
新日本建設	3,300	764.00	2,521,200
NIPPPO	6,000	1,694.00	10,164,000
東亜道路工業	5,000	251.00	1,255,000
前田道路	9,000	1,748.00	15,732,000
日本道路	8,000	371.00	2,968,000
東亜建設工業	24,000	153.00	3,672,000
若築建設	16,000	136.00	2,176,000
東洋建設	8,700	417.00	3,627,900
五洋建設	30,900	518.00	16,006,200
大林道路	3,200	609.00	1,948,800
世紀東急工業	4,400	473.00	2,081,200
福田組	5,000	968.00	4,840,000
日本ドライケミカル	300	2,075.00	622,500
住友林業	19,100	1,420.00	27,122,000
日本基礎技術	3,100	318.00	985,800
日成ビルド工業	8,000	570.00	4,560,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	14,000	67.00	938,000
巴コーポレーション	3,500	322.00	1,127,000
パナホーム	10,000	796.00	7,960,000
大和ハウス工業	82,200	2,757.50	226,666,500
ライト工業	5,300	1,049.00	5,559,700
積水ハウス	93,000	1,653.00	153,729,000
日特建設	3,000	383.00	1,149,000
北陸電気工事	1,300	675.00	877,500
ユアテック	4,000	661.00	2,644,000
西部電気工業	2,000	407.00	814,000
四電工	2,000	378.00	756,000
中電工	4,000	1,968.00	7,872,000
関電工	11,000	855.00	9,405,000
きんでん	16,800	1,094.00	18,379,200
東京エネシス	3,000	985.00	2,955,000
トーエネック	4,000	533.00	2,132,000
住友電設	2,200	1,130.00	2,486,000

日本電設工業	4,500	1,676.00	7,542,000
協和エクシオ	10,900	1,284.00	13,995,600
新日本空調	2,300	1,019.00	2,343,700
日本工営	9,000	299.00	2,691,000
N D S	4,000	249.00	996,000
九電工	5,100	3,050.00	15,555,000
三機工業	6,200	783.00	4,854,600
日揮	27,900	1,439.00	40,148,100
中外炉工業	8,000	210.00	1,680,000
ヤマト	2,500	522.00	1,305,000
太平電業	4,000	1,055.00	4,220,000
高砂熱学工業	8,300	1,180.00	9,794,000
三晃金属工業	3,000	283.00	849,000
N E C ネットエスアイ	3,100	1,828.00	5,666,800
朝日工業社	3,000	491.00	1,473,000
明星工業	5,000	460.00	2,300,000
大気社	3,400	2,436.00	8,282,400
ダイダン	4,000	738.00	2,952,000
日比谷総合設備	3,300	1,526.00	5,035,800
東芝プラントシステム	4,500	1,648.00	7,416,000
日本製粉	18,000	796.00	14,328,000
日清製粉グループ本社	30,500	1,645.00	50,172,500
日東富士製粉	2,000	332.00	664,000
昭和産業	11,000	448.00	4,928,000
鳥越製粉	2,200	663.00	1,458,600
中部飼料	2,600	675.00	1,755,000
フィード・ワン	16,700	113.00	1,887,100
東洋精糖	4,000	100.00	400,000
日本甜菜製糖	14,000	182.00	2,548,000
三井製糖	11,000	480.00	5,280,000
塩水港精糖	3,000	219.00	657,000
日新製糖	1,200	1,379.00	1,654,800
ネクスト	7,300	862.00	6,292,600
ジェイエイシーリクルートメント	1,600	1,479.00	2,366,400
日本M & A センター	4,000	6,610.00	26,440,000
ノバレーゼ	700	807.00	564,900
アコーディア・ゴルフ	7,200	1,048.00	7,545,600
中広	200	603.00	120,600
タケエイ	2,300	835.00	1,920,500
トラスト・テック	1,000	1,317.00	1,317,000
パソナグループ	2,200	750.00	1,650,000
C D S	600	745.00	447,000
リンクアンドモチベーション	5,200	209.00	1,086,800
G C A サヴィアン	2,300	796.00	1,830,800
エス・エム・エス	3,200	2,149.00	6,876,800
テンプホールディングス	18,200	1,701.00	30,958,200
リニカル	1,500	1,489.00	2,233,500
クックパッド	5,800	1,371.00	7,951,800
エスクリ	1,100	568.00	624,800
アイ・ケイ・ケイ	1,400	538.00	753,200

森永製菓	25,000	690.00	17,250,000
中村屋	6,000	460.00	2,760,000
江崎グリコ	6,400	6,200.00	39,680,000
名糖産業	1,200	1,293.00	1,551,600
不二家	16,000	193.00	3,088,000
山崎製パン	20,400	2,927.00	59,710,800
第一屋製パン	4,000	107.00	428,000
モロゾフ	4,000	421.00	1,684,000
亀田製菓	1,500	5,860.00	8,790,000
寿スピリッツ	2,000	3,360.00	6,720,000
カルビー	10,300	4,300.00	44,290,000
森永乳業	25,000	759.00	18,975,000
六甲バター	1,200	2,313.00	2,775,600
ヤクルト本社	14,900	4,875.00	72,637,500
明治ホールディングス	16,500	10,560.00	174,240,000
雪印メグミルク	6,500	3,660.00	23,790,000
プリマハム	18,000	310.00	5,580,000
日本ハム	20,000	2,517.00	50,340,000
林兼産業	9,000	83.00	747,000
丸大食品	14,000	473.00	6,622,000
S Foods	1,700	2,822.00	4,797,400
伊藤ハム米久ホールディングス	16,600	1,052.00	17,463,200
学情	1,000	1,346.00	1,346,000
スタジオアリス	1,200	2,392.00	2,870,400
シミックホールディングス	1,300	1,570.00	2,041,000
システナ	2,400	1,450.00	3,480,000
N J S	500	1,101.00	550,500
デジタルアーツ	1,200	2,836.00	3,403,200
新日鉄住金ソリューションズ	4,100	1,487.00	6,096,700
総合警備保障	8,700	4,730.00	41,151,000
キューブシステム	1,100	696.00	765,600
いちごグループホールディングス	27,100	362.00	9,810,200
日本駐車場開発	29,500	129.00	3,805,500
コア	1,000	897.00	897,000
カカクコム	18,600	2,007.00	37,330,200
アイロムグループ	700	954.00	667,800
ルネサンス	1,300	1,103.00	1,433,900
ディップ	2,900	2,854.00	8,276,600
S B Sホールディングス	2,400	693.00	1,663,200
オプトホールディング	1,600	787.00	1,259,200
新日本科学	2,500	650.00	1,625,000
ツクイ	3,100	1,677.00	5,198,700
キャリアデザインセンター	500	927.00	463,500
エムスリー	22,500	3,645.00	82,012,500
ツカダ・グローバルホールディング	1,900	700.00	1,330,000
アウトソーシング	1,200	4,140.00	4,968,000
ウェルネット	1,900	2,078.00	3,948,200
ディー・エヌ・エー	11,600	2,442.00	28,327,200
博報堂D Yホールディングス	35,900	1,136.00	40,782,400
ぐるなび	3,000	2,885.00	8,655,000

エスアールジータカミヤ	2,800	396.00	1,108,800
ジャパンベストレスキューシステム	3,200	210.00	672,000
ファンコミュニケーションズ	6,000	836.00	5,016,000
ジェイコムホールディングス	500	2,426.00	1,213,000
WDBホールディングス	900	846.00	761,400
ティア	1,200	621.00	745,200
パリュコマース	2,400	324.00	777,600
インフォマート	5,000	961.00	4,805,000
サッポロホールディングス	8,500	2,964.00	25,194,000
アサヒグループホールディングス	52,200	3,366.00	175,705,200
麒麟ホールディングス	112,700	1,778.50	200,436,950
宝ホールディングス	20,100	929.00	18,672,900
オエノンホールディングス	8,000	195.00	1,560,000
養命酒製造	900	1,702.00	1,531,800
コカ・コーラウエスト	9,400	2,902.00	27,278,800
コカ・コーライーストジャパン	9,800	1,957.00	19,178,600
サントリー食品インターナショナル	19,100	4,620.00	88,242,000
ダイドードリンコ	1,400	5,530.00	7,742,000
伊藤園	8,300	3,930.00	32,619,000
キーコーヒー	2,400	1,864.00	4,473,600
ユニカフェ	700	867.00	606,900
ジャパンプーズ	400	1,158.00	463,200
日清オイリオグループ	15,000	484.00	7,260,000
不二製油グループ本社	7,400	2,046.00	15,140,400
かどや製油	300	2,942.00	882,600
J-オイルミルズ	12,000	342.00	4,104,000
ローソン	9,300	8,040.00	74,772,000
サンエー	1,700	4,990.00	8,483,000
ダイユーエイト	600	633.00	379,800
カワチ薬品	1,900	2,256.00	4,286,400
エービーシー・マート	3,200	6,610.00	21,152,000
ハードオフコーポレーション	1,200	1,154.00	1,384,800
高千穂交易	900	865.00	778,500
アスクル	3,000	3,405.00	10,215,000
ゲオホールディングス	4,100	1,329.00	5,448,900
アダストリア	4,500	3,285.00	14,782,500
ジーフット	1,500	705.00	1,057,500
シー・ヴィ・エス・バイエリア	4,000	70.00	280,000
伊藤忠食品	600	4,070.00	2,442,000
くらコーポレーション	1,400	6,000.00	8,400,000
キャンドゥ	1,300	1,630.00	2,119,000
エレマテック	1,100	1,922.00	2,114,200
パル	1,400	2,316.00	3,242,400
JALUX	800	1,579.00	1,263,200
エディオン	10,400	869.00	9,037,600
あらた	1,100	2,122.00	2,334,200
サーラコーポレーション	3,400	549.00	1,866,600
ワッツ	1,000	1,096.00	1,096,000
トーメンデバイス	400	1,790.00	716,000
ハローズ	800	2,002.00	1,601,600

ＪＰホールディングス	6,400	276.00	1,766,400
あみやき亭	500	4,085.00	2,042,500
東京エレクトロン デバイス	900	1,482.00	1,333,800
ひらまつ	3,400	630.00	2,142,000
フィールズ	2,100	1,176.00	2,469,600
双日	154,300	238.00	36,723,400
ゲンキー	500	3,745.00	1,872,500
アルフレッサ ホールディングス	30,800	2,119.00	65,265,200
サッポロドラッグストアー	300	1,990.00	597,000
大黒天物産	600	4,800.00	2,880,000
ハニーズ	2,200	1,364.00	3,000,800
ファーマライズホールディングス	600	502.00	301,200
キッコーマン	21,000	3,800.00	79,800,000
味の素	58,500	2,479.50	145,050,750
キュービー	14,100	3,350.00	47,235,000
ハウス食品グループ本社	9,500	2,416.00	22,952,000
カゴメ	10,000	2,707.00	27,070,000
焼津水産化学工業	1,300	982.00	1,276,600
アリアケジャパン	2,300	6,010.00	13,823,000
ピエトロ	300	1,677.00	503,100
エバラ食品工業	700	1,855.00	1,298,500
ニチレイ	30,000	952.00	28,560,000
横浜冷凍	6,100	1,076.00	6,563,600
東洋水産	13,700	4,165.00	57,060,500
イトアイト	300	1,976.00	592,800
日清食品ホールディングス	11,800	5,520.00	65,136,000
永谷園ホールディングス	3,000	1,198.00	3,594,000
一正蒲鉾	1,000	1,054.00	1,054,000
フジッコ	2,700	2,978.00	8,040,600
ロック・フィールド	2,900	1,536.00	4,454,400
日本たばこ産業	164,400	4,289.00	705,111,600
ケンコーマヨネーズ	900	3,305.00	2,974,500
わらべや日洋	1,500	2,181.00	3,271,500
なとり	1,400	1,514.00	2,119,600
北の達人コーポレーション	500	476.00	238,000
ユーグレナ	8,900	1,364.00	12,139,600
片倉工業	3,300	1,080.00	3,564,000
ゲンゼ	21,000	272.00	5,712,000
ヒューリック	51,100	978.00	49,975,800
神栄	3,000	108.00	324,000
山下医科器械	200	1,623.00	324,600
ラサ商事	1,100	469.00	515,900
アルペン	2,200	1,630.00	3,586,000
ラクーン	1,100	493.00	542,300
クオール	2,500	1,288.00	3,220,000
アルコニックス	1,400	1,435.00	2,009,000
神戸物産	1,600	1,959.00	3,134,400
ジェイアイエヌ	1,700	4,075.00	6,927,500
ビックカメラ	14,100	924.00	13,028,400
ＤＣＭホールディングス	12,000	922.00	11,064,000

MonotaRO	8,700	3,135.00	27,274,500
東京一番フーズ	600	548.00	328,800
ダイヤモンドダイニング	500	983.00	491,500
あい ホールディングス	4,400	2,232.00	9,820,800
ディーブイエックス	900	1,225.00	1,102,500
きちり	700	593.00	415,100
アークランドサービスホールディングス	800	2,923.00	2,338,400
J.フロント リテイリング	31,000	1,010.00	31,310,000
ドトール・日レスホールディングス	4,300	1,795.00	7,718,500
マツモトキヨシホールディングス	5,100	4,595.00	23,434,500
ブロンコビリー	1,300	3,445.00	4,478,500
スタートトゥデイ	7,500	5,220.00	39,150,000
トレジャー・ファクトリー	700	962.00	673,400
物語コーポレーション	600	5,280.00	3,168,000
ココカラファイン	2,600	4,800.00	12,480,000
三越伊勢丹ホールディングス	48,700	891.00	43,391,700
東洋紡	103,000	196.00	20,188,000
ユニチカ	76,000	57.00	4,332,000
富士紡ホールディングス	13,000	238.00	3,094,000
日清紡ホールディングス	13,800	893.00	12,323,400
倉敷紡績	26,000	167.00	4,342,000
ダイワボウホールディングス	22,000	216.00	4,752,000
シキボウ	16,000	100.00	1,600,000
日東紡績	17,000	342.00	5,814,000
トヨタ紡織	8,700	1,941.00	16,886,700
マクニカ・富士エレホールディングス	4,400	1,012.00	4,452,800
ウエルシアホールディングス	2,100	6,930.00	14,553,000
クリエイトSDホールディングス	3,600	2,615.00	9,414,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,200	993.00	4,170,600
八洲電機	1,900	515.00	978,500
UKCホールディングス	1,600	1,488.00	2,380,800
丸善CHIホールディングス	2,900	379.00	1,099,100
OCHIホールディングス	700	981.00	686,700
TOKAIホールディングス	10,800	670.00	7,236,000
ミサワ	400	502.00	200,800
エー・ピーカンパニー	400	812.00	324,800
三洋貿易	1,300	1,123.00	1,459,900
チムニー	600	2,720.00	1,632,000
シュッピン	900	1,082.00	973,800
ウイン・パートナーズ	900	1,394.00	1,254,600
ネクステージ	400	820.00	328,000
ジョイフル本田	4,000	2,283.00	9,132,000
鳥貴族	600	2,083.00	1,249,800
キリン堂ホールディングス	800	897.00	717,600
ホットランド	800	907.00	725,600
すかいらーく	7,500	1,310.00	9,825,000
綿半ホールディングス	900	1,484.00	1,335,600
日本毛織	8,000	682.00	5,456,000

大東紡織	4,000	62.00	248,000	
トーア紡コーポレーション	1,100	454.00	499,400	
ダイドーリミテッド	2,900	419.00	1,215,100	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	8,100	990.00	8,019,000	
三栄建築設計	1,000	1,030.00	1,030,000	
野村不動産ホールディングス	16,300	1,656.00	26,992,800	
三重交通グループホールディングス	4,300	347.00	1,492,100	
サムティ	1,800	938.00	1,688,400	
ディア・ライフ	1,700	312.00	530,400	
エー・ディー・ワークス	22,400	36.00	806,400	
日本商業開発	1,100	1,393.00	1,532,300	
プレサンスコーポレーション	800	3,860.00	3,088,000	
ユニゾホールディングス	1,500	3,495.00	5,242,500	
日本管理センター	1,600	1,258.00	2,012,800	
サンセイランディック	600	734.00	440,400	
エストラスト	400	515.00	206,000	
フージャースホールディングス	3,400	521.00	1,771,400	
オープンハウス	3,500	2,540.00	8,890,000	
東急不動産ホールディングス	59,300	570.00	33,801,000	
飯田グループホールディングス	22,700	2,019.00	45,831,300	
ムゲンエステート	700	856.00	599,200	
帝国繊維	2,700	1,283.00	3,464,100	
ブックオフコーポレーション	1,400	818.00	1,145,200	
日本コークス工業	21,000	59.00	1,239,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	700	986.00	690,200	
ミタチ産業	600	534.00	320,400	
あさひ	1,800	1,526.00	2,746,800	
日本調剤	600	4,495.00	2,697,000	
コスモス薬品	1,200	19,690.00	23,628,000	
シップヘルスケアホールディングス	5,000	3,105.00	15,525,000	
トーエル	1,200	789.00	946,800	
一六堂	600	316.00	189,600	
ソフトクリエイトホールディングス	1,200	973.00	1,167,600	
セブン&アイ・ホールディングス	102,500	4,078.00	417,995,000	
薬王堂	500	5,100.00	2,550,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	6,600	955.00	6,303,000	
明治電機工業	800	958.00	766,400	
ツルハホールディングス	5,600	11,770.00	65,912,000	
デリカフーズ	500	959.00	479,500	
スターティア	500	463.00	231,500	
サンマルクホールディングス	1,900	3,015.00	5,728,500	
フェリシモ	700	1,023.00	716,100	
トリドール	3,000	3,055.00	9,165,000	
クスリのアオキ	2,200	4,925.00	10,835,000	
帝人	106,000	355.00	37,630,000	
東レ	189,000	882.00	166,698,000	
クラレ	41,000	1,201.00	49,241,000	
旭化成	162,000	698.50	113,157,000	

サカイオーベックス	7,000	132.00	924,000
稲葉製作所	1,400	1,364.00	1,909,600
宮地エンジニアリンググループ	8,000	127.00	1,016,000
トーカロ	1,800	1,691.00	3,043,800
アルファ	900	910.00	819,000
SUMCO	20,300	597.00	12,119,100
川田テクノロジーズ	500	3,105.00	1,552,500
シーアールイー	200	2,549.00	509,800
住江織物	7,000	179.00	1,253,000
日本フェルト	1,400	451.00	631,400
イチカワ	2,000	260.00	520,000
エコナックホールディングス	8,000	38.00	304,000
日東製網	3,000	162.00	486,000
芦森工業	6,000	153.00	918,000
アツギ	20,000	105.00	2,100,000
ダイニック	5,000	149.00	745,000
共和レザー	1,700	751.00	1,276,700
セーレン	6,500	906.00	5,889,000
東海染工	4,000	112.00	448,000
小松精練	4,000	666.00	2,664,000
ワコールホールディングス	15,000	1,010.00	15,150,000
ホギメディカル	1,600	7,060.00	11,296,000
レナウン	7,000	104.00	728,000
クラウドディア	600	492.00	295,200
T S Iホールディングス	11,600	529.00	6,136,400
T I S	8,100	2,230.00	18,063,000
ネオス	700	554.00	387,800
電算システム	900	1,403.00	1,262,700
グリー	14,900	576.00	8,582,400
コーエーテックホールディングス	5,800	1,811.00	10,503,800
三菱総合研究所	900	3,025.00	2,722,500
ボルテージ	500	1,128.00	564,000
電算	300	1,884.00	565,200
A G S	500	972.00	486,000
ファインデックス	1,600	1,260.00	2,016,000
ヒト・コミュニケーションズ	600	1,797.00	1,078,200
ブレインパッド	400	1,061.00	424,400
K L a b	3,800	767.00	2,914,600
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	1,600	738.00	1,180,800
イーブックイニシアティブジャパン	500	832.00	416,000
ネクソン	23,500	1,477.00	34,709,500
アイスタイル	3,700	745.00	2,756,500
エムアップ	600	579.00	347,400
エイチーム	1,300	1,832.00	2,381,600
テクノスジャパン	700	1,930.00	1,351,000
e n i s h	800	566.00	452,800
コロプラ	6,800	1,988.00	13,518,400
モバイルクリエイト	1,600	335.00	536,000
オルトプラス	900	333.00	299,700

ブロードリーフ	2,500	948.00	2,370,000
ハーツユナイテッドグループ	700	3,240.00	2,268,000
メディアドゥ	500	1,811.00	905,500
ブイキューブ	1,600	792.00	1,267,200
サイバーリンクス	400	982.00	392,800
ディー・エル・イー	700	889.00	622,300
VOYAGE GROUP	800	1,044.00	835,200
オブティム	200	4,740.00	948,000
特種東海製紙	15,000	356.00	5,340,000
ベリサーブ	300	3,315.00	994,500
ティーガイア	2,400	1,439.00	3,453,600
日本アジアグループ	2,800	387.00	1,083,600
豆蔵ホールディングス	1,900	918.00	1,744,200
テクマトリックス	1,000	2,310.00	2,310,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	57,100	283.00	16,159,300
GMOペイメントゲートウェイ	2,000	5,540.00	11,080,000
ザッパラス	1,400	359.00	502,600
インターネットイニシアティブ	4,000	2,054.00	8,216,000
さくらインターネット	1,600	812.00	1,299,200
GMOクラウド	500	1,015.00	507,500
SRAホールディングス	1,400	2,068.00	2,895,200
MINORIソリューションズ	500	843.00	421,500
システムインテグレータ	300	634.00	190,200
朝日ネット	2,200	411.00	904,200
コムチュア	400	3,495.00	1,398,000
サイバーコム	300	791.00	237,300
王子ホールディングス	102,000	384.00	39,168,000
日本製紙	13,400	1,801.00	24,133,400
三菱製紙	40,000	66.00	2,640,000
北越紀州製紙	16,100	738.00	11,881,800
中越パルプ工業	10,000	200.00	2,000,000
巴川製紙所	4,000	168.00	672,000
大王製紙	11,500	1,120.00	12,880,000
gumi	2,500	810.00	2,025,000
パイプドHD	300	946.00	283,800
レンゴー	23,000	693.00	15,939,000
トーモク	8,000	287.00	2,296,000
ザ・パック	1,800	2,631.00	4,735,800
昭和電工	17,300	909.00	15,725,700
住友化学	191,000	396.00	75,636,000
日本化成	5,000	101.00	505,000
住友精化	5,000	590.00	2,950,000
日産化学工業	15,500	3,070.00	47,585,000
ラサ工業	10,000	91.00	910,000
クレハ	20,000	359.00	7,180,000
多木化学	2,000	640.00	1,280,000
テイカ	4,000	444.00	1,776,000
石原産業	47,000	59.00	2,773,000
片倉コープアグリ	3,000	193.00	579,000

日東エフシー	1,500	814.00	1,221,000
日本曹達	17,000	385.00	6,545,000
東ソー	70,000	438.00	30,660,000
トクヤマ	43,000	286.00	12,298,000
セントラル硝子	28,000	419.00	11,732,000
東亜合成	16,300	941.00	15,338,300
大阪ソーダ	11,000	418.00	4,598,000
関東電化工業	6,000	1,033.00	6,198,000
デンカ	54,000	400.00	21,600,000
イビデン	15,200	1,082.00	16,446,400
信越化学工業	46,600	5,901.00	274,986,600
日本カーバイド工業	9,000	130.00	1,170,000
堺化学工業	11,000	263.00	2,893,000
エア・ウォーター	21,000	1,460.00	30,660,000
大陽日酸	20,000	863.00	17,260,000
日本化学工業	10,000	193.00	1,930,000
日本パーカライジング	13,300	1,093.00	14,536,900
高圧ガス工業	4,000	627.00	2,508,000
チタン工業	3,000	160.00	480,000
四国化成工業	4,000	765.00	3,060,000
戸田工業	5,000	265.00	1,325,000
ステラ ケミファ	1,300	3,425.00	4,452,500
保土谷化学工業	8,000	258.00	2,064,000
日本触媒	3,800	5,740.00	21,812,000
大日精化工業	10,000	403.00	4,030,000
カネカ	35,000	654.00	22,890,000
協和発酵キリン	31,100	1,769.00	55,015,900
三菱瓦斯化学	45,000	506.00	22,770,000
三井化学	110,000	351.00	38,610,000
J S R	24,400	1,328.00	32,403,200
東京応化工業	5,200	2,464.00	12,812,800
大阪有機化学工業	1,900	537.00	1,020,300
三菱ケミカルホールディングス	174,100	445.70	77,596,370
日本合成化学工業	6,000	499.00	2,994,000
ダイセル	35,100	983.00	34,503,300
住友ベークライト	23,000	447.00	10,281,000
積水化学工業	59,000	1,274.00	75,166,000
日本ゼオン	22,000	625.00	13,750,000
アイカ工業	7,800	2,273.00	17,729,400
宇部興産	139,000	163.00	22,657,000
積水樹脂	4,000	1,437.00	5,748,000
タキロン	6,000	439.00	2,634,000
旭有機材	8,000	188.00	1,504,000
日立化成	12,800	1,812.00	23,193,600
ニチバン	3,000	745.00	2,235,000
リケンテクノス	5,600	404.00	2,262,400
大倉工業	6,000	268.00	1,608,000
積水化成成品工業	7,000	297.00	2,079,000
群栄化学工業	7,000	281.00	1,967,000
タイガースポリマー	1,300	477.00	620,100

ミライアル	900	724.00	651,600	
ダイキアクシス	500	802.00	401,000	
ダイキョーニシカワ	3,300	1,126.00	3,715,800	
日本化薬	17,000	916.00	15,572,000	
カーリットホールディングス	2,400	452.00	1,084,800	
E P S ホールディングス	3,200	1,241.00	3,971,200	
レッグス	500	680.00	340,000	
プレステージ・インターナショナル	2,200	1,529.00	3,363,800	
フェイス	600	1,034.00	620,400	
ハイマックス	300	1,074.00	322,200	
アミューズ	1,400	1,757.00	2,459,800	
野村総合研究所	17,200	3,475.00	59,770,000	
ドリームインキュベータ	900	1,852.00	1,666,800	
サイバネットシステム	2,000	662.00	1,324,000	
クイック	1,300	788.00	1,024,400	
T A C	1,400	184.00	257,600	
C E ホールディングス	400	905.00	362,000	
ケネディクス	34,800	379.00	13,189,200	
電通	28,900	4,435.00	128,171,500	
インテージホールディングス	1,300	1,563.00	2,031,900	
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,200	388.00	465,600	
東邦システムサイエンス	700	600.00	420,000	
ぴあ	800	2,112.00	1,689,600	
イオンファンタジー	900	2,669.00	2,402,100	
ソースネクスト	1,200	496.00	595,200	
シーティーエス	800	758.00	606,400	
ネクシィーズグループ	900	1,239.00	1,115,100	
メディカルシステムネットワーク	2,800	456.00	1,276,800	
ティー・ワイ・オー	4,800	164.00	787,200	
日本精化	2,200	736.00	1,619,200	
扶桑化学工業	1,600	1,517.00	2,427,200	
A D E K A	12,800	1,161.00	14,860,800	
日油	19,000	803.00	15,257,000	
ミヨシ油脂	10,000	115.00	1,150,000	
新日本理化	4,100	131.00	537,100	
ハリマ化成グループ	2,200	477.00	1,049,400	
花王	69,900	5,827.00	407,307,300	
第一工業製薬	6,000	313.00	1,878,000	
ニイタカ	400	1,312.00	524,800	
三洋化成工業	8,000	755.00	6,040,000	
武田薬品工業	103,500	4,253.00	440,185,500	
アステラス製薬	291,100	1,603.50	466,778,850	
大日本住友製薬	18,400	1,874.00	34,481,600	
塩野義製薬	37,900	5,539.00	209,928,100	
田辺三菱製薬	30,300	1,834.00	55,570,200	
わかもと製薬	3,000	220.00	660,000	
あすか製薬	3,300	1,717.00	5,666,100	
日本新薬	6,000	5,320.00	31,920,000	
ビオフェルミン製薬	400	2,708.00	1,083,200	
中外製薬	25,900	3,680.00	95,312,000	

科研製薬	4,500	6,900.00	31,050,000
エーザイ	32,000	5,509.00	176,288,000
理研ビタミン	800	4,905.00	3,924,000
ロート製薬	12,700	1,506.00	19,126,200
小野薬品工業	59,000	3,952.00	233,168,000
久光製薬	8,100	6,020.00	48,762,000
有機合成薬品工業	1,700	220.00	374,000
持田製薬	1,800	8,560.00	15,408,000
参天製薬	47,900	1,635.00	78,316,500
扶桑薬品工業	9,000	274.00	2,466,000
日本ケミファ	4,000	439.00	1,756,000
ツムラ	8,200	2,779.00	22,787,800
日医工	6,100	1,995.00	12,169,500
テルモ	38,000	4,495.00	170,810,000
みらかホールディングス	6,600	4,470.00	29,502,000
キッセイ薬品工業	4,600	2,003.00	9,213,800
生化学工業	4,800	1,601.00	7,684,800
栄研化学	2,200	2,305.00	5,071,000
日水製薬	1,000	1,111.00	1,111,000
鳥居薬品	1,800	2,307.00	4,152,600
JCRファーマ	2,000	2,970.00	5,940,000
東和薬品	1,200	4,820.00	5,784,000
富士製薬工業	800	2,331.00	1,864,800
沢井製薬	4,400	7,920.00	34,848,000
ゼリア新薬工業	5,300	1,544.00	8,183,200
第一三共	87,400	2,547.50	222,651,500
キョーリン製薬ホールディングス	6,900	2,050.00	14,145,000
大幸薬品	1,300	1,591.00	2,068,300
ダイト	1,400	2,873.00	4,022,200
大塚ホールディングス	55,900	4,835.00	270,276,500
大正製薬ホールディングス	6,300	10,730.00	67,599,000
ペプチドリーム	4,300	5,550.00	23,865,000
大日本塗料	15,000	181.00	2,715,000
日本ペイントホールディングス	20,100	2,320.00	46,632,000
関西ペイント	29,400	1,927.00	56,653,800
神東塗料	2,000	160.00	320,000
中国塗料	7,000	598.00	4,186,000
日本特殊塗料	1,800	988.00	1,778,400
藤倉化成	3,500	535.00	1,872,500
太陽ホールディングス	1,900	2,956.00	5,616,400
D I C	10,300	2,078.00	21,403,400
サカタインクス	5,300	1,130.00	5,989,000
東洋インキS Cホールディングス	26,000	413.00	10,738,000
T & K T O K A	1,900	797.00	1,514,300
アルプス技研	1,000	1,908.00	1,908,000
サニックス	4,100	144.00	590,400
ダイオーズ	500	940.00	470,000
日本空調サービス	2,300	516.00	1,186,800
オリエンタルランド	28,000	6,359.00	178,052,000
フォーカスシステムズ	900	440.00	396,000

ダスキン	6,600	1,692.00	11,167,200
パーク24	12,400	3,355.00	41,602,000
明光ネットワークジャパン	3,200	1,261.00	4,035,200
ファルコホールディングス	1,100	1,317.00	1,448,700
クレスコ	600	2,333.00	1,399,800
フジ・メディア・ホールディングス	25,500	1,110.00	28,305,000
秀英予備校	500	367.00	183,500
田谷	400	672.00	268,800
ラウンドワン	8,100	831.00	6,731,100
リゾートトラスト	10,900	2,095.00	22,835,500
オービック	8,400	5,550.00	46,620,000
ジャストシステム	4,500	843.00	3,793,500
TDCソフトウェアエンジニアリング	1,100	583.00	641,300
ヤフー	175,600	452.00	79,371,200
ビー・エム・エル	1,500	4,785.00	7,177,500
ワタベウエディング	800	411.00	328,800
トレンドマイクロ	11,900	3,630.00	43,197,000
りらいあコミュニケーションズ	4,300	1,012.00	4,351,600
インフォメーション・ディベロプメント	500	942.00	471,000
リソー教育	4,800	407.00	1,953,600
日本オラクル	3,900	5,580.00	21,762,000
早稲田アカデミー	300	851.00	255,300
アルファシステムズ	800	1,656.00	1,324,800
フューチャー	2,900	750.00	2,175,000
CAC Holdings	1,800	778.00	1,400,400
ソフトバンク・テクノロジー	700	1,814.00	1,269,800
トーセ	700	631.00	441,700
ユー・エス・エス	31,400	1,589.00	49,894,600
オービックビジネスコンサルタント	1,200	4,700.00	5,640,000
伊藤忠テクノソリューションズ	5,500	2,188.00	12,034,000
アイティフォー	3,200	501.00	1,603,200
東京個別指導学院	1,300	633.00	822,900
東計電算	400	1,748.00	699,200
サイバーエージェント	6,800	6,200.00	42,160,000
楽天	121,400	1,050.00	127,470,000
エクスネット	200	1,492.00	298,400
テー・オー・ダブリュー	2,100	575.00	1,207,500
大塚商会	6,600	4,765.00	31,449,000
総合メディカル	1,200	3,695.00	4,434,000
サイボウズ	3,300	366.00	1,207,800
ソフトブレーン	3,600	482.00	1,735,200
セントラルスポーツ	900	2,305.00	2,074,500
パラカ	700	1,447.00	1,012,900
電通国際情報サービス	1,500	1,692.00	2,538,000
デジタルガレージ	3,800	2,147.00	8,158,600
イーエムシステムズ	800	1,245.00	996,000
ウェザーニューズ	800	3,150.00	2,520,000
C I J	2,200	447.00	983,400
東洋ビジネスエンジニアリング	200	1,371.00	274,200

日本エンタープライズ	2,500	294.00	735,000
WOWOW	1,200	2,287.00	2,744,400
フュージョンパートナー	1,500	538.00	807,000
フルキャストホールディングス	2,400	821.00	1,970,400
富士フイルムホールディングス	59,500	3,724.00	221,578,000
コニカミノルタ	62,000	715.00	44,330,000
資生堂	49,300	2,885.50	142,255,150
ライオン	30,000	1,689.00	50,670,000
高砂香料工業	1,700	2,695.00	4,581,500
マンダム	2,400	4,710.00	11,304,000
ミルボン	1,500	4,705.00	7,057,500
ファンケル	6,000	1,404.00	8,424,000
コーセー	4,200	8,590.00	36,078,000
コタ	900	1,109.00	998,100
シーズ・ホールディングス	3,300	2,281.00	7,527,300
シーボン	300	2,060.00	618,000
ポーラ・オルビスホールディングス	2,600	9,700.00	25,220,000
ノエビアホールディングス	1,600	3,160.00	5,056,000
アジュバンコスメジャパン	500	887.00	443,500
エステー	1,800	1,121.00	2,017,800
アグロ カネショウ	1,000	1,029.00	1,029,000
コニシ	4,100	1,268.00	5,198,800
長谷川香料	3,300	1,785.00	5,890,500
星光PMC	1,400	999.00	1,398,600
小林製薬	7,900	4,430.00	34,997,000
荒川化学工業	2,200	899.00	1,977,800
メック	2,000	856.00	1,712,000
日本高純度化学	700	2,013.00	1,409,100
タカラバイオ	5,600	1,351.00	7,565,600
JCU	800	3,005.00	2,404,000
新田ゼラチン	1,700	760.00	1,292,000
OATアグリオ	300	1,236.00	370,800
デクセリアルズ	7,800	699.00	5,452,200
アース製薬	1,900	4,960.00	9,424,000
イハラケミカル工業	4,000	916.00	3,664,000
北興化学工業	3,000	273.00	819,000
大成ラミック	700	2,783.00	1,948,100
クミアイ化学工業	5,400	563.00	3,040,200
日本農薬	5,900	455.00	2,684,500
昭和シェル石油	26,100	889.00	23,202,900
富士興産	900	405.00	364,500
ニチレキ	3,200	632.00	2,022,400
東燃ゼネラル石油	39,000	917.00	35,763,000
ユシロ化学工業	1,400	1,323.00	1,852,200
ビービー・カストロール	1,100	1,167.00	1,283,700
富士石油	6,000	311.00	1,866,000
MORESCO	800	1,105.00	884,000
出光興産	13,600	1,954.00	26,574,400
JXホールディングス	307,700	381.00	117,233,700
コスモエネルギーホールディングス	7,800	1,172.00	9,141,600

横浜ゴム	15,700	1,237.00	19,420,900
東洋ゴム工業	11,800	1,048.00	12,366,400
ブリヂストン	87,700	3,140.00	275,378,000
住友ゴム工業	24,300	1,300.00	31,590,000
藤倉ゴム工業	2,200	464.00	1,020,800
オカモト	8,000	1,116.00	8,928,000
アキレス	21,000	124.00	2,604,000
フコク	900	708.00	637,200
ニッタ	2,800	2,257.00	6,319,600
クリエートメディック	800	798.00	638,400
住友理工	5,600	802.00	4,491,200
三ツ星ベルト	6,000	788.00	4,728,000
バンドー化学	9,000	467.00	4,203,000
鬼怒川ゴム工業	6,000	776.00	4,656,000
旭硝子	137,000	490.00	67,130,000
日本板硝子	125,000	60.00	7,500,000
石塚硝子	4,000	148.00	592,000
有沢製作所	3,800	491.00	1,865,800
日本山村硝子	10,000	153.00	1,530,000
日本電気硝子	54,000	418.00	22,572,000
オハラ	1,000	486.00	486,000
住友大阪セメント	51,000	448.00	22,848,000
太平洋セメント	162,000	248.00	40,176,000
デイ・シイ	2,400	339.00	813,600
リゾートソリューション	3,000	292.00	876,000
日本ヒューム	2,500	524.00	1,310,000
日本コンクリート工業	5,300	280.00	1,484,000
三谷セキサン	1,300	2,036.00	2,646,800
アジアパイルホールディングス	3,200	359.00	1,148,800
東海カーボン	23,000	251.00	5,773,000
日本カーボン	13,000	181.00	2,353,000
東洋炭素	1,400	1,252.00	1,752,800
ノリタケカンパニーリミテド	15,000	228.00	3,420,000
TOTO	19,100	3,900.00	74,490,000
日本碍子	32,800	1,918.00	62,910,400
日本特殊陶業	22,400	1,393.00	31,203,200
ダントーホールディングス	3,000	182.00	546,000
MARUWA	1,000	3,060.00	3,060,000
品川リフラクトリーズ	7,000	176.00	1,232,000
黒崎播磨	6,000	231.00	1,386,000
ヨータイ	1,000	273.00	273,000
イソライト工業	1,300	183.00	237,900
東京窯業	3,200	148.00	473,600
ニッカトー	900	355.00	319,500
フジミインコーポレーテッド	2,300	1,435.00	3,300,500
エーアンドエーマテリアル	5,000	77.00	385,000
ニチアス	13,000	800.00	10,400,000
新日鐵住金	117,200	1,864.00	218,460,800
神戸製鋼所	477,000	82.00	39,114,000
中山製鋼所	29,000	48.00	1,392,000

合同製鐵	15,000	148.00	2,220,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	71,000	1,242.50	88,217,500
日新製鋼	11,900	1,242.00	14,779,800
東京製鐵	14,300	558.00	7,979,400
共英製鋼	2,800	1,556.00	4,356,800
大和工業	5,700	2,194.00	12,505,800
東京鐵鋼	5,000	350.00	1,750,000
大阪製鐵	1,600	1,639.00	2,622,400
淀川製鋼所	3,900	2,433.00	9,488,700
東洋鋼鈹	6,200	231.00	1,432,200
丸一鋼管	8,700	3,510.00	30,537,000
モリ工業	4,000	278.00	1,112,000
大同特殊鋼	44,000	349.00	15,356,000
日本高周波鋼業	10,000	64.00	640,000
日本冶金工業	19,100	111.00	2,120,100
山陽特殊製鋼	15,000	484.00	7,260,000
愛知製鋼	15,000	432.00	6,480,000
日立金属	29,700	954.00	28,333,800
日本金属	7,000	88.00	616,000
大平洋金属	18,000	278.00	5,004,000
新日本電工	14,700	150.00	2,205,000
栗本鐵工所	12,000	151.00	1,812,000
虹 技	4,000	144.00	576,000
日本鑄鉄管	3,000	127.00	381,000
日本製鋼所	43,000	436.00	18,748,000
三菱製鋼	18,000	146.00	2,628,000
日亜鋼業	3,600	207.00	745,200
日本精線	2,000	382.00	764,000
大紀アルミニウム工業所	4,000	282.00	1,128,000
日本軽金属ホールディングス	58,800	216.00	12,700,800
三井金属鉱業	66,000	173.00	11,418,000
東邦亜鉛	14,000	333.00	4,662,000
三菱マテリアル	162,000	241.00	39,042,000
住友金属鉱山	72,000	1,031.00	74,232,000
DOWAホールディングス	33,000	526.00	17,358,000
古河機械金属	41,000	123.00	5,043,000
エス・サイエンス	11,800	31.00	365,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,600	1,197.00	3,112,200
東邦チタニウム	4,400	629.00	2,767,600
UACJ	36,000	247.00	8,892,000
古河電気工業	82,000	243.00	19,926,000
住友電気工業	104,000	1,244.00	129,376,000
フジクラ	36,000	435.00	15,660,000
昭和電線ホールディングス	31,000	53.00	1,643,000
東京特殊電線	400	702.00	280,800
タツタ電線	5,400	280.00	1,512,000
沖電線	3,000	169.00	507,000
カナレ電気	400	1,823.00	729,200
平河ヒューテック	1,200	800.00	960,000

リヨービ	16,000	394.00	6,304,000
アーレスティ	3,000	667.00	2,001,000
アサヒホールディングス	3,900	1,541.00	6,009,900
東洋製罐グループホールディングス	18,500	1,921.00	35,538,500
ホッカンホールディングス	7,000	292.00	2,044,000
コロナ	1,400	1,027.00	1,437,800
横河ブリッジホールディングス	4,900	982.00	4,811,800
OSJBホールディングス	5,700	181.00	1,031,700
駒井ハルテック	5,000	185.00	925,000
高田機工	2,000	179.00	358,000
三和ホールディングス	25,800	908.00	23,426,400
文化シャッター	7,200	768.00	5,529,600
三協立山	3,400	1,450.00	4,930,000
アルインコ	1,900	949.00	1,803,100
東洋シャッター	600	492.00	295,200
LIXILグループ	36,200	1,640.00	59,368,000
日本ファイルコン	1,900	418.00	794,200
ノーリツ	5,100	1,775.00	9,052,500
長府製作所	2,800	2,424.00	6,787,200
リンナイ	4,800	8,990.00	43,152,000
ユニプレス	5,200	1,478.00	7,685,600
ダイニチ工業	1,300	591.00	768,300
日東精工	4,000	266.00	1,064,000
三洋工業	3,000	158.00	474,000
岡部	5,400	708.00	3,823,200
ジーテクト	2,700	1,242.00	3,353,400
中国工業	400	651.00	260,400
東プレ	5,000	2,117.00	10,585,000
高周波熱錬	4,800	677.00	3,249,600
東京製綱	18,000	148.00	2,664,000
サンコール	1,400	430.00	602,000
モリテックスチール	1,300	238.00	309,400
パイオラックス	1,300	4,215.00	5,479,500
日本発条	24,500	780.00	19,110,000
中央発條	3,000	272.00	816,000
アドバネクス	500	1,111.00	555,500
三浦工業	11,600	2,216.00	25,705,600
タクマ	10,000	803.00	8,030,000
テクノプロ・ホールディングス	4,200	3,315.00	13,923,000
インターワークス	500	1,196.00	598,000
Keeper 技研	300	1,501.00	450,300
ファーストロジック	100	1,746.00	174,600
リブセンス	1,700	407.00	691,900
ジャパンマテリアル	1,100	3,900.00	4,290,000
ベクトル	800	2,996.00	2,396,800
ウチヤマホールディングス	1,300	422.00	548,600
サクセスホールディングス	200	1,167.00	233,400
キャリアリンク	700	927.00	648,900
I B J	2,000	602.00	1,204,000
アサンテ	1,000	1,464.00	1,464,000

N・フィールド	1,200	1,812.00	2,174,400
M&Aキャピタルパートナーズ	300	2,292.00	687,600
ライドオン・エクスプレス	600	1,412.00	847,200
E R Iホールディングス	700	751.00	525,700
アビスト	400	2,029.00	811,600
ウィルグループ	600	921.00	552,600
日本ビューホテル	400	1,249.00	499,600
リクルートホールディングス	52,300	3,760.00	196,648,000
エラン	300	1,329.00	398,700
ツガミ	8,000	400.00	3,200,000
オークマ	17,000	640.00	10,880,000
東芝機械	14,000	292.00	4,088,000
アマダホールディングス	37,900	967.00	36,649,300
アイダエンジニアリング	6,800	801.00	5,446,800
滝澤鉄工所	8,000	117.00	936,000
富士機械製造	8,500	918.00	7,803,000
牧野フライス製作所	13,000	497.00	6,461,000
オーエスジー	11,800	1,552.00	18,313,600
ダイジェット工業	3,000	122.00	366,000
旭ダイヤモンド工業	7,000	735.00	5,145,000
D M G森精機	14,300	927.00	13,256,100
ソディック	6,600	749.00	4,943,400
ディスコ	3,300	8,750.00	28,875,000
日東工器	1,500	2,086.00	3,129,000
パンチ工業	1,000	715.00	715,000
日本郵政	76,200	1,188.00	90,525,600
ベルシステム24ホールディングス	5,100	767.00	3,911,700
豊田自動織機	22,600	3,750.00	84,750,000
豊和工業	1,500	517.00	775,500
OKK	10,000	93.00	930,000
石川製作所	6,000	68.00	408,000
東洋機械金属	1,900	345.00	655,500
津田駒工業	6,000	113.00	678,000
エンシュウ	6,000	54.00	324,000
島精機製作所	3,700	1,818.00	6,726,600
NCホールディングス	800	834.00	667,200
フリー	500	2,640.00	1,320,000
ヤマシンフィルタ	500	440.00	220,000
日阪製作所	3,300	805.00	2,656,500
やまびこ	4,800	706.00	3,388,800
ベガサスミシン製造	2,700	440.00	1,188,000
ナブテスコ	13,500	2,419.00	32,656,500
三井海洋開発	3,000	1,474.00	4,422,000
レオン自動機	2,200	540.00	1,188,000
S M C	7,800	23,200.00	180,960,000
新川	2,300	474.00	1,090,200
ホソカワミクロン	4,000	518.00	2,072,000
ユニオンツール	1,100	2,681.00	2,949,100
オイレス工業	3,400	1,606.00	5,460,400
日精エー・エス・ビー機械	800	1,650.00	1,320,000

サトーホールディングス	3,500	1,918.00	6,713,000
日本エアテック	900	605.00	544,500
日精樹脂工業	1,900	583.00	1,107,700
オカダアイヨン	500	721.00	360,500
ワイエイシイ	1,000	1,443.00	1,443,000
小松製作所	127,300	1,759.00	223,920,700
住友重機械工業	76,000	426.00	32,376,000
日立建機	11,600	1,378.00	15,984,800
日工	4,000	291.00	1,164,000
巴工業	1,100	1,465.00	1,611,500
井関農機	27,000	214.00	5,778,000
TOWA	2,500	999.00	2,497,500
丸山製作所	5,000	155.00	775,000
北川鉄工所	12,000	160.00	1,920,000
シンニッタ	2,300	507.00	1,166,100
タカキタ	900	489.00	440,100
クボタ	124,700	1,276.00	159,117,200
荏原実業	800	1,153.00	922,400
東洋エンジニアリング	15,000	324.00	4,860,000
三菱化工機	9,000	179.00	1,611,000
月島機械	4,900	914.00	4,478,600
帝国電機製作所	1,900	760.00	1,444,000
東京機械製作所	10,000	36.00	360,000
新東工業	5,900	692.00	4,082,800
澁谷工業	2,200	1,625.00	3,575,000
アイチコーポレーション	3,700	704.00	2,604,800
小森コーポレーション	6,300	1,140.00	7,182,000
鶴見製作所	1,900	1,208.00	2,295,200
住友精密工業	4,000	298.00	1,192,000
酒井重工業	5,000	159.00	795,000
荏原製作所	57,000	559.00	31,863,000
石井鐵工所	4,000	144.00	576,000
西島製作所	2,800	1,022.00	2,861,600
北越工業	2,800	557.00	1,559,600
千代田化工建設	20,000	665.00	13,300,000
ダイキン工業	36,100	8,029.00	289,846,900
オルガノ	4,000	377.00	1,508,000
トヨーカネツ	12,000	196.00	2,352,000
栗田工業	15,600	2,148.00	33,508,800
椿本チエイン	15,000	601.00	9,015,000
大同工業	5,000	185.00	925,000
日機装	8,900	629.00	5,598,100
木村化工機	2,200	285.00	627,000
新興プランテック	5,700	720.00	4,104,000
アネスト岩田	4,200	861.00	3,616,200
ダイフク	13,300	1,782.00	23,700,600
サムコ	600	825.00	495,000
加藤製作所	6,000	375.00	2,250,000
油研工業	5,000	161.00	805,000
タダノ	12,000	787.00	9,444,000

フジテック	7,200	886.00	6,379,200
C K D	6,900	770.00	5,313,000
キトー	3,100	751.00	2,328,100
平和	7,700	2,017.00	15,530,900
理想科学工業	2,700	1,260.00	3,402,000
SANKYO	6,900	3,850.00	26,565,000
日本金銭機械	2,300	737.00	1,695,100
マースエンジニアリング	1,400	2,107.00	2,949,800
福島工業	1,500	3,170.00	4,755,000
オーイズミ	1,000	357.00	357,000
ダイコク電機	1,000	1,458.00	1,458,000
竹内製作所	4,900	1,031.00	5,051,900
アマノ	7,700	1,708.00	13,151,600
JUKI	3,700	780.00	2,886,000
サンデンホールディングス	15,000	262.00	3,930,000
蛇の目マシン工業	2,400	511.00	1,226,400
ブラザー工業	32,100	1,000.00	32,100,000
マックス	4,000	1,163.00	4,652,000
モリタホールディングス	4,300	1,321.00	5,680,300
グローリー	8,500	2,704.00	22,984,000
新晃工業	1,700	1,064.00	1,808,800
大和冷機工業	4,000	862.00	3,448,000
セガサミーホールディングス	26,700	1,105.00	29,503,500
日本ピストンリング	1,000	1,325.00	1,325,000
リケン	11,000	300.00	3,300,000
T P R	3,100	1,800.00	5,580,000
ツバキ・ナカシマ	3,100	1,089.00	3,375,900
ホシザキ	5,400	9,160.00	49,464,000
大豊工業	2,000	996.00	1,992,000
日本精工	51,000	702.00	35,802,000
NTN	62,000	243.00	15,066,000
ジェイテクト	26,500	1,041.00	27,586,500
不二越	23,000	259.00	5,957,000
ミネベア	40,000	617.00	24,680,000
日本トムソン	8,500	287.00	2,439,500
THK	16,500	1,691.00	27,901,500
ユーシン精機	1,000	1,594.00	1,594,000
前澤給装工業	1,000	1,337.00	1,337,000
イーグル工業	3,100	1,110.00	3,441,000
前澤工業	1,800	266.00	478,800
日本ピラー工業	2,500	980.00	2,450,000
キッツ	11,100	487.00	5,405,700
日立製作所	633,000	403.30	255,288,900
東芝	523,000	269.50	140,948,500
三菱電機	265,000	1,108.00	293,620,000
富士電機	75,000	398.00	29,850,000
東洋電機製造	5,000	238.00	1,190,000
安川電機	30,800	1,204.00	37,083,200
シンフォニアテクノロジー	16,000	156.00	2,496,000
明電舎	23,000	313.00	7,199,000

オリジン電気	4,000	248.00	992,000
山洋電気	6,000	435.00	2,610,000
デンヨー	2,300	990.00	2,277,000
日立工機	6,600	568.00	3,748,800
三櫻工業	3,100	510.00	1,581,000
マキタ	16,200	6,260.00	101,412,000
東芝テック	18,000	345.00	6,210,000
芝浦メカトロニクス	4,000	196.00	784,000
マブチモーター	7,000	3,820.00	26,740,000
日本電産	29,900	7,131.00	213,216,900
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	300	2,485.00	745,500
東光高岳	1,400	1,542.00	2,158,800
ダブル・スコープ	2,100	1,712.00	3,595,200
宮越ホールディングス	800	496.00	396,800
ダイヘン	15,000	437.00	6,555,000
田淵電機	2,800	321.00	898,800
ヤーマン	300	1,974.00	592,200
JVCケンウッド	18,200	205.00	3,731,000
ミマキエンジニアリング	2,200	413.00	908,600
第一精工	1,000	923.00	923,000
日新電機	5,800	1,468.00	8,514,400
大崎電気工業	5,000	810.00	4,050,000
オムロン	28,000	3,060.00	85,680,000
日東工業	4,000	1,219.00	4,876,000
I D E C	3,200	886.00	2,835,200
不二電機工業	200	1,395.00	279,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	48,000	386.00	18,528,000
サクサホールディングス	6,000	180.00	1,080,000
メルコホールディングス	1,400	2,127.00	2,977,800
テクノメディカ	600	1,442.00	865,200
日本電気	341,000	247.00	84,227,000
富士通	239,000	343.70	82,144,300
沖電気工業	108,000	126.00	13,608,000
岩崎通信機	12,000	61.00	732,000
電気興業	7,000	443.00	3,101,000
サンケン電気	14,000	298.00	4,172,000
ナカヨ	2,000	305.00	610,000
アイホン	1,400	1,671.00	2,339,400
ルネサスエレクトロニクス	12,800	520.00	6,656,000
セイコーエプソン	37,000	1,549.00	57,313,000
ワコム	19,300	380.00	7,334,000
アルバック	4,600	2,834.00	13,036,400
アクセル	1,100	653.00	718,300
E I Z O	2,500	2,604.00	6,510,000
ジャパンディスプレイ	46,300	179.00	8,287,700
日本信号	6,800	834.00	5,671,200
京三製作所	6,000	343.00	2,058,000
能美防災	2,800	1,429.00	4,001,200
ホーチキ	1,800	1,163.00	2,093,400
エレコム	2,100	2,206.00	4,632,600

日本無線	7,000	250.00	1,750,000
パナソニック	283,600	863.00	244,746,800
シャープ	210,000	103.00	21,630,000
アンリツ	14,900	564.00	8,403,600
富士通ゼネラル	8,000	2,231.00	17,848,000
日立国際電気	5,700	1,584.00	9,028,800
ソニー	175,100	3,013.00	527,576,300
T D K	15,000	5,250.00	78,750,000
帝国通信工業	6,000	138.00	828,000
ミツミ電機	9,400	381.00	3,581,400
タムラ製作所	10,000	277.00	2,770,000
アルプス電気	21,400	1,664.00	35,609,600
池上通信機	8,000	117.00	936,000
パイオニア	40,200	164.00	6,592,800
日本電波工業	2,200	836.00	1,839,200
鈴木	1,000	485.00	485,000
日本トリム	700	7,690.00	5,383,000
ローランド ディー・ジー・	1,200	1,777.00	2,132,400
日本コロムビア	800	445.00	356,000
フォスター電機	3,100	1,552.00	4,811,200
クラリオン	13,000	222.00	2,886,000
S M K	7,000	321.00	2,247,000
ヨコオ	1,800	499.00	898,200
ティアック	18,000	33.00	594,000
ホシデン	7,500	575.00	4,312,500
ヒロセ電機	4,000	11,870.00	47,480,000
日本航空電子工業	7,000	1,303.00	9,121,000
T O A	2,900	912.00	2,644,800
日立マクセル	4,100	1,323.00	5,424,300
古野電気	2,900	513.00	1,487,700
ユニデンホールディングス	8,000	111.00	888,000
アルパイン	5,900	943.00	5,563,700
スミダコーポレーション	2,000	647.00	1,294,000
アイコム	1,400	1,892.00	2,648,800
リオン	900	1,356.00	1,220,400
本多通信工業	700	705.00	493,500
船井電機	2,500	856.00	2,140,000
横河電機	24,800	1,151.00	28,544,800
新電元工業	9,000	305.00	2,745,000
アズビル	8,100	2,982.00	24,154,200
東亜ディーケーケー	1,400	441.00	617,400
日本光電工業	10,400	2,881.00	29,962,400
チノー	900	1,037.00	933,300
共和電業	3,000	310.00	930,000
日本電子材料	1,000	381.00	381,000
堀場製作所	4,600	4,295.00	19,757,000
アドバンテスト	16,900	1,029.00	17,390,100
小野測器	1,200	840.00	1,008,000
エスベック	2,600	1,178.00	3,062,800
パナソニック デバイス S U N X	2,200	590.00	1,298,000

キーエンス	5,600	70,710.00	395,976,000	
日置電機	1,300	1,818.00	2,363,400	
シスメックス	19,300	6,880.00	132,784,000	
日本マイクロニクス	4,600	853.00	3,923,800	
メガチップス	2,500	1,069.00	2,672,500	
OBARA GROUP	1,400	3,730.00	5,222,000	
イマジカ・ロボットホールディングス	2,100	460.00	966,000	
澤藤電機	1,000	169.00	169,000	
デンソー	61,300	3,399.00	208,358,700	
コーセル	3,400	974.00	3,311,600	
新日本無線	1,800	344.00	619,200	
オブテックス	1,800	2,559.00	4,606,200	
千代田インテグレ	1,300	1,782.00	2,316,600	
アイ・オー・データ機器	800	616.00	492,800	
レーザーテック	2,900	1,310.00	3,799,000	
スタンレー電気	17,700	2,096.00	37,099,200	
岩崎電気	8,000	125.00	1,000,000	
ウシオ電機	15,100	1,135.00	17,138,500	
岡谷電機産業	1,300	352.00	457,600	
ヘリオス テクノホールディング	2,100	331.00	695,100	
日本セラミック	1,400	1,949.00	2,728,600	
遠藤照明	1,300	914.00	1,188,200	
日本デジタル研究所	2,100	1,371.00	2,879,100	
古河電池	2,000	593.00	1,186,000	
双信電機	1,200	260.00	312,000	
山一電機	2,200	606.00	1,333,200	
図研	1,800	841.00	1,513,800	
日本電子	10,000	352.00	3,520,000	
カシオ計算機	24,900	1,422.00	35,407,800	
ファナック	25,400	15,500.00	393,700,000	
日本シイエムケイ	5,300	389.00	2,061,700	
エンプラス	1,300	2,512.00	3,265,600	
大真空	5,000	255.00	1,275,000	
ローム	12,000	3,640.00	43,680,000	
浜松ホトニクス	19,400	2,800.00	54,320,000	
三井ハイテック	3,600	586.00	2,109,600	
新光電気工業	9,400	468.00	4,399,200	
京セラ	40,700	4,613.00	187,749,100	
協栄産業	3,000	123.00	369,000	
太陽誘電	12,100	781.00	9,450,100	
村田製作所	26,200	10,475.00	274,445,000	
ユーシン	3,300	614.00	2,026,200	
双葉電子工業	4,100	1,819.00	7,457,900	
日東電工	20,100	6,173.00	124,077,300	
北陸電気工業	10,000	102.00	1,020,000	
東海理化電機製作所	7,300	1,360.00	9,928,000	
ニチコン	7,800	626.00	4,882,800	
日本ケミコン	20,000	117.00	2,340,000	
KOA	3,400	699.00	2,376,600	

三井造船	96,000	133.00	12,768,000
日立造船	19,700	464.00	9,140,800
三菱重工業	442,000	413.60	182,811,200
川崎重工業	193,000	260.00	50,180,000
I H I	191,000	274.00	52,334,000
名村造船所	7,400	497.00	3,677,800
サノヤスホールディングス	3,000	161.00	483,000
日本車輛製造	10,000	270.00	2,700,000
ニチュ三菱フォークリフト	2,900	609.00	1,766,100
近畿車輛	4,000	254.00	1,016,000
F P G	8,700	993.00	8,639,100
島根銀行	500	1,140.00	570,000
じもとホールディングス	17,600	136.00	2,393,600
全国保証	6,400	3,845.00	24,608,000
足利ホールディングス	18,000	301.00	5,418,000
東京T Yフィナンシャルグループ	3,400	2,017.00	6,857,800
九州フィナンシャルグループ	37,500	487.00	18,262,500
かんぽ生命保険	10,000	1,927.00	19,270,000
ゆうちょ銀行	62,800	1,111.00	69,770,800
富山第一銀行	6,200	450.00	2,790,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	170,700	379.00	64,695,300
日産自動車	346,400	918.90	318,306,960
いすゞ自動車	71,900	1,232.00	88,580,800
トヨタ自動車	308,700	5,055.00	1,560,478,500
日野自動車	35,400	916.00	32,426,400
三菱自動車工業	98,500	442.00	43,537,000
エフテック	1,300	865.00	1,124,500
レシップホールディングス	800	790.00	632,000
G M B	400	914.00	365,600
ファルテック	400	1,143.00	457,200
武蔵精密工業	2,600	1,823.00	4,739,800
日産車体	12,100	946.00	11,446,600
新明和工業	11,000	584.00	6,424,000
極東開発工業	4,900	892.00	4,370,800
日信工業	5,500	1,235.00	6,792,500
トピー工業	20,000	200.00	4,000,000
ティラド	10,000	175.00	1,750,000
曙ブレーキ工業	12,600	181.00	2,280,600
タチエス	3,900	1,384.00	5,397,600
N O K	12,000	1,581.00	18,972,000
フタバ産業	7,600	429.00	3,260,400
K Y B	28,000	319.00	8,932,000
市光工業	6,000	245.00	1,470,000
大同メタル工業	3,500	980.00	3,430,000
プレス工業	13,200	314.00	4,144,800
ミクニ	3,100	285.00	883,500
カルソニックカンセイ	19,000	742.00	14,098,000
太平洋工業	5,500	885.00	4,867,500
ケーヒン	5,700	1,424.00	8,116,800

河西工業	3,000	862.00	2,586,000
アイシン精機	25,400	3,760.00	95,504,000
富士機工	2,900	286.00	829,400
マツダ	78,600	1,211.50	95,223,900
ダイハツ工業	29,600	1,314.00	38,894,400
今仙電機製作所	2,300	820.00	1,886,000
本田技研工業	223,400	2,476.50	553,250,100
スズキ	45,400	2,691.00	122,171,400
富士重工業	78,400	3,288.00	257,779,200
安永	800	470.00	376,000
ヤマハ発動機	35,100	1,426.00	50,052,600
ショーワ	6,400	550.00	3,520,000
小糸製作所	14,900	4,340.00	64,666,000
T B K	2,900	344.00	997,600
エクセディ	3,400	2,024.00	6,881,600
ミツバ	4,200	973.00	4,086,600
豊田合成	9,000	1,708.00	15,372,000
愛三工業	4,300	628.00	2,700,400
盟和産業	400	991.00	396,400
ヨロズ	2,300	1,368.00	3,146,400
エフ・シー・シー	4,100	1,608.00	6,592,800
新家工業	5,000	125.00	625,000
シマノ	10,000	13,740.00	137,400,000
タカタ	4,500	347.00	1,561,500
テイ・エス テック	5,800	2,371.00	13,751,800
ジャムコ	1,400	1,819.00	2,546,600
小野建	2,100	1,170.00	2,457,000
はるやま商事	1,000	726.00	726,000
佐島電機	1,900	658.00	1,250,200
カップ・クリエイト	3,400	1,293.00	4,396,200
エコートレーディング	600	570.00	342,000
伯東	1,900	850.00	1,615,000
コンドーテック	1,900	707.00	1,343,300
中山福	1,500	762.00	1,143,000
ライトオン	1,800	1,300.00	2,340,000
ナガイレーベン	3,500	2,359.00	8,256,500
ジーンズメイト	800	165.00	132,000
三菱食品	2,700	2,694.00	7,273,800
良品計画	2,800	22,070.00	61,796,000
三城ホールディングス	3,000	403.00	1,209,000
松田産業	1,800	1,258.00	2,264,400
第一興商	4,300	4,295.00	18,468,500
メディカルホールディングス	24,500	1,543.00	37,803,500
アドヴァン	2,500	830.00	2,075,000
S P K	600	1,968.00	1,180,800
萩原電気	800	1,868.00	1,494,400
アルビス	600	2,115.00	1,269,000
アズワン	1,900	4,160.00	7,904,000
スズデン	800	891.00	712,800
尾家産業	800	864.00	691,200

シモジマ	1,700	1,064.00	1,808,800
ドウシシャ	2,900	1,978.00	5,736,200
小津産業	500	1,995.00	997,500
コナカ	3,100	490.00	1,519,000
高速	1,500	844.00	1,266,000
ハウス オブ ローゼ	300	1,395.00	418,500
G-7ホールディングス	700	1,175.00	822,500
たけびし	900	994.00	894,600
イオン北海道	1,600	508.00	812,800
コジマ	3,600	238.00	856,800
ヒマラヤ	800	910.00	728,000
コーナン商事	3,500	1,935.00	6,772,500
黒田電気	4,600	1,773.00	8,155,800
ネットワンシステムズ	10,600	609.00	6,455,400
エコス	900	1,217.00	1,095,300
ワタミ	2,900	1,062.00	3,079,800
マルシェ	600	817.00	490,200
リックス	500	1,617.00	808,500
ドンキホーテホールディングス	15,800	3,565.00	56,327,000
丸文	2,200	560.00	1,232,000
西松屋チェーン	4,800	1,522.00	7,305,600
ゼンショーホールディングス	12,600	1,543.00	19,441,800
ハピネット	2,200	822.00	1,808,400
幸楽苑ホールディングス	1,500	1,526.00	2,289,000
ハークスレイ	700	958.00	670,600
橋本総業ホールディングス	500	1,453.00	726,500
日本ライフライン	1,200	3,870.00	4,644,000
サイゼリヤ	4,000	1,830.00	7,320,000
エクセル	1,200	1,283.00	1,539,600
V Tホールディングス	8,300	442.00	3,668,600
マルカキカイ	800	993.00	794,400
アルゴグラフィックス	1,100	1,548.00	1,702,800
魚力	800	1,320.00	1,056,000
ガリバーインターナショナル	6,600	783.00	5,167,800
日本エム・ディ・エム	2,000	669.00	1,338,000
ポブラ	600	480.00	288,000
ユナイテッドアローズ	3,500	3,070.00	10,745,000
進和	1,400	1,355.00	1,897,000
エスケイジャパン	600	245.00	147,000
ダイトエレクトロン	1,100	552.00	607,200
ハイデイ日高	2,200	2,502.00	5,504,400
シークス	1,600	3,290.00	5,264,000
京都きもの友禅	1,700	805.00	1,368,500
コロワイド	8,100	1,852.00	15,001,200
ピーシーデポコーポレーション	2,700	1,420.00	3,834,000
田中商事	700	625.00	437,500
オーハシテクニカ	1,400	1,131.00	1,583,400
壺番屋	2,200	3,550.00	7,810,000
白銅	700	1,056.00	739,200
トップカルチャー	900	455.00	409,500

PLANT	600	1,120.00	672,000	
スギホールディングス	4,400	4,930.00	21,692,000	
島津製作所	32,000	1,348.00	43,136,000	
JMS	5,000	270.00	1,350,000	
クボテック	500	427.00	213,500	
長野計器	1,500	552.00	828,000	
ブイ・テクノロジー	600	12,100.00	7,260,000	
スター精密	4,700	1,059.00	4,977,300	
東京計器	8,000	150.00	1,200,000	
愛知時計電機	3,000	299.00	897,000	
オーバル	2,400	228.00	547,200	
東京精密	4,800	2,219.00	10,651,200	
マニー	3,300	1,637.00	5,402,100	
ニコン	46,300	1,366.00	63,245,800	
トプコン	8,300	922.00	7,652,600	
オリンパス	37,000	3,425.00	126,725,000	
理研計器	2,000	1,066.00	2,132,000	
SCREENホールディングス	25,000	1,045.00	26,125,000	
キヤノン電子	2,300	1,369.00	3,148,700	
タムロン	2,000	1,272.00	2,544,000	
HOYA	56,100	3,527.00	197,864,700	
ノーリツ鋼機	2,200	675.00	1,485,000	
エー・アンド・デイ	2,300	353.00	811,900	
キヤノン	133,600	2,802.50	374,414,000	
リコー	80,400	823.00	66,169,200	
シチズンホールディングス	30,600	482.00	14,749,200	
リズム時計工業	11,000	178.00	1,958,000	
大研医器	2,000	785.00	1,570,000	
メニコン	1,700	3,145.00	5,346,500	
スノーピーク	300	4,330.00	1,299,000	
パラマウントベッドホールディングス	2,600	4,835.00	12,571,000	
トランザクション	500	1,037.00	518,500	
SHOBI	800	397.00	317,600	
ニホンフラッシュ	1,000	1,161.00	1,161,000	
前田工織	2,500	990.00	2,475,000	
永大産業	4,000	381.00	1,524,000	
アートネイチャー	2,700	782.00	2,111,400	
ダンロップスポーツ	1,600	901.00	1,441,600	
バンダイナムコホールディングス	25,700	2,639.00	67,822,300	
アイフィスジャパン	600	356.00	213,600	
共立印刷	4,100	292.00	1,197,200	
SHOEI	1,100	1,473.00	1,620,300	
フランスベッドホールディングス	3,500	905.00	3,167,500	
マーベラス	4,100	815.00	3,341,500	
パイロットコーポレーション	4,300	4,135.00	17,780,500	
萩原工業	700	2,518.00	1,762,600	
エイベックス・グループ・ホールディングス	4,500	1,115.00	5,017,500	
トッパン・フォームズ	4,400	1,042.00	4,584,800	
フジシールインターナショナル	3,000	3,700.00	11,100,000	

タカラトミー	8,200	879.00	7,207,800
廣濟堂	2,300	291.00	669,300
As-me エステール	700	580.00	406,000
アーク	10,400	68.00	707,200
レック	800	1,790.00	1,432,000
タカノ	1,100	596.00	655,600
プロネクス	2,300	978.00	2,249,400
ホクシン	2,000	106.00	212,000
ウッドワン	5,000	223.00	1,115,000
大建工業	10,000	316.00	3,160,000
きもと	4,200	147.00	617,400
凸版印刷	70,000	854.00	59,780,000
大日本印刷	72,000	1,165.00	83,880,000
図書印刷	5,000	462.00	2,310,000
共同印刷	8,000	315.00	2,520,000
日本写真印刷	4,200	1,781.00	7,480,200
光村印刷	2,000	179.00	358,000
藤森工業	2,200	1,873.00	4,120,600
宝印刷	1,200	1,363.00	1,635,600
前澤化成工業	1,800	991.00	1,783,800
アシックス	23,100	1,584.00	36,590,400
ツツミ	1,200	1,965.00	2,358,000
JSP	1,700	1,930.00	3,281,000
ニチハ	3,500	1,549.00	5,421,500
エフピコ	2,300	5,050.00	11,615,000
小松ウオール工業	800	1,534.00	1,227,200
ヤマハ	18,200	2,589.00	47,119,800
河合楽器製作所	900	1,850.00	1,665,000
クリナップ	2,900	750.00	2,175,000
ピジョン	14,100	2,816.00	39,705,600
天馬	1,900	1,494.00	2,838,600
兼松日産農林	3,000	135.00	405,000
キングジム	2,100	814.00	1,709,400
リンテック	5,900	1,956.00	11,540,400
TASAKI	500	1,121.00	560,500
信越ポリマー	5,100	578.00	2,947,800
東リ	7,000	281.00	1,967,000
イトーキ	5,200	520.00	2,704,000
任天堂	15,300	16,270.00	248,931,000
三菱鉛筆	1,900	4,565.00	8,673,500
松風	1,200	1,320.00	1,584,000
タカラスタンダード	10,000	935.00	9,350,000
コクヨ	12,900	1,387.00	17,892,300
ナカバヤシ	5,000	231.00	1,155,000
ニフコ	5,000	5,190.00	25,950,000
立川ブラインド工業	1,100	682.00	750,200
グロープライド	1,200	1,644.00	1,972,800
岡村製作所	8,700	962.00	8,369,400
日本バルカー工業	10,000	255.00	2,550,000
MUTOHホールディングス	3,000	222.00	666,000

伊藤忠商事	192,200	1,226.00	235,637,200
丸紅	241,100	459.00	110,664,900
スクロール	3,700	350.00	1,295,000
高島	5,000	151.00	755,000
ヨンドシーホールディングス	1,900	1,901.00	3,611,900
三陽商会	15,000	187.00	2,805,000
長瀬産業	14,700	1,076.00	15,817,200
ナイガイ	9,000	40.00	360,000
蝶理	1,600	1,290.00	2,064,000
豊田通商	27,300	2,177.00	59,432,100
オンワードホールディングス	17,000	604.00	10,268,000
三共生興	3,700	326.00	1,206,200
兼松	52,000	158.00	8,216,000
美津濃	13,000	454.00	5,902,000
ツカモトコーポレーション	4,000	98.00	392,000
ファミリーマート	7,500	6,200.00	46,500,000
ルック	5,000	126.00	630,000
三井物産	221,500	1,188.00	263,142,000
日本紙パルプ商事	13,000	334.00	4,342,000
東京エレクトロン	20,400	8,490.00	173,196,000
日立ハイテクノロジーズ	8,500	2,700.00	22,950,000
カメイ	3,200	756.00	2,419,200
東都水産	4,000	153.00	612,000
OUGホールディングス	4,000	234.00	936,000
スターゼン	900	3,900.00	3,510,000
セイコーホールディングス	16,000	292.00	4,672,000
山善	9,400	797.00	7,491,800
椿本興業	3,000	251.00	753,000
住友商事	154,200	1,015.00	156,513,000
日本ユニシス	6,800	1,291.00	8,778,800
内田洋行	6,000	462.00	2,772,000
三菱商事	183,800	1,748.00	321,282,400
第一実業	6,000	427.00	2,562,000
キヤノンマーケティングジャパン	7,000	1,870.00	13,090,000
西華産業	8,000	232.00	1,856,000
佐藤商事	2,200	590.00	1,298,000
菱洋エレクトロ	2,800	1,285.00	3,598,000
東京産業	2,400	333.00	799,200
ユアサ商事	2,300	2,100.00	4,830,000
神鋼商事	5,000	160.00	800,000
小林産業	1,600	254.00	406,400
阪和興業	24,000	541.00	12,984,000
カナデン	2,300	886.00	2,037,800
菱電商事	4,000	606.00	2,424,000
ニプロ	18,500	1,248.00	23,088,000
フルサト工業	1,300	1,209.00	1,571,700
岩谷産業	29,000	573.00	16,617,000
すてきナイスグループ	10,000	131.00	1,310,000
昭光通商	9,000	71.00	639,000
二チモウ	4,000	159.00	636,000

極東貿易	4,000	173.00	692,000
イワキ	4,000	183.00	732,000
兼松エレクトロニクス	1,500	1,812.00	2,718,000
三愛石油	6,000	594.00	3,564,000
稲畑産業	5,900	906.00	5,345,400
G S Iクレオス	6,000	91.00	546,000
明和産業	2,300	296.00	680,800
キムラタン	110,000	6.00	660,000
ゴールドウイン	1,100	4,510.00	4,961,000
ユニ・チャーム	52,600	2,060.50	108,382,300
デサント	5,900	1,043.00	6,153,700
キング	1,300	343.00	445,900
ワキタ	5,200	645.00	3,354,000
ヤマトインターナショナル	1,600	385.00	616,000
東邦ホールディングス	7,800	2,328.00	18,158,400
サンゲツ	8,500	1,924.00	16,354,000
ミツウロコグループホールディングス	3,900	485.00	1,891,500
シナネンホールディングス	5,000	391.00	1,955,000
伊藤忠エネクス	6,300	949.00	5,978,700
サンリオ	7,600	1,720.00	13,072,000
サンワテクノス	1,600	718.00	1,148,800
リョーサン	3,900	2,357.00	9,192,300
新光商事	2,900	959.00	2,781,100
トーヨー	1,100	2,427.00	2,669,700
三信電気	3,400	810.00	2,754,000
東陽テクニカ	3,200	953.00	3,049,600
モスフードサービス	3,200	2,908.00	9,305,600
加賀電子	2,200	1,152.00	2,534,400
三益半導体工業	1,900	863.00	1,639,700
ソーダニッカ	2,500	444.00	1,110,000
立花エレテック	1,800	1,042.00	1,875,600
木曽路	3,000	2,241.00	6,723,000
サトレストランシシステムズ	2,900	808.00	2,343,200
千趣会	4,800	651.00	3,124,800
タカキュー	1,900	173.00	328,700
ケーヨー	4,100	518.00	2,123,800
アデランス	4,300	468.00	2,012,400
上新電機	6,000	838.00	5,028,000
日本瓦斯	3,700	2,244.00	8,302,800
ベスト電器	7,900	100.00	790,000
ロイヤルホールディングス	4,100	1,825.00	7,482,500
東天紅	2,000	129.00	258,000
いなげや	2,700	1,372.00	3,704,400
島忠	6,300	2,208.00	13,910,400
チヨダ	2,900	2,232.00	6,472,800
ライフコーポレーション	1,500	2,561.00	3,841,500
リンガーハット	2,200	2,290.00	5,038,000
さが美	2,000	75.00	150,000
MR MAX	2,100	271.00	569,100
テンアライド	2,300	364.00	837,200

AOKIホールディングス	5,600	1,045.00	5,852,000
オークワ	4,000	1,032.00	4,128,000
コメリ	3,800	2,546.00	9,674,800
青山商事	4,700	3,675.00	17,272,500
しまむら	2,800	15,140.00	42,392,000
はせがわ	1,100	414.00	455,400
高島屋	36,000	697.00	25,092,000
松屋	4,900	661.00	3,238,900
エイチ・ツー・オー リテイリング	12,500	1,287.00	16,087,500
近鉄百貨店	9,000	316.00	2,844,000
丸栄	5,000	78.00	390,000
ニッセンホールディングス	3,600	91.00	327,600
パルコ	2,300	816.00	1,876,800
丸井グループ	30,100	1,399.00	42,109,900
クレディセゾン	18,600	1,598.00	29,722,800
アクシアル リテイリング	1,900	3,345.00	6,355,500
井筒屋	13,000	42.00	546,000
イオン	100,800	1,444.50	145,605,600
ユニーグループ・ホールディングス	23,500	856.00	20,116,000
イズミ	4,900	3,810.00	18,669,000
東武ストア	3,000	292.00	876,000
フォーバル	1,300	715.00	929,500
平和堂	5,000	1,872.00	9,360,000
フジ	2,700	2,261.00	6,104,700
ヤオコー	2,800	4,340.00	12,152,000
ゼビオホールディングス	3,300	1,368.00	4,514,400
ケーズホールディングス	10,300	2,026.00	20,867,800
PALTAC	3,900	2,139.00	8,342,100
三谷産業	2,600	310.00	806,000
Olympicグループ	1,400	503.00	704,200
日産東京販売ホールディングス	4,100	204.00	836,400
新生銀行	212,000	134.00	28,408,000
あおぞら銀行	155,000	339.00	52,545,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,965,500	428.70	842,609,850
りそなホールディングス	286,600	358.00	102,602,800
三井住友トラスト・ホールディングス	511,000	289.80	148,087,800
三井住友フィナンシャルグループ	196,200	2,775.00	544,455,000
第四銀行	31,000	312.00	9,672,000
北越銀行	26,000	165.00	4,290,000
西日本シティ銀行	80,000	167.00	13,360,000
千葉銀行	94,000	445.00	41,830,000
常陽銀行	89,000	353.00	31,417,000
群馬銀行	54,000	346.00	18,684,000
武蔵野銀行	3,900	2,166.00	8,447,400
千葉興業銀行	6,700	342.00	2,291,400
筑波銀行	10,200	254.00	2,590,800
七十七銀行	38,000	321.00	12,198,000
青森銀行	18,000	270.00	4,860,000
秋田銀行	16,000	291.00	4,656,000
山形銀行	14,000	378.00	5,292,000

岩手銀行	1,700	3,850.00	6,545,000
東邦銀行	22,000	307.00	6,754,000
東北銀行	12,000	140.00	1,680,000
みちのく銀行	12,000	176.00	2,112,000
ふくおかフィナンシャルグループ	106,000	319.00	33,814,000
静岡銀行	72,000	657.00	47,304,000
十六銀行	31,000	251.00	7,781,000
スルガ銀行	23,300	2,085.00	48,580,500
八十二銀行	44,300	419.00	18,561,700
山梨中央銀行	15,000	348.00	5,220,000
大垣共立銀行	33,000	269.00	8,877,000
福井銀行	21,000	214.00	4,494,000
北國銀行	26,000	266.00	6,916,000
清水銀行	800	2,131.00	1,704,800
富山銀行	500	3,300.00	1,650,000
滋賀銀行	23,000	427.00	9,821,000
南都銀行	24,000	311.00	7,464,000
百五銀行	22,000	332.00	7,304,000
京都銀行	47,000	580.00	27,260,000
紀陽銀行	9,600	1,218.00	11,692,800
三重銀行	11,000	171.00	1,881,000
ほくほくフィナンシャルグループ	167,000	111.00	18,537,000
広島銀行	72,000	315.00	22,680,000
山陰合同銀行	14,700	615.00	9,040,500
中国銀行	17,400	973.00	16,930,200
鳥取銀行	8,000	157.00	1,256,000
伊予銀行	26,200	570.00	14,934,000
百十四銀行	27,000	285.00	7,695,000
四国銀行	19,000	193.00	3,667,000
阿波銀行	20,000	509.00	10,180,000
大分銀行	14,000	290.00	4,060,000
宮崎銀行	16,000	231.00	3,696,000
佐賀銀行	15,000	214.00	3,210,000
十八銀行	15,000	228.00	3,420,000
沖縄銀行	2,220	2,796.00	6,207,120
琉球銀行	5,000	979.00	4,895,000
セブン銀行	91,800	293.00	26,897,400
みずほフィナンシャルグループ	3,474,100	142.00	493,322,200
高知銀行	9,000	99.00	891,000
山口フィナンシャルグループ	23,000	907.00	20,861,000
アクリーティブ	2,000	328.00	656,000
芙蓉総合リース	2,800	4,025.00	11,270,000
興銀リース	4,600	1,681.00	7,732,600
東京センチュリーリース	5,800	3,175.00	18,415,000
SBIホールディングス	29,400	952.00	27,988,800
日本証券金融	10,800	363.00	3,920,400
アイフル	41,000	297.00	12,177,000
日本アジア投資	1,700	298.00	506,600
ポケットカード	2,400	494.00	1,185,600
長野銀行	8,000	192.00	1,536,000

名古屋銀行	21,000	298.00	6,258,000
北洋銀行	36,900	257.00	9,483,300
愛知銀行	800	3,985.00	3,188,000
第三銀行	14,000	150.00	2,100,000
中京銀行	10,000	226.00	2,260,000
大光銀行	9,000	172.00	1,548,000
愛媛銀行	14,000	216.00	3,024,000
トマト銀行	9,000	133.00	1,197,000
みなと銀行	22,000	143.00	3,146,000
京葉銀行	20,000	364.00	7,280,000
関西アーバン銀行	3,400	863.00	2,934,200
栃木銀行	13,000	319.00	4,147,000
北日本銀行	800	2,370.00	1,896,000
東和銀行	46,000	77.00	3,542,000
福島銀行	30,000	86.00	2,580,000
大東銀行	15,000	171.00	2,565,000
リコーリース	1,900	2,494.00	4,738,600
イオンフィナンシャルサービス	16,100	2,140.00	34,454,000
アコム	49,200	467.00	22,976,400
ジャックス	14,000	472.00	6,608,000
オリエントコーポレーション	105,900	176.00	18,638,400
日立キャピタル	5,800	1,731.00	10,039,800
アプラスフィナンシャル	11,700	89.00	1,041,300
オリックス	173,500	1,251.00	217,048,500
三菱UFJリース	62,100	351.00	21,797,100
ジャフコ	4,100	2,369.00	9,712,900
トモニホールディングス	18,800	305.00	5,734,000
大和証券グループ本社	229,000	513.90	117,683,100
野村ホールディングス	471,300	352.60	166,180,380
岡三証券グループ	21,000	436.00	9,156,000
丸三証券	7,300	814.00	5,942,200
東洋証券	9,000	171.00	1,539,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	28,100	414.00	11,633,400
光世証券	6,000	102.00	612,000
水戸証券	7,600	207.00	1,573,200
いちよし証券	5,500	698.00	3,839,000
松井証券	12,000	829.00	9,948,000
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	54,400	2,600.00	141,440,000
だいこう証券ビジネス	1,200	542.00	650,400
日本取引所グループ	71,900	1,155.00	83,044,500
マネックスグループ	28,500	219.00	6,241,500
カブドットコム証券	20,900	304.00	6,353,600
極東証券	3,300	1,041.00	3,435,300
岩井コスモホールディングス	2,300	800.00	1,840,000
藍澤証券	4,600	490.00	2,254,000
フィデアホールディングス	20,000	129.00	2,580,000
池田泉州ホールディングス	26,000	364.00	9,464,000
アニコムホールディングス	1,700	2,683.00	4,561,100

MS & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	73,200	2,429.00	177,802,800	
マネースクウェアHD	800	782.00	625,600	
ソニーフィナンシャルホールディング ス	23,500	1,050.00	24,675,000	
マネーパートナーズグループ	2,300	510.00	1,173,000	
小林洋行	700	278.00	194,600	
第一生命保険	157,000	1,011.50	158,805,500	
東京海上ホールディングス	99,200	3,252.00	322,598,400	
イー・ギャランティ	800	3,050.00	2,440,000	
アサックス	400	1,336.00	534,400	
NECキャピタルソリューション	1,000	1,377.00	1,377,000	
T & Dホールディングス	89,300	813.00	72,600,900	
三井不動産	130,000	2,039.00	265,070,000	
三菱地所	182,000	1,727.50	314,405,000	
平和不動産	4,600	1,199.00	5,515,400	
東京建物	26,800	1,143.00	30,632,400	
ダイビル	6,300	802.00	5,052,600	
京阪神ビルディング	4,100	494.00	2,025,400	
住友不動産	59,000	2,453.50	144,756,500	
太平洋興発	10,000	66.00	660,000	
大京	46,000	142.00	6,532,000	
テーオーシー	9,500	770.00	7,315,000	
東京楽天地	4,000	471.00	1,884,000	
レオパレス21	28,900	688.00	19,883,200	
スターツコーポレーション	2,800	1,881.00	5,266,800	
フジ住宅	3,100	635.00	1,968,500	
空港施設	3,000	471.00	1,413,000	
明和地所	1,300	540.00	702,000	
住友不動産販売	1,800	1,980.00	3,564,000	
ゴールドクレスト	1,900	1,442.00	2,739,800	
リログループ	1,000	16,780.00	16,780,000	
日本エスリード	1,000	987.00	987,000	
日神不動産	3,300	330.00	1,089,000	
タカラレーベン	10,700	779.00	8,335,300	
サンヨーハウジング名古屋	1,300	879.00	1,142,700	
イオンモール	15,800	1,212.00	19,149,600	
ファースト住建	900	1,161.00	1,044,900	
ランド	11,400	19.00	216,600	
東祥	800	4,620.00	3,696,000	
トーセイ	3,700	760.00	2,812,000	
穴吹興産	3,000	242.00	726,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	15,200	1,014.00	15,412,800	
サンフロンティア不動産	3,000	963.00	2,889,000	
エフ・ジェー・ネクスト	2,100	491.00	1,031,100	
ランドビジネス	1,400	236.00	330,400	
グランディハウス	2,100	314.00	659,400	
東武鉄道	133,000	563.00	74,879,000	
相鉄ホールディングス	43,000	553.00	23,779,000	
東京急行電鉄	144,000	861.00	123,984,000	

京浜急行電鉄	68,000	1,028.00	69,904,000
小田急電鉄	80,000	1,197.00	95,760,000
京王電鉄	69,000	956.00	65,964,000
京成電鉄	37,000	1,294.00	47,878,000
富士急行	7,000	1,457.00	10,199,000
新京成電鉄	3,000	375.00	1,125,000
東日本旅客鉄道	45,400	9,339.00	423,990,600
西日本旅客鉄道	23,900	6,486.00	155,015,400
東海旅客鉄道	22,200	18,065.00	401,043,000
西武ホールディングス	26,400	1,582.00	41,764,800
鴻池運輸	3,500	1,023.00	3,580,500
西日本鉄道	32,000	509.00	16,288,000
ハマキョウレックス	1,900	1,890.00	3,591,000
サカイ引越センター	1,000	2,897.00	2,897,000
近鉄グループホールディングス	250,000	432.00	108,000,000
阪急阪神ホールディングス	167,000	756.00	126,252,000
南海電気鉄道	56,000	574.00	32,144,000
京阪ホールディングス	56,000	711.00	39,816,000
神戸電鉄	6,000	361.00	2,166,000
名古屋鉄道	90,000	588.00	52,920,000
山陽電気鉄道	9,000	478.00	4,302,000
トランコム	700	6,600.00	4,620,000
日本通運	96,000	469.00	45,024,000
ヤマトホールディングス	44,400	2,546.00	113,042,400
山九	33,000	527.00	17,391,000
日新	10,000	281.00	2,810,000
丸運	1,300	239.00	310,700
丸全昭和運輸	8,000	359.00	2,872,000
センコー	11,200	617.00	6,910,400
トナミホールディングス	5,000	264.00	1,320,000
ニッコンホールディングス	7,900	1,812.00	14,314,800
日本石油輸送	3,000	218.00	654,000
福山通運	15,000	559.00	8,385,000
セイノーホールディングス	17,600	973.00	17,124,800
神奈川中央交通	3,000	589.00	1,767,000
日立物流	5,200	1,645.00	8,554,000
丸和運輸機関	700	3,010.00	2,107,000
C & F ロジホールディングス	2,400	1,031.00	2,474,400
日本郵船	223,000	169.00	37,687,000
商船三井	121,000	202.00	24,442,000
川崎汽船	109,000	244.00	26,596,000
NSユナイテッド海運	11,000	120.00	1,320,000
明治海運	2,200	292.00	642,400
飯野海運	12,800	357.00	4,569,600
共栄タンカー	2,000	147.00	294,000
日本航空	47,500	3,022.00	143,545,000
ANAホールディングス	461,000	276.70	127,558,700
パスコ	2,000	295.00	590,000
三菱倉庫	18,000	1,360.00	24,480,000
三井倉庫ホールディングス	14,000	253.00	3,542,000

住友倉庫	18,000	480.00	8,640,000
澁澤倉庫	6,000	272.00	1,632,000
ヤマタネ	11,000	131.00	1,441,000
東陽倉庫	4,200	212.00	890,400
乾汽船	2,000	860.00	1,720,000
日本トランスシティ	6,000	346.00	2,076,000
ケイヒン	5,000	128.00	640,000
中央倉庫	1,400	892.00	1,248,800
安田倉庫	1,900	585.00	1,111,500
東洋埠頭	7,000	135.00	945,000
宇徳	2,000	287.00	574,000
上組	30,000	893.00	26,790,000
サンリツ	600	485.00	291,000
キムラユニティー	600	1,007.00	604,200
キューソー流通システム	700	2,523.00	1,766,100
郵船ロジスティクス	2,300	947.00	2,178,100
近鉄エクスプレス	4,400	1,213.00	5,337,200
東海運	1,300	251.00	326,300
エーアイティー	1,500	829.00	1,243,500
内外トランスライン	800	902.00	721,600
東京放送ホールディングス	14,700	1,318.00	19,374,600
日本テレビホールディングス	22,400	1,654.00	37,049,600
朝日放送	2,400	605.00	1,452,000
テレビ朝日ホールディングス	6,700	1,603.00	10,740,100
スカパーJ S A Tホールディングス	18,600	443.00	8,239,800
テレビ東京ホールディングス	2,200	1,963.00	4,318,600
日本BS放送	500	992.00	496,000
U-NEXT	800	732.00	585,600
ワイヤレスゲート	700	1,591.00	1,113,700
コネクシオ	2,200	1,370.00	3,014,000
日本通信	17,300	209.00	3,615,700
クロップス	400	511.00	204,400
日本電信電話	189,300	4,829.00	914,129,700
KDDI	242,300	3,134.00	759,368,200
光通信	2,900	8,580.00	24,882,000
NTTドコモ	183,000	2,795.00	511,485,000
エムティーアイ	3,700	633.00	2,342,100
GMOインターネット	8,900	1,025.00	9,122,500
カドカワ	7,600	1,390.00	10,564,000
学研ホールディングス	8,000	254.00	2,032,000
ゼンリン	3,200	1,916.00	6,131,200
昭文社	1,300	536.00	696,800
インプレスホールディングス	2,000	131.00	262,000
東京電力ホールディングス	210,500	403.00	84,831,500
中部電力	75,900	1,422.00	107,929,800
関西電力	101,300	956.70	96,913,710
中国電力	34,300	1,291.00	44,281,300
北陸電力	24,300	1,249.00	30,350,700
東北電力	62,000	1,266.00	78,492,000
四国電力	22,300	1,142.00	25,466,600

九州電力	54,800	994.00	54,471,200
北海道電力	23,200	779.00	18,072,800
沖縄電力	4,000	2,127.00	8,508,000
電源開発	21,200	2,392.00	50,710,400
ファーストエスコ	1,000	687.00	687,000
イーレックス	700	2,343.00	1,640,100
東京瓦斯	277,000	414.60	114,844,200
大阪瓦斯	257,000	390.50	100,358,500
東邦瓦斯	63,000	866.00	54,558,000
北海道瓦斯	6,000	276.00	1,656,000
広島ガス	4,300	302.00	1,298,600
西部瓦斯	28,000	242.00	6,776,000
静岡ガス	7,000	713.00	4,991,000
メタウォーター	1,600	2,903.00	4,644,800
アイネット	1,400	1,077.00	1,507,800
松竹	16,000	1,074.00	17,184,000
東宝	17,500	2,696.00	47,180,000
エイチ・アイ・エス	4,200	3,085.00	12,957,000
東映	9,000	908.00	8,172,000
AOI Pro.	1,200	956.00	1,147,200
ラックランド	400	1,526.00	610,400
エヌ・ティ・ティ・データ	15,100	4,725.00	71,347,500
共立メンテナンス	1,900	6,310.00	11,989,000
イチネンホールディングス	2,700	907.00	2,448,900
建設技術研究所	1,500	777.00	1,165,500
スペース	1,400	1,119.00	1,566,600
アインホールディングス	2,900	6,920.00	20,068,000
燦ホールディングス	500	1,331.00	665,500
ピー・シー・エー	300	1,172.00	351,600
スバル興業	2,000	382.00	764,000
東京テアトル	10,000	113.00	1,130,000
ビジネスブレイン太田昭和	400	907.00	362,800
ナガワ	500	3,510.00	1,755,000
よみうりランド	5,000	431.00	2,155,000
東京都競馬	18,000	201.00	3,618,000
常磐興産	10,000	148.00	1,480,000
カナモト	3,600	1,841.00	6,627,600
東京ドーム	21,000	453.00	9,513,000
D T S	2,700	1,878.00	5,070,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	10,400	3,290.00	34,216,000
シーイーシー	1,600	1,286.00	2,057,600
カブコン	6,300	2,169.00	13,664,700
西尾レントオール	2,100	2,023.00	4,248,300
アイ・エス・ビー	400	824.00	329,600
アゴラ・ホスピタリティー・グループ	13,000	34.00	442,000
日本空港ビルデング	7,800	3,540.00	27,612,000
トランス・コスモス	3,000	2,877.00	8,631,000
乃村工藝社	5,500	1,604.00	8,822,000

ジャステック	1,600	960.00	1,536,000
S C S K	5,800	3,675.00	21,315,000
藤田観光	9,000	342.00	3,078,000
K N T - C Tホールディングス	13,000	131.00	1,703,000
日本管財	2,200	1,647.00	3,623,400
トーカイ	1,100	3,005.00	3,305,500
白洋舎	300	2,394.00	718,200
セコム	27,000	7,443.00	200,961,000
日本システムウエア	900	1,021.00	918,900
セントラル警備保障	1,100	1,945.00	2,139,500
アイネス	3,500	982.00	3,437,000
丹青社	4,900	712.00	3,488,800
メイテック	3,100	3,535.00	10,958,500
T K C	2,300	2,651.00	6,097,300
アサツー ディ・ケイ	4,500	2,219.00	9,985,500
富士ソフト	3,600	2,258.00	8,128,800
応用地質	2,400	1,006.00	2,414,400
船井総研ホールディングス	3,600	1,299.00	4,676,400
N S D	5,200	1,623.00	8,439,600
進学会	1,200	494.00	592,800
丸紅建材リース	2,000	166.00	332,000
オオバ	1,900	390.00	741,000
コナミホールディングス	11,100	4,050.00	44,955,000
学究社	400	1,140.00	456,000
ベネッセホールディングス	8,700	2,376.00	20,671,200
イオンディライト	2,500	2,828.00	7,070,000
ナック	1,600	792.00	1,267,200
福井コンピュータホールディングス	700	2,085.00	1,459,500
ニチイ学館	4,500	658.00	2,961,000
ダイセキ	4,900	1,787.00	8,756,300
ステップ	900	1,060.00	954,000
日鉄住金物産	21,000	327.00	6,867,000
元気寿司	700	2,047.00	1,432,900
トラスコ中山	2,800	5,190.00	14,532,000
ヤマダ電機	74,500	536.00	39,932,000
オートバックスセブン	9,100	1,385.00	12,603,500
アークランドサカモト	4,100	1,130.00	4,633,000
ニトリホールディングス	10,600	13,120.00	139,072,000
グルメ杵屋	2,000	964.00	1,928,000
愛眼	1,900	199.00	378,100
ケーユーホールディングス	1,300	707.00	919,100
吉野家ホールディングス	9,000	1,393.00	12,537,000
加藤産業	3,800	2,330.00	8,854,000
イノテック	2,200	408.00	897,600
イエローハット	2,300	2,267.00	5,214,100
松屋フーズ	1,200	2,758.00	3,309,600
J B C Cホールディングス	2,000	642.00	1,284,000
J Kホールディングス	2,500	460.00	1,150,000
サガミチェーン	3,300	1,192.00	3,933,600
日伝	1,000	3,060.00	3,060,000

関西スーパーマーケット	2,000	985.00	1,970,000	
ミロク情報サービス	1,800	1,449.00	2,608,200	
北沢産業	2,000	151.00	302,000	
杉本商事	1,400	1,120.00	1,568,000	
因幡電機産業	3,400	3,350.00	11,390,000	
王将フードサービス	1,800	3,790.00	6,822,000	
プレナス	2,700	1,750.00	4,725,000	
ミニストップ	1,800	1,647.00	2,964,600	
アークス	4,600	2,586.00	11,895,600	
バローホールディングス	5,300	2,656.00	14,076,800	
バイテックホールディングス	1,000	1,014.00	1,014,000	
ミスミグループ本社	27,500	1,686.00	46,365,000	
藤久	200	1,674.00	334,800	
アルテック	2,100	128.00	268,800	
ベルク	1,200	4,280.00	5,136,000	
大 庄	1,300	1,527.00	1,985,100	
タキヒヨー	4,000	420.00	1,680,000	
ファーストリテイリング	4,100	25,445.00	104,324,500	
ソフトバンクグループ	138,800	5,399.00	749,381,200	
蔵王産業	400	1,271.00	508,400	
スズケン	11,100	3,095.00	34,354,500	
サンドラッグ	5,200	9,060.00	47,112,000	
サックスパー ホールディングス	2,300	904.00	2,079,200	
ジェコス	1,700	918.00	1,560,600	
ヤマザワ	500	1,680.00	840,000	
やまや	500	1,588.00	794,000	
ルネサスイーストン	2,000	393.00	786,000	
ベルーナ	6,100	573.00	3,495,300	
合計	41,079,520		44,457,897,740	

(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7月29日現在

資産総額	47,155,667,415円
負債総額	686,694,647円
純資産総額(-)	46,468,972,768円
発行済数量	35,182,943口
1口当たり純資産額(/)	1,320.78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かかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

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

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを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、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(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、交換請求の受付け、交換有価証券の交付および信託終了にかかる金銭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1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1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。

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、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。

平成28年7月29日現在、D I A Mアセットマネジメント株式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	0	0
追加型株式投資信託	389	5,918,600,293,964
単位型公社債投資信託	48	353,027,465,726
単位型株式投資信託	7	79,600,055,072
合計	444	6,351,227,814,762

（ご参考）

平成28年7月29日現在におけるみずほ投信投資顧問株式会社および新光投信株式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）

・みずほ投信投資顧問株式会社

基本的性格	本数	純資産総額(円)
追加型公社債投資信託	13	250,148,557,515
追加型株式投資信託	234	2,260,638,584,910
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	3	1,491,433,486
合計	250	2,512,278,575,911

・新光投信株式会社

基本的性格	本数	純資産総額(円)
追加型公社債投資信託	25	622,747,870,142
追加型株式投資信託	244	3,210,390,488,192
単位型公社債投資信託	6	40,614,819,596
単位型株式投資信託	75	269,539,047,169
合計	350	4,143,292,225,099

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。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第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株式会社に変更いたしました。

委託会社の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新光投信株式会社の第56期事業年度の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 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,079,828	973,035
会計方針の変更による累積的影響額	203,600	-
会計方針の変更を反映した期首残高	876,227	973,035
勤務費用	128,297	134,944
利息費用	7,798	8,660
数理計算上の差異の発生額	10,345	21,441
退職給付の支払額	49,633	51,531
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	973,035	1,086,550

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(千円)

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

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

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

（3）主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

(1) サービスごとの情報

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

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

当社は、本邦の外部顧客に対する営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

当社は、本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

特定の顧客に対する営業収益で損益計算書の営業収益の10%以上を占めるものがないため、記載を省略しております。

(関連当事者との取引)

(1) 親会社及び法人主要株主等

第30期(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その他 の関係 会社	第一生命 保険株式 会社	東京都 千代田 区	3,431 億円	生命保 険業	(被所有) 直接50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用 の助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	862,448	未収投資 助言報酬	237,575

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	3,431億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	795,405	未収投資助言報酬	207,235

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(2)子会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	DIAM International Ltd	London United kingdom	4,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	658,756	未払費用	235,583
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000千USD	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	383,980	未払費用	173,074
	DIAM SINGAPORE PTE.LTD.	Central Singapore	1,100,000千円	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	増資の引受	400,000	-	-

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 (被 所有) 割合	関係内容		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
子 会 社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	9,000 千GBP	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払 増資の引受	800,617 912,600	未払 費用 -	308,974 -
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000 千USD	資産の 運用	(所有) 直接 100%	兼務 2名	当社預 り資産 の運用	当社預り資 産の運用の 顧問料の支 払	473,948	未払 費用	157,130

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額及び期末残高には免税取引のため、消費税等は含まれておりません。

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関係				
その他の 関係会 社の子 会社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	2,217,439	未払 手数料	306,365
								預金の預入 (純額)	551,351	現金・ 預金	11,276,198
								受取利息	2,139	未収 収益	71
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払	407,531	未払 費用	240,725
								業務委託料 の支払	8,540	未払金	6,501
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 追加 (純額)	3,500,000	金銭の 信託	14,169,657
								信託報酬の 支払	8,254		

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関 係				
その他の 関係会 社の子 会社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	兼務 1名	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	3,023,040	未払 手数料	372,837
								預金の預入 (純額)	879,733	現金・ 預金	12,155,931
								受取利息	1,787	未収 収益	123
その他の 関係会 社の子 会社	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払	557,013	未払 費用	292,861
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 払戻 (純額)	700,000	金銭の 信託	13,094,914
								信託報酬の 支払	8,336		

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注3) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

(注4) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注5) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

(1株当たり情報)

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	1,254,132円02銭	1,357,615円66銭
1株当たり当期純利益金額	213,583円46銭	213,606円51銭

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第30期 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
当期純利益	5,126,003千円	5,126,556千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,126,003千円	5,126,556千円
期中平均株式数	24,000株	24,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(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。
- 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、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。

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。

(1)貸借対照表

	（単位： 千円）	
	前事業年度 （平成27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	20,801,864	20,903,257
有価証券	127,840	82,540
前払費用	156,891	157,231
未収委託者報酬	1,827,951	2,183,032
未収運用受託報酬	1,812,198	1,713,643
繰延税金資産	185,882	162,369
その他流動資産	159,069	293,051
貸倒引当金	1,092	1,185
流動資産合計	25,070,606	25,493,940
固定資産		
有形固定資産		
建物（純額）	124,850	100,000
工具、器具及び備品（純額）	71,443	90,655
リース資産（純額）	2,140	818
有形固定資産合計	1 198,434	1 191,474
無形固定資産		
電話加入権	12,747	12,747
その他無形固定資産	65	35
無形固定資産合計	12,812	12,782
投資その他の資産		
投資有価証券	3,987,168	3,260,206
長期差入保証金	360,258	340,503
前払年金費用	331,766	346,659
会員権	8,400	8,400
その他	23,186	19,551
貸倒引当金	19,534	19,404
投資その他の資産合計	4,691,245	3,955,916
固定資産合計	4,902,492	4,160,172
資産合計	29,973,099	29,654,112
負債の部		
流動負債		
預り金	77,889	29,699
リース債務	2,648	1,202
未払金		
未払収益分配金	746	833
未払償還金	5,716	3,906
未払手数料	819,341	838,064
その他未払金	86,205	9,022
未払金合計	912,009	851,826
未払費用	2,038,097	1,896,033
未払法人税等	393,574	570,376
未払消費税等	426,857	227,078
賞与引当金	328,900	318,000
その他流動負債	3,075	999
流動負債合計	4,183,052	3,895,216
固定負債		
リース債務	2,088	886
役員退職慰労引当金	104,240	147,427
時効後支払損引当金	8,128	6,471
繰延税金負債	306,725	38,000
その他固定負債	6,926	1,931
固定負債合計	428,109	194,716
負債合計	4,611,161	4,089,932
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,045,600	2,045,600

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

(2)損益計算書

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

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

(3)株主資本等変動計算書

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位: 千円)

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

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	41,248	41,248	23,842,406
当期変動額			
剰余金の配当			352,443
当期純利益			1,103,790
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	768,183	768,183	768,183
当期変動額合計	768,183	768,183	1,519,530
当期末残高	726,935	726,935	25,361,937

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位: 千円)

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

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	726,935	726,935	25,361,937
当期変動額			
剰余金の配当			551,284
当期純利益			1,720,534
自己株式の取得			377,863
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	589,143	589,143	589,143
当期変動額合計	589,143	589,143	202,242
当期末残高	137,791	137,791	25,564,180

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

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

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

(3) リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定率法を採用しております。

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金（前払年金費用）

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

(4) 役員退職慰労引当金

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

(5) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

5. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

時価ヘッジによっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段...株価指数先物取引

ヘッジ対象...有価証券

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジの有効性評価の方法

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

7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

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

1. 概要

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

2. 適用予定日

当社は、当該適用指針を平成28年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。

3. 当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、軽微であります。

会計上の見積りの変更に関する注記

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

追加情報

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

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

注記事項

（貸借対照表関係）

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

（損益計算書関係）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1 減損損失

当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

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

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

2 事業再構築費用

事業再構築に伴うグループ会社への転籍関連費用であります。

3 外国税負担損失

証券投資信託に係る外国税負担額であります。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当するものはありません。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1 発行済株式に関する事項

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

2 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

（2）基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1 発行済株式に関する事項

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

2 自己株式に関する事項

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

（変動事由の概要）

平成28年1月6日の株主総会決議による自己株式の取得 13,662株

3. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 売上高

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

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 売上高

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

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当するものはありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

上記の取引については、一般取引条件と同様に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

(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。

なお、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、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。

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。

(1) 貸借対照表

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

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

(2) 損益計算書

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	平成26年4月1日	(自	平成27年4月1日
	至	平成27年3月31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

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または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おります。

(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
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500	「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。
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616	「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。
みずほ証券株式会社	125,167	「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。
J Pモルガン証券株式会社	73,272	「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。
UBS証券株式会社	46,450	「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。
ソシエテ・ジェネラル証券株式会社	(1) 30,765	「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。
大和証券株式会社	100,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
東海東京証券株式会社	6,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ドイツ証券株式会社	72,728	「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。
S M B C日興証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
野村證券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
B N Pパリバ証券株式会社	102,025	「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。
メリルリンチ日本証券株式会社	119,440	「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。
モルガン・スタンレーMUF G証券株式会社	62,149	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は平成28年3月末日現在

（ 1 ）平成28年5月1日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1)募集販売の取扱い
- (2)追加設定の申込事務
- (3)交換請求の受付
- (4)受益権の買取りに関する事務
- (5)信託終了時の取扱い
- (6)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。

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8月10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

P w C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 E T F トピックスの平成28年1月9日から平成28年7月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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 E T F トピックスの平成28年7月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を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

D I A Mアセットマネジメント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。