

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書の訂正届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長
<b>【提出日】</b>	平成29年4月5日
<b>【発行者名】</b>	アセットマネジメントOne株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 西 恵正
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	上野 圭子
<b>【電話番号】</b>	03-6774-5100
<b>【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】</b>	One ETF トピックス
<b>【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】</b>	10兆円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	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)

**1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

有価証券報告書の提出に伴い、平成28年10月7日付をもって提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)について、ファンドの名称の変更および記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

**2【訂正の内容】**

\_\_\_\_\_の部分は訂正部分を示します。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

<訂正前>

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。)

<訂正後>

One 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。)

## 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】

### (2)【ファンドの沿革】

<訂正前>

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

<訂正後>

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

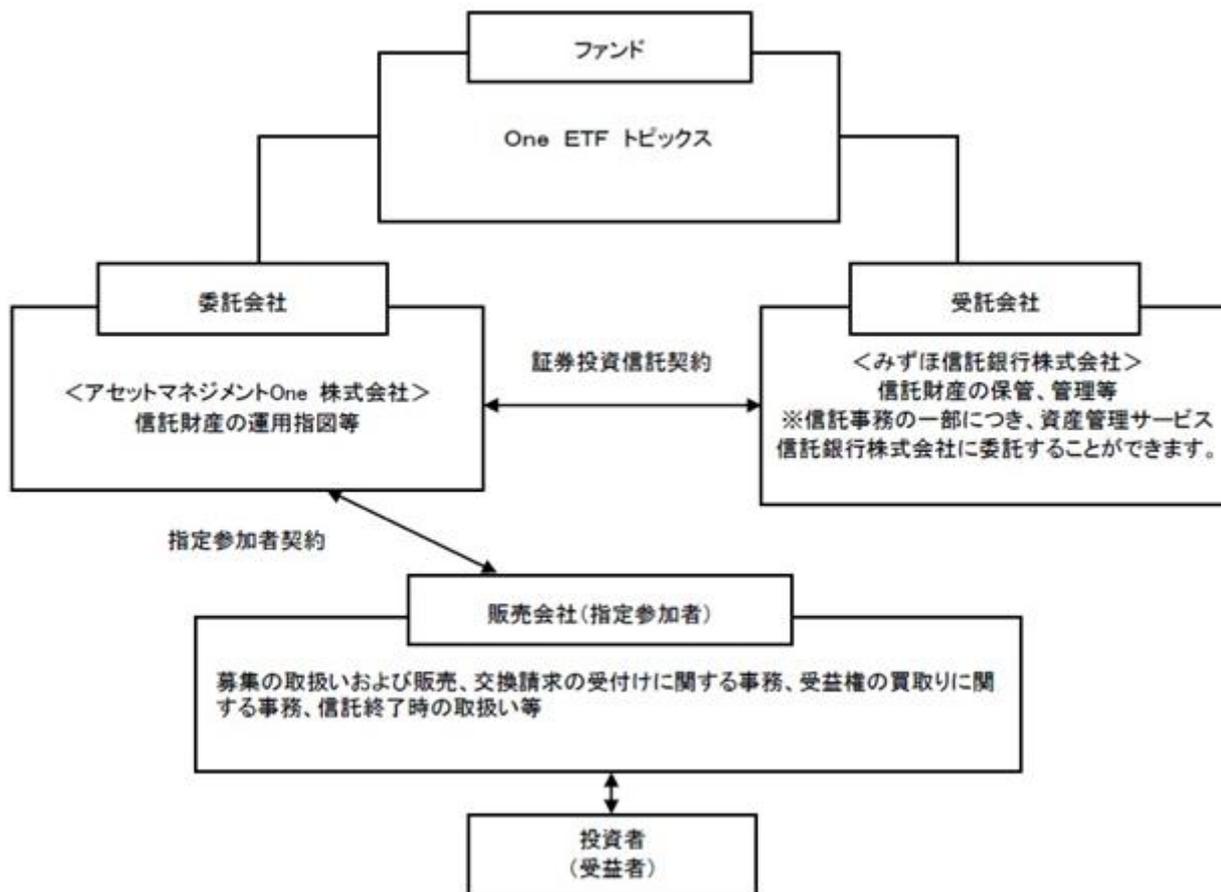
平成27年9月7日 ファンドの受益権を東京証券取引所へ上場

平成29年4月5日 ファンドの名称を「DIAM ETF トピックス」から「One ETF トピックス」に変更

### (3)【ファンドの仕組み】

原届出書の「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 (3)ファンドの仕組み」  
につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>



#### ・「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29年1月31日現在）

#### 委託会社の沿革

昭和60年7月1日	会社設立
平成10年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
平成10年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可

平成11年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
平成20年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更
平成28年10月1日	DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社(資産運用部門)が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

## 大株主の状況

(平成29年1月31日現在)

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

1：A種種類株式(15,510株)を含みます。

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

## 2【投資方針】

### (3)【運用体制】

<訂正前>

(略)

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。

<訂正後>

(略)

運用体制は平成29年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 3【投資リスク】

<訂正前>

(略)

<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

(略)

<リスク管理体制>

(略)

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。

<訂正後>

(略)

<その他の留意点>

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

有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。

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ことがあること
- ・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

(略)

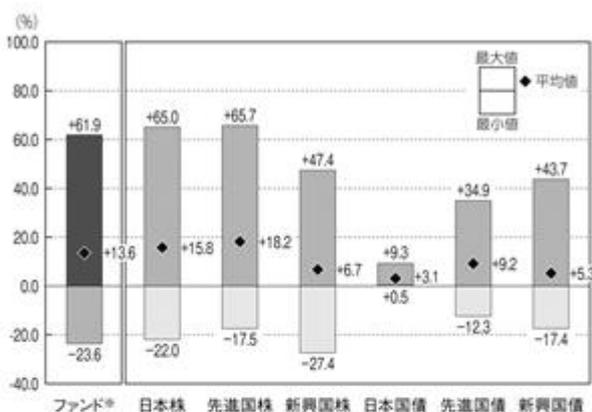
<リスク管理体制>

(略)

上記体制は平成29年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

「参考情報」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

**(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**

ファンド:2012年2月~2017年1月(2012年2月~2016年8月は対象指数のデータ)

代表的な資産クラス:2012年2月~2017年1月

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

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

\*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。

\*ファンドの年間騰落率がない期間については、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・表示していますので、ファンドの実績ではありません。

\*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・リ・ディバーシファイド(円ベース)  
(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースの指数を採用しています。

●「東証株価指数(TOPIX)」は、株式会社東京証券取引所(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・リ・ディバーシファイド」に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

#### 4【手数料等及び税金】

##### (3)【信託報酬等】

<訂正前>

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。

(略)

<訂正後>

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29年4月5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。

(略)

##### (4)【その他の手数料等】

<訂正前>

(略)

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。

<訂正後>

(略)

平成29年4月5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】

<訂正前>

(略)

上記は平成28年7月末現在のものですので、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。

<訂正後>

(略)

上記は平成29年1月末現在のものですので、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】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

## (1)【投資状況】

平成29年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	86,279,195,365	98.87
内 日本	86,279,195,365	98.87
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	989,880,537	1.13
純資産総額	87,269,075,902	100.00

その他資産の投資状況

平成29年1月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	970,880,000	1.11
内 日本	970,880,000	1.11

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成29年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	472,800	6,882.13 3,253,874,130	6,584.00 3,112,915,200	- -	3.57%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	2,908,600	734.06 2,135,087,744	730.90 2,125,895,740	- -	2.44%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	308,100	5,063.19 1,559,968,862	4,979.00 1,534,029,900	- -	1.76%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	172,800	8,382.42 1,448,483,823	8,701.00 1,503,532,800	- -	1.72%
5	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	307,400	4,522.01 1,390,068,776	4,451.00 1,368,237,400	- -	1.57%
6	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	350,000	3,484.08 1,219,430,318	3,387.00 1,185,450,000	- -	1.36%
7	KDDI 日本	株式 情報・通信業	379,700	3,052.97 1,159,216,178	3,030.00 1,150,491,000	- -	1.32%
8	みずほフィナンシャルグル ープ 日本	株式 銀行業	5,211,300	213.52 1,112,745,206	210.30 1,095,936,390	- -	1.26%
9	ソニー 日本	株式 電気機器	274,600	3,354.40 921,120,360	3,423.00 939,955,800	- -	1.08%
10	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	241,500	3,884.55 938,120,800	3,640.00 879,060,000	- -	1.01%
11	ファナック 日本	株式 電気機器	39,400	20,391.43 803,422,357	22,165.00 873,301,000	- -	1.00%
12	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	286,800	2,742.99 786,691,177	2,706.50 776,224,200	- -	0.89%
13	キーエンス 日本	株式 電気機器	17,600	41,669.35 733,380,695	43,870.00 772,112,000	- -	0.88%
14	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	75,200	10,460.09 786,598,981	10,230.00 769,296,000	- -	0.88%
15	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	155,500	4,867.64 756,918,722	4,731.00 735,670,500	- -	0.84%
16	三菱商事 日本	株式 卸売業	288,000	2,544.09 732,700,788	2,549.50 734,256,000	- -	0.84%
17	セブン&アイ・ホールディ ングス 日本	株式 小売業	160,600	4,554.91 731,518,709	4,509.00 724,145,400	- -	0.83%
18	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	152,700	4,924.64 751,992,767	4,724.00 721,354,800	- -	0.83%
19	三菱電機 日本	株式 電気機器	414,800	1,648.39 683,752,358	1,721.50 714,078,200	- -	0.82%
20	信越化学工業 日本	株式 化学	73,000	9,445.70 689,536,805	9,747.00 711,531,000	- -	0.82%

21	キヤノン 日本	株式 電気機器	209,400	3,315.06 694,174,898	3,345.00 700,443,000	- -	0.80%
22	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	416,100	1,630.24 678,345,674	1,513.50 629,767,350	- -	0.72%
23	村田製作所 日本	株式 電気機器	40,800	15,400.17 628,326,985	15,255.00 622,404,000	- -	0.71%
24	三菱地所 日本	株式 不動産業	285,000	2,352.10 670,350,000	2,162.50 616,312,500	- -	0.71%
25	日立製作所 日本	株式 電気機器	934,000	655.00 611,778,070	647.60 604,858,400	- -	0.69%
26	ダイキン工業 日本	株式 機械	53,100	11,151.72 592,156,759	11,225.00 596,047,500	- -	0.68%
27	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	32,300	19,530.82 630,845,514	18,270.00 590,121,000	- -	0.68%
28	花王 日本	株式 化学	103,500	5,514.16 570,716,499	5,583.00 577,840,500	- -	0.66%
29	三井物産 日本	株式 卸売業	347,100	1,636.31 567,964,762	1,656.50 574,971,150	- -	0.66%
30	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	137,500	4,225.19 580,964,248	4,143.00 569,662,500	- -	0.65%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成29年1月31日現在

種類	投資比率
株式	98.87%
合計	98.87%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成29年1月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.48%
輸送用機器		9.34%
銀行業		8.43%
情報・通信業		7.93%
化学		6.61%
機械		5.06%
小売業		4.60%
医薬品		4.58%
卸売業		4.43%
食料品		4.31%
陸運業		4.19%
サービス業		3.59%
建設業		2.91%
保険業		2.67%
不動産業		2.50%
電気・ガス業		1.76%
その他製品		1.72%
精密機器		1.53%
鉄鋼		1.32%
その他金融業		1.25%
証券、商品先物取引業		1.22%
ガラス・土石製品		0.97%
非鉄金属		0.94%
ゴム製品		0.88%
繊維製品		0.71%
金属製品		0.70%
空運業		0.57%
石油・石炭製品		0.55%
鉱業		0.34%
パルプ・紙		0.24%
海運業		0.24%
倉庫・運輸関連業	0.19%	
水産・農林業	0.11%	
合計	98.87%	

(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29年1月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 2903月	買建	64	991,040,000	970,880,000	1.11%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日(平成29年1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	
第3計算期間末 (平成29年1月8日)	56,557	57,023	1,552.83	1,565.63	1,549
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
8月末日	49,365	-	1,327.78	-	-
9月末日	48,232	-	1,331.83	-	-
10月末日	50,790	-	1,402.46	-	1,403
11月末日	33,158	-	1,479.72	-	1,479
12月末日	55,753	-	1,530.77	-	-
平成29年1月末日	87,269	-	1,521.31	-	1,525

(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
第3計算期間	12.80

## 【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
第3計算期間	29.6

(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
第3計算期間	24,942,000	25,686,378

(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。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2017年1月31日

## 基準価額・純資産の推移

(設定日(2015年9月4日)~2017年1月31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
第3期	(2017.01.08)	1,280円
設定来累計		4,060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	98.87
内 日本	98.87
コールローン、その他の資産(負債控除後)	1.13
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)	1.11

## 組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	12.48%
2	輸送用機器	9.34%
3	銀行業	8.43%
4	情報・通信業	7.93%
5	化学	6.61%

## 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	3.57%
2	三菱UFJフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	2.44%
3	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.76%
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.72%
5	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.57%
6	本田技研工業	株式	日本	輸送用機器	1.36%
7	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.32%
8	みずほフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.26%
9	ソニー	株式	日本	電気機器	1.08%
10	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	1.01%

## 年間収益率の推移



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しております。

※当ファンドの収益率は、暦年ベースで表示しています。但し、2015年は設定日から年末までの収益率、および2017年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※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も参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
- 委託会社ホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

### 第3【ファンドの経理状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

#### <更新・訂正後>

(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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(平成28年7月9日から平成29年1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2期 平成28年7月8日現在	第3期 平成29年1月8日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	932,976,558	1,364,443,453
株式	44,457,897,740	55,557,455,993
派生商品評価勘定	328,056	42,489,264
未収入金	-	24,651,238
未収配当金	73,957,419	73,244,312
前払金	79,863,892	-
差入委託証拠金	47,283,108	60,599,544
流動資産合計	45,592,306,773	57,122,883,804
資産合計	45,592,306,773	57,122,883,804
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	33,203,720	-
前受金	-	69,829,544
未払金	59,118,456	-
未払収益分配金	564,927,988	466,200,793
未払受託者報酬	7,105,152	7,692,926
未払委託者報酬	12,687,803	13,737,398
未払利息	-	6,064
その他未払費用	15,887,157	8,198,295
流動負債合計	692,930,276	565,665,020
負債合計	692,930,276	565,665,020
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 54,820,314,625	1 53,722,357,075
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 9,920,938,128	2 2,834,861,709
（分配準備積立金）	3,404,514	2,999,118
元本等合計	44,899,376,497	56,557,218,784
純資産合計	44,899,376,497	56,557,218,784
負債純資産合計	45,592,306,773	57,122,883,804

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	平成28年1月9日 平成28年7月8日	自	平成28年7月9日 平成29年1月8日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		597,391,033		498,195,945
受取利息		41,568		741
有価証券売買等損益		8,708,628,279		13,110,199,333
派生商品取引等損益		131,931,736		216,967,184
その他収益		537,593		563,245
<b>営業収益合計</b>		<b>8,242,589,821</b>		<b>13,825,926,448</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		101,232		282,126
受託者報酬		7,105,152		7,692,926
委託者報酬		12,687,803		13,737,398
その他費用		10,966,229		11,252,084
<b>営業費用合計</b>		<b>30,860,416</b>		<b>32,964,534</b>
営業利益又は営業損失（ ）		8,273,450,237		13,792,961,914
経常利益又は経常損失（ ）		8,273,450,237		13,792,961,914
当期純利益又は当期純損失（ ）		8,273,450,237		13,792,961,914
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		9,920,938,128
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,908,657,625		198,935,720
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		198,935,720
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,211,959,708		769,897,004
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,211,959,708		769,897,004
分配金		2,564,927,988		2,466,200,793
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		<b>9,920,938,128</b>		<b>2,834,861,709</b>

## (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2期 平成28年7月8日現在	第3期 平成29年1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	41,363,501,700円 36,763,047,500円 23,306,234,575円	54,820,314,625円 36,789,450,000円 37,887,407,550円
2. 受益権の総数	37,166,315口	36,421,937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2期	第3期
	自 平成28年1月9日 至 平成28年7月8日	自 平成28年7月9日 至 平成29年1月8日
1 . 1 その他費用	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。	その他費用の内訳は、監査費用(271,902円)、ライセンス料(7,941,941円)、その他(3,038,241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(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。	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(498,477,805円)及び分配準備積立金(3,404,514円)の合計額から、経費(32,682,408円)を控除して計算される分配対象額は469,199,911円(100口当たり1,288円)であり、うち466,200,793円(100口当たり1,280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2期	第3期
	自 平成28年1月9日 至 平成28年7月8日	自 平成28年7月9日 至 平成29年1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	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 平成28年7月8日現在	第3期 平成29年1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2期 平成28年7月8日現在	第3期 平成29年1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	6,505,380,154	7,369,863,321
合計	6,505,380,154	7,369,863,321

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	第2期 平成28年7月8日 現在				第3期 平成29年1月8日 現在			
	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）
	うち 1年超				うち 1年超			
市場取引								
先物取引								
買 建	468,824,000	-	435,960,000	32,864,000	948,530,000	-	991,040,000	42,510,000
合計	468,824,000	-	435,960,000	32,864,000	948,530,000	-	991,040,000	42,510,000

## （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2期 平成28年7月8日現在	第3期 平成29年1月8日現在
1口当たり純資産額	1,208.07円	1,552.83円
（100口当たり純資産額）	（120,807円）	（155,283円）

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成29年1月8日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	1,100	2,740.00	3,014,000	
日本水産	35,700	575.00	20,527,500	
マルハニチロ	5,200	3,270.00	17,004,000	
ハウスイ	2,000	131.00	262,000	
カネコ種苗	900	1,555.00	1,399,500	
サカタのタネ	4,100	3,315.00	13,591,500	
ホクト	2,800	2,139.00	5,989,200	
ホクリヨウ	300	755.00	226,500	
ショーボンドホールディングス	2,900	5,030.00	14,587,000	
ミライト・ホールディングス	8,400	1,064.00	8,937,600	
タマホーム	2,100	545.00	1,144,500	
サンヨーホームズ	600	656.00	393,600	
住石ホールディングス	7,600	98.00	744,800	
日鉄鉱業	800	5,510.00	4,408,000	
三井松島産業	1,700	1,313.00	2,232,100	
国際石油開発帝石	144,700	1,153.50	166,911,450	
日本海洋掘削	1,000	2,483.00	2,483,000	
石油資源開発	4,400	2,632.00	11,580,800	
K&Oエナジーグループ	1,800	1,880.00	3,384,000	
ダイセキ環境ソリューション	600	1,477.00	886,200	
安藤・間	19,700	788.00	15,523,600	
東急建設	9,800	963.00	9,437,400	
コムシスホールディングス	10,700	2,173.00	23,251,100	
ミサワホーム	3,200	1,107.00	3,542,400	
ビーアールホールディングス	2,700	271.00	731,700	
高松コンストラクショングループ	2,100	2,480.00	5,208,000	
東建コーポレーション	1,100	8,500.00	9,350,000	
ソネック	300	636.00	190,800	
ヤマウラ	1,300	565.00	734,500	
大成建設	140,000	843.00	118,020,000	
大林組	82,400	1,133.00	93,359,200	
清水建設	84,000	1,098.00	92,232,000	
飛島建設	26,500	184.00	4,876,000	
長谷工コーポレーション	32,100	1,227.00	39,386,700	
松井建設	3,000	1,072.00	3,216,000	
銭高組	4,000	502.00	2,008,000	
鹿島建設	121,000	830.00	100,430,000	
不動テトラ	22,200	213.00	4,728,600	
大末建設	1,000	1,012.00	1,012,000	
鉄建建設	17,000	347.00	5,899,000	
西松建設	32,000	591.00	18,912,000	
三井住友建設	105,300	125.00	13,162,500	
大豊建設	10,000	562.00	5,620,000	

前田建設工業	17,000	1,049.00	17,833,000
佐田建設	1,900	451.00	856,900
ナカノフドー建設	2,100	617.00	1,295,700
奥村組	23,000	680.00	15,640,000
東鉄工業	3,300	3,140.00	10,362,000
イチケン	2,000	467.00	934,000
浅沼組	9,000	380.00	3,420,000
戸田建設	32,000	635.00	20,320,000
熊谷組	43,000	302.00	12,986,000
青木あすなろ建設	1,800	815.00	1,467,000
北野建設	6,000	329.00	1,974,000
植木組	3,000	258.00	774,000
三井ホーム	4,000	528.00	2,112,000
矢作建設工業	3,700	1,101.00	4,073,700
ピーエス三菱	2,900	397.00	1,151,300
日本ハウスホールディングス	5,600	519.00	2,906,400
大東建託	10,100	18,165.00	183,466,500
新日本建設	3,300	963.00	3,177,900
N I P P O	6,000	2,213.00	13,278,000
東亜道路工業	5,000	355.00	1,775,000
前田道路	9,000	1,980.00	17,820,000
日本道路	8,000	462.00	3,696,000
東亜建設工業	2,200	2,024.00	4,452,800
若築建設	16,000	158.00	2,528,000
東洋建設	7,900	423.00	3,341,700
五洋建設	30,500	579.00	17,659,500
大林道路	2,900	723.00	2,096,700
世紀東急工業	4,000	504.00	2,016,000
福田組	4,000	1,146.00	4,584,000
日本ドライケミカル	300	2,390.00	717,000
住友林業	18,900	1,590.00	30,051,000
日本基礎技術	3,100	366.00	1,134,600
日成ビルド工業	8,000	555.00	4,440,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	14,000	81.00	1,134,000
巴コーポレーション	3,400	366.00	1,244,400
パナホーム	10,000	964.00	9,640,000
大和ハウス工業	81,100	3,359.00	272,414,900
ライト工業	5,300	1,211.00	6,418,300
積水ハウス	86,400	1,991.00	172,022,400
日特建設	2,300	480.00	1,104,000
北陸電気工事	1,300	909.00	1,181,700
ユアテック	4,000	829.00	3,316,000
西部電気工業	500	2,297.00	1,148,500
四電工	2,000	450.00	900,000
中電工	3,500	2,604.00	9,114,000
関電工	11,000	1,080.00	11,880,000
きんでん	18,300	1,488.00	27,230,400
東京エネシス	3,000	1,018.00	3,054,000
トーエネック	4,000	583.00	2,332,000
住友電設	1,900	1,295.00	2,460,500

日本電設工業	4,500	1,895.00	8,527,500
協和エクシオ	10,800	1,728.00	18,662,400
新日本空調	2,100	1,296.00	2,721,600
日本工営	1,700	2,625.00	4,462,500
N D S	400	2,926.00	1,170,400
九電工	5,300	3,100.00	16,430,000
三機工業	6,100	996.00	6,075,600
日揮	25,600	2,160.00	55,296,000
中外炉工業	8,000	232.00	1,856,000
ヤマト	2,500	587.00	1,467,500
太平電業	4,000	1,145.00	4,580,000
高砂熱学工業	7,600	1,538.00	11,688,800
三晃金属工業	200	3,270.00	654,000
N E C ネットエスアイ	2,700	2,240.00	6,048,000
朝日工業社	600	2,984.00	1,790,400
明星工業	5,000	589.00	2,945,000
大気社	3,600	2,888.00	10,396,800
ダイダン	4,000	962.00	3,848,000
日比谷総合設備	3,100	1,689.00	5,235,900
東芝プラントシステム	4,500	1,619.00	7,285,500
日本製粉	8,200	1,672.00	13,710,400
日清製粉グループ本社	30,100	1,781.00	53,608,100
日東富士製粉	200	3,890.00	778,000
昭和産業	11,000	613.00	6,743,000
鳥越製粉	2,200	791.00	1,740,200
中部飼料	3,000	1,046.00	3,138,000
フィード・ワン	16,500	164.00	2,706,000
東洋精糖	4,000	117.00	468,000
日本甜菜製糖	1,400	2,373.00	3,322,200
三井製糖	1,900	2,530.00	4,807,000
塩水港精糖	2,900	250.00	725,000
日新製糖	1,200	1,706.00	2,047,200
ネクスト	6,300	849.00	5,348,700
ジェイエイシーリクルートメント	1,600	1,367.00	2,187,200
日本M & A センター	7,400	3,385.00	25,049,000
アコーディア・ゴルフ	7,700	1,202.00	9,255,400
中広	200	698.00	139,600
タケエイ	2,200	1,026.00	2,257,200
トラスト・テック	1,000	1,719.00	1,719,000
コシダカホールディングス	900	2,112.00	1,900,800
パソナグループ	2,200	845.00	1,859,000
C D S	600	1,040.00	624,000
リンクアンドモチベーション	6,000	444.00	2,664,000
G C A	2,300	873.00	2,007,900
エス・エム・エス	3,600	2,665.00	9,594,000
テンプホールディングス	19,800	1,903.00	37,679,400
リニカル	1,500	1,349.00	2,023,500
クックパッド	5,700	1,099.00	6,264,300
エスクリ	900	626.00	563,400
アイ・ケイ・ケイ	1,100	697.00	766,700

森永製菓	5,400	4,850.00	26,190,000
中村屋	600	5,040.00	3,024,000
江崎グリコ	6,900	5,580.00	38,502,000
名糖産業	1,200	1,398.00	1,677,600
不二家	16,000	226.00	3,616,000
山崎製パン	20,100	2,315.00	46,531,500
第一屋製パン	4,000	137.00	548,000
モロゾフ	4,000	510.00	2,040,000
亀田製菓	1,500	5,400.00	8,100,000
寿スピリッツ	2,000	2,825.00	5,650,000
カルビー	11,200	3,770.00	42,224,000
森永乳業	25,000	870.00	21,750,000
六甲バター	1,200	2,529.00	3,034,800
ヤクルト本社	14,700	5,570.00	81,879,000
明治ホールディングス	16,300	9,310.00	151,753,000
雪印メグミルク	5,900	3,325.00	19,617,500
プリマハム	17,000	425.00	7,225,000
日本ハム	19,000	3,215.00	61,085,000
林兼産業	900	879.00	791,100
丸大食品	13,000	500.00	6,500,000
S Foods	1,500	3,035.00	4,552,500
伊藤ハム米久ホールディングス	15,800	1,105.00	17,459,000
学情	1,100	1,233.00	1,356,300
スタジオアリス	1,000	2,244.00	2,244,000
シミックホールディングス	1,300	1,544.00	2,007,200
システナ	1,900	1,855.00	3,524,500
N J S	600	1,394.00	836,400
デジタルアーツ	1,100	2,731.00	3,004,100
新日鉄住金ソリューションズ	4,000	2,107.00	8,428,000
総合警備保障	9,300	4,620.00	42,966,000
キューブシステム	1,000	690.00	690,000
いちご	23,000	457.00	10,511,000
日本駐車場開発	29,200	168.00	4,905,600
コア	1,000	1,254.00	1,254,000
カカクコム	18,300	2,008.00	36,746,400
アイロムグループ	800	1,385.00	1,108,000
ルネサンス	1,300	1,546.00	2,009,800
ディップ	3,300	2,413.00	7,962,900
S B Sホールディングス	2,400	846.00	2,030,400
オプトホールディング	1,800	724.00	1,303,200
新日本科学	2,900	612.00	1,774,800
ツクイ	6,100	796.00	4,855,600
キャリアデザインセンター	500	1,310.00	655,000
エムスリー	22,200	3,100.00	68,820,000
ツカダ・グローバルホールディング	1,900	680.00	1,292,000
アウトソーシング	1,500	3,840.00	5,760,000
ウェルネット	1,900	1,392.00	2,644,800
ワールドホールディングス	600	2,165.00	1,299,000
ディー・エヌ・エー	11,500	2,721.00	31,291,500
博報堂DYホールディングス	35,500	1,477.00	52,433,500

ぐるなび	3,700	2,428.00	8,983,600	
エスアールジータカミヤ	2,800	620.00	1,736,000	
ジャパンベストレスキューシステム	3,200	249.00	796,800	
ファンコミュニケーションズ	6,500	758.00	4,927,000	
ライク	500	1,954.00	977,000	
WDBホールディングス	900	1,339.00	1,205,100	
ティア	1,200	646.00	775,200	
バリューコマース	2,400	340.00	816,000	
インフォマート	10,900	703.00	7,662,700	
サッポロホールディングス	9,000	3,050.00	27,450,000	
アサヒグループホールディングス	51,500	3,742.00	192,713,000	
麒麟ホールディングス	118,300	1,965.50	232,518,650	
宝ホールディングス	19,900	1,104.00	21,969,600	
オエノンホールディングス	7,000	274.00	1,918,000	
養命酒製造	800	1,888.00	1,510,400	
コカ・コーラウエスト	9,300	3,460.00	32,178,000	
コカ・コーライーストジャパン	10,700	2,584.00	27,648,800	
サントリー食品インターナショナル	18,800	4,965.00	93,342,000	
ダイドードリンコ	1,300	6,230.00	8,099,000	
伊藤園	8,100	3,995.00	32,359,500	
キーコーヒー	2,400	2,235.00	5,364,000	
ユニカフェ	700	977.00	683,900	
ジャパンフーズ	300	1,250.00	375,000	
日清オイリオグループ	16,000	566.00	9,056,000	
不二製油グループ本社	7,300	2,326.00	16,979,800	
かどや製油	300	4,000.00	1,200,000	
J・オイルミルズ	1,300	4,045.00	5,258,500	
ローソン	8,400	8,250.00	69,300,000	
サンエー	1,800	5,610.00	10,098,000	
カワチ薬品	1,900	3,055.00	5,804,500	
エービーシー・マート	4,400	6,970.00	30,668,000	
ハードオフコーポレーション	1,100	1,213.00	1,334,300	
高千穂交易	900	1,013.00	911,700	
アスクル	2,900	3,940.00	11,426,000	
ゲオホールディングス	4,000	1,399.00	5,596,000	
アダストリア	3,700	3,160.00	11,692,000	
ジーフット	1,500	830.00	1,245,000	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	300	723.00	216,900	
伊藤忠食品	600	4,410.00	2,646,000	
くらコーポレーション	1,600	4,935.00	7,896,000	
キャンドゥ	1,300	1,787.00	2,323,100	
エレマテック	1,000	1,955.00	1,955,000	
パルグループホールディングス	1,200	2,785.00	3,342,000	
JALUX	800	2,060.00	1,648,000	
エディオン	9,400	1,124.00	10,565,600	
あらた	1,100	2,709.00	2,979,900	
サーラコーポレーション	3,000	647.00	1,941,000	
ワッツ	1,000	1,131.00	1,131,000	
トーメンデバイス	400	2,082.00	832,800	
ハローズ	800	2,401.00	1,920,800	

J Pホールディングス	7,400	277.00	2,049,800
あみやき亭	500	4,010.00	2,005,000
東京エレクトロン デバイス	900	1,596.00	1,436,400
ひらまつ	3,300	678.00	2,237,400
フィールズ	1,800	1,368.00	2,462,400
双日	142,900	292.00	41,726,800
ゲンキー	500	6,120.00	3,060,000
アルフレッサ ホールディングス	28,600	1,947.00	55,684,200
大黒天物産	600	5,250.00	3,150,000
ハニーズ	2,100	1,218.00	2,557,800
ファーマライズホールディングス	600	530.00	318,000
キッコーマン	19,000	3,790.00	72,010,000
味の素	56,600	2,376.00	134,481,600
キューピー	14,000	2,944.00	41,216,000
ハウス食品グループ本社	10,200	2,479.00	25,285,800
カゴメ	9,900	2,990.00	29,601,000
焼津水産化学工業	1,300	1,159.00	1,506,700
アリアケジャパン	2,200	6,540.00	14,388,000
ピエトロ	300	1,639.00	491,700
エバラ食品工業	700	2,072.00	1,450,400
ニチレイ	13,500	2,533.00	34,195,500
横浜冷凍	6,000	1,058.00	6,348,000
東洋水産	13,500	4,180.00	56,430,000
イトアンド	300	2,187.00	656,100
大冷	200	1,727.00	345,400
日清食品ホールディングス	10,700	6,210.00	66,447,000
永谷園ホールディングス	3,000	1,439.00	4,317,000
一正蒲鉾	1,000	1,145.00	1,145,000
フジッコ	2,700	2,467.00	6,660,900
ロック・フィールド	2,900	1,595.00	4,625,500
日本たばこ産業	152,200	3,920.00	596,624,000
ケンコーマヨネーズ	1,000	3,365.00	3,365,000
わらべや日洋ホールディングス	1,600	2,469.00	3,950,400
なとり	1,400	1,961.00	2,745,400
北の達人コーポレーション	600	508.00	304,800
ユーグレナ	8,800	1,283.00	11,290,400
片倉工業	3,200	1,376.00	4,403,200
ゲンゼ	19,000	408.00	7,752,000
ヒューリック	50,500	1,084.00	54,742,000
神栄	3,000	186.00	558,000
山下医科器械	200	1,776.00	355,200
ラサ商事	1,000	624.00	624,000
アルペン	2,200	2,155.00	4,741,000
ラクーン	1,000	472.00	472,000
クオール	2,700	1,502.00	4,055,400
アルコニックス	1,400	1,705.00	2,387,000
神戸物産	1,300	4,185.00	5,440,500
ジェイアイエヌ	1,600	5,680.00	9,088,000
ビックカメラ	13,900	1,085.00	15,081,500
D C Mホールディングス	14,700	1,095.00	16,096,500

MonotaRO	8,600	2,620.00	22,532,000	
東京一番フーズ	600	548.00	328,800	
ダイヤモンドダイニング	500	1,291.00	645,500	
あい ホールディングス	4,300	2,375.00	10,212,500	
ディーブイエックス	900	1,362.00	1,225,800	
きちり	600	670.00	402,000	
アークランドサービスホールディングス	800	2,895.00	2,316,000	
J.フロント リテイリング	30,600	1,716.00	52,509,600	
ドトール・日レスホールディングス	4,200	2,166.00	9,097,200	
マツモトキヨシホールディングス	4,600	5,820.00	26,772,000	
ブロンコビリー	1,300	2,948.00	3,832,400	
スタートトゥデイ	22,100	2,098.00	46,365,800	
トレジャー・ファクトリー	700	923.00	646,100	
物語コーポレーション	600	4,235.00	2,541,000	
ココカラファイン	2,500	4,490.00	11,225,000	
三越伊勢丹ホールディングス	48,100	1,350.00	64,935,000	
東洋紡	102,000	181.00	18,462,000	
ユニチカ	70,000	84.00	5,880,000	
富士紡ホールディングス	1,200	3,395.00	4,074,000	
日清紡ホールディングス	13,600	1,160.00	15,776,000	
倉敷紡績	26,000	240.00	6,240,000	
ダイワボウホールディングス	21,000	290.00	6,090,000	
シキボウ	14,000	145.00	2,030,000	
日東紡績	21,000	462.00	9,702,000	
トヨタ紡織	8,600	2,679.00	23,039,400	
マクニカ・富士エレホールディングス	4,500	1,586.00	7,137,000	
Hamee	400	943.00	377,200	
ウエルシアホールディングス	2,400	7,330.00	17,592,000	
クリエイトSDホールディングス	3,600	2,566.00	9,237,600	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,500	1,025.00	4,612,500	
八洲電機	1,900	634.00	1,204,600	
UKCホールディングス	1,600	2,234.00	3,574,400	
丸善CHIホールディングス	2,800	376.00	1,052,800	
OCHIホールディングス	700	1,237.00	865,900	
TOKAIホールディングス	10,600	824.00	8,734,400	
ミサワ	400	510.00	204,000	
ティーライフ	200	1,412.00	282,400	
大阪工機	300	731.00	219,300	
エー・ピーカンパニー	400	833.00	333,200	
三洋貿易	1,300	1,607.00	2,089,100	
チムニー	700	2,913.00	2,039,100	
シュッピン	900	1,487.00	1,338,300	
ビューティガレージ	200	1,117.00	223,400	
ウイン・パートナーズ	1,700	1,007.00	1,711,900	
ネクステージ	500	2,024.00	1,012,000	
ジョイフル本田	3,900	3,170.00	12,363,000	
鳥貴族	600	2,611.00	1,566,600	
キリン堂ホールディングス	800	866.00	692,800	

ホットランド	1,100	1,154.00	1,269,400
すかいらく	10,400	1,577.00	16,400,800
綿半ホールディングス	1,000	1,664.00	1,664,000
日本毛織	7,200	862.00	6,206,400
ダイトウボウ	3,000	72.00	216,000
トーア紡コーポレーション	1,100	555.00	610,500
ガイドーリミテッド	2,900	418.00	1,212,200
ヨシックス	200	1,355.00	271,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	8,000	1,003.00	8,024,000
三栄建築設計	1,000	1,799.00	1,799,000
野村不動産ホールディングス	16,100	1,995.00	32,119,500
三重交通グループホールディングス	4,300	396.00	1,702,800
サムティ	1,900	1,168.00	2,219,200
ディア・ライフ	1,600	386.00	617,600
エー・ディー・ワークス	22,200	46.00	1,021,200
日本商業開発	1,300	2,025.00	2,632,500
プレサンスコーポレーション	3,800	1,463.00	5,559,400
ユニゾホールディングス	2,000	3,240.00	6,480,000
THEグローバル社	800	458.00	366,400
日本管理センター	1,700	1,350.00	2,295,000
サンセイランディック	500	728.00	364,000
エストラスト	400	685.00	274,000
フージャースホールディングス	3,100	630.00	1,953,000
オープンハウス	3,500	2,803.00	9,810,500
東急不動産ホールディングス	58,500	708.00	41,418,000
飯田グループホールディングス	20,200	2,289.00	46,237,800
ムゲンエステート	800	767.00	613,600
帝国繊維	2,700	1,567.00	4,230,900
ブックオフコーポレーション	1,400	813.00	1,138,200
日本コークス工業	20,700	108.00	2,235,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,000	910.00	910,000
ミタチ産業	600	623.00	373,800
B E E N O S	300	1,566.00	469,800
あさひ	1,800	1,335.00	2,403,000
日本調剤	900	4,545.00	4,090,500
コスモス薬品	1,200	22,710.00	27,252,000
シップヘルスケアホールディングス	4,600	3,040.00	13,984,000
トーエル	1,200	993.00	1,191,600
一六堂	500	402.00	201,000
ソフトクリエイイトホールディングス	1,200	1,393.00	1,671,600
オンリー	300	812.00	243,600
セブン&アイ・ホールディングス	101,300	4,564.00	462,333,200
薬王堂	1,200	2,310.00	2,772,000
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	6,500	1,053.00	6,844,500
明治電機工業	800	1,204.00	963,200
ツルハホールディングス	5,600	11,320.00	63,392,000
デリカフーズ	500	1,002.00	501,000
スターティア	500	545.00	272,500

サンマルクホールディングス	1,600	3,590.00	5,744,000
フェリシモ	700	1,034.00	723,800
トリドールホールディングス	3,000	2,566.00	7,698,000
帝人	21,000	2,454.00	51,534,000
東レ	186,000	976.80	181,684,800
クラレ	43,200	1,796.00	77,587,200
旭化成	160,000	1,011.00	161,760,000
サカイオーベックス	600	1,804.00	1,082,400
稲葉製作所	1,400	1,367.00	1,913,800
宮地エンジニアリンググループ	7,000	202.00	1,414,000
トーカロ	1,700	2,528.00	4,297,600
アルファ	900	1,122.00	1,009,800
SUMCO	26,800	1,458.00	39,074,400
川田テクノロジーズ	500	7,990.00	3,995,000
RS Technologies	100	3,980.00	398,000
ファーストブラザーズ	200	1,847.00	369,400
シーアールイー	300	1,507.00	452,100
住江織物	6,000	258.00	1,548,000
日本フェルト	1,500	514.00	771,000
イチカワ	2,000	298.00	596,000
エコナックホールディングス	9,000	58.00	522,000
日東製網	300	2,188.00	656,400
芦森工業	6,000	165.00	990,000
アツギ	21,000	128.00	2,688,000
コメダホールディングス	3,300	1,883.00	6,213,900
サツドラホールディングス	300	2,009.00	602,700
ダイユー・リックホールディングス	800	751.00	600,800
パロックジャパンリミテッド	1,400	1,354.00	1,895,600
クスリのアオキホールディングス	2,200	5,430.00	11,946,000
ダイニック	5,000	189.00	945,000
共和レザー	1,500	903.00	1,354,500
セーレン	6,400	1,451.00	9,286,400
ソトー	1,000	1,161.00	1,161,000
東海染工	4,000	146.00	584,000
小松精練	3,600	756.00	2,721,600
ワコールホールディングス	15,000	1,379.00	20,685,000
ホギメディカル	1,600	7,390.00	11,824,000
レナウン	6,900	116.00	800,400
クラウドシア	600	559.00	335,400
T S Iホールディングス	10,600	720.00	7,632,000
T I S	8,000	2,523.00	20,184,000
ネオス	700	443.00	310,100
電算システム	800	1,754.00	1,403,200
グリー	14,700	632.00	9,290,400
コーエーテクモホールディングス	5,700	2,116.00	12,061,200
三菱総合研究所	900	3,305.00	2,974,500
ボルテージ	500	1,079.00	539,500
電算	300	2,351.00	705,300
A G S	600	1,420.00	852,000
ファインデックス	1,800	978.00	1,760,400

ヒト・コミュニケーションズ	500	1,679.00	839,500
ブレインパッド	400	1,248.00	499,200
K L a b	4,600	683.00	3,141,800
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	1,700	1,049.00	1,783,300
イーブクイニシアティブジャパン	400	902.00	360,800
ネクソン	26,500	1,714.00	45,421,000
アイスタイル	3,700	846.00	3,130,200
エムアップ	700	646.00	452,200
エイチーム	1,300	2,385.00	3,100,500
テクノスジャパン	1,900	1,351.00	2,566,900
e n i s h	700	584.00	408,800
コロプラ	6,700	1,021.00	6,840,700
モバイルクリエイト	1,600	383.00	612,800
オルトプラス	1,000	703.00	703,000
ブロードリーフ	6,000	657.00	3,942,000
ハーツユナイテッドグループ	1,300	1,800.00	2,340,000
メディアドゥ	500	1,483.00	741,500
ブイキューブ	1,300	718.00	933,400
サイバーリンクス	400	1,029.00	411,600
ディー・エル・イー	700	750.00	525,000
フィックスターズ	300	4,000.00	1,200,000
VOYAGE GROUP	800	1,125.00	900,000
オブティム	300	5,800.00	1,740,000
特種東海製紙	1,500	4,000.00	6,000,000
ベリサーブ	300	3,185.00	955,500
ティーガイア	2,400	1,923.00	4,615,200
日本アジアグループ	2,700	453.00	1,223,100
豆蔵ホールディングス	1,800	1,032.00	1,857,600
テクマトリックス	800	2,125.00	1,700,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	50,700	257.00	13,029,900
GMOペイメントゲートウェイ	2,000	5,580.00	11,160,000
ザッパラス	1,400	428.00	599,200
インターネットイニシアティブ	3,600	1,829.00	6,584,400
さくらインターネット	1,800	1,049.00	1,888,200
GMOクラウド	500	1,331.00	665,500
S R Aホールディングス	1,300	2,628.00	3,416,400
MINORIソリューションズ	500	1,115.00	557,500
システムインテグレータ	300	646.00	193,800
朝日ネット	2,200	503.00	1,106,600
アドソル日進	500	1,181.00	590,500
フリービット	1,300	880.00	1,144,000
コムチュア	400	3,520.00	1,408,000
サイバーコム	300	1,042.00	312,600
王子ホールディングス	100,000	498.00	49,800,000
日本製紙	11,500	2,112.00	24,288,000
三菱製紙	3,700	792.00	2,930,400
北越紀州製紙	14,300	696.00	9,952,800
中越パルプ工業	10,000	245.00	2,450,000

巴川製紙所	4,000	238.00	952,000
大王製紙	10,200	1,276.00	13,015,200
阿波製紙	500	609.00	304,500
メディカル・データ・ビジョン	400	2,723.00	1,089,200
gumi	2,500	870.00	2,175,000
PCIホールディングス	300	2,843.00	852,900
パイブドHD	400	1,109.00	443,600
アイビーシー	200	1,080.00	216,000
LINE	4,000	4,150.00	16,600,000
レンゴー	24,800	653.00	16,194,400
トモク	8,000	334.00	2,672,000
ザ・パック	1,800	2,735.00	4,923,000
AOI TYO HOLDINGS	1,964	872.00	1,712,608
昭和電工	17,100	1,725.00	29,497,500
住友化学	189,000	564.00	106,596,000
住友精化	1,100	4,580.00	5,038,000
日産化学工業	14,100	4,005.00	56,470,500
ラサ工業	10,000	140.00	1,400,000
クレハ	1,900	4,500.00	8,550,000
多木化学	2,000	811.00	1,622,000
テイカ	4,000	670.00	2,680,000
石原産業	4,600	953.00	4,383,800
片倉コープアグリ	3,000	233.00	699,000
日東エフシー	1,500	945.00	1,417,500
日本曹達	15,000	553.00	8,295,000
東ソー	74,000	801.00	59,274,000
トクヤマ	40,000	446.00	17,840,000
セントラル硝子	26,000	546.00	14,196,000
東亜合成	16,100	1,195.00	19,239,500
大阪ソーダ	11,000	485.00	5,335,000
関東電化工業	5,000	1,085.00	5,425,000
デンカ	53,000	523.00	27,719,000
イビデン	17,200	1,576.00	27,107,200
信越化学工業	46,100	9,437.00	435,045,700
日本カーバイド工業	9,000	154.00	1,386,000
堺化学工業	10,000	404.00	4,040,000
エア・ウォーター	21,200	2,160.00	45,792,000
大陽日酸	19,800	1,388.00	27,482,400
日本化学工業	10,000	242.00	2,420,000
日本パーカライジング	13,100	1,390.00	18,209,000
高圧ガス工業	3,800	774.00	2,941,200
チタン工業	3,000	196.00	588,000
四国化成工業	4,000	1,082.00	4,328,000
戸田工業	5,000	285.00	1,425,000
ステラ ケミファ	1,200	3,260.00	3,912,000
保土谷化学工業	900	2,765.00	2,488,500
日本触媒	4,000	7,540.00	30,160,000
大日精化工業	11,000	681.00	7,491,000
カネカ	35,000	968.00	33,880,000
協和発酵キリン	30,700	1,672.00	51,330,400

三菱瓦斯化学	23,900	2,013.00	48,110,700
三井化学	117,000	543.00	63,531,000
J S R	25,800	1,865.00	48,117,000
東京応化工業	4,800	3,940.00	18,912,000
大阪有機化学工業	1,700	1,048.00	1,781,600
三菱ケミカルホールディングス	173,050	781.50	135,238,575
K Hネオケム	3,100	1,241.00	3,847,100
ダイセル	34,600	1,298.00	44,910,800
住友ベークライト	23,000	665.00	15,295,000
積水化学工業	58,300	1,905.00	111,061,500
日本ゼオン	22,000	1,159.00	25,498,000
アイカ工業	8,200	3,110.00	25,502,000
宇部興産	129,000	252.00	32,508,000
積水樹脂	4,000	1,851.00	7,404,000
タキロン	5,000	528.00	2,640,000
旭有機材	8,000	226.00	1,808,000
日立化成	14,300	2,967.00	42,428,100
ニチバン	3,000	873.00	2,619,000
リケンテクノス	5,500	550.00	3,025,000
大倉工業	6,000	517.00	3,102,000
積水化成成品工業	3,700	839.00	3,104,300
群栄化学工業	600	3,375.00	2,025,000
タイガースポリマー	1,300	832.00	1,081,600
ミライアル	900	1,038.00	934,200
ダイキアクシス	400	1,137.00	454,800
ダイキョーニシカワ	4,500	1,449.00	6,520,500
日本化薬	17,000	1,458.00	24,786,000
カーリットホールディングス	2,400	565.00	1,356,000
E P Sホールディングス	3,200	1,384.00	4,428,800
ソルクシーズ	700	548.00	383,600
レグス	600	869.00	521,400
プレステージ・インターナショナル	3,600	825.00	2,970,000
フェイス	600	1,274.00	764,400
ハイマックス	300	1,415.00	424,500
アミューズ	1,400	1,853.00	2,594,200
野村総合研究所	18,040	3,660.00	66,026,400
ドリームインキュベータ	800	2,083.00	1,666,400
サイバネットシステム	2,000	694.00	1,388,000
クイック	1,300	1,069.00	1,389,700
T A C	1,400	231.00	323,400
C Eホールディングス	400	1,156.00	462,400
ケネディクス	34,400	442.00	15,204,800
電通	28,500	5,640.00	160,740,000
インテージホールディングス	1,400	2,010.00	2,814,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,200	763.00	915,600
東邦システムサイエンス	800	675.00	540,000
ぴあ	800	2,987.00	2,389,600
イオンファンタジー	800	3,185.00	2,548,000
ソースネクスト	1,400	589.00	824,600
シーティーエス	700	1,391.00	973,700

ネクシィーズグループ	900	1,441.00	1,296,900
メディカルシステムネットワーク	2,700	445.00	1,201,500
日本精化	2,100	930.00	1,953,000
扶桑化学工業	1,800	2,473.00	4,451,400
ADEKA	11,000	1,616.00	17,776,000
日油	21,000	1,167.00	24,507,000
ミヨシ油脂	9,000	148.00	1,332,000
新日本理化	4,100	164.00	672,400
ハリマ化成グループ	2,200	785.00	1,727,000
花王	65,200	5,576.00	363,555,200
第一工業製薬	6,000	386.00	2,316,000
ニイタカ	400	1,454.00	581,600
三洋化成工業	1,600	5,010.00	8,016,000
武田薬品工業	96,300	4,965.00	478,129,500
アステラス製薬	262,300	1,646.50	431,876,950
大日本住友製薬	18,200	2,072.00	37,710,400
塩野義製薬	34,700	5,685.00	197,269,500
田辺三菱製薬	29,900	2,330.00	69,667,000
わかもと製薬	3,000	250.00	750,000
あすか製薬	2,800	1,838.00	5,146,400
日本新薬	5,900	5,990.00	35,341,000
ピオフェルミン製薬	400	3,060.00	1,224,000
中外製薬	25,600	3,475.00	88,960,000
科研製薬	4,800	6,510.00	31,248,000
エーザイ	31,600	6,895.00	217,882,000
理研ビタミン	800	4,720.00	3,776,000
ロート製薬	12,600	1,902.00	23,965,200
小野薬品工業	58,300	2,597.50	151,434,250
久光製薬	7,200	6,040.00	43,488,000
有機合成薬品工業	1,700	257.00	436,900
持田製薬	1,800	8,450.00	15,210,000
参天製薬	47,300	1,481.00	70,051,300
扶桑薬品工業	900	2,826.00	2,543,400
日本ケミファ	400	5,640.00	2,256,000
ツムラ	8,600	3,315.00	28,509,000
日医工	6,000	1,794.00	10,764,000
テルモ	37,600	4,390.00	165,064,000
みらかホールディングス	6,500	5,410.00	35,165,000
キッセイ薬品工業	4,500	2,976.00	13,392,000
生化学工業	4,800	1,760.00	8,448,000
栄研化学	2,200	3,045.00	6,699,000
日水製薬	1,000	1,315.00	1,315,000
鳥居薬品	1,800	2,567.00	4,620,600
JCRファーマ	2,000	3,130.00	6,260,000
東和薬品	1,200	4,730.00	5,676,000
富士製薬工業	800	2,817.00	2,253,600
沢井製薬	4,400	6,430.00	28,292,000
ゼリア新薬工業	5,300	1,829.00	9,693,700
第一三共	75,600	2,486.00	187,941,600
キョーリン製薬ホールディングス	6,300	2,674.00	16,846,200

大幸薬品	1,300	1,864.00	2,423,200	
ダイト	1,400	2,321.00	3,249,400	
大塚ホールディングス	55,200	5,213.00	287,757,600	
大正製薬ホールディングス	5,500	9,940.00	54,670,000	
ペプチドリーム	4,400	6,150.00	27,060,000	
大日本塗料	15,000	237.00	3,555,000	
日本ペイントホールディングス	19,800	3,240.00	64,152,000	
関西ペイント	27,000	2,224.00	60,048,000	
神東塗料	2,000	224.00	448,000	
中国塗料	7,400	857.00	6,341,800	
日本特殊塗料	1,800	1,773.00	3,191,400	
藤倉化成	3,500	675.00	2,362,500	
太陽ホールディングス	2,100	4,685.00	9,838,500	
D I C	10,100	3,585.00	36,208,500	
サカタインクス	5,200	1,468.00	7,633,600	
東洋インキS Cホールディングス	25,000	550.00	13,750,000	
T & K T O K A	1,900	1,064.00	2,021,600	
アルプス技研	1,000	2,557.00	2,557,000	
サニックス	4,100	198.00	811,800	
ダイオーズ	500	1,065.00	532,500	
日本空調サービス	2,500	622.00	1,555,000	
オリエンタルランド	27,700	6,759.00	187,224,300	
フォーカスシステムズ	900	519.00	467,100	
ダスキン	6,600	2,417.00	15,952,200	
パーク24	12,300	3,230.00	39,729,000	
明光ネットワークジャパン	3,200	1,158.00	3,705,600	
ファルコホールディングス	1,200	1,518.00	1,821,600	
クレスコ	500	2,398.00	1,199,000	
フジ・メディア・ホールディングス	25,200	1,703.00	42,915,600	
秀英予備校	500	436.00	218,000	
田谷	400	644.00	257,600	
ラウンドワン	8,000	812.00	6,496,000	
リゾートトラスト	9,900	2,316.00	22,928,400	
オービック	8,300	5,330.00	44,239,000	
ジャストシステム	3,900	1,192.00	4,648,800	
T D Cソフトウェアエンジニアリング	1,100	1,178.00	1,295,800	
ヤフー	173,400	476.00	82,538,400	
ビー・エム・エル	3,400	2,819.00	9,584,600	
ワタベウェディング	400	430.00	172,000	
トレンドマイクロ	12,800	4,300.00	55,040,000	
りらいあコミュニケーションズ	4,200	1,190.00	4,998,000	
インフォメーション・ディベロプメント	650	1,182.00	768,300	
リソー教育	4,400	626.00	2,754,400	
日本オラクル	3,900	6,080.00	23,712,000	
早稲田アカデミー	300	1,034.00	310,200	
アルファシステムズ	800	1,996.00	1,596,800	
フューチャー	3,300	768.00	2,534,400	
C A C Holdings	1,800	922.00	1,659,600	
ソフトバンク・テクノロジー	600	3,670.00	2,202,000	

トーセ	700	819.00	573,300
ユー・エス・エス	31,000	1,925.00	59,675,000
オービックビジネスコンサルタント	1,200	5,120.00	6,144,000
伊藤忠テクノソリューションズ	5,500	3,090.00	16,995,000
アイティフォー	3,100	642.00	1,990,200
東京個別指導学院	800	942.00	753,600
東計電算	400	2,111.00	844,400
サイバーエージェント	13,500	3,010.00	40,635,000
楽天	130,800	1,221.50	159,772,200
エクスネット	200	1,806.00	361,200
クリーク・アンド・リバー社	900	909.00	818,100
テー・オー・ダブリュー	2,100	660.00	1,386,000
大塚商会	6,500	5,490.00	35,685,000
総合メディカル	1,200	4,215.00	5,058,000
サイボウズ	3,200	458.00	1,465,600
ソフトブレイン	3,300	432.00	1,425,600
セントラルスポーツ	900	2,863.00	2,576,700
パラカ	700	2,073.00	1,451,100
電通国際情報サービス	1,500	1,832.00	2,748,000
デジタルガレージ	3,800	2,122.00	8,063,600
イーエムシステムズ	800	1,670.00	1,336,000
ウェザーニューズ	800	3,665.00	2,932,000
C I J	2,200	527.00	1,159,400
東洋ビジネスエンジニアリング	200	1,530.00	306,000
日本エンタープライズ	2,500	285.00	712,500
WOWOW	1,200	3,425.00	4,110,000
スカラ	1,500	814.00	1,221,000
フルキャストホールディングス	2,600	982.00	2,553,200
富士フイルムホールディングス	50,900	4,507.00	229,406,300
コニカミノルタ	57,400	1,182.00	67,846,800
資生堂	48,700	3,092.00	150,580,400
ライオン	32,000	1,968.00	62,976,000
高砂香料工業	1,700	3,110.00	5,287,000
マンダム	2,600	5,130.00	13,338,000
ミルボン	1,400	4,490.00	6,286,000
ファンケル	5,500	1,718.00	9,449,000
コーセー	4,200	10,250.00	43,050,000
コタ	1,000	1,298.00	1,298,000
シーズ・ホールディングス	3,300	3,420.00	11,286,000
シーボン	300	2,498.00	749,400
ポーラ・オルビスホールディングス	2,600	10,650.00	27,690,000
ノエビアホールディングス	1,600	3,850.00	6,160,000
アジュバンコスメジャパン	500	925.00	462,500
エステー	1,800	1,611.00	2,899,800
アグロ カネショウ	1,000	1,206.00	1,206,000
コニシ	4,000	1,312.00	5,248,000
長谷川香料	3,300	2,002.00	6,606,600
星光PMC	1,400	1,196.00	1,674,400
小林製薬	7,100	5,180.00	36,778,000
荒川化学工業	2,200	1,892.00	4,162,400

メック	2,000	982.00	1,964,000
日本高純度化学	700	2,468.00	1,727,600
タカラバイオ	5,500	1,601.00	8,805,500
JCU	800	5,780.00	4,624,000
新田ゼラチン	1,500	759.00	1,138,500
OATアグリオ	300	1,355.00	406,500
デクセリアルズ	6,700	1,150.00	7,705,000
アース製薬	1,800	4,885.00	8,793,000
イハラケミカル工業	3,600	1,133.00	4,078,800
北興化学工業	3,000	455.00	1,365,000
大成ラミック	700	3,200.00	2,240,000
クミアイ化学工業	5,300	714.00	3,784,200
日本農薬	5,900	651.00	3,840,900
昭和シェル石油	22,900	1,115.00	25,533,500
富士興産	900	459.00	413,100
ニチレキ	3,100	962.00	2,982,200
東燃ゼネラル石油	42,000	1,271.00	53,382,000
ユシロ化学工業	1,400	1,485.00	2,079,000
ビーピー・カストロール	1,000	1,408.00	1,408,000
富士石油	6,000	390.00	2,340,000
MORESCO	900	1,654.00	1,488,600
出光興産	12,200	3,210.00	39,162,000
JXホールディングス	284,900	510.30	145,384,470
コスモエネルギーホールディングス	7,700	1,742.00	13,413,400
横浜ゴム	15,500	2,156.00	33,418,000
東洋ゴム工業	13,600	1,484.00	20,182,400
ブリヂストン	86,700	4,265.00	369,775,500
住友ゴム工業	24,000	1,901.00	45,624,000
藤倉ゴム工業	2,100	678.00	1,423,800
オカモト	8,000	1,099.00	8,792,000
アキレス	2,100	1,674.00	3,515,400
フコク	1,100	954.00	1,049,400
ニッタ	2,300	3,220.00	7,406,000
クリエートメディック	800	961.00	768,800
住友理工	4,800	1,168.00	5,606,400
三ツ星ベルト	6,000	1,047.00	6,282,000
バンドー化学	4,700	1,051.00	4,939,700
旭硝子	126,000	814.00	102,564,000
日本板硝子	11,700	870.00	10,179,000
石塚硝子	4,000	199.00	796,000
有沢製作所	4,300	672.00	2,889,600
日本山村硝子	10,000	207.00	2,070,000
日本電気硝子	53,000	641.00	33,973,000
オハラ	1,000	865.00	865,000
住友大阪セメント	48,000	452.00	21,696,000
太平洋セメント	155,000	384.00	59,520,000
リソルホールディングス	3,000	345.00	1,035,000
日本ヒューム	2,500	710.00	1,775,000
日本コンクリート工業	5,700	355.00	2,023,500
三谷セキサン	1,300	3,075.00	3,997,500

アジアパイルホールディングス	3,200	545.00	1,744,000	
東海カーボン	24,000	386.00	9,264,000	
日本カーボン	13,000	232.00	3,016,000	
東洋炭素	1,400	1,856.00	2,598,400	
ノリタケカンパニーリミテド	1,400	2,893.00	4,050,200	
TOTO	18,900	4,740.00	89,586,000	
日本碍子	32,400	2,336.00	75,686,400	
日本特殊陶業	22,100	2,528.00	55,868,800	
ダントーホールディングス	2,000	193.00	386,000	
MARUWA	900	3,745.00	3,370,500	
品川リフクトリーズ	6,000	254.00	1,524,000	
黒崎播磨	6,000	323.00	1,938,000	
ヨータイ	1,000	358.00	358,000	
イソライト工業	1,300	293.00	380,900	
東京窯業	3,100	194.00	601,400	
ニッカトー	800	411.00	328,800	
フジインコーポレーテッド	2,200	2,207.00	4,855,400	
エーアンドエーマテリアル	5,000	130.00	650,000	
ニチアス	13,000	1,140.00	14,820,000	
新日鐵住金	115,700	2,629.00	304,175,300	
神戸製鋼所	44,400	1,114.00	49,461,600	
中山製鋼所	2,900	749.00	2,172,100	
合同製鐵	1,400	2,113.00	2,958,200	
ジェイ エフ イー ホールディングス	70,200	1,787.00	125,447,400	
日新製鋼	11,700	1,496.00	17,503,200	
東京製鐵	13,000	869.00	11,297,000	
共英製鋼	2,700	2,195.00	5,926,500	
大和工業	5,200	3,195.00	16,614,000	
東京鐵鋼	5,000	482.00	2,410,000	
大阪製鐵	1,600	2,221.00	3,553,600	
淀川製鋼所	3,500	3,115.00	10,902,500	
東洋鋼鈹	6,100	378.00	2,305,800	
丸一鋼管	8,600	3,845.00	33,067,000	
モリ工業	800	1,991.00	1,592,800	
大同特殊鋼	43,000	492.00	21,156,000	
日本高周波鋼業	9,000	89.00	801,000	
日本冶金工業	21,200	192.00	4,070,400	
山陽特殊製鋼	15,000	558.00	8,370,000	
愛知製鋼	1,500	5,000.00	7,500,000	
日立金属	26,100	1,609.00	41,994,900	
日本金属	600	1,277.00	766,200	
大平洋金属	16,000	368.00	5,888,000	
新日本電工	14,500	250.00	3,625,000	
栗本鐵工所	1,200	2,316.00	2,779,200	
虹 技	4,000	263.00	1,052,000	
日本鑄鉄管	3,000	194.00	582,000	
日本製鋼所	8,500	2,099.00	17,841,500	
三菱製鋼	18,000	234.00	4,212,000	
日亜鋼業	3,500	279.00	976,500	

日本精線	2,000	598.00	1,196,000
大紀アルミニウム工業所	4,000	513.00	2,052,000
日本軽金属ホールディングス	58,100	261.00	15,164,100
三井金属鉱業	70,000	299.00	20,930,000
東邦亜鉛	14,000	458.00	6,412,000
三菱マテリアル	16,000	3,670.00	58,720,000
住友金属鉱山	66,000	1,554.50	102,597,000
DOWAホールディングス	28,000	904.00	25,312,000
古河機械金属	40,000	219.00	8,760,000
エス・サイエンス	11,700	38.00	444,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,800	1,627.00	4,555,600
東邦チタニウム	4,300	791.00	3,401,300
UACJ	33,000	325.00	10,725,000
古河電気工業	8,600	3,475.00	29,885,000
住友電気工業	96,700	1,650.00	159,555,000
フジクラ	33,800	663.00	22,409,400
昭和電線ホールディングス	31,000	88.00	2,728,000
東京特殊電線	400	1,330.00	532,000
タツタ電線	4,800	466.00	2,236,800
沖電線	3,000	239.00	717,000
カナレ電気	400	2,177.00	870,800
平河ヒューテック	1,200	1,275.00	1,530,000
リョービ	16,000	480.00	7,680,000
アーレスティ	3,000	1,316.00	3,948,000
アサヒホールディングス	3,900	2,119.00	8,264,100
東洋製罐グループホールディングス	18,200	2,204.00	40,112,800
ホッカンホールディングス	7,000	467.00	3,269,000
コロナ	1,300	1,174.00	1,526,200
横河ブリッジホールディングス	4,500	1,355.00	6,097,500
OSJBホールディングス	8,400	250.00	2,100,000
駒井ハルテック	500	2,186.00	1,093,000
高田機工	2,000	233.00	466,000
三和ホールディングス	25,500	1,139.00	29,044,500
文化シャッター	7,100	924.00	6,560,400
三協立山	3,400	1,688.00	5,739,200
アルインコ	1,800	1,062.00	1,911,600
東洋シャッター	600	630.00	378,000
LIXILグループ	35,700	2,699.00	96,354,300
日本フィルコン	1,900	586.00	1,113,400
ノーリツ	5,000	2,014.00	10,070,000
長府製作所	2,700	2,622.00	7,079,400
リンナイ	4,400	9,690.00	42,636,000
ユニプレス	4,700	2,349.00	11,040,300
ダイニチ工業	1,300	734.00	954,200
日東精工	3,700	438.00	1,620,600
三洋工業	3,000	200.00	600,000
岡部	5,300	956.00	5,066,800
ジーテクト	2,700	2,226.00	6,010,200
中国工業	400	684.00	273,600
東プレ	4,900	2,898.00	14,200,200

高周波熱錬	4,800	912.00	4,377,600
東京製綱	1,700	1,955.00	3,323,500
サンコール	1,400	562.00	786,800
モリテックスチール	1,300	288.00	374,400
パイオラックス	1,300	7,610.00	9,893,000
日本発条	24,200	1,127.00	27,273,400
中央発條	3,000	325.00	975,000
アドバネクス	400	1,748.00	699,200
三浦工業	10,500	1,824.00	19,152,000
タクマ	8,200	1,019.00	8,355,800
テクノプロ・ホールディングス	4,100	3,800.00	15,580,000
アトラ	300	755.00	226,500
インターワークス	500	1,088.00	544,000
K e e P e r 技研	300	1,866.00	559,800
ファーストロジック	100	2,178.00	217,800
デザインワン・ジャパン	200	2,270.00	454,000
イー・ガーディアン	800	1,395.00	1,116,000
リブセンス	1,700	465.00	790,500
ジャパンマテリアル	1,900	1,783.00	3,387,700
ベクトル	2,100	1,225.00	2,572,500
ウチヤマホールディングス	1,200	435.00	522,000
サクセスホールディングス	200	1,289.00	257,800
キャリアリンク	600	800.00	480,000
I B J	2,000	677.00	1,354,000
アサンテ	900	1,814.00	1,632,600
N・フィールド	1,200	1,511.00	1,813,200
M&Aキャピタルパートナーズ	300	3,255.00	976,500
ライドオン・エクスプレス	600	885.00	531,000
E R Iホールディングス	700	784.00	548,800
アピスト	400	3,965.00	1,586,000
ウィルグループ	1,000	745.00	745,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	400	1,795.00	718,000
日本ビューホテル	400	1,520.00	608,000
リクルートホールディングス	55,900	4,740.00	264,966,000
エラン	300	1,317.00	395,100
ツガミ	7,000	686.00	4,802,000
オークマ	17,000	1,095.00	18,615,000
東芝機械	15,000	485.00	7,275,000
アマダホールディングス	34,500	1,328.00	45,816,000
アイダエンジニアリング	7,300	1,121.00	8,183,300
滝澤鉄工所	8,000	162.00	1,296,000
富士機械製造	7,800	1,361.00	10,615,800
牧野フライス製作所	13,000	921.00	11,973,000
オーエスジー	11,700	2,365.00	27,670,500
ダイジェット工業	3,000	180.00	540,000
旭ダイヤモンド工業	7,300	870.00	6,351,000
D M G 森精機	15,200	1,435.00	21,812,000
ソディック	6,500	981.00	6,376,500
ディスコ	3,000	14,090.00	42,270,000
日東工器	1,500	2,574.00	3,861,000

パンチ工業	900	914.00	822,600	
土木管理総合試験所	300	744.00	223,200	
日本郵政	66,800	1,507.00	100,667,600	
ベルシステム24ホールディングス	3,900	1,033.00	4,028,700	
ソラスト	1,200	1,340.00	1,608,000	
豊田自動織機	22,300	5,610.00	125,103,000	
豊和工業	1,400	627.00	877,800	
OKK	9,000	122.00	1,098,000	
石川製作所	600	686.00	411,600	
東洋機械金属	1,700	469.00	797,300	
津田駒工業	6,000	169.00	1,014,000	
エンシュウ	6,000	101.00	606,000	
島精機製作所	3,300	4,030.00	13,299,000	
NCホールディングス	800	933.00	746,400	
フリー	500	3,460.00	1,730,000	
ヤマシンフィルタ	500	1,291.00	645,500	
日阪製作所	3,500	927.00	3,244,500	
やまびこ	4,700	1,693.00	7,957,100	
ペガサスミシン製造	2,500	733.00	1,832,500	
ナブテスコ	13,300	2,812.00	37,399,600	
三井海洋開発	2,600	1,977.00	5,140,200	
レオン自動機	2,200	910.00	2,002,000	
SMC	7,700	29,200.00	224,840,000	
新川	2,100	850.00	1,785,000	
ホソカワミクロン	4,000	785.00	3,140,000	
ユニオンツール	1,100	3,135.00	3,448,500	
オイレス工業	3,300	2,152.00	7,101,600	
日精エー・エス・ビー機械	800	2,329.00	1,863,200	
サトーホールディングス	3,200	2,413.00	7,721,600	
日本エアーテック	800	650.00	520,000	
日精樹脂工業	2,000	1,050.00	2,100,000	
オカダアイヨン	500	1,178.00	589,000	
ワイエイシイ	1,000	1,307.00	1,307,000	
小松製作所	118,400	2,672.50	316,424,000	
住友重機械工業	75,000	753.00	56,475,000	
日立建機	11,500	2,552.00	29,348,000	
日工	800	2,227.00	1,781,600	
巴工業	1,000	1,794.00	1,794,000	
井関農機	26,000	230.00	5,980,000	
TOWA	2,100	1,624.00	3,410,400	
丸山製作所	5,000	194.00	970,000	
北川鉄工所	1,200	2,430.00	2,916,000	
シンニッタン	2,100	688.00	1,444,800	
ローツェ	900	1,858.00	1,672,200	
タカキタ	900	569.00	512,100	
クボタ	123,200	1,701.00	209,563,200	
荏原実業	700	1,345.00	941,500	
東洋エンジニアリング	16,000	309.00	4,944,000	
三菱化工機	8,000	222.00	1,776,000	
月島機械	4,900	1,251.00	6,129,900	

帝国電機製作所	1,900	1,001.00	1,901,900
東京機械製作所	10,000	77.00	770,000
新東工業	5,800	1,066.00	6,182,800
澁谷工業	2,100	2,458.00	5,161,800
アイチコーポレーション	3,600	852.00	3,067,200
小森コーポレーション	6,200	1,480.00	9,176,000
鶴見製作所	1,900	1,772.00	3,366,800
住友精密工業	4,000	365.00	1,460,000
酒井重工業	5,000	359.00	1,795,000
荏原製作所	11,300	3,280.00	37,064,000
石井鐵工所	400	1,891.00	756,400
西島製作所	2,500	1,174.00	2,935,000
北越工業	2,800	806.00	2,256,800
千代田化工建設	20,000	826.00	16,520,000
ダイキン工業	33,500	11,110.00	372,185,000
オルガノ	5,000	487.00	2,435,000
トーヨーカネツ	12,000	326.00	3,912,000
栗田工業	14,500	2,640.00	38,280,000
椿本チエイン	15,000	951.00	14,265,000
大同工業	5,000	270.00	1,350,000
日機装	8,500	1,104.00	9,384,000
木村化工機	2,200	343.00	754,600
新興プランテック	5,600	853.00	4,776,800
アネスト岩田	4,400	1,175.00	5,170,000
ダイフク	12,200	2,483.00	30,292,600
サムコ	600	1,091.00	654,600
加藤製作所	1,300	3,040.00	3,952,000
油研工業	5,000	225.00	1,125,000
タダノ	12,800	1,454.00	18,611,200
フジテック	7,100	1,375.00	9,762,500
C K D	7,300	1,362.00	9,942,600
キトー	3,100	1,298.00	4,023,800
平和	7,600	2,754.00	20,930,400
理想科学工業	2,400	2,001.00	4,802,400
SANKYO	6,800	3,870.00	26,316,000
日本金銭機械	2,300	1,568.00	3,606,400
マースエンジニアリング	1,400	2,251.00	3,151,400
福島工業	1,500	3,410.00	5,115,000
オーイズミ	1,000	731.00	731,000
ダイコク電機	1,000	1,845.00	1,845,000
竹内製作所	4,500	2,578.00	11,601,000
アマノ	7,600	2,158.00	16,400,800
JUKI	3,900	1,061.00	4,137,900
サンデンホールディングス	15,000	368.00	5,520,000
蛇の目ミシン工業	2,400	866.00	2,078,400
ブラザー工業	31,700	2,108.00	66,823,600
マックス	4,000	1,451.00	5,804,000
モリタホールディングス	4,300	1,648.00	7,086,400
グローリー	7,800	3,765.00	29,367,000
新晃工業	1,700	1,456.00	2,475,200

大和冷機工業	3,900	935.00	3,646,500
セガサミーホールディングス	24,300	1,838.00	44,663,400
日本ピストンリング	1,000	2,150.00	2,150,000
リケン	1,100	4,445.00	4,889,500
T P R	2,700	3,345.00	9,031,500
ツバキ・ナカシマ	2,700	1,726.00	4,660,200
ホシザキ	5,400	9,450.00	51,030,000
大豊工業	2,000	1,689.00	3,378,000
日本精工	50,400	1,368.00	68,947,200
N T N	57,000	475.00	27,075,000
ジェイテクト	26,100	1,922.00	50,164,200
不二越	25,000	531.00	13,275,000
ミネベア	39,500	1,102.00	43,529,000
日本トムソン	7,800	509.00	3,970,200
T H K	17,300	2,604.00	45,049,200
ユーシン精機	1,100	2,958.00	3,253,800
前澤給装工業	900	1,539.00	1,385,100
イーグル工業	2,700	1,605.00	4,333,500
前澤工業	1,800	375.00	675,000
日本ピラー工業	2,500	1,259.00	3,147,500
キッツ	11,800	681.00	8,035,800
日立製作所	589,000	656.40	386,619,600
東芝	548,000	287.20	157,385,600
三菱電機	261,500	1,647.50	430,821,250
富士電機	74,000	609.00	45,066,000
東洋電機製造	1,000	1,647.00	1,647,000
安川電機	28,400	1,848.00	52,483,200
シンフォニア テクノロジー	16,000	292.00	4,672,000
明電舎	23,000	405.00	9,315,000
オリジン電気	4,000	327.00	1,308,000
山洋電気	6,000	861.00	5,166,000
デンヨー	2,300	1,632.00	3,753,600
日立工機	6,600	1,498.00	9,886,800
三櫻工業	3,100	849.00	2,631,900
マキタ	16,000	7,960.00	127,360,000
東芝テック	15,000	587.00	8,805,000
芝浦メカトロニクス	4,000	271.00	1,084,000
マブチモーター	6,900	5,970.00	41,193,000
日本電産	31,800	10,420.00	331,356,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	300	3,020.00	906,000
東光高岳	1,200	2,141.00	2,569,200
ダブル・スコープ	2,400	1,751.00	4,202,400
宮越ホールディングス	800	509.00	407,200
ダイヘン	13,000	740.00	9,620,000
田淵電機	3,700	409.00	1,513,300
ヤーマン	300	5,670.00	1,701,000
J V C ケンウッド	18,000	333.00	5,994,000
ミマキエンジニアリング	2,200	707.00	1,555,400
第一精工	1,100	1,388.00	1,526,800
日新電機	4,900	1,302.00	6,379,800

大崎電気工業	5,000	1,188.00	5,940,000
オムロン	26,100	4,525.00	118,102,500
日東工業	3,600	1,626.00	5,853,600
I D E C	3,200	1,114.00	3,564,800
不二電機工業	300	1,428.00	428,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	47,000	487.00	22,889,000
サクサホールディングス	6,000	228.00	1,368,000
メルコホールディングス	1,400	3,300.00	4,620,000
テクノメディカ	600	2,020.00	1,212,000
日本電気	337,000	318.00	107,166,000
富士通	236,000	684.40	161,518,400
沖電気工業	10,600	1,722.00	18,253,200
岩崎通信機	11,000	90.00	990,000
電気興業	7,000	589.00	4,123,000
サンケン電気	14,000	508.00	7,112,000
ナカヨ	3,000	400.00	1,200,000
アイホン	1,400	1,999.00	2,798,600
ルネサスエレクトロニクス	12,700	986.00	12,522,200
セイコーエプソン	36,500	2,552.00	93,148,000
ワコム	19,000	328.00	6,232,000
アルバック	4,500	3,680.00	16,560,000
アクセル	1,000	1,023.00	1,023,000
E I Z O	2,400	3,595.00	8,628,000
ジャパンディスプレイ	45,800	336.00	15,388,800
日本信号	6,800	1,003.00	6,820,400
京三製作所	6,000	405.00	2,430,000
能美防災	2,800	1,791.00	5,014,800
ホーチキ	1,800	1,455.00	2,619,000
エレコム	2,100	2,012.00	4,225,200
日本無線	1,500	1,415.00	2,122,500
パナソニック	280,100	1,212.50	339,621,250
アンリツ	17,900	689.00	12,333,100
富士通ゼネラル	8,000	2,576.00	20,608,000
日立国際電気	6,400	2,518.00	16,115,200
ソニー	173,100	3,316.00	573,999,600
T D K	13,800	8,050.00	111,090,000
帝国通信工業	5,000	182.00	910,000
ミツミ電機	8,700	649.00	5,646,300
タムラ製作所	9,000	455.00	4,095,000
アルプス電気	22,600	2,768.00	62,556,800
池上通信機	8,000	175.00	1,400,000
パイオニア	36,800	265.00	9,752,000
日本電波工業	2,400	917.00	2,200,800
鈴木	900	522.00	469,800
日本トリム	600	4,850.00	2,910,000
ローランド ディー・ジー・	1,300	3,025.00	3,932,500
日本コロムビア	700	645.00	451,500
フォスター電機	2,900	2,077.00	6,023,300
クラリオン	13,000	445.00	5,785,000
S M K	6,000	431.00	2,586,000

ヨコオ	1,700	995.00	1,691,500
ティアック	18,000	55.00	990,000
ホシデン	7,400	972.00	7,192,800
ヒロセ電機	4,000	14,710.00	58,840,000
日本航空電子工業	8,000	1,722.00	13,776,000
TOA	2,900	1,055.00	3,059,500
日立マクセル	3,700	2,046.00	7,570,200
古野電気	3,200	880.00	2,816,000
ユニデンホールディングス	7,000	176.00	1,232,000
アルパイン	5,800	1,616.00	9,372,800
スミダコーポレーション	2,000	1,114.00	2,228,000
アイコム	1,400	2,326.00	3,256,400
リオン	900	1,632.00	1,468,800
本多通信工業	800	1,318.00	1,054,400
船井電機	2,800	954.00	2,671,200
横河電機	26,600	1,751.00	46,576,600
新電元工業	9,000	440.00	3,960,000
アズビル	7,400	3,360.00	24,864,000
東亜ディーケーケー	1,200	549.00	658,800
日本光電工業	10,200	2,624.00	26,764,800
チノー	900	1,129.00	1,016,100
共和電業	2,800	405.00	1,134,000
日本電子材料	1,000	609.00	609,000
堀場製作所	4,900	5,590.00	27,391,000
アドバンテスト	16,700	1,967.00	32,848,900
小野測器	1,200	875.00	1,050,000
エスベック	2,200	1,355.00	2,981,000
パナソニック デバイスSUNX	2,100	815.00	1,711,500
キーエンス	5,600	83,400.00	467,040,000
日置電機	1,300	2,147.00	2,791,100
シスメックス	19,100	6,950.00	132,745,000
日本マイクロニクス	4,600	1,124.00	5,170,400
メガチップス	2,300	2,416.00	5,556,800
OBARA GROUP	1,400	5,210.00	7,294,000
イマジカ・ロボットホールディングス	2,000	719.00	1,438,000
澤藤電機	1,000	220.00	220,000
デンソー	60,400	5,118.00	309,127,200
コーセル	3,400	1,329.00	4,518,600
イリソ電子工業	800	6,860.00	5,488,000
新日本無線	2,100	421.00	884,100
オプテックスグループ	1,900	2,615.00	4,968,500
千代田インテグレ	1,300	2,413.00	3,136,900
アイ・オー・データ機器	800	1,229.00	983,200
レーザーテック	2,900	2,254.00	6,536,600
スタンレー電気	17,500	3,195.00	55,912,500
岩崎電気	9,000	197.00	1,773,000
ウシオ電機	14,900	1,502.00	22,379,800
岡谷電機産業	1,300	411.00	534,300
ヘリオス テクノホールディング	2,300	547.00	1,258,100

日本セラミック	2,000	2,050.00	4,100,000
遠藤照明	1,200	904.00	1,084,800
日本デジタル研究所	2,300	2,404.00	5,529,200
古河電池	2,000	755.00	1,510,000
双信電機	1,200	289.00	346,800
山一電機	2,300	1,139.00	2,619,700
図研	1,600	1,280.00	2,048,000
日本電子	9,000	522.00	4,698,000
カシオ計算機	19,700	1,685.00	33,194,500
ファナック	24,900	20,250.00	504,225,000
日本シイエムケイ	5,300	700.00	3,710,000
エンプラス	1,100	3,525.00	3,877,500
大真空	900	1,469.00	1,322,100
ローム	11,900	6,980.00	83,062,000
浜松ホトニクス	19,100	3,200.00	61,120,000
三井ハイテック	3,200	883.00	2,825,600
新光電気工業	9,300	812.00	7,551,600
京セラ	40,200	5,904.00	237,340,800
協栄産業	3,000	158.00	474,000
太陽誘電	11,900	1,359.00	16,172,100
村田製作所	25,700	15,625.00	401,562,500
ユーシン	3,200	752.00	2,406,400
双葉電子工業	4,000	2,000.00	8,000,000
日東電工	18,500	8,987.00	166,259,500
北陸電気工業	10,000	141.00	1,410,000
東海理化電機製作所	6,500	2,383.00	15,489,500
ニチコン	7,700	1,077.00	8,292,900
日本ケミコン	21,000	262.00	5,502,000
K O A	3,400	1,159.00	3,940,600
三井造船	89,000	183.00	16,287,000
日立造船	19,400	621.00	12,047,400
三菱重工業	411,000	527.70	216,884,700
川崎重工業	191,000	364.00	69,524,000
I H I	188,000	306.00	57,528,000
名村造船所	7,400	788.00	5,831,200
サノヤスホールディングス	3,000	277.00	831,000
日本車輛製造	9,000	290.00	2,610,000
ニチユ三菱フォークリフト	2,800	815.00	2,282,000
近畿車輛	400	2,658.00	1,063,200
F P G	8,600	1,050.00	9,030,000
島根銀行	500	1,395.00	697,500
じもとホールディングス	17,400	198.00	3,445,200
全国保証	6,800	3,990.00	27,132,000
めぶきフィナンシャルグループ	116,700	455.00	53,098,500
東京T Yフィナンシャルグループ	3,500	4,240.00	14,840,000
九州フィナンシャルグループ	39,700	809.00	32,117,300
かんぽ生命保険	9,100	2,519.00	22,922,900
ゆうちょ銀行	68,500	1,433.00	98,160,500
富山第一銀行	6,100	551.00	3,361,100

コンコルディア・フィナンシャルグループ	158,400	577.50	91,476,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	16,400	1,226.00	20,106,400	
日産自動車	293,400	1,173.00	344,158,200	
いすゞ自動車	71,000	1,540.00	109,340,000	
トヨタ自動車	298,100	6,930.00	2,065,833,000	
日野自動車	35,000	1,243.00	43,505,000	
三菱自動車工業	89,800	701.00	62,949,800	
エフテック	1,300	1,367.00	1,777,100	
レシップホールディングス	800	891.00	712,800	
GMB	400	1,161.00	464,400	
ファルテック	400	1,380.00	552,000	
武蔵精密工業	2,900	3,335.00	9,671,500	
日産車体	10,800	1,169.00	12,625,200	
新明和工業	10,000	1,088.00	10,880,000	
極東開発工業	4,900	1,615.00	7,913,500	
日信工業	5,500	1,887.00	10,378,500	
トビー工業	2,000	3,155.00	6,310,000	
ティラド	10,000	301.00	3,010,000	
曙ブレーキ工業	11,400	314.00	3,579,600	
タチエス	4,200	1,942.00	8,156,400	
NOK	11,900	2,396.00	28,512,400	
フタバ産業	7,500	704.00	5,280,000	
KYB	27,000	566.00	15,282,000	
市光工業	5,000	380.00	1,900,000	
大同メタル工業	3,100	1,185.00	3,673,500	
プレス工業	13,000	529.00	6,877,000	
ミクニ	3,100	404.00	1,252,400	
カルソニックカンセイ	17,000	1,791.00	30,447,000	
太平洋工業	5,000	1,504.00	7,520,000	
ケーヒン	5,600	2,062.00	11,547,200	
河西工業	3,300	1,402.00	4,626,600	
アイシン精機	22,400	5,100.00	114,240,000	
富士機工	2,400	512.00	1,228,800	
マツダ	77,600	1,881.50	146,004,400	
今仙電機製作所	2,200	1,024.00	2,252,800	
本田技研工業	220,600	3,501.00	772,320,600	
スズキ	48,600	4,270.00	207,522,000	
富士重工業	76,100	4,934.00	375,477,400	
安永	900	1,986.00	1,787,400	
ヤマハ発動機	34,600	2,530.00	87,538,000	
ショーワ	6,400	849.00	5,433,600	
小糸製作所	14,700	6,260.00	92,022,000	
TBK	3,100	508.00	1,574,800	
エクセディ	3,300	3,295.00	10,873,500	
ミツバ	4,500	1,981.00	8,914,500	
豊田合成	7,900	2,759.00	21,796,100	
愛三工業	4,300	1,015.00	4,364,500	
盟和産業	400	1,208.00	483,200	

ヨロズ	2,300	1,706.00	3,923,800
エフ・シー・シー	4,000	2,119.00	8,476,000
新家工業	6,000	165.00	990,000
シマノ	9,900	19,040.00	188,496,000
タカタ	4,400	925.00	4,070,000
テイ・エス テック	5,700	3,065.00	17,470,500
ジャムコ	1,400	2,499.00	3,498,600
小野建	2,100	1,388.00	2,914,800
はるやまホールディングス	1,100	871.00	958,100
ノジマ	2,800	1,329.00	3,721,200
佐鳥電機	1,900	732.00	1,390,800
カップ・クリエイト	3,400	1,292.00	4,392,800
エコートレーディング	600	683.00	409,800
伯東	1,700	1,072.00	1,822,400
コンドーテック	1,900	877.00	1,666,300
中山福	1,400	821.00	1,149,400
ライトオン	1,800	1,021.00	1,837,800
ナガイレーベン	3,500	2,561.00	8,963,500
ジーンズメイト	800	189.00	151,200
三菱食品	2,700	3,530.00	9,531,000
良品計画	3,200	22,550.00	72,160,000
三城ホールディングス	3,000	470.00	1,410,000
松田産業	1,800	1,529.00	2,752,200
第一興商	3,900	4,805.00	18,739,500
メディカルホールディングス	24,200	1,862.00	45,060,400
アドヴァン	2,500	1,166.00	2,915,000
S P K	500	2,408.00	1,204,000
萩原電気	800	2,201.00	1,760,800
アルビス	600	3,610.00	2,166,000
アズワン	1,900	5,120.00	9,728,000
スズデン	900	1,033.00	929,700
尾家産業	800	1,127.00	901,600
シモジマ	1,500	1,148.00	1,722,000
ドウシシャ	2,800	2,111.00	5,910,800
小津産業	500	2,164.00	1,082,000
コナカ	3,100	614.00	1,903,400
高速	1,400	1,118.00	1,565,200
ハウス オブ ローゼ	300	1,549.00	464,700
G - 7ホールディングス	700	1,810.00	1,267,000
たけびし	800	1,216.00	972,800
イオン北海道	2,400	596.00	1,430,400
コジマ	3,600	294.00	1,058,400
ヒマラヤ	800	868.00	694,400
コーナン商事	3,400	2,264.00	7,697,600
黒田電気	3,300	2,388.00	7,880,400
ネットワンシステムズ	10,500	767.00	8,053,500
エコス	900	1,332.00	1,198,800
ワタミ	2,900	1,164.00	3,375,600
マルシェ	500	829.00	414,500
リックス	500	1,520.00	760,000

システムソフト	4,300	163.00	700,900
ドンキホーテホールディングス	15,700	4,405.00	69,158,500
丸文	2,100	704.00	1,478,400
西松屋チェーン	4,200	1,407.00	5,909,400
ゼンショーホールディングス	12,500	1,946.00	24,325,000
ハビネット	2,000	1,307.00	2,614,000
幸楽苑ホールディングス	1,500	1,670.00	2,505,000
ハークスレイ	600	1,163.00	697,800
橋本総業ホールディングス	500	1,540.00	770,000
日本ライフライン	2,100	2,348.00	4,930,800
サイゼリヤ	4,000	2,751.00	11,004,000
エクセル	1,000	1,557.00	1,557,000
V Tホールディングス	8,200	586.00	4,805,200
マルカキカイ	800	1,672.00	1,337,600
アルゴグラフィックス	1,100	2,288.00	2,516,800
魚力	800	1,281.00	1,024,800
I D O M	6,500	666.00	4,329,000
日本エム・ディ・エム	1,800	926.00	1,666,800
ポブラ	600	504.00	302,400
フジ・コーポレーション	400	2,115.00	846,000
ユナイテッドアローズ	3,200	3,420.00	10,944,000
進和	1,400	1,800.00	2,520,000
エスケイジャパン	500	328.00	164,000
ダイトロン	1,100	969.00	1,065,900
ハイデイ日高	2,200	2,793.00	6,144,600
シークス	1,700	3,835.00	6,519,500
京都きもの友禅	1,500	969.00	1,453,500
コロワイド	8,000	1,928.00	15,424,000
ピーシーデポコーポレーション	3,200	646.00	2,067,200
田中商事	700	703.00	492,100
オーハシテクニカ	1,400	1,493.00	2,090,200
壱番屋	2,200	3,795.00	8,349,000
白銅	600	1,450.00	870,000
トップカルチャー	900	483.00	434,700
P L A N T	500	1,215.00	607,500
スギホールディングス	5,300	5,680.00	30,104,000
島津製作所	31,600	1,888.00	59,660,800
J M S	5,000	308.00	1,540,000
クボテック	500	651.00	325,500
長野計器	1,900	709.00	1,347,100
ブイ・テクノロジー	500	13,510.00	6,755,000
スター精密	4,300	1,614.00	6,940,200
東京計器	8,000	227.00	1,816,000
愛知時計電機	300	3,895.00	1,168,500
オーバル	2,400	274.00	657,600
東京精密	4,700	3,580.00	16,826,000
マニー	3,300	2,855.00	9,421,500
ニコン	42,700	1,862.00	79,507,400
トプコン	12,300	1,763.00	21,684,900
オリンパス	39,100	4,110.00	160,701,000

理研計器	2,200	1,711.00	3,764,200
S C R E E Nホールディングス	5,000	7,140.00	35,700,000
キヤノン電子	2,200	1,806.00	3,973,200
タムロン	2,200	2,000.00	4,400,000
H O Y A	50,400	4,915.00	247,716,000
ノーリツ鋼機	2,500	919.00	2,297,500
エー・アンド・デイ	2,200	481.00	1,058,200
キヤノン	132,000	3,323.00	438,636,000
リコー	73,700	1,018.00	75,026,600
シチズン時計	26,800	706.00	18,920,800
リズム時計工業	10,000	184.00	1,840,000
大研医器	2,200	818.00	1,799,600
メニコン	1,700	3,395.00	5,771,500
スノーピーク	400	3,100.00	1,240,000
パラマウントベッドホールディングス	2,400	4,720.00	11,328,000
トランザクション	500	1,622.00	811,000
S H O B I	800	423.00	338,400
ニホンフラッシュ	1,100	1,330.00	1,463,000
前田工織	2,500	1,312.00	3,280,000
永大産業	3,000	512.00	1,536,000
アートネイチャー	2,600	739.00	1,921,400
ダンロップスポーツ	1,500	1,095.00	1,642,500
バンダイナムコホールディングス	27,000	3,215.00	86,805,000
アイフィスジャパン	500	423.00	211,500
共立印刷	4,100	323.00	1,324,300
S H O E I	1,100	2,150.00	2,365,000
フランスベッドホールディングス	3,100	952.00	2,951,200
マーベラス	4,100	800.00	3,280,000
パイロットコーポレーション	4,300	5,000.00	21,500,000
萩原工業	700	2,636.00	1,845,200
エイベックス・グループ・ホールディングス	4,500	1,797.00	8,086,500
トッパン・フォームズ	4,400	1,220.00	5,368,000
フジシールインターナショナル	5,500	2,552.00	14,036,000
タカラトミー	9,500	1,255.00	11,922,500
廣濟堂	2,500	399.00	997,500
A s - m e エステール	700	703.00	492,100
アーク	10,300	121.00	1,246,300
レック	800	3,235.00	2,588,000
タカノ	1,100	877.00	964,700
プロネクス	2,300	1,106.00	2,543,800
ホクシン	1,700	207.00	351,900
ウッドワン	4,000	276.00	1,104,000
大建工業	1,700	2,135.00	3,629,500
きもと	4,600	249.00	1,145,400
凸版印刷	69,000	1,161.00	80,109,000
大日本印刷	71,000	1,210.00	85,910,000
図書印刷	3,000	498.00	1,494,000
共同印刷	8,000	409.00	3,272,000
日本写真印刷	4,100	3,085.00	12,648,500

光村印刷	2,000	224.00	448,000
藤森工業	1,900	3,000.00	5,700,000
宝印刷	1,200	1,565.00	1,878,000
前澤化成工業	1,700	1,196.00	2,033,200
アシックス	24,400	2,362.00	57,632,800
ツツミ	900	2,011.00	1,809,900
J S P	1,200	2,687.00	3,224,400
ニチハ	3,400	2,971.00	10,101,400
エフピコ	2,300	5,540.00	12,742,000
小松ウオール工業	800	1,963.00	1,570,400
ヤマハ	16,500	3,680.00	60,720,000
河合楽器製作所	1,000	2,365.00	2,365,000
クリナップ	2,900	953.00	2,763,700
ピジョン	14,800	3,065.00	45,362,000
天馬	1,700	2,051.00	3,486,700
兼松サステック	3,000	187.00	561,000
キングジム	2,000	846.00	1,692,000
リンテック	5,800	2,567.00	14,888,600
T A S A K I	700	1,613.00	1,129,100
信越ポリマー	5,000	908.00	4,540,000
東リ	6,100	381.00	2,324,100
イトーキ	5,200	749.00	3,894,800
任天堂	15,100	24,050.00	363,155,000
三菱鉛筆	2,000	6,360.00	12,720,000
松風	1,300	1,381.00	1,795,300
タカラスタンダード	5,100	1,960.00	9,996,000
コクヨ	12,700	1,401.00	17,792,700
ナカバヤシ	4,000	277.00	1,108,000
ニフコ	4,500	6,160.00	27,720,000
立川ブラインド工業	1,100	908.00	998,800
グローブライド	1,200	1,970.00	2,364,000
岡村製作所	8,600	1,061.00	9,124,600
日本バルカー工業	2,000	1,570.00	3,140,000
M U T O Hホールディングス	3,000	261.00	783,000
伊藤忠商事	177,200	1,567.00	277,672,400
丸紅	238,100	671.80	159,955,580
スクロール	3,700	356.00	1,317,200
高島	4,000	203.00	812,000
ヨンドシーホールディングス	1,800	2,559.00	4,606,200
三陽商会	13,000	183.00	2,379,000
長瀬産業	14,500	1,545.00	22,402,500
ナイガイ	9,000	63.00	567,000
蝶理	1,500	1,786.00	2,679,000
豊田通商	27,000	3,075.00	83,025,000
オンワードホールディングス	17,000	828.00	14,076,000
三共生興	3,700	414.00	1,531,800
兼松	51,000	198.00	10,098,000
美津濃	13,000	592.00	7,696,000
ツカモトコーポレーション	4,000	137.00	548,000

ユニー・ファミリーマートホールディングス	10,600	7,920.00	83,952,000	
ルック	5,000	176.00	880,000	
三井物産	218,800	1,637.50	358,285,000	
日本紙パルプ商事	13,000	375.00	4,875,000	
東京エレクトロン	16,300	10,950.00	178,485,000	
日立ハイテクノロジーズ	8,400	4,655.00	39,102,000	
カメイ	3,100	1,184.00	3,670,400	
東都水産	400	1,872.00	748,800	
OUGホールディングス	4,000	267.00	1,068,000	
スターゼン	1,000	4,875.00	4,875,000	
セイコーホールディングス	17,000	435.00	7,395,000	
山善	9,300	986.00	9,169,800	
椿本興業	3,000	366.00	1,098,000	
住友商事	152,300	1,410.00	214,743,000	
日本ユニシス	6,700	1,499.00	10,043,300	
内田洋行	6,000	496.00	2,976,000	
三菱商事	181,600	2,545.50	462,262,800	
第一実業	5,000	685.00	3,425,000	
キャノンマーケティングジャパン	6,900	2,027.00	13,986,300	
西華産業	8,000	350.00	2,800,000	
佐藤商事	2,200	872.00	1,918,400	
菱洋エレクトロ	2,300	1,478.00	3,399,400	
東京産業	2,400	493.00	1,183,200	
ユアサ商事	2,300	3,010.00	6,923,000	
神鋼商事	600	2,497.00	1,498,200	
小林産業	1,800	262.00	471,600	
阪和興業	24,000	777.00	18,648,000	
カナデン	2,300	1,090.00	2,507,000	
菱電商事	4,000	756.00	3,024,000	
ニプロ	17,000	1,331.00	22,627,000	
フルサト工業	1,300	1,737.00	2,258,100	
岩谷産業	27,000	624.00	16,848,000	
すてきナイスグループ	10,000	156.00	1,560,000	
昭光通商	9,000	101.00	909,000	
ニチモウ	3,000	178.00	534,000	
極東貿易	4,000	245.00	980,000	
イワキ	4,000	226.00	904,000	
兼松エレクトロニクス	1,500	2,657.00	3,985,500	
三愛石油	6,500	855.00	5,557,500	
稲畑産業	5,800	1,315.00	7,627,000	
G S Iクレオス	6,000	129.00	774,000	
明和産業	2,200	403.00	886,600	
キムラタン	108,000	7.00	756,000	
ゴールドウイン	1,100	5,450.00	5,995,000	
ユニ・チャーム	52,000	2,590.50	134,706,000	
デサント	5,900	1,382.00	8,153,800	
キング	1,300	413.00	536,900	
ワキタ	5,100	1,016.00	5,181,600	
ヤマトインターナショナル	1,600	406.00	649,600	

東邦ホールディングス	7,700	2,382.00	18,341,400
サンゲツ	8,300	2,118.00	17,579,400
ミツウロコグループホールディングス	3,900	728.00	2,839,200
シナネンホールディングス	1,000	2,188.00	2,188,000
伊藤忠エネクス	5,300	956.00	5,066,800
サンリオ	7,500	2,323.00	17,422,500
サンワテクノス	1,400	962.00	1,346,800
リョーサン	3,600	3,540.00	12,744,000
新光商事	2,600	1,290.00	3,354,000
トーヨー	1,100	2,599.00	2,858,900
三信電気	2,700	1,159.00	3,129,300
東陽テクニカ	3,200	1,038.00	3,321,600
モスフードサービス	3,200	3,525.00	11,280,000
加賀電子	2,200	2,023.00	4,450,600
三益半導体工業	1,900	1,670.00	3,173,000
ソーダニッカ	2,500	507.00	1,267,500
立花エレテック	1,600	1,375.00	2,200,000
木曽路	3,000	2,342.00	7,026,000
サトレストランシステムズ	2,800	821.00	2,298,800
千趣会	4,400	730.00	3,212,000
タカキュー	1,900	201.00	381,900
ケーヨー	4,100	577.00	2,365,700
アデランス	900	620.00	558,000
上新電機	6,000	1,046.00	6,276,000
日本瓦斯	4,400	3,335.00	14,674,000
ベスト電器	7,800	154.00	1,201,200
ロイヤルホールディングス	4,000	1,918.00	7,672,000
東天紅	2,000	156.00	312,000
いなげや	2,700	1,541.00	4,160,700
島忠	6,300	3,020.00	19,026,000
チヨダ	2,900	2,824.00	8,189,600
ライフコーポレーション	1,800	3,365.00	6,057,000
リンガーハット	2,700	2,302.00	6,215,400
さが美	2,000	125.00	250,000
MR MAX	3,000	420.00	1,260,000
テンアライド	2,200	382.00	840,400
AOKIホールディングス	4,800	1,445.00	6,936,000
オークワ	3,000	1,163.00	3,489,000
コメリ	3,700	2,789.00	10,319,300
青山商事	5,100	4,155.00	21,190,500
しまむら	2,800	15,370.00	43,036,000
はせがわ	1,300	447.00	581,100
高島屋	41,000	999.00	40,959,000
松屋	5,300	1,058.00	5,607,400
エイチ・ツー・オーリテイリング	12,400	1,885.00	23,374,000
近鉄百貨店	9,000	360.00	3,240,000
丸栄	5,000	90.00	450,000
パルコ	2,300	1,075.00	2,472,500
丸井グループ	25,500	1,751.00	44,650,500
クレディセゾン	18,400	2,142.00	39,412,800

アクシアル リテイリング	1,900	4,145.00	7,875,500	
井筒屋	1,300	416.00	540,800	
イオン	99,600	1,699.50	169,270,200	
イズミ	4,800	5,210.00	25,008,000	
東武ストア	300	2,900.00	870,000	
フォーバル	1,100	728.00	800,800	
平和堂	4,900	2,847.00	13,950,300	
フジ	2,700	2,478.00	6,690,600	
ヤオコー	2,700	4,770.00	12,879,000	
ゼビオホールディングス	3,300	1,840.00	6,072,000	
ケーズホールディングス	11,100	2,113.00	23,454,300	
PALTAC	3,900	2,826.00	11,021,400	
三谷産業	2,600	358.00	930,800	
Olympicグループ	1,400	651.00	911,400	
日産東京販売ホールディングス	3,600	361.00	1,299,600	
新生銀行	230,000	200.00	46,000,000	
あおぞら銀行	153,000	423.00	64,719,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,833,600	738.00	1,353,196,800	
りそなホールディングス	283,100	626.70	177,418,770	
三井住友トラスト・ホールディングス	50,500	4,313.00	217,806,500	
三井住友フィナンシャルグループ	193,800	4,545.00	880,821,000	
第四銀行	30,000	534.00	16,020,000	
北越銀行	2,600	2,689.00	6,991,400	
千葉銀行	93,000	737.00	68,541,000	
群馬銀行	53,800	660.00	35,508,000	
武蔵野銀行	3,900	3,495.00	13,630,500	
千葉興業銀行	6,600	613.00	4,045,800	
筑波銀行	10,100	359.00	3,625,900	
七十七銀行	38,000	579.00	22,002,000	
青森銀行	19,000	399.00	7,581,000	
秋田銀行	16,000	386.00	6,176,000	
山形銀行	14,000	491.00	6,874,000	
岩手銀行	1,600	4,865.00	7,784,000	
東邦銀行	22,000	444.00	9,768,000	
東北銀行	12,000	158.00	1,896,000	
みちのく銀行	12,000	227.00	2,724,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	98,000	535.00	52,430,000	
静岡銀行	66,000	1,013.00	66,858,000	
十六銀行	32,000	423.00	13,536,000	
スルガ銀行	24,700	2,628.00	64,911,600	
八十二銀行	46,700	699.00	32,643,300	
山梨中央銀行	15,000	561.00	8,415,000	
大垣共立銀行	32,000	468.00	14,976,000	
福井銀行	21,000	299.00	6,279,000	
北國銀行	26,000	436.00	11,336,000	
清水銀行	800	3,815.00	3,052,000	
富山銀行	500	4,495.00	2,247,500	
滋賀銀行	23,000	650.00	14,950,000	
南都銀行	2,300	4,590.00	10,557,000	
百五銀行	22,000	485.00	10,670,000	

京都銀行	43,000	886.00	38,098,000
紀陽銀行	9,100	1,897.00	17,262,700
三重銀行	1,100	2,492.00	2,741,200
ほくほくフィナンシャルグループ	16,100	2,060.00	33,166,000
広島銀行	71,000	560.00	39,760,000
山陰合同銀行	14,500	1,005.00	14,572,500
中国銀行	17,200	1,705.00	29,326,000
鳥取銀行	800	1,954.00	1,563,200
伊予銀行	25,900	828.00	21,445,200
百十四銀行	27,000	401.00	10,827,000
四国銀行	19,000	289.00	5,491,000
阿波銀行	21,000	729.00	15,309,000
大分銀行	14,000	443.00	6,202,000
宮崎銀行	16,000	380.00	6,080,000
佐賀銀行	15,000	305.00	4,575,000
十八銀行	15,000	361.00	5,415,000
沖縄銀行	2,400	4,260.00	10,224,000
琉球銀行	5,000	1,551.00	7,755,000
セブン銀行	90,700	340.00	30,838,000
みずほフィナンシャルグループ	3,285,200	214.40	704,346,880
高知銀行	9,000	136.00	1,224,000
山口フィナンシャルグループ	23,000	1,287.00	29,601,000
アクリーティブ	2,000	492.00	984,000
芙蓉総合リース	2,800	5,670.00	15,876,000
興銀リース	4,500	2,621.00	11,794,500
東京センチュリー	4,900	4,050.00	19,845,000
SBIホールディングス	27,400	1,569.00	42,990,600
日本証券金融	10,700	640.00	6,848,000
アイフル	40,600	353.00	14,331,800
日本アジア投資	2,300	519.00	1,193,700
ポケットカード	1,800	578.00	1,040,400
長野銀行	800	2,052.00	1,641,600
名古屋銀行	2,000	4,245.00	8,490,000
北洋銀行	39,500	491.00	19,394,500
愛知銀行	800	6,850.00	5,480,000
第三銀行	1,400	1,908.00	2,671,200
中京銀行	1,000	2,363.00	2,363,000
大光銀行	9,000	269.00	2,421,000
愛媛銀行	2,900	1,380.00	4,002,000
トマト銀行	900	1,620.00	1,458,000
みなと銀行	2,200	2,169.00	4,771,800
京葉銀行	20,000	550.00	11,000,000
関西アーバン銀行	3,400	1,479.00	5,028,600
栃木銀行	13,300	587.00	7,807,100
北日本銀行	800	3,165.00	2,532,000
東和銀行	45,000	115.00	5,175,000
福島銀行	26,000	100.00	2,600,000
大東銀行	13,000	170.00	2,210,000
リコーリース	1,900	3,630.00	6,897,000
イオンフィナンシャルサービス	15,400	2,136.00	32,894,400

アコム	48,600	511.00	24,834,600
ジャックス	13,000	529.00	6,877,000
オリエントコーポレーション	52,300	217.00	11,349,100
日立キャピタル	5,700	2,999.00	17,094,300
アプラスフィナンシャル	11,600	120.00	1,392,000
オリックス	171,300	1,873.00	320,844,900
三菱UFJリース	61,400	605.00	37,147,000
ジャフコ	4,000	3,920.00	15,680,000
トモニホールディングス	19,900	637.00	12,676,300
大和証券グループ本社	226,000	745.00	168,370,000
野村ホールディングス	494,700	699.80	346,191,060
岡三証券グループ	21,000	744.00	15,624,000
丸三証券	7,700	1,004.00	7,730,800
東洋証券	9,000	291.00	2,619,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	27,800	642.00	17,847,600
光世証券	6,000	206.00	1,236,000
水戸証券	7,500	328.00	2,460,000
いちよし証券	5,400	919.00	4,962,600
松井証券	13,800	1,026.00	14,158,800
SOMPOホールディングス	50,600	4,079.00	206,397,400
だいこう証券ビジネス	1,200	636.00	763,200
日本取引所グループ	75,200	1,691.00	127,163,200
マネックスグループ	26,000	335.00	8,710,000
カブドットコム証券	18,000	407.00	7,326,000
極東証券	3,200	1,785.00	5,712,000
岩井コスモホールディングス	2,300	1,129.00	2,596,700
藍澤証券	4,500	668.00	3,006,000
フィデアホールディングス	23,500	213.00	5,005,500
池田泉州ホールディングス	25,700	554.00	14,237,800
アニコムホールディングス	1,600	2,417.00	3,867,200
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	72,300	3,731.00	269,751,300
ソニーフィナンシャルホールディングス	23,200	1,866.00	43,291,200
マネーパートナーズグループ	3,100	558.00	1,729,800
小林洋行	700	280.00	196,000
第一生命ホールディングス	145,900	2,028.50	295,958,150
東京海上ホールディングス	98,000	4,917.00	481,866,000
イー・ギャランティ	700	2,548.00	1,783,600
アサックス	400	1,639.00	655,600
NECキャピタルソリューション	1,000	1,837.00	1,837,000
T&Dホールディングス	88,200	1,604.00	141,472,800
アドバンスクリエイト	600	1,828.00	1,096,800
三井不動産	128,000	2,793.50	357,568,000
三菱地所	180,000	2,386.50	429,570,000
平和不動産	4,600	1,665.00	7,659,000
東京建物	28,100	1,605.00	45,100,500
ダイビル	6,200	1,022.00	6,336,400
京阪神ビルディング	4,000	624.00	2,496,000

住友不動産	58,000	3,232.00	187,456,000
太平洋興発	10,000	101.00	1,010,000
大京	45,000	244.00	10,980,000
テーオーシー	9,400	965.00	9,071,000
東京楽天地	4,000	538.00	2,152,000
レオパレス21	30,500	678.00	20,679,000
スターツコーポレーション	2,500	2,040.00	5,100,000
フジ住宅	3,100	769.00	2,383,900
空港施設	2,900	585.00	1,696,500
明和地所	1,300	747.00	971,100
住友不動産販売	2,200	2,827.00	6,219,400
ゴールドクレスト	2,200	2,253.00	4,956,600
リログループ	1,000	17,000.00	17,000,000
日本エスリード	900	1,366.00	1,229,400
日神不動産	2,900	549.00	1,592,100
日本エスコン	3,200	444.00	1,420,800
タカラレーベン	10,600	757.00	8,024,200
サンヨーハウジング名古屋	1,200	1,112.00	1,334,400
イオンモール	15,600	1,718.00	26,800,800
ファースト住建	900	1,513.00	1,361,700
ランド	20,800	17.00	353,600
東祥	500	5,540.00	2,770,000
トーセイ	3,300	883.00	2,913,900
穴吹興産	300	2,646.00	793,800
エヌ・ティ・ティ都市開発	15,000	1,074.00	16,110,000
サンフロンティア不動産	2,600	1,075.00	2,795,000
エフ・ジェー・ネクスト	2,100	750.00	1,575,000
インテリックス	500	755.00	377,500
ランドビジネス	1,400	281.00	393,400
グランディハウス	2,100	429.00	900,900
東武鉄道	131,000	597.00	78,207,000
相鉄ホールディングス	39,000	603.00	23,517,000
東京急行電鉄	133,000	895.00	119,035,000
京浜急行電鉄	67,000	1,397.00	93,599,000
小田急電鉄	39,300	2,411.00	94,752,300
京王電鉄	68,000	995.00	67,660,000
京成電鉄	18,400	2,971.00	54,666,400
富士急行	7,000	1,175.00	8,225,000
新京成電鉄	3,000	419.00	1,257,000
東日本旅客鉄道	47,400	10,510.00	498,174,000
西日本旅客鉄道	23,600	7,398.00	174,592,800
東海旅客鉄道	20,400	19,705.00	401,982,000
西武ホールディングス	33,900	2,145.00	72,715,500
鴻池運輸	3,500	1,550.00	5,425,000
西日本鉄道	29,000	564.00	16,356,000
ハマキョウレックス	1,600	2,236.00	3,577,600
サカイ引越センター	800	2,686.00	2,148,800
近鉄グループホールディングス	247,000	461.00	113,867,000
阪急阪神ホールディングス	31,000	3,915.00	121,365,000
南海電気鉄道	52,000	605.00	31,460,000

京阪ホールディングス	55,000	796.00	43,780,000
神戸電鉄	6,000	379.00	2,274,000
名古屋鉄道	89,000	575.00	51,175,000
山陽電気鉄道	9,000	615.00	5,535,000
トランコム	700	5,800.00	4,060,000
日本通運	95,000	642.00	60,990,000
ヤマトホールディングス	43,800	2,502.50	109,609,500
山九	32,000	730.00	23,360,000
日新	10,000	377.00	3,770,000
丸運	1,300	256.00	332,800
丸全昭和運輸	8,000	478.00	3,824,000
センコー	11,000	844.00	9,284,000
トナミホールディングス	5,000	374.00	1,870,000
ニッコンホールディングス	8,300	2,505.00	20,791,500
日本石油輸送	300	2,469.00	740,700
福山通運	15,000	685.00	10,275,000
セイノーホールディングス	17,400	1,351.00	23,507,400
神奈川中央交通	3,000	724.00	2,172,000
日立物流	5,100	2,421.00	12,347,100
丸和運輸機関	600	2,908.00	1,744,800
C & F ロジホールディングス	2,500	1,301.00	3,252,500
日本郵船	207,000	229.00	47,403,000
商船三井	129,000	342.00	44,118,000
川崎汽船	93,000	279.00	25,947,000
NSユナイテッド海運	11,000	208.00	2,288,000
明治海運	2,200	443.00	974,600
飯野海運	12,700	495.00	6,286,500
共栄タンカー	2,000	226.00	452,000
九州旅客鉄道	18,300	3,090.00	56,547,000
日本航空	44,200	3,532.00	156,114,400
A N A ホールディングス	455,000	321.40	146,237,000
パスコ	2,000	415.00	830,000
三菱倉庫	16,000	1,696.00	27,136,000
三井倉庫ホールディングス	14,000	350.00	4,900,000
住友倉庫	18,000	634.00	11,412,000
澁澤倉庫	6,000	361.00	2,166,000
ヤマタネ	1,200	1,657.00	1,988,400
東陽倉庫	4,200	295.00	1,239,000
乾汽船	1,800	1,010.00	1,818,000
日本トランスシティ	6,000	439.00	2,634,000
ケイヒン	4,000	158.00	632,000
中央倉庫	1,400	1,095.00	1,533,000
安田倉庫	1,900	777.00	1,476,300
東洋埠頭	7,000	193.00	1,351,000
宇徳	2,000	424.00	848,000
上組	29,000	1,137.00	32,973,000
サンリツ	600	532.00	319,200
キムラユニティー	600	1,222.00	733,200
キューソー流通システム	800	2,580.00	2,064,000
郵船ロジスティクス	2,200	1,234.00	2,714,800

近鉄エクスプレス	4,400	1,620.00	7,128,000
東海運	1,300	462.00	600,600
エーアイティー	1,500	1,144.00	1,716,000
内外トランスライン	700	1,083.00	758,100
東京放送ホールディングス	15,900	1,998.00	31,768,200
日本テレビホールディングス	22,100	2,185.00	48,288,500
朝日放送	2,400	724.00	1,737,600
テレビ朝日ホールディングス	6,600	2,421.00	15,978,600
スカパーJ S A Tホールディングス	15,700	542.00	8,509,400
テレビ東京ホールディングス	2,000	2,345.00	4,690,000
日本BS放送	500	1,078.00	539,000
U-NEXT	600	692.00	415,200
ワイヤレスゲート	800	1,809.00	1,447,200
コネクシオ	2,100	1,513.00	3,177,300
日本通信	20,200	172.00	3,474,400
クロップス	500	560.00	280,000
日本電信電話	194,200	5,073.00	985,176,600
KDDI	239,400	3,060.00	732,564,000
光通信	2,900	10,930.00	31,697,000
NTTドコモ	180,800	2,750.50	497,290,400
エムティーアイ	3,700	749.00	2,771,300
GMOインターネット	8,800	1,549.00	13,631,200
カドカワ	7,000	1,763.00	12,341,000
学研ホールディングス	8,000	330.00	2,640,000
ゼンリン	3,200	2,436.00	7,795,200
昭文社	1,300	690.00	897,000
インプレスホールディングス	2,000	144.00	288,000
東京電力ホールディングス	208,000	479.00	99,632,000
中部電力	80,800	1,646.00	132,996,800
関西電力	100,000	1,302.00	130,200,000
中国電力	33,900	1,388.00	47,053,200
北陸電力	24,000	1,338.00	32,112,000
東北電力	61,200	1,498.00	91,677,600
四国電力	22,100	1,191.00	26,321,100
九州電力	54,100	1,288.00	69,680,800
北海道電力	22,900	932.00	21,342,800
沖縄電力	3,600	2,769.00	9,968,400
電源開発	19,500	2,778.00	54,171,000
エフオン	1,000	981.00	981,000
イーレックス	1,000	3,295.00	3,295,000
東京瓦斯	263,000	538.30	141,572,900
大阪瓦斯	238,000	457.10	108,789,800
東邦瓦斯	62,000	971.00	60,202,000
北海道瓦斯	6,000	278.00	1,668,000
広島ガス	5,000	379.00	1,895,000
西部瓦斯	28,000	258.00	7,224,000
静岡ガス	7,500	832.00	6,240,000
メタウォーター	1,400	2,772.00	3,880,800
アイネット	1,400	1,140.00	1,596,000
松竹	16,000	1,372.00	21,952,000

東宝	15,800	3,375.00	53,325,000
エイチ・アイ・エス	4,200	3,080.00	12,936,000
東映	9,000	1,033.00	9,297,000
ラックランド	400	1,925.00	770,000
エヌ・ティ・ティ・データ	14,900	5,760.00	85,824,000
共立メンテナンス	2,100	7,170.00	15,057,000
イチネンホールディングス	2,700	1,196.00	3,229,200
建設技術研究所	1,600	1,056.00	1,689,600
スペース	1,400	1,258.00	1,761,200
アインホールディングス	2,900	8,080.00	23,432,000
燦ホールディングス	500	1,567.00	783,500
ピー・シー・エー	400	1,427.00	570,800
スバル興業	2,000	525.00	1,050,000
東京テアトル	10,000	163.00	1,630,000
タナベ経営	500	1,289.00	644,500
ビジネスブレイン太田昭和	400	1,028.00	411,200
ナガワ	500	4,490.00	2,245,000
よみうりランド	5,000	495.00	2,475,000
東京都競馬	18,000	271.00	4,878,000
常磐興産	900	1,619.00	1,457,100
カナモト	3,600	3,225.00	11,610,000
東京ドーム	10,200	1,171.00	11,944,200
D T S	2,500	2,623.00	6,557,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9,300	3,095.00	28,783,500
シーイーシー	1,400	1,896.00	2,654,400
カブコン	5,700	2,767.00	15,771,900
西尾レントオール	2,100	3,640.00	7,644,000
アイ・エス・ビー	500	960.00	480,000
アゴラ・ホスピタリティ・グループ	13,000	40.00	520,000
日本空港ビルデング	7,700	4,310.00	33,187,000
トランス・コスモス	3,000	2,923.00	8,769,000
乃村工藝社	5,500	1,722.00	9,471,000
ジャステック	1,500	1,071.00	1,606,500
S C S K	6,600	4,285.00	28,281,000
藤田観光	8,000	370.00	2,960,000
K N T - C Tホールディングス	14,000	149.00	2,086,000
日本管財	2,200	1,849.00	4,067,800
トーカイ	1,100	4,030.00	4,433,000
白洋舎	200	2,682.00	536,400
セコム	26,600	8,725.00	232,085,000
日本システムウエア	800	1,543.00	1,234,400
セントラル警備保障	1,100	2,096.00	2,305,600
アイネス	3,000	1,251.00	3,753,000
丹青社	4,400	827.00	3,638,800
メイテック	3,100	4,545.00	14,089,500
T K C	2,200	3,245.00	7,139,000
アサツー ディ・ケイ	4,200	2,922.00	12,272,400
富士ソフト	3,600	2,882.00	10,375,200

応用地質	2,400	1,398.00	3,355,200
船井総研ホールディングス	3,300	1,821.00	6,009,300
NSD	5,100	1,890.00	9,639,000
進学会	1,100	594.00	653,400
丸紅建材リース	2,000	227.00	454,000
オオバ	1,900	467.00	887,300
コナミホールディングス	10,900	4,940.00	53,846,000
学究社	700	1,487.00	1,040,900
ベネッセホールディングス	8,600	3,325.00	28,595,000
イオンディライト	2,900	3,420.00	9,918,000
ナック	1,600	995.00	1,592,000
福井コンピュータホールディングス	700	3,070.00	2,149,000
ニチイ学館	4,400	883.00	3,885,200
ダイセキ	4,500	2,435.00	10,957,500
ステップ	900	1,396.00	1,256,400
日鉄住金物産	2,100	4,645.00	9,754,500
元気寿司	600	2,152.00	1,291,200
トラスコ中山	5,500	2,469.00	13,579,500
ヤマダ電機	80,900	635.00	51,371,500
オートバックスセブン	9,000	1,773.00	15,957,000
アークランドサカモト	4,100	1,412.00	5,789,200
ニトリホールディングス	10,500	13,530.00	142,065,000
グルメ杵屋	2,000	1,016.00	2,032,000
愛眼	1,800	198.00	356,400
ケーユーホールディングス	1,300	836.00	1,086,800
吉野家ホールディングス	8,400	1,639.00	13,767,600
加藤産業	3,800	2,761.00	10,491,800
イノテック	2,100	606.00	1,272,600
イエローハット	2,300	2,579.00	5,931,700
松屋フーズ	1,200	3,895.00	4,674,000
JBCホールディングス	2,000	799.00	1,598,000
JKホールディングス	2,400	601.00	1,442,400
サガミチェーン	3,000	1,304.00	3,912,000
日伝	1,000	3,195.00	3,195,000
関西スーパーマーケット	2,000	1,549.00	3,098,000
ミロク情報サービス	1,800	1,814.00	3,265,200
北沢産業	2,000	194.00	388,000
杉本商事	1,400	1,578.00	2,209,200
因幡電機産業	3,400	4,040.00	13,736,000
王将フードサービス	1,800	4,440.00	7,992,000
ブレナス	2,700	2,331.00	6,293,700
ミニストップ	1,800	2,027.00	3,648,600
アークス	4,500	2,685.00	12,082,500
パローホールディングス	5,200	3,140.00	16,328,000
バイテックホールディングス	1,000	1,285.00	1,285,000
ミスミグループ本社	27,200	1,965.00	53,448,000
藤久	200	1,714.00	342,800
アルテック	2,100	220.00	462,000
ベルク	1,100	4,285.00	4,713,500
大庄	1,300	1,603.00	2,083,900

タキヒヨー	4,000	473.00	1,892,000	
ファーストリテイリング	4,000	39,720.00	158,880,000	
ソフトバンクグループ	108,900	8,363.00	910,730,700	
蔵王産業	400	1,426.00	570,400	
スズケン	11,000	3,910.00	43,010,000	
サンドラッグ	4,600	8,400.00	38,640,000	
サックスパー ホールディングス	2,300	1,238.00	2,847,400	
ジェコス	1,700	1,127.00	1,915,900	
ヤマザワ	500	1,822.00	911,000	
やまや	500	1,765.00	882,500	
ルネサスイーストン	2,200	540.00	1,188,000	
ベルーナ	6,000	808.00	4,848,000	
合計	37,094,004		55,557,455,993	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成29年1月31日現在

資産総額	87,846,697,932円
負債総額	577,622,030円
純資産総額（ - ）	87,269,075,902円
発行済数量	57,364,337口
1口当たり純資産額（ / ）	1,521.31円

## 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】

原届出書の「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」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

#### (1) 資本金の額（平成29年1月31日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

#### (2) 会社の機構（平成29年1月31日現在）

##### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

##### 投資運用の意思決定機構

#### 1.投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

#### 2.運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえ、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】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 2 事業の内容及び営業の概況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

### <更新・訂正後>

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

平成29年1月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	1,153,760,242,911
追加型株式投資信託	868	11,607,919,733,086
単位型公社債投資信託	56	309,058,467,566
単位型株式投資信託	103	730,271,926,332
合計	1,065	13,801,010,369,895

### 3【委託会社等の経理状況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

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

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

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

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

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

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

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

## (3)【株主資本等変動計算書】

第30期(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

(単位:千円)

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

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

第31期(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

(単位:千円)

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

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

## 重要な会計方針

項目	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法
4. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。それ以外の無形固定資産については、定額法によっております。</p>
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金は、一般債権は貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権は個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を計上しております。また、退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法は以下のとおりであります。 数理計算上の差異：各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理 過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p>
7. 消費税等の処理方法	税抜方式によっております。

**未適用の会計基準等**

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

**（1）概要**

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

**（2）適用予定日**

平成28年4月1日以後に開始する事業年度の期首から適用予定であります。

**（3）当該会計基準等の適用による影響**

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

**会計上の見積りの変更**

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

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

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

**追加情報**

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

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

**注記事項**

(貸借対照表関係)

## 1. 固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

## 2. 関係会社項目

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

(千円)

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

(損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

## 2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第30期(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成26年6月30日 定時株主総会	普通 株式	2,328,000	97,000	平成26年3月31日	平成26年7月1日

## (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	24,000	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成27年6月29日 定時株主総会	普通 株式	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27年6月30日

## (2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

平成28年6月29日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成28年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,544,000	106,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

デリバティブ取引は、後述するリスクを低減する目的で行っております。取引は実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

## 第30期(平成27年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	12,051,921	12,051,921	-
(2) 金銭の信託	14,169,657	14,169,657	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	532,891	532,891	-
資産計	26,754,470	26,754,470	-
(1) 未払法人税等	1,539,263	1,539,263	-
負債計	1,539,263	1,539,263	-

## 第31期(平成28年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	12,951,736	12,951,736	-
(2) 金銭の信託	13,094,914	13,094,914	-
(3) 投資有価証券 その他有価証券	381,005	381,005	-
資産計	26,427,656	26,427,656	-
(1) 未払法人税等	1,223,957	1,223,957	-
負債計	1,223,957	1,223,957	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## (3) 投資有価証券

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

負 債

## (1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

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

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

差入保証金は、本社オフィス等の不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第30期(平成27年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	12,051,921	-	-	-
合計	12,051,921	-	-	-

第31期(平成28年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	12,951,736	-	-	-
合計	12,951,736	-	-	-

(注4) 社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額

該当事項はありません。

(有価証券関係)

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 4. その他有価証券

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	516,710	146,101	370,608
債券	-	-	-
その他（投資信託）	16,181	13,000	3,181
小計	532,891	159,101	373,789
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	532,891	159,101	373,789

（注）非上場株式（貸借対照表計上額80,246千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第31期（平成28年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	365,683	146,101	219,581
債券	-	-	-
その他（投資信託）	15,322	13,000	2,322
小計	381,005	159,101	221,903
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	381,005	159,101	221,903

（注）非上場株式（貸借対照表計上額77,696千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券  
該当事項はありません。

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

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他有価証券	5,927	3,377	-

7. 減損処理を行った有価証券  
該当事項はありません。

(金銭の信託関係)

1. 運用目的の金銭の信託

第30期(平成27年3月31日現在)

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

第31期(平成28年3月31日現在)

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

2. 満期保有目的の金銭の信託  
該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託  
該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

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

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

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度(非積立型制度であります)を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

## 当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

### 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

#### （資産除去債務関係）

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

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

#### （セグメント情報等）

##### 1. セグメント情報

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

##### 2. 関連情報

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

#### （1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

#### （2）地域ごとの情報

##### 営業収益

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

##### 有形固定資産

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

#### （3）主要な顧客ごとの情報

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

## 第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

## (1) サービスごとの情報

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

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## (関連当事者との取引)

## (1) 親会社及び法人主要株主等

## 第30期(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)

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

## 第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## (2)子会社等

## 第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

## 第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

## (3)兄弟会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

## 第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関 係				
その他の 関係会 社の子 会社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	兼務 1名	当社設定投 資信託の販 売、預金取 引	投資信託の 販売代行手 数料	3,023,040	未払 手数料	372,837
								預金の預入 (純額)	879,733	現金・ 預金	12,155,931
								受取利息	1,787	未収 収益	123
	みずほ第 一フィナ ンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払	557,013	未払 費用	292,861
								業務委託料 の支払	8,540	未払金	7,581
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託財 産の運用	信託元本の 払戻 (純額)	700,000	金銭の 信託	13,094,914
								信託報酬の 支払	8,336		

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

(注4) 預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。

(注5) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

## (1株当たり情報)

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

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

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

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

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

	第32期中間会計期間末 (平成28年9月30日現在)	
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		11,605,537
金銭の信託		11,792,364
前払費用		122,161
未収委託者報酬		4,755,701
未収運用受託報酬		2,465,934
未収投資助言報酬		261,221
未収収益		181,959
繰延税金資産		329,236
その他		122,804
	流動資産計	31,636,922
固定資産		
有形固定資産		1,541,889
建物	1	6,517
器具備品	1	152,176
建設仮勘定		1,383,196
無形固定資産		1,613,174
ソフトウェア		1,421,245
ソフトウェア仮勘定		184,656
電話加入権		7,148
電信電話専用施設利用権		124
投資その他の資産		6,281,765
投資有価証券		441,519
関係会社株式		3,229,196
繰延税金資産		713,716
差入保証金		1,808,323
その他		89,010
	固定資産計	9,436,830
	資産合計	41,073,753

(単位:千円)

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

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金				利益剰余金 合計	
				別途積立金	研究開発積 立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047	28,000,340	32,428,818
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,544,000	2,544,000	2,544,000
別途積立金の 積立				2,550,000			2,550,000	-	-
中間純利益							1,861,504	1,861,504	1,861,504
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額 (純額)									
当中間期変動額 合計	-	-	-	2,550,000	-	-	3,232,495	682,495	682,495
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	123,293	24,580,000	300,000	200,000	2,114,551	27,317,845	31,746,323

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

## 重要な会計方針

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

## 会計方針の変更

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

## 追加情報

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

## 注記事項

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

## 1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2．配当に関する事項

## 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成28年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

## （金融商品関係）

第32期中間会計期間末（平成28年9月30日現在）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

## （注1）金融商品の時価の算定方法

## 資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

有価証券運用を主目的とする単独運用の金銭の信託において信託財産として運用されている有価証券について、投資信託は基準価額によっております。また、デリバティブ取引は取引相手先金融機関より提示された価格によっております。

## (3) 投資有価証券

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

## 負 債

## (1) 未払法人税等

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

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

差入保証金は、本社オフィスの不動産賃借契約に基づき差し入れた敷金等であり、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、時価開示の対象としておりません。

## (有価証券関係)

第32期中間会計期間末  
(平成28年9月30日現在)

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

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

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額77,696千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## (金銭の信託関係)

第32期中間会計期間末  
(平成28年9月30日現在)

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

## (資産除去債務関係)

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

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

## (セグメント情報等)

第32期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

## 1. セグメント情報

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

## 2. 関連情報

## (1) サービスごとの情報

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

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

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

## (1株当たり情報)

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

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

## （重要な後発事象）

第32期中間会計期間  
（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

当社（以下「DIAM」という）は、平成28年7月13日付で締結した、DIAM、みずほ投信投資顧問株式会社（以下「MHAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及び新光投信株式会社（以下「新光投信」という）（以下総称して「統合4社」という）間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

## 1．結合当事企業

結合当事企業	DIAM	MHAM	TB	新光投信
事業の内容	投資運用業務、投資助言・代理業務	投資運用業務、投資助言・代理業務	信託業務、銀行業務、投資運用業務	投資運用業務、投資助言・代理業務

## 2．企業結合日

平成28年10月1日

## 3．企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

## 4．結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5．交付した株式数

「3．企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社である株式会社みずほフィナンシャルグループ（以下「みずほフィナンシャルグループ」という）に対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないA種種類株式15,510株を交付しました。

## 6．企業結合の主な目的

当社は、みずほフィナンシャルグループ及び第一生命保険株式会社（以下「第一生命」という）の資産運用ビジネス強化・発展に対する強力なコミットメントのもと、統合4社が長年にわたって培ってきた資産運用に係わる英知を結集し、みずほフィナンシャルグループと第一生命両社グループとの連携も最大限活用して、お客さまに最高水準のソリューションを提供するグローバルな運用会社としての飛躍を目指してまいります。

## 7．取得企業を決定するに至った主な根拠

「3．企業結合の方法」の吸収合併において、法的に消滅会社となるMHAMの親会社であるみずほフィナンシャルグループが、結合後企業の議決権の過半数を保有することになるため、企業結合の会計上はMHAMが取得企業に該当し、DIAMが被取得企業となるものです。

## 8．実施予定の会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号 平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分）に基づき、「3．企業結合の方法」の吸収合併及びの吸収分割については共通支配下の取引として処理し、の吸収合併については逆取得として処理することをそれぞれ予定しております。

(参考)みずほ投信投資顧問株式会社の経理状況

当該(参考)において、みずほ投信投資顧問株式会社を「当社」という。

1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

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

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

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

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

みずほ投信投資顧問株式会社

取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

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

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

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

## 強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会御中

## 新日本有限責任監査法人

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

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

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

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

### 強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

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

以上

---

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

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

## (1)貸借対照表

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

資本剰余金		
資本準備金	2,266,400	2,266,400
その他資本剰余金	2,450,074	2,450,074
資本剰余金合計	<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)
<b>繰延税金資産</b>		
有価証券償却超過額	4,795千円	4,551千円
ソフトウェア償却超過額	69,263	52,651
賞与引当金損金算入限度超過額	108,734	98,134
社会保険料損金不算入額	15,665	14,233
役員退職慰労引当金	34,461	45,488
未払事業税	30,421	39,817
その他	93,137	58,782
繰延税金資産小計	356,479	313,659
評価性引当額	24,103	22,331
繰延税金資産合計	332,375	291,328
<b>繰延税金負債</b>		
前払年金費用	107,027	106,147
その他有価証券評価差額金	346,190	60,812
繰延税金負債合計	453,218	166,959
繰延税金資産の純額	120,843	124,368

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

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

## 3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

## (資産除去債務関係)

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

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

## (セグメント情報等)

## [セグメント情報]

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

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## [ 関連情報 ]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 売上高

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 売上高

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

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

## [ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当するものではありません。

## (関連当事者情報)

## 1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

上記の取引については、一般取引条件と同様に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

## (1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## (1) 中間貸借対照表

(単位: 千円)

第54期中間会計期間  
(平成28年9月30日)

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

## (2) 中間損益計算書

(単位: 千円)

第54期中間会計期間

(自 平成28年4月1日

至 平成28年9月30日)

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第54期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

(単位：千円)

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

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

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

## 重要な会計方針

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却方法

## (1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

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

## (2) 賞与引当金

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

## (3) 退職給付引当金（前払年金費用）

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

## (4) 役員退職慰労引当金（執行役員に対する退職慰労引当金）

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

## (5) 時効後支払損引当金

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

## 4. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

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

## 5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

## 追加情報

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

## 注記事項

（中間貸借対照表関係）

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

## （中間損益計算書関係）

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

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第54期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

## 1 発行済株式に関する事項

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

## 2．自己株式に関する事項

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

## 3 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

## （金融商品関係）

第54期中間会計期間(平成28年9月30日)

## 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位： 千円）

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

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

## 資 産

## (1) 現金及び預金

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

## (2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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

## (4) 投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

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

## 負債

## (1) 未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の中間貸借対照表計上額

区分	中間貸借対照表計上額(千円)
非上場株式	60,720

上記については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

## (有価証券関係)

第54期中間会計期間(平成28年9月30日)

## 1 其他有価証券

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

## (資産除去債務関係)

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

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

## (セグメント情報等)

## [セグメント情報]

第54期中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## [関連情報]

第54期中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 売上高

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

## (2) 有形固定資産

有形固定資産はすべて本邦に所在しております。

## 3 主要な顧客ごとの情報

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

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

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

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額は、以下のとおりであります。

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

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

(重要な後発事象)

当社(以下「MHAM」という)は、平成28年7月13日付で締結した、MHAM、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」という)、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」という)及び新光投信株式会社(以下「新光投信」という)(以下総称して「統合4社」という)間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 企業結合日  
平成28年10月1日

2. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

## （参考）新光投信株式会社の経理状況

### 1．財務諸表の作成方法について

委託会社である新光投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

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

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

### 2．監査証明について

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

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

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

新光投信株式会社  
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 福村 寛  
業務執行社員

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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会御中

## 新日本有限責任監査法人

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

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

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

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

### 強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

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

以上

---

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

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

## (1) 貸借対照表

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

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

## (2) 損益計算書

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

	前事業年度 (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
その他特別損失	22,227	-
特別損失合計	305,082	310,625
税引前当期純利益	5,629,593	5,575,383
法人税、住民税及び事業税	2,111,379	1,832,729
法人税等調整額	66,999	19,773
法人税等合計	2,044,380	1,852,503
当期純利益	3,585,212	3,722,880

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

## 重要な会計方針

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 関連会社株式

総平均法による原価法

#### (2) その他有価証券

時価のあるもの

決算期末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定）

時価のないもの

総平均法による原価法

### 2．固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8～18年

構築物 20年

器具備品 2～20年

#### (2) 無形固定資産

定額法。

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

### 3．引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

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

#### (2) 役員賞与引当金

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

#### (3) 外国税支払損失引当金

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

#### (4) 訴訟損失引当金

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

#### (5) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

#### 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

#### （6）役員退職慰労引当金

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

#### （7）執行役員退職慰労引当金

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

#### 4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

#### 5．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### （1）消費税等の会計処理

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

#### （未適用の会計基準）

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

##### （1）概要

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

##### （2）適用予定日

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

##### （3）当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

#### （追加情報）

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

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

## 注記事項

## (貸借対照表関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

2. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

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

## (損益計算書関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

2. 特別損失における合併関連費用の内訳は次のとおりであります。

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

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

## 1. 発行済株式に関する事項

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

## 2. 自己株式に関する事項

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

## 3. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年12月24日 臨時株主総会	普通株式	2,539,409	1,400	平成26年11月26日	平成26年12月25日

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

## 1. 発行済株式に関する事項

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

(変動事由の概要)

自己株式の消却

## 2. 自己株式に関する事項

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

(変動事由の概要)

自己株式の消却

## 3. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年11月17日 取締役会	普通株式	3,446,341	1,900	平成27年12月8日	平成27年12月17日

## （金融商品関係）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### (1) 金融商品に対する取組方針

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

なお、当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するための取得など、投資信託協会の規則に定める範囲において投資信託の取得及び処分を行っております。

#### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

#### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

##### 信用リスク（預金の預入先の信用リスク）の管理

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

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

##### 市場リスク（価格変動リスク及び為替変動リスク）の管理

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

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

##### 流動性リスクの管理

資金繰りについては、資金運用スケジュールを作成し、それに基づいた管理を行っております。また手元流動性を一定額以上維持することなどにより、流動性リスクを管理しております。

#### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

（注）1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## (1) 現金及び預金

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

## (2) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (3) 未収委託者報酬

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

（注）2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品（単位：千円）

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

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

## (注)3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 前事業年度(平成27年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	13,426,934	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	3,200,000	2,060,328	1,537,061	63,735
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	-	-	-

## 当事業年度(平成28年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 預金	14,861,112	-	-	-
(2) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	3,500,000	529,761	1,249,513	11,916
(3) 未収委託者報酬	2,884,368	-	-	-

## (有価証券関係)

## 1. 関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

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

(注)非上場株式(貸借対照表計上額199,051千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## 当事業年度(平成28年3月31日)

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

(注)非上場株式(貸借対照表計上額199,051千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## 3.売却したその他有価証券

## 前事業年度(平成27年3月31日)

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

## 4．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について10,952千円（その他有価証券）減損処理を行っております。  
当事業年度において、有価証券について62,800千円（その他有価証券）減損処理を行っております。

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

## （退職給付関係）

## 1．採用している退職給付制度の概要

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

## 2．確定給付制度

## (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

## (2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

## (4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

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

## (5)年金資産に関する事項

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

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6)数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度17,347千円 当事業年度16,733千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

(注) 繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

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

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

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

## 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

### (資産除去債務関係)

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

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

### (セグメント情報等)

#### セグメント情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)及び

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

#### 関連情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)及び

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

##### 1. 製品及びサービスごとの情報

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

##### 2. 地域ごとの情報

###### (1) 営業収益

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

###### (2) 有形固定資産

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

##### 3. 主要な顧客ごとの情報

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

#### 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

#### 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

## 関連当事者情報

## 1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る）等

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

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

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

(注) 2. 取引条件及び取引条件の決定方法等

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## 親会社情報

みずほ証券株式会社（非上場）

## （1株当たり情報）

	前事業年度 （自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）	当事業年度 （自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）
1株当たり純資産額	11,433円05銭	11,481円90銭
1株当たり当期純利益金額	1,976円56銭	2,052円45銭

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

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

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

## 中間財務諸表

## (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

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

(単位：千円)

当中間会計期間  
(平成28年9月30日)

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

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

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

## (3)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年4月 1日 至 平成28年9月30日）

（単位：千円）

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

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

## [ 注記事項 ]

## ( 重要な会計方針 )

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

## (1) 有価証券

関連会社株式

総平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

当中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定)

時価のないもの

総平均法による原価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

器具備品

定率法

なお、主な耐用年数は2～20年であります。

## (2) 無形固定資産

定額法。

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

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

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

## (2) 訴訟損失引当金

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

## (3) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

## 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

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

## （中間貸借対照表関係）

## 1. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

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

## 2. 消費税等の取扱い

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

## （中間損益計算書関係）

## 1. 減価償却実施額は、次のとおりであります。

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

## （中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

## 1. 発行済株式に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月15日 取締役会	普通 株式	12,515,661	6,900	平成28年7月5日	平成28年7月27日

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

## (金融商品関係)

## 金融商品の時価等に関する事項

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

当中間会計期間(自平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

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

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

## (1) 現金及び預金

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

## (2) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

## (3) 未収委託者報酬

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

## (4) 未払手数料

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

(注)2.時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額(千円)
非上場株式	276,151

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(2)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

## (有価証券関係)

当中間会計期間(平成28年9月30日)

## 1. 関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

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

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額199,051千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

当中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

## 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

## （1株当たり情報）

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

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

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

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

## （追加情報）

## 役員賞与引当金

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

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

## 役員退職慰労引当金

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

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

#### 執行役員退職慰労引当金

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

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

#### 繰延税金資産

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

#### (重要な後発事象)

当社(以下「新光投信」という)は、平成28年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」という)、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」という)及びみずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」という)(以下総称して「統合4社」という)間の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日付で統合いたしました。

1. 企業結合日  
平成28年10月1日

2. 企業結合の方法

MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施。

## 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】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 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」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

## (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。
シティグループ証券株式会社	96,307	「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。

BNP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

## 独立監査人の監査報告書

平成29年2月1日

アセットマネジメントOne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 公認会計士 佐々木 貴司 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 鶴 田 光夫 印  
業務執行社員

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7月9日から平成29年1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29年1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

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

以 上

---

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

X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

# 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。

[次へ](#)

# 独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会御中

## 新日本有限責任監査法人

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

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

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

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

### 強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

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

以上

---

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

（注2）XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。