

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長
<b>【提出日】</b>	平成29年10月6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>	三木谷 正直
<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)

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

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。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

当初元本は1口当たり1,475円とします。

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額 とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。当ファンドの基準価額は100口当たりで表示されます。

#### < 基準価額の照会方法等 >

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

### （５）【申込手数料】

販売会社が定める額とします。

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(6) 【申込単位】

1ユニット以上1ユニット単位とします。

「ユニット」とは、東証株価指数(TOPIX)(以下、「対象指数」という場合があります。)に連動すると委託会社が想定する現物株式ポートフォリオの1単位に相当する口数の受益権をいいます。

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

(7) 【申込期間】

継続申込期間：平成29年10月7日から平成30年4月6日まで

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

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

(8) 【申込取扱場所】

ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(9) 【払込期日】

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに、原則としてその保有する現物株式ポートフォリオ等を販売会社に引き渡すものとします。

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

現物株式ポートフォリオ等に金銭が含まれる場合は、当該金銭については、販売会社によって、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

・株式会社証券保管振替機構

## (12) 【その他】

## ・お申込の受付

取得申込みの受付は原則として販売会社の毎営業日に行われます。

取得申込みの受付は原則として正午までにお申込みが行われ、かつ、取得申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとして取扱います。

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

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

## ・お申込方法

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

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

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

## ・その他

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得のお申込みの受付を中止することおよびすでに受付けたファンドのお申込みの受付を取り消すことがあります。

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

なお、販売会社は、当該取得申込みにかかる現物株式ポートフォリオ等の受渡しまたは支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託にかかる現物株式ポートフォリオ等について受入れまたは振替済の通知を受けた場合には、振替機関に対し追加信託が行われた旨を通知するものとします。

**振替受益権について**

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

ファンドの収益分配金、交換有価証券は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払い、交付されます。

**(参考)****投資信託振替制度**

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

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

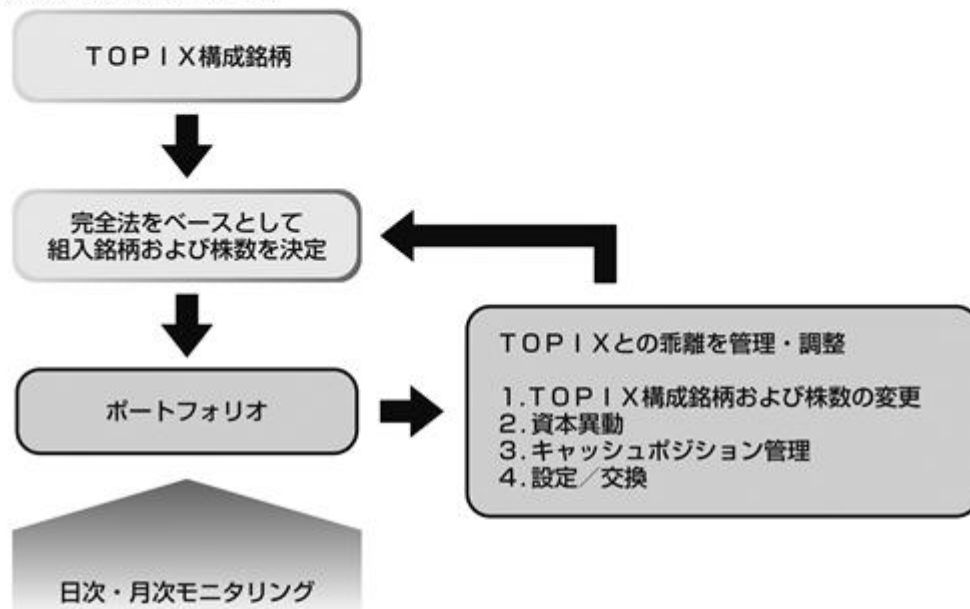
当ファンドの信託の限度額は、10兆円相当額とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

## &lt;ファンドの特色&gt;

1

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

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



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

2

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

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

**東証株価指数(TOPIX)について**

- ・ TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「株東京証券取引所」という。)の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。
- ・ 株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。
- ・ 株東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びTOPIXの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ・ 株東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
- ・ 当ファンドは、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。
- ・ 株東京証券取引所は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ・ 株東京証券取引所は、当社又は本件商品の購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- ・ 以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

**分配方針**

年2回の決算時(毎年1月、7月の8日)に収益分配を行います。

分配金額は、経費控除後の配当等収益の全額を原則とします。

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



## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類定義

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
国内	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
株式	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいいます。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分定義

株式・一般	大型株、中小型株の属性にあてはまらない全てのものをいいます。
年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
日本	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

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

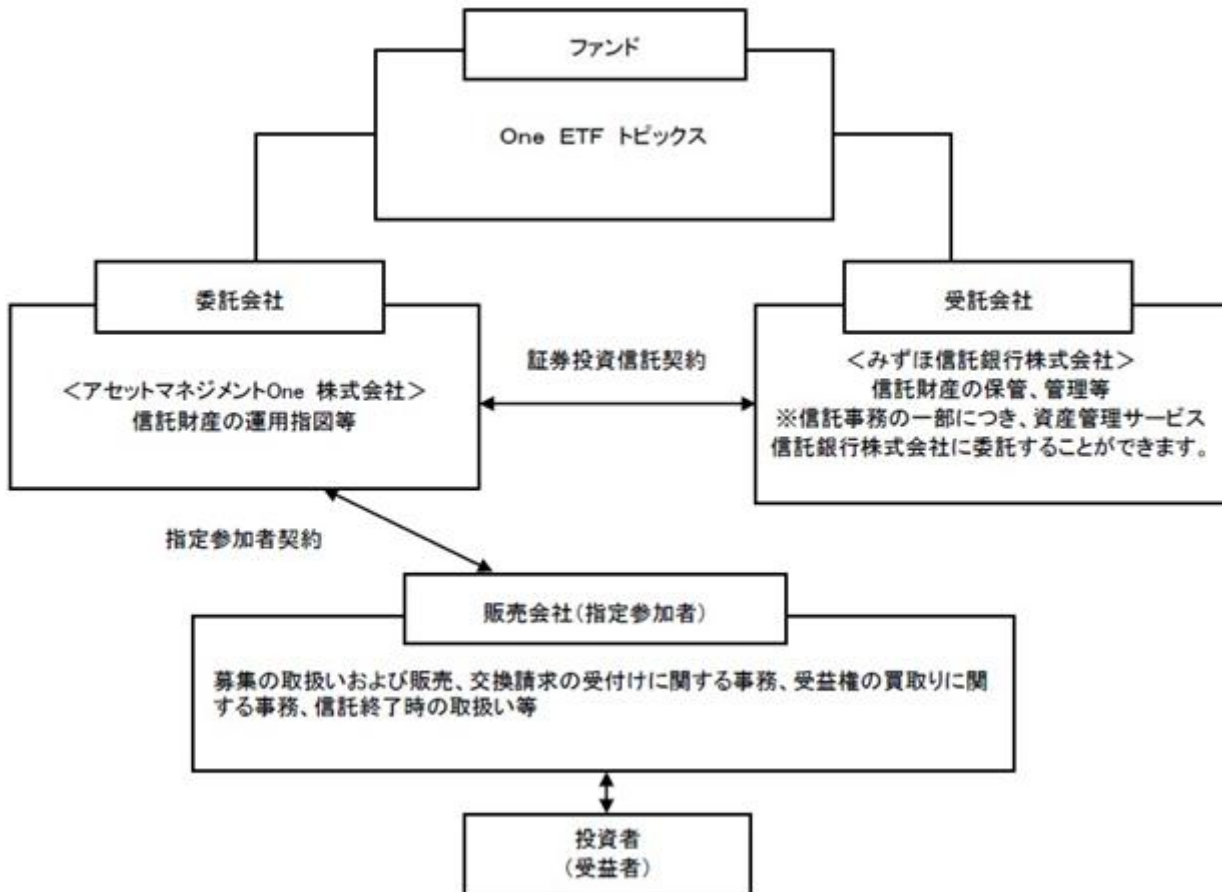
## (2) 【ファンドの沿革】

平成27年9月4日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

平成27年9月7日 ファンドの受益権を東京証券取引所へ上場

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】



- ・「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7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7月31日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

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

- この信託は、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象指数の変動率に一致させることを目的として、対象指数に採用されている銘柄（採用予定の銘柄を含みます。）の株式に対する投資として運用を行います。
- 信託財産中に占める個別銘柄の株数の比率は、対象指数における個別銘柄の時価総額構成比率から算出される株数の比率程度を維持することを原則とします。なお、対象指数から除外された銘柄は、市場動向等を勘案し速やかに売却することを基本としますが、当該銘柄の流動性等によっては、速やかに売却できない場合があります。
- 1.の方針に沿うよう、信託財産の構成を調整するための指図を行うこと、および補完的に有価証券指数等先物取引等を行うことができます。デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならび

に投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

4. 市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
5. 株式への投資割合には、制限を設けません。
6. 外貨建資産への投資は、行いません。
7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

## (2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第18条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項に定めるものをいいます。以下同じ。)とします。

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第24条に定めるものに限ります。)

ハ. 金銭債権

運用の指図範囲等(約款第19条第1項)

委託会社は信託財産を主として株式に投資することを指図します。

運用の指図範囲等(約款第19条第2項)

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

1. 預金

2. コール・ローン

## (3) 【運用体制】

## a. ファンドの運用体制



## 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

## 運用計画の決定

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

## 売買執行の実施

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

## モニタリング

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

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

#### 内部管理等のモニタリング

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

#### b．ファンドの関係法人に関する管理

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

#### c．運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は平成29年7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。

### （４）【分配方針】

#### 1 収益分配方針

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

経費控除後の配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）の全額を分配することを原則とします。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

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

#### 2 収益分配方式

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

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

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

### 3 収益分配金の支払い

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

### (5) 【投資制限】

株式への投資割合には、制限を設けません。(約款第21条)

外貨建資産への投資は、行いません。(約款第21条)

デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。(約款第21条)

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

投資する株式等の範囲(約款第23条)

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

2) 上記1)の規定にかかわらず、上場予定の株式で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができます。

先物取引等の運用指図(約款第24条)

委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)、有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします。

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第25条)



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

有価証券の貸付の指図および範囲（約款第26条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式を貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えない範囲内で貸付の指図をすることができます。
- 2) 上記1)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- 3) 委託会社は、株式の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

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

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

### 3【投資リスク】

#### < 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### 株価変動リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 流動性リスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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われた場合、または組入銘柄の配当金や権利処理等によって、信託財産に現金が発生すること
- ・先物を利用した場合、先物価格と同指数との間に価格差があること
- ・信託報酬等のコスト負担があること

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

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

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

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

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

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

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

#### ・注意事項

イ.当ファンドは、株式などの値動きのある有価証券に投資しますので、基準価額は変動します。

ロ.投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

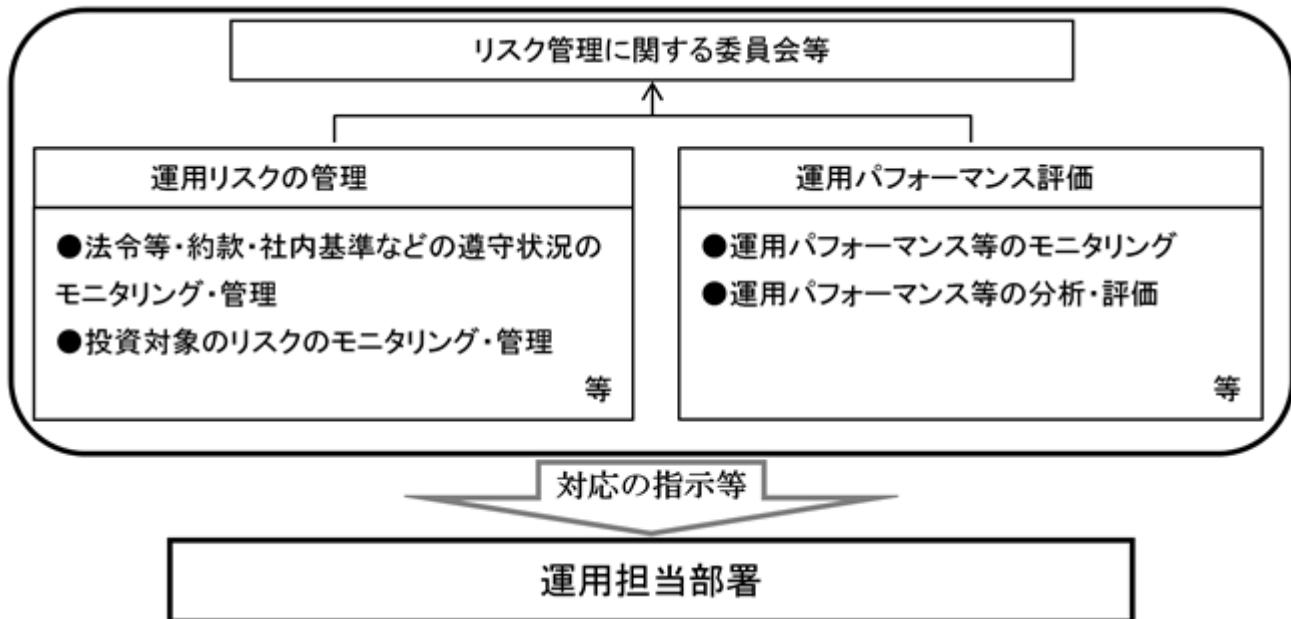
ハ.投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

ニ.投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。

#### <リスク管理体制>

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

- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



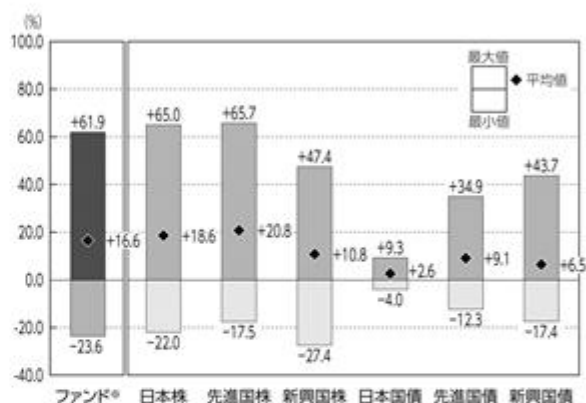
上記体制は平成29年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <参考情報>

### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2012年8月～2017年7月(2012年8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8月～2017年7月

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

\*ファンドの年間騰落率は、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、運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(配当込み、円ベース)
  - 新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
  - 日本国債…NOMURA-BPI国債
  - 先進国債…シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
  - 新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド(円ベース)
- (注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

- 「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- 「シティ世界国債インデックス(除く日本)」は、シティグループ・インデックスLLCが開発した債券指数で、日本を除く世界主要国の国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

販売会社が定める額とします。

消費税等相当額がかかります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

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

##### (2)【換金（解約）手数料】

販売会社が定める額とします。

消費税等相当額がかかります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

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

##### (3)【信託報酬等】

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

ただし、 により計算される額（税抜）と により計算される額（税抜）の合計額は、各計算期間においてファンドの純資産総額に対して年率0.25%（税抜）を乗じて得た額を超えないものとします。

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10月6日現在は、年率0.08424%（税抜0.078%）になります。配分は以下の通りです。

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.050%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
受託会社	年率0.028%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行、名義登録事務・分配金支払関係事務等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

信託報酬は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（４）【その他の手数料等】

信託財産留保額

ありません。

その他の費用

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

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

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

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

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

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

お申込時に要するその他の費用

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

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

平成29年10月6日現在。

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

## （５）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上特定株式投資信託として取扱われます。

### 個人の受益者に対する課税

#### 受益権の売却時

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

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

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

#### 収益分配時

収益分配金は配当所得として課税されます。

原則として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告により、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用あり）のいずれかを選択することもできます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記と同様の取扱いとなります。

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

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

特定株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入したETFなどから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設する（特定株式投資信託の場合、収益分配金の受取方法として、非課税口座を開設する金融機関等経由で受領する「株式数比例配分方式」を選択する必要があります。）など、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

### 法人の受益者に対する課税

#### 受益権の売却時

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

#### 収益分配金の受取り時

収益分配金については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率で源泉徴収されます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。なお、当ファンドは、原則として、益金不算入制度の適用が可能です。

#### 受益権と現物株式との交換時

受益権と現物株式との交換についても上記と同様の取扱いとなります。

上記は平成29年7月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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



## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

平成29年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	89,943,779,100	98.07
内 日本	89,943,779,100	98.07
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,771,338,277	1.93
純資産総額	91,715,117,377	100.00

## その他資産の投資状況

平成29年7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)	1,732,865,000	1.89
内 日本	1,732,865,000	1.89

(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7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	464,700	6,159.50 2,862,321,900	6,234.00 2,896,939,800	- -	3.16%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	2,858,700	753.39 2,153,735,400	700.00 2,001,090,000	- -	2.18%
3	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	302,800	5,292.79 1,602,659,300	5,390.00 1,632,092,000	- -	1.78%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	169,800	8,938.16 1,517,699,800	8,958.00 1,521,068,400	- -	1.66%
5	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	302,100	4,370.31 1,320,272,400	4,195.00 1,267,309,500	- -	1.38%
6	ソニー 日本	株式 電気機器	270,100	4,253.65 1,148,911,300	4,540.00 1,226,254,000	- -	1.34%
7	KDDI 日本	株式 情報・通信業	368,500	2,986.84 1,100,653,500	2,920.00 1,076,020,000	- -	1.17%
8	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	344,000	3,087.56 1,062,121,800	3,108.00 1,069,152,000	- -	1.17%
9	みずほフィナンシャルグルー プ 日本	株式 銀行業	5,122,500	205.77 1,054,076,730	196.40 1,006,059,000	- -	1.10%
10	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	237,400	3,861.81 916,794,400	3,834.00 910,191,600	- -	0.99%
11	キーエンス 日本	株式 電気機器	17,300	49,092.89 849,307,000	51,020.00 882,646,000	- -	0.96%
12	任天堂 日本	株式 その他製品	23,500	35,189.27 826,948,000	37,480.00 880,780,000	- -	0.96%
13	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	150,200	5,638.58 846,915,600	5,832.00 875,966,400	- -	0.96%
14	ファナック 日本	株式 電気機器	38,700	21,740.73 841,366,500	22,565.00 873,265,500	- -	0.95%
15	キヤノン 日本	株式 電気機器	205,800	3,657.29 752,672,000	3,837.00 789,654,600	- -	0.86%
16	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	73,900	10,654.38 787,359,000	10,350.00 764,865,000	- -	0.83%
17	信越化学工業 日本	株式 化学	71,800	9,950.87 714,472,900	10,110.00 725,898,000	- -	0.79%
18	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	277,700	2,649.46 735,757,100	2,563.00 711,745,100	- -	0.78%
19	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	151,900	4,754.34 722,185,500	4,645.00 705,575,500	- -	0.77%
20	セブン&アイ・ホールディ ングス 日本	株式 小売業	157,900	4,559.37 719,925,800	4,445.00 701,865,500	- -	0.77%

21	三菱電機 日本	株式 電気機器	407,700	1,658.92 676,343,600	1,710.50 697,370,850	- -	0.76%
22	日立製作所 日本	株式 電気機器	918,000	698.88 641,580,300	759.60 697,312,800	- -	0.76%
23	村田製作所 日本	株式 電気機器	40,100	16,687.61 669,173,500	17,180.00 688,918,000	- -	0.75%
24	三菱商事 日本	株式 卸売業	283,100	2,395.65 678,210,550	2,396.50 678,449,150	- -	0.74%
25	パナソニック 日本	株式 電気機器	439,000	1,466.60 643,841,600	1,521.00 667,719,000	- -	0.73%
26	花王 日本	株式 化学	94,000	6,653.19 625,399,898	6,714.00 631,116,000	- -	0.69%
27	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	135,100	4,798.49 648,276,800	4,657.00 629,160,700	- -	0.69%
28	ダイキン工業 日本	株式 機械	52,200	11,726.17 612,106,500	11,700.00 610,740,000	- -	0.67%
29	日本電産 日本	株式 電気機器	49,500	11,510.90 569,790,000	12,160.00 601,920,000	- -	0.66%
30	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	31,800	17,884.82 568,737,500	17,750.00 564,450,000	- -	0.62%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成29年7月31日現在

種類	投資比率
株式	98.07%
合計	98.07%

(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7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	13.15%
輸送用機器		8.52%
情報・通信業		7.84%
銀行業		7.59%
化学		6.93%
機械		5.14%
小売業		4.52%
食料品		4.47%
医薬品		4.45%
卸売業		4.35%
陸運業		4.01%
サービス業		3.78%
建設業		3.16%
保険業		2.43%
不動産業		2.35%
その他製品		2.09%
電気・ガス業		1.76%
精密機器		1.59%
鉄鋼		1.27%
その他金融業		1.25%
証券、商品先物取引業		1.07%
ガラス・土石製品		0.97%
非鉄金属		0.96%
ゴム製品		0.94%
繊維製品		0.69%
金属製品		0.69%
空運業		0.56%
石油・石炭製品		0.49%
鉱業		0.30%
パルプ・紙		0.25%
海運業		0.21%
倉庫・運輸関連業	0.19%	
水産・農林業	0.11%	
合計	98.07%	

(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7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 2909月	買建	107	1,720,753,888	1,732,865,000	1.89%

(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7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)	東京証券取引所 市場相場
第1計算期間末 (平成28年1月8日)	40,584	40,937	1,447.21	1,459.81	1,450
第2計算期間末 (平成28年7月8日)	44,899	45,464	1,208.07	1,223.27	
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
第4計算期間末 (平成29年7月8日)	91,052	91,952	1,608.21	1,624.11	1,606
平成28年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
2月末日	86,643	-	1,535.59	-	1,545
3月末日	83,236	-	1,526.26	-	1,553
4月末日	85,847	-	1,545.83	-	1,550
5月末日	92,686	-	1,583.50	-	1,583
6月末日	87,375	-	1,629.05	-	-
7月末日	91,715	-	1,619.76	-	1,620

(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
第4計算期間	15.90

## 【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
第4計算期間	4.6

(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
第4計算期間	51,843,900	31,648,350

(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7月31日

## 基準価額・純資産の推移

(2015年9月4日～2017年7月31日)



※基準価額は100口当たり・信託報酬控除後の価額です。設定当初の投資元本は147,500円(100口当たり)です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2015年9月4日)

※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

## 分配の推移(税引前)

第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
第4期 (2017.07.08)	1,590円
設定来累計	5,650円

※分配金は100口当たりです。

## 主要な資産の状況

※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	98.07
内 日本	98.07
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.93
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)	1.89

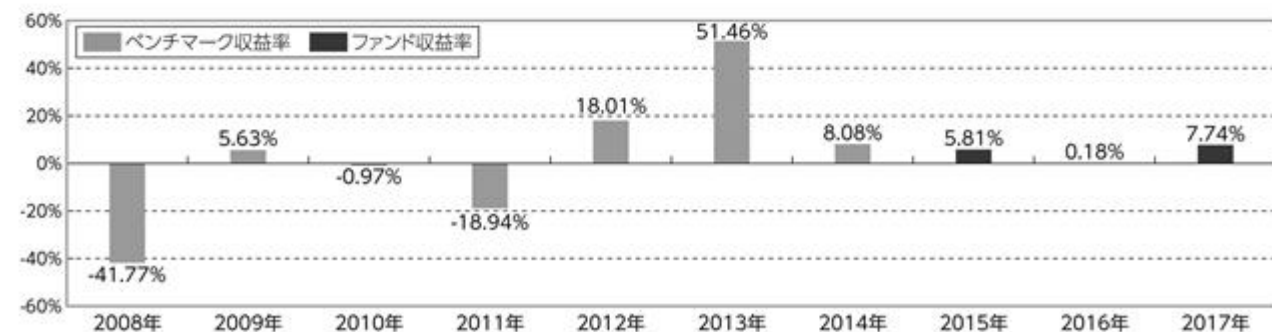
## 組入上位5業種(国内株式)

順位	業種	投資比率
1	電気機器	13.15%
2	輸送用機器	8.52%
3	情報・通信業	7.84%
4	銀行業	7.59%
5	化学	6.93%

## 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	3.16%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.18%
3	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.78%
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.66%
5	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.38%
6	ソニー	株式	日本	電気機器	1.34%
7	KDDI	株式	日本	情報・通信業	1.17%
8	本田技研工業	株式	日本	輸送用機器	1.17%
9	みずほフィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.10%
10	日本たばこ産業	株式	日本	食料品	0.99%

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※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、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。



## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### ・お申込の受付

取得申込みの受付は原則として販売会社の毎営業日に行われます。

取得申込みの受付は原則として正午までにお申込みが行われ、かつ、取得申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとして取扱います。

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

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

#### ・お申込単位

1ユニット以上1ユニット単位とします。

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

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

#### ・お申込価額

取得申込受付日の基準価額 とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。当ファンドの基準価額は100口当たりで表示されます。

#### < 基準価額の照会方法等 >

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

#### ・お申込方法

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

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

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

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに、原則として取得申込のユニット数に応じた現物株式ポートフォリオおよび金銭（現物株式ポートフォリオ等）を販売会社に引き渡すものとします。

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

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

#### ・ 申込手数料

販売会社が定める額とします。

消費税等相当額がかかります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。販売会社は、以下の方法でご確認ください。

#### ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

#### ・ その他

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

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

なお、販売会社は、当該取得申込みにかかる現物株式ポートフォリオ等の受渡しまたは支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載

または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託にかかる現物株式ポートフォリオ等について受入れまたは振替済の通知を受けた場合には、振替機関に対し追加信託が行われた旨を通知するものとします。

## 2【換金(解約)手続等】

### ・解約の受付

解約の請求はできません。

### ・交換の受付

受益者は、毎営業日、自己に帰属する受益権と信託財産に属する有価証券との交換(「交換」といいます。)を請求できます。受益者が交換の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

交換請求の受付は、原則として正午までに交換請求が行われ、かつ、交換請求の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当該交換請求受付日の請求として取扱います。

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

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

### ・交換単位

委託会社が定める口数(最小交換口数)の整数倍とします。

「最小交換口数」は、委託会社が交換請求受付日の3営業日前までに提示します。

### ・交換価額

交換にかかる受益権の評価額は交換請求受付日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額(ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額)を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。

### <基準価額の照会方法等>

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

#### ・交換の方法

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

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

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

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

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

#### ・交換手数料

販売会社が定める額とします。

消費税等相当額がかかります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。販売会社は、以下の方法でご確認ください。

##### ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

#### ・その他

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

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

#### ・買取り

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

買取請求の受付は、原則として販売会社の定める時刻までに買取請求が行われ、かつ、買取請求の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の買取請求受付分とします。

ただし、2.の場合の請求は、信託終了日の2営業日前までとします。

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

受益権の買取価額は、買取請求の受付日の基準価額とします。

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

販売会社は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて受益権の買取りを停止することおよびすでに受け付けた受益権の買取りを取り消すことができます。

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

## &lt;主な投資対象の時価評価方法の原則&gt;

投資対象	評価方法
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場

なお、当ファンドの基準価額は100口当たりで表示されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

## (2)【保管】

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、受益証券を発行しませんので、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

## (3)【信託期間】

信託期間は、平成27年9月4日から無期限です。

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

## (4)【計算期間】

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

## (5)【その他】

## イ.償還規定

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

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

- c. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- d. 上記c.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本d.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- e. 上記c.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- f. 上記c.からe.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記c.からe.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- g. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- h. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- i. 受託会社は委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- j. 信託契約の解約を行う場合には、書面決議において当該解約に反対した受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続きに関する事項は、上記c.に規定する書面に付記します。

#### ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、上記a.の事項(上記a.の変更事項にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a.からf.の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがい約款を変更します。
- i. 重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続に関する事項は、上記b.に規定する書面に付記します。

## 八．関係法人との契約の更改

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

## 二．公告

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

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金に対する請求権および名義登録

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

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

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



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

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

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

## (2) 信託終了時の交換請求権

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

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

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

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

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

(3) 交換請求権および買取請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(平成29年1月9日から平成29年7月8日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。
- (4) 平成29年4月5日に当ファンドの名称を「DIAM ETF トピックス」から「One ETF トピックス」へと変更しております。

## 1【財務諸表】

## One ETF トピックス

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 平成29年1月8日現在	第4期 平成29年7月8日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,364,443,453	2,343,812,243
株式	55,557,455,993	89,496,710,140
派生商品評価勘定	42,489,264	5,937,136
未収入金	24,651,238	4,612,912
未収配当金	73,244,312	99,614,641
前払金	-	464,190
差入委託証拠金	60,599,544	77,470,752
流動資産合計	57,122,883,804	92,028,622,014
資産合計	57,122,883,804	92,028,622,014
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,503,240
前受金	69,829,544	16,895,752
未払収益分配金	466,200,793	900,218,043
未払受託者報酬	7,692,926	12,757,263
未払委託者報酬	13,737,398	22,780,865
未払利息	6,064	5,239
その他未払費用	8,198,295	21,809,164
流動負債合計	565,665,020	975,969,566
負債合計	565,665,020	975,969,566
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 53,722,357,075	1 83,510,793,325
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,834,861,709	7,541,859,123
（分配準備積立金）	2,999,118	4,548,744
元本等合計	56,557,218,784	91,052,652,448
純資産合計	56,557,218,784	91,052,652,448
負債純資産合計	57,122,883,804	92,028,622,014

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自	平成28年7月9日 平成29年1月8日	自	平成29年1月9日 平成29年7月8日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		498,195,945		955,059,351
受取利息		741		177
有価証券売買等損益		13,110,199,333		3,377,604,659
派生商品取引等損益		216,967,184		99,798,016
その他収益		563,245		633,817
<b>営業収益合計</b>		<b>13,825,926,448</b>		<b>4,433,096,020</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		282,126		527,401
受託者報酬		7,692,926		12,757,263
委託者報酬		13,737,398		22,780,865
その他費用		11,252,084		17,860,147
<b>営業費用合計</b>		<b>32,964,534</b>		<b>53,925,676</b>
営業利益又は営業損失（ ）		13,792,961,914		4,379,170,344
経常利益又は経常損失（ ）		13,792,961,914		4,379,170,344
当期純利益又は当期純損失（ ）		13,792,961,914		4,379,170,344
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（ ）		9,920,938,128		2,834,861,709
剰余金増加額又は欠損金減少額		198,935,720		4,245,881,143
当期一部交換に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		198,935,720		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		4,245,881,143
剰余金減少額又は欠損金増加額		769,897,004		3,017,836,030
当期一部交換に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		3,017,836,030
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		769,897,004		-
分配金		2,466,200,793		2,900,218,043
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		<b>2,834,861,709</b>		<b>7,541,859,123</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3期 平成29年1月8日現在	第4期 平成29年7月8日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部交換元本額	54,820,314,625円 36,789,450,000円 37,887,407,550円	53,722,357,075円 76,469,752,500円 46,681,316,250円
2. 受益権の総数	36,421,937口	56,617,487口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期	第4期
	自 平成28年7月9日 至 平成29年1月8日	自 平成29年1月9日 至 平成29年7月8日
1. 1 その他費用	その他費用の内訳は、監査費用(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。	その他費用の内訳は、監査費用(408,569円)、ライセンス料(14,039,030円)、その他(3,412,548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(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。	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(955,165,944円)及び分配準備積立金(2,999,118円)の合計額から、経費(53,398,275円)を控除して計算される分配対象額は904,766,787円(100口当たり1,598円)であり、うち900,218,043円(100口当たり1,590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3期	第4期
	自 平成28年7月9日 至 平成29年1月8日	自 平成29年1月9日 至 平成29年7月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用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3期 平成29年1月8日現在	第4期 平成29年7月8日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第3期 平成29年1月8日現在	第4期 平成29年7月8日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	7,369,863,321	2,792,521,978
合計	7,369,863,321	2,792,521,978

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	第3期 平成29年1月8日 現在				第4期 平成29年7月8日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	948,530,000	-	991,040,000	42,510,000	1,538,255,000	-	1,542,720,000	4,465,000
合計	948,530,000	-	991,040,000	42,510,000	1,538,255,000	-	1,542,720,000	4,465,000

## （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3期 平成29年1月8日現在	第4期 平成29年7月8日現在
	1口当たり純資産額 （100口当たり純資産額）	1,552.83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7月8日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	1,700	3,110.00	5,287,000	
日本水産	55,600	633.00	35,194,800	
マルハニチロ	8,100	2,925.00	23,692,500	
ハウスイ	3,000	125.00	375,000	
カネコ種苗	1,500	1,449.00	2,173,500	
サカタのタネ	6,300	3,560.00	22,428,000	
ホクト	4,400	1,967.00	8,654,800	
ホクリヨウ	600	1,046.00	627,600	
ショーボンドホールディングス	4,100	5,670.00	23,247,000	
ミライト・ホールディングス	13,200	1,292.00	17,054,400	
タマホーム	3,200	633.00	2,025,600	
サンヨーホームズ	900	637.00	573,300	
ファーストコーポレーション	900	1,083.00	974,700	
インベスターズクラウド	500	5,840.00	2,920,000	
住石ホールディングス	11,900	100.00	1,190,000	
日鉄鉱業	1,200	6,060.00	7,272,000	
三井松島産業	2,600	1,430.00	3,718,000	
国際石油開発帝石	225,400	1,069.00	240,952,600	
日本海洋掘削	1,500	2,202.00	3,303,000	
石油資源開発	6,800	2,296.00	15,612,800	
K&Oエナジーグループ	2,900	1,775.00	5,147,500	
ダイセキ環境ソリューション	1,200	1,341.00	1,609,200	
安藤・間	30,700	728.00	22,349,600	
東急建設	15,200	897.00	13,634,400	
コムシスホールディングス	16,700	2,300.00	38,410,000	
ミサワホーム	5,100	1,008.00	5,140,800	
ビーアールホールディングス	4,200	381.00	1,600,200	
高松コンストラクショングループ	3,200	2,789.00	8,924,800	
東建コーポレーション	1,600	13,630.00	21,808,000	
ソネック	500	825.00	412,500	
ヤマウラ	2,000	954.00	1,908,000	
大成建設	218,000	1,034.00	225,412,000	
大林組	128,300	1,310.00	168,073,000	
清水建設	130,900	1,196.00	156,556,400	
飛島建設	41,200	170.00	7,004,000	
長谷工コーポレーション	49,900	1,375.00	68,612,500	
松井建設	4,700	869.00	4,084,300	
銭高組	6,000	443.00	2,658,000	
鹿島建設	188,000	960.00	180,480,000	
不動テトラ	34,500	187.00	6,451,500	
大末建設	1,500	1,015.00	1,522,500	
鉄建建設	26,000	339.00	8,814,000	
西松建設	49,000	613.00	30,037,000	

三井住友建設	164,000	122.00	20,008,000
大豊建設	16,000	549.00	8,784,000
前田建設工業	28,000	1,302.00	36,456,000
佐田建設	2,900	437.00	1,267,300
ナカノフード建設	3,300	633.00	2,088,900
奥村組	35,000	751.00	26,285,000
東鉄工業	5,100	3,360.00	17,136,000
イチケン	4,000	406.00	1,624,000
浅沼組	15,000	340.00	5,100,000
戸田建設	50,000	709.00	35,450,000
熊谷組	67,000	364.00	24,388,000
青木あすなろ建設	2,800	869.00	2,433,200
北野建設	9,000	326.00	2,934,000
植木組	5,000	272.00	1,360,000
三井ホーム	6,000	717.00	4,302,000
矢作建設工業	5,800	914.00	5,301,200
ピーエス三菱	4,500	488.00	2,196,000
日本ハウスホールディングス	8,700	523.00	4,550,100
大東建託	15,500	17,905.00	277,527,500
新日本建設	5,100	932.00	4,753,200
N I P P O	10,000	2,251.00	22,510,000
東亜道路工業	8,000	461.00	3,688,000
前田道路	13,000	2,321.00	30,173,000
日本道路	13,000	595.00	7,735,000
東亜建設工業	3,500	1,769.00	6,191,500
若築建設	25,000	178.00	4,450,000
東洋建設	12,300	447.00	5,498,100
五洋建設	47,500	638.00	30,305,000
大林道路	4,000	940.00	3,760,000
世紀東急工業	6,200	589.00	3,651,800
福田組	1,400	5,180.00	7,252,000
日本ドライケミカル	500	2,356.00	1,178,000
住友林業	29,500	1,735.00	51,182,500
日本基礎技術	4,800	365.00	1,752,000
日成ビルド工業	13,000	620.00	8,060,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	22,000	85.00	1,870,000
巴コーポレーション	5,300	362.00	1,918,600
パナホーム	8,000	1,201.00	9,608,000
大和ハウス工業	126,400	3,780.00	477,792,000
ライト工業	8,200	1,161.00	9,520,200
積水ハウス	131,000	1,965.50	257,480,500
日特建設	3,600	590.00	2,124,000
北陸電気工事	2,100	933.00	1,959,300
ユアテック	7,000	765.00	5,355,000
西部電気工業	700	2,368.00	1,657,600
四電工	3,000	550.00	1,650,000
中電工	4,800	2,924.00	14,035,200
関電工	17,000	1,132.00	19,244,000
きんでん	28,500	1,819.00	51,841,500
東京エネシス	4,400	1,037.00	4,562,800

トーエネック	6,000	719.00	4,314,000
住友電設	3,000	1,622.00	4,866,000
日本電設工業	6,600	2,234.00	14,744,400
協和エクシオ	16,800	1,878.00	31,550,400
新日本空調	3,300	1,521.00	5,019,300
日本工営	2,700	3,115.00	8,410,500
N D S	700	3,085.00	2,159,500
九電工	8,400	4,225.00	35,490,000
三機工業	9,100	1,242.00	11,302,200
日揮	39,900	1,849.00	73,775,100
中外炉工業	13,000	224.00	2,912,000
ヤマト	3,800	662.00	2,515,600
太平電業	6,000	1,348.00	8,088,000
高砂熱学工業	11,800	1,825.00	21,535,000
三晃金属工業	400	3,330.00	1,332,000
N E C ネットズエスアイ	4,100	2,482.00	10,176,200
朝日工業社	1,000	3,085.00	3,085,000
明星工業	7,700	676.00	5,205,200
大気社	5,700	2,933.00	16,718,100
ダイダン	6,000	1,467.00	8,802,000
日比谷総合設備	4,800	1,916.00	9,196,800
東芝プラントシステム	6,900	1,849.00	12,758,100
日本製粉	12,700	1,746.00	22,174,200
日清製粉グループ本社	46,900	1,786.00	83,763,400
日東富士製粉	300	3,935.00	1,180,500
昭和産業	18,000	599.00	10,782,000
鳥越製粉	3,400	798.00	2,713,200
中部飼料	4,700	1,433.00	6,735,100
フィード・ワン	25,700	221.00	5,679,700
東洋精糖	6,000	116.00	696,000
日本甜菜製糖	2,200	2,145.00	4,719,000
三井製糖	3,000	3,180.00	9,540,000
塩水港精糖	4,600	243.00	1,117,800
日新製糖	1,800	1,861.00	3,349,800
L I F U L L	9,900	935.00	9,256,500
ジェイエイシーリクルートメント	2,400	1,842.00	4,420,800
日本M&Aセンター	11,500	4,055.00	46,632,500
メンバーズ	1,000	688.00	688,000
中広	400	748.00	299,200
タケエイ	3,500	1,074.00	3,759,000
トラスト・テック	1,600	2,266.00	3,625,600
コシダカホールディングス	1,900	3,085.00	5,861,500
パソナグループ	3,000	1,018.00	3,054,000
C D S	900	1,287.00	1,158,300
リンクアンドモチベーション	9,400	758.00	7,125,200
G C A	3,500	1,042.00	3,647,000
エス・エム・エス	5,700	3,315.00	18,895,500
パーソルホールディングス	30,900	2,078.00	64,210,200
リニカル	2,300	1,714.00	3,942,200
クックパッド	8,900	908.00	8,081,200

エスクリ	1,400	726.00	1,016,400
アイ・ケイ・ケイ	1,800	786.00	1,414,800
森永製菓	8,400	6,290.00	52,836,000
中村屋	1,000	5,010.00	5,010,000
江崎グリコ	10,700	6,000.00	64,200,000
名糖産業	1,800	1,438.00	2,588,400
不二家	2,400	2,440.00	5,856,000
山崎製パン	31,300	2,195.00	68,703,500
第一屋製パン	700	1,217.00	851,900
モロゾフ	7,000	642.00	4,494,000
亀田製菓	2,400	5,410.00	12,984,000
寿スピリッツ	4,100	3,530.00	14,473,000
カルビー	17,500	4,270.00	74,725,000
森永乳業	38,000	857.00	32,566,000
六甲バター	1,900	2,585.00	4,911,500
ヤクルト本社	22,900	7,520.00	172,208,000
明治ホールディングス	25,300	8,940.00	226,182,000
雪印メグミルク	9,200	3,155.00	29,026,000
プリマハム	27,000	648.00	17,496,000
日本ハム	30,000	3,330.00	99,900,000
林兼産業	1,400	838.00	1,173,200
丸大食品	20,000	513.00	10,260,000
S Foods	2,300	4,130.00	9,499,000
伊藤ハム米久ホールディングス	24,700	1,000.00	24,700,000
学情	1,700	1,278.00	2,172,600
スタジオアリス	1,600	2,406.00	3,849,600
シミックホールディングス	2,000	1,492.00	2,984,000
システナ	3,000	2,185.00	6,555,000
N J S	900	1,363.00	1,226,700
デジタルアーツ	1,700	3,880.00	6,596,000
新日鉄住金ソリューションズ	5,900	2,555.00	15,074,500
総合警備保障	14,500	4,940.00	71,630,000
キューブシステム	2,200	847.00	1,863,400
いちご	35,800	336.00	12,028,800
日本駐車場開発	45,400	163.00	7,400,200
コア	1,600	1,463.00	2,340,800
カカクコム	28,000	1,636.00	45,808,000
アイロムグループ	1,200	1,545.00	1,854,000
セントケア・ホールディング	500	1,666.00	833,000
サイネックス	400	1,001.00	400,400
ルネサンス	2,000	1,980.00	3,960,000
ディップ	5,100	2,289.00	11,673,900
S B Sホールディングス	3,800	870.00	3,306,000
オプトホールディング	2,900	1,390.00	4,031,000
新日本科学	4,400	681.00	2,996,400
ツクイ	9,500	674.00	6,403,000
キャリアデザインセンター	800	1,431.00	1,144,800
エムスリー	34,600	3,015.00	104,319,000
ツカダ・グローバルホールディング	2,900	603.00	1,748,700
プラス	200	1,125.00	225,000

アウトソーシング	2,600	5,120.00	13,312,000
ウェルネット	3,000	1,337.00	4,011,000
ワールドホールディングス	1,200	2,671.00	3,205,200
ディー・エヌ・エー	17,900	2,596.00	46,468,400
博報堂DYホールディングス	55,300	1,455.00	80,461,500
ぐるなび	5,800	1,795.00	10,411,000
エスアールジータカミヤ	4,300	553.00	2,377,900
ジャパンベストレスキューシステム	4,500	279.00	1,255,500
ファンコミュニケーションズ	10,100	970.00	9,797,000
ライク	700	3,165.00	2,215,500
ビジネス・ブレークスルー	1,700	388.00	659,600
WDBホールディングス	1,400	2,180.00	3,052,000
ティア	1,900	776.00	1,474,400
CDG	300	1,805.00	541,500
バリューコマース	3,700	680.00	2,516,000
インフォマート	16,900	800.00	13,520,000
サッポロホールディングス	14,000	3,095.00	43,330,000
アサヒグループホールディングス	80,300	4,352.00	349,465,600
麒麟ホールディングス	184,300	2,325.00	428,497,500
宝ホールディングス	31,000	1,163.00	36,053,000
オエノンホールディングス	10,900	283.00	3,084,700
養命酒製造	1,300	2,087.00	2,713,100
コカ・コーラボトラーズジャパン	27,000	3,365.00	90,855,000
サントリー食品インターナショナル	29,300	5,210.00	152,653,000
ダイドーグループホールディングス	2,000	5,670.00	11,340,000
伊藤園	12,700	4,090.00	51,943,000
キーコーヒー	3,800	2,187.00	8,310,600
ユニカフェ	1,200	980.00	1,176,000
ジャパンフーズ	500	1,372.00	686,000
日清オイリオグループ	25,000	645.00	16,125,000
不二製油グループ本社	11,400	2,547.00	29,035,800
かどや製油	400	4,985.00	1,994,000
J-オイルミルズ	2,000	3,890.00	7,780,000
ローソン	11,900	7,350.00	87,465,000
サンエー	2,800	4,720.00	13,216,000
カワチ薬品	2,900	2,672.00	7,748,800
エービーシー・マート	6,900	6,400.00	44,160,000
ハードオフコーポレーション	1,700	1,120.00	1,904,000
高千穂交易	1,400	1,069.00	1,496,600
アスクル	3,900	3,680.00	14,352,000
ゲオホールディングス	6,300	1,163.00	7,326,900
アダストリア	5,800	2,799.00	16,234,200
ジーフット	2,300	793.00	1,823,900
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	500	771.00	385,500
伊藤忠食品	900	4,635.00	4,171,500
くらコーポレーション	2,500	5,260.00	13,150,000
キャンドゥ	2,000	1,683.00	3,366,000
エレマテック	1,500	1,836.00	2,754,000
パルグループホールディングス	1,900	2,846.00	5,407,400
JALUX	1,200	2,702.00	3,242,400

エディオン	14,600	997.00	14,556,200
あらた	1,700	3,830.00	6,511,000
サーラコーポレーション	4,700	765.00	3,595,500
ワッツ	1,500	1,277.00	1,915,500
トーメンデバイス	600	2,205.00	1,323,000
ハローズ	1,200	2,310.00	2,772,000
J Pホールディングス	11,500	295.00	3,392,500
あみやき亭	700	4,125.00	2,887,500
東京エレクトロン デバイス	1,400	1,676.00	2,346,400
ひらまつ	5,200	645.00	3,354,000
フィールズ	2,900	1,195.00	3,465,500
双日	222,600	281.00	62,550,600
ゲンキー	1,500	3,060.00	4,590,000
アルフレッサ ホールディングス	44,600	2,107.00	93,972,200
大黒天物産	900	5,540.00	4,986,000
ハニーズホールディングス	3,600	1,176.00	4,233,600
ファーマライズホールディングス	900	527.00	474,300
キッコーマン	29,900	3,510.00	104,949,000
味の素	88,200	2,365.50	208,637,100
キュービー	21,800	2,781.00	60,625,800
ハウス食品グループ本社	15,800	2,773.00	43,813,400
カゴメ	15,400	3,315.00	51,051,000
焼津水産化学工業	2,000	1,180.00	2,360,000
アリアケジャパン	3,500	7,650.00	26,775,000
ピエトロ	500	1,630.00	815,000
エバラ食品工業	1,000	2,050.00	2,050,000
ニチレイ	19,900	3,125.00	62,187,500
横浜冷凍	8,900	1,057.00	9,407,300
東洋水産	21,000	4,190.00	87,990,000
イートアンド	500	2,290.00	1,145,000
大冷	400	1,820.00	728,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	100	2,931.00	293,100
日清食品ホールディングス	16,700	6,930.00	115,731,000
永谷園ホールディングス	4,000	1,396.00	5,584,000
一正蒲鉾	1,500	1,282.00	1,923,000
フジッコ	4,100	2,519.00	10,327,900
ロック・フィールド	4,100	1,850.00	7,585,000
日本たばこ産業	237,200	3,862.00	916,066,400
ケンコーマヨネーズ	2,300	3,165.00	7,279,500
わらべや日洋ホールディングス	2,500	2,955.00	7,387,500
なとり	2,100	2,057.00	4,319,700
イフジ産業	700	746.00	522,200
北の達人コーポレーション	1,800	839.00	1,510,200
ユーグレナ	14,800	1,179.00	17,449,200
片倉工業	5,000	1,312.00	6,560,000
グンゼ	30,000	403.00	12,090,000
ヒューリック	78,600	1,132.00	88,975,200
神栄	5,000	168.00	840,000
山下医科器械	300	1,786.00	535,800
ラサ商事	1,600	965.00	1,544,000



アルペン	2,900	1,953.00	5,663,700
ラクーン	2,400	652.00	1,564,800
クオール	4,300	1,688.00	7,258,400
アルコニックス	2,100	1,985.00	4,168,500
神戸物産	2,000	5,110.00	10,220,000
ジーンズ	2,600	6,050.00	15,730,000
ピックカメラ	21,600	1,168.00	25,228,800
DCMホールディングス	22,900	960.00	21,984,000
MonotaRO	13,400	3,505.00	46,967,000
東京一番フーズ	900	579.00	521,100
ダイヤモンドダイニング	800	2,196.00	1,756,800
あいホールディングス	5,400	2,937.00	15,859,800
ディーブイエックス	1,300	1,291.00	1,678,300
きちり	1,000	667.00	667,000
アークランドサービスホールディングス	3,100	1,868.00	5,790,800
J.フロントリテイリング	47,700	1,630.00	77,751,000
ドトール・日レスホールディングス	6,600	2,387.00	15,754,200
マツモトキヨシホールディングス	7,100	6,320.00	44,872,000
ブロンコビリー	2,000	2,607.00	5,214,000
スタートトゥデイ	34,400	2,706.00	93,086,400
トレジャー・ファクトリー	1,100	798.00	877,800
物語コーポレーション	1,100	5,600.00	6,160,000
ココカラファイン	3,900	5,360.00	20,904,000
三越伊勢丹ホールディングス	75,000	1,108.00	83,100,000
東洋紡	158,000	210.00	33,180,000
ユニチカ	110,000	83.00	9,130,000
富士紡ホールディングス	1,900	3,310.00	6,289,000
日清紡ホールディングス	21,200	1,147.00	24,316,400
倉敷紡績	40,000	264.00	10,560,000
ダイワボウホールディングス	32,000	405.00	12,960,000
シキボウ	22,000	149.00	3,278,000
日東紡績	32,000	589.00	18,848,000
トヨタ紡織	13,400	2,239.00	30,002,600
マクニカ・富士エレホールディングス	7,000	1,632.00	11,424,000
Hamee	1,100	1,603.00	1,763,300
ウエルシアホールディングス	9,900	4,035.00	39,946,500
クリエイトSDホールディングス	5,500	2,517.00	13,843,500
パイタルケーエスケー・ホールディングス	7,100	893.00	6,340,300
八洲電機	2,900	800.00	2,320,000
メディアスホールディングス	600	3,000.00	1,800,000
UKCホールディングス	2,400	1,887.00	4,528,800
丸善CHIホールディングス	4,400	364.00	1,601,600
大光	900	1,127.00	1,014,300
OCHIホールディングス	1,100	1,330.00	1,463,000
TOKAIホールディングス	16,600	829.00	13,761,400
ミサワ	700	451.00	315,700
ティーライフ	500	1,704.00	852,000
大阪工機	600	800.00	480,000

エー・ピーカンパニー	600	890.00	534,000	
三洋貿易	2,100	2,656.00	5,577,600	
チムニー	1,100	2,802.00	3,082,200	
シュッピン	1,400	2,054.00	2,875,600	
ビューティガレージ	500	1,551.00	775,500	
ウイン・パートナーズ	2,700	1,293.00	3,491,100	
ネクステージ	1,500	1,913.00	2,869,500	
ジョイフル本田	6,100	3,215.00	19,611,500	
鳥貴族	1,400	2,550.00	3,570,000	
キリン堂ホールディングス	1,200	990.00	1,188,000	
ホットランド	1,700	1,381.00	2,347,700	
すかいらく	16,300	1,665.00	27,139,500	
綿半ホールディングス	1,500	2,387.00	3,580,500	
日本毛織	11,300	932.00	10,531,600	
ダイトウボウ	5,000	75.00	375,000	
トーア紡コーポレーション	1,700	552.00	938,400	
ダイドーリミテッド	4,500	438.00	1,971,000	
ヨシックス	500	1,638.00	819,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	12,500	1,080.00	13,500,000	
三栄建築設計	1,500	1,750.00	2,625,000	
野村不動産ホールディングス	25,000	2,192.00	54,800,000	
三重交通グループホールディングス	6,700	389.00	2,606,300	
サムティ	3,000	1,208.00	3,624,000	
ディア・ライフ	3,400	423.00	1,438,200	
日本商業開発	2,100	1,651.00	3,467,100	
プレサンスコーポレーション	5,800	1,530.00	8,874,000	
ユニゾホールディングス	3,100	2,575.00	7,982,500	
THEグローバル社	1,800	540.00	972,000	
日本管理センター	2,700	1,433.00	3,869,100	
サンセイランディック	800	766.00	612,800	
エストラスト	700	706.00	494,200	
フージャースホールディングス	4,900	979.00	4,797,100	
オープンハウス	6,100	3,455.00	21,075,500	
東急不動産ホールディングス	91,200	654.00	59,644,800	
飯田グループホールディングス	31,400	1,849.00	58,058,600	
ムゲンエステート	1,700	922.00	1,567,400	
帝国繊維	4,200	1,938.00	8,139,600	
ブックオフコーポレーション	2,100	793.00	1,665,300	
日本コークス工業	32,300	98.00	3,165,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,500	788.00	1,182,000	
ミタチ産業	900	654.00	588,600	
B E E N O S	600	1,418.00	850,800	
あさひ	2,800	1,314.00	3,679,200	
日本調剤	1,300	3,520.00	4,576,000	
コスモス薬品	1,900	21,560.00	40,964,000	
シップヘルスケアホールディングス	7,200	3,395.00	24,444,000	
トーエル	1,800	901.00	1,621,800	
一六堂	800	391.00	312,800	
ソフトクリエイイトホールディングス	1,800	1,449.00	2,608,200	

オンリー	600	823.00	493,800	
セブン&アイ・ホールディングス	157,800	4,560.00	719,568,000	
葉王堂	1,900	2,929.00	5,565,100	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	10,100	1,013.00	10,231,300	
明治電機工業	1,300	1,332.00	1,731,600	
ツルハホールディングス	7,500	11,670.00	87,525,000	
デリカフーズ	800	1,674.00	1,339,200	
スターティア	900	657.00	591,300	
サンマルクホールディングス	2,400	3,405.00	8,172,000	
フェリシモ	1,100	1,143.00	1,257,300	
トリドールホールディングス	4,600	2,849.00	13,105,400	
帝人	32,700	2,178.00	71,220,600	
東レ	290,200	956.90	277,692,380	
クラレ	67,300	2,119.00	142,608,700	
旭化成	249,000	1,201.00	299,049,000	
サカイオーベックス	900	1,787.00	1,608,300	
TOKYO BASE	500	5,010.00	2,505,000	
稲葉製作所	2,100	1,453.00	3,051,300	
宮地エンジニアリンググループ	11,000	262.00	2,882,000	
トーカロ	2,600	3,770.00	9,802,000	
アルファ	1,300	2,413.00	3,136,900	
SUMCO	41,700	1,730.00	72,141,000	
川田テクノロジーズ	800	7,590.00	6,072,000	
RS Technologies	400	3,885.00	1,554,000	
ファーストブラザーズ	500	1,493.00	746,500	
ハウズドゥ	600	1,651.00	990,600	
シーアールイー	600	1,501.00	900,600	
ケイアイスター不動産	1,000	2,040.00	2,040,000	
住江織物	11,000	274.00	3,014,000	
日本フェルト	2,300	507.00	1,166,100	
イチカワ	3,000	311.00	933,000	
エコナックホールディングス	14,000	71.00	994,000	
日東製網	400	1,854.00	741,600	
芦森工業	9,000	349.00	3,141,000	
アツギ	33,000	127.00	4,191,000	
コメダホールディングス	6,800	1,819.00	12,369,200	
サツドラホールディングス	500	1,967.00	983,500	
ダイユー・リックホールディングス	1,200	794.00	952,800	
バロックジャパンリミテッド	3,000	1,225.00	3,675,000	
クスリのアオキホールディングス	3,000	5,700.00	17,100,000	
ダイニック	8,000	188.00	1,504,000	
共和レザー	2,300	937.00	2,155,100	
スシローグローバルホールディングス	3,400	3,335.00	11,339,000	
LIXILピバ	3,600	2,000.00	7,200,000	
セーレン	10,000	1,762.00	17,620,000	
ソトー	1,500	1,148.00	1,722,000	
東海染工	6,000	135.00	810,000	
小松精練	5,600	710.00	3,976,000	
ワコールホールディングス	24,000	1,511.00	36,264,000	

ホギメディカル	2,500	7,300.00	18,250,000	
レナウン	10,800	151.00	1,630,800	
クラウディア	900	641.00	576,900	
T S Iホールディングス	16,500	787.00	12,985,500	
T I S	12,500	3,035.00	37,937,500	
ネオス	1,100	483.00	531,300	
電算システム	1,300	1,756.00	2,282,800	
グリー	22,900	936.00	21,434,400	
コーエーテックモホールディングス	8,900	2,154.00	19,170,600	
三菱総合研究所	1,600	3,255.00	5,208,000	
ボルテージ	700	1,563.00	1,094,100	
電算	400	2,189.00	875,600	
A G S	900	1,601.00	1,440,900	
ファインデックス	2,800	912.00	2,553,600	
ヒト・コミュニケーションズ	800	2,076.00	1,660,800	
ブレインパッド	800	1,300.00	1,040,000	
K L a b	7,200	1,920.00	13,824,000	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,700	1,515.00	4,090,500	
イーブクイニシアティブジャパン	600	1,123.00	673,800	
ネクソン	41,600	2,121.00	88,233,600	
アイスタイル	8,500	848.00	7,208,000	
エムアップ	1,100	1,830.00	2,013,000	
エイチーム	2,500	2,900.00	7,250,000	
テクノスジャパン	2,900	1,124.00	3,259,600	
e n i s h	1,100	2,799.00	3,078,900	
コロプラ	12,100	1,137.00	13,757,700	
モバイルクリエイト	2,700	419.00	1,131,300	
オルトプラス	1,700	1,150.00	1,955,000	
ブロードリーフ	9,300	699.00	6,500,700	
ハーツユナイテッドグループ	2,000	1,717.00	3,434,000	
メディアドゥ	1,100	2,670.00	2,937,000	
ブイキューブ	2,100	586.00	1,230,600	
サイバーリンクス	600	1,257.00	754,200	
ディー・エル・イー	1,700	597.00	1,014,900	
フィックスターズ	600	4,205.00	2,523,000	
VOYAGE GROUP	1,900	2,413.00	4,584,700	
オブティム	800	2,948.00	2,358,400	
セレス	900	1,532.00	1,378,800	
特種東海製紙	2,300	4,040.00	9,292,000	
ベリサーブ	400	3,380.00	1,352,000	
ティーガイア	3,800	2,115.00	8,037,000	
日本アジアグループ	4,300	431.00	1,853,300	
豆蔵ホールディングス	2,800	982.00	2,749,600	
テクマトリックス	2,300	1,788.00	4,112,400	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	79,000	291.00	22,989,000	
GMOペイメントゲートウェイ	2,600	6,160.00	16,016,000	
ザッパラス	1,900	519.00	986,100	
システムリサーチ	400	2,193.00	877,200	

インターネットイニシアティブ	5,500	2,040.00	11,220,000
さくらインターネット	3,100	912.00	2,827,200
GMOクラウド	800	3,720.00	2,976,000
SRAホールディングス	2,000	3,090.00	6,180,000
MINORISソリューションズ	800	1,298.00	1,038,400
システムインテグレータ	500	771.00	385,500
朝日ネット	3,400	520.00	1,768,000
アドソル日進	1,000	1,202.00	1,202,000
フリービット	2,800	924.00	2,587,200
コムチュア	600	4,800.00	2,880,000
サイバーコム	700	1,085.00	759,500
王子ホールディングス	156,000	570.00	88,920,000
日本製紙	17,900	2,197.00	39,326,300
三菱製紙	5,700	785.00	4,474,500
北越紀州製紙	22,300	844.00	18,821,200
中越パルプ工業	16,000	233.00	3,728,000
巴川製紙所	6,000	236.00	1,416,000
大王製紙	15,900	1,483.00	23,579,700
阿波製紙	1,000	637.00	637,000
メディカル・データ・ビジョン	1,700	2,664.00	4,528,800
gumi	4,300	1,365.00	5,869,500
ショーケース・ティービー	600	1,187.00	712,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	600	1,960.00	1,176,000
PCIホールディングス	600	2,557.00	1,534,200
パイブドHD	700	1,213.00	849,100
アイビーシー	400	1,089.00	435,600
オーブンドア	500	3,160.00	1,580,000
LINE	8,500	3,845.00	32,682,500
レンゴー	38,600	650.00	25,090,000
トーモク	13,000	390.00	5,070,000
ザ・バック	2,800	3,615.00	10,122,000
オークネット	1,200	1,384.00	1,660,800
AOITYO HOLDINGS	3,100	1,098.00	3,403,800
マクロミル	4,800	2,546.00	12,220,800
昭和電工	26,600	2,647.00	70,410,200
住友化学	294,000	642.00	188,748,000
住友精化	1,700	5,400.00	9,180,000
日産化学工業	21,600	3,790.00	81,864,000
ラサ工業	15,000	144.00	2,160,000
クレハ	3,000	5,500.00	16,500,000
多木化学	500	4,600.00	2,300,000
テイカ	6,000	964.00	5,784,000
石原産業	7,200	1,141.00	8,215,200
片倉コープアグリ	5,000	261.00	1,305,000
日東エフシー	2,300	953.00	2,191,900
日本曹達	24,000	623.00	14,952,000
東ソー	116,000	1,178.00	136,648,000
トクヤマ	62,000	550.00	34,100,000
セントラル硝子	41,000	480.00	19,680,000

東亜合成	25,000	1,431.00	35,775,000
大阪ソーダ	17,000	537.00	9,129,000
関東電化工業	8,200	1,024.00	8,396,800
デンカ	79,000	588.00	46,452,000
イビデン	26,700	1,911.00	51,023,700
信越化学工業	71,700	9,944.00	712,984,800
日本カーバイド工業	14,000	184.00	2,576,000
堺化学工業	15,000	427.00	6,405,000
エア・ウォーター	33,000	2,051.00	67,683,000
大陽日酸	30,800	1,244.00	38,315,200
日本化学工業	15,000	239.00	3,585,000
日本パーカライズン	20,400	1,608.00	32,803,200
高圧ガス工業	5,900	804.00	4,743,600
チタン工業	5,000	197.00	985,000
四国化成工業	6,000	1,340.00	8,040,000
戸田工業	8,000	279.00	2,232,000
ステラ ケミファ	1,900	2,958.00	5,620,200
保土谷化学工業	1,400	4,430.00	6,202,000
日本触媒	6,300	7,220.00	45,486,000
大日精化工業	17,000	908.00	15,436,000
カネカ	54,000	866.00	46,764,000
協和発酵キリン	47,900	1,971.00	94,410,900
三菱瓦斯化学	37,300	2,449.00	91,347,700
三井化学	182,000	598.00	108,836,000
J S R	40,200	1,944.00	78,148,800
東京応化工業	7,500	3,720.00	27,900,000
大阪有機化学工業	2,600	1,349.00	3,507,400
三菱ケミカルホールディングス	269,500	950.50	256,159,750
K Hネオケム	6,500	2,156.00	14,014,000
ダイセル	53,900	1,413.00	76,160,700
住友ベークライト	35,000	808.00	28,280,000
積水化学工業	89,000	1,981.00	176,309,000
日本ゼオン	34,000	1,220.00	41,480,000
アイカ工業	12,800	3,390.00	43,392,000
宇部興産	201,000	295.00	59,295,000
積水樹脂	6,200	2,020.00	12,524,000
タキロンシーアイ	8,000	581.00	4,648,000
旭有機材	13,000	254.00	3,302,000
日立化成	22,200	3,320.00	73,704,000
ニチバン	4,000	971.00	3,884,000
リケンテクノス	8,600	626.00	5,383,600
大倉工業	10,000	583.00	5,830,000
積水化成成品工業	5,600	936.00	5,241,600
群栄化学工業	1,000	3,555.00	3,555,000
タイガースポリマー	2,000	735.00	1,470,000
ミライアル	1,400	1,053.00	1,474,200
ダイキアクシス	1,300	1,002.00	1,302,600
ダイキョーニシカワ	7,000	1,576.00	11,032,000
日本化薬	26,000	1,588.00	41,288,000
カーリットホールディングス	3,700	602.00	2,227,400

E P Sホールディングス	5,500	1,737.00	9,553,500
ソルクシーズ	1,400	792.00	1,108,800
レグス	900	778.00	700,200
プレステージ・インターナショナル	7,500	1,171.00	8,782,500
フェイス	1,000	1,179.00	1,179,000
ハイマックス	500	1,611.00	805,500
アミューズ	2,200	2,965.00	6,523,000
野村総合研究所	28,200	4,285.00	120,837,000
ドリームインキュベータ	1,200	2,143.00	2,571,600
サイバネットシステム	3,100	720.00	2,232,000
クイック	2,000	1,481.00	2,962,000
T A C	2,200	246.00	541,200
C Eホールディングス	500	1,119.00	559,500
ケネディクス	50,600	527.00	26,666,200
電通	44,500	5,240.00	233,180,000
インテージホールディングス	2,100	2,244.00	4,712,400
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,900	816.00	1,550,400
東邦システムサイエンス	1,200	724.00	868,800
びあ	1,200	3,610.00	4,332,000
イオンファンタジー	1,200	3,215.00	3,858,000
ソースネクスト	2,300	612.00	1,407,600
シーティーエス	2,100	1,257.00	2,639,700
ネクシィーズグループ	1,400	1,790.00	2,506,000
メディカルシステムネットワーク	4,300	495.00	2,128,500
日本精化	3,300	1,002.00	3,306,600
扶桑化学工業	2,800	3,460.00	9,688,000
A D E K A	17,200	1,678.00	28,861,600
日油	31,000	1,440.00	44,640,000
ミヨシ油脂	1,500	1,404.00	2,106,000
新日本理化	6,300	157.00	989,100
ハリマ化成グループ	3,400	1,022.00	3,474,800
花王	99,800	6,652.00	663,869,600
第一工業製薬	9,000	528.00	4,752,000
日華化学	1,300	1,177.00	1,530,100
ニイタカ	600	1,736.00	1,041,600
三洋化成工業	2,500	5,280.00	13,200,000
武田薬品工業	150,000	5,637.00	845,550,000
アステラス製薬	392,500	1,379.50	541,453,750
大日本住友製薬	28,300	1,519.00	42,987,700
塩野義製薬	50,700	6,028.00	305,619,600
田辺三菱製薬	46,600	2,627.00	122,418,200
わかもと製薬	5,000	276.00	1,380,000
あすか製薬	4,300	1,674.00	7,198,200
日本新薬	9,200	7,020.00	64,584,000
ビオフェルミン製薬	600	3,025.00	1,815,000
中外製薬	39,800	4,085.00	162,583,000
科研製薬	7,500	5,870.00	44,025,000
エーザイ	49,200	6,033.00	296,823,600
理研ビタミン	1,300	4,380.00	5,694,000
ロート製薬	19,600	2,270.00	44,492,000

小野薬品工業	90,800	2,475.00	224,730,000
久光製薬	11,300	5,280.00	59,664,000
有機合成薬品工業	2,600	283.00	735,800
持田製薬	2,700	7,880.00	21,276,000
参天製薬	72,200	1,544.00	111,476,800
扶桑薬品工業	1,300	2,717.00	3,532,100
日本ケミファ	600	5,100.00	3,060,000
ツムラ	13,400	4,395.00	58,893,000
日医工	9,400	1,751.00	16,459,400
テルモ	58,500	4,330.00	253,305,000
みらかホールディングス	10,200	4,900.00	49,980,000
キッセイ薬品工業	7,100	2,926.00	20,774,600
生化学工業	7,400	1,836.00	13,586,400
栄研化学	3,400	3,450.00	11,730,000
日水製薬	1,600	1,383.00	2,212,800
鳥居薬品	2,700	2,689.00	7,260,300
JCRファーマ	3,100	2,777.00	8,608,700
東和薬品	1,800	5,100.00	9,180,000
富士製薬工業	1,300	3,715.00	4,829,500
沢井製薬	6,800	6,160.00	41,888,000
ゼリア新薬工業	8,200	2,104.00	17,252,800
第一三共	117,700	2,525.50	297,251,350
キョーリン製薬ホールディングス	9,800	2,433.00	23,843,400
大幸薬品	2,000	2,419.00	4,838,000
ダイト	2,400	2,442.00	5,860,800
大塚ホールディングス	86,000	4,736.00	407,296,000
大正製薬ホールディングス	8,600	8,420.00	72,412,000
ペプチドリーム	15,000	3,330.00	49,950,000
大日本塗料	23,000	305.00	7,015,000
日本ペイントホールディングス	30,900	4,140.00	127,926,000
関西ペイント	42,000	2,540.00	106,680,000
神東塗料	3,000	202.00	606,000
中国塗料	11,500	856.00	9,844,000
日本特殊塗料	2,800	1,844.00	5,163,200
藤倉化成	5,400	626.00	3,380,400
太陽ホールディングス	3,300	4,980.00	16,434,000
DIC	15,800	4,210.00	66,518,000
サカタインクス	8,200	1,786.00	14,645,200
東洋インキSCホールディングス	40,000	577.00	23,080,000
T&K TOKA	2,900	1,153.00	3,343,700
アルプス技研	1,600	3,685.00	5,896,000
サニックス	6,400	290.00	1,856,000
ダイオーズ	700	1,261.00	882,700
日本空調サービス	3,800	690.00	2,622,000
オリエンタルランド	43,100	7,502.00	323,336,200
フォーカスシステムズ	1,900	1,223.00	2,323,700
ダスキン	9,800	2,807.00	27,508,600
パーク24	19,100	2,915.00	55,676,500
明光ネットワークジャパン	4,600	1,449.00	6,665,400
ファルコホールディングス	1,900	1,529.00	2,905,100



クレスコ	900	3,390.00	3,051,000
フジ・メディア・ホールディングス	39,300	1,515.00	59,539,500
秀英予備校	800	452.00	361,600
田谷	700	667.00	466,900
ラウンドワン	12,500	1,079.00	13,487,500
リゾートトラスト	15,400	2,049.00	31,554,600
オービック	13,000	6,790.00	88,270,000
ジャストシステム	6,100	1,584.00	9,662,400
TDCソフトウェアエンジニアリング	1,600	1,232.00	1,971,200
ヤフー	270,200	487.00	131,587,400
ビー・エム・エル	5,200	2,159.00	11,226,800
ワタベウェディング	600	543.00	325,800
トレンドマイクロ	20,000	5,690.00	113,800,000
りらいあコミュニケーションズ	6,600	1,209.00	7,979,400
インフォメーション・ディベロブメント	1,100	1,416.00	1,557,600
リソー教育	6,800	895.00	6,086,000
日本オラクル	6,100	7,310.00	44,591,000
早稲田アカデミー	500	1,446.00	723,000
アルファシステムズ	1,200	2,101.00	2,521,200
フューチャー	5,100	928.00	4,732,800
CAC Holdings	2,800	1,012.00	2,833,600
ソフトバンク・テクノロジー	1,800	1,994.00	3,589,200
トーセ	1,000	2,450.00	2,450,000
ユー・エス・エス	48,300	2,200.00	106,260,000
オービックビジネスコンサルタント	1,900	5,720.00	10,868,000
伊藤忠テクノソリューションズ	8,500	3,915.00	33,277,500
アイティフォー	4,900	629.00	3,082,100
東京個別指導学院	1,300	1,501.00	1,951,300
東計電算	700	2,740.00	1,918,000
サイバーエージェント	24,000	3,555.00	85,320,000
楽天	204,000	1,316.00	268,464,000
エクスネット	700	892.00	624,400
クリーク・アンド・リバー社	1,900	1,236.00	2,348,400
テー・オー・ダブリュー	3,200	855.00	2,736,000
大塚商会	10,100	6,830.00	68,983,000
総合メディカル	1,800	4,715.00	8,487,000
サイボウズ	5,000	498.00	2,490,000
ソフトブレーン	5,100	502.00	2,560,200
セントラルスポーツ	1,400	4,440.00	6,216,000
パラカ	1,200	2,048.00	2,457,600
電通国際情報サービス	2,300	2,542.00	5,846,600
デジタルガレージ	7,300	2,072.00	15,125,600
イーエムシステムズ	1,300	2,560.00	3,328,000
ウェザーニューズ	1,300	3,470.00	4,511,000
C I J	3,200	557.00	1,782,400
東洋ビジネスエンジニアリング	400	1,740.00	696,000
日本エンタープライズ	3,800	271.00	1,029,800
WOWOW	1,800	3,085.00	5,553,000
スカラ	2,600	857.00	2,228,200

フルキャストホールディングス	4,100	1,277.00	5,235,700
富士フィルムホールディングス	79,300	4,013.00	318,230,900
コニカミノルタ	89,400	935.00	83,589,000
資生堂	75,900	3,862.00	293,125,800
ライオン	49,700	2,276.00	113,117,200
高砂香料工業	2,600	4,215.00	10,959,000
マンダム	4,000	6,010.00	24,040,000
ミルボン	2,200	6,050.00	13,310,000
ファンケル	8,500	2,045.00	17,382,500
コーセー	6,500	11,930.00	77,545,000
コタ	1,700	1,217.00	2,068,900
シーズ・ホールディングス	5,200	4,125.00	21,450,000
シーボン	500	2,460.00	1,230,000
ポーラ・オルビスホールディングス	16,300	2,960.00	48,248,000
ノエビアホールディングス	2,500	5,560.00	13,900,000
アジュバンコスメジャパン	800	956.00	764,800
エステー	2,700	2,505.00	6,763,500
アグロ カネショウ	1,500	1,501.00	2,251,500
コニシ	6,300	1,603.00	10,098,900
長谷川香料	5,100	2,289.00	11,673,900
星光PMC	2,200	1,295.00	2,849,000
小林製薬	10,700	6,590.00	70,513,000
荒川化学工業	3,400	1,897.00	6,449,800
メック	3,100	1,346.00	4,172,600
日本高純度化学	1,100	2,360.00	2,596,000
タカラバイオ	11,400	1,544.00	17,601,600
JCU	2,500	4,010.00	10,025,000
新田ゼラチン	2,400	747.00	1,792,800
OATアグリオ	500	1,616.00	808,000
デクセリアルズ	10,500	1,087.00	11,413,500
アース製薬	2,900	6,070.00	17,603,000
北興化学工業	3,900	491.00	1,914,900
大成ラミック	1,200	2,874.00	3,448,800
クミアイ化学工業	16,900	615.00	10,393,500
日本農薬	10,000	646.00	6,460,000
昭和シェル石油	35,800	1,115.00	39,917,000
富士興産	1,300	515.00	669,500
ニチレキ	4,900	1,388.00	6,801,200
ユシロ化学工業	2,100	1,519.00	3,189,900
ビービー・カストロール	1,600	1,863.00	2,980,800
富士石油	9,300	334.00	3,106,200
MORESCO	1,400	2,161.00	3,025,400
出光興産	19,000	2,805.00	53,295,000
JXTGホールディングス	609,900	491.30	299,643,870
コスモエネルギーホールディングス	12,100	1,780.00	21,538,000
横浜ゴム	24,100	2,291.00	55,213,100
東洋ゴム工業	21,100	2,344.00	49,458,400
ブリヂストン	135,000	4,794.00	647,190,000
住友ゴム工業	37,400	1,994.00	74,575,600
藤倉ゴム工業	3,300	690.00	2,277,000

オカモト	12,000	1,298.00	15,576,000
アキレス	3,300	1,912.00	6,309,600
フコク	1,700	1,017.00	1,728,900
ニッタ	3,600	3,565.00	12,834,000
クリエートメディック	1,300	981.00	1,275,300
住友理工	7,400	1,156.00	8,554,400
三ツ星ベルト	9,000	1,225.00	11,025,000
バンドー化学	7,300	1,088.00	7,942,400
旭硝子	39,000	4,780.00	186,420,000
日本板硝子	18,200	962.00	17,508,400
石塚硝子	6,000	217.00	1,302,000
有沢製作所	6,800	908.00	6,174,400
日本山村硝子	16,000	184.00	2,944,000
日本電気硝子	16,500	3,915.00	64,597,500
オハラ	1,500	1,206.00	1,809,000
住友大阪セメント	74,000	537.00	39,738,000
太平洋セメント	241,000	418.00	100,738,000
リソルホールディングス	4,000	365.00	1,460,000
日本ヒューム	3,800	679.00	2,580,200
日本コンクリート工業	8,900	423.00	3,764,700
三谷セキサン	2,000	2,781.00	5,562,000
アジアパイルホールディングス	4,900	751.00	3,679,900
東海カーボン	37,300	646.00	24,095,800
日本カーボン	2,000	3,250.00	6,500,000
東洋炭素	2,200	1,899.00	4,177,800
ノリタケカンパニーリミテド	2,300	3,835.00	8,820,500
TOTO	29,400	4,185.00	123,039,000
日本碍子	50,500	2,252.00	113,726,000
日本特殊陶業	34,500	2,373.00	81,868,500
ダントーホールディングス	3,000	148.00	444,000
MARUWA	1,500	4,495.00	6,742,500
品川リフラクトリーズ	10,000	273.00	2,730,000
黒崎播磨	9,000	428.00	3,852,000
ヨータイ	2,000	375.00	750,000
イソライト工業	2,000	372.00	744,000
東京窯業	4,900	213.00	1,043,700
ニッカトー	1,300	590.00	767,000
フジインコーポレーテッド	3,400	2,363.00	8,034,200
エーアンドエーマテリアル	8,000	125.00	1,000,000
ニチアス	21,000	1,330.00	27,930,000
新日鐵住金	180,300	2,630.00	474,189,000
神戸製鋼所	69,100	1,212.00	83,749,200
中山製鋼所	4,500	677.00	3,046,500
合同製鐵	2,200	2,298.00	5,055,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	109,300	2,020.00	220,786,000
日新製鋼	13,000	1,257.00	16,341,000
東京製鐵	20,200	991.00	20,018,200
共英製鋼	4,300	1,907.00	8,200,100
大和工業	8,000	2,976.00	23,808,000

東京鐵鋼	8,000	446.00	3,568,000
大阪製鐵	2,500	2,206.00	5,515,000
淀川製鋼所	5,500	3,050.00	16,775,000
東洋鋼鈑	9,600	420.00	4,032,000
丸一鋼管	13,400	3,400.00	45,560,000
モリ工業	1,200	2,265.00	2,718,000
大同特殊鋼	67,000	676.00	45,292,000
日本高周波鋼業	14,000	84.00	1,176,000
日本冶金工業	33,100	241.00	7,977,100
山陽特殊製鋼	24,000	656.00	15,744,000
愛知製鋼	2,400	4,580.00	10,992,000
日立金属	40,700	1,620.00	65,934,000
日本金属	1,000	1,608.00	1,608,000
大平洋金属	26,000	294.00	7,644,000
新日本電工	22,600	403.00	9,107,800
栗本鐵工所	1,900	2,064.00	3,921,600
虹 技	6,000	235.00	1,410,000
日本鑄鉄管	4,000	177.00	708,000
日本製鋼所	13,200	1,869.00	24,670,800
三菱製鋼	28,000	278.00	7,784,000
日亜鋼業	5,500	284.00	1,562,000
日本精線	3,000	697.00	2,091,000
大紀アルミニウム工業所	7,000	609.00	4,263,000
日本輕金属ホールディングス	102,900	278.00	28,606,200
三井金属鉱業	109,000	465.00	50,685,000
東邦亜鉛	23,000	477.00	10,971,000
三菱マテリアル	24,900	3,400.00	84,660,000
住友金属鉱山	103,000	1,508.00	155,324,000
D O W Aホールディングス	44,000	874.00	38,456,000
古河機械金属	62,000	203.00	12,586,000
エス・サイエンス	17,900	187.00	3,347,300
大阪チタニウムテクノロジーズ	4,400	1,764.00	7,761,600
東邦チタニウム	6,800	803.00	5,460,400
U A C J	56,000	318.00	17,808,000
古河電気工業	13,400	4,860.00	65,124,000
住友電気工業	150,600	1,781.00	268,218,600
フジクラ	52,600	945.00	49,707,000
昭和電線ホールディングス	48,000	91.00	4,368,000
東京特殊電線	600	2,015.00	1,209,000
タツタ電線	7,500	676.00	5,070,000
沖電線	4,000	269.00	1,076,000
カナレ電気	600	2,429.00	1,457,400
平河ヒューテック	1,900	1,491.00	2,832,900
リョービ	23,000	476.00	10,948,000
アーレスティ	4,600	1,142.00	5,253,200
アサヒホールディングス	6,000	1,876.00	11,256,000
東洋製罐グループホールディングス	28,400	1,833.00	52,057,200
ホッカンホールディングス	10,000	423.00	4,230,000
コロナ	2,100	1,154.00	2,423,400
横河ブリッジホールディングス	7,000	1,566.00	10,962,000

OSJBホールディングス	13,100	289.00	3,785,900
駒井ハルテック	800	2,209.00	1,767,200
高田機工	3,000	279.00	837,000
三和ホールディングス	39,700	1,176.00	46,687,200
文化シャッター	11,100	875.00	9,712,500
三協立山	5,200	1,729.00	8,990,800
アルインコ	2,700	1,106.00	2,986,200
東洋シャッター	1,000	631.00	631,000
LIXILグループ	55,700	2,770.00	154,289,000
日本フィルコン	2,900	592.00	1,716,800
ノーリツ	7,800	2,180.00	17,004,000
長府製作所	4,300	2,581.00	11,098,300
リンナイ	6,800	10,120.00	68,816,000
ユニプレス	7,400	2,628.00	19,447,200
ダイニチ工業	2,000	791.00	1,582,000
日東精工	5,700	471.00	2,684,700
三洋工業	5,000	221.00	1,105,000
岡部	8,300	1,026.00	8,515,800
ジーテクト	4,200	2,188.00	9,189,600
中国工業	600	745.00	447,000
東ブレ	7,700	3,010.00	23,177,000
高周波熱錬	7,300	1,028.00	7,504,400
東京製綱	2,700	1,707.00	4,608,900
サンコール	2,100	634.00	1,331,400
モリテックスチール	2,000	292.00	584,000
パイオラックス	6,100	3,030.00	18,483,000
エイチワン	3,000	1,211.00	3,633,000
日本発条	37,600	1,216.00	45,721,600
中央発條	5,000	346.00	1,730,000
アドバネクス	700	1,663.00	1,164,100
三浦工業	16,300	2,166.00	35,305,800
タクマ	12,800	1,148.00	14,694,400
テクノプロ・ホールディングス	6,500	4,445.00	28,892,500
アトラ	600	678.00	406,800
インターワークス	800	1,095.00	876,000
Keepertech 技研	1,200	1,294.00	1,552,800
ファーストロジック	300	2,598.00	779,400
三機サービス	400	1,332.00	532,800
デザインワン・ジャパン	700	1,575.00	1,102,500
イー・ガーディアン	1,800	2,313.00	4,163,400
リブセンス	2,700	625.00	1,687,500
ジャパンマテリアル	2,900	1,957.00	5,675,300
ベクトル	3,200	1,765.00	5,648,000
ウチヤマホールディングス	1,800	463.00	833,400
サクセスホールディングス	400	1,617.00	646,800
キャリアリンク	900	643.00	578,700
IBJ	3,100	730.00	2,263,000
アサンテ	1,500	2,108.00	3,162,000
N・フィールド	1,900	1,448.00	2,751,200
バリューHR	400	3,020.00	1,208,000

M & Aキャピタルパートナーズ	700	4,905.00	3,433,500	
ライドオン・エクスプレス	1,000	1,195.00	1,195,000	
E R Iホールディングス	1,000	813.00	813,000	
アピスト	500	4,095.00	2,047,500	
ウィルグループ	1,600	951.00	1,521,600	
エスクロー・エージェント・ジャパン	900	2,367.00	2,130,300	
日本ビューホテル	800	1,435.00	1,148,000	
リクルートホールディングス	261,400	1,890.00	494,046,000	
エラン	500	2,606.00	1,303,000	
ツガミ	11,000	862.00	9,482,000	
オークマ	26,000	1,056.00	27,456,000	
東芝機械	24,000	515.00	12,360,000	
アマダホールディングス	53,800	1,286.00	69,186,800	
アイダエンジニアリング	11,400	1,083.00	12,346,200	
滝澤鉄工所	12,000	180.00	2,160,000	
富士機械製造	12,200	1,699.00	20,727,800	
牧野フライス製作所	20,000	924.00	18,480,000	
オーエスジー	18,200	2,338.00	42,551,600	
ダイジェット工業	5,000	175.00	875,000	
旭ダイヤモンド工業	11,200	866.00	9,699,200	
D M G森精機	23,000	1,827.00	42,021,000	
ソディック	10,100	1,336.00	13,493,600	
ディスコ	4,700	18,210.00	85,587,000	
日東工器	2,300	2,633.00	6,055,900	
パンチ工業	1,400	1,279.00	1,790,600	
富士ダイス	1,400	729.00	1,020,600	
土木管理総合試験所	500	1,707.00	853,500	
日本郵政	104,100	1,406.00	146,364,600	
ベルシステム24ホールディングス	6,100	1,132.00	6,905,200	
一蔵	400	1,111.00	444,400	
L I T A L I C O	500	1,504.00	752,000	
エボラブルアジア	700	2,909.00	2,036,300	
ソラスト	2,500	1,469.00	3,672,500	
豊田自動織機	34,800	6,190.00	215,412,000	
豊和工業	2,200	815.00	1,793,000	
O K K	14,000	129.00	1,806,000	
石川製作所	1,000	1,209.00	1,209,000	
東洋機械金属	2,700	785.00	2,119,500	
津田駒工業	9,000	179.00	1,611,000	
エンシュウ	10,000	118.00	1,180,000	
島精機製作所	5,200	5,230.00	27,196,000	
N Cホールディングス	1,300	867.00	1,127,100	
フリーー	2,300	1,307.00	3,006,100	
ヤマシンフィルタ	1,000	2,194.00	2,194,000	
日阪製作所	5,400	958.00	5,173,200	
やまびこ	7,300	1,303.00	9,511,900	
ペガサスミシン製造	3,800	726.00	2,758,800	
ナブテスコ	20,800	3,230.00	67,184,000	
三井海洋開発	4,000	2,598.00	10,392,000	
レオン自動機	3,400	1,219.00	4,144,600	

S M C	12,000	34,690.00	416,280,000	
新川	3,300	739.00	2,438,700	
ホソカワミクロン	1,400	5,210.00	7,294,000	
ユニオンツール	1,700	3,170.00	5,389,000	
オイレス工業	4,900	1,991.00	9,755,900	
日精エー・エス・ビー機械	1,300	3,810.00	4,953,000	
サトーホールディングス	5,000	2,645.00	13,225,000	
日本エアーテック	1,300	840.00	1,092,000	
日精樹脂工業	3,200	1,099.00	3,516,800	
オカダアイオン	1,100	1,385.00	1,523,500	
ワイエイシイホールディングス	1,500	1,324.00	1,986,000	
小松製作所	184,400	2,855.50	526,554,200	
住友重機械工業	117,000	771.00	90,207,000	
日立建機	17,900	2,818.00	50,442,200	
日工	1,200	2,206.00	2,647,200	
巴工業	1,600	1,805.00	2,888,000	
井関農機	4,100	2,225.00	9,122,500	
T O W A	3,300	1,681.00	5,547,300	
丸山製作所	800	1,781.00	1,424,800	
北川鉄工所	1,800	2,421.00	4,357,800	
シンニッタン	3,300	694.00	2,290,200	
ローツェ	1,900	2,708.00	5,145,200	
タカキタ	1,300	520.00	676,000	
クボタ	191,300	1,925.00	368,252,500	
荏原実業	1,100	1,498.00	1,647,800	
東洋エンジニアリング	25,000	274.00	6,850,000	
三菱化工機	13,000	249.00	3,237,000	
月島機械	7,600	1,279.00	9,720,400	
帝国電機製作所	2,900	1,130.00	3,277,000	
東京機械製作所	15,000	74.00	1,110,000	
新東工業	9,100	1,145.00	10,419,500	
澁谷工業	3,300	3,245.00	10,708,500	
アイチコーポレーション	5,700	795.00	4,531,500	
小森コーポレーション	9,600	1,384.00	13,286,400	
鶴見製作所	3,000	1,844.00	5,532,000	
住友精密工業	6,000	345.00	2,070,000	
酒井重工業	8,000	333.00	2,664,000	
荏原製作所	18,100	3,235.00	58,553,500	
石井鐵工所	600	1,644.00	986,400	
西島製作所	3,900	1,133.00	4,418,700	
北越工業	4,300	1,064.00	4,575,200	
千代田化工建設	31,000	654.00	20,274,000	
ダイキン工業	52,100	11,725.00	610,872,500	
オルガノ	8,000	556.00	4,448,000	
トーヨーカネツ	17,000	333.00	5,661,000	
栗田工業	22,000	2,996.00	65,912,000	
椿本チエイン	23,000	987.00	22,701,000	
大同工業	8,000	307.00	2,456,000	
日機装	13,200	1,095.00	14,454,000	
木村化工機	3,400	374.00	1,271,600	

新興プランテック	8,800	912.00	8,025,600
アネスト岩田	6,900	1,029.00	7,100,100
ダイフク	19,100	3,270.00	62,457,000
サムコ	1,000	928.00	928,000
加藤製作所	2,100	3,365.00	7,066,500
油研工業	7,000	227.00	1,589,000
タダノ	20,000	1,371.00	27,420,000
フジテック	11,100	1,496.00	16,605,600
C K D	11,400	1,891.00	21,557,400
キトー	4,800	1,252.00	6,009,600
平和	11,800	2,505.00	29,559,000
理想科学工業	3,800	2,146.00	8,154,800
S A N K Y O	10,600	3,730.00	39,538,000
日本金銭機械	3,500	1,169.00	4,091,500
マースエンジニアリング	2,200	2,402.00	5,284,400
福島工業	2,400	4,745.00	11,388,000
オーイズミ	1,600	594.00	950,400
ダイコク電機	1,600	1,716.00	2,745,600
竹内製作所	7,000	2,039.00	14,273,000
アマノ	11,800	2,353.00	27,765,400
J U K I	6,000	1,646.00	9,876,000
サンデンホールディングス	23,000	336.00	7,728,000
蛇の目ミシン工業	3,700	880.00	3,256,000
ブラザー工業	46,600	2,632.00	122,651,200
マックス	6,000	1,589.00	9,534,000
モリタホールディングス	6,700	1,694.00	11,349,800
グローリー	12,200	3,715.00	45,323,000
新晃工業	3,500	1,770.00	6,195,000
大和冷機工業	6,100	1,222.00	7,454,200
セガサミーホールディングス	37,900	1,500.00	56,850,000
日本ピストンリング	1,500	2,279.00	3,418,500
リケン	1,800	5,210.00	9,378,000
T P R	4,300	3,690.00	15,867,000
ツバキ・ナカシマ	4,300	2,150.00	9,245,000
ホシザキ	11,200	10,080.00	112,896,000
大豊工業	3,100	1,450.00	4,495,000
日本精工	78,400	1,443.00	113,131,200
N T N	88,000	522.00	45,936,000
ジェイテクト	40,700	1,691.00	68,823,700
不二越	38,000	621.00	23,598,000
ミネベアミツミ	69,500	1,754.00	121,903,000
日本トムソン	12,200	586.00	7,149,200
T H K	27,000	3,195.00	86,265,000
ユーシン精機	1,700	2,674.00	4,545,800
前澤給装工業	1,400	1,526.00	2,136,400
イーグル工業	4,100	1,901.00	7,794,100
前澤工業	2,500	320.00	800,000
日本ピラー工業	3,900	1,703.00	6,641,700
キッツ	18,300	994.00	18,190,200
日立製作所	917,000	698.30	640,341,100



東芝	854,000	261.90	223,662,600
三菱電機	407,400	1,659.50	676,080,300
富士電機	115,000	603.00	69,345,000
東洋電機製造	1,600	1,661.00	2,657,600
安川電機	44,300	2,352.00	104,193,600
シンフォニアテクノロジー	25,000	461.00	11,525,000
明電舎	35,000	387.00	13,545,000
オリジン電気	6,000	309.00	1,854,000
山洋電気	10,000	1,131.00	11,310,000
デンヨー	3,500	1,934.00	6,769,000
三櫻工業	4,800	810.00	3,888,000
マキタ	49,800	4,160.00	207,168,000
東芝テック	24,000	605.00	14,520,000
芝浦メカトロニクス	6,000	327.00	1,962,000
マブチモーター	10,700	5,570.00	59,599,000
日本電産	49,500	11,510.00	569,745,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,200	1,714.00	2,056,800
東光高岳	1,900	1,679.00	3,190,100
ダブル・スコープ	3,700	2,055.00	7,603,500
宮越ホールディングス	1,300	464.00	603,200
ダイヘン	21,000	873.00	18,333,000
田淵電機	5,800	341.00	1,977,800
ヤーマン	500	8,250.00	4,125,000
JVCケンウッド	28,000	328.00	9,184,000
ミマキエンジニアリング	3,400	817.00	2,777,800
第一精工	1,800	2,111.00	3,799,800
日新電機	7,700	1,230.00	9,471,000
大崎電気工業	8,000	867.00	6,936,000
オムロン	40,600	4,970.00	201,782,000
日東工業	5,600	1,751.00	9,805,600
I D E C	5,000	1,453.00	7,265,000
不二電機工業	400	1,398.00	559,200
ジーエス・ユアサコーポレーション	74,000	485.00	35,890,000
サクサホールディングス	10,000	228.00	2,280,000
メルコホールディングス	2,100	3,215.00	6,751,500
テクノメディカ	900	1,929.00	1,736,100
日本電気	525,000	295.00	154,875,000
富士通	368,000	813.80	299,478,400
沖電気工業	16,500	1,606.00	26,499,000
岩崎通信機	17,000	84.00	1,428,000
電気興業	11,000	565.00	6,215,000
サンケン電気	22,000	538.00	11,836,000
ナカヨ	4,000	378.00	1,512,000
アイホン	2,200	1,942.00	4,272,400
ルネサスエレクトロニクス	19,800	987.00	19,542,600
セイコーエプソン	56,900	2,548.00	144,981,200
ワコム	29,600	359.00	10,626,400
アルパック	6,400	5,320.00	34,048,000
アクセル	1,600	807.00	1,291,200
E I Z O	3,800	4,350.00	16,530,000

ジャパンディスプレイ	71,300	202.00	14,402,600	
日本信号	10,500	1,062.00	11,151,000	
京三製作所	9,000	589.00	5,301,000	
能美防災	4,300	1,661.00	7,142,300	
ホーチキ	2,800	1,798.00	5,034,400	
エレコム	3,300	2,236.00	7,378,800	
日本無線	2,300	1,448.00	3,330,400	
パナソニック	438,600	1,464.50	642,329,700	
アンリツ	27,800	986.00	27,410,800	
富士通ゼネラル	13,000	2,626.00	34,138,000	
日立国際電気	9,900	2,655.00	26,284,500	
ソニー	269,800	4,245.00	1,145,301,000	
T D K	21,500	7,490.00	161,035,000	
帝国通信工業	8,000	208.00	1,664,000	
タムラ製作所	15,000	523.00	7,845,000	
アルプス電気	35,300	3,180.00	112,254,000	
池上通信機	12,000	156.00	1,872,000	
パイオニア	57,400	217.00	12,455,800	
日本電波工業	3,700	880.00	3,256,000	
鈴木	1,500	722.00	1,083,000	
日本トリム	900	4,255.00	3,829,500	
ローランド ディー・ジー	2,000	2,599.00	5,198,000	
日本コロムビア	1,100	688.00	756,800	
フォスター電機	4,500	2,004.00	9,018,000	
クラリオン	20,000	434.00	8,680,000	
S M K	10,000	448.00	4,480,000	
ヨコオ	2,700	1,419.00	3,831,300	
ティアック	27,000	49.00	1,323,000	
ホシデン	11,600	1,198.00	13,896,800	
ヒロセ電機	6,200	15,790.00	97,898,000	
日本航空電子工業	11,000	1,641.00	18,051,000	
T O A	4,500	1,059.00	4,765,500	
日立マクセル	5,700	2,345.00	13,366,500	
古野電気	4,900	654.00	3,204,600	
ユニデンホールディングス	11,000	262.00	2,882,000	
アルパイン	9,100	1,689.00	15,369,900	
スミダコーポレーション	3,500	2,140.00	7,490,000	
アイコム	2,100	2,517.00	5,285,700	
リオン	1,500	1,749.00	2,623,500	
本多通信工業	1,600	1,681.00	2,689,600	
船井電機	4,300	1,053.00	4,527,900	
横河電機	41,400	1,775.00	73,485,000	
新電元工業	15,000	613.00	9,195,000	
アズビル	11,400	4,185.00	47,709,000	
東亜ディーケーケー	1,900	703.00	1,335,700	
日本光電工業	16,000	2,566.00	41,056,000	
チノー	1,400	1,256.00	1,758,400	
共和電業	4,300	451.00	1,939,300	
日本電子材料	1,500	709.00	1,063,500	
堀場製作所	7,600	6,730.00	51,148,000	

アドバンテスト	26,000	1,930.00	50,180,000
小野測器	1,800	755.00	1,359,000
エスペック	3,400	1,703.00	5,790,200
キーエンス	17,300	49,070.00	848,911,000
日置電機	2,000	2,197.00	4,394,000
シスメックス	29,700	6,340.00	188,298,000
日本マイクロニクス	6,600	1,110.00	7,326,000
メガチップス	3,600	2,781.00	10,011,600
OBARA GROUP	2,200	5,970.00	13,134,000
イマジカ・ロボットホールディングス	3,200	723.00	2,313,600
澤藤電機	2,000	562.00	1,124,000
デンソー	94,200	4,766.00	448,957,200
コーセル	5,300	1,354.00	7,176,200
イリソ電子工業	1,600	8,880.00	14,208,000
新日本無線	3,200	695.00	2,224,000
オブテックスグループ	2,900	3,540.00	10,266,000
千代田インテグレ	2,000	2,246.00	4,492,000
アイ・オー・データ機器	1,600	1,195.00	1,912,000
レーザーテック	8,400	1,519.00	12,759,600
スタンレー電気	27,200	3,555.00	96,696,000
岩崎電気	14,000	198.00	2,772,000
ウシオ電機	23,200	1,423.00	33,013,600
岡谷電機産業	2,000	398.00	796,000
ヘリオス テクノホールディング	3,500	779.00	2,726,500
日本セラミック	3,200	2,593.00	8,297,600
遠藤照明	1,900	1,148.00	2,181,200
古河電池	3,000	770.00	2,310,000
双信電機	1,800	300.00	540,000
山一電機	3,600	1,738.00	6,256,800
図研	2,500	1,496.00	3,740,000
日本電子	14,000	585.00	8,190,000
カシオ計算機	30,700	1,699.00	52,159,300
ファナック	38,700	21,725.00	840,757,500
日本シイエムケイ	8,200	949.00	7,781,800
エンプラス	1,700	3,525.00	5,992,500
大真空	1,400	1,772.00	2,480,800
ローム	18,500	8,470.00	156,695,000
浜松ホトニクス	27,800	3,435.00	95,493,000
三井ハイテック	5,000	1,679.00	8,395,000
新光電気工業	14,400	956.00	13,766,400
京セラ	62,700	6,437.00	403,599,900
協栄産業	5,000	184.00	920,000
太陽誘電	18,600	1,755.00	32,643,000
村田製作所	40,100	16,685.00	669,068,500
ユーシン	5,300	768.00	4,070,400
双葉電子工業	6,200	2,027.00	12,567,400
日東電工	28,800	9,653.00	278,006,400
北陸電気工業	15,000	139.00	2,085,000
東海理化電機製作所	10,100	2,132.00	21,533,200

ニチコン	12,000	1,213.00	14,556,000
日本ケミコン	33,000	456.00	15,048,000
K O A	5,300	2,245.00	11,898,500
三井造船	138,000	160.00	22,080,000
日立造船	30,300	559.00	16,937,700
三菱重工業	640,000	463.10	296,384,000
川崎重工業	297,000	339.00	100,683,000
I H I	293,000	374.00	109,582,000
名村造船所	11,500	677.00	7,785,500
サノヤスホールディングス	4,600	261.00	1,200,600
日本車輛製造	14,000	281.00	3,934,000
ニチユ三菱フォークリフト	4,500	789.00	3,550,500
近畿車輛	600	2,552.00	1,531,200
F P G	13,500	1,149.00	15,511,500
島根銀行	800	1,314.00	1,051,200
じもとホールディングス	27,000	202.00	5,454,000
全国保証	10,600	4,685.00	49,661,000
めぶきフィナンシャルグループ	181,800	432.00	78,537,600
東京ＴＹフィナンシャルグループ	5,500	3,125.00	17,187,500
九州フィナンシャルグループ	61,800	729.00	45,052,200
かんぼ生命保険	14,200	2,488.00	35,329,600
ゆうちょ銀行	106,700	1,444.00	154,074,800
富山第一銀行	9,600	518.00	4,972,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	244,300	572.60	139,886,180
西日本フィナンシャルホールディングス	25,600	1,187.00	30,387,200
日産自動車	450,400	1,146.50	516,383,600
いすゞ自動車	110,700	1,413.50	156,474,450
トヨタ自動車	464,300	6,157.00	2,858,695,100
日野自動車	54,500	1,265.00	68,942,500
三菱自動車工業	140,000	746.00	104,440,000
エフテック	2,200	1,448.00	3,185,600
レシップホールディングス	1,300	896.00	1,164,800
G M B	600	1,191.00	714,600
ファルテック	700	1,387.00	970,900
武蔵精密工業	4,400	3,270.00	14,388,000
日産車体	16,800	1,088.00	18,278,400
新明和工業	15,400	953.00	14,676,200
極東開発工業	7,600	1,811.00	13,763,600
日信工業	8,500	1,829.00	15,546,500
トピー工業	3,100	3,335.00	10,338,500
ティラド	15,000	353.00	5,295,000
曙ブレーキ工業	17,700	367.00	6,495,900
タチエス	6,500	2,099.00	13,643,500
N O K	18,500	2,422.00	44,807,000
フタバ産業	11,600	1,032.00	11,971,200
K Y B	43,000	591.00	25,413,000
市光工業	8,000	885.00	7,080,000
大同メタル工業	4,800	1,009.00	4,843,200

プレス工業	20,300	537.00	10,901,100
ミクニ	4,800	467.00	2,241,600
太平洋工業	8,600	1,507.00	12,960,200
ケーヒン	8,800	1,612.00	14,185,600
河西工業	5,200	1,466.00	7,623,200
アイシン精機	34,900	5,880.00	205,212,000
富士機工	3,700	737.00	2,726,900
マツダ	120,900	1,629.00	196,946,100
今仙電機製作所	3,500	1,282.00	4,487,000
本田技研工業	343,700	3,087.00	1,061,001,900
スズキ	75,700	5,291.00	400,528,700
S U B A R U	118,600	4,086.00	484,599,600
安永	1,800	1,224.00	2,203,200
ヤマハ発動機	53,900	2,910.00	156,849,000
ショーワ	9,900	1,112.00	11,008,800
小糸製作所	22,900	5,790.00	132,591,000
T B K	4,900	516.00	2,528,400
エクセディ	5,200	3,205.00	16,666,000
ミツバ	7,000	2,090.00	14,630,000
豊田合成	12,300	2,739.00	33,689,700
愛三工業	6,700	920.00	6,164,000
盟和産業	600	1,219.00	731,400
ヨロズ	3,600	1,804.00	6,494,400
エフ・シー・シー	6,200	2,236.00	13,863,200
新家工業	9,000	192.00	1,728,000
シマノ	15,400	17,870.00	275,198,000
テイ・エス テック	8,900	3,315.00	29,503,500
ジャムコ	2,200	2,533.00	5,572,600
小野建	3,300	1,770.00	5,841,000
はるやまホールディングス	1,800	992.00	1,785,600
ノジマ	5,900	1,713.00	10,106,700
佐鳥電機	2,800	846.00	2,368,800
カップ・クリエイト	5,300	1,253.00	6,640,900
エコートレーディング	900	718.00	646,200
伯東	2,600	1,458.00	3,790,800
コンドーテック	3,000	977.00	2,931,000
中山福	2,200	791.00	1,740,200
ライトオン	3,200	971.00	3,107,200
ナガイレーベン	5,000	2,541.00	12,705,000
ジーンズメイト	1,200	725.00	870,000
三菱食品	4,100	3,165.00	12,976,500
良品計画	5,000	27,110.00	135,550,000
三城ホールディングス	4,700	464.00	2,180,800
松田産業	2,700	1,472.00	3,974,400
第一興商	6,100	5,110.00	31,171,000
メディバルホールディングス	37,700	2,026.00	76,380,200
アドヴァン	3,800	1,127.00	4,282,600
S P K	800	2,643.00	2,114,400
萩原電気	1,300	2,214.00	2,878,200
アルビス	1,000	4,700.00	4,700,000

アズワン	2,900	5,330.00	15,457,000
スズデン	1,300	1,290.00	1,677,000
尾家産業	1,200	1,211.00	1,453,200
シモジマ	2,300	1,115.00	2,564,500
ドウシシャ	4,400	2,155.00	9,482,000
小津産業	800	2,157.00	1,725,600
コナカ	4,800	593.00	2,846,400
高速	2,200	1,059.00	2,329,800
ハウス オブ ローゼ	500	1,551.00	775,500
G-7ホールディングス	1,100	2,142.00	2,356,200
たけびし	1,300	1,423.00	1,849,900
イオン北海道	3,800	606.00	2,302,800
コジマ	6,500	304.00	1,976,000
ヒマラヤ	1,000	870.00	870,000
コーナン商事	5,300	2,048.00	10,854,400
黒田電気	5,100	2,144.00	10,934,400
ネットワンシステムズ	16,300	1,100.00	17,930,000
エコス	1,500	1,205.00	1,807,500
ワタミ	4,400	1,341.00	5,900,400
マルシェ	800	823.00	658,400
リックス	800	1,783.00	1,426,400
システムソフト	8,900	161.00	1,432,900
ドンキホーテホールディングス	24,400	4,090.00	99,796,000
丸文	3,300	788.00	2,600,400
西松屋チェーン	6,600	1,181.00	7,794,600
ゼンショーホールディングス	19,500	2,002.00	39,039,000
ハピネット	3,100	1,917.00	5,942,700
幸楽苑ホールディングス	2,400	1,805.00	4,332,000
ハークスレイ	900	1,099.00	989,100
橋本総業ホールディングス	800	1,631.00	1,304,800
日本ライフライン	4,300	4,540.00	19,522,000
サイゼリヤ	5,600	3,200.00	17,920,000
エクセル	1,600	1,442.00	2,307,200
V Tホールディングス	12,700	567.00	7,200,900
マルカキカイ	1,200	1,883.00	2,259,600
アルゴグラフィックス	1,700	2,532.00	4,304,400
魚力	1,200	1,236.00	1,483,200
IDOM	10,100	779.00	7,867,900
日本エム・ディ・エム	2,800	938.00	2,626,400
ポブラ	900	571.00	513,900
フジ・コーポレーション	600	1,984.00	1,190,400
ユナイテッドアローズ	5,000	3,435.00	17,175,000
進和	2,200	2,130.00	4,686,000
エスケイジャパン	700	292.00	204,400
ダイترون	1,700	1,429.00	2,429,300
ハイデイ日高	4,100	2,944.00	12,070,400
シークス	2,700	4,410.00	11,907,000
京都きもの友禅	2,400	928.00	2,227,200
コロワイド	12,500	1,879.00	23,487,500
ピーシーデポコーポレーション	5,000	572.00	2,860,000

田中商事	1,200	732.00	878,400
オーハシテクニカ	2,100	1,410.00	2,961,000
巻番屋	2,700	3,790.00	10,233,000
白銅	900	1,742.00	1,567,800
トップカルチャー	1,400	495.00	693,000
P L A N T	900	1,216.00	1,094,400
スギホールディングス	8,300	5,370.00	44,571,000
島津製作所	49,200	2,162.00	106,370,400
J M S	7,000	324.00	2,268,000
クボテック	800	588.00	470,400
長野計器	3,000	750.00	2,250,000
ブイ・テクノロジー	800	18,860.00	15,088,000
スター精密	6,700	1,912.00	12,810,400
東京計器	13,000	312.00	4,056,000
愛知時計電機	500	3,660.00	1,830,000
インターアクション	1,400	767.00	1,073,800
オーバル	3,700	266.00	984,200
東京精密	7,400	3,605.00	26,677,000
マニー	4,600	2,721.00	12,516,600
ニコン	66,600	1,879.00	125,141,400
トプコン	19,200	1,949.00	37,420,800
オリンパス	61,000	4,080.00	248,880,000
理研計器	3,400	2,022.00	6,874,800
S C R E E Nホールディングス	7,800	7,660.00	59,748,000
キヤノン電子	3,500	2,199.00	7,696,500
タムロン	3,400	1,974.00	6,711,600
H O Y A	78,600	5,653.00	444,325,800
シード	500	2,429.00	1,214,500
ノーリツ鋼機	3,900	964.00	3,759,600
エー・アンド・デイ	3,500	449.00	1,571,500
キヤノン	205,600	3,652.00	750,851,200
リコー	114,800	953.00	109,404,400
シチズン時計	41,800	804.00	33,607,200
リズム時計工業	15,000	235.00	3,525,000
大研医器	3,400	782.00	2,658,800
メニコン	2,600	3,560.00	9,256,000
スノーピーク	600	3,180.00	1,908,000
パラマウントベッドホールディングス	3,700	4,925.00	18,222,500
トランザクション	1,700	1,349.00	2,293,300
S H O B I	1,300	447.00	581,100
ニホンフラッシュ	1,800	1,500.00	2,700,000
前田工織	3,800	1,653.00	6,281,400
永大産業	5,000	504.00	2,520,000
アートネイチャー	4,100	711.00	2,915,100
ダンロップスポーツ	2,400	1,128.00	2,707,200
パンダイナムコホールディングス	42,100	3,905.00	164,400,500
アイフィスジャパン	900	726.00	653,400
共立印刷	6,300	339.00	2,135,700
S H O E I	1,700	3,090.00	5,253,000
フランスベッドホールディングス	4,800	984.00	4,723,200

マーベラス	6,400	1,109.00	7,097,600
パイロットコーポレーション	6,700	4,700.00	31,490,000
萩原工業	1,100	2,926.00	3,218,600
エイベックス・グループ・ホールディングス	6,900	1,484.00	10,239,600
トッパン・フォームズ	6,800	1,210.00	8,228,000
フジシールインターナショナル	8,600	3,005.00	25,843,000
タカラトミー	14,800	1,340.00	19,832,000
廣済堂	3,800	360.00	1,368,000
A s - m e エステール	1,000	703.00	703,000
アーク	16,100	114.00	1,835,400
レック	2,500	2,651.00	6,627,500
タカノ	1,700	1,112.00	1,890,400
プロネクサス	3,600	1,234.00	4,442,400
ホクシン	2,700	192.00	518,400
ウッドワン	6,000	283.00	1,698,000
大建工業	2,700	2,480.00	6,696,000
きもと	7,100	259.00	1,838,900
凸版印刷	108,000	1,201.00	129,708,000
大日本印刷	108,000	1,234.00	133,272,000
図書印刷	5,000	501.00	2,505,000
共同印刷	12,000	379.00	4,548,000
日本写真印刷	6,700	2,998.00	20,086,600
光村印刷	3,000	248.00	744,000
藤森工業	3,000	3,300.00	9,900,000
ヴィア・ホールディングス	2,900	966.00	2,801,400
宝印刷	2,000	1,638.00	3,276,000
前澤化成工業	2,600	1,220.00	3,172,000
アシックス	37,900	2,032.00	77,012,800
ツツミ	1,400	2,113.00	2,958,200
J S P	1,900	3,255.00	6,184,500
ニチハ	5,300	3,990.00	21,147,000
エフピコ	3,500	6,090.00	21,315,000
小松ウオール工業	1,300	2,050.00	2,665,000
ヤマハ	25,700	3,945.00	101,386,500
河合楽器製作所	1,500	2,295.00	3,442,500
クリナップ	4,000	878.00	3,512,000
ピジョン	23,100	4,065.00	93,901,500
天馬	2,600	2,094.00	5,444,400
兼松サステック	4,000	227.00	908,000
キングジム	3,200	985.00	3,152,000
リンテック	9,100	2,699.00	24,560,900
信越ポリマー	7,800	899.00	7,012,200
東リ	9,500	362.00	3,439,000
イトーキ	8,000	918.00	7,344,000
任天堂	23,500	35,160.00	826,260,000
三菱鉛筆	6,300	3,020.00	19,026,000
松風	2,000	1,326.00	2,652,000
タカラスタンダード	7,900	1,813.00	14,322,700
コクヨ	19,800	1,494.00	29,581,200



ナカバヤシ	7,000	319.00	2,233,000
ニフコ	7,000	6,180.00	43,260,000
立川ブラインド工業	1,700	1,225.00	2,082,500
グロープライド	1,800	1,900.00	3,420,000
岡村製作所	13,300	1,037.00	13,792,100
日本バルカー工業	3,100	2,356.00	7,303,600
MUTOHホールディングス	5,000	250.00	1,250,000
伊藤忠商事	276,100	1,713.00	472,959,300
丸紅	371,000	739.50	274,354,500
スクロール	5,700	374.00	2,131,800
高島	6,000	207.00	1,242,000
ヨンドシーホールディングス	3,800	2,634.00	10,009,200
三陽商会	2,100	1,775.00	3,727,500
長瀬産業	22,700	1,725.00	39,157,500
ナイガイ	15,000	67.00	1,005,000
蝶理	2,400	2,046.00	4,910,400
豊田通商	42,000	3,355.00	140,910,000
オンワードホールディングス	26,000	810.00	21,060,000
三共生興	5,700	388.00	2,211,600
兼松	80,000	237.00	18,960,000
美津濃	20,000	644.00	12,880,000
ツカモトコーポレーション	7,000	128.00	896,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	16,500	6,230.00	102,795,000
ルック	7,000	265.00	1,855,000
三井物産	340,900	1,608.00	548,167,200
日本紙パルプ商事	20,000	427.00	8,540,000
東京エレクトロン	25,500	15,230.00	388,365,000
日立ハイテクノロジーズ	13,100	4,280.00	56,068,000
カメイ	4,900	1,521.00	7,452,900
東都水産	600	1,865.00	1,119,000
OUGホールディングス	6,000	263.00	1,578,000
スターゼン	1,600	4,650.00	7,440,000
セイコーホールディングス	27,000	467.00	12,609,000
山善	14,500	1,133.00	16,428,500
椿本興業	4,000	428.00	1,712,000
住友商事	237,300	1,482.50	351,797,250
日本ユニシス	10,400	1,840.00	19,136,000
内田洋行	1,700	2,809.00	4,775,300
三菱商事	282,800	2,396.00	677,588,800
第一実業	9,000	612.00	5,508,000
キャノンマーケティングジャパン	10,700	2,489.00	26,632,300
西華産業	12,000	401.00	4,812,000
佐藤商事	3,400	905.00	3,077,000
菱洋エレクトロ	3,500	1,804.00	6,314,000
東京産業	3,700	440.00	1,628,000
ユアサ商事	3,600	3,450.00	12,420,000
神鋼商事	900	2,579.00	2,321,100
小林産業	2,700	319.00	861,300
阪和興業	38,000	808.00	30,704,000

カナデン	3,600	1,142.00	4,111,200
菱電商事	6,000	797.00	4,782,000
ニプロ	26,400	1,501.00	39,626,400
フルサト工業	2,100	1,668.00	3,502,800
岩谷産業	42,000	698.00	29,316,000
すてきナイスグループ	16,000	159.00	2,544,000
昭光通商	13,000	99.00	1,287,000
ニチモウ	5,000	176.00	880,000
極東貿易	6,000	276.00	1,656,000
イワキ	6,000	439.00	2,634,000
兼松エレクトロニクス	2,400	3,560.00	8,544,000
三愛石油	10,100	1,147.00	11,584,700
稲畑産業	9,000	1,482.00	13,338,000
G S Iクレオス	9,000	140.00	1,260,000
明和産業	3,500	434.00	1,519,000
キムラタン	169,000	7.00	1,183,000
ゴールドウイン	1,700	6,780.00	11,526,000
ユニ・チャーム	81,000	2,829.00	229,149,000
デサント	9,100	1,493.00	13,586,300
キング	2,000	409.00	818,000
ワキタ	8,000	1,295.00	10,360,000
ヤマトインターナショナル	2,700	435.00	1,174,500
東邦ホールディングス	12,100	2,146.00	25,966,600
サンゲツ	12,800	1,951.00	24,972,800
ミツウロコグループホールディングス	6,100	714.00	4,355,400
シナネンホールディングス	1,600	2,246.00	3,593,600
伊藤忠エネクス	8,300	959.00	7,959,700
サンリオ	11,600	2,155.00	24,998,000
サンワテクノス	2,200	1,493.00	3,284,600
リョーサン	5,100	4,205.00	21,445,500
新光商事	4,100	1,374.00	5,633,400
トーヨー	1,700	3,025.00	5,142,500
三信電気	4,200	1,436.00	6,031,200
東陽テクニカ	4,300	1,082.00	4,652,600
モスフードサービス	4,900	3,355.00	16,439,500
加賀電子	3,400	2,321.00	7,891,400
三益半導体工業	3,400	1,716.00	5,834,400
ソーダニッカ	3,900	521.00	2,031,900
立花エレテック	2,500	1,510.00	3,775,000
木曽路	4,600	2,680.00	12,328,000
サトレストランシステムズ	4,400	901.00	3,964,400
千趣会	6,800	782.00	5,317,600
タカキュー	2,900	196.00	568,400
ケーヨー	6,300	830.00	5,229,000
上新電機	9,000	1,557.00	14,013,000
日本瓦斯	6,900	3,575.00	24,667,500
ロイヤルホールディングス	6,200	2,525.00	15,655,000
東天紅	3,000	199.00	597,000
いなげや	4,200	1,846.00	7,753,200
島忠	9,800	2,647.00	25,940,600

チヨダ	4,400	2,874.00	12,645,600
ライフコーポレーション	2,900	3,030.00	8,787,000
リンガーハット	4,200	2,408.00	10,113,600
さが美	3,000	120.00	360,000
MR MAX	4,700	543.00	2,552,100
テンアライド	3,500	398.00	1,393,000
AOKIホールディングス	7,500	1,432.00	10,740,000
オークワ	5,000	1,249.00	6,245,000
コメリ	5,800	2,828.00	16,402,400
青山商事	7,900	3,955.00	31,244,500
しまむら	4,400	13,700.00	60,280,000
はせがわ	2,000	476.00	952,000
高島屋	63,000	1,026.00	64,638,000
松屋	8,200	993.00	8,142,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	19,300	1,939.00	37,422,700
近鉄百貨店	14,000	350.00	4,900,000
パルコ	3,600	1,306.00	4,701,600
丸井グループ	39,700	1,571.00	62,368,700
クレディセゾン	28,600	2,214.00	63,320,400
アクシアル リテイリング	2,900	4,150.00	12,035,000
井筒屋	2,000	422.00	844,000
イオン	155,100	1,734.00	268,943,400
イズミ	6,800	6,100.00	41,480,000
東武ストア	500	3,075.00	1,537,500
フォーバル	1,600	762.00	1,219,200
平和堂	7,600	2,273.00	17,274,800
フジ	4,200	2,639.00	11,083,800
ヤオコー	4,300	4,700.00	20,210,000
ゼビオホールディングス	5,100	1,960.00	9,996,000
ケーズホールディングス	15,900	2,166.00	34,439,400
PALTAC	6,000	3,845.00	23,070,000
三谷産業	4,000	419.00	1,676,000
Olympicグループ	2,200	596.00	1,311,200
日産東京販売ホールディングス	5,500	445.00	2,447,500
新生銀行	359,000	193.00	69,287,000
あおぞら銀行	238,000	433.00	103,054,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	2,856,300	754.00	2,153,650,200
りそなホールディングス	441,000	609.70	268,877,700
三井住友トラスト・ホールディングス	78,700	4,030.00	317,161,000
三井住友フィナンシャルグループ	301,800	4,372.00	1,319,469,600
第四銀行	46,000	509.00	23,414,000
北越銀行	4,100	2,637.00	10,811,700
千葉銀行	145,000	809.00	117,305,000
群馬銀行	83,800	667.00	55,894,600
武蔵野銀行	6,000	3,460.00	20,760,000
千葉興業銀行	10,300	596.00	6,138,800
筑波銀行	15,700	336.00	5,275,200
七十七銀行	59,000	552.00	32,568,000
青森銀行	29,000	391.00	11,339,000
秋田銀行	24,000	320.00	7,680,000

山形銀行	21,000	490.00	10,290,000
岩手銀行	2,500	4,480.00	11,200,000
東邦銀行	34,000	393.00	13,362,000
東北銀行	19,000	152.00	2,888,000
みちのく銀行	23,000	185.00	4,255,000
ふくおかフィナンシャルグループ	153,000	547.00	83,691,000
静岡銀行	99,000	1,020.00	100,980,000
十六銀行	51,000	368.00	18,768,000
スルガ銀行	38,500	2,762.00	106,337,000
八十二銀行	72,700	726.00	52,780,200
山梨中央銀行	23,000	459.00	10,557,000
大垣共立銀行	58,000	324.00	18,792,000
福井銀行	32,000	272.00	8,704,000
北國銀行	40,000	427.00	17,080,000
清水銀行	1,300	3,590.00	4,667,000
富山銀行	700	4,180.00	2,926,000
滋賀銀行	35,000	587.00	20,545,000
南都銀行	4,300	3,195.00	13,738,500
百五銀行	34,000	457.00	15,538,000
京都銀行	67,000	1,050.00	70,350,000
紀陽銀行	14,200	1,969.00	27,959,800
三重銀行	1,700	2,488.00	4,229,600
ほくほくフィナンシャルグループ	25,100	1,837.00	46,108,700
広島銀行	111,000	486.00	53,946,000
山陰合同銀行	22,300	917.00	20,449,100
中国銀行	26,700	1,704.00	45,496,800
鳥取銀行	1,200	1,694.00	2,032,800
伊予銀行	53,800	925.00	49,765,000
百十四銀行	41,000	371.00	15,211,000
四国銀行	29,000	302.00	8,758,000
阿波銀行	32,000	752.00	24,064,000
大分銀行	22,000	419.00	9,218,000
宮崎銀行	25,000	362.00	9,050,000
佐賀銀行	23,000	262.00	6,026,000
十八銀行	23,000	304.00	6,992,000
沖縄銀行	3,700	4,480.00	16,576,000
琉球銀行	7,800	1,627.00	12,690,600
セブン銀行	141,300	416.00	58,780,800
みずほフィナンシャルグループ	5,118,300	205.90	1,053,857,970
高知銀行	14,000	124.00	1,736,000
山口フィナンシャルグループ	35,000	1,340.00	46,900,000
アクリーティブ	3,100	402.00	1,246,200
芙蓉総合リース	4,300	6,450.00	27,735,000
興銀リース	7,100	2,636.00	18,715,600
東京センチュリー	7,600	4,675.00	35,530,000
SBIホールディングス	42,600	1,541.00	65,646,600
日本証券金融	16,600	574.00	9,528,400
アイフル	63,200	393.00	24,837,600
日本アジア投資	3,600	431.00	1,551,600
ポケットカード	2,800	766.00	2,144,800

長野銀行	1,200	1,975.00	2,370,000	
名古屋銀行	3,000	4,135.00	12,405,000	
北洋銀行	61,500	393.00	24,169,500	
愛知銀行	1,300	6,140.00	7,982,000	
第三銀行	2,100	1,702.00	3,574,200	
中京銀行	1,500	2,308.00	3,462,000	
大光銀行	13,000	235.00	3,055,000	
愛媛銀行	4,800	1,413.00	6,782,400	
トマト銀行	1,500	1,556.00	2,334,000	
みなと銀行	3,400	2,090.00	7,106,000	
京葉銀行	31,000	481.00	14,911,000	
関西アーバン銀行	5,300	1,303.00	6,905,900	
栃木銀行	20,800	468.00	9,734,400	
北日本銀行	1,200	3,145.00	3,774,000	
東和銀行	71,000	127.00	9,017,000	
福島銀行	41,000	87.00	3,567,000	
大東銀行	20,000	164.00	3,280,000	
リコーリース	3,000	3,870.00	11,610,000	
イオンフィナンシャルサービス	24,100	2,393.00	57,671,300	
アコム	75,700	510.00	38,607,000	
ジャックス	21,000	539.00	11,319,000	
オリエントコーポレーション	81,500	192.00	15,648,000	
日立キャピタル	8,900	2,730.00	24,297,000	
アプラスフィナンシャル	18,100	109.00	1,972,900	
オリックス	266,900	1,775.50	473,880,950	
三菱UFJリース	95,600	622.00	59,463,200	
ジャフコ	6,300	4,465.00	28,129,500	
トモニホールディングス	31,100	535.00	16,638,500	
大和証券グループ本社	343,000	667.40	228,918,200	
野村ホールディングス	770,600	657.10	506,361,260	
岡三証券グループ	32,000	735.00	23,520,000	
丸三証券	12,000	930.00	11,160,000	
東洋証券	13,000	255.00	3,315,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	43,300	630.00	27,279,000	
光世証券	9,000	160.00	1,440,000	
水戸証券	11,700	307.00	3,591,900	
いちよし証券	8,400	941.00	7,904,400	
松井証券	21,500	919.00	19,758,500	
SOMPOホールディングス	78,800	4,364.00	343,883,200	
だいこう証券ビジネス	1,800	611.00	1,099,800	
日本取引所グループ	117,200	2,005.00	234,986,000	
マネックスグループ	39,900	306.00	12,209,400	
カブドットコム証券	28,100	376.00	10,565,600	
極東証券	5,100	1,607.00	8,195,700	
岩井コスモホールディングス	3,600	1,253.00	4,510,800	
藍澤証券	7,000	667.00	4,669,000	
フィデアホールディングス	36,600	183.00	6,697,800	
池田泉州ホールディングス	40,000	456.00	18,240,000	
アニコムホールディングス	2,600	2,588.00	6,728,800	

MS & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	112,600	3,869.00	435,649,400	
ソニーフィナンシャルホールディング ス	36,100	2,037.00	73,535,700	
マネーパートナーズグループ	4,800	513.00	2,462,400	
小林洋行	1,100	270.00	297,000	
第一生命ホールディングス	227,300	2,072.50	471,079,250	
東京海上ホールディングス	151,800	4,752.00	721,353,600	
イー・ギャランティ	1,100	2,575.00	2,832,500	
アサックス	700	1,660.00	1,162,000	
NECキャピタルソリューション	1,500	1,782.00	2,673,000	
T & Dホールディングス	137,400	1,740.00	239,076,000	
アドバンスクリエイト	900	1,967.00	1,770,300	
三井不動産	199,900	2,578.50	515,442,150	
三菱地所	280,400	2,011.50	564,024,600	
平和不動産	7,100	1,758.00	12,481,800	
東京建物	43,700	1,441.00	62,971,700	
ダイビル	9,700	1,127.00	10,931,900	
京阪神ビルディング	6,200	682.00	4,228,400	
住友不動産	90,000	3,367.00	303,030,000	
太平洋興発	16,000	103.00	1,648,000	
大京	70,000	234.00	16,380,000	
テーオーシー	14,600	1,017.00	14,848,200	
東京楽天地	6,000	591.00	3,546,000	
レオパレス21	47,600	712.00	33,891,200	
スターツコーポレーション	5,100	2,665.00	13,591,500	
フジ住宅	4,800	740.00	3,552,000	
空港施設	4,600	614.00	2,824,400	
明和地所	2,100	814.00	1,709,400	
ゴールドクレスト	3,400	2,396.00	8,146,400	
リログループ	20,000	2,163.00	43,260,000	
日本エスリード	1,500	1,756.00	2,634,000	
日神不動産	4,500	580.00	2,610,000	
日本エスコン	6,600	474.00	3,128,400	
タカラレーベン	16,200	481.00	7,792,200	
サンヨーハウジング名古屋	1,900	1,099.00	2,088,100	
イオンモール	24,300	2,054.00	49,912,200	
ファースト住建	1,400	1,563.00	2,188,200	
ランド	39,300	17.00	668,100	
東祥	1,100	5,090.00	5,599,000	
トーセイ	5,200	789.00	4,102,800	
穴吹興産	400	2,917.00	1,166,800	
エヌ・ティ・ティ都市開発	23,400	1,063.00	24,874,200	
サンフロンティア不動産	4,100	1,124.00	4,608,400	
エフ・ジェー・ネクスト	3,300	837.00	2,762,100	
インテリックス	1,200	837.00	1,004,400	
ランドビジネス	2,200	291.00	640,200	
グランディハウス	3,300	425.00	1,402,500	
東武鉄道	204,000	602.00	122,808,000	
相鉄ホールディングス	61,000	550.00	33,550,000	

東京急行電鉄	207,000	848.00	175,536,000
京浜急行電鉄	105,000	1,317.00	138,285,000
小田急電鉄	61,200	2,213.00	135,435,600
京王電鉄	107,000	925.00	98,975,000
京成電鉄	28,600	2,944.00	84,198,400
富士急行	10,000	1,173.00	11,730,000
新京成電鉄	5,000	415.00	2,075,000
東日本旅客鉄道	73,900	10,650.00	787,035,000
西日本旅客鉄道	36,800	7,916.00	291,308,800
東海旅客鉄道	31,800	17,885.00	568,743,000
西武ホールディングス	52,700	1,994.00	105,083,800
鴻池運輸	5,400	1,518.00	8,197,200
西日本鉄道	46,000	496.00	22,816,000
ハマキョウレックス	2,500	2,754.00	6,885,000
サカイ引越センター	1,800	4,400.00	7,920,000
近鉄グループホールディングス	384,000	425.00	163,200,000
阪急阪神ホールディングス	48,200	4,005.00	193,041,000
南海電気鉄道	81,000	569.00	46,089,000
京阪ホールディングス	86,000	701.00	60,286,000
神戸電鉄	9,000	393.00	3,537,000
名古屋鉄道	139,000	516.00	71,724,000
山陽電気鉄道	14,000	560.00	7,840,000
トランコム	1,100	5,440.00	5,984,000
日本通運	142,000	697.00	98,974,000
ヤマトホールディングス	68,300	2,244.00	153,265,200
山九	50,000	741.00	37,050,000
日新	16,000	519.00	8,304,000
丸運	2,100	282.00	592,200
丸全昭和運輸	13,000	451.00	5,863,000
センコーグループホールディングス	18,100	738.00	13,357,800
トナミホールディングス	8,000	425.00	3,400,000
ニッコンホールディングス	12,900	2,538.00	32,740,200
日本石油輸送	400	2,738.00	1,095,200
福山通運	23,000	715.00	16,445,000
セイノーホールディングス	27,100	1,485.00	40,243,500
神奈川中央交通	4,000	734.00	2,936,000
日立物流	8,000	2,591.00	20,728,000
丸和運輸機関	1,000	3,950.00	3,950,000
C & F ロジホールディングス	4,000	1,319.00	5,276,000
日本郵船	323,000	217.00	70,091,000
商船三井	200,000	339.00	67,800,000
川崎汽船	145,000	273.00	39,585,000
NSユナイテッド海運	17,000	230.00	3,910,000
明治海運	3,400	408.00	1,387,200
飯野海運	19,800	497.00	9,840,600
共栄タンカー	3,000	211.00	633,000
九州旅客鉄道	37,900	3,595.00	136,250,500
日本航空	67,100	3,504.00	235,118,400
A N A ホールディングス	709,000	378.60	268,427,400
パスコ	4,000	369.00	1,476,000

三菱倉庫	25,000	1,471.00	36,775,000
三井倉庫ホールディングス	22,000	309.00	6,798,000
住友倉庫	28,000	715.00	20,020,000
澁澤倉庫	10,000	364.00	3,640,000
ヤマタネ	1,900	1,618.00	3,074,200
東陽倉庫	6,500	298.00	1,937,000
乾汽船	2,800	840.00	2,352,000
日本トランスシティ	9,000	448.00	4,032,000
ケイヒン	7,000	160.00	1,120,000
中央倉庫	2,200	1,069.00	2,351,800
安田倉庫	3,000	741.00	2,223,000
東洋埠頭	11,000	185.00	2,035,000
宇徳	3,100	464.00	1,438,400
上組	46,000	1,165.00	53,590,000
サンリツ	900	698.00	628,200
キムラユニティー	1,000	1,156.00	1,156,000
キューソー流通システム	1,200	2,749.00	3,298,800
郵船ロジスティクス	3,500	1,003.00	3,510,500
近鉄エクスプレス	6,800	1,857.00	12,627,600
東海運	2,100	429.00	900,900
エーアイティー	2,300	1,008.00	2,318,400
内外トランスライン	1,100	1,292.00	1,421,200
東京放送ホールディングス	24,800	1,903.00	47,194,400
日本テレビホールディングス	34,400	1,829.00	62,917,600
朝日放送	3,700	802.00	2,967,400
テレビ朝日ホールディングス	10,300	1,927.00	19,848,100
スカパーJ S A Tホールディングス	24,500	475.00	11,637,500
テレビ東京ホールディングス	3,100	2,220.00	6,882,000
日本BS放送	1,300	1,256.00	1,632,800
ビジョン	1,200	2,445.00	2,934,000
U-NEXT	1,000	1,107.00	1,107,000
ワイヤレスゲート	1,700	1,464.00	2,488,800
コネクシオ	3,300	1,973.00	6,510,900
日本通信	32,400	165.00	5,346,000
クロップス	800	591.00	472,800
日本電信電話	302,600	5,294.00	1,601,964,400
KDDI	368,200	2,989.50	1,100,733,900
光通信	4,500	11,560.00	52,020,000
NTTドコモ	277,500	2,650.00	735,375,000
エムティーアイ	5,000	707.00	3,535,000
GMOインターネット	13,700	1,401.00	19,193,700
アйдママーケティングコミュニケーション	500	710.00	355,000
カドカワ	10,900	1,409.00	15,358,100
学研ホールディングス	1,300	3,220.00	4,186,000
ゼンリン	5,000	3,215.00	16,075,000
昭文社	2,200	717.00	1,577,400
インプレスホールディングス	3,100	141.00	437,100
東京電力ホールディングス	324,000	460.00	149,040,000
中部電力	125,800	1,451.00	182,535,800



関西電力	155,800	1,484.50	231,285,100
中国電力	52,800	1,228.00	64,838,400
北陸電力	37,400	996.00	37,250,400
東北電力	95,400	1,514.00	144,435,600
四国電力	34,400	1,301.00	44,754,400
九州電力	84,300	1,325.00	111,697,500
北海道電力	35,700	851.00	30,380,700
沖縄電力	6,200	2,611.00	16,188,200
電源開発	30,400	2,724.00	82,809,600
エフオン	1,900	1,004.00	1,907,600
イーレックス	4,800	1,015.00	4,872,000
東京瓦斯	410,000	571.30	234,233,000
大阪瓦斯	371,000	441.40	163,759,400
東邦瓦斯	95,000	787.00	74,765,000
北海道瓦斯	10,000	274.00	2,740,000
広島ガス	7,900	350.00	2,765,000
西部瓦斯	43,000	270.00	11,610,000
静岡ガス	11,700	772.00	9,032,400
メタウォーター	2,200	3,105.00	6,831,000
アイネット	2,100	1,328.00	2,788,800
松竹	25,000	1,398.00	34,950,000
東宝	24,700	3,385.00	83,609,500
エイチ・アイ・エス	6,500	3,450.00	22,425,000
東映	14,000	1,077.00	15,078,000
ラックランド	700	2,030.00	1,421,000
エヌ・ティ・ティ・データ	116,400	1,226.00	142,706,400
共立メンテナンス	6,500	3,245.00	21,092,500
イチネンホールディングス	4,100	1,217.00	4,989,700
建設技術研究所	2,500	1,135.00	2,837,500
スペース	2,200	1,455.00	3,201,000
アインホールディングス	4,900	7,990.00	39,151,000
燦ホールディングス	800	2,109.00	1,687,200
ピー・シー・エー	500	1,451.00	725,500
スバル興業	3,000	608.00	1,824,000
東京テアトル	15,000	142.00	2,130,000
タナベ経営	800	1,404.00	1,123,200
ビジネスブレイン太田昭和	600	1,048.00	628,800
ナガワ	700	3,965.00	2,775,500
よみうりランド	8,000	541.00	4,328,000
東京都競馬	2,700	2,977.00	8,037,900
常盤興産	1,500	1,771.00	2,656,500
カナモト	5,600	3,765.00	21,084,000
東京ドーム	15,900	1,022.00	16,249,800
D T S	3,900	3,445.00	13,435,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	14,500	3,495.00	50,677,500
シーイーシー	2,200	2,108.00	4,637,600
カプコン	8,800	2,551.00	22,448,800
西尾レントオール	3,200	3,580.00	11,456,000
アイ・エス・ピー	700	1,528.00	1,069,600

アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	20,000	36.00	720,000	
日本空港ビルデング	12,000	4,290.00	51,480,000	
トランス・コスモス	4,600	2,600.00	11,960,000	
乃村工藝社	8,500	2,293.00	19,490,500	
ジャステック	2,400	1,244.00	2,985,600	
S C S K	10,200	4,820.00	49,164,000	
藤田観光	1,300	3,730.00	4,849,000	
K N T - C Tホールディングス	23,000	199.00	4,577,000	
日本管財	3,400	1,938.00	6,589,200	
トーカイ	1,800	4,565.00	8,217,000	
白洋舎	400	2,971.00	1,188,400	
セコム	41,500	8,427.00	349,720,500	
日本システムウエア	1,200	1,769.00	2,122,800	
セントラル警備保障	1,800	1,915.00	3,447,000	
アイネス	4,700	1,120.00	5,264,000	
丹青社	6,900	1,120.00	7,728,000	
メイテック	4,600	4,655.00	21,413,000	
T K C	3,500	3,215.00	11,252,500	
アサツー ディ・ケイ	6,400	2,770.00	17,728,000	
富士ソフト	5,600	3,145.00	17,612,000	
応用地質	3,800	1,528.00	5,806,400	
船井総研ホールディングス	5,100	2,799.00	14,274,900	
N S D	8,000	2,007.00	16,056,000	
進学会	1,700	574.00	975,800	
丸紅建材リース	4,000	222.00	888,000	
オオバ	3,100	511.00	1,584,100	
コナミホールディングス	17,000	5,960.00	101,320,000	
いであ	700	1,040.00	728,000	
学究社	1,000	1,560.00	1,560,000	
ベネッセホールディングス	13,400	4,300.00	57,620,000	
イオンディライト	4,500	3,605.00	16,222,500	
ナック	2,400	1,007.00	2,416,800	
福井コンピュータホールディングス	1,100	3,620.00	3,982,000	
ニチイ学館	6,900	1,111.00	7,665,900	
ダイセキ	7,000	2,781.00	19,467,000	
ステップ	1,300	1,436.00	1,866,800	
日鉄住金物産	3,300	5,580.00	18,414,000	
元気寿司	900	2,230.00	2,007,000	
トラスコ中山	8,600	2,759.00	23,727,400	
ヤマダ電機	129,492	565.00	73,162,980	
オートバックスセブン	14,000	1,844.00	25,816,000	
モリト	3,000	916.00	2,748,000	
アークランドサカモト	6,400	1,491.00	9,542,400	
ニトリホールディングス	16,300	15,220.00	248,086,000	
グルメ杵屋	3,000	1,106.00	3,318,000	
愛眼	2,700	215.00	580,500	
ケーユーホールディングス	2,000	995.00	1,990,000	
吉野家ホールディングス	13,100	1,839.00	24,090,900	
加藤産業	5,900	2,910.00	17,169,000	

イノテック	3,200	650.00	2,080,000
イエローハット	3,600	2,723.00	9,802,800
松屋フーズ	1,800	4,135.00	7,443,000
JBCホールディングス	3,200	833.00	2,665,600
JKホールディングス	3,800	671.00	2,549,800
サガミチェーン	4,700	1,373.00	6,453,100
日伝	1,600	3,815.00	6,104,000
関西スーパーマーケット	3,100	1,507.00	4,671,700
ミロク情報サービス	3,700	2,283.00	8,447,100
北沢産業	3,100	202.00	626,200
杉本商事	2,200	1,543.00	3,394,600
因幡電機産業	5,300	4,240.00	22,472,000
王将フードサービス	2,800	4,285.00	11,998,000
プレナス	4,200	2,311.00	9,706,200
ミニストップ	2,800	2,326.00	6,512,800
アークス	7,100	2,379.00	16,890,900
パローホールディングス	8,100	2,486.00	20,136,600
パイテックホールディングス	1,500	1,412.00	2,118,000
ミスミグループ本社	43,000	2,606.00	112,058,000
藤久	300	1,720.00	516,000
アルテック	3,200	234.00	748,800
ベルク	1,700	4,925.00	8,372,500
大 庄	2,000	1,760.00	3,520,000
タキヒヨー	6,000	468.00	2,808,000
ファーストリテイリング	6,300	36,820.00	231,966,000
ソフトバンクグループ	169,700	8,934.00	1,516,099,800
蔵王産業	600	1,453.00	871,800
スズケン	17,200	3,635.00	62,522,000
サンドラッグ	14,300	4,060.00	58,058,000
サックスパー ホールディングス	3,500	1,235.00	4,322,500
ジェコス	2,600	1,332.00	3,463,200
ヤマザワ	800	1,780.00	1,424,000
やまや	800	1,642.00	1,313,600
ルネサスイーストン	3,400	591.00	2,009,400
ペルーナ	8,100	1,316.00	10,659,600
合計	57,780,192		89,496,710,140

## (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7月31日現在

資産総額	92,883,799,607円
負債総額	1,168,682,230円
純資産総額( - )	91,715,117,377円
発行済数量	56,622,531口
1口当たり純資産額( / )	1,619.76円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (3) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

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

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

### (4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、交換請求の受付、交換有価証券の交付および信託終了にかかる金銭の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額（平成29年7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7月31日現在）

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

## 2.運用計画、売買計画の決定

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成29年7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	1,168,722,685,027
追加型株式投資信託	862	11,823,622,172,099
単位型公社債投資信託	57	303,337,802,496
単位型株式投資信託	125	828,610,960,565
合計	1,082	14,124,293,620,187



### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第32期事業年度(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

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

委託会社の財務諸表に引き続き、D I A Mアセットマネジメント株式会社の第32期中間会計期間の中間財務諸表、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31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,951,736	27,972,477
金銭の信託	13,094,914	12,366,219
有価証券	-	297,560
未収委託者報酬	4,460,404	10,164,041
未収運用受託報酬	1,859,778	7,250,239
未収投資助言報酬	277,603	316,414
未収収益	205,097	52,278
前払費用	44,951	533,411
繰延税金資産	341,078	678,104
その他	40,689	445,717
流動資産計	33,276,255	60,076,462
固定資産		
有形固定資産	658,607	1,900,343
建物	1 29,219	1 1,243,812
車両運搬具	1 549	1 -
器具備品	1 184,683	1 656,235
建設仮勘定	444,155	295
無形固定資産	1,706,201	1,614,084
商標権	7	5
ソフトウェア	1,645,861	1,511,558
ソフトウェア仮勘定	53,036	98,483
電話加入権	7,148	3,934
電信電話専用施設利用権	146	103
投資その他の資産	6,497,772	10,055,336
投資有価証券	458,701	3,265,786
関係会社株式	3,229,196	3,306,296
長期差入保証金	2,040,945	1,800,827
前払年金費用	-	686,322
繰延税金資産	679,092	893,887
その他	89,835	102,215
固定資産計	8,862,580	13,569,764
資産合計	42,138,836	73,646,227

（単位：千円）

	第31期 （平成28年3月31日現在）	第32期 （平成29年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	966,681	1,169,128
未払金	2,055,332	4,745,195
未払収益分配金	-	1,027
未払償還金	49,873	57,332
未払手数料	1,744,274	4,062,695
その他未払金	261,185	624,140
未払費用	3,076,566	7,030,589
未払法人税等	1,223,957	1,915,556
未払消費税等	352,820	891,476
賞与引当金	728,769	1,432,264
役員賞与引当金	-	27,495
流動負債計	8,404,128	17,211,706
固定負債		
退職給付引当金	997,396	1,305,273
役員退職慰労引当金	154,535	-
時効後支払損引当金	-	216,466
本社移転費用引当金	-	942,315
固定負債計	1,151,932	2,464,055
負債合計	9,556,060	19,675,761
（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	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	-	17,124,479
利益剰余金	28,000,340	31,899,643
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	27,877,047	31,776,350
別途積立金	22,030,000	24,580,000
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	5,347,047	6,696,350
株主資本計	32,428,818	53,452,601
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	153,956	517,864
評価・換算差額等計	153,956	517,864
純資産合計	32,582,775	53,970,465
負債・純資産合計	42,138,836	73,646,227

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	30,188,445		56,355,754	
運用受託報酬	7,595,678		12,834,241	
投資助言報酬	993,027		1,002,482	
その他営業収益	724,211		378,715	
営業収益計		39,501,363		70,571,194
営業費用				
支払手数料	12,946,176		24,957,038	
広告宣伝費	468,931		838,356	
公告費	258		991	
調査費	7,616,390		15,105,578	
調査費	4,969,812		7,780,474	
委託調査費	2,646,578		7,325,104	
委託計算費	412,257		891,379	
営業雑経費	548,183		1,102,921	
通信費	34,855		51,523	
印刷費	436,756		926,453	
協会費	23,698		37,471	
諸会費	40		74	
支払販売手数料	52,833		87,399	
営業費用計		21,992,198		42,896,265
一般管理費				
給料	5,382,757		8,517,089	
役員報酬	242,446		220,145	
給料・手当	4,431,015		7,485,027	
賞与	709,295		811,916	
交際費	43,975		66,813	
寄付金	2,628		13,467	
旅費交通費	254,276		297,237	
租税公課	180,892		430,779	
不動産賃借料	1,128,367		1,961,686	
退職給付費用	226,460		358,960	
固定資産減価償却費	902,248		825,593	
福利厚生費	36,173		39,792	
修繕費	31,617		27,435	
賞与引当金繰入額	728,769		1,432,264	
役員賞与引当金繰入額	-		27,495	
役員退職慰労引当金繰入額	49,320		-	
役員退職慰労金	5,250		63,072	
機器リース料	140		210	
事務委託費	251,913		1,530,113	
事務用消耗品費	70,839		127,265	
器具備品費	14,182		271,658	
諸経費	214,532		129,981	
一般管理費計		9,524,346		16,120,918
営業利益		7,984,819		11,554,010

(単位:千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		2,079		537
受取配当金		25,274		51,036
時効成立分配金・償還金		-		103
為替差益		3,996		7,025
投資信託解約益		-		2
雑収入	1	6,693	1	18,213
営業外収益計		38,044		76,918
営業外費用				
投資信託解約損		-		31,945
投資信託償還損		-		47,201
金銭の信託運用損		305,368		552,635
時効成立後支払分配金・償還金		-		39
時効後支払損引当金繰入額		-		209,210
営業外費用計		305,368		841,031
経常利益		7,717,494		10,789,897
特別利益				
固定資産売却益	2	-	2	2,348
投資有価証券売却益		3,377		-
貸倒引当金戻入益		-		8,883
訴訟損失引当金戻入益		-		21,677
その他特別利益		-		746
特別利益計		3,377		33,655
特別損失				
固定資産除却損	3	624	3	23,600
固定資産売却損	4	2,653	4	10,323
投資有価証券評価損		-		12,085
ゴルフ会員権評価損		6,307		4,832
訴訟和解金		-		30,000
本社移転費用	5	-	5	1,511,622
特別損失計		9,584		1,592,463
税引前当期純利益		7,711,286		9,231,089
法人税、住民税及び事業税		2,557,305		2,965,061
法人税等調整額		27,424		177,275
法人税等合計		2,584,730		2,787,786
当期純利益		5,126,556		6,443,302

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

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				
		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	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	-	2,428,478	123,293	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491
当期変動額									
剰余金の配当									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
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
当期末残高	2,000,000	2,428,478	-	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047

	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	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	25,417,784	29,846,262	252,905	252,905	30,099,168
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	-	-			-
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)			98,949	98,949	98,949
当期変動額合計	2,582,556	2,582,556	98,949	98,949	2,483,607
当期末残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775

第32期(自平成28年4月1日至平成29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	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	-	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047
当期変動額									
剰余金の配当									2,544,000
別途積立金の積立						2,550,000			2,550,000
当期純利益									6,443,302
合併による増加			17,124,479	17,124,479					
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	17,124,479	17,124,479	-	2,550,000	-	-	1,349,302
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350

	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	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775
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	-	-			-
当期純利益	6,443,302	6,443,302			6,443,302
合併による増加		17,124,479			17,124,479
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)		-	363,907	363,907	363,907
当期変動額合計	3,899,302	21,023,782	363,907	363,907	21,387,689
当期末残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465

## 重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。 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。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度及び確定給付型企业年金制度（キャッシュバラン型）について、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 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 なお、一部の確定給付企業年金制度については、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</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> <p>(5) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(6) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。 なお、本社移転費用引当金繰入額は、本社移転費用に含めて表示しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。



## 会計方針の変更

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
<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）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。</p> <p>この結果、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42,532千円増加しております。</p>

## 追加情報

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
<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）を当事業年度から適用しております。</p> <p>2. 当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。</p> <p>これに伴い、当事業年度末日までに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

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第31期 （平成28年3月31日現在）	第32期 （平成29年3月31日現在）
建物	767,802	53,098
車両運搬具	4,374	-
器具備品	562,853	734,064

（損益計算書関係）

1. 関係会社項目

各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

（千円）

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
雑収入	4,715	8,183

2. 固定資産売却益の内訳

（千円）

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
建物	-	546
車両運搬具	-	696
器具備品	-	1,104

## 3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
器具備品	182	4,727
ソフトウェア	442	2,821
電話加入権	-	16,052

## 4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
建物	-	543
器具備品	2,653	9,779

## 5. 本社移転費用の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
本社移転費用引当金繰入額	-	942,315
旧本社不動産賃借料	-	418,583
賃貸借契約解約損	-	150,723

## (株主資本等変動計算書関係)

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) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの  
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

## 第32期（自平成28年4月1日 至平成29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	490	-	24,490
A種種類株式	-	15,510	-	15,510
合計	24,000	16,000	-	40,000

（注）普通株式及びA種種類株式の発行済株式総数の増加は、当社統合に伴う新株の発行による増加であります。

## 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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの  
平成29年6月21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29年6月21日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	3,200,000	80,000	平成29年3月31日	平成29年6月22日
	A種種 類株式					

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業を営んでおります。資金運用については、短期的な預金等に限定してあります。

当社が運用を行う投資信託の商品性を適正に維持するため、当該投資信託を特定金外信託を通じて、または直接保有しております。なお、特定金外信託を通じて行っているデリバティブ取引は後述するリスクを低減する目的で行っております。当該デリバティブ取引は、実需の範囲内でのみ利用することとしており、投機的な取引は行わない方針であります。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、相手先の信用リスクに晒されてあります。

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

営業債権の相手先の信用リスクに関しては、当社の信用リスク管理の基本方針に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行うとともに、主な相手先の信用状況を把握する体制としています。

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

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

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

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第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) 未収委託者報酬	4,460,404	4,460,404	-
(4) 未収運用受託報酬	1,859,778	1,859,778	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	381,005	381,005	-
資産計	32,747,840	32,747,840	-
(1) 未払手数料	1,744,274	1,744,274	-
負債計	1,744,274	1,744,274	-

第32期(平成29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	27,972,477	27,972,477	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	12,366,219	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	10,164,041	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	7,250,239	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	3,225,878	3,225,878	-
資産計	60,978,855	60,978,855	-
(1) 未払手数料	4,062,695	4,062,695	-
負債計	4,062,695	4,062,695	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

## (5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、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) 未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
非上場株式	77,696	337,468
関係会社株式	3,229,196	3,306,296

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 第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) 現金・預金	12,951,736	-	-	-
(2) 金銭の信託	13,094,914	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	4,460,404	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	1,859,778	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	-	-	-	-

## 第32期(平成29年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	27,972,477	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,366,219	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	10,164,041	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	7,250,239	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	297,560	320,736	888,110	12,660

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第31期の貸借対照表計上額3,229,196千円、第32期の貸借対照表計上額3,306,296千円)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

## 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
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	-	-	-
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。

第32期(平成29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	609,710	146,101	463,608
投資信託	2,384,278	2,091,387	292,891
小計	2,993,988	2,237,489	756,499
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	231,889	241,951	10,061
小計	231,889	241,951	10,061
合計	3,225,878	2,479,440	746,438

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額337,468千円)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「其他有価証券」には含めておりません。

## 3. 当該事業年度中に売却した其他有価証券

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)
株式	5,927	3,377	-

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
投資信託	717,905	2	79,146

(注) 投資信託の「売却額」、「売却の合計額」及び「売却損の合計額」は、解約又は償還によるものであります。

## 4. 減損処理を行った有価証券

第32期において、有価証券について12,085千円(其他有価証券)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、確定給付型の制度として確定給付企業年金制度(積立型制度であります)及び退職一時金制度(非積立型制度であります)を採用しております。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。

なお、当社が有する確定給付企業年金制度の一部は、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(複数事業主制度を含む)

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期	第32期
	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	973,035	1,086,550
勤務費用	134,944	189,127
利息費用	8,660	10,905
数理計算上の差異の発生額	21,441	89,303
退職給付の支払額	51,531	144,062
過去勤務費用の発生額	-	-
合併による増加	-	1,486,547
退職給付債務の期末残高	1,086,550	2,718,372

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期	第32期
	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
年金資産の期首残高	-	-
期待運用収益	-	16,033
数理計算上の差異の発生額	-	1,894
事業主からの拠出額	-	37,402
退職給付の支払額	-	28,876
合併による増加	-	1,336,984
年金資産の期末残高	-	1,363,437

## (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

(千円)

	第31期	第32期
	(平成28年3月31日現在)	(平成29年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	-	1,275,346
年金資産	-	1,363,437
	-	88,090
非積立型制度の退職給付債務	1,086,550	1,443,026
未積立退職給付債務	1,086,550	1,354,935
未認識数理計算上の差異	79,449	430,203
未認識過去勤務費用	9,704	4,852
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	997,396	919,879
退職給付引当金	997,396	1,245,019
前払年金費用	-	325,140
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	997,396	919,879



## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
勤務費用	134,944	189,127
利息費用	8,660	10,905
期待運用収益	-	16,033
数理計算上の差異の費用処理額	31,542	78,229
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
その他	2,268	7,498
確定給付制度に係る退職給付費用	182,267	274,580

## (5) 年金資産に関する事項

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。

(千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
株式	-	31.5%
債券	-	29.0%
共同運用資産	-	24.1%
生命保険一般勘定	-	10.5%
現金及び預金	-	4.6%
合計	-	100.0%

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

主要な数理計算上の計算基礎

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
割引率	0.89%	0.02% ~ 1.09%
長期期待運用収益率	-	2.50%
予想昇給率	1.00% ~ 8.73%	1.00% ~ 8.73%

## 3. 簡便法を適用した確定給付制度

## (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

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	-	-
退職給付費用	-	22,562
退職給付の支払額	-	-
制度への拠出額	-	36,177
合併による増加	-	287,313
退職給付引当金の期末残高	-	300,927

## (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

(千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	-	789,261
年金資産	-	1,150,443
		361,181
非積立型制度の退職給付債務	-	60,254
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	-	300,927
退職給付引当金	-	60,254
前払年金費用	-	361,181
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	-	300,927

## (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 - 千円 当事業年度22,562千円

## 4. 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44,193千円、当事業年度61,817千円であります。

## (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31期	第32期
	(平成28年3月31日現在)	(平成29年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	79,702	124,081
未払事業所税	5,581	11,054
賞与引当金	224,898	441,996
未払法定福利費	28,395	80,909
資産除去債務	13,244	86,421
減価償却超過額(一括償却資産)	3,389	10,666
減価償却超過額	136,503	116,920
繰延資産償却超過額(税法上)	1,339	32,949
退職給付引当金	305,591	399,808
役員退職慰労引当金	47,318	-
時効後支払損引当金	-	66,282
ゴルフ会員権評価損	3,768	14,295
関係会社株式評価損	166,740	191,166
未払給与	-	12,344
本社移転費用引当金	-	289,865
その他有価証券評価差額金	1,196	-
その他	2,500	17,552
繰延税金資産小計	1,020,171	1,896,316
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,020,171	1,896,316
繰延税金負債		
前払年金費用	-	210,151
その他有価証券評価差額金	-	114,171
繰延税金負債合計	-	324,323
繰延税金資産の純額	1,020,171	1,571,992

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳  
 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

## （企業結合等関係）

当社（以下「AMOne」という）は、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しております。

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

会社名	DIAM （存続会社）	MHAM （消滅会社）
合併比率（*）	1	0.0154

（\*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社であるMHFGに対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないIA種類株式15,510株を交付しました。

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率 50.00%

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成28年10月1日から平成29年3月31日まで

## (2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

## (3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

b. 発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

## (4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451,657千円

うち現金・預金 11,605,537千円

うち金銭の信託 11,792,364千円

b. 負債の額 負債合計 9,256,209千円

うち未払手数料及び未払費用 4,539,592千円

(注) 顧客関連資産に配分された金額及びそれに係る繰延税金負債は、資産の額及び負債の額には含まれておりません。

## (5) のれん以外の無形固定資産に配分された金額及び主要な種類別の内訳並びに全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030,000千円

## b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030,000千円

## c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	123,277,747千円
資産合計	123,277,747千円
流動負債	- 千円
固定負債	14,647,470千円
負債合計	14,647,470千円
純資産	108,630,277千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん金額74,319,216千円及び顧客関連資産の金額50,434,199千円が含まれております。

## (2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,483,082千円
経常利益	4,483,082千円
税引前当期純利益	4,483,082千円
当期純利益	3,693,863千円
1株当たり当期純利益	115,512円36銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,595,800千円が含まれております。

## (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、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

第31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)及び第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

## (1) サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 親会社及び法人主要株主等

第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

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

## 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せん。

## (2) 子会社及び関連会社等

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	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	912,600	-	-
									473,948	未払費用	157,130

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 当社預り資産の運用の顧問料は、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	投資信託の 販売代行手 数料	3,023,040	未払手 数料	372,837
	みずほ第 一ファイ 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  金融技術の 開発業務委 託	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	557,013  8,540	未払費 用  未払金	292,861  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) 信託報酬の 支払	700,000  8,336	金銭の 信託	13,094,914

## 第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の 関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投 資信託の販 売	投資信託の 販売代行手 数料	4,530,351	未払 手数料	767,732
	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) 信託報酬の 支払	100,000  7,080	金銭の 信託	12,366,219
	みずほ証 券株式 会社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定投 資信託の販 売	投資信託の 販売代行手 数料	5,061,766	未払 手数料	1,166,212
	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	-	-	投資一任契 約の締結	運用受託報 酬の受取	2,520,431	未収運 用受託 報酬	2,722,066

## 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) 当社預り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) 業務委託料は、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4) 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。
- (注5) 運用受託報酬は、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6) 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せん。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

### (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

当事業年度において、重要な関連会社は株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティングであり、その要約財務諸表は以下のとおりであります。

(単位：千円)

株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティング		
	前事業年度	当事業年度
流動資産合計	-	7,449,532
固定資産合計	-	124,292
流動負債合計	-	1,665,547
固定負債合計	-	114,110
純資産合計	-	5,794,167
営業収益	-	1,093,658
税引前当期純利益	-	5,546,153
当期純利益	-	3,891,816

### (1株当たり情報)

	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	1,357,615円66銭	1,349,261円64銭
1株当たり当期純利益金額	213,606円51銭	201,491円22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31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
当期純利益金額	5,126,556千円	6,443,302千円
普通株主及び普通株主と同等の 株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の 株式に係る当期純利益金額	5,126,556千円	6,443,302千円
普通株式及び普通株式と同等の 株式の期中平均株式数	24,000株	31,978株
(うち普通株式)	(24,000株)	(24,244株)
(うちA種種類株式)	(-)	(7,734株)

(注1) A種種類株式は、剰余金の配当請求権及び残余財産分配請求権について普通株式と同等の権利を有しているため、1株当たり情報の算定上、普通株式に含めて計算しています。

(重要な後発事象)

当社は、株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティング(以下、同社といいます。)の株式のうち当社が保有している全株式について、同社が実施する自己株式取得に伴い、平成29年4月1日付で同社へ譲渡いたしました。

これにより、関係会社株式売却益として1,492百万円の特別利益を計上する予定であります。

(参考)DIAMアセットマネジメント株式会社の経理状況

1. 委託会社であるDIAMアセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という。)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)、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. 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。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会御中

## 新日本有限責任監査法人

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

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

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

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

### 強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

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

以上

---

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

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

## (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。</p> <p>なお、当中間会計期間において、中間財務諸表への影響額はありません。</p>

## 追加情報

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

## 注記事項

（中間貸借対照表関係）

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

（中間損益計算書関係）

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

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第32期中間会計期間（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

## 1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2．配当に関する事項

## 配当金支払額

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

## （金融商品関係）

第32期中間会計期間末（平成28年9月30日現在）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

## （注1）金融商品の時価の算定方法

## 資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 投資有価証券

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

## 負債

### (1) 未払法人税等

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

### (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

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

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

## (有価証券関係)

第32期中間会計期間末  
(平成28年9月30日現在)

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

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

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

## (金銭の信託関係)

第32期中間会計期間末  
(平成28年9月30日現在)

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

## (資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

第32期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

(1) サービスごとの情報

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

(注) 一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

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



## (1株当たり情報)

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

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

## （重要な後発事象）

第32期中間会計期間  
（自平成28年4月1日 至平成28年9月30日）

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

## 1．結合当事企業

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

## 2．企業結合日

平成28年10月1日

## 3．企業結合の方法

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

## 4．結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5．交付した株式数

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

## 6．企業結合の主な目的

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

## 7．取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 8．実施予定の会計処理

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

(参考)みずほ投信投資顧問株式会社の経理状況

当該(参考)において、みずほ投信投資顧問株式会社を「当社」という。

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

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

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

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

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

みずほ投信投資顧問株式会社

取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

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

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

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

## 強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

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

以上

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

2.XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会御中

## 新日本有限責任監査法人

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

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

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

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

### 強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

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

以上

---

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

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

## (1)貸借対照表

	（単位： 千円）	
	前事業年度 （平成27年 3月31日）	当事業年度 （平成28年 3月31日）
<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						
	利益準備金	利益剰余金				利益剰余金合計	株主資本合計
		その他利益剰余金					
	配当準備積立金	退職慰労積立金	別途積立金	繰越利益剰余金			
当期首残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	6,988,395	17,121,579	23,883,654
当期変動額							
剰余金の配当					352,443	352,443	352,443
当期純利益					1,103,790	1,103,790	1,103,790
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)							
当期変動額合計					751,347	751,347	751,347
当期末残高	128,584	104,600	100,000	9,800,000	7,739,742	17,872,927	24,635,002

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位: 千円)

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

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

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

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

### 2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

### 3. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産（リース資産を除く）

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

#### (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

#### (3) リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定率法を採用しております。

### 4. 引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

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

#### (2) 賞与引当金

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

#### (3) 退職給付引当金（前払年金費用）

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

#### (4) 役員退職慰労引当金

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

#### (5) 時効後支払損引当金

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

### 5. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

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

### 6. ヘッジ会計の方法

#### (1) ヘッジ会計の方法

時価ヘッジによっております。

#### (2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段...株価指数先物取引

ヘッジ対象...有価証券

#### (3) ヘッジ方針

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

#### (4) ヘッジの有効性評価の方法

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

## 7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

## 未適用の会計基準等

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

## 1. 概要

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

## 2. 適用予定日

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

## 3. 当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、軽微であります。

## 会計上の見積りの変更に関する注記

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

## 追加情報

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

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

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

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

## （損益計算書関係）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

## 1 減損損失

当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

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

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

## 2 事業再構築費用

事業再構築に伴うグループ会社への転籍関連費用であります。

## 3 外国税負担損失

証券投資信託に係る外国税負担額であります。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当するものはありません。

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

## 1 発行済株式に関する事項

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

## 2 配当に関する事項

## （1）配当金支払額

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

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1 発行済株式に関する事項

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

## 2 自己株式に関する事項

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

## （変動事由の概要）

平成28年1月6日の株主総会決議による自己株式の取得 13,662株

## 3. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

## (リース取引関係)

## 1. ファイナンス・リース取引（借主側）

## 所有権移転外ファイナンス・リース取引

## リース資産の内容

## 有形固定資産

主として、事務用機器及び車両運搬具であります。

## リース資産の減価償却の方法

重要な会計方針「3. 固定資産の減価償却方法」に記載のとおりであります。

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

デリバティブは、当社が保有する特定の有価証券の投資リスクを低減させる目的で利用しており、投機的な取引は行わない方針であります。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

営業債権の相手先の信用リスクに関しては、当社の信用リスク管理の基本方針に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行うとともに、主な相手先の信用状況を半期ごとに把握する体制としております。

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

## 市場リスクの管理

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

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

資 産

## (1) 現金及び預金

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

## (2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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

## (4) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」を参照ください。

負 債

## (1) 未払手数料

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

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」を参照ください。

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

(単位:千円)

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

上記については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」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 其他有価証券のうち 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 其他有価証券のうち 満期のあるもの 証券投資信託	82,540	-	-	-	-	2,395,185
合計	24,881,762	-	-	-	-	2,395,185

## (有価証券関係)

## 1 その他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

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

## 当事業年度(平成28年3月31日)

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

2 当事業年度中に売却したその他有価証券  
該当するものではありません。

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

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

## 当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

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

(デリバティブ取引関係)

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

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

## 当事業年度(平成28年3月31日)

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

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## 株式関連

前事業年度(平成27年3月31日)

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

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

当事業年度(平成28年3月31日)

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

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

## (3) 退職給付費用

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

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度17,436千円、当事業年度17,574千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

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

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

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

## (資産除去債務関係)

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

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

## (セグメント情報等)

## [セグメント情報]

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

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## [ 関連情報 ]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 売上高

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 売上高

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

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

## [ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当するものはありません。

## (関連当事者情報)

## 1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

上記の取引については、一般取引条件と同様に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

## (1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## (1) 中間貸借対照表

(単位: 千円)

第54期中間会計期間  
(平成28年9月30日)

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



## (2) 中間損益計算書

(単位: 千円)

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第54期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

(単位： 千円)

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

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

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

## 重要な会計方針

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却方法

## (1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

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

## (2) 賞与引当金

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

## (3) 退職給付引当金（前払年金費用）

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

## (4) 役員退職慰労引当金（執行役員に対する退職慰労引当金）

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

## (5) 時効後支払損引当金

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

## 4. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

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

## 5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

## 追加情報

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

## 注記事項

（中間貸借対照表関係）

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

## (中間損益計算書関係)

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

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第54期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

## 1 発行済株式に関する事項

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

## 2. 自己株式に関する事項

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

## 3 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

## (金融商品関係)

第54期中間会計期間(平成28年9月30日)

## 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位： 千円)

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

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

## 資 産

## (1) 現金及び預金

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

## (2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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

## (4) 投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

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

## 負債

## (1) 未払手数料

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

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

区分	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	60,720

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

## (有価証券関係)

第54期中間会計期間（平成28年9月30日）

## 1 其他有価証券

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

## (資産除去債務関係)

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

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

## (セグメント情報等)

## [セグメント情報]

第54期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## [関連情報]

第54期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 売上高

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

## (2) 有形固定資産

有形固定資産はすべて本邦に所在しております。

## 3 主要な顧客ごとの情報

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

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

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

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額は、以下のとおりであります。

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

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

(重要な後発事象)

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

1. 企業結合日  
平成28年10月1日

2. 企業結合の方法

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

（参考）新光投信株式会社の経理状況

1．財務諸表の作成方法について

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

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

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

2．監査証明について

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

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

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

新光投信株式会社  
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 伊藤 志保

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 福村 寛

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第56期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

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

### 強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

### 利害関係

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

以上

- ( ) 1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

### 中間監査意見

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

### 強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

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

以上

---

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

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。

## (1) 貸借対照表

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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



## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

## 重要な会計方針

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 関連会社株式

総平均法による原価法

#### (2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

総平均法による原価法

### 2．固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8～18年

構築物 20年

器具備品 2～20年

#### (2) 無形固定資産

定額法。

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

### 3．引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

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

#### (2) 役員賞与引当金

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

#### (3) 外国税支払損失引当金

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

#### (4) 訴訟損失引当金

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

#### (5) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

#### 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

#### （6）役員退職慰労引当金

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

#### （7）執行役員退職慰労引当金

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

#### 4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

#### 5．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### （1）消費税等の会計処理

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

#### （未適用の会計基準）

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

##### （1）概要

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

##### （2）適用予定日

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

##### （3）当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

#### （追加情報）

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

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

## 注記事項

## (貸借対照表関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

2. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

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

## (損益計算書関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

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

2. 特別損失における合併関連費用の内訳は次のとおりであります。

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

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)

## 1. 発行済株式に関する事項

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

## 2. 自己株式に関する事項

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

## 3. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

## 1. 発行済株式に関する事項

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

(変動事由の概要)

自己株式の消却

## 2. 自己株式に関する事項

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

(変動事由の概要)

自己株式の消却

## 3. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（預金の預入先の信用リスク）の管理

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

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

市場リスク（価格変動リスク及び為替変動リスク）の管理

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

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

流動性リスクの管理

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

（注）1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## (1) 現金及び預金

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

## (2) 有価証券及び投資有価証券

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

## (3) 未収委託者報酬

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

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

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

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



## (注) 3. 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 前事業年度(平成27年3月31日)

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

## 当事業年度(平成28年3月31日)

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

## （有価証券関係）

## 1．関連会社株式

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

## 2．その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

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

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

当事業年度(平成28年3月31日)

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

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

### 3.売却したその他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

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

当事業年度(平成28年3月31日)

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

## 4. 減損処理を行った有価証券

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

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

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)

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

## (2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

## (4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

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

## (5)年金資産に関する事項

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

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6)数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

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

## （税効果会計関係）

## 1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

（注）繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

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

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

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

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

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

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

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

セグメント情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）及び

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）及び

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当社は、単一セグメントであるため、記載を省略しております。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。



## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

## 関連当事者情報

## 1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る)等

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

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

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

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

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

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

(注) 2. 取引条件及び取引条件の決定方法等

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## 親会社情報

みずほ証券株式会社（非上場）

## （1株当たり情報）

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

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

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

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

## 中間財務諸表

## (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

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

(単位：千円)

当中間会計期間  
(平成28年9月30日)

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

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

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

## (3)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年4月 1日 至 平成28年9月30日）

（単位：千円）

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

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

[ 注記事項 ]

（重要な会計方針）

1．資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

関連会社株式

総平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

総平均法による原価法

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

器具備品

定率法

なお、主な耐用年数は2～20年であります。

(2) 無形固定資産

定額法。

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

3．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 訴訟損失引当金

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

(3) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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



## 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

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

## (中間貸借対照表関係)

## 1. 資産の金額から直接控除している減価償却累計額の額

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

## 2. 消費税等の取扱い

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

## (中間損益計算書関係)

## 1. 減価償却実施額は、次のとおりであります。

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

## (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

## 1. 発行済株式に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

## （金融商品関係）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

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

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

## (1) 現金及び預金

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

## (2) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

## (3) 未収委託者報酬

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

## (4) 未払手数料

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

（注）2．時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	276,151

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

## （有価証券関係）

当中間会計期間（平成28年9月30日）

## 1．関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

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

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

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は、資産運用業という単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

当中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

## [ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

該当事項はありません。

## [ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

該当事項はありません。

## [ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

該当事項はありません。

## ( 1株当たり情報 )

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

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

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

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

## ( 追加情報 )

## 役員賞与引当金

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

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

## 役員退職慰労引当金

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

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

#### 執行役員退職慰労引当金

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

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

#### 繰延税金資産

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

#### (重要な後発事象)

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

1. 企業結合日  
平成28年10月1日

2. 企業結合の方法

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1)受託会社

## a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

## b. 資本金の額

平成29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	61,450	「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 ) 35,765	「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。
B N Pパリバ証券株式会社	102,025	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
メリルリンチ日本証券株式会社	( 1 ) 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29年3月末日現在

( 1 ) 平成28年12月31日現在

## 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

## 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。



### 第3【その他】

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

## 独立監査人の監査報告書

平成29年6月7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、アセットマネジメントOne株式会社の平成29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。

#### 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成29年8月2日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 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One ETF トピックスの平成29年1月9日から平成29年7月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**監査意見**

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、One ETF トピックスの平成29年7月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。