

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年8月8日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 西 恵正
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	三木谷 正直
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	動的パッケージファンド<DC年金>
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券の金額】	継続募集額(平成29年8月9日から平成30年2月8日まで) 5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

動的パッケージファンド<DC年金>（以下「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】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」と称することがあります。）です。

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ることとし、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、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社は、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。

また、当ファンドについて、委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供された信用格付けまたは信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供される予定の信用格付けはありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除して求めた金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した価額をいいます。ただし、便宜上1万口当たりに換算した価額で表示されることがあります。

基準価額については、委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	<a href="http://www.am-one.co.jp/">http://www.am-one.co.jp/</a>	0120-104-694

注：電話番号はコールセンターのものです（以下同じ）。

電話によるお問い合わせは、営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。（以下同じ。）

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

1円以上1円単位

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

平成29年 8月 9日から平成30年 2月 8日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドの申込取扱場所（以下「販売会社」といいます。）については、下記の委託会社の照会先までお問い合わせください。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	<a href="http://www.am-one.co.jp/">http://www.am-one.co.jp/</a>	0120-104-694

(9) 【払込期日】

取得申込金額は、販売会社が定める期日までに、販売会社にお支払いいただきます。なお、取得申込金額には利息は付されません。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、アセットマネジメントOne株式会社（「委託者」または「委託会社」といいます。）の指定する口座を経由して、みずほ信託銀行株式会社（「受託者」または「受託会社」といいます。）の指定するファンド口座（受託会社が再信託している場合は、当該再信託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】

取得申込金額は、お申込みの販売会社にお支払いください。なお、払込取扱場所については、下記の委託会社の照会先までお問い合わせください。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	<a href="http://www.am-one.co.jp/">http://www.am-one.co.jp/</a>	0120-104-694

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる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】

投資信託振替制度における振替受益権について

当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。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載

の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

投資信託振替制度(以下「振替制度」といいます。)においては、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します。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行われます。

## 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】

MHAM日本債券インデックスマザーファンド受益証券、MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券、MHAM TOPIXマザーファンド受益証券およびMHAM外国株式インデックスマザーファンド受益証券（以下、各々を「主要投資対象マザーファンド受益証券」といいます。）への投資を通じて、国内外の公社債および株式に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

##### <ファンドの特色>

国内外の公社債・株式へ分散投資を行い、安定した収益の獲得を目指します。

国内債券、外国債券、国内株式および外国株式を主要投資対象とし、各資産のリスク（価格変動性）や、投資環境分析を勘案して配分比率を決定します。

資産配分比率は、リスク均等配分を基本としつつ、投資環境分析による各資産の魅力判定に応じた機動的な変更を行うことで、安定した収益の獲得を目指します。

\* ファンドの特色における「リスク」とは、各資産の価格変動やファンドの基準価額の振れ幅の大きさのことをいいます。

各資産およびファンド全体のリスクの状況を管理し、配分比率を調整することにより、基準価額の変動を抑制することを目指します。

各資産のリスク水準の変化に応じて、各資産への配分比率の変更を行います。また、ファンド全体での価格変動リスクが高いと判断した場合には、MHAM国内短期債券マザーファンド受益証券（以下、各主要投資対象マザーファンド受益証券を含め「マザーファンド受益証券」といいます。）への投資を通じて、国内短期債券や短期金融商品に投資を行います。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

5,000億円を上限に信託金を追加することができます。なお、信託金の上限額については、受託会社と合意のうえ、変更することができます。

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法において、以下のように分類・区分されます。

##### <商品分類>

・商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉となる資産）
---------	--------	------------------------

単位型	国内	株式
追加型	海外	債券
	内外	不動産投信
		その他資産 ( )
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・商品分類定義

追加型	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う。
内外	目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書又は投資信託約款において、「株式」、「債券」、「不動産投信」及び「その他資産」のうち、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

< 属性区分 >

・属性区分表

投資対象資産 (実際の組入資産)	決算頻度	投資対象地域	投資形態
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリーファンド <sup>①</sup>
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回	日本 北米 欧州 アジア オセアニア	ファンド・オブ・ファンズ
不動産投信	年4回	中南米 アフリカ 中近東 (中東)	為替ヘッジ <sup>②</sup>
その他資産 (投資信託証券) <sup>①</sup>	年6回 (隔月)	エマージング	あり ( )
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型	年12回 (毎月)		なし
	日々		
	その他 ( )		

① 当ファンドが投資信託証券への投資を通じて実質的な投資対象とする資産は、「資産複合(株式・債券)/資産配分変更型」です。

② 「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## ・属性区分定義

その他資産 （投資信託証券）	目論見書又は投資信託約款において、主として「株式」、「債券」及び「不動産投信」以外の資産に投資する旨の記載があるものをいい、括弧内の記載はその該当資産を表す。
資産複合 （株式・債券） 資産配分変更型	目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、括弧内の記載はその該当複数資産を表す。 当ファンドは、主としてマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式および債券に投資を行います。
年1回	目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル （日本を含む）	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が、日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

- （注1）商品分類および属性区分は、委託会社が目論見書または約款の記載内容等に基づいて分類しています。
- （注2）当ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。
- （注3）当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式および債券を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

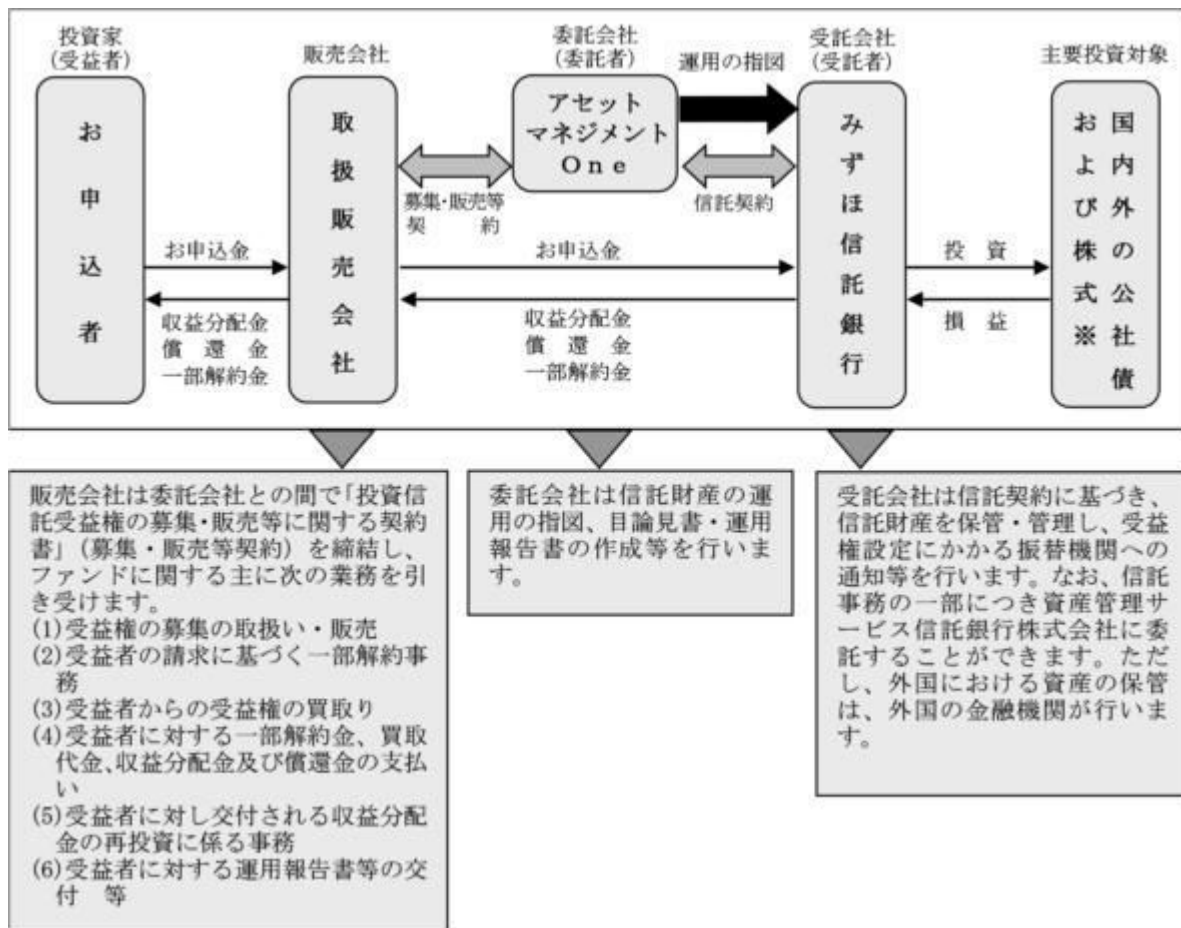
## （2）【ファンドの沿革】

平成27年11月30日 信託契約締結、当ファンドの設定・運用開始

平成28年10月1日 ファンドの委託会社としての業務をみずほ投信投資顧問株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継

## （3）【ファンドの仕組み】

## 当ファンドの運営の仕組み

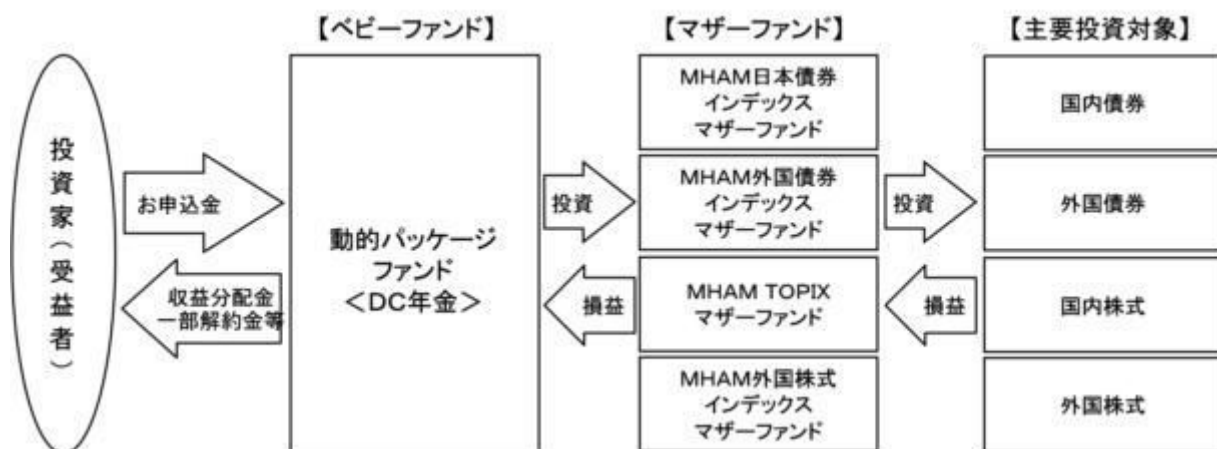


主要投資対象である国内外の公社債および株式には、主として、各マザーファンドを通じて投資を行います。

## ファミリーファンド方式の仕組み

当ファンドは、下図のマザーファンドを通じて各資産への投資を行う「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

## ファミリーファンド方式



ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資することにより、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。資産配分の決定の際、一部のマザーファンド受益証券への投資を行わない場合があります。また、ファンド全体のリスクの状況によっては、上記のマザーファンドを通じた投資のほか、MHAM国内短期債券マザーファンドを通じて国内短期債券に投資する場合や、信託財産の純資産総額の50%を上限に短期金融商品等へ直接投資する



場合があります。

マザーファンドのほかに、株式、公社債等に直接投資する場合があります。

## 委託会社の概況

1．資本金の額 20億円（平成29年5月末日現在）

2．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、商号を興銀第一ライフ・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株式会社に變更

3．大株主の状況（平成29年5月末日現在）

名称	住所	所有株式数	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】

#### 基本方針

この投資信託は、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

#### 運用方法

##### 1．主要投資対象

MHAM日本債券インデックスマザーファンド受益証券、MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券、MHAM TOPIXマザーファンド受益証券およびMHAM外国株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

## 2. 投資態度

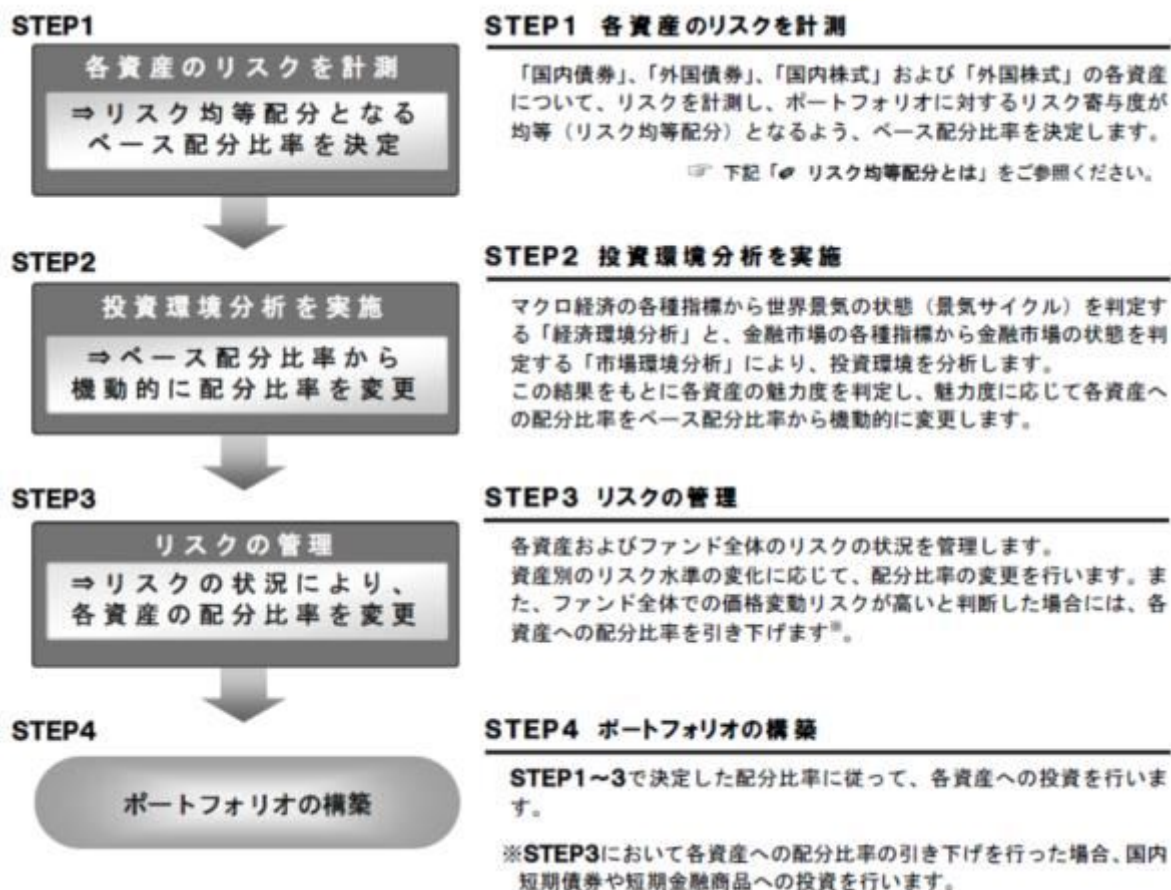
- a. 主として、各主要投資対象マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の公社債および株式に投資を行います。
- b. 各主要投資対象マザーファンド受益証券への投資割合については、各マザーファンドが主要投資対象とする資産のリスク（価格変動性）や、投資環境分析等を勘案のうえ配分比率を決定します。ただし、ファンドの価格変動リスクを勘案し、MHAM国内短期債券マザーファンド受益証券への投資を行う場合、および信託財産の純資産総額の50%を上限に預金等の短期金融商品への直接投資を行う場合があります。
- c. 実質組入 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。  
「実質組入」とは、投資対象である当該資産につき、当ファンドの信託財産に属する当該資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該資産のうち当ファンドの信託財産に属するとみなした額との合計額をいいます。（以下同じ。）
- d. マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。
- e. 市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### ファンドの投資プロセス

#### 1. 当ファンドの投資プロセス

当ファンドは、以下の投資プロセスにより、各資産への投資割合を決定し、当ファンドを管理します。

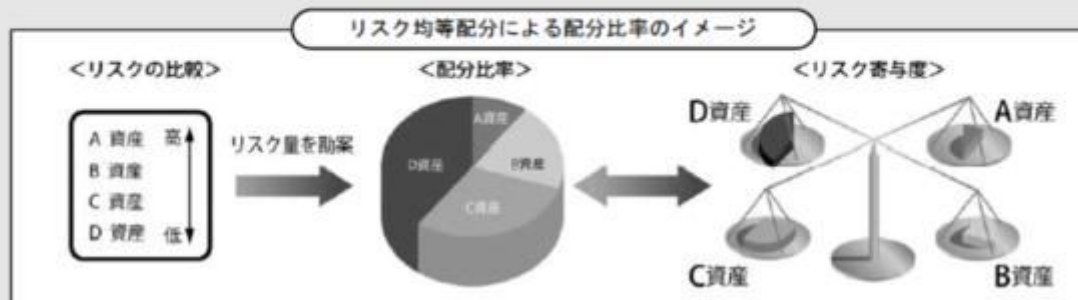
各資産への配分比率は、特定の資産へのリスク集中回避を意図した「リスク均等配分」をベースに、投資環境分析やリスクの状況を踏まえて機動的に変更します。



上記のプロセスは、今後変更される場合があります。

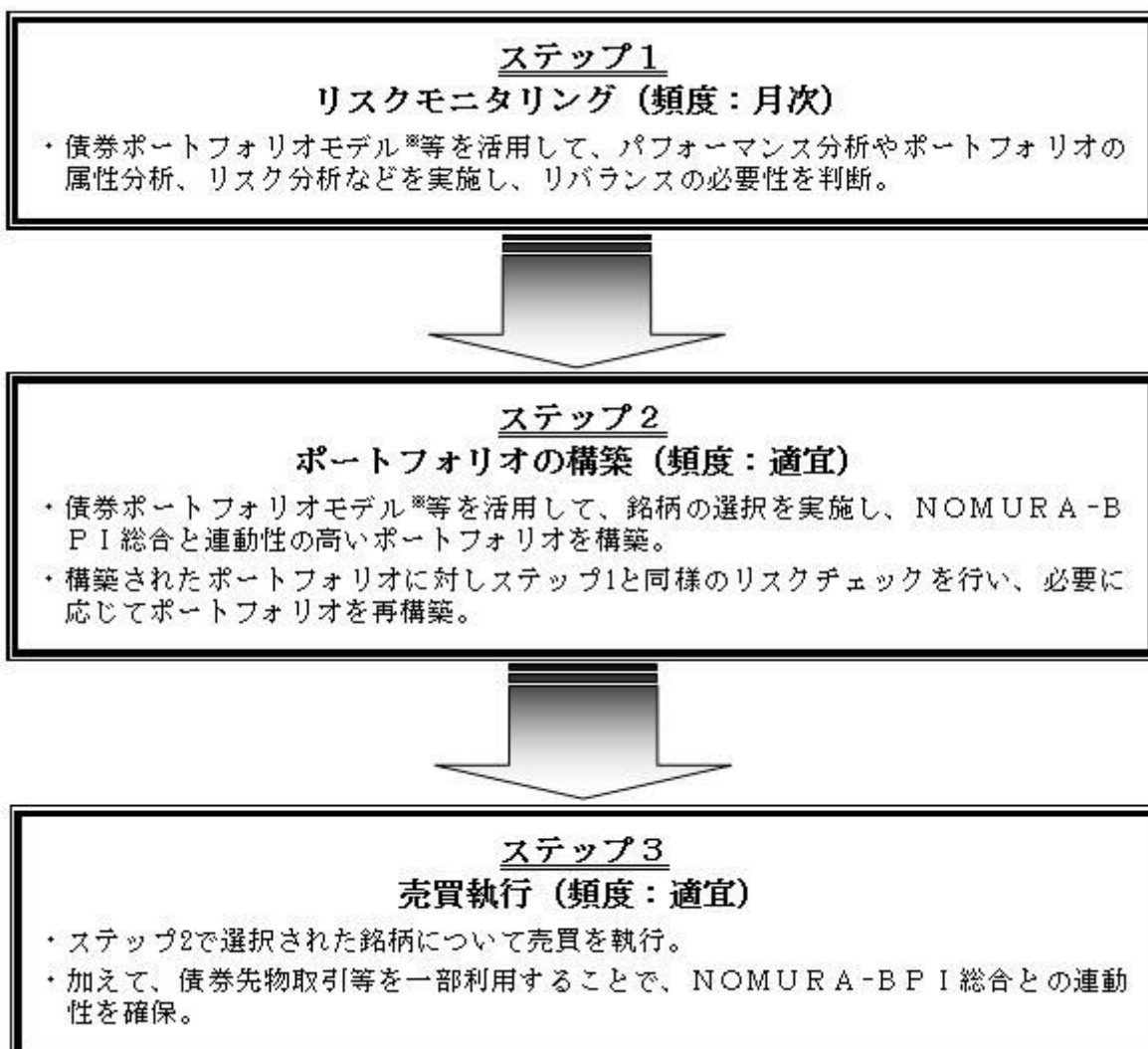
## ☛ リスク均等配分とは

「リスク均等配分」とは、各資産のリスク（価格変動性）の大きさに着目した分散投資の方法で、リスクが相対的に高い資産の配分比率を低くし、リスクが相対的に低い資産の配分比率を高くすることにより、ファンドに対する各資産のリスク寄与度を均等にするを旨とする投資手法です。これにより、リスクが高い資産の値動きがファンド全体の値動きに与える影響を抑える効果が期待されます。



## 2. 各マザーファンドの投資プロセス

### <MHAM日本債券インデックスマザーファンドの投資プロセス>



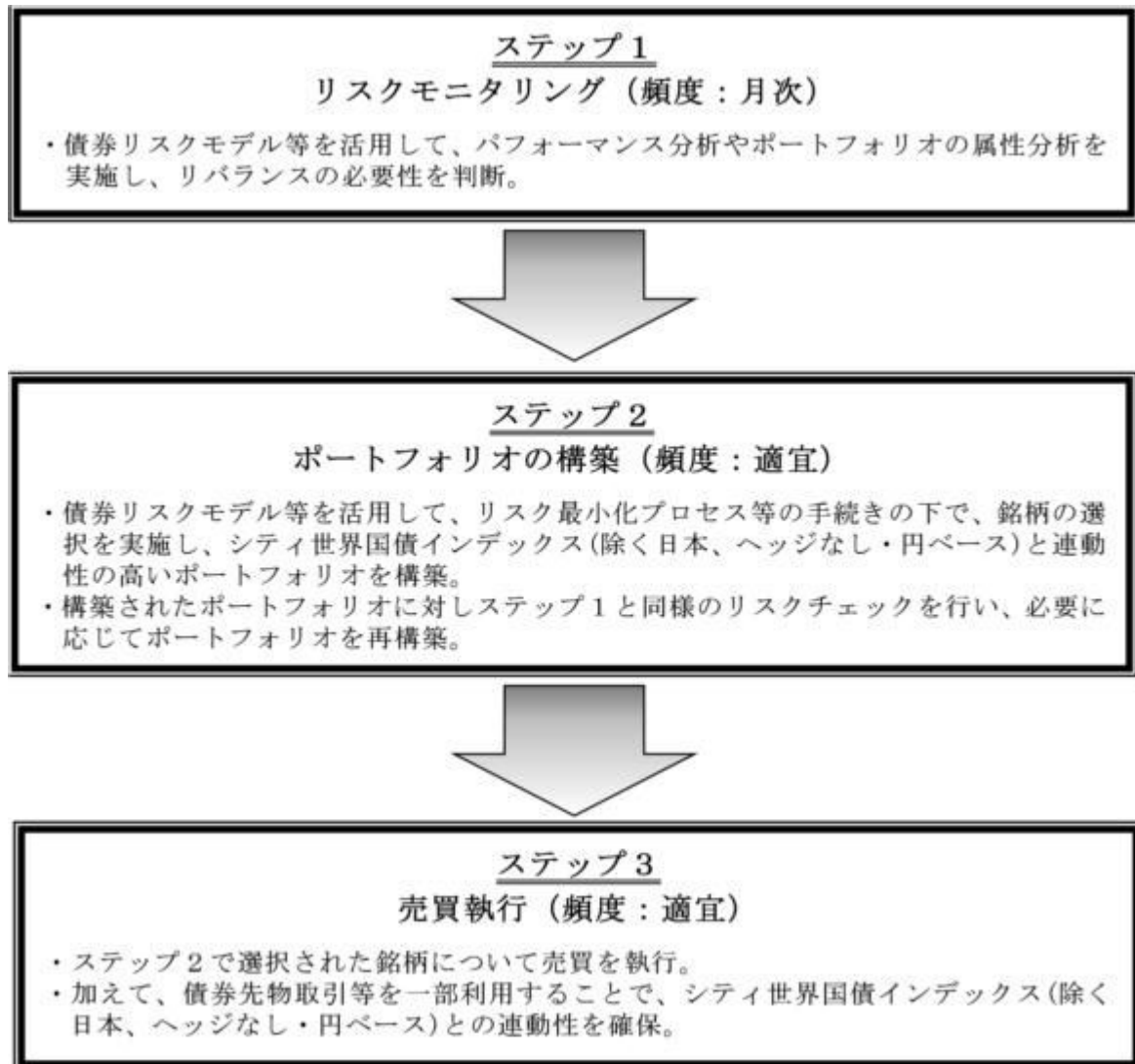
市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。また、モデルおよび使用す

るファクターについては、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

< 債券ポートフォリオモデルとは... >

デュレーション、残存期間構成、コンベクシティ等の属性をコントロールしながら、対象指数に連動する銘柄群を効率的に選びだします。

< MHAM外国債券インデックスマザーファンドの投資プロセス >

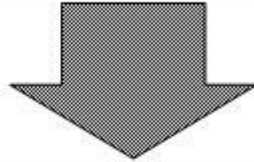


市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。また、使用するモデル等については、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

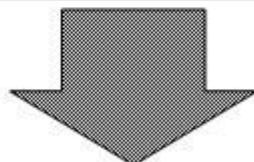
< MHAM TOPIXマザーファンドの投資プロセス >

**ステップ1****リスクモニタリング（頻度：月次）**

- ・日本株式マルチファクターモデル\*等を活用して、パフォーマンス分析やポートフォリオの属性分析を実施し、リバランスの必要性を判断。
- ・格付け推定モデル等を活用して、個別銘柄の信用リスクを評価。委託会社の日本株アナリストの意見も参考に保有・売却について判断。

**ステップ2****ポートフォリオの構築（頻度：適宜）**

- ・日本株式マルチファクターモデルを活用して、リスク最小化プロセス等の手続きの下で銘柄の選択を実施し、東証株価指数（TOPIX）と連動性の高いポートフォリオを構築。
- ・構築されたポートフォリオに対しステップ1と同様のリスクチェックを行い、必要に応じてポートフォリオを再構築。

**ステップ3****売買執行（頻度：適宜）**

- ・ステップ2で選択された銘柄について売買を執行。
- ・加えて、株価指数先物取引等を一部利用することで、株式と株価指数先物取引等の合計の実質組入比率を高位に維持し、TOPIXとの連動性を確保。

市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。また、使用するモデル等については、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

**< 日本株式マルチファクターモデルとは... >**

1988年に構築以来随時改良を加えている、アセットマネジメントOneが独自に開発した複数のリスクファクターによって株式のリターンを分解・説明するモデルです。これにより、TOPIX（東証株価指数）に連動する銘柄群を効率的に選び、定期的に銘柄群の見直しをすることによりTOPIXに対する連動性を高めます。

**< MHAM外国株式インデックスマザーファンドの投資プロセス >**

### ステップ1

#### リスクモニタリング（頻度：月次）

- ・ BARRAモデル<sup>®</sup>等を活用して、パフォーマンス分析やポートフォリオの属性分析を実施し、リバランスの必要性を判断。



### ステップ2

#### ポートフォリオの構築（頻度：適宜）

- ・ BARRAモデル等を活用して、リスク最小化プロセス等の手続きの下で銘柄の選択を実施し、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）と連動性の高いポートフォリオを構築。
- ・ 構築されたポートフォリオに対しステップ1と同様のリスクチェックを行い、必要に応じてポートフォリオを再構築。



### ステップ3

#### 売買執行（頻度：適宜）

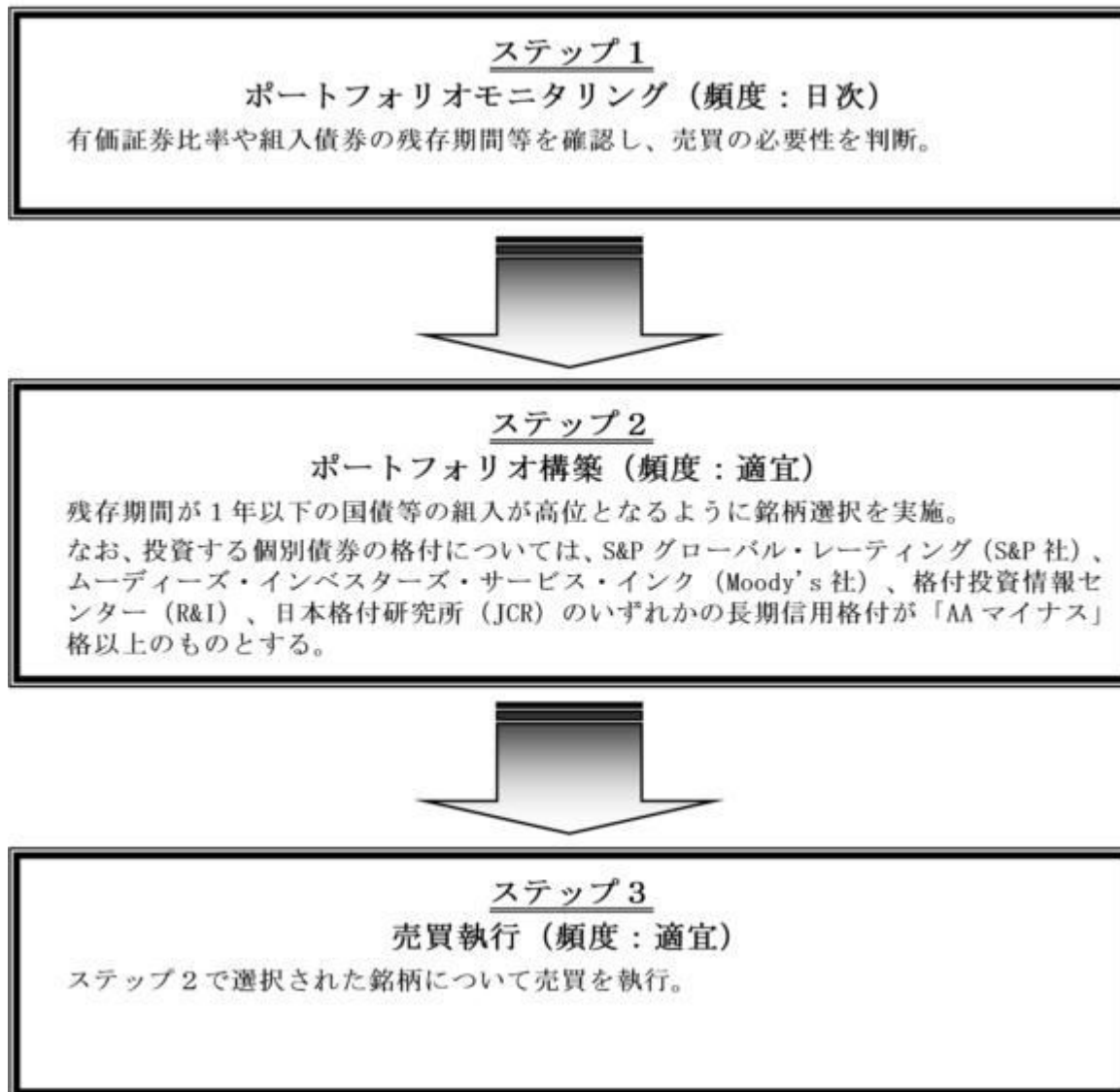
- ・ ステップ2で選択された銘柄について売買を執行。
- ・ 加えて、株価指数先物取引等を一部利用することで、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）との連動性を確保。

市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。また、使用するモデル等については、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

#### < BARRAモデルとは... >

米国バーラ社（現MSCI Inc.）が開発した、株価・債券価格の変動要因を説明する統計的モデルにより、ポートフォリオのリスク管理やパフォーマンス分析を行う投資分析ツールです。

#### < MHAM国内短期債券マザーファンドの投資プロセス >



市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

## （2）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - a．有価証券
  - b．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第25条、第26条および第27条に定めるものに限りません。）
  - c．金銭債権
  - d．約束手形（a．に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 2．次に掲げる特定資産以外の資産
  - a．為替手形

## 有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として下記1．から下記5．までのアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託の受益証券を含む下記6．から下記27.までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1．MHAM日本債券インデックスマザーファンド受益証券
- 2．MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券
- 3．MHAM TOPIXマザーファンド受益証券
- 4．MHAM外国株式インデックスマザーファンド受益証券
- 5．MHAM国内短期債券マザーファンド受益証券
- 6．株券または新株引受権証書
- 7．国債証券
- 8．地方債証券
- 9．特別の法律により法人が発行する債券
- 10．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）
- 11．資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 12．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 13．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 14．資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 15．コマースナル・ペーパー
- 16．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 17．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前記1．から前記16.の証券または証書の性質を有するもの（外国の者の発行する証券または証書で、前記6．から前記11.の証券または証書の性質を有するプリファードセキュリティーズ（ハイブリッド型のプリファードセキュリティーズを含みます。）およびこれらに類するものを含みます。）
- 18．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 19．投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、プリファードセキュリティーズ（投資証券および投資法人債券のハイブリッド型のものを含みます。）に該当するものを含みます。）
- 20．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）



21. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
  22. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  23. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  24. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
  25. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
  26. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  27. 外国の者に対する権利で前記26.の有価証券の性質を有するもの
- なお、前記6.の証券または証書、前記17.および前記22.の証券または証書のうち前記6.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前記7.から前記11.までの証券および前記17.ならびに前記22.の証券または証書のうち前記7.から前記11.までの証券の性質を有するものならびに前記19.の証券のうち投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、前記18.の証券および前記19.の証券(投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

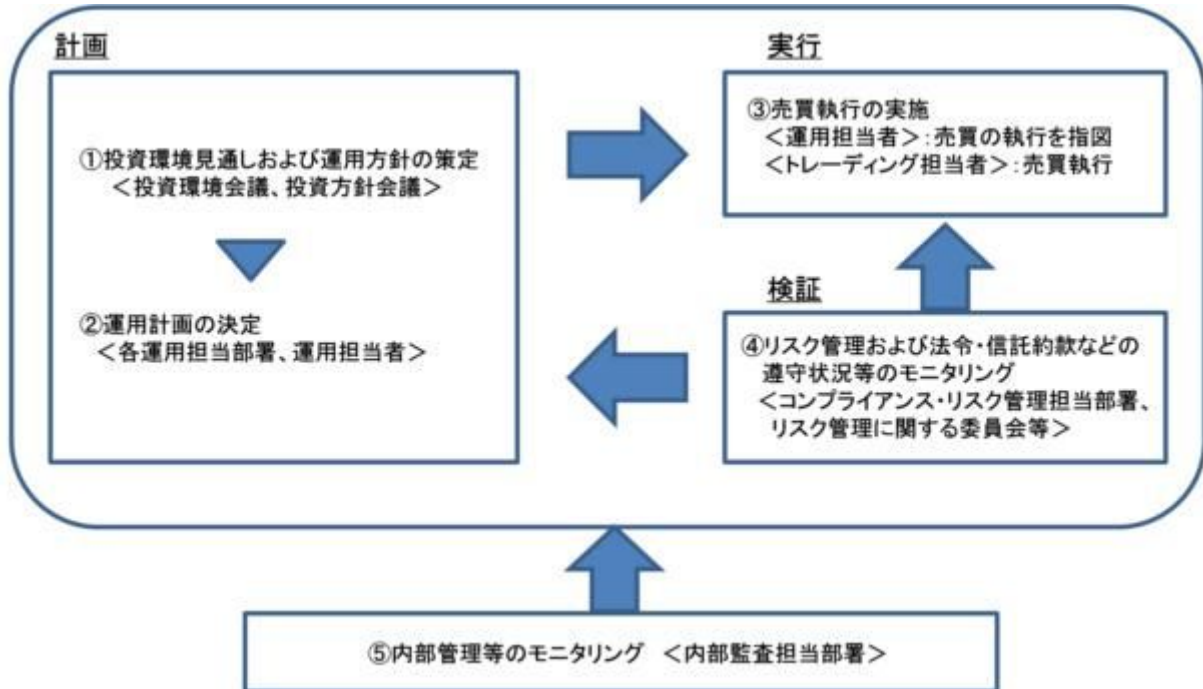
委託会社は、信託金を、 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。また、 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、下記1.から下記4.までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前記5.の権利の性質を有するもの
7. 金銭債権(ただし、流動性のあるプリファードセキュリティーズに該当するもの限り、前記1.から前記6.で該当するものならびに「 有価証券の指図範囲」の17.および19.に定める証券または証書を除きます。)
8. 投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利(金融商品取引法第2条第2項第5号に定めるものをいいます。)
9. 外国の法律に基づく権利であって前記8.に掲げる権利に類するもの(リミテッド・パートナーシップ(LP)(マスター・リミテッド・パートナーシップ(MLP)に該当するものを含みます。)を含みます。)
10. 合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権(金融商品取引法第2条第2項第3号で定めるものをいいます。)
11. 外国法人の社員権で前記10.に掲げる権利の性質を有するもの(リミテッド・ライアビリティ・カンパニー(LLC)(マスター・リミテッド・パートナーシップ(MLP)に該当するものを含みます。)を含みます。)

なお、前記5.、前記6.および前記8.から前記11.までの権利等を以下「みなし有価証券」といいます。

### (3) 【運用体制】

#### a. ファンドの運用体制



#### 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

#### 運用計画の決定

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

#### 売買執行の実施

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

#### モニタリング

運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署（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。

定期的に関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（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

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5月末日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎計算期末(原則として5月8日。ただし、休業日の場合は翌日以降の最初の営業日)に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益(繰越分およびマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。))を含みます。)および売買益(評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額)等の全額とします。
2. 分配金額は、委託会社が基準価額の水準や市況動向等を勘案して決定します。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。
3. 収益分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

将来の収益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。

収益分配金の再投資

1. 収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、販売会社に交付されます。
2. 販売会社は、分配金自動引き落とし投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行い、当該再投資にかかる売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5) 【投資制限】

a. 約款で定める投資制限

株式、新株引受権証券および新株予約権証券(約款 運用の基本方針 運用方法(3) 投資制限、約款第17条および約款第20条)

1. 株式への実質投資割合 には制限を設けません。

「実質投資割合」とは、投資対象である当該資産につき、当ファンドの信託財産に属する当該資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該資産のうち当ファンドの信託財産に属するとみなした額との合計額の当ファンドの信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。(以下同じ。)

2. 委託会社は、新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
3. 同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。
4. 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合には制限を設けません。
5. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。)に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。なお、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

#### みなし有価証券(約款第17条)

委託会社は、みなし有価証券への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の50以上となる投資の指図をしません。

#### 投資信託証券(約款第17条)

委託会社は、投資信託証券(マザーファンド受益証券および取引所金融商品市場(金融商品取引法第2条第17項に規定する金融商品市場をいいます。)または外国金融商品市場に上場等(不動産投資信託証券については、予定を含みます。以下同じ。)され、かつこれらの市場において常時売却可能(市場の急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。)な投資信託証券(以下「上場投資信託証券」といいます。)を除きます。)への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

#### 転換社債等(約款第21条)

委託会社は、同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

#### 外貨建資産(約款 運用の基本方針 運用方法(3)投資制限および約款第31条)

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。ただし、外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### 外国為替予約(約款第32条)

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

#### 信用リスク集中回避のための投資制限(約款第22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従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

#### デリバティブ取引等(約款 運用の基本方針 運用方法(3)投資制限、約款第23条)

委託会社は、デリバティブ取引等(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買および商品投資等取引(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。))を含みます。(ただし、この信託において取引可能なものに限り、以下同じ。))について、一般社団法人投資信託協会規則に定める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ることとなる投資の指図をしません。

#### 信用取引(約款第24条)

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお当該売り付けの決済については、株券の引き渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
2. 信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  - a. 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
  - b. 株式分割により取得する株券
  - c. 有償増資により取得する株券
  - d. 売り出しにより取得する株券
  - e. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(「転換社債型新株予約権付社債」の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
  - f. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前記e.に定めるものを除きます。))の行使により取得可能な株券

#### 有価証券先物取引等(約款第25条)

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引(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。))および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。))ならびに外国の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(以下同じ。))。
2. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
3. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における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。

#### スワップ取引(約款第26条)

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび

為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
4. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または担保の受入れの指図を行うものとします。

#### 金利先渡取引および為替先渡取引(約款第27条)

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

#### 有価証券の貸付(約款第28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および公社債を以下の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - a. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  - b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
2. 前記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、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### 公社債の空売り(約款第29条)

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債(信託財産により借入れた公社債を含みます。)の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
2. 前記1. の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2. の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純

資産総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売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### 公社債の借入れ（約款第30条）

- 1．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- 2．前記1．の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3．信託財産の一部解約等の事由により、前記2．の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総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借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 4．前記1．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

#### 資金の借入れ（約款第38条）

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

#### b．法令で定める投資制限

同一の法人の発行する株式の取得割合（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を、運用の指図を行うすべ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の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって取得することを委託会社に指図しないものとします。

#### <各マザーファンドの投資方針および主な投資制限>

「MHAM日本債券インデックスマザーファンド」

##### 1．基本方針

この投資信託は、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

す。

NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が、国内で発行された公募利付債券の流通市場全体の動向を的確に表すために開発した経過利子込時価総額加重型の投資収益指数です。NOMURA-BPI総合は、銘柄種類別・残存年数別に分類した各セクターポートフォリオに対して、それぞれの投資収益指数が用意され、一定の組入基準にもとづいて構成されたインデックス・ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算され、機関投資家に広く認知されています。NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は、当該指数の正確性、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。

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

主として、わが国の公社債に投資を行い、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指します。

公社債の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、公社債の組入時価総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用が行えない場合があります。

### (3) 投資制限

株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使、株主割当または社債権者割当により取得したものに限り行えるものとし、その投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## 「MHAM外国債券インデックスマザーファンド」

### 1. 基本方針

この投資信託は、シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）とは、Citigroup Index LLCが開発した債券指数で、日本を除く世界主要国の国債の総合利回りを各市場の時価総額で加重平均して指数化したものです。なお、同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

シティ世界国債インデックス（除く日本）に採用されている国・地域の公社債を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度



主として、シティ世界国債インデックス(除く日本)に採用されている国・地域の公社債に投資を行い、シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動する投資成果を目指します。

公社債の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、公社債の組入時価総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用が行えない場合があります。

### (3) 投資制限

株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使、株主割当または社債権者割当により取得したものに限り行えるものとし、その投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

外国為替の売買の予約取引は、約款第30条の範囲で行います。

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10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## 「MHAM TOPIXマザーファンド」

### 1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、東証株価指数(TOPIX)と連動する投資成果を目標として運用を行います。

東証株価指数(TOPIX=Tokyo Stock Price Index)とは、東京証券取引所第一部全銘柄を対象とした株価指数で、基準時(1968年1月4日終値)の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。

- \*1 TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「(株)東京証券取引所」といいます。)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・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有します。
- \*2 (株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- \*3 (株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の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。
- \*4 (株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- \*5 ファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- \*6 (株)東京証券取引所は、ファンドの購入者または公衆に対し、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。
- \*7 (株)東京証券取引所は、アセットマネジメントOne(株)またはファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- \*8 以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所はファンドの設定、販売およ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。

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

現物株への投資よりT O P I X先物等を活用する方が有利と認められるときは、T O P I X先物等を活用することがあります。

株価指数等の先物取引を含む株式の実質組入比率は、原則信託財産の純資産総額の範囲内となるよう運用を行います。一時的に株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

組入対象銘柄は、東京証券取引所第一部上場株式とします。ただし、流動性に著しく欠ける銘柄や信用リスクが高いと判断される銘柄等は組入れません。

上記 から について、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

### (3) 投資制限

株式の組入比率には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

有価証券先物取引等は約款第15条の範囲で行います。

スワップ取引は約款第16条の範囲で行います。

金利先渡取引は約款第17条の範囲で行います。

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10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## 「MHAM外国株式インデックスマザーファンド」

### 1. 基本方針

この投資信託は、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）<sup>1, 2</sup>の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

1 MSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）とは、MSCIインク（以下、MSCI）が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株価指数を、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に帰属します。またMSCI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。

2 税引き前配当再投資ベースとします（以下同じ。）。

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

MSCIコクサイ・インデックスを構成している国（地域を含みます。）の株式を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

主として、MSCIコクサイ・インデックスを構成している国（地域を含みます。）の株式に投

資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース・為替ヘッジなし)の動きに連動する投資成果を目指します。

株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入時価総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用が行えない場合があります。

### (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。(ただし、MSCIコクサイ・インデックスを構成している株式を除きます。)

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外国為替の売買の予約取引は、約款第29条の範囲で行います。

みなし有価証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の50%未満とします。

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10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## 「MHAM国内短期債券マザーファンド」

### 1. 基本方針

この投資信託は、主としてわが国の短期の国債、地方債、政府保証債、金融債等(以下「国債等」といいます。)に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

この投資信託は、わが国の短期の国債等を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

わが国の短期の国債等を主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指します。

投資する個別債券の格付については、S&Pグローバル・レーティング(S&P社)、ムーディーズ・インベスターズ・サービス・インク(Moody's社)、格付投資情報センター(R&I)、日本格付研

究所（JCR）のいずれかの長期信用格付が「AAマイナス」格以上のものとします。

投資する個別債券の残存期間については、原則として1年以下とします。

市場動向および資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

### （3）投資制限

株式（新株引受権証券を含みます。）への投資は行いません。

同一発行体が発行する有価証券への投資割合は、国債、地方債、特別の法律により法人の発行する債券を除き、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債等への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等は、約款第19条の範囲で行います。

スワップ取引は、約款第20条の範囲で行います。

金利先渡取引は、約款第21条の範囲で行います。

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10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## 3【投資リスク】

### (1) 当ファンドにおける主として想定されるリスクと収益性に与える影響度合い

- ・当ファンドは、主として各マザーファンド受益証券への投資を通じて値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。したがって、元本や一定の投資成果が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。
- ・運用により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者の皆様に帰属します。
- ・投資信託は預金商品や保険商品ではなく、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
- ・登録金融機関が取扱う投資信託は、投資者保護基金の対象ではありません。
- ・投資信託は預貯金とは異なります。
- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

当ファンドにおいて主として想定されるリスクは以下の通りですが、基準価額の変動要因はこれらに限定されるものではありません。

なお、以下のリスクは、主にマザーファンドを通じて当ファンドが行う有価証券等への投資により発生します。

### 資産配分リスク

資産配分リスクとは、複数資産への投資（資産配分）を行った場合に、投資成果の悪い資産への配分が大きかったため、投資全体の成果も悪くってしまうリスクをいいます。

一般に、投資に際して資産配分を行う場合には、そのうちの1資産の価値変動が投資全体の成果に及ぼす影響度合いを小さくする効果が期待されますが、その場合にも、それぞれの資産の価値変動は、当該資産への資産配分の比率に応じて、投資全体の成果に影響を及ぼします。当ファンドは、国内外の公社債および株式に資産配分を行いますが、配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数の資産の価値が同時に下落した場合等には、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

### 金利変動リスク

金利変動リスクとは、金利変動により公社債の価格が下落するリスクをいいます。

一般に金利が上昇した場合には、既に発行されて流通している公社債の価格は下落します。金利上昇は、当ファンドが投資する公社債の価格に影響を及ぼし、当ファンドの基準価額を下落させる要因となります。また、金利変動により株式市場と公社債市場の間で資金シフトが起こる場合があります、その場合、金利変動の影響は株式市場にも及びます。

### 株価変動リスク

株価変動リスクとは、株式市場および投資先となっている企業の株価が下落するリスクをいいます。

当ファンドが投資する企業の株価が下落した場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、当ファンドが投資する企業が業績悪化や倒産等に陥った場合には、当該企業の株価が大きく下落することや無くなることもあり、当ファンドの基準価額に大きな影響を及ぼすことがあります。

### 為替変動リスク

為替変動リスクとは、為替変動により外貨建資産の円換算価格が下落するリスクをいいます。当ファンドでは、外貨建資産への投資にあたり、原則として為替ヘッジを行わないため、投資対象通貨と円との外国為替相場が円高となった場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。

### 信用リスク

信用リスクとは、公社債等の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利息や償還金をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなる（債務不履行）リスクをいいます。

一般に債務不履行が生じた場合、またはその可能性が高まった場合には、当該発行体が発行する公社債および短期金融商品（コマーシャル・ペーパー等）の価格は下落します。また、当該発行体が企業の場合には、一般にその企業の株価が下落する要因となります。当ファンドが投資する公社債等の発行体や株式の発行企業がこうした状況に陥った場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

### 流動性リスク

流動性リスクとは、有価証券を売却（または購入）しようとする際に、需要（または供給）がないため、有価証券を希望する時期に、希望する価格で売却（または購入）することができなくなるリスクをいいます。

一般に規模が小さい市場での売買や、取引量の少ない有価証券の売買にあたっては、流動性リスクへの留意が特に必要とされます。また、一般に市場を取り巻く外部環境の急変があった場合には、市場実勢価格での売買ができなくなる可能性が高まります。当ファンドが投資する株式・公社債等の流動性が

損なわれた場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

#### カントリーリスク

カントリーリスクとは、投資先となっている国（地域）の政治・経済・社会・国際関係等が不安定な状態、あるいは混乱した状態等に陥った場合に、当該国における資産価値や当該国通貨の価値が下落するリスクをいいます。

当ファンドの投資先となっている国（地域）がこうした状態に陥った場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

#### <その他>

- ・投資対象国において、税制、決済ルールの変更などにより税金や費用が新たに発生した場合や、外国為替取引規制や外国からの投資規制の実施などがあった場合は、当ファンドの基準価額に影響を与える場合があります。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用に影響を受ける場合があります。
- ・当ファンドは、一部解約の実行の請求金額が多額な場合や取引所等における取引の停止等があるときには、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことがあります。

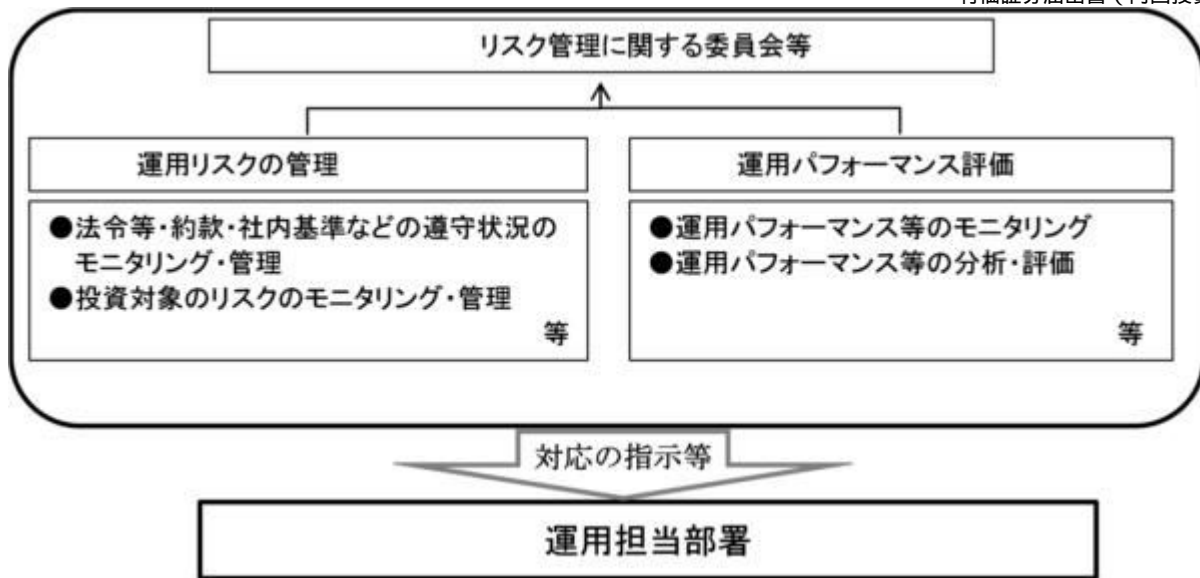
#### <収益分配金に関する留意点>

- ・投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- ・分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・投資家（受益者）のファンドの取得価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド取得後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり方が小さかった場合も同様です。

## (2) リスク管理体制

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

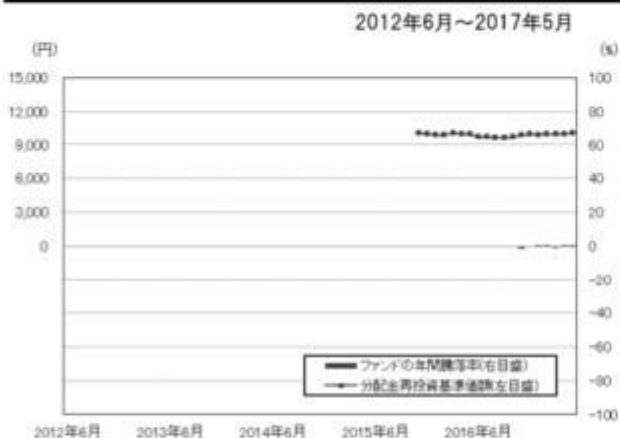
- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



リスク管理体制は平成29年5月末日現在のものであり、今後変更になることがあります。

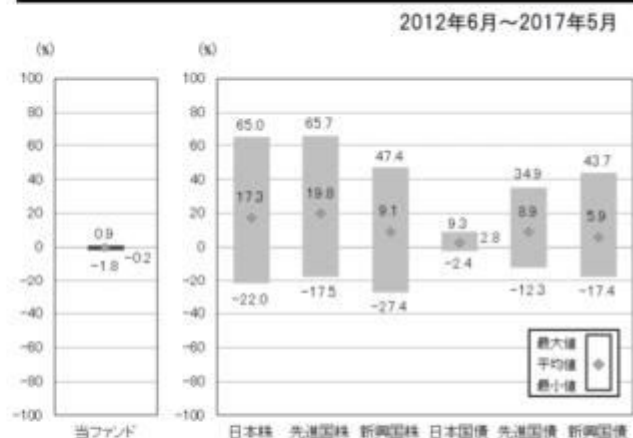
## <参考情報>

### 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



- \* 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。(以下同じ。)
- \* 年間騰落率(各月末時点について1年前と比較したものは、分配金再投資基準価額をもとに計算していますので、基準価額をもとに計算した騰落率とは異なる場合があります。)
- \* なお、当ファンドは2015年11月30日に設定しているため、年間騰落率については2016年11月以降の騰落率を表示しています。また、分配金再投資基準価額については2015年11月末より表示しています。

### 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



- \* 上記は、当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、2012年6月～2017年5月の5年間における年間騰落率(各月末時点について1年前と比較したものの)の平均・最大・最小を表示したものです。
- \* 当ファンドの年間騰落率は、分配金再投資基準価額をもとに計算していますので、基準価額をもとに計算した騰落率とは異なる場合があります。なお、当ファンドは2015年11月30日に設定しているため、当ファンドの年間騰落率については2016年11月以降の平均・最大・最小を表示しています。
- \* 代表的な資産クラスは比較対象として記載しているため、当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ロクサイ・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・ディバーシファイド(円ベース)  
 (注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

- 「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ロクサイ・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・ディバーシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金(解約)手数料】

ありません。

## (3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.6372%(税抜0.59%)の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分(税抜)については、以下の通りとします。

委託会社	販売会社	受託会社
0.38%	0.18%	0.03%

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。なお、信託報酬にかかる消費税ならびに地方消費税に相当する金額(8%以下「消費税等相当額」といいます。)を信託報酬支弁の時に信託財産中から支弁します。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

## &lt; 信託報酬等を対価とする役務の内容 &gt;

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



#### （４）【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用に係る消費税等相当額、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該費用に係る消費税等相当額、外国における資産の保管等に要する費用、信託財産に属する資産のデフォルト等の発生に伴う諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および資金の借入れを行った際の当該借入金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。なお、信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、当該費用に係る消費税等相当額とともに毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき、信託財産中から支弁します。

当ファンドの組入有価証券の売買時の売買委託手数料、先物・オプション取引等に要する費用およびこれら手数料ならびに費用にかかる消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

上記、 の手数料等（借入金の利息および財務諸表の監査に要する費用を除きます。）については、当ファンドが投資対象とするマザーファンドにおいて発生する場合、マザーファンドの信託財産中から支弁されます。これらはマザーファンドの基準価額に反映されるため、結果として当ファンドの受益者が間接的に負担することとなります。

#### （５）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

##### 個人の受益者に対する課税

##### 収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

##### 解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

##### 損益通算について

解約（換金）時および償還時の差損（譲渡損）については、確定申告を行うことにより上場株式等（上場株式、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募株式投資信託および特定

公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）など。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限ります。）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。

#### 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記は、平成29年5月末日現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

#### 個別元本方式について

受益者毎の信託時の受益権の価額等を当該受益者の元本とする個別元本方式は次のとおりです。

##### < 個別元本について >

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、個別元本の算出が行われる場合があります。

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

##### < 収益分配金の課税について >

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

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

配金となります。

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

以下の運用状況は平成29年 5月31日現在です。

投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。なお、小数点第3位を切捨てており、端数調整は行っておりません。

### （1）【投資状況】

動的パッケージファンド<DC年金>

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	157,219,526	70.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		66,127,249	29.60
合計(純資産総額)		223,346,775	100.00

### （参考）MHAM日本債券インデックスマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	86,235,114,600	81.87
地方債証券	日本	6,347,745,347	6.02
特殊債券	日本	6,844,904,559	6.49
社債券	日本	4,658,665,000	4.42
	フランス	100,910,000	0.09
	オーストラリア	100,217,000	0.09
	オランダ	100,037,000	0.09
	スウェーデン	99,923,000	0.09
	小計	5,059,752,000	4.80
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		839,084,753	0.79
合計(純資産総額)		105,326,601,259	100.00

### （参考）MHAM外国債券インデックスマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	4,891,109,258	43.28

フランス	1,114,885,609	9.86
イタリア	1,060,027,192	9.37
ドイツ	811,570,120	7.18
イギリス	806,264,235	7.13
スペイン	610,042,253	5.39
ベルギー	267,972,215	2.37
オランダ	257,609,292	2.27
オーストラリア	234,413,770	2.07
カナダ	232,201,695	2.05
オーストリア	181,745,915	1.60
アイルランド	97,381,304	0.86
メキシコ	88,007,322	0.77
フィンランド	75,778,317	0.67
デンマーク	67,382,487	0.59
ポーランド	59,318,541	0.52
南アフリカ	57,107,115	0.50
マレーシア	47,967,532	0.42
スウェーデン	47,701,675	0.42
シンガポール	41,764,058	0.36
ノルウェー	26,058,810	0.23
スイス	17,155,531	0.15
小計	11,093,464,246	98.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	207,479,223	1.83
合計(純資産総額)	11,300,943,469	100.00

## (参考) MHAM TOPIXマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	45,643,472,860	97.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,176,605,591	2.51
合計(純資産総額)		46,820,078,451	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	1,177,500,000	2.51

(注) 株価指数先物取引の時価の算定方法については、取引所の発表する計算日の清算値段により評価しております。

## (参考) MHAM外国株式インデックスマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	19,176,208,094	58.05
	イギリス	2,225,297,823	6.73
	スイス	1,267,676,560	3.83
	フランス	1,261,265,412	3.81
	ドイツ	1,250,311,029	3.78
	カナダ	1,218,713,939	3.68
	オーストラリア	814,458,618	2.46
	オランダ	626,556,639	1.89
	アイルランド	508,120,951	1.53
	スペイン	456,828,492	1.38
	スウェーデン	378,350,734	1.14
	香港	301,023,671	0.91
	シンガポール	250,398,230	0.75
	イタリア	246,201,422	0.74
	デンマーク	233,474,269	0.70
	ジャージー	189,112,816	0.57
	バミューダ	156,337,596	0.47
	ベルギー	154,562,017	0.46
	フィンランド	134,195,708	0.40
	キュラソー	91,109,178	0.27
	ケイマン諸島	84,257,013	0.25
	ノルウェー	81,040,201	0.24
	イスラエル	74,382,851	0.22
	ルクセンブルグ	39,758,720	0.12
	オーストリア	30,167,113	0.09
	ニュージーランド	21,401,626	0.06
	パナマ	20,807,561	0.06
	ポルトガル	20,193,470	0.06
	リベリア	19,188,688	0.05
	パプアニューギニア	7,636,205	0.02
英ヴァージン諸島	5,827,504	0.01	
マン島	5,177,773	0.01	
モーリシャス	2,030,383	0.00	
	小計	31,352,072,306	94.90
投資信託受益証券	香港	5,269,939	0.01
投資証券	アメリカ	637,784,172	1.93
	オーストラリア	72,938,504	0.22
	フランス	45,238,093	0.13
	イギリス	33,718,830	0.10
	香港	16,639,440	0.05
	シンガポール	15,590,200	0.04

	カナダ	6,839,917	0.02
	小計	828,749,156	2.50
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		847,544,421	2.56
合計(純資産総額)		33,033,635,822	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	561,731,671	1.70
	買建	ドイツ	162,670,740	0.49
	買建	イギリス	64,085,047	0.19
	買建	オーストラリア	47,435,380	0.14

(注) 株価指数先物取引の時価の算定方法については、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により評価しております。

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## 動的パッケージファンド&lt;DC年金&gt;

## イ. 評価額上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	MHAM日本債券インデックスマ ザーファンド	64,983,235	1.2253	79,628,143	1.2251	79,610,961	35.64
2	日本	親投資信託 受益証券	MHAM外国株式インデックスマ ザーファンド	18,319,974	1.6560	30,337,877	1.6432	30,103,381	13.47
3	日本	親投資信託 受益証券	MHAM TOPIXマザーファ ンド	16,267,064	1.7981	29,250,375	1.7800	28,955,373	12.96
4	日本	親投資信託 受益証券	MHAM外国債券インデックスマ ザーファンド	15,116,789	1.2279	18,561,906	1.2271	18,549,811	8.30

## ロ. 種類別投資比率

種類	国内/外国	投資比率(%)
親投資信託受益証券	国内	70.39
合計		70.39

(参考) MHAM日本債券インデックスマザーファンド

## イ. 評価額上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第325回利付 国債(10年)	990,000,000	105.02	1,039,727,700	104.79	1,037,480,400	0.8	2022年9 月20日	0.98
2	日本	国債証券	第129回利付 国債(5年)	1,010,000,000	101.11	1,021,280,200	100.99	1,020,039,400	0.1	2021年9 月20日	0.96
3	日本	国債証券	第329回利付 国債(10年)	960,000,000	105.63	1,014,067,200	105.41	1,011,964,800	0.8	2023年6 月20日	0.96
4	日本	国債証券	第332回利付 国債(10年)	960,000,000	104.69	1,005,072,000	104.47	1,002,979,200	0.6	2023年12 月20日	0.95
5	日本	国債証券	第339回利付 国債(10年)	940,000,000	103.58	973,661,400	103.42	972,213,800	0.4	2025年6 月20日	0.92
6	日本	国債証券	第333回利付 国債(10年)	910,000,000	104.83	953,998,500	104.61	951,960,100	0.6	2024年3 月20日	0.90
7	日本	国債証券	第340回利付 国債(10年)	900,000,000	103.64	932,841,000	103.44	931,041,000	0.4	2025年9 月20日	0.88
8	日本	国債証券	第312回利付 国債(10年)	880,000,000	104.98	923,832,800	104.78	922,072,800	1.2	2020年12 月20日	0.87
9	日本	国債証券	第127回利付 国債(5年)	900,000,000	101.04	909,441,000	100.91	908,244,000	0.1	2021年3 月20日	0.86
10	日本	国債証券	第342回利付 国債(10年)	900,000,000	101.02	909,180,000	100.83	907,515,000	0.1	2026年3 月20日	0.86
11	日本	国債証券	第124回利付 国債(5年)	900,000,000	100.87	907,884,000	100.73	906,606,000	0.1	2020年6 月20日	0.86
12	日本	国債証券	第122回利付 国債(5年)	900,000,000	100.74	906,732,000	100.64	905,760,000	0.1	2019年12 月20日	0.85
13	日本	国債証券	第328回利付 国債(10年)	870,000,000	104.24	906,966,300	104.05	905,243,700	0.6	2023年3 月20日	0.85
14	日本	国債証券	第130回利付 国債(5年)	890,000,000	101.25	901,169,500	101.07	899,576,400	0.1	2021年12 月20日	0.85
15	日本	国債証券	第335回利付 国債(10年)	860,000,000	104.25	896,618,800	104.06	894,984,800	0.5	2024年9 月20日	0.84
16	日本	国債証券	第123回利付 国債(5年)	880,000,000	100.81	887,207,200	100.70	886,177,600	0.1	2020年3 月20日	0.84
17	日本	国債証券	第128回利付 国債(5年)	870,000,000	101.09	879,543,900	100.95	878,317,200	0.1	2021年6 月20日	0.83
18	日本	国債証券	第125回利付 国債(5年)	870,000,000	100.93	878,091,000	100.79	876,925,200	0.1	2020年9 月20日	0.83
19	日本	国債証券	第343回利付 国債(10年)	860,000,000	100.95	868,230,200	100.81	866,991,800	0.1	2026年6 月20日	0.82
20	日本	国債証券	第341回利付 国債(10年)	840,000,000	102.80	863,562,000	102.60	861,915,600	0.3	2025年12 月20日	0.81
21	日本	国債証券	第334回利付 国債(10年)	810,000,000	104.92	849,877,200	104.74	848,442,600	0.6	2024年6 月20日	0.80
22	日本	国債証券	第338回利付 国債(10年)	810,000,000	103.55	838,763,100	103.40	837,548,100	0.4	2025年3 月20日	0.79
23	日本	国債証券	第344回利付 国債(10年)	810,000,000	100.88	817,128,000	100.74	816,010,200	0.1	2026年9 月20日	0.77
24	日本	国債証券	第345回利付 国債(10年)	810,000,000	100.81	816,601,500	100.66	815,394,600	0.1	2026年12 月20日	0.77
25	日本	国債証券	第116回利付 国債(5年)	800,000,000	100.67	805,376,000	100.58	804,664,000	0.2	2018年12 月20日	0.76
26	日本	国債証券	第126回利付 国債(5年)	780,000,000	101.00	787,800,000	100.85	786,676,800	0.1	2020年12 月20日	0.74
27	日本	国債証券	第117回利付 国債(5年)	750,000,000	100.76	755,737,500	100.66	755,002,500	0.2	2019年3 月20日	0.71
28	日本	国債証券	第330回利付 国債(10年)	710,000,000	105.83	751,407,200	105.60	749,802,600	0.8	2023年9 月20日	0.71
29	日本	国債証券	第305回利付 国債(10年)	720,000,000	103.90	748,080,000	103.71	746,726,400	1.3	2019年12 月20日	0.70
30	日本	国債証券	第318回利付 国債(10年)	680,000,000	105.07	714,510,000	104.86	713,082,000	1	2021年9 月20日	0.67

## ロ.種類別投資比率

種類	国内/外国	投資比率(%)
国債証券	国内	81.87
地方債証券	国内	6.02
特殊債券	国内	6.49
社債券	国内	4.42
	外国	0.38
合計		99.20

(参考)MHAM外国債券インデックスマザーファンド

## イ.評価額上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375%	1,000,000	11,113.33	111,133,375	11,115.93	111,159,382	1.375	2018年9 月30日	0.98
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2%	580,000	10,898.35	63,210,445	11,008.44	63,848,985	2	2025年2 月15日	0.56
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25%	550,000	11,113.75	61,125,645	11,222.56	61,724,100	2.25	2024年11 月15日	0.54
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625%	500,000	11,748.75	58,743,785	11,751.35	58,756,788	3.625	2020年2 月15日	0.51
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5%	490,000	11,331.79	55,525,771	11,438.41	56,048,236	2.5	2024年5 月15日	0.49
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75%	460,000	11,524.23	53,011,486	11,620.45	53,454,112	2.75	2023年11 月15日	0.47
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2%	470,000	11,082.13	52,086,011	11,166.21	52,481,219	2	2023年2 月15日	0.46
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125%	450,000	10,973.94	49,382,748	11,092.53	49,916,396	2.125	2025年5 月15日	0.44
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625%	440,000	10,454.51	45,999,855	10,581.94	46,560,549	1.625	2026年5 月15日	0.41
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75%	390,000	11,518.16	44,920,855	11,618.72	45,313,029	2.75	2024年2 月15日	0.40
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625%	400,000	11,077.79	44,311,183	11,119.40	44,477,623	1.625	2020年11 月30日	0.39
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.25%	400,000	11,089.06	44,356,261	11,096.86	44,387,468	1.25	2018年12 月15日	0.39
13	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF) 2.5%	320,000	13,633.26	43,626,434	13,603.51	43,531,240	2.5	2020年10 月25日	0.38
14	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF) 4.25%	275,000	15,643.72	43,020,255	15,755.28	43,327,032	4.25	2023年10 月25日	0.38
15	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF) 3.25%	300,000	14,316.84	42,950,534	14,360.84	43,082,541	3.25	2021年10 月25日	0.38
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75%	390,000	10,899.21	42,506,955	10,989.37	42,858,560	1.75	2023年5 月15日	0.37
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25%	380,000	11,043.12	41,963,857	11,166.21	42,431,623	2.25	2025年11 月15日	0.37
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625%	365,000	11,460.95	41,832,483	11,486.09	41,924,242	2.625	2020年8 月15日	0.37
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2%	380,000	10,763.12	40,899,856	10,890.55	41,384,092	2	2026年11 月15日	0.36



20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75%	370,000	11,118.53	41,138,593	11,161.01	41,295,758	1.75	2020年12 月31日	0.36
21	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF) 3.75%	300,000	13,675.40	41,026,211	13,640.69	40,922,093	3.75	2019年10 月25日	0.36
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5%	390,000	10,316.67	40,235,049	10,443.24	40,728,647	1.5	2026年 8 月15日	0.36
23	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF) 3.5%	260,000	15,461.52	40,199,959	15,611.50	40,589,906	3.5	2026年 4 月25日	0.35
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2%	360,000	11,177.48	40,238,950	11,238.16	40,457,403	2	2021年11 月15日	0.35
25	イギリス	国債証券	UK TSY 1.75%	270,000	14,733.54	39,780,568	14,732.83	39,778,648	1.75	2019年 7 月22日	0.35
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2%	360,000	10,852.40	39,068,669	10,969.43	39,489,971	2	2025年 8 月15日	0.34
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625%	370,000	10,477.05	38,765,089	10,605.34	39,239,790	1.625	2026年 2 月15日	0.34
28	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF) 4.5%	200,000	19,297.77	38,595,551	19,554.35	39,108,704	4.5	2041年 4 月25日	0.34
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625%	350,000	10,889.68	38,113,892	10,967.70	38,386,958	1.625	2022年11 月15日	0.33
30	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI 6%	220,000	17,498.02	38,495,647	17,434.80	38,356,575	6	2031年 5 月 1日	0.33

## ロ.種類別投資比率

種類	国内/外国	投資比率(%)
国債証券	外国	98.16
合計		98.16

(参考)MHAM TOPIXマザーファンド

## イ.評価額上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	242,000	6,504.54	1,574,098,680	5,932.00	1,435,544,000	3.06
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,489,800	767.44	1,143,332,112	690.90	1,029,302,820	2.19
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	157,800	4,896.50	772,667,700	5,308.00	837,602,400	1.78
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	88,600	8,354.60	740,217,560	9,003.00	797,665,800	1.70
5	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	157,400	4,384.66	690,145,484	3,974.00	625,507,600	1.33
6	日本	株式	KDDI	情報・通信業	194,600	2,983.55	580,598,830	3,066.00	596,643,600	1.27
7	日本	株式	ソニー	電気機器	140,800	3,659.08	515,198,464	4,034.00	567,987,200	1.21
8	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	179,300	3,586.06	642,980,558	3,117.00	558,878,100	1.19
9	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,669,500	213.66	570,365,370	192.80	514,679,600	1.09
10	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	123,600	3,801.00	469,803,600	4,161.00	514,299,600	1.09
11	日本	株式	キーエンス	電気機器	9,000	45,071.46	405,643,140	50,310.00	452,790,000	0.96
12	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	78,200	5,296.09	414,154,238	5,707.00	446,287,400	0.95

13	日本	株式	ファナック	電気機器	20,200	22,329.55	451,056,910	21,770.00	439,754,000	0.93
14	日本	株式	任天堂	その他製品	12,300	24,759.80	304,545,540	33,650.00	413,895,000	0.88
15	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	38,500	10,028.40	386,093,400	10,615.00	408,677,500	0.87
16	日本	株式	キヤノン	電気機器	107,200	3,472.75	372,278,800	3,780.00	405,216,000	0.86
17	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	144,600	2,676.79	387,063,834	2,717.00	392,878,200	0.83
18	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	82,300	4,372.04	359,818,892	4,708.00	387,468,400	0.82
19	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	79,100	5,063.90	400,554,490	4,700.00	371,770,000	0.79
20	日本	株式	信越化学工業	化学	37,400	9,672.12	361,737,288	9,932.00	371,456,800	0.79
21	日本	株式	花王	化学	52,000	5,980.54	310,988,080	6,983.00	363,116,000	0.77
22	日本	株式	三菱商事	卸売業	147,600	2,504.76	369,702,576	2,218.00	327,376,800	0.69
23	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	70,200	4,692.82	329,435,964	4,652.00	326,570,400	0.69
24	日本	株式	パナソニック	電気機器	228,800	1,283.49	293,662,512	1,420.50	325,010,400	0.69
25	日本	株式	三菱電機	電気機器	212,500	1,693.09	359,781,625	1,527.00	324,487,500	0.69
26	日本	株式	村田製作所	電気機器	20,900	16,357.46	341,870,914	15,350.00	320,815,000	0.68
27	日本	株式	日立製作所	電気機器	479,000	629.15	301,362,850	668.70	320,307,300	0.68
28	日本	株式	三菱地所	不動産業	146,400	2,209.56	323,479,584	2,068.50	302,828,400	0.64
29	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	16,500	18,452.02	304,458,330	18,135.00	299,227,500	0.63
30	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	212,900	1,558.95	331,900,455	1,398.50	297,740,650	0.63

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.29
		建設業	3.06
		食料品	4.71
		繊維製品	0.65
		パルプ・紙	0.24
		化学	6.76
		医薬品	4.54
		石油・石炭製品	0.47
		ゴム製品	0.95
		ガラス・土石製品	0.94
		鉄鋼	1.12
		非鉄金属	0.90
		金属製品	0.69
		機械	4.93
		電気機器	12.78
		輸送用機器	8.33
		精密機器	1.56
その他製品	2.01		
電気・ガス業	1.85		

	陸運業	4.13
	海運業	0.21
	空運業	0.53
	倉庫・運輸関連業	0.19
	情報・通信業	8.00
	卸売業	4.18
	小売業	4.69
	銀行業	7.47
	証券、商品先物取引業	1.09
	保険業	2.47
	その他金融業	1.22
	不動産業	2.41
	サービス業	3.84
合計		97.48

## (参考)MHAM外国株式インデックスマザーファンド

## イ. 評価額上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	46,174	16,528.60	763,191,650	17,051.22	787,323,180	2.38
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	63,926	7,656.23	489,432,798	7,812.69	499,434,251	1.51
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	3,492	103,653.28	361,957,267	110,593.83	386,193,661	1.16
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	20,227	16,670.63	337,196,841	16,908.08	341,999,831	1.03
5	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	23,564	13,704.66	322,936,835	14,104.12	332,349,616	1.00
6	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	35,866	9,100.93	326,414,285	8,998.85	322,752,969	0.97
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	2,693	102,874.34	277,040,610	108,283.64	291,607,855	0.88

8	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	30,980	9,653.51	299,066,049	9,309.54	288,409,673	0.87
9	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	2,555	105,443.06	269,407,041	110,535.02	282,416,984	0.85
10	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	26,929	9,093.59	244,881,554	9,360.72	252,074,950	0.76
11	アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	41,309	6,115.00	252,604,767	5,787.67	239,083,009	0.72
12	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	76,468	3,242.25	247,928,465	3,035.86	232,146,571	0.70
13	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービス	53,128	4,278.61	227,314,396	4,277.50	227,255,445	0.68
14	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	87,365	2,634.19	230,136,044	2,542.09	222,090,007	0.67
15	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	22,113	9,598.03	212,241,458	9,697.90	214,449,751	0.64
16	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	10,591	18,480.38	195,725,789	18,320.60	194,033,534	0.58
17	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	16,287	11,738.45	191,184,272	11,546.49	188,057,806	0.56
18	アメリカ	株式	COMCAST CORP CL-A	メディア	41,170	4,328.54	178,206,388	4,560.45	187,753,974	0.56
19	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	52,528	3,714.94	195,138,410	3,565.14	187,269,926	0.56
20	スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSS CHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6,071	30,565.86	185,565,354	30,315.78	184,047,155	0.55
21	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	35,226	5,180.72	182,496,128	5,126.35	180,580,876	0.54
22	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	10,491	17,279.80	181,282,391	17,074.52	179,128,840	0.54
23	アメリカ	株式	COCA-COLA COMPANY	食品・飲料・タバコ	35,445	4,847.84	171,831,774	5,040.91	178,675,154	0.54
24	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	13,412	12,455.25	167,049,947	13,309.65	178,509,053	0.54
25	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	19,306	8,735.53	168,648,325	8,934.46	172,488,723	0.52

26	アメリカ	株式	MERCK & CO. INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	23,840	7,098.11	169,218,971	7,199.08	171,626,182	0.51
27	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	16,128	10,218.30	164,800,846	10,510.13	169,507,396	0.51
28	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	24,618	6,684.23	164,552,384	6,839.57	168,376,643	0.50
29	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	170,871	936.00	159,936,110	960.47	164,116,811	0.49
30	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	40,875	4,085.54	166,996,742	4,014.53	164,094,028	0.49

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.47
		素材	4.68
		資本財	7.32
		商業・専門サービス	0.96
		運輸	1.95
		自動車・自動車部品	1.44
		耐久消費財・アパレル	1.71
		消費者サービス	1.86
		メディア	2.56
		小売	3.87
		食品・生活必需品小売り	1.84
		食品・飲料・タバコ	5.88
		家庭用品・パーソナル用品	2.19
		ヘルスケア機器・サービス	3.94
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.42
		銀行	9.03
		各種金融	4.03
保険	4.03		
不動産	0.56		
ソフトウェア・サービス	9.55		

		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.94
		電気通信サービス	2.73
		公益事業	3.27
		半導体・半導体製造装置	2.56
投資信託受益証券	外国		0.01
投資証券	外国		2.50
合計			97.43

### 【投資不動産物件】

#### 動的パッケージファンド＜DC年金＞

該当事項はありません。

（参考）MHAM日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）MHAM外国債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）MHAM TOPIXマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）MHAM外国株式インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

#### 動的パッケージファンド＜DC年金＞

該当事項はありません。

（参考）MHAM日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）MHAM外国債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）MHAM TOPIXマザーファンド

資産の種類	取引所	資産の名称	建別	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	75	日本・円	1,164,890,412	1,177,500,000	2.51

（注）時価の算定方法

取引所の発表する計算日の清算値段により評価しています。

（参考）MHAM外国株式インデックスマザーファンド

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	建別	数量	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMIN 1706	買建	2	米・ドル	241,400	26,785,744	241,070	26,749,127	0.08
	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P500 1706	買建	8	米・ドル	4,745,775	526,591,194	4,821,400	534,982,544	1.61
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO 1706	買建	37	ユーロ	1,328,510	164,668,814	1,312,390	162,670,740	0.49
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 1706	買建	4	オーストラリア・ドル	581,100	48,173,190	572,200	47,435,380	0.14
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE100 1706	買建	6	英・ポンド	441,225	62,764,256	450,510	64,085,047	0.19

（注）時価の算定方法

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または最終相場により評価しております。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

動的パッケージファンド＜DC年金＞

平成29年5月末日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末（平成28年 5月 9日）	1	1	0.9860	0.9860
第2計算期間末（平成29年 5月 8日）	217	217	1.0039	1.0039
平成28年 5月末日	3		0.9917	
6月末日	142		0.9674	
7月末日	142		0.9682	
8月末日	185		0.9636	
9月末日	188		0.9599	
10月末日	192		0.9661	
11月末日	198		0.9823	
12月末日	196		0.9932	

平成29年 1月末日	200		0.9879	
2月末日	201		0.9916	
3月末日	209		0.9910	
4月末日	216		0.9956	
5月末日	223		1.0009	

(注)表中の末日とは当該月の最終営業日を指します。

#### 【分配の推移】

#### 動的パッケージファンド<DC年金>

期	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	平成27年11月30日～平成28年 5月 9日	0.0000
第2計算期間	平成28年 5月10日～平成29年 5月 8日	0.0000

#### 【収益率の推移】

#### 動的パッケージファンド<DC年金>

期	計算期間	収益率(%)
第1計算期間	平成27年11月30日～平成28年 5月 9日	1.40
第2計算期間	平成28年 5月10日～平成29年 5月 8日	1.82

(注1)収益率は期間騰落率。

(注2)小数点第3位四捨五入。

#### (4)【設定及び解約の実績】

#### 動的パッケージファンド<DC年金>

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	平成27年11月30日～平成28年 5月 9日	3,049,848	1,969,584	1,080,264
第2計算期間	平成28年 5月10日～平成29年 5月 8日	251,804,976	35,891,119	216,994,121

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

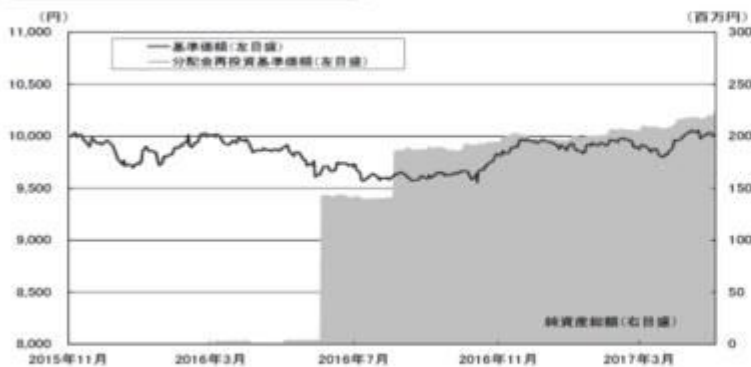
#### 参考情報



データの基準日:2017年5月31日

## 基準価額・純資産の推移

(2015年11月30日～2017年5月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2015年11月30日)

## 分配の推移(税引前)

2017年 5月	0円
2016年 5月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

※各比率は小数点第二位を四捨五入して表示しています。

## ＜資産の組入比率＞

資産		比率(%)
国内債券	MHAM日本債券インデックス マザーファンド受益証券	35.6
外国債券	MHAM外国債券インデックス マザーファンド受益証券	8.3
国内株式	MHAM TOPIX マザーファンド受益証券	13.0
外国株式	MHAM外国株式インデックス マザーファンド受益証券	13.5
現金・預金・その他の資産		29.6
合計		100.0

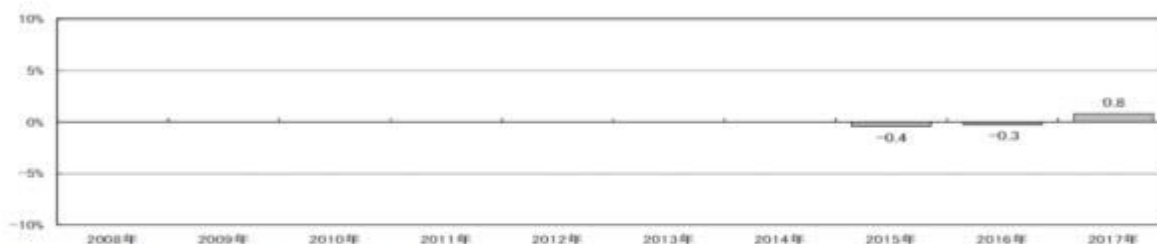
※比率は、当ファンドの純資産総額に対する組入比率です。

## ＜マザーファンドにおける組入上位銘柄＞

組入上位銘柄		国/地域	償還期限	比率(%)
国内債券	第325回利付国債(10年)	日本	2022年9月20日	1.0
	第129回利付国債(5年)	日本	2021年9月20日	1.0
	第329回利付国債(10年)	日本	2023年6月20日	1.0
	第332回利付国債(10年)	日本	2023年12月20日	1.0
	第339回利付国債(10年)	日本	2025年6月20日	0.9
外国債券	米国国債	アメリカ	2018年9月30日	1.0
	米国国債	アメリカ	2025年2月15日	0.6
	米国国債	アメリカ	2024年11月15日	0.5
	米国国債	アメリカ	2020年2月15日	0.5
	米国国債	アメリカ	2024年5月15日	0.5
国内株式	トヨタ自動車	日本	—	3.1
	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	—	2.2
	日本電信電話	日本	—	1.8
	ソフトバンクグループ	日本	—	1.7
	三井住友フィナンシャルグループ	日本	—	1.3
外国株式	アップル	アメリカ	—	2.4
	マイクロソフト	アメリカ	—	1.5
	アマゾン ドット コム	アメリカ	—	1.2
	フェイスブック	アメリカ	—	1.0
	ジョンソン・エンド・ジョンソン	アメリカ	—	1.0

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

## 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。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 1【申込（販売）手続等】

- (1)当ファンドのお申込みは、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後3時までにお買付けのお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日分のお申込みといたします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については翌営業日のお取扱いとなります。ただし、取得申込日が、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日にあたる場合には、お申込みの受付はいたしません。
- (2)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、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、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。
- (3)受益権の取得のお申込みは、確定拠出年金制度による取得のお申込みのみを対象といたします。確定拠出年金制度を通じての取得のお申込みについては、確定拠出年金制度の定めにしたがうものとします。
- (4)当ファンドは、収益分配がなされた場合、分配金を自動的に無手数料で再投資する「自動けいぞく投資」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で別に定める「自動けいぞく投資約款」にしたがって、分配金自動けいぞく投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。
- (5)取得申込者は、販売会社において、1円以上1円単位をもって購入することができます。
- (6)取得申込みにかかる受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
- (7)分配金自動けいぞく投資に関する契約に基づき、収益分配金を再投資する際は、1口単位で購入できるものとします。なお、その際の受益権の価額は、原則として各計算期間終了日の基準価額とします。
- (8)信託財産の効率的な運用または受益者に対する公平性を期する運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合、取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

## 2【換金（解約）手続等】

- (1)受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し、1口単位をもって解約を請求することができます。
- (2)解約の請求を行う受益者は、振替制度にかかる口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。なお、解約の請求を受益者が行う際は、振替受益権をもって行うものとします。
- (3)解約請求の受付については、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後3時までには解約のお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日分のお申込みとします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については、翌営業

日のお取扱いとなります。ただし、解約請求受付日が、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日にあたる場合には、解約請求の受付はいたしません。

- (4) 解約の価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。詳しくは、委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	0120-104-694

電話によるお問い合わせは、営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。（以下同じ。）

- (5) 解約代金は、受益者の解約請求を受付けた日から起算して、原則として、6営業日目から受益者に支払われます。
- (6) 信託財産の資金管理を円滑に行うために、大口の解約請求には制限を設ける場合があります。
- (7) 委託会社は、信託財産の効率的な運用または受益者に対する公平性を期する運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合（一部解約の実行の請求金額が多額な場合を含みます。）、取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことができます。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できません。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この日が前記(3)に規定する一部解約の実行の請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の実行の請求を受け付けることができる日とします。）に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、前記(4)の規定に準じて算出した価額とします。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入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従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

投資対象	評価方法
マザーファンド受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における取引所の最終相場
公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算日の直近の日とします。

当ファンドの基準価額は、委託会社の毎営業日（土曜日、日曜日、「国民の祝日に関する法律」に定める休日ならびに12月31日、1月2日および1月3日以外の日とします。）に計算されます。基準価

額については、委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。基準価額は1万口単位で表示されたものが発表されます。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	<a href="http://www.am-one.co.jp/">http://www.am-one.co.jp/</a>	0120-104-694

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

平成27年11月30日から無期限とします。

(4)【計算期間】

原則として毎年5月9日から翌年5月8日までとします。ただし、第1計算期間は平成27年11月30日から平成28年5月8日までとします。

上記の規定にかかわらず、計算期間終了日に該当する日(以下「当該日」といいます。)が休業日のとき、計算期間終了日は、当該日の翌日以降の最初の営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

信託契約の解約

1. 委託会社は、次のいずれかに該当する場合、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(繰上償還)させることがあります。この場合、委託会社は書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。ただし、当該信託契約の解約についての委託会社による提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには書面決議は行いません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の手続きを行うことが困難な場合にも書面決議は行いません。
  - a. この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき。
  - b. やむを得ない事情が発生したとき。
  - c. 信託契約の一部解約により、受益権の口数が10億口を下回ることとなるとき。
2. 前記1.により信託契約を解約する場合には、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。
3. 委託会社は、次の事象が起きた場合、信託契約を解約し、信託を終了(繰上償還)させます。
  - a. 委託会社が監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき。
  - b. 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。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、この信託は、「信託約款の変更等」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
  - c. 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において、委託会社が新受託会社を選任できないとき。

## 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は「信託約款の変更等」および「書面決議」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、
2. 委託会社は、前記1.の事項(前記1.の変更事項にあっては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、前記1.の併合事項にあっては、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。ただし、当該重大な約款の変更等についての委託会社による提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには書面決議は行いません。
3. この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一又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。
4. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記の規定にしたがいます。

## 書面決議

1. 委託会社は、信託契約の解約または重大な約款の変更等に係る書面決議を行う場合には、あらかじめ、書面決議の日および当該決議の内容に応じて次の事項をそれぞれ定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約または信託約款に係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。
  - a. 信託契約の解約の場合 信託契約の解約の理由など
  - b. 重大な約款の変更等の場合 重大な約款の変更等の内容およびその理由など
2. 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係る受益者としての受託会社を除きます。以下この2.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。
3. 書面決議は、議決権を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。
4. 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。
5. この信託は、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

## 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

1. 委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴ない、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。
2. 委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴ない、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

関係法人との契約の更改ならびに受託会社の辞任または解任に伴う取扱い

1. 委託会社と販売会社との間の募集・販売等契約は、締結日から原則1年間とし、期間終了の3ヵ月前までに別段の意思表示のない時は、同一条件にて継続されます。
2. 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。また、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申し立てることができます。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、「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、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託事務処理の再信託

受託会社は、当ファンドにかかる信託事務処理の一部について、資産管理サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

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、次のアドレスに掲載します。

<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ます。

運用報告書

委託会社は、決算時および信託終了時に期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した「運用報告書」を作成します。

- ・ 交付運用報告書は、販売会社を通じて交付いたします。
- ・ 運用報告書（全体版）は、次のアドレスに掲載します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、交付いたします。

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

#### 4【受益者の権利等】

##### (1) 収益分配金請求権

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

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

##### (2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を

失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

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

(3) 一部解約請求権

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

(4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

#### 動的パッケージファンド<DC年金>

(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)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間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。

#### 1【財務諸表】



## 【動的パッケージファンド&lt;DC年金&gt;】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期計算期間 (平成28年 5月 9日現在)	第2期計算期間 (平成29年 5月 8日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,558,908	66,384,411
親投資信託受益証券	1,053,549	152,095,305
未収入金	415,700	-
流動資産合計	3,028,157	218,479,716
資産合計	3,028,157	218,479,716
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,959,145	-
未払受託者報酬	218	32,290
未払委託者報酬	3,632	602,659
未払利息	3	147
その他未払費用	5	4,240
流動負債合計	1,963,003	639,336
負債合計	1,963,003	639,336
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,080,264	216,994,121
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	15,110	846,259
(分配準備積立金)	2,552	7,871,817
元本等合計	1,065,154	217,840,380
純資産合計	1,065,154	217,840,380
負債純資産合計	3,028,157	218,479,716

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期計算期間 (自 平成27年11月30日 至 平成28年 5月 9日)	第2期計算期間 (自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)
営業収益		
受取利息	1	340
有価証券売買等損益	23,851	9,497,756
営業収益合計	23,850	9,498,096
営業費用		
支払利息	3	33,202
受託者報酬	218	52,061
委託者報酬	3,632	971,654
その他費用	5	6,819
営業費用合計	3,858	1,063,736
営業利益又は営業損失( )	27,708	8,434,360
経常利益又は経常損失( )	27,708	8,434,360
当期純利益又は当期純損失( )	27,708	8,434,360
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	11,833	549,529
期首剰余金又は期首欠損金( )	-	15,110
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,159	1,300,151
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	1,300,151
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,159	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,394	8,323,613
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,394	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	8,323,613
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	15,110	846,259

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

項目	第2期計算期間 (自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  基準価額で評価しております。
2 収益・費用の計上基準	有価証券売買等損益  約定日基準で計上しております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

第1期計算期間 (平成28年 5月 9日現在)		第2期計算期間 (平成29年 5月 8日現在)	
1	計算期間末日における受益権の総数  1,080,264口	1	計算期間末日における受益権の総数  216,994,121口
2	元本の欠損金額 純資産額は元本を15,110円下回っております。	2	元本の欠損金額
3	計算期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産の額 0.9860円  (1万口当たり純資産の額) (9,860円)	3	計算期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産の額 1.0039円  (1万口当たり純資産の額) (10,039円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第1期計算期間 (自 平成27年11月30日 至 平成28年 5月 9日)	第2期計算期間 (自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)
1 分配金の計算過程  計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,552円)、有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(1,800円)、分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は4,352円(1万口当たり40円)	1 分配金の計算過程  計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,654,729円)、有価証券売買等損益(6,214,994円)、収益調整金(1,078,820円)、分配準備積立金(2,094円)より、分配対象収

第1期計算期間 (自 平成27年11月30日 至 平成28年 5月 9日)	第2期計算期間 (自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)
ありますが、当期の収益分配金につきましては、見送りとなりました。	益は8,950,637円(1万口当たり412円)ですが、当期の収益分配金につきましては、見送りとなりました。

## (金融商品に関する注記)

## 1.金融商品の状況に関する事項

項目	第1期計算期間 (自 平成27年11月30日 至 平成28年 5月 9日)	第2期計算期間 (自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。  これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左

項目	第1期計算期間 (自 平成27年11月30日 至 平成28年 5月 9日)	第2期計算期間 (自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部門がポジション管理を行っておりますが、取引の執行・記録・管理については、トレーディング部門が行っております。また、コンプライアンス・リスク管理部門においてデリバティブに関する法令・約款など運用に関する諸規則の遵守状況のチェックを行うとともにポートフォリオのリスク状況の分析・チェックを行い、上記プロセスを通じ、適正なリスク管理が行われているかをチェックし、必要に応じて関連部署へ報告、注意、勧告を行っております。</p> <p>なお具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>
4 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>また、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。</p>	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期計算期間 (平成28年 5月 9日現在)	第2期計算期間 (平成29年 5月 8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	(1)有価証券 親投資信託受益証券  原則として、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務  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、時価は帳簿価額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。	(1)有価証券 親投資信託受益証券  同左  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務  同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

第1期計算期間(自 平成27年11月30日 至 平成28年 5月 9日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	6,274
合計	6,274

第2期計算期間(自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	9,690,211
合計	9,690,211

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

第1期計算期間 (自 平成27年11月30日 至 平成28年 5月 9日)	第2期計算期間 (自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はありません。	同左

## ( その他の注記 )

項目	期別	第1期計算期間 (平成28年 5月 9日現在)	第2期計算期間 (平成29年 5月 8日現在)
期首元本額		1,000,000円	1,080,264円
期中追加設定元本額		2,049,848円	251,804,976円
期中一部解約元本額		1,969,584円	35,891,119円

## ( 4 ) 【附属明細表】

第 1 有価証券明細表  
(1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(平成29年 5月 8日現在)

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本・円	MHAM日本債券インデックスマザーファンド	59,969,925	73,493,143	
		MHAM外国株式インデックスマザーファンド	18,583,164	30,773,719	
		MHAM外国債券インデックスマザーファンド	15,613,462	19,171,769	
		MHAM TOPIXマザーファンド	15,930,110	28,656,674	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：69.8%	110,096,661	152,095,305 100.0%	
合計				152,095,305	

(注1) 比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### （参考）

当ファンドは、「MHAM日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「MHAM外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「MHAM TOPIXマザーファンド」受益証券、及び「MHAM外国株式インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。なお、同マザーファンドの状況は次の通りです。

#### MHAM日本債券インデックスマザーファンド

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

（単位：円）	
（平成29年 5月 8日現在）	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	1,683,216,346
国債証券	85,562,676,100
地方債証券	6,558,746,323
特殊債証券	6,969,437,827
社債証券	5,165,690,000
未収利息	233,194,950
前払費用	5,864,573
流動資産合計	106,178,826,119
<b>資産合計</b>	
106,178,826,119	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	1,414,096,848
未払利息	3,731
流動負債合計	1,414,100,579
<b>負債合計</b>	
1,414,100,579	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	85,488,693,568
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	19,276,031,972
元本等合計	104,764,725,540
<b>純資産合計</b>	
104,764,725,540	
<b>負債純資産合計</b>	
106,178,826,119	

#### 注記表



## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	(自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券  原則として時価で評価しております。
2 収益・費用の計上基準	有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益  約定日基準で計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	(平成29年 5月 8日現在)
1 計算期間末日における受益権の総数	85,488,693,568口
2 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産の額 1.2255円  (1万口当たり純資産の額) (12,255円)

## （金融商品に関する注記）

## 1.金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。
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。 なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。 これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドは信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、債券先物取引を行っており、当該デリバティブ取引は対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。

項目	(自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>
4 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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る場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、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。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年 5月 8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	<p>貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p> <p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>わが国の金融商品取引所または海外取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）（外貨建証券を除く）、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）または価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できない場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>

項目	(平成29年 5月 8日現在)
	(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務  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、時価は帳簿価額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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	2,577,814,500
地方債証券	96,493,515
特殊債証券	114,165,426
社債証券	37,220,000
合計	2,825,693,441

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	期別 (平成29年 5月 8日現在)
期首	平成28年 5月10日
親投資信託の期首における元本額	108,523,414,542円
期中追加設定元本額	52,370,140,348円
期中一部解約元本額	75,404,861,322円
期末元本額及びその内訳として当該親投資信託受益証券を投資対象とする委託者指図型投資信託ごとの元本額	
期末元本額	85,488,693,568円
動的パッケージファンド<DC年金>	59,969,925円
コア資産形成ファンド	60,418,074円
MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)	57,415,061,023円
MHAM 日本債券インデックス・ラップ	32,467,514円

期別	(平成29年 5月 8日現在)
項目	
MHAM日本債券インデックスファンド	180,787,145円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	15,376,035,487円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	10,289,279,517円
MHAM動的パッケージ4資産ファンド[適格機関投資家限定]	2,074,674,883円

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(平成29年 5月 8日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本・円	第367回利付国債(2年)	300,000,000	301,179,000	
		第370回利付国債(2年)	420,000,000	421,982,400	
		第371回利付国債(2年)	400,000,000	401,988,000	
		第373回利付国債(2年)	150,000,000	150,825,000	
		第375回利付国債(2年)	150,000,000	150,886,500	
		第112回利付国債(5年)	490,000,000	493,356,500	
		第113回利付国債(5年)	600,000,000	603,444,000	
		第114回利付国債(5年)	510,000,000	513,554,700	
		第115回利付国債(5年)	700,000,000	703,927,000	
		第116回利付国債(5年)	800,000,000	805,376,000	
		第117回利付国債(5年)	750,000,000	755,737,500	
		第118回利付国債(5年)	600,000,000	604,962,000	
		第119回利付国債(5年)	430,000,000	432,644,500	
		第120回利付国債(5年)	600,000,000	605,484,000	
		第121回利付国債(5年)	440,000,000	442,974,400	
		第122回利付国債(5年)	900,000,000	906,732,000	
		第123回利付国債(5年)	880,000,000	887,207,200	
		第124回利付国債(5年)	900,000,000	907,884,000	
		第125回利付国債(5年)	870,000,000	878,091,000	
		第126回利付国債(5年)	780,000,000	787,800,000	
		第127回利付国債(5年)	900,000,000	909,441,000	
第128回利付国債(5年)	870,000,000	879,543,900			
第129回利付国債(5年)	810,000,000	819,250,200			
第130回利付国債(5年)	890,000,000	901,169,500			

第131回利付国債(5年)	550,000,000	556,726,500	
第1回利付国債(40年)	80,000,000	114,224,000	
第2回利付国債(40年)	140,000,000	193,195,800	
第3回利付国債(40年)	140,000,000	194,027,400	
第4回利付国債(40年)	200,000,000	278,308,000	
第5回利付国債(40年)	210,000,000	280,602,000	
第6回利付国債(40年)	220,000,000	287,834,800	
第7回利付国債(40年)	230,000,000	287,288,400	
第8回利付国債(40年)	240,000,000	277,012,800	
第9回利付国債(40年)	330,000,000	273,441,300	
第293回利付国債(10年)	490,000,000	500,980,900	
第294回利付国債(10年)	220,000,000	224,683,800	
第295回利付国債(10年)	340,000,000	346,480,400	
第296回利付国債(10年)	640,000,000	654,924,800	
第297回利付国債(10年)	290,000,000	297,583,500	
第298回利付国債(10年)	610,000,000	624,963,300	
第299回利付国債(10年)	390,000,000	400,959,000	
第300回利付国債(10年)	230,000,000	237,320,900	
第301回利付国債(10年)	510,000,000	528,278,400	
第302回利付国債(10年)	350,000,000	361,763,500	
第303回利付国債(10年)	590,000,000	612,207,600	
第304回利付国債(10年)	330,000,000	341,635,800	
第305回利付国債(10年)	720,000,000	748,080,000	
第306回利付国債(10年)	540,000,000	564,445,800	
第307回利付国債(10年)	270,000,000	281,448,000	
第308回利付国債(10年)	360,000,000	376,614,000	
第309回利付国債(10年)	600,000,000	623,934,000	
第310回利付国債(10年)	490,000,000	509,394,200	
第311回利付国債(10年)	250,000,000	258,205,000	
第312回利付国債(10年)	880,000,000	923,832,800	
第313回利付国債(10年)	600,000,000	634,146,000	
第314回利付国債(10年)	370,000,000	388,181,800	
第315回利付国債(10年)	430,000,000	454,204,700	
第316回利付国債(10年)	330,000,000	347,209,500	
第317回利付国債(10年)	340,000,000	358,747,600	
第318回利付国債(10年)	680,000,000	714,510,000	
第319回利付国債(10年)	480,000,000	507,873,600	
第320回利付国債(10年)	570,000,000	600,449,400	
第321回利付国債(10年)	670,000,000	707,546,800	
第322回利付国債(10年)	400,000,000	420,460,000	
第323回利付国債(10年)	400,000,000	421,312,000	
第324回利付国債(10年)	610,000,000	639,359,300	

第325回利付国債（10年）	990,000,000	1,039,727,700
第326回利付国債（10年）	440,000,000	460,521,600
第327回利付国債（10年）	600,000,000	631,374,000
第328回利付国債（10年）	870,000,000	906,966,300
第329回利付国債（10年）	960,000,000	1,014,067,200
第330回利付国債（10年）	710,000,000	751,407,200
第331回利付国債（10年）	400,000,000	418,200,000
第332回利付国債（10年）	960,000,000	1,005,072,000
第333回利付国債（10年）	910,000,000	953,998,500
第334回利付国債（10年）	700,000,000	734,573,000
第335回利付国債（10年）	860,000,000	896,618,800
第336回利付国債（10年）	380,000,000	396,275,400
第337回利付国債（10年）	590,000,000	606,242,700
第338回利付国債（10年）	810,000,000	838,763,100
第339回利付国債（10年）	940,000,000	973,661,400
第340回利付国債（10年）	900,000,000	932,841,000
第341回利付国債（10年）	840,000,000	863,562,000
第342回利付国債（10年）	900,000,000	909,180,000
第343回利付国債（10年）	860,000,000	868,230,200
第344回利付国債（10年）	880,000,000	887,823,200
第345回利付国債（10年）	810,000,000	816,601,500
第346回利付国債（10年）	470,000,000	473,463,900
第1回利付国債（30年）	10,000,000	13,232,900
第11回利付国債（30年）	50,000,000	60,387,000
第12回利付国債（30年）	30,000,000	38,125,800
第13回利付国債（30年）	50,000,000	62,854,000
第14回利付国債（30年）	50,000,000	66,160,500
第15回利付国債（30年）	60,000,000	80,437,800
第16回利付国債（30年）	90,000,000	120,882,600
第17回利付国債（30年）	70,000,000	92,959,300
第18回利付国債（30年）	80,000,000	104,987,200
第19回利付国債（30年）	80,000,000	105,049,600
第20回利付国債（30年）	130,000,000	175,502,600
第21回利付国債（30年）	110,000,000	144,826,000
第22回利付国債（30年）	70,000,000	94,700,200
第23回利付国債（30年）	150,000,000	203,043,000
第24回利付国債（30年）	80,000,000	108,439,200
第25回利付国債（30年）	130,000,000	171,642,900
第26回利付国債（30年）	220,000,000	294,716,400
第27回利付国債（30年）	220,000,000	299,659,800
第28回利付国債（30年）	240,000,000	328,190,400
第29回利付国債（30年）	250,000,000	338,095,000
第30回利付国債（30年）	290,000,000	387,521,200

第3 1 回利付国債(3 0年)	280,000,000	369,429,200	
第3 2 回利付国債(3 0年)	360,000,000	484,002,000	
第3 3 回利付国債(3 0年)	360,000,000	462,330,000	
第3 4 回利付国債(3 0年)	340,000,000	452,597,800	
第3 5 回利付国債(3 0年)	370,000,000	477,570,100	
第3 6 回利付国債(3 0年)	360,000,000	466,005,600	
第3 7 回利付国債(3 0年)	410,000,000	522,159,600	
第3 8 回利付国債(3 0年)	280,000,000	350,898,800	
第3 9 回利付国債(3 0年)	240,000,000	306,285,600	
第4 0 回利付国債(3 0年)	230,000,000	288,233,700	
第4 1 回利付国債(3 0年)	240,000,000	295,166,400	
第4 2 回利付国債(3 0年)	240,000,000	295,262,400	
第4 3 回利付国債(3 0年)	150,000,000	184,602,000	
第4 4 回利付国債(3 0年)	240,000,000	295,454,400	
第4 5 回利付国債(3 0年)	250,000,000	295,595,000	
第4 6 回利付国債(3 0年)	300,000,000	354,711,000	
第4 7 回利付国債(3 0年)	290,000,000	350,073,500	
第4 8 回利付国債(3 0年)	290,000,000	335,657,600	
第4 9 回利付国債(3 0年)	300,000,000	347,163,000	
第5 0 回利付国債(3 0年)	290,000,000	290,681,500	
第5 1 回利付国債(3 0年)	270,000,000	235,618,200	
第5 2 回利付国債(3 0年)	280,000,000	258,182,400	
第5 3 回利付国債(3 0年)	270,000,000	255,843,900	
第5 4 回利付国債(3 0年)	170,000,000	169,794,300	
第4 6 回利付国債(2 0年)	40,000,000	42,978,000	
第5 9 回利付国債(2 0年)	10,000,000	11,028,600	
第6 4 回利付国債(2 0年)	30,000,000	33,853,800	
第6 5 回利付国債(2 0年)	60,000,000	67,966,200	
第6 7 回利付国債(2 0年)	50,000,000	56,888,000	
第7 0 回利付国債(2 0年)	50,000,000	58,890,500	
第7 1 回利付国債(2 0年)	40,000,000	46,540,000	
第7 2 回利付国債(2 0年)	110,000,000	127,669,300	
第7 3 回利付国債(2 0年)	40,000,000	46,284,400	
第7 4 回利付国債(2 0年)	40,000,000	46,590,400	
第7 5 回利付国債(2 0年)	40,000,000	46,768,000	
第7 6 回利付国債(2 0年)	70,000,000	80,739,400	
第7 7 回利付国債(2 0年)	40,000,000	46,452,400	
第7 8 回利付国債(2 0年)	60,000,000	69,473,400	
第7 9 回利付国債(2 0年)	50,000,000	58,301,500	
第8 0 回利付国債(2 0年)	90,000,000	105,674,400	
第8 1 回利付国債(2 0年)	160,000,000	187,235,200	
第8 2 回利付国債(2 0年)	140,000,000	165,004,000	

第83回利付国債(20年)	70,000,000	82,804,400
第84回利付国債(20年)	170,000,000	199,629,300
第85回利付国債(20年)	150,000,000	178,066,500
第86回利付国債(20年)	120,000,000	144,582,000
第87回利付国債(20年)	120,000,000	143,517,600
第88回利付国債(20年)	240,000,000	290,431,200
第89回利付国債(20年)	10,000,000	12,010,100
第90回利付国債(20年)	170,000,000	204,926,500
第91回利付国債(20年)	110,000,000	133,629,100
第92回利付国債(20年)	290,000,000	348,043,500
第93回利付国債(20年)	120,000,000	143,311,200
第94回利付国債(20年)	220,000,000	264,899,800
第95回利付国債(20年)	200,000,000	245,646,000
第96回利付国債(20年)	120,000,000	144,969,600
第97回利付国債(20年)	160,000,000	195,569,600
第98回利付国債(20年)	160,000,000	193,918,400
第99回利付国債(20年)	300,000,000	364,737,000
第100回利付国債(20年)	240,000,000	295,096,800
第101回利付国債(20年)	130,000,000	162,646,900
第102回利付国債(20年)	140,000,000	175,774,200
第103回利付国債(20年)	160,000,000	199,121,600
第104回利付国債(20年)	110,000,000	134,473,900
第105回利付国債(20年)	240,000,000	294,266,400
第106回利付国債(20年)	100,000,000	123,736,000
第107回利付国債(20年)	150,000,000	184,440,000
第108回利付国債(20年)	250,000,000	301,660,000
第109回利付国債(20年)	170,000,000	205,504,500
第110回利付国債(20年)	240,000,000	295,740,000
第111回利付国債(20年)	170,000,000	212,088,600
第112回利付国債(20年)	280,000,000	345,982,000
第113回利付国債(20年)	410,000,000	507,666,100
第114回利付国債(20年)	300,000,000	372,417,000
第115回利付国債(20年)	110,000,000	137,914,700
第116回利付国債(20年)	180,000,000	226,126,800
第117回利付国債(20年)	250,000,000	310,917,500
第118回利付国債(20年)	185,000,000	228,130,900
第119回利付国債(20年)	100,000,000	120,752,000
第120回利付国債(20年)	220,000,000	260,018,000
第121回利付国債(20年)	260,000,000	317,946,200
第122回利付国債(20年)	210,000,000	254,064,300
第123回利付国債(20年)	290,000,000	363,022,000
第124回利付国債(20年)	180,000,000	222,939,000
第125回利付国債(20年)	210,000,000	266,282,100



		第126回利付国債(20年)	140,000,000	173,751,200	
		第127回利付国債(20年)	120,000,000	147,213,600	
		第128回利付国債(20年)	290,000,000	356,439,000	
		第129回利付国債(20年)	60,000,000	72,925,200	
		第130回利付国債(20年)	250,000,000	304,152,500	
		第131回利付国債(20年)	170,000,000	204,464,100	
		第132回利付国債(20年)	210,000,000	252,751,800	
		第133回利付国債(20年)	270,000,000	328,770,900	
		第134回利付国債(20年)	200,000,000	243,892,000	
		第135回利付国債(20年)	170,000,000	204,731,000	
		第136回利付国債(20年)	150,000,000	178,501,500	
		第137回利付国債(20年)	170,000,000	204,999,600	
		第138回利付国債(20年)	200,000,000	235,206,000	
		第139回利付国債(20年)	130,000,000	154,767,600	
		第140回利付国債(20年)	430,000,000	518,795,000	
		第141回利付国債(20年)	300,000,000	362,103,000	
		第142回利付国債(20年)	180,000,000	219,942,000	
		第143回利付国債(20年)	300,000,000	357,690,000	
		第144回利付国債(20年)	140,000,000	164,686,200	
		第145回利付国債(20年)	450,000,000	543,483,000	
		第146回利付国債(20年)	400,000,000	483,204,000	
		第147回利付国債(20年)	420,000,000	500,854,200	
		第148回利付国債(20年)	300,000,000	352,959,000	
		第149回利付国債(20年)	460,000,000	541,038,200	
		第150回利付国債(20年)	430,000,000	498,602,200	
		第151回利付国債(20年)	430,000,000	483,814,500	
		第152回利付国債(20年)	460,000,000	517,030,800	
		第153回利付国債(20年)	420,000,000	478,984,800	
		第154回利付国債(20年)	420,000,000	471,429,000	
		第155回利付国債(20年)	460,000,000	499,587,600	
		第156回利付国債(20年)	450,000,000	439,591,500	
		第157回利付国債(20年)	440,000,000	412,649,600	
		第158回利付国債(20年)	450,000,000	445,279,500	
		第159回利付国債(20年)	460,000,000	462,433,400	
		第160回利付国債(20年)	200,000,000	204,456,000	
	小計	銘柄数: 229	78,175,000,000	85,562,676,100	
		組入時価比率: 81.7%		82.0%	
	合計			85,562,676,100	
地方債証券	日本・円	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,284,000	
		第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,196,000	
		第18回東京都公募公債(20年)	100,000,000	122,412,000	
		第21回東京都公募公債(20年)	100,000,000	122,828,000	

第681回東京都公募公債	100,000,000	103,962,000	
第687回東京都公募公債	100,000,000	103,716,000	
第760回東京都公募公債	100,000,000	99,120,000	
第3回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	133,975,000	
第176回神奈川県公募公債	100,000,000	103,851,000	
第213回神奈川県公募公債	100,000,000	103,508,000	
第2回静岡県公募公債（15年）	100,000,000	111,858,000	
第4回静岡県公募公債（15年）	100,000,000	111,710,000	
平成20年度第5回静岡県公募公債	103,100,000	105,505,323	
第13回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	116,132,000	
平成25年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	104,456,000	
平成25年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	104,937,000	
平成27年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	99,647,000	
平成25年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	104,316,000	
第7回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	103,780,000	
第63回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,116,000	
第66回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,123,000	
第69回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,530,000	
第71回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,696,000	
第73回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,091,000	
第74回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,176,000	
第77回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,496,000	
第80回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,889,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,991,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,543,000	
第97回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,387,000	
第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,026,000	
第105回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,881,000	
第115回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,255,000	
第132回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,290,000	
第153回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,026,000	
平成23年度第2回堺市公募公債	100,000,000	104,816,000	
平成26年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	103,639,000	
平成26年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	103,196,000	
平成22年度第1回栃木県公募公債	100,000,000	103,687,000	
平成26年度第1回熊本市公募公債	100,000,000	103,196,000	
平成23年度第1回新潟市公募公債 （10年）	100,000,000	104,829,000	
平成27年度第1回奈良県公募公債	100,000,000	100,306,000	
平成26年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	103,343,000	
平成26年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	101,955,000	
第16回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	114,888,000	

		第467回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	103,399,000	
		平成26年度第4回神戸市公募公債	100,000,000	103,982,000	
		平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	104,694,000	
		第29回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	115,072,000	
		平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	103,505,000	
		第41回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	100,350,000	
		第6回北九州市公募公債(20年)	100,000,000	119,830,000	
		平成20年度第3回福岡市公募公債	100,000,000	101,688,000	
		平成26年度第3回広島市公募公債	100,000,000	102,667,000	
		平成25年度第1回仙台市公募公債	100,000,000	100,392,000	
		第8回さいたま市公募公債	100,000,000	104,335,000	
		平成26年度第1回相模原市公募公債	100,000,000	103,442,000	
		平成26年度第1回三重県公募公債	100,000,000	102,892,000	
		平成26年度第1回岡山市公募公債(10年)	100,000,000	101,921,000	
		第7回広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	100,000,000	102,939,000	
		第119回愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	100,000,000	100,103,000	
		第119回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	102,971,000	
	小計	銘柄数: 62 組入時価比率: 6.3%	6,203,100,000	6,558,746,323 6.3%	
	合計			6,558,746,323	
特殊債券	日本・円	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,062,000	
		第64回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,135,000	
		第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,419,000	
		第75回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,860,000	
		第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,157,000	
		第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,190,000	
		第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,247,000	
		第97回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,292,000	
		第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,638,000	
		第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	105,525,810	
		第124回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,255,000	
		第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	116,000,000	122,129,440	

第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,040,000	
第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,450,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,617,000	
第153回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,522,000	
第155回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,715,000	
第162回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,388,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,392,000	
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,622,000	
第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,723,000	
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,837,000	
第202回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	105,000,000	109,935,000	
第211回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,641,000	
第218回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,730,000	
第250回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,457,000	
第254回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,185,000	
第7回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	100,000,000	100,415,000	
第8回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,128,000	
第9回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	100,000,000	100,686,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,324,000	
第13回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	122,693,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,563,000	
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	117,016,000	
第24回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,571,000	
第29回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,469,000	
第36回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,667,000	
第36回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	115,510,000	
第38回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,486,000	
第40回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,051,000	

第44回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,317,000	
第71回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,787,000	
第30回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	100,639,000	
第23回国際協力銀行債券	100,000,000	116,657,000	
第20回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	103,664,000	
第21回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	103,253,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,105,000	23,615,876	
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,511,000	36,102,405	
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,638,000	50,350,984	
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,468,000	20,795,133	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,986,000	50,091,304	
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,859,000	56,951,045	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,790,000	58,938,787	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,295,000	67,566,972	
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,572,000	64,478,814	
第82回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,544,000	73,147,073	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,283,000	75,010,960	
第86回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,913,000	77,701,261	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,646,000	79,950,533	
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,307,000	83,500,451	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,295,000	90,408,782	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,187,000	92,138,197	
第11回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	102,199,000	
い第770号商工債	100,000,000	100,398,000	
い第777号商工債	100,000,000	100,560,000	
い第780号商工債	100,000,000	100,624,000	
い第772号農林債	100,000,000	100,549,000	
第288回信金中金債(5年)	100,000,000	100,449,000	
第293回信金中金債(5年)	100,000,000	100,461,000	
第186号商工債(3年)	100,000,000	100,180,000	
第18回国際協力機構債券	100,000,000	105,048,000	

		第78回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	105,161,000	
	小計	銘柄数：72 組入時価比率：6.7%	6,582,399,000	6,969,437,827	6.7%
	合計			6,969,437,827	
社債券	日本・円	第8回ノルデア・バンク・アクツイエボラーグ・プブリクト円貨社	100,000,000	99,973,000	
		第5回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債(2013)	100,000,000	100,818,000	
		第11回阪神高速道路株式会社社債	100,000,000	100,508,000	
		第344回東京交通債券	100,000,000	109,024,000	
		第16回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	103,181,000	
		第11回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債(2015)	100,000,000	100,264,000	
		第27回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレン	100,000,000	100,089,000	
		第26回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,603,000	
		第56回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	104,300,000	
		第26回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,482,000	
		第22回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,312,000	
		第10回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,365,000	
		第9回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,483,000	
		第8回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	100,528,000	
		第49回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	104,411,000	
		第4回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	101,001,000	
		第65回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	103,021,000	
		第23回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	101,522,000	
		第36回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	101,653,000	
		第8回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	103,635,000	
		第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	103,110,000	
		第57回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	100,421,000	
		第53回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	100,394,000	
		第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	111,473,000	
		第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	120,472,000	

	第12回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	118,000,000	
	第9回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	101,207,000	
	第59回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,469,000	
	第35回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	100,467,000	
	第38回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	100,550,000	
	第34回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,059,000	
	第12回東京センチュリーリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,364,000	
	第31回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	101,096,000	
	第60回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,336,000	
	第29回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,399,000	
	第16回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	101,808,000	
	第112回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,601,000	
	第86回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,938,000	
	第71回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,247,000	
	第64回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,481,000	
	第65回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	122,037,000	
	第7回西日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	103,858,000	
	第62回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	103,882,000	
	第484回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,737,000	
	第382回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,490,000	
	第311回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,758,000	
	第405回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,602,000	
	第34回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	104,267,000	
	第30回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	103,611,000	
	第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	104,383,000	
小計	銘柄数：50 組入時価比率：4.9%	5,000,000,000	5,165,690,000	5.0%
合計			5,165,690,000	
	合計		104,256,550,250	

（注1）比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## MHAM外国債券インデックスマザーファンド

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

(単位：円)	
(平成29年 5月 8日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	123,155,826
コール・ローン	443,369,998
国債証券	11,342,687,475
未収利息	85,947,025
前払金	11,638,525
前払費用	9,262,824
流動資産合計	12,016,061,673
資産合計	12,016,061,673
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,114
未払金	15,717,481
未払解約金	440,274,507
未払利息	982
流動負債合計	455,994,084
負債合計	455,994,084
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	9,414,646,557
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,145,421,032
元本等合計	11,560,067,589
純資産合計	11,560,067,589
負債純資産合計	12,016,061,673

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)



項目	(自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p>
2 派生商品等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として時価で評価しております。</p>
3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は計算期間末日に残高がある場合、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
4 収益・費用の計上基準	<p>有価証券売買等損益、派生商品取引等損益及び為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成29年 5月 8日現在)
1 計算期間末日における受益権の総数	9,414,646,557口
2 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産の額 1.2279円
	(1万口当たり純資産の額) (12,279円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)
1 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。</p>

項目	(自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>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。</p> <p>なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。</p> <p>これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>当ファンドは信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、債券先物取引を行っており、当該デリバティブ取引は対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>また、外貨建証券の売買等の決済に伴い必要となる外貨の売買のために、為替予約取引を行っております。</p>
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>
4 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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る場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、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。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年 5月 8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	<p>貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>国債証券</p>

項目	(平成29年 5月 8日現在)
	<p>わが国の金融商品取引所または海外取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値)(外貨建証券を除く)、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く)または価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できない場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引</p> <p>為替予約取引</p> <p>デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

(自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	281,498,836
合計	281,498,836

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## (通貨関連)

(平成29年 5月 8日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	32,600,000	-	32,598,886	1,114
	米・ドル	16,730,000	-	16,729,405	595

	ユーロ	12,880,000	-	12,879,687	313
	英・ボンド	2,990,000	-	2,989,794	206
	合計	32,600,000	-	32,598,886	1,114

## （注）時価の算定方法

(1) 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

## （その他の注記）

項目	期別 (平成29年 5月 8日現在)
期首	平成28年 5月10日
親投資信託の期首における元本額	19,012,523,105円
期中追加設定元本額	7,497,932,152円
期中一部解約元本額	17,095,808,700円
期末元本額及びその内訳として当該親投資信託受益証券を投資対象とする委託者指図型投資信託ごとの元本額	
期末元本額	9,414,646,557円
動的パッケージファンド<DC年金>	15,613,462円
コア資産形成ファンド	15,976,929円
MHAM外国債券インデックスファンド（ファンドラップ）	476,894,824円
MHAM外国債券インデックスファンド	78,383,478円
MHAM外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	1,180,773,815円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	4,076,708,749円
MHAM外国債券パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	3,570,295,300円

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米・ドル	US TREASURY N/B 0.75%	160,000.00	158,437.50	
		US TREASURY N/B 0.875%	150,000.00	149,390.62	
		US TREASURY N/B 1.125%	300,000.00	299,718.75	
		US TREASURY N/B 1.125%	320,000.00	319,125.00	
		US TREASURY N/B 1.125%	180,000.00	179,451.56	
		US TREASURY N/B 1.125%	240,000.00	239,268.75	
		US TREASURY N/B 1.125%	150,000.00	148,769.53	
		US TREASURY N/B 1.125%	130,000.00	128,639.06	
		US TREASURY N/B 1.125%	140,000.00	138,392.18	
		US TREASURY N/B 1.125%	220,000.00	215,135.93	
		US TREASURY N/B 1.125%	30,000.00	29,175.00	
		US TREASURY N/B 1.125%	90,000.00	87,426.00	
		US TREASURY N/B 1.125%	50,000.00	48,477.50	
		US TREASURY N/B 1.25%	200,000.00	199,953.12	
		US TREASURY N/B 1.25%	300,000.00	299,929.68	
		US TREASURY N/B 1.25%	200,000.00	199,906.25	
		US TREASURY N/B 1.25%	400,000.00	399,750.00	
		US TREASURY N/B 1.25%	170,000.00	169,880.46	
		US TREASURY N/B 1.25%	150,000.00	149,812.50	
		US TREASURY N/B 1.25%	100,000.00	99,859.37	
		US TREASURY N/B 1.25%	130,000.00	129,268.75	
		US TREASURY N/B 1.25%	120,000.00	119,268.75	
		US TREASURY N/B 1.25%	40,000.00	39,253.12	
		US TREASURY N/B 1.25%	300,000.00	292,453.12	
		US TREASURY N/B 1.25%	150,000.00	142,590.00	
		US TREASURY N/B 1.375%	300,000.00	300,585.93	
		US TREASURY N/B 1.375%	230,000.00	230,377.34	
		US TREASURY N/B 1.375%	1,000,000.00	1,001,562.50	
		US TREASURY N/B 1.375%	300,000.00	300,468.75	
		US TREASURY N/B 1.375%	130,000.00	130,182.81	
		US TREASURY N/B 1.375%	170,000.00	170,225.78	
		US TREASURY N/B 1.375%	120,000.00	119,821.87	
		US TREASURY N/B 1.375%	130,000.00	129,746.09	
		US TREASURY N/B 1.375%	220,000.00	219,415.62	
		US TREASURY N/B 1.375%	330,000.00	328,994.53	
US TREASURY N/B 1.375%	250,000.00	249,101.56			
US TREASURY N/B 1.375%	300,000.00	298,687.50			
US TREASURY N/B 1.375%	300,000.00	298,429.68			
US TREASURY N/B 1.375%	250,000.00	248,105.47			
US TREASURY N/B 1.375%	190,000.00	188,396.87			

US TREASURY N/B 1.375%	70,000.00	69,354.68
US TREASURY N/B 1.375%	420,000.00	414,914.06
US TREASURY N/B 1.375%	230,000.00	219,765.00
US TREASURY N/B 1.5%	280,000.00	280,918.75
US TREASURY N/B 1.5%	300,000.00	300,984.37
US TREASURY N/B 1.5%	200,000.00	200,671.87
US TREASURY N/B 1.5%	200,000.00	200,656.25
US TREASURY N/B 1.5%	210,000.00	210,721.87
US TREASURY N/B 1.5%	251,400.00	251,969.57
US TREASURY N/B 1.5%	300,000.00	300,609.37
US TREASURY N/B 1.5%	250,000.00	249,628.90
US TREASURY N/B 1.5%	210,000.00	206,407.03
US TREASURY N/B 1.5%	240,000.00	232,950.00
US TREASURY N/B 1.5%	30,000.00	29,090.62
US TREASURY N/B 1.5%	390,000.00	362,608.59
US TREASURY N/B 1.625%	240,000.00	241,406.25
US TREASURY N/B 1.625%	200,000.00	201,171.87
US TREASURY N/B 1.625%	250,000.00	251,425.78
US TREASURY N/B 1.625%	310,000.00	311,743.75
US TREASURY N/B 1.625%	300,000.00	301,617.18
US TREASURY N/B 1.625%	325,000.00	326,523.43
US TREASURY N/B 1.625%	80,000.00	80,293.75
US TREASURY N/B 1.625%	250,000.00	250,429.68
US TREASURY N/B 1.625%	270,000.00	270,316.40
US TREASURY N/B 1.625%	400,000.00	399,343.75
US TREASURY N/B 1.625%	150,000.00	147,562.50
US TREASURY N/B 1.625%	350,000.00	343,492.18
US TREASURY N/B 1.625%	100,000.00	97,546.87
US TREASURY N/B 1.625%	230,000.00	224,178.12
US TREASURY N/B 1.625%	90,000.00	87,273.00
US TREASURY N/B 1.625%	370,000.00	349,360.93
US TREASURY N/B 1.625%	440,000.00	414,562.50
US TREASURY N/B 1.75%	260,000.00	262,153.12
US TREASURY N/B 1.75%	200,000.00	200,703.12
US TREASURY N/B 1.75%	370,000.00	370,751.56
US TREASURY N/B 1.75%	160,000.00	159,350.00
US TREASURY N/B 1.75%	200,000.00	198,734.37
US TREASURY N/B 1.75%	80,000.00	79,462.50
US TREASURY N/B 1.75%	180,000.00	178,650.00
US TREASURY N/B 1.75%	400,000.00	397,156.25
US TREASURY N/B 1.75%	210,000.00	207,653.90
US TREASURY N/B 1.75%	330,000.00	325,153.12

US TREASURY N/B 1.75%	390,000.00	383,083.59
US TREASURY N/B 1.875%	120,000.00	121,171.87
US TREASURY N/B 1.875%	250,000.00	250,312.50
US TREASURY N/B 1.875%	110,000.00	110,017.18
US TREASURY N/B 1.875%	320,000.00	319,792.00
US TREASURY N/B 1.875%	50,000.00	49,929.68
US TREASURY N/B 1.875%	210,000.00	209,146.87
US TREASURY N/B 1.875%	200,000.00	198,859.37
US TREASURY N/B 1%	300,000.00	299,367.18
US TREASURY N/B 1%	300,000.00	299,343.75
US TREASURY N/B 1%	200,000.00	199,421.87
US TREASURY N/B 1%	170,000.00	169,455.46
US TREASURY N/B 1%	290,000.00	288,368.75
US TREASURY N/B 1%	300,000.00	297,630.00
US TREASURY N/B 1%	300,000.00	297,375.00
US TREASURY N/B 1%	170,000.00	168,233.59
US TREASURY N/B 2.125%	210,000.00	213,461.71
US TREASURY N/B 2.125%	200,000.00	203,046.87
US TREASURY N/B 2.125%	190,000.00	192,642.18
US TREASURY N/B 2.125%	140,000.00	141,968.75
US TREASURY N/B 2.125%	250,000.00	253,144.53
US TREASURY N/B 2.125%	250,000.00	252,929.68
US TREASURY N/B 2.125%	220,000.00	222,114.06
US TREASURY N/B 2.125%	260,000.00	261,645.31
US TREASURY N/B 2.125%	130,000.00	129,935.00
US TREASURY N/B 2.125%	150,000.00	149,707.03
US TREASURY N/B 2.125%	580,000.00	573,656.25
US TREASURY N/B 2.25%	170,000.00	173,293.75
US TREASURY N/B 2.25%	180,000.00	183,445.31
US TREASURY N/B 2.25%	300,000.00	305,484.37
US TREASURY N/B 2.25%	40,000.00	40,275.00
US TREASURY N/B 2.25%	160,000.00	160,920.00
US TREASURY N/B 2.25%	680,000.00	681,115.62
US TREASURY N/B 2.25%	380,000.00	378,189.05
US TREASURY N/B 2.25%	290,000.00	287,349.19
US TREASURY N/B 2.25%	270,000.00	230,006.25
US TREASURY N/B 2.375%	200,000.00	204,937.50
US TREASURY N/B 2.375%	320,000.00	323,775.00
US TREASURY N/B 2.5%	300,000.00	307,242.18
US TREASURY N/B 2.5%	490,000.00	500,412.50
US TREASURY N/B 2.5%	270,000.00	244,244.53
US TREASURY N/B 2.5%	280,000.00	252,612.50
US TREASURY N/B 2.5%	250,000.00	225,449.22

US TREASURY N/B 2.625%	365,000.00	377,005.07
US TREASURY N/B 2.625%	250,000.00	258,339.84
US TREASURY N/B 2.75%	180,000.00	184,570.31
US TREASURY N/B 2.75%	460,000.00	477,753.12
US TREASURY N/B 2.75%	390,000.00	404,838.28
US TREASURY N/B 2.75%	130,000.00	124,739.06
US TREASURY N/B 2.75%	156,000.00	149,601.56
US TREASURY N/B 2.875%	290,000.00	284,177.32
US TREASURY N/B 2.875%	250,000.00	244,003.90
US TREASURY N/B 2.875%	260,000.00	253,743.74
US TREASURY N/B 2%	210,000.00	212,707.03
US TREASURY N/B 2%	150,000.00	151,875.00
US TREASURY N/B 2%	180,000.00	182,053.12
US TREASURY N/B 2%	300,000.00	303,210.93
US TREASURY N/B 2%	120,000.00	121,153.12
US TREASURY N/B 2%	210,000.00	211,640.62
US TREASURY N/B 2%	210,000.00	211,427.34
US TREASURY N/B 2%	360,000.00	362,643.75
US TREASURY N/B 2%	190,000.00	191,157.81
US TREASURY N/B 2%	250,000.00	251,777.34
US TREASURY N/B 2%	250,000.00	250,605.47
US TREASURY N/B 2%	300,000.00	300,000.00
US TREASURY N/B 2%	470,000.00	469,412.50
US TREASURY N/B 2%	580,000.00	569,668.75
US TREASURY N/B 2%	360,000.00	352,096.87
US TREASURY N/B 2%	380,000.00	368,600.00
US TREASURY N/B 3.125%	260,000.00	269,323.43
US TREASURY N/B 3.125%	300,000.00	315,890.62
US TREASURY N/B 3.125%	105,000.00	108,133.59
US TREASURY N/B 3.125%	150,000.00	154,335.93
US TREASURY N/B 3.125%	250,000.00	256,738.28
US TREASURY N/B 3.125%	260,000.00	266,784.37
US TREASURY N/B 3.375%	305,000.00	319,844.92
US TREASURY N/B 3.375%	230,000.00	246,908.59
US TREASURY N/B 3.5%	215,000.00	227,513.67
US TREASURY N/B 3.5%	50,000.00	55,289.06
US TREASURY N/B 3.625%	220,000.00	231,051.56
US TREASURY N/B 3.625%	500,000.00	529,414.06
US TREASURY N/B 3.625%	130,000.00	139,232.03
US TREASURY N/B 3.625%	220,000.00	246,245.31
US TREASURY N/B 3.625%	210,000.00	235,396.87
US TREASURY N/B 3.75%	195,000.00	202,221.09



	US TREASURY N/B 3.75%	110,000.00	125,511.71
	US TREASURY N/B 3.75%	330,000.00	377,566.40
	US TREASURY N/B 3.875%	75,000.00	77,015.62
	US TREASURY N/B 3.875%	140,000.00	162,596.87
	US TREASURY N/B 3%	150,000.00	150,937.50
	US TREASURY N/B 3%	240,000.00	240,393.74
	US TREASURY N/B 3%	280,000.00	280,153.12
	US TREASURY N/B 3%	260,000.00	260,060.93
	US TREASURY N/B 3%	240,000.00	240,431.23
	US TREASURY N/B 4.25%	80,000.00	98,106.25
	US TREASURY N/B 4.25%	130,000.00	159,432.81
	US TREASURY N/B 4.375%	50,000.00	62,667.96
	US TREASURY N/B 4.375%	100,000.00	124,742.18
	US TREASURY N/B 4.375%	65,000.00	81,138.28
	US TREASURY N/B 4.375%	100,000.00	125,070.31
	US TREASURY N/B 4.5%	90,000.00	114,475.78
	US TREASURY N/B 4.5%	60,000.00	76,425.00
	US TREASURY N/B 4.5%	85,000.00	107,837.10
	US TREASURY N/B 4.625%	120,000.00	154,875.00
	US TREASURY N/B 4.75%	100,000.00	131,632.81
	US TREASURY N/B 5.25%	65,000.00	83,194.92
	US TREASURY N/B 5.25%	80,000.00	102,800.00
	US TREASURY N/B 5.375%	80,000.00	106,987.50
	US TREASURY N/B 5.5%	50,000.00	65,054.68
	US TREASURY N/B 5%	55,000.00	74,262.89
	US TREASURY N/B 6.125%	80,000.00	107,793.75
	US TREASURY N/B 6.25%	70,000.00	87,270.31
	US TREASURY N/B 6.25%	49,000.00	69,564.68
	US TREASURY N/B 6.5%	50,000.00	67,757.81
	US TREASURY N/B 6%	60,000.00	77,700.00
	US TREASURY N/B 8%	35,000.00	44,329.68
小計	銘柄数：198	44,136,400.00	44,672,125.66 (5,036,335,446)
	組入時価比率：43.6%		44.4%
カナダ・ドル	CANADIAN GOVT 0.5%	140,000.00	139,756.40
	CANADIAN GOVT 0.5%	180,000.00	179,595.00
	CANADIAN GOVT 0.5%	80,000.00	79,773.60
	CANADIAN GOVT 0.5%	80,000.00	78,136.00
	CANADIAN GOVT 0.75%	80,000.00	79,811.20
	CANADIAN GOVT 0.75%	100,000.00	99,464.00
	CANADIAN GOVT 0.75%	80,000.00	79,382.40
	CANADIAN GOVT 1.25%	40,000.00	40,314.40
	CANADIAN GOVT 1.5%	170,000.00	173,510.50

	CANADIAN GOVT 1.5%	100,000.00	102,018.00
	CANADIAN GOVT 1.5%	110,000.00	110,566.50
	CANADIAN GOVT 1.75%	70,000.00	71,377.60
	CANADIAN GOVT 1.75%	100,000.00	102,399.00
	CANADIAN GOVT 1%	20,000.00	18,984.00
	CANADIAN GOVT 2.25%	90,000.00	96,250.50
	CANADIAN GOVT 2.5%	70,000.00	75,914.30
	CANADIAN GOVT 2.75%	110,000.00	119,292.80
	CANADIAN GOVT 2.75%	80,000.00	90,880.00
	CANADIAN GOVT 2.75%	20,000.00	23,750.60
	CANADIAN GOVT 3.25%	85,000.00	92,902.45
	CANADIAN GOVT 3.5%	70,000.00	75,730.90
	CANADIAN GOVT 3.5%	120,000.00	153,308.40
	CANADIAN GOVT 3.75%	150,000.00	159,369.00
	CANADIAN GOVT 4%	100,000.00	134,251.00
	CANADIAN GOVT 5.75%	90,000.00	129,142.80
	CANADIAN GOVT 5.75%	80,000.00	121,773.60
	CANADIAN GOVT 5%	90,000.00	132,698.70
	CANADIAN GOVT 8%	40,000.00	64,084.40
小計	銘柄数：28	2,545,000.00	2,824,438.05 (233,072,627)
	組入時価比率：2.0%		2.1%
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR 10%	1,564,000.00	1,824,193.29
	MEX BONOS DESARR 10%	500,000.00	625,350.00
	MEX BONOS DESARR 5.75%	314,000.00	284,719.81
	MEX BONOS DESARR 5%	1,866,000.00	1,782,030.00
	MEX BONOS DESARR 6.5%	2,086,000.00	2,043,654.20
	MEX BONOS DESARR 6.5%	976,000.00	949,062.40
	MEX BONOS DESARR 7.5%	1,000,000.00	1,018,380.00
	MEX BONOS DESARR 7.75%	1,000,000.00	1,024,700.00
	MEX BONOS DESARR 7.75%	500,000.00	511,550.00
	MEX BONOS DESARR 7.75%	1,050,000.00	1,069,110.00
	MEX BONOS DESARR 8.5%	840,000.00	918,709.68
	MEX BONOS DESARR 8.5%	700,000.00	768,460.00
	MEX BONOS DESARR 8%	1,000,000.00	1,024,700.00
	MEX BONOS DESARR 8%	1,000,000.00	1,046,699.00
小計	銘柄数：14	14,396,000.00	14,891,318.38 (88,603,344)
	組入時価比率：0.8%		0.8%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 0.8%	110,000.00	112,695.00
	BELGIUM KINGDOM 0.8%	30,000.00	30,063.00
	BELGIUM KINGDOM 1.25%	100,000.00	102,050.00
	BELGIUM KINGDOM 1.6%	40,000.00	37,992.00

BELGIUM KINGDOM 1.9%	40,000.00	43,164.00	
BELGIUM KINGDOM 1%	70,000.00	72,142.00	
BELGIUM KINGDOM 1%	40,000.00	39,180.00	
BELGIUM KINGDOM 2.15%	20,000.00	20,010.00	
BELGIUM KINGDOM 2.25%	80,000.00	90,792.00	
BELGIUM KINGDOM 2.25%	20,000.00	21,004.00	
BELGIUM KINGDOM 2.6%	130,000.00	151,294.00	
BELGIUM KINGDOM 3.75%	80,000.00	91,320.00	
BELGIUM KINGDOM 3.75%	80,000.00	115,848.00	
BELGIUM KINGDOM 3%	120,000.00	130,116.00	
BELGIUM KINGDOM 3%	40,000.00	50,568.00	
BELGIUM KINGDOM 4.25%	110,000.00	131,813.00	
BELGIUM KINGDOM 4.25%	100,000.00	123,310.00	
BELGIUM KINGDOM 4.25%	115,000.00	176,513.50	
BELGIUM KINGDOM 4.5%	70,000.00	94,255.00	
BELGIUM KINGDOM 4%	120,000.00	144,966.00	
BELGIUM KINGDOM 4%	60,000.00	83,370.00	
BELGIUM KINGDOM 5.5%	155,000.00	231,694.00	
BELGIUM KINGDOM 5%	110,000.00	176,000.00	
BONOS Y OBLIG DEL 0.25%	80,000.00	80,696.80	
BONOS Y OBLIG DEL 0.75%	160,000.00	164,112.00	
BONOS Y OBLIG DEL 1.15%	40,000.00	41,602.00	
BONOS Y OBLIG DEL 1.3%	80,000.00	79,016.00	
BONOS Y OBLIG DEL 1.4%	150,000.00	156,510.00	
BONOS Y OBLIG DEL 1.5%	120,000.00	119,210.40	
BONOS Y OBLIG DEL 1.6%	100,000.00	103,060.00	
BONOS Y OBLIG DEL 1.95%	140,000.00	146,384.00	
BONOS Y OBLIG DEL 1.95%	140,000.00	138,992.00	
BONOS Y OBLIG DEL 2.15%	130,000.00	138,444.80	
BONOS Y OBLIG DEL 2.35%	50,000.00	50,525.00	
BONOS Y OBLIG DEL 2.75%	180,000.00	190,819.80	
BONOS Y OBLIG DEL 2.75%	135,000.00	150,633.00	
BONOS Y OBLIG DEL 2.9%	60,000.00	60,401.40	
BONOS Y OBLIG DEL 3.45%	10,000.00	10,467.00	
BONOS Y OBLIG DEL 3.75%	150,000.00	159,195.00	
BONOS Y OBLIG DEL 3.8%	120,000.00	142,836.00	
BONOS Y OBLIG DEL 4.1%	170,000.00	179,163.00	
BONOS Y OBLIG DEL 4.2%	130,000.00	164,827.00	
BONOS Y OBLIG DEL 4.4%	130,000.00	159,464.50	
BONOS Y OBLIG DEL 4.6%	155,000.00	171,585.00	
BONOS Y OBLIG DEL 4.65%	185,000.00	233,784.50	
BONOS Y OBLIG DEL 4.7%	110,000.00	149,501.00	

BONOS Y OBLIG DEL 4.8%	140,000.00	175,980.00
BONOS Y OBLIG DEL 4.85%	170,000.00	198,877.90
BONOS Y OBLIG DEL 4.9%	100,000.00	138,900.00
BONOS Y OBLIG DEL 4%	120,000.00	134,658.00
BONOS Y OBLIG DEL 5.15%	70,000.00	94,339.00
BONOS Y OBLIG DEL 5.15%	80,000.00	115,752.00
BONOS Y OBLIG DEL 5.4%	90,000.00	114,507.00
BONOS Y OBLIG DEL 5.5%	200,000.00	243,330.00
BONOS Y OBLIG DEL 5.75%	135,000.00	199,206.00
BONOS Y OBLIG DEL 5.85%	175,000.00	220,543.75
BONOS Y OBLIG DEL 5.9%	135,000.00	187,042.50
BONOS Y OBLIG DEL 6%	160,000.00	231,648.00
BUNDES OBLIGATION 0.25%	120,000.00	122,784.00
BUNDES OBLIGATION 0.25%	140,000.00	143,997.00
BUNDES OBLIGATION 0.5%	140,000.00	143,294.20
BUNDES OBLIGATION 0%	190,000.00	193,676.50
BUNDES OBLIGATION 0%	30,000.00	30,612.00
BUNDES OBLIGATION 0%	100,000.00	101,965.00
BUNDES OBLIGATION 1%	185,000.00	189,658.30
BUNDES OBLIGATION 1%	150,000.00	154,665.00
BUNDESREPUB. DEUT 0.25%	90,000.00	88,604.10
BUNDESREPUB. DEUT 0.5%	120,000.00	123,753.60
BUNDESREPUB. DEUT 0.5%	180,000.00	184,080.60
BUNDESREPUB. DEUT 0%	200,000.00	193,874.00
BUNDESREPUB. DEUT 1.5%	190,000.00	208,306.50
BUNDESREPUB. DEUT 1.5%	80,000.00	87,825.60
BUNDESREPUB. DEUT 1.5%	90,000.00	99,018.00
BUNDESREPUB. DEUT 1.5%	90,000.00	99,583.20
BUNDESREPUB. DEUT 1.75%	140,000.00	154,812.00
BUNDESREPUB. DEUT 1.75%	130,000.00	145,935.40
BUNDESREPUB. DEUT 1%	150,000.00	160,707.00
BUNDESREPUB. DEUT 1%	140,000.00	149,661.40
BUNDESREPUB. DEUT 2.25%	100,000.00	109,550.00
BUNDESREPUB. DEUT 2.25%	120,000.00	134,226.00
BUNDESREPUB. DEUT 2.5%	200,000.00	222,580.00
BUNDESREPUB. DEUT 2.5%	140,000.00	183,415.40
BUNDESREPUB. DEUT 2.5%	130,000.00	171,748.20
BUNDESREPUB. DEUT 2%	170,000.00	189,261.00
BUNDESREPUB. DEUT 2%	160,000.00	181,416.00
BUNDESREPUB. DEUT 3.25%	140,000.00	162,036.00
BUNDESREPUB. DEUT 3.25%	70,000.00	103,011.30
BUNDESREPUB. DEUT 3.5%	50,000.00	54,585.00
BUNDESREPUB. DEUT 3.75%	250,000.00	268,747.50

BUNDESREPUB. DEUT 3%	200,000.00	223,130.00	
BUNDESREPUB. DEUT 4.25%	200,000.00	211,632.00	
BUNDESREPUB. DEUT 4.25%	100,000.00	164,832.00	
BUNDESREPUB. DEUT 4.75%	100,000.00	146,269.00	
BUNDESREPUB. DEUT 4.75%	110,000.00	179,685.00	
BUNDESREPUB. DEUT 4.75%	100,000.00	177,056.00	
BUNDESREPUB. DEUT 4%	160,000.00	248,760.00	
BUNDESREPUB. DEUT 5.5%	110,000.00	180,061.20	
BUNDESREPUB. DEUT 5.625%	120,000.00	184,725.60	
BUNDESREPUB. DEUT 6.25%	70,000.00	99,428.70	
BUNDESREPUB. DEUT 6.25%	70,000.00	118,643.70	
BUNDESREPUB. DEUT 6.5%	40,000.00	64,272.40	
BUNDESSCHATZANW 0%	100,000.00	100,838.00	
BUNDESSCHATZANW 0%	80,000.00	80,928.80	
BUONI POLIENNALI 0.3%	80,000.00	80,504.00	
BUONI POLIENNALI 0.35%	70,000.00	68,852.00	
BUONI POLIENNALI 0.45%	60,000.00	59,724.00	
BUONI POLIENNALI 0.65%	100,000.00	100,950.00	
BUONI POLIENNALI 0.7%	70,000.00	70,819.00	
BUONI POLIENNALI 0.95%	60,000.00	59,202.00	
BUONI POLIENNALI 1.05%	160,000.00	163,408.00	
BUONI POLIENNALI 1.25%	90,000.00	84,186.00	
BUONI POLIENNALI 1.35%	160,000.00	163,248.00	
BUONI POLIENNALI 1.45%	160,000.00	163,376.00	
BUONI POLIENNALI 1.5%	110,000.00	113,399.00	
BUONI POLIENNALI 1.5%	190,000.00	185,877.00	
BUONI POLIENNALI 1.6%	110,000.00	106,645.00	
BUONI POLIENNALI 1.65%	170,000.00	153,272.00	
BUONI POLIENNALI 2.15%	140,000.00	148,624.00	
BUONI POLIENNALI 2.2%	20,000.00	20,064.00	
BUONI POLIENNALI 2.25%	80,000.00	73,952.00	
BUONI POLIENNALI 2.5%	150,000.00	157,306.50	
BUONI POLIENNALI 2.5%	187,000.00	197,285.00	
BUONI POLIENNALI 2.7%	100,000.00	90,200.00	
BUONI POLIENNALI 2.8%	30,000.00	25,470.00	
BUONI POLIENNALI 2%	130,000.00	131,040.00	
BUONI POLIENNALI 3.25%	110,000.00	111,056.00	
BUONI POLIENNALI 3.5%	150,000.00	158,334.00	
BUONI POLIENNALI 3.5%	220,000.00	245,542.00	
BUONI POLIENNALI 3.75%	80,000.00	89,896.00	
BUONI POLIENNALI 3.75%	150,000.00	168,765.00	
BUONI POLIENNALI 3.75%	220,000.00	248,446.00	

BUONI POLIENNALI 3.75%	160,000.00	182,752.00
BUONI POLIENNALI 4.25%	180,000.00	193,226.40
BUONI POLIENNALI 4.25%	160,000.00	175,152.00
BUONI POLIENNALI 4.25%	180,000.00	200,070.00
BUONI POLIENNALI 4.5%	200,000.00	211,582.00
BUONI POLIENNALI 4.5%	110,000.00	118,998.00
BUONI POLIENNALI 4.5%	225,000.00	250,987.50
BUONI POLIENNALI 4.5%	90,000.00	106,668.00
BUONI POLIENNALI 4.5%	160,000.00	190,544.00
BUONI POLIENNALI 4.5%	190,000.00	229,216.00
BUONI POLIENNALI 4.75%	230,000.00	269,606.00
BUONI POLIENNALI 4.75%	90,000.00	111,600.00
BUONI POLIENNALI 4.75%	70,000.00	89,180.00
BUONI POLIENNALI 4%	180,000.00	201,402.00
BUONI POLIENNALI 4%	180,000.00	210,978.00
BUONI POLIENNALI 5.25%	150,000.00	195,915.00
BUONI POLIENNALI 5.5%	170,000.00	209,066.00
BUONI POLIENNALI 5.5%	110,000.00	135,630.00
BUONI POLIENNALI 5.75%	110,000.00	153,439.00
BUONI POLIENNALI 5%	155,000.00	184,729.00
BUONI POLIENNALI 5%	150,000.00	185,415.00
BUONI POLIENNALI 5%	170,000.00	221,969.00
BUONI POLIENNALI 5%	150,000.00	197,115.00
BUONI POLIENNALI 5%	150,000.00	195,900.00
BUONI POLIENNALI 6.5%	210,000.00	294,609.00
BUONI POLIENNALI 6%	220,000.00	310,574.00
BUONI POLIENNALI 7.25%	60,000.00	87,078.00
BUONI POLIENNALI 9%	80,000.00	117,600.00
FINNISH GOVT 0.375%	40,000.00	41,054.00
FINNISH GOVT 0.5%	40,000.00	40,072.00
FINNISH GOVT 0.75%	30,000.00	29,403.00
FINNISH GOVT 0.875%	10,000.00	10,402.00
FINNISH GOVT 0%	30,000.00	30,264.00
FINNISH GOVT 0%	20,000.00	19,858.00
FINNISH GOVT 1.125%	50,000.00	51,180.00
FINNISH GOVT 1.5%	50,000.00	54,430.00
FINNISH GOVT 1.625%	20,000.00	21,824.00
FINNISH GOVT 2.625%	30,000.00	39,069.00
FINNISH GOVT 2.75%	30,000.00	36,717.00
FINNISH GOVT 2%	20,000.00	22,526.00
FINNISH GOVT 3.375%	60,000.00	66,828.00
FINNISH GOVT 3.5%	50,000.00	57,570.00
FINNISH GOVT 4.375%	20,000.00	22,140.00

FINNISH GOVT 4%	50,000.00	64,915.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.25%	250,000.00	254,900.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.25%	190,000.00	180,823.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.5%	240,000.00	245,592.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.5%	180,000.00	179,460.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.5%	190,000.00	186,485.00	
FRANCE (GOVT OF) 0%	150,000.00	151,920.00	
FRANCE (GOVT OF) 0%	70,000.00	70,560.00	
FRANCE (GOVT OF) 0%	50,000.00	50,045.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.25%	140,000.00	134,358.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.5%	190,000.00	197,448.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75%	210,000.00	229,992.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75%	160,000.00	175,792.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75%	30,000.00	30,633.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75%	40,000.00	35,940.00	
FRANCE (GOVT OF) 1%	160,000.00	163,760.00	
FRANCE (GOVT OF) 1%	260,000.00	267,618.00	
FRANCE (GOVT OF) 1%	210,000.00	217,203.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.25%	260,000.00	291,824.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.25%	250,000.00	283,700.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.5%	320,000.00	351,968.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.5%	200,000.00	232,980.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.75%	200,000.00	236,720.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.25%	300,000.00	346,515.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.25%	180,000.00	236,430.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.5%	235,000.00	262,718.25	
FRANCE (GOVT OF) 3.5%	260,000.00	324,324.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.75%	300,000.00	330,990.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.75%	210,000.00	243,715.50	
FRANCE (GOVT OF) 3%	210,000.00	242,340.00	
FRANCE (GOVT OF) 4.25%	170,000.00	181,611.00	
FRANCE (GOVT OF) 4.25%	115,000.00	125,852.55	
FRANCE (GOVT OF) 4.25%	275,000.00	347,077.50	
FRANCE (GOVT OF) 4.5%	200,000.00	311,380.00	
FRANCE (GOVT OF) 4.75%	185,000.00	283,401.50	
FRANCE (GOVT OF) 4%	160,000.00	230,768.00	
FRANCE (GOVT OF) 4%	90,000.00	138,771.00	
FRANCE (GOVT OF) 4%	80,000.00	125,280.00	
FRANCE (GOVT OF) 5.5%	150,000.00	227,445.00	
FRANCE (GOVT OF) 5.75%	220,000.00	359,150.00	
FRANCE (GOVT OF) 6%	180,000.00	261,648.00	
FRANCE (GOVT OF) 8.5%	80,000.00	97,680.00	

FRANCE (GOVT OF) 8.5%	120,000.00	179,988.00
FRANCE(GOVT OF) 0%	40,000.00	40,376.00
IRISH TSY 0.8%	50,000.00	51,925.00
IRISH TSY 1.7%	30,000.00	29,766.00
IRISH TSY 1%	40,000.00	40,336.00
IRISH TSY 2.4%	70,000.00	79,177.00
IRISH TSY 2%	40,000.00	40,152.00
IRISH TSY 3.4%	50,000.00	60,025.00
IRISH TSY 3.9%	40,000.00	48,704.00
IRISH TSY 4.4%	80,000.00	88,120.00
IRISH TSY 4.5%	80,000.00	85,699.20
IRISH TSY 4.5%	70,000.00	79,992.50
IRISH TSY 5.4%	70,000.00	95,382.00
IRISH TSY 5.9%	20,000.00	23,083.00
IRISH TSY 5%	60,000.00	71,034.00
NETHERLANDS GOVT 0.25%	90,000.00	91,791.00
NETHERLANDS GOVT 0.25%	90,000.00	89,577.00
NETHERLANDS GOVT 0.5%	80,000.00	80,432.00
NETHERLANDS GOVT 0.75%	20,000.00	20,214.00
NETHERLANDS GOVT 0%	20,000.00	20,234.00
NETHERLANDS GOVT 1.25%	120,000.00	123,812.40
NETHERLANDS GOVT 1.75%	110,000.00	122,100.00
NETHERLANDS GOVT 2.25%	140,000.00	158,193.00
NETHERLANDS GOVT 2.5%	80,000.00	99,312.00
NETHERLANDS GOVT 2.75%	80,000.00	109,488.00
NETHERLANDS GOVT 2%	90,000.00	101,952.00
NETHERLANDS GOVT 3.25%	80,000.00	92,232.00
NETHERLANDS GOVT 3.5%	110,000.00	124,190.00
NETHERLANDS GOVT 3.75%	40,000.00	48,834.00
NETHERLANDS GOVT 3.75%	100,000.00	156,930.00
NETHERLANDS GOVT 4%	130,000.00	137,111.00
NETHERLANDS GOVT 4%	130,000.00	143,182.00
NETHERLANDS GOVT 4%	100,000.00	153,980.00
NETHERLANDS GOVT 5.5%	100,000.00	151,100.00
NETHERLANDS GOVT 7.5%	70,000.00	100,632.00
REP OF AUSTRIA 0.25%	60,000.00	61,146.00
REP OF AUSTRIA 0.75%	50,000.00	50,850.00
REP OF AUSTRIA 1.15%	90,000.00	92,232.00
REP OF AUSTRIA 1.2%	90,000.00	95,994.00
REP OF AUSTRIA 1.5%	20,000.00	19,792.00
REP OF AUSTRIA 1.65%	70,000.00	77,231.00
REP OF AUSTRIA 1.75%	70,000.00	77,651.00
REP OF AUSTRIA 1.95%	60,000.00	63,153.00



小計	REP OF AUSTRIA 2.4%	30,000.00	36,204.00	
	REP OF AUSTRIA 3.15%	50,000.00	68,875.00	
	REP OF AUSTRIA 3.4%	90,000.00	107,415.00	
	REP OF AUSTRIA 3.5%	105,000.00	122,325.00	
	REP OF AUSTRIA 3.65%	70,000.00	83,230.00	
	REP OF AUSTRIA 3.8%	30,000.00	49,923.00	
	REP OF AUSTRIA 3.9%	80,000.00	91,080.00	
	REP OF AUSTRIA 4.15%	70,000.00	106,365.00	
	REP OF AUSTRIA 4.35%	90,000.00	98,198.10	
	REP OF AUSTRIA 4.85%	30,000.00	41,640.00	
	REP OF AUSTRIA 6.25%	85,000.00	133,433.00	
	銘柄数：270	31,512,000.00	36,795,132.95	(4,550,822,043)
	組入時価比率：39.4%			40.1%
英・ポンド	UK TSY 0.5%	60,000.00	59,880.00	
	UK TSY 1.25%	20,000.00	20,108.00	
	UK TSY 1.5%	130,000.00	135,824.00	
	UK TSY 1.5%	150,000.00	155,760.00	
	UK TSY 1.5%	40,000.00	37,316.00	
	UK TSY 1.75%	270,000.00	279,652.50	
	UK TSY 1.75%	200,000.00	213,044.00	
	UK TSY 1.75%	30,000.00	29,775.00	
	UK TSY 2.25%	120,000.00	131,972.40	
	UK TSY 2.5%	80,000.00	102,817.60	
	UK TSY 2.75%	140,000.00	159,604.20	
	UK TSY 2%	110,000.00	116,277.70	
	UK TSY 2%	160,000.00	173,849.60	
	UK TSY 3.25%	160,000.00	208,014.40	
	UK TSY 3.5%	160,000.00	216,656.00	
	UK TSY 3.5%	120,000.00	196,922.40	
	UK TSY 3.75%	110,000.00	119,383.33	
	UK TSY 3.75%	150,000.00	167,743.50	
	UK TSY 3.75%	110,000.00	125,730.00	
	UK TSY 3.75%	90,000.00	137,957.40	
	UK TSY 4.25%	75,000.00	98,550.00	
	UK TSY 4.25%	100,000.00	136,603.00	
	UK TSY 4.25%	140,000.00	197,188.60	
	UK TSY 4.25%	110,000.00	159,426.30	
	UK TSY 4.25%	80,000.00	117,396.80	
UK TSY 4.25%	130,000.00	202,504.25		
UK TSY 4.25%	97,000.00	156,617.17		
UK TSY 4.25%	132,000.00	227,603.64		

小計	UK TSY 4.5%	150,000.00	162,081.75
	UK TSY 4.5%	150,000.00	214,407.00
	UK TSY 4.5%	115,000.00	178,167.20
	UK TSY 4.75%	160,000.00	180,928.00
	UK TSY 4.75%	85,000.00	120,338.75
	UK TSY 4.75%	85,000.00	130,467.35
	UK TSY 4%	110,000.00	129,117.45
	UK TSY 4%	110,000.00	189,267.10
	UK TSY 5%	75,000.00	98,758.50
	UK TSY 6%	80,000.00	121,625.60
	UK TSY 8%	60,000.00	78,809.40
	銘柄数：39	4,454,000.00	5,688,145.89 (831,038,114)
	組入時価比率：7.2%		7.3%
スイス・フラン	SWITZERLAND 2.25%	30,000.00	32,922.00
	SWITZERLAND 2%	20,000.00	22,130.00
	SWITZERLAND 4%	30,000.00	37,836.00
	SWITZERLAND 4%	40,000.00	57,708.00
	小計	銘柄数：4	120,000.00
組入時価比率：0.1%		0.2%	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVT 1.5%	530,000.00	572,908.80
	SWEDISH GOVT 1%	540,000.00	557,366.40
	SWEDISH GOVT 2.5%	360,000.00	418,107.60
	SWEDISH GOVT 3.5%	440,000.00	517,770.00
	SWEDISH GOVT 3.5%	280,000.00	376,670.00
	SWEDISH GOVT 5%	1,080,000.00	1,285,135.20
	小計	銘柄数：6	3,230,000.00
組入時価比率：0.4%		0.4%	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVT 1.5%	350,000.00	347,550.00
	NORWEGIAN GOVT 2%	500,000.00	521,650.00
	NORWEGIAN GOVT 3.75%	470,000.00	521,700.00
	NORWEGIAN GOVT 3%	520,000.00	574,652.00
	小計	銘柄数：4	1,840,000.00
組入時価比率：0.2%		0.2%	
デンマーク・クローネ	KINGDOM OF DENMARK 1.5%	390,000.00	426,894.00
	KINGDOM OF DENMARK 1.75%	660,000.00	739,200.00
	KINGDOM OF DENMARK 3%	670,000.00	767,820.00
	KINGDOM OF DENMARK 4.5%	860,000.00	1,441,962.00
	KINGDOM OF DENMARK 4%	590,000.00	658,027.00
	小計	銘柄数：5	3,170,000.00

			(67,083,806)		
	組入時価比率：0.6%		0.6%		
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVT 1.5%	250,000.00	244,025.00		
	POLAND GOVT 1.75%	230,000.00	221,352.00		
	POLAND GOVT 2.5%	290,000.00	270,628.00		
	POLAND GOVT 2.5%	60,000.00	55,488.00		
	POLAND GOVT 2%	120,000.00	116,520.00		
	POLAND GOVT 3.25%	180,000.00	179,838.00		
	POLAND GOVT 4%	250,000.00	261,000.00		
	POLAND GOVT 5.25%	120,000.00	130,560.00		
	POLAND GOVT 5.5%	90,000.00	97,227.00		
	POLAND GOVT 5.75%	200,000.00	224,600.00		
	POLAND GOVT 5.75%	50,000.00	56,850.00		
	POLAND GOVT 5.75%	100,000.00	122,210.00		
	小計	銘柄数：12	1,940,000.00	1,980,298.00	
				(58,260,367)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%		
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVT 1.75%	150,000.00	148,777.50		
	AUSTRALIAN GOVT 2.25%	90,000.00	85,655.43		
	AUSTRALIAN GOVT 2.75%	170,000.00	173,893.00		
	AUSTRALIAN GOVT 2.75%	190,000.00	193,781.00		
	AUSTRALIAN GOVT 2.75%	140,000.00	140,423.08		
	AUSTRALIAN GOVT 2.75%	90,000.00	89,646.12		
	AUSTRALIAN GOVT 2.75%	50,000.00	46,590.00		
	AUSTRALIAN GOVT 2%	90,000.00	89,442.00		
	AUSTRALIAN GOVT 3.25%	165,000.00	173,332.50		
	AUSTRALIAN GOVT 3.25%	100,000.00	104,210.00		
	AUSTRALIAN GOVT 3.25%	20,000.00	19,430.00		
	AUSTRALIAN GOVT 3.75%	60,000.00	63,480.00		
	AUSTRALIAN GOVT 3%	50,000.00	44,451.00		
	AUSTRALIAN GOVT 4.25%	220,000.00	248,688.00		
	AUSTRALIAN GOVT 4.5%	200,000.00	214,940.00		
	AUSTRALIAN GOVT 4.5%	80,000.00	94,120.00		
	AUSTRALIAN GOVT 4.75%	200,000.00	236,520.00		
	AUSTRALIAN GOVT 5.25%	130,000.00	138,333.00		
	AUSTRALIAN GOVT 5.5%	170,000.00	200,294.00		
	AUSTRALIAN GOVT 5.75%	140,000.00	159,992.00		
	AUSTRALIAN GOVT 5.75%	140,000.00	164,360.00		
小計	銘柄数：21	2,645,000.00	2,830,358.63		
			(236,250,034)		
	組入時価比率：2.0%		2.1%		
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVT 1.25%	20,000.00	19,776.00		
	SINGAPORE GOVT 2.125%	30,000.00	30,141.00		

	SINGAPORE GOVT 2.25%	60,000.00	61,566.00	
	SINGAPORE GOVT 2.375%	20,000.00	20,502.00	
	SINGAPORE GOVT 2.5%	90,000.00	92,313.90	
	SINGAPORE GOVT 2.75%	40,000.00	42,028.00	
	SINGAPORE GOVT 2.75%	30,000.00	31,998.00	
	SINGAPORE GOVT 2.75%	20,000.00	21,082.00	
	SINGAPORE GOVT 2.875%	10,000.00	10,640.00	
	SINGAPORE GOVT 2.875%	20,000.00	21,271.60	
	SINGAPORE GOVT 3.125%	20,000.00	21,421.00	
	SINGAPORE GOVT 3.25%	35,000.00	37,058.35	
	SINGAPORE GOVT 3.375%	20,000.00	22,608.00	
	SINGAPORE GOVT 3.5%	40,000.00	44,720.80	
	SINGAPORE GOVT 3%	40,000.00	42,799.60	
小計	銘柄数：15	495,000.00	519,926.25	
			(41,677,288)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA GOVT 3.492%	800,000.00	798,400.00	
	MALAYSIA GOVT 3.955%	900,000.00	894,600.00	
	MALAYSIA GOVT 4.181%	150,000.00	152,060.70	
小計	銘柄数：3	1,850,000.00	1,845,060.70	
			(48,008,479)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
南アフリカ・ランド	REP SOUTH AFRICA 10.5%	1,160,000.00	1,289,804.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.25%	1,000,000.00	719,600.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.5%	520,000.00	369,044.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.75%	260,000.00	251,550.00	
	REP SOUTH AFRICA 7.25%	590,000.00	584,867.00	
	REP SOUTH AFRICA 7.75%	500,000.00	490,900.00	
	REP SOUTH AFRICA 7%	750,000.00	621,600.00	
	REP SOUTH AFRICA 8.25%	340,000.00	310,658.00	
	REP SOUTH AFRICA 8.5%	430,000.00	389,279.00	
	REP SOUTH AFRICA 8.75%	600,000.00	544,260.00	
	REP SOUTH AFRICA 8.75%	720,000.00	652,536.00	
	REP SOUTH AFRICA 8.875%	560,000.00	529,816.00	
	REP SOUTH AFRICA 8%	600,000.00	547,860.00	
小計	銘柄数：13	8,030,000.00	7,301,774.00	
			(60,896,795)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
合計			11,342,687,475	
			(11,342,687,475)	

(注1) 比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(注2) 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

（注3）合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

## 有価証券明細表注記

### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米・ドル	国債証券 198銘柄	100.0%	44.4%
カナダ・ドル	国債証券 28銘柄	100.0%	2.1%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 270銘柄	100.0%	40.1%
英・ポンド	国債証券 39銘柄	100.0%	7.3%
スイス・フラン	国債証券 4銘柄	100.0%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェー・クローネ	国債証券 4銘柄	100.0%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.6%
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリア・ドル	国債証券 21銘柄	100.0%	2.1%
シンガポール・ドル	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%
マレーシア・リングギット	国債証券 3銘柄	100.0%	0.4%
南アフリカ・ランド	国債証券 13銘柄	100.0%	0.5%

## 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」に記載しております。

### MHAM TOPIXマザーファンド

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

（単位：円）

（平成29年 5月 8日現在）

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	879,895,114
株式	46,777,512,321
派生商品評価勘定	64,889,220

(平成29年 5月 8日現在)

未収入金	3,718,056
未収配当金	429,998,425
差入委託証拠金	46,620,000
流動資産合計	48,202,633,136
資産合計	48,202,633,136
負債の部	
流動負債	
前受金	43,785,000
未払解約金	39,210,000
未払利息	1,950
流動負債合計	82,996,950
負債合計	82,996,950
純資産の部	
元本等	
元本	26,749,859,229
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	21,369,776,957
元本等合計	48,119,636,186
純資産合計	48,119,636,186
負債純資産合計	48,202,633,136

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	(自 平成29年 3月11日 至 平成29年 5月 8日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  原則として時価で評価しております。
2 派生商品等の評価基準及び評価方法	先物取引  原則として時価で評価しております。
3 収益・費用の計上基準	受取配当金  受取配当金は、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。  有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益  約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成29年 5月 8日現在)	
1 計算期間末日における受益権の総数		26,749,859,229口
2 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産の額	1.7989円
	(1万口当たり純資産の額)	(17,989円)

## (金融商品に関する注記)

## 1.金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成29年 3月11日 至 平成29年 5月 8日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。
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。 なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。 これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドは信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っており、当該デリバティブ取引は対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。
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。 なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。
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

項目	(平成29年 5月 8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>株式</p> <p>わが国の金融商品取引所または海外取引所に上場されている有価証券 当該有価証券については、原則として上記の取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できない場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>先物取引</p> <p>デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(自 平成29年 3月11日 至 平成29年 5月 8日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	406,716,207
合計	406,716,207

(デリバティブ取引等に関する注記)



## 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)

(平成29年 5月 8日現在)

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,218,150,780	-	1,283,040,000	64,889,220
合計		1,218,150,780	-	1,283,040,000	64,889,220

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については、取引所の発表する計算日の清算値段により評価しております。

(その他の注記)

項目	期別 (平成29年 5月 8日現在)
期首	平成29年 3月11日
親投資信託の期首における元本額	26,820,135,745円
期中追加設定元本額	544,934,430円
期中一部解約元本額	615,210,946円
期末元本額及びその内訳として当該親投資信託受益証券を投資対象とする委託者指図型投資信託ごとの元本額	
期末元本額	26,749,859,229円
MHAMスリーウェイオープン	1,175,497,479円
MHAM TOPIXオープン	5,262,737,779円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	13,730,284,480円
動的パッケージファンド<DC年金>	15,930,110円
コア資産形成ファンド	16,173,703円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	281,555,655円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	4,111,705,157円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,155,974,866円

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1)株式

(平成29年 5月 8日現在)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	

日本・円	極洋	900	2,985.00	2,686,500
	日本水産	29,700	558.00	16,572,600
	マルハニチロ	4,300	3,270.00	14,061,000
	カネコ種苗	700	1,471.00	1,029,700
	サカタのタネ	3,300	3,455.00	11,401,500
	ホクト	2,300	2,165.00	4,979,500
	ホクリヨウ	300	853.00	255,900
	日鉄鉱業	600	6,030.00	3,618,000
	三井松島産業	1,400	1,474.00	2,063,600
	国際石油開発帝石	119,800	1,099.50	131,720,100
	日本海洋掘削	800	2,387.00	1,909,600
	石油資源開発	3,700	2,505.00	9,268,500
	K & Oエナジーグループ	1,500	1,844.00	2,766,000
	ショーボンドホールディングス	2,200	5,210.00	11,462,000
	ミライト・ホールディングス	7,000	1,190.00	8,330,000
	タマホーム	1,800	657.00	1,182,600
	サンヨーホームズ	600	640.00	384,000
	ファーストコーポレーション	500	1,066.00	533,000
	インベスターズクラウド	300	4,330.00	1,299,000
	ダイセキ環境ソリューション	700	1,356.00	949,200
	安藤・間	16,300	830.00	13,529,000
	東急建設	8,000	933.00	7,464,000
	コムシスホールディングス	8,900	2,195.00	19,535,500
	ミサワホーム	2,700	1,077.00	2,907,900
	ビーアールホールディングス	2,400	407.00	976,800
	高松コンストラクショングループ	1,700	2,733.00	4,646,100
	東建コーポレーション	800	9,250.00	7,400,000
	ソネック	400	692.00	276,800
	ヤマウラ	1,200	663.00	795,600
	大成建設	115,000	879.00	101,085,000
	大林組	67,900	1,126.00	76,455,400
	清水建設	69,000	1,108.00	76,452,000
	飛鳥建設	22,100	172.00	3,801,200
	長谷工コーポレーション	26,400	1,317.00	34,768,800
	松井建設	2,500	1,002.00	2,505,000
	銭高組	3,000	417.00	1,251,000
	鹿島建設	99,000	776.00	76,824,000
	不動テトラ	18,500	190.00	3,515,000
	大末建設	800	1,023.00	818,400
	鉄建建設	14,000	339.00	4,746,000
西松建設	26,000	589.00	15,314,000	
三井住友建設	87,100	124.00	10,800,400	

大豊建設	8,000	558.00	4,464,000
前田建設工業	15,000	1,090.00	16,350,000
佐田建設	1,600	432.00	691,200
ナカノフドー建設	1,800	671.00	1,207,800
奥村組	18,000	712.00	12,816,000
東鉄工業	2,700	3,275.00	8,842,500
イチケン	2,000	433.00	866,000
浅沼組	8,000	337.00	2,696,000
戸田建設	26,000	724.00	18,824,000
熊谷組	36,000	310.00	11,160,000
青木あすなろ建設	1,500	835.00	1,252,500
北野建設	4,000	315.00	1,260,000
植木組	3,000	258.00	774,000
三井ホーム	3,000	710.00	2,130,000
矢作建設工業	3,100	1,035.00	3,208,500
ピーエス三菱	2,500	433.00	1,082,500
日本ハウスホールディングス	4,600	486.00	2,235,600
大東建託	8,200	16,615.00	136,243,000
新日本建設	2,700	936.00	2,527,200
N I P P O	5,000	2,240.00	11,200,000
東亜道路工業	4,000	350.00	1,400,000
前田道路	7,000	2,138.00	14,966,000
日本道路	7,000	528.00	3,696,000
東亜建設工業	1,900	2,133.00	4,052,700
若築建設	13,000	151.00	1,963,000
東洋建設	6,700	417.00	2,793,900
五洋建設	25,400	584.00	14,833,600
大林道路	2,400	697.00	1,672,800
世紀東急工業	3,300	612.00	2,019,600
福田組	4,000	1,000.00	4,000,000
住友林業	15,600	1,767.00	27,565,200
日本基礎技術	2,900	356.00	1,032,400
日成ビルド工業	7,000	586.00	4,102,000
巴コーポレーション	2,900	362.00	1,049,800
パナホーム	9,000	1,232.00	11,088,000
大和ハウス工業	66,800	3,527.00	235,603,600
ライト工業	4,400	1,149.00	5,055,600
積水ハウス	71,100	1,887.50	134,201,250
日特建設	2,000	466.00	932,000
北陸電気工事	1,100	905.00	995,500
ユアテック	4,000	722.00	2,888,000
西部電気工業	400	2,300.00	920,000

四電工	2,000	490.00	980,000
中電工	2,500	2,751.00	6,877,500
関電工	9,000	1,129.00	10,161,000
きんでん	15,100	1,763.00	26,621,300
東京エネシス	2,300	971.00	2,233,300
トーエネック	3,000	594.00	1,782,000
住友電設	1,600	1,350.00	2,160,000
日本電設工業	3,700	2,251.00	8,328,700
協和エクシオ	8,900	1,730.00	15,397,000
新日本空調	1,700	1,569.00	2,667,300
N D S	300	2,981.00	894,300
九電工	4,400	3,650.00	16,060,000
三機工業	5,000	1,018.00	5,090,000
日揮	21,200	1,811.00	38,393,200
中外炉工業	7,000	226.00	1,582,000
ヤマト	2,100	567.00	1,190,700
太平電業	3,000	1,133.00	3,399,000
高砂熱学工業	6,200	1,775.00	11,005,000
三晃金属工業	200	3,135.00	627,000
朝日工業社	500	3,140.00	1,570,000
明星工業	4,200	646.00	2,713,200
大気社	3,000	2,928.00	8,784,000
ダイダン	3,000	1,152.00	3,456,000
日比谷総合設備	2,500	1,790.00	4,475,000
東芝プラントシステム	3,700	1,820.00	6,734,000
OSJBホールディングス	7,000	267.00	1,869,000
東洋エンジニアリング	14,000	284.00	3,976,000
千代田化工建設	17,000	741.00	12,597,000
新興プランテック	4,700	864.00	4,060,800
日本製粉	6,700	1,735.00	11,624,500
日清製粉グループ本社	24,800	1,747.00	43,325,600
日東富士製粉	100	3,925.00	392,500
昭和産業	9,000	615.00	5,535,000
鳥越製粉	1,800	830.00	1,494,000
中部飼料	2,500	1,426.00	3,565,000
フィード・ワン	13,900	211.00	2,932,900
東洋精糖	4,000	116.00	464,000
日本甜菜製糖	1,100	2,425.00	2,667,500
三井製糖	1,600	2,825.00	4,520,000
塩水港精糖	2,900	250.00	725,000
日新製糖	900	1,922.00	1,729,800
森永製菓	4,400	5,750.00	25,300,000

中村屋	500	4,835.00	2,417,500
江崎グリコ	5,700	6,020.00	34,314,000
名糖産業	1,000	1,519.00	1,519,000
不二家	14,000	259.00	3,626,000
山崎製パン	16,600	2,247.00	37,300,200
第一屋製パン	5,000	123.00	615,000
モロゾフ	3,000	591.00	1,773,000
亀田製菓	1,300	5,270.00	6,851,000
寿スピリッツ	2,200	3,005.00	6,611,000
カルビー	9,200	4,020.00	36,984,000
森永乳業	20,000	908.00	18,160,000
六甲バター	1,000	2,507.00	2,507,000
ヤクルト本社	12,100	6,630.00	80,223,000
明治ホールディングス	13,400	9,650.00	129,310,000
雪印メグミルク	4,900	3,385.00	16,586,500
プリマハム	14,000	520.00	7,280,000
日本ハム	16,000	3,250.00	52,000,000
丸大食品	11,000	520.00	5,720,000
S Foods	1,200	3,520.00	4,224,000
伊藤ハム米久ホールディングス	13,200	1,040.00	13,728,000
サッポロホールディングス	7,500	3,230.00	24,225,000
アサヒグループホールディングス	42,500	4,376.00	185,980,000
キリンホールディングス	97,500	2,225.00	216,937,500
宝ホールディングス	16,500	1,240.00	20,460,000
オエノンホールディングス	6,000	257.00	1,542,000
養命酒製造	700	2,099.00	1,469,300
コカ・コーラボトラーズジャパン	14,300	3,345.00	47,833,500
サントリー食品インターナショナル	15,500	5,240.00	81,220,000
ダイドーグループホールディングス	1,100	5,430.00	5,973,000
伊藤園	6,700	4,145.00	27,771,500
キーコーヒー	2,000	2,283.00	4,566,000
ユニカフェ	700	972.00	680,400
ジャパンフーズ	300	1,355.00	406,500
日清オイリオグループ	13,000	692.00	8,996,000
不二製油グループ本社	6,100	2,721.00	16,598,100
かどや製油	200	5,590.00	1,118,000
J - オイルミルズ	1,000	4,375.00	4,375,000
キッコーマン	15,800	3,480.00	54,984,000
味の素	46,700	2,218.00	103,580,600
キューピー	11,500	2,914.00	33,511,000
ハウス食品グループ本社	8,400	2,532.00	21,268,800
カゴメ	8,200	3,200.00	26,240,000

焼津水産化学工業	1,100	1,289.00	1,417,900
アリアケジャパン	1,800	7,330.00	13,194,000
ピエトロ	300	1,614.00	484,200
エバラ食品工業	500	2,119.00	1,059,500
ニチレイ	11,200	2,839.00	31,796,800
東洋水産	11,100	4,295.00	47,674,500
イートアンド	300	2,249.00	674,700
大冷	200	1,811.00	362,200
日清食品ホールディングス	8,800	6,530.00	57,464,000
永谷園ホールディングス	2,000	1,480.00	2,960,000
一正蒲鉾	800	1,298.00	1,038,400
フジッコ	2,200	2,601.00	5,722,200
ロック・フィールド	2,200	1,824.00	4,012,800
日本たばこ産業	125,400	3,780.00	474,012,000
ケンコーマヨネーズ	1,200	2,890.00	3,468,000
わらべや日洋ホールディングス	1,300	2,823.00	3,669,900
なとり	1,200	1,960.00	2,352,000
イフジ産業	400	801.00	320,400
北の達人コーポレーション	1,000	826.00	826,000
ユーグレナ	7,800	1,196.00	9,328,800
ミヨシ油脂	8,000	143.00	1,144,000
理研ビタミン	700	4,330.00	3,031,000
片倉工業	2,800	1,454.00	4,071,200
ゲンゼ	16,000	470.00	7,520,000
東洋紡	86,000	200.00	17,200,000
富士紡ホールディングス	1,100	3,145.00	3,459,500
倉敷紡績	22,000	260.00	5,720,000
シキボウ	12,000	142.00	1,704,000
日本毛織	6,300	904.00	5,695,200
トーア紡コーポレーション	1,200	560.00	672,000
ダイドーリミテッド	3,200	443.00	1,417,600
帝国繊維	2,200	1,791.00	3,940,200
帝人	17,500	2,210.00	38,675,000
東レ	154,100	999.10	153,961,310
サカイオーベックス	600	1,830.00	1,098,000
住江織物	6,000	261.00	1,566,000
日本フェルト	1,700	520.00	884,000
イチカワ	2,000	296.00	592,000
日東製網	300	1,878.00	563,400
アツギ	19,000	135.00	2,565,000
ダイニック	5,000	194.00	970,000
セーレン	5,400	1,609.00	8,688,600

ソトー	900	1,160.00	1,044,000
東海染工	4,000	138.00	552,000
小松精練	3,200	750.00	2,400,000
ワコールホールディングス	13,000	1,458.00	18,954,000
ホギメディカル	1,400	7,450.00	10,430,000
クラウドピア	1,000	552.00	552,000
T S Iホールディングス	8,800	773.00	6,802,400
三陽商会	13,000	168.00	2,184,000
オンワードホールディングス	14,000	866.00	12,124,000
ルック	4,000	201.00	804,000
ゴールドウイン	900	6,130.00	5,517,000
デサント	4,900	1,410.00	6,909,000
キング	1,300	401.00	521,300
ヤマトインターナショナル	2,000	418.00	836,000
特種東海製紙	1,200	4,265.00	5,118,000
王子ホールディングス	83,000	546.00	45,318,000
日本製紙	9,500	2,110.00	20,045,000
三菱製紙	3,400	780.00	2,652,000
北越紀州製紙	12,300	796.00	9,790,800
中越パルプ工業	9,000	240.00	2,160,000
大王製紙	8,500	1,469.00	12,486,500
阿波製紙	600	597.00	358,200
レンゴー	20,700	678.00	14,034,600
トーモク	6,000	353.00	2,118,000
ザ・パック	1,500	3,200.00	4,800,000
クラレ	35,600	1,840.00	65,504,000
旭化成	132,000	1,106.50	146,058,000
共和レザー	1,100	925.00	1,017,500
昭和電工	14,200	2,229.00	31,651,800
住友化学	156,000	655.00	102,180,000
住友精化	900	5,000.00	4,500,000
日産化学工業	11,600	3,580.00	41,528,000
ラサ工業	8,000	148.00	1,184,000
クレハ	1,600	5,100.00	8,160,000
多木化学	1,000	939.00	939,000
テイカ	3,000	804.00	2,412,000
石原産業	4,000	1,139.00	4,556,000
片倉コープアグリ	3,000	249.00	747,000
日東エフシー	1,200	907.00	1,088,400
日本曹達	13,000	642.00	8,346,000
東ソー	61,000	1,062.00	64,782,000
トクヤマ	33,000	552.00	18,216,000

セントラル硝子	22,000	498.00	10,956,000
東亜合成	13,200	1,348.00	17,793,600
大阪ソーダ	9,000	517.00	4,653,000
関東電化工業	4,400	1,010.00	4,444,000
デンカ	44,000	586.00	25,784,000
信越化学工業	38,000	9,947.00	377,986,000
日本カーバイド工業	8,000	167.00	1,336,000
堺化学工業	8,000	401.00	3,208,000
エア・ウォーター	17,500	2,232.00	39,060,000
大陽日酸	16,400	1,389.00	22,779,600
日本化学工業	8,000	238.00	1,904,000
日本パーカライジング	10,800	1,525.00	16,470,000
高压ガス工業	3,000	773.00	2,319,000
四国化成工業	3,000	1,424.00	4,272,000
戸田工業	5,000	273.00	1,365,000
ステラ ケミファ	1,100	2,903.00	3,193,300
保土谷化学工業	800	3,660.00	2,928,000
日本触媒	3,300	7,460.00	24,618,000
大日精化工業	9,000	796.00	7,164,000
カネカ	29,000	913.00	26,477,000
三菱瓦斯化学	19,800	2,498.00	49,460,400
三井化学	96,000	593.00	56,928,000
J S R	21,300	2,006.00	42,727,800
東京応化工業	4,000	3,700.00	14,800,000
大阪有機化学工業	1,400	1,219.00	1,706,600
三菱ケミカルホールディングス	142,700	917.50	130,927,250
K Hネオケム	3,500	1,636.00	5,726,000
ダイセル	28,600	1,323.00	37,837,800
住友ベークライト	19,000	732.00	13,908,000
積水化学工業	48,000	1,994.00	95,712,000
日本ゼオン	18,000	1,210.00	21,780,000
アイカ工業	6,800	3,285.00	22,338,000
宇部興産	107,000	266.00	28,462,000
積水樹脂	3,100	2,086.00	6,466,600
タキロンシーアイ	4,000	594.00	2,376,000
旭有機材	7,000	239.00	1,673,000
日立化成	11,800	3,325.00	39,235,000
ニチバン	2,000	920.00	1,840,000
リケンテクノス	4,600	544.00	2,502,400
大倉工業	5,000	543.00	2,715,000
積水化成品工業	2,900	850.00	2,465,000
群栄化学工業	500	3,750.00	1,875,000



タイガースポリマー	1,100	743.00	817,300
ミライアル	800	976.00	780,800
ダイキアクシス	400	2,112.00	844,800
ダイキョーニシカワ	3,700	1,482.00	5,483,400
日本化薬	14,000	1,569.00	21,966,000
カーリットホールディングス	2,100	579.00	1,215,900
日本精化	1,700	991.00	1,684,700
扶桑化学工業	1,500	3,730.00	5,595,000
A D E K A	9,100	1,711.00	15,570,100
日油	16,000	1,334.00	21,344,000
新日本理化	3,800	145.00	551,000
ハリマ化成グループ	1,900	825.00	1,567,500
花王	52,800	6,444.00	340,243,200
第一工業製薬	5,000	468.00	2,340,000
日華化学	800	1,297.00	1,037,600
ニイタカ	300	1,825.00	547,500
三洋化成工業	1,300	5,350.00	6,955,000
有機合成薬品工業	1,900	292.00	554,800
大日本塗料	12,000	269.00	3,228,000
日本ペイントホールディングス	16,300	4,430.00	72,209,000
関西ペイント	22,300	2,530.00	56,419,000
神東塗料	2,000	215.00	430,000
中国塗料	6,200	863.00	5,350,600
日本特殊塗料	1,500	1,779.00	2,668,500
藤倉化成	2,800	674.00	1,887,200
太陽ホールディングス	1,700	4,845.00	8,236,500
D I C	8,400	4,195.00	35,238,000
サカタインクス	4,300	1,666.00	7,163,800
東洋インキS Cホールディングス	20,000	579.00	11,580,000
T & K T O K A	1,500	1,138.00	1,707,000
富士フイルムホールディングス	42,000	4,268.00	179,256,000
資生堂	40,200	3,165.00	127,233,000
ライオン	26,300	2,130.00	56,019,000
高砂香料工業	1,400	3,855.00	5,397,000
マンダム	2,100	5,600.00	11,760,000
ミルボン	1,100	5,590.00	6,149,000
ファンケル	4,500	1,871.00	8,419,500
コーセー	3,400	11,440.00	38,896,000
コタ	900	1,224.00	1,101,600
シーズ・ホールディングス	2,800	3,455.00	9,674,000
シーボン	300	2,454.00	736,200
ポーラ・オルビスホールディングス	8,600	2,695.00	23,177,000

ノエビアホールディングス	1,300	4,650.00	6,045,000
アジュバンコスメジャパン	500	951.00	475,500
エステー	1,500	1,880.00	2,820,000
アグロ カネショウ	800	1,584.00	1,267,200
コニシ	3,300	1,433.00	4,728,900
長谷川香料	2,700	2,285.00	6,169,500
星光P M C	1,200	1,243.00	1,491,600
小林製薬	5,700	6,200.00	35,340,000
荒川化学工業	1,800	2,100.00	3,780,000
メック	1,700	1,217.00	2,068,900
日本高純度化学	600	2,411.00	1,446,600
タカラバイオ	6,100	1,542.00	9,406,200
J C U	1,300	3,545.00	4,608,500
新田ゼラチン	1,300	760.00	988,000
O A T アグリオ	300	1,636.00	490,800
デクセリアルズ	5,600	1,000.00	5,600,000
アース製薬	1,500	6,230.00	9,345,000
北興化学工業	2,000	487.00	974,000
大成ラミック	700	2,912.00	2,038,400
クミアイ化学工業	10,553	647.00	6,827,791
日本農薬	5,400	749.00	4,044,600
アキレス	1,700	1,837.00	3,122,900
有沢製作所	3,600	816.00	2,937,600
日東電工	15,300	9,238.00	141,341,400
レック	1,300	2,361.00	3,069,300
きもと	4,100	227.00	930,700
藤森工業	1,600	3,485.00	5,576,000
前澤化成工業	1,300	1,226.00	1,593,800
J S P	1,000	2,823.00	2,823,000
エフピコ	1,900	5,460.00	10,374,000
天馬	1,400	2,227.00	3,117,800
信越ポリマー	4,300	839.00	3,607,700
東リ	4,900	396.00	1,940,400
ニフコ	3,700	5,720.00	21,164,000
日本バルカー工業	1,600	1,956.00	3,129,600
ユニ・チャーム	42,900	2,814.50	120,742,050
協和発酵キリン	25,400	1,991.00	50,571,400
武田薬品工業	79,300	5,496.00	435,832,800
アステラス製薬	216,100	1,444.50	312,156,450
大日本住友製薬	15,100	1,856.00	28,025,600
塩野義製薬	26,800	6,079.00	162,917,200
田辺三菱製薬	24,600	2,507.00	61,672,200

わかもと製薬	3,000	283.00	849,000
あすか製薬	2,400	1,684.00	4,041,600
日本新薬	4,800	6,170.00	29,616,000
Bioフェルミン製薬	300	2,970.00	891,000
中外製薬	21,100	4,110.00	86,721,000
科研製薬	3,900	6,870.00	26,793,000
エーザイ	26,000	5,959.00	154,934,000
ロート製薬	10,400	2,229.00	23,181,600
小野薬品工業	48,100	2,391.00	115,007,100
久光製薬	6,000	5,950.00	35,700,000
持田製薬	1,400	8,790.00	12,306,000
参天製薬	38,200	1,616.00	61,731,200
扶桑薬品工業	700	2,928.00	2,049,600
日本ケミファ	300	5,290.00	1,587,000
ツムラ	7,100	3,765.00	26,731,500
日医工	5,000	1,808.00	9,040,000
キッセイ薬品工業	3,800	3,050.00	11,590,000
生化学工業	3,900	1,828.00	7,129,200
栄研化学	1,800	3,325.00	5,985,000
日水製薬	800	1,407.00	1,125,600
鳥居薬品	1,400	2,855.00	3,997,000
JCRファーマ	1,700	2,427.00	4,125,900
東和薬品	1,000	5,810.00	5,810,000
富士製薬工業	700	3,600.00	2,520,000
沢井製薬	3,600	6,220.00	22,392,000
ゼリア新薬工業	4,400	1,751.00	7,704,400
第一三共	62,300	2,562.50	159,643,750
キョーリン製薬ホールディングス	5,200	2,426.00	12,615,200
大幸薬品	1,100	1,876.00	2,063,600
ダイト	1,300	2,371.00	3,082,300
大塚ホールディングス	45,500	5,086.00	231,413,000
大正製薬ホールディングス	4,500	9,550.00	42,975,000
ペプチドリーム	4,000	6,200.00	24,800,000
昭和シェル石油	19,000	1,113.00	21,147,000
ニチレキ	2,600	1,038.00	2,698,800
ユシロ化学工業	1,100	1,454.00	1,599,400
ビーピー・カストロール	900	1,892.00	1,702,800
富士石油	5,400	377.00	2,035,800
MORESCO	700	1,991.00	1,393,700
出光興産	10,100	3,815.00	38,531,500
JXTGホールディングス	324,500	514.90	167,085,050
コスモエネルギーホールディングス	6,400	1,853.00	11,859,200

横浜ゴム	12,900	2,265.00	29,218,500
東洋ゴム工業	11,200	2,023.00	22,657,600
ブリヂストン	71,200	4,784.00	340,620,800
住友ゴム工業	19,900	2,081.00	41,411,900
藤倉ゴム工業	1,900	710.00	1,349,000
オカモト	6,000	1,259.00	7,554,000
フコク	1,000	933.00	933,000
ニッタ	1,900	3,315.00	6,298,500
住友理工	4,100	1,208.00	4,952,800
三ツ星ベルト	5,000	1,128.00	5,640,000
バンドー化学	3,900	1,058.00	4,126,200
日東紡績	17,000	606.00	10,302,000
旭硝子	104,000	1,004.00	104,416,000
日本板硝子	10,000	916.00	9,160,000
日本山村硝子	9,000	197.00	1,773,000
日本電気硝子	44,000	766.00	33,704,000
オハラ	900	1,111.00	999,900
住友大阪セメント	39,000	505.00	19,695,000
太平洋セメント	128,000	380.00	48,640,000
日本ヒューム	2,000	700.00	1,400,000
日本コンクリート工業	4,800	367.00	1,761,600
三谷セキサン	1,000	2,856.00	2,856,000
アジアパイルホールディングス	2,600	620.00	1,612,000
東海カーボン	20,100	514.00	10,331,400
日本カーボン	11,000	308.00	3,388,000
東洋炭素	1,200	1,902.00	2,282,400
ノリタケカンパニーリミテド	1,200	3,080.00	3,696,000
TOTO	15,500	4,325.00	67,037,500
日本碍子	26,700	2,460.00	65,682,000
日本特殊陶業	18,300	2,511.00	45,951,300
MARUWA	800	4,300.00	3,440,000
品川リフラクトリーズ	5,000	308.00	1,540,000
黒崎播磨	5,000	451.00	2,255,000
ヨータイ	1,000	385.00	385,000
イソライト工業	1,200	461.00	553,200
東京窯業	3,100	202.00	626,200
ニッカトー	700	440.00	308,000
フジミインコーポレーテッド	1,800	2,257.00	4,062,600
エーアンドエーマテリアル	5,000	128.00	640,000
ニチアス	11,000	1,235.00	13,585,000
ニチハ	2,800	3,630.00	10,164,000
新日鐵住金	95,400	2,519.00	240,312,600

神戸製鋼所	37,000	1,139.00	42,143,000
中山製鋼所	2,400	747.00	1,792,800
合同製鐵	1,200	1,715.00	2,058,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	57,900	1,889.00	109,373,100
日新製鋼	6,900	1,362.00	9,397,800
東京製鐵	10,800	863.00	9,320,400
共英製鋼	2,300	1,785.00	4,105,500
大和工業	4,200	2,810.00	11,802,000
東京鐵鋼	4,000	441.00	1,764,000
大阪製鐵	1,300	2,101.00	2,731,300
淀川製鋼所	2,900	3,030.00	8,787,000
東洋鋼鋳	5,200	411.00	2,137,200
丸一鋼管	7,000	3,290.00	23,030,000
モリ工業	600	2,299.00	1,379,400
大同特殊鋼	35,000	636.00	22,260,000
日本冶金工業	17,900	214.00	3,830,600
山陽特殊製鋼	13,000	597.00	7,761,000
愛知製鋼	1,200	4,390.00	5,268,000
日立金属	21,500	1,599.00	34,378,500
日本金属	600	1,472.00	883,200
大平洋金属	14,000	359.00	5,026,000
新日本電工	12,200	347.00	4,233,400
栗本鐵工所	1,000	2,249.00	2,249,000
虹技	3,000	232.00	696,000
日本鑄鐵管	3,000	168.00	504,000
三菱製鋼	15,000	253.00	3,795,000
日亜鋼業	2,900	273.00	791,700
日本精線	1,000	683.00	683,000
シンニッタン	1,700	721.00	1,225,700
新家工業	4,000	208.00	832,000
大紀アルミニウム工業所	4,000	553.00	2,212,000
日本輕金属ホールディングス	54,900	255.00	13,999,500
三井金属鋳業	59,000	385.00	22,715,000
東邦亜鉛	12,000	499.00	5,988,000
三菱マテリアル	13,300	3,425.00	45,552,500
住友金属鋳山	55,000	1,489.00	81,895,000
DOWAホールディングス	23,000	845.00	19,435,000
古河機械金属	34,000	217.00	7,378,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,400	1,783.00	4,279,200
東邦チタニウム	3,800	775.00	2,945,000
UACJ	30,000	308.00	9,240,000
古河電気工業	7,100	4,595.00	32,624,500

住友電気工業	79,800	1,901.00	151,699,800
フジクラ	28,100	865.00	24,306,500
東京特殊電線	300	1,710.00	513,000
タツタ電線	4,100	583.00	2,390,300
沖電線	2,000	224.00	448,000
カナレ電気	300	2,241.00	672,300
平河ヒューテック	1,000	1,340.00	1,340,000
リョービ	13,000	523.00	6,799,000
アーレスティ	2,500	1,144.00	2,860,000
アサヒホールディングス	3,200	2,106.00	6,739,200
稲葉製作所	1,100	1,397.00	1,536,700
宮地エンジニアリンググループ	6,000	220.00	1,320,000
トーカロ	1,400	3,290.00	4,606,000
アルファCo	700	2,240.00	1,568,000
SUMCO	22,100	1,988.00	43,934,800
川田テクノロジーズ	400	7,490.00	2,996,000
RS Technologies	100	6,870.00	687,000
東洋製罐グループホールディングス	15,100	1,924.00	29,052,400
ホッカンホールディングス	5,000	521.00	2,605,000
コロナ	1,100	1,147.00	1,261,700
横河ブリッジホールディングス	3,700	1,415.00	5,235,500
駒井ハルテック	400	2,164.00	865,600
高田機工	2,000	277.00	554,000
三和ホールディングス	20,900	1,170.00	24,453,000
文化シャッター	5,800	894.00	5,185,200
三協立山	2,800	1,679.00	4,701,200
アルインコ	1,400	1,037.00	1,451,800
東洋シャッター	600	630.00	378,000
LIXILグループ	29,500	2,850.00	84,075,000
日本ファイルコン	1,600	610.00	976,000
ノーリツ	4,200	2,256.00	9,475,200
長府製作所	2,200	2,691.00	5,920,200
リンナイ	3,600	9,510.00	34,236,000
ダイニチ工業	1,000	723.00	723,000
日東精工	3,100	469.00	1,453,900
三洋工業	3,000	202.00	606,000
岡部	4,400	1,014.00	4,461,600
ジーテクト	2,200	2,109.00	4,639,800
中国工業	500	756.00	378,000
東プレ	4,000	3,135.00	12,540,000
高周波熱錬	3,800	964.00	3,663,200
東京製綱	1,500	1,740.00	2,610,000

サンコール	1,000	549.00	549,000
モリテック スチール	1,400	288.00	403,200
パイオラックス	3,200	2,782.00	8,902,400
エイチワン	1,600	1,637.00	2,619,200
日本発條	19,900	1,294.00	25,750,600
中央発條	2,000	349.00	698,000
アドバネクス	400	1,524.00	609,600
立川ブラインド工業	800	984.00	787,200
三益半導体工業	1,800	1,778.00	3,200,400
日本ドライケミカル	300	2,458.00	737,400
日本製鋼所	7,100	1,853.00	13,156,300
三浦工業	8,700	1,968.00	17,121,600
タクマ	6,800	1,165.00	7,922,000
ツガミ	6,000	927.00	5,562,000
オークマ	14,000	1,143.00	16,002,000
東芝機械	13,000	487.00	6,331,000
アマダホールディングス	28,500	1,362.00	38,817,000
アイダエンジニアリング	6,000	1,015.00	6,090,000
滝澤鉄工所	7,000	170.00	1,190,000
富士機械製造	6,500	1,455.00	9,457,500
牧野フライス製作所	11,000	1,034.00	11,374,000
オーエスジー	9,700	2,342.00	22,717,400
ダイジェット工業	3,000	183.00	549,000
旭ダイヤモンド工業	6,200	885.00	5,487,000
D M G 森精機	12,300	1,893.00	23,283,900
ソディック	5,400	1,135.00	6,129,000
ディスコ	2,500	18,620.00	46,550,000
日東工器	1,200	2,690.00	3,228,000
パンチ工業	800	1,163.00	930,400
豊和工業	1,400	722.00	1,010,800
OKK	9,000	120.00	1,080,000
東洋機械金属	1,500	700.00	1,050,000
津田駒工業	6,000	179.00	1,074,000
島精機製作所	2,800	5,150.00	14,420,000
N C ホールディングス	800	910.00	728,000
フリー	1,200	1,499.00	1,798,800
ヤマシンフィルタ	600	2,270.00	1,362,000
日阪製作所	2,900	995.00	2,885,500
やまびこ	3,900	1,390.00	5,421,000
ペガサスミシン製造	2,000	940.00	1,880,000
ナブテスコ	11,000	3,350.00	36,850,000
三井海洋開発	2,200	2,693.00	5,924,600

レオン自動機	1,800	1,112.00	2,001,600
S M C	6,300	32,350.00	203,805,000
ホソカワミクロン	800	4,315.00	3,452,000
ユニオンツール	900	3,450.00	3,105,000
オイレス工業	2,600	2,123.00	5,519,800
日精エー・エス・ビー機械	700	2,946.00	2,062,200
サトーホールディングス	2,600	2,634.00	6,848,400
日本エアテック	800	815.00	652,000
日精樹脂工業	1,700	1,143.00	1,943,100
オカダアイヨン	700	1,131.00	791,700
小松製作所	97,700	2,882.00	281,571,400
住友重機械工業	62,000	800.00	49,600,000
日立建機	9,600	2,832.00	27,187,200
日工	600	2,061.00	1,236,600
巴工業	900	1,819.00	1,637,100
井関農機	22,000	237.00	5,214,000
T O W A	1,800	1,943.00	3,497,400
丸山製作所	500	1,798.00	899,000
北川鉄工所	1,000	2,261.00	2,261,000
ローツェ	1,000	2,298.00	2,298,000
タカキタ	800	553.00	442,400
クボタ	101,300	1,790.00	181,327,000
荏原実業	600	1,486.00	891,600
三菱化工機	7,000	226.00	1,582,000
月島機械	4,000	1,273.00	5,092,000
帝国電機製作所	1,600	1,116.00	1,785,600
新東工業	4,900	1,022.00	5,007,800
澁谷工業	1,800	3,370.00	6,066,000
アイチ コーポレーション	3,000	797.00	2,391,000
小森コーポレーション	5,100	1,573.00	8,022,300
鶴見製作所	1,600	1,726.00	2,761,600
住友精密工業	4,000	372.00	1,488,000
酒井重工業	4,000	310.00	1,240,000
荏原製作所	9,600	3,450.00	33,120,000
石井鐵工所	400	1,683.00	673,200
西島製作所	2,200	1,077.00	2,369,400
北越工業	2,300	1,024.00	2,355,200
ダイキン工業	27,600	11,225.00	309,810,000
オルガノ	4,000	522.00	2,088,000
トーヨーカネツ	10,000	295.00	2,950,000
栗田工業	12,000	3,015.00	36,180,000
椿本チエイン	12,000	1,014.00	12,168,000



大同工業	4,000	300.00	1,200,000
木村化工機	2,100	328.00	688,800
アネスト岩田	3,700	1,027.00	3,799,900
ダイフク	10,100	3,015.00	30,451,500
サムコ	600	1,007.00	604,200
加藤製作所	1,100	2,937.00	3,230,700
油研工業	4,000	229.00	916,000
タダノ	10,700	1,374.00	14,701,800
フジテック	5,900	1,380.00	8,142,000
C K D	6,100	1,507.00	9,192,700
キトー	2,600	1,208.00	3,140,800
平和	6,300	2,908.00	18,320,400
理想科学工業	2,000	2,168.00	4,336,000
SANKYO	5,600	3,925.00	21,980,000
日本金銭機械	2,000	1,307.00	2,614,000
マースエンジニアリング	1,100	2,382.00	2,620,200
福島工業	1,200	4,190.00	5,028,000
オーイズミ	1,000	594.00	594,000
ダイコク電機	900	1,650.00	1,485,000
竹内製作所	3,700	2,002.00	7,407,400
アマノ	6,200	2,402.00	14,892,400
サンデンホールディングス	13,000	370.00	4,810,000
蛇の目ミシン工業	2,100	811.00	1,703,100
マックス	3,000	1,649.00	4,947,000
グローリー	6,500	3,860.00	25,090,000
新晃工業	1,900	1,771.00	3,364,900
大和冷機工業	3,300	1,118.00	3,689,400
セガサミーホールディングス	20,100	1,555.00	31,255,500
日本ピストンリング	800	2,625.00	2,100,000
リケン	900	5,200.00	4,680,000
T P R	2,300	3,940.00	9,062,000
ツバキ・ナカシマ	2,300	2,050.00	4,715,000
ホシザキ	5,900	9,610.00	56,699,000
大豊工業	1,700	1,556.00	2,645,200
日本精工	41,600	1,607.00	66,851,200
N T N	47,000	587.00	27,589,000
ジェイテクト	21,600	1,882.00	40,651,200
不二越	21,000	622.00	13,062,000
日本トムソン	6,700	644.00	4,314,800
T H K	14,300	3,005.00	42,971,500
ユーシン精機	900	3,220.00	2,898,000
前澤給装工業	800	1,605.00	1,284,000

イーグル工業	2,200	1,640.00	3,608,000
前澤工業	1,800	331.00	595,800
日本ピラー工業	2,000	1,598.00	3,196,000
キッツ	9,800	823.00	8,065,400
マキタ	26,400	4,155.00	109,692,000
日立造船	16,400	658.00	10,791,200
三菱重工業	339,000	455.90	154,550,100
I H I	156,000	395.00	61,620,000
スター精密	3,600	1,900.00	6,840,000
日清紡ホールディングス	11,300	1,181.00	13,345,300
イビデン	14,200	2,032.00	28,854,400
コニカミノルタ	47,400	1,021.00	48,395,400
ブラザー工業	26,100	2,473.00	64,545,300
ミネベアミツミ	36,800	1,640.00	60,352,000
日立製作所	485,000	635.50	308,217,500
東芝	454,000	240.80	109,323,200
三菱電機	215,500	1,664.50	358,699,750
富士電機	61,000	641.00	39,101,000
東洋電機製造	900	1,691.00	1,521,900
安川電機	23,500	2,258.00	53,063,000
シンフォニアテクノロジー	13,000	330.00	4,290,000
明電舎	19,000	422.00	8,018,000
オリジン電気	3,000	317.00	951,000
山洋電気	5,000	1,006.00	5,030,000
デンヨー	1,900	1,770.00	3,363,000
東芝テック	13,000	600.00	7,800,000
芝浦メカトロニクス	4,000	290.00	1,160,000
マブチモーター	5,700	6,610.00	37,677,000
日本電産	26,200	10,580.00	277,196,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	300	3,065.00	919,500
東光高岳	1,000	1,708.00	1,708,000
ダブル・スコープ	2,000	1,629.00	3,258,000
ダイヘン	11,000	761.00	8,371,000
田淵電機	3,200	335.00	1,072,000
ヤーマン	300	5,530.00	1,659,000
JVCケンウッド	15,100	304.00	4,590,400
ミマキエンジニアリング	1,800	716.00	1,288,800
第一精工	1,000	1,744.00	1,744,000
日新電機	4,100	1,366.00	5,600,600
大崎電気工業	4,000	962.00	3,848,000
オムロン	21,500	4,715.00	101,372,500
日東工業	3,000	1,713.00	5,139,000

I D E C	2,600	1,260.00	3,276,000
不二電機工業	300	1,345.00	403,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	39,000	535.00	20,865,000
サクサホールディングス	5,000	219.00	1,095,000
メルコホールディングス	1,100	3,290.00	3,619,000
テクノメディカ	500	2,067.00	1,033,500
日本電気	278,000	287.00	79,786,000
富士通	195,000	792.40	154,518,000
沖電気工業	8,800	1,699.00	14,951,200
電気興業	6,000	570.00	3,420,000
サンケン電気	12,000	538.00	6,456,000
ナカヨ	2,000	362.00	724,000
アイホン	1,100	1,840.00	2,024,000
ルネサスエレクトロニクス	10,500	1,126.00	11,823,000
セイコーエプソン	30,100	2,358.00	70,975,800
ワコム	15,800	406.00	6,414,800
アルバック	3,400	5,480.00	18,632,000
アクセル	1,000	778.00	778,000
E I Z O	2,000	3,760.00	7,520,000
ジャパンディスプレイ	38,000	231.00	8,778,000
日本信号	5,600	1,093.00	6,120,800
京三製作所	5,000	467.00	2,335,000
能美防災	2,300	1,600.00	3,680,000
ホーチキ	1,400	1,580.00	2,212,000
エレコム	1,800	2,394.00	4,309,200
日本無線	1,300	1,473.00	1,914,900
パナソニック	232,100	1,376.50	319,485,650
アンリツ	14,900	954.00	14,214,600
富士通ゼネラル	6,900	2,479.00	17,105,100
日立国際電気	5,300	2,486.00	13,175,800
ソニー	142,800	3,989.00	569,629,200
T D K	11,400	7,140.00	81,396,000
帝国通信工業	4,000	193.00	772,000
タムラ製作所	8,000	553.00	4,424,000
アルプス電気	18,700	3,350.00	62,645,000
池上通信機	7,000	150.00	1,050,000
パイオニア	31,300	207.00	6,479,100
日本電波工業	2,100	832.00	1,747,200
鈴木	800	680.00	544,000
日本トリム	500	3,795.00	1,897,500
ローランド ディー . ジー .	1,000	3,570.00	3,570,000
フォスター電機	2,400	1,955.00	4,692,000

クラリオン	11,000	457.00	5,027,000
SMK	5,000	391.00	1,955,000
ヨコオ	1,500	1,438.00	2,157,000
ホシデン	6,200	1,255.00	7,781,000
ヒロセ電機	3,300	15,270.00	50,391,000
日本航空電子工業	6,000	1,593.00	9,558,000
TOA	2,400	1,059.00	2,541,600
日立マクセル	3,000	2,262.00	6,786,000
古野電気	2,700	711.00	1,919,700
ユニデンホールディングス	6,000	172.00	1,032,000
アルパイン	4,900	1,648.00	8,075,200
スミダコーポレーション	1,900	1,456.00	2,766,400
アイコム	1,100	2,873.00	3,160,300
リオン	800	1,577.00	1,261,600
本多通信工業	900	1,483.00	1,334,700
横河電機	22,000	1,811.00	39,842,000
新電元工業	8,000	528.00	4,224,000
アズビル	6,100	3,965.00	24,186,500
東亜ディーケーケー	1,000	620.00	620,000
日本光電工業	8,400	2,605.00	21,882,000
チノー	700	1,269.00	888,300
共和電業	2,300	481.00	1,106,300
日本電子材料	1,000	662.00	662,000
堀場製作所	4,000	6,940.00	27,760,000
アドバンテスト	13,900	2,116.00	29,412,400
小野測器	1,000	819.00	819,000
エスベック	1,800	1,413.00	2,543,400
キーエンス	9,200	47,590.00	437,828,000
日置電機	1,000	2,387.00	2,387,000
シスメックス	15,700	7,280.00	114,296,000
日本マイクロニクス	3,500	983.00	3,440,500
メガチップス	1,900	3,040.00	5,776,000
OBARA GROUP	1,200	5,380.00	6,456,000
澤藤電機	1,000	495.00	495,000
コーセル	2,800	1,538.00	4,306,400
イリソ電子工業	900	7,290.00	6,561,000
新日本無線	1,800	572.00	1,029,600
オプテックスグループ	1,500	3,225.00	4,837,500
千代田インテグレ	1,000	2,536.00	2,536,000
アイ・オー・データ機器	900	1,193.00	1,073,700
レーザーテック	4,400	1,400.00	6,160,000
スタンレー電気	14,400	3,420.00	49,248,000

岩崎電気	8,000	172.00	1,376,000
ウシオ電機	12,300	1,476.00	18,154,800
岡谷電機産業	1,300	402.00	522,600
ヘリオス テクノ ホールディング	1,900	645.00	1,225,500
日本セラミック	1,700	2,430.00	4,131,000
遠藤照明	1,100	1,131.00	1,244,100
古河電池	1,000	732.00	732,000
双信電機	1,400	304.00	425,600
山一電機	1,900	1,554.00	2,952,600
図研	1,300	1,400.00	1,820,000
日本電子	7,000	584.00	4,088,000
カシオ計算機	16,300	1,629.00	26,552,700
ファナック	20,500	23,260.00	476,830,000
日本シイエムケイ	4,600	791.00	3,638,600
エンプラス	900	3,180.00	2,862,000
大真空	800	1,414.00	1,131,200
ローム	9,800	8,470.00	83,006,000
浜松ホトニクス	14,700	3,460.00	50,862,000
三井ハイテック	2,700	1,161.00	3,134,700
新光電気工業	7,800	901.00	7,027,800
京セラ	33,200	6,599.00	219,086,800
太陽誘電	10,000	1,479.00	14,790,000
村田製作所	21,200	16,095.00	341,214,000
ユーシン	2,900	776.00	2,250,400
双葉電子工業	3,300	2,073.00	6,840,900
北陸電気工業	9,000	139.00	1,251,000
ニチコン	6,500	1,132.00	7,358,000
日本ケミコン	18,000	403.00	7,254,000
K O A	2,800	2,029.00	5,681,200
市光工業	4,000	610.00	2,440,000
小糸製作所	12,100	6,170.00	74,657,000
ミツバ	3,700	2,283.00	8,447,100
S C R E E Nホールディングス	4,200	8,800.00	36,960,000
キャノン電子	1,800	2,154.00	3,877,200
キャノン	108,700	3,794.00	412,407,800
リコー	60,900	917.00	55,845,300
M U T O Hホールディングス	3,000	244.00	732,000
東京エレクトロン	13,500	15,095.00	203,782,500
トヨタ紡織	7,100	2,427.00	17,231,700
芦森工業	6,000	166.00	996,000
ユニプレス	3,900	2,470.00	9,633,000
豊田自動織機	18,400	5,810.00	106,904,000

モリタホールディングス	3,500	1,684.00	5,894,000
三櫻工業	2,800	848.00	2,374,400
デンソー	49,800	4,994.00	248,701,200
東海理化電機製作所	5,400	2,218.00	11,977,200
三井造船	74,000	170.00	12,580,000
川崎重工業	158,000	351.00	55,458,000
名村造船所	6,100	752.00	4,587,200
日本車輛製造	8,000	297.00	2,376,000
ニチユ三菱フォークリフト	2,500	697.00	1,742,500
近畿車輛	400	2,598.00	1,039,200
日産自動車	238,300	1,085.00	258,555,500
いすゞ自動車	58,600	1,556.00	91,181,600
トヨタ自動車	245,500	6,235.00	1,530,692,500
日野自動車	28,900	1,406.00	40,633,400
三菱自動車工業	74,300	724.00	53,793,200
エフテック	1,300	1,399.00	1,818,700
レシップホールディングス	800	887.00	709,600
GMB	400	1,419.00	567,600
ファルテック	400	1,338.00	535,200
武蔵精密工業	2,400	2,833.00	6,799,200
日産車体	8,900	1,090.00	9,701,000
新明和工業	8,000	979.00	7,832,000
極東開発工業	4,000	1,873.00	7,492,000
日信工業	4,600	1,957.00	9,002,200
トピー工業	1,700	3,105.00	5,278,500
ティラド	8,000	342.00	2,736,000
曙ブレーキ工業	10,000	375.00	3,750,000
タチエス	3,500	2,257.00	7,899,500
NOK	9,800	2,749.00	26,940,200
フタバ産業	6,300	952.00	5,997,600
KYB	23,000	569.00	13,087,000
大同メタル工業	2,600	1,027.00	2,670,200
プレス工業	10,900	577.00	6,289,300
ミクニ	2,600	457.00	1,188,200
太平洋工業	4,600	1,649.00	7,585,400
ケーヒン	4,700	1,831.00	8,605,700
河西工業	2,700	1,490.00	4,023,000
アイシン精機	18,500	5,860.00	108,410,000
富士機工	2,100	737.00	1,547,700
マツダ	64,100	1,634.00	104,739,400
今仙電機製作所	1,900	1,080.00	2,052,000
本田技研工業	181,900	3,261.00	593,175,900

スズキ	40,100	4,922.00	197,372,200
SUBARU	62,700	4,256.00	266,851,200
安永	1,000	1,412.00	1,412,000
ヤマハ発動機	28,600	2,740.00	78,364,000
ショーワ	5,400	1,137.00	6,139,800
TBK	2,700	532.00	1,436,400
エクセディ	2,800	3,240.00	9,072,000
豊田合成	6,600	2,967.00	19,582,200
愛三工業	3,700	1,000.00	3,700,000
盟和産業	300	1,246.00	373,800
ヨロズ	1,900	1,829.00	3,475,100
エフ・シー・シー	3,400	2,241.00	7,619,400
シマノ	8,100	17,920.00	145,152,000
テイ・エス テック	4,700	3,355.00	15,768,500
ジャムコ	1,200	2,791.00	3,349,200
テルモ	31,000	4,160.00	128,960,000
クリエートメディック	600	987.00	592,200
日機装	7,100	1,198.00	8,505,800
島津製作所	26,000	1,980.00	51,480,000
JMS	4,000	340.00	1,360,000
長野計器	1,600	736.00	1,177,600
ブイ・テクノロジー	400	17,980.00	7,192,000
東京計器	7,000	230.00	1,610,000
愛知時計電機	200	3,770.00	754,000
インターアクション	800	747.00	597,600
オーバル	2,200	272.00	598,400
東京精密	3,900	3,705.00	14,449,500
マニー	2,500	3,075.00	7,687,500
ニコン	35,400	1,643.00	58,162,200
トプコン	10,200	2,187.00	22,307,400
オリンパス	32,300	4,250.00	137,275,000
理研計器	1,700	1,715.00	2,915,500
タムロン	1,800	2,173.00	3,911,400
HOYA	41,500	5,666.00	235,139,000
シード	200	2,073.00	414,600
ノーリツ鋼機	2,200	890.00	1,958,000
エー・アンド・デイ	1,900	464.00	881,600
シチズン時計	22,300	766.00	17,081,800
リズム時計工業	8,000	194.00	1,552,000
大研医器	1,800	824.00	1,483,200
メニコン	1,400	3,585.00	5,019,000
松風	1,000	1,351.00	1,351,000

セイコーホールディングス	14,000	488.00	6,832,000
ニプロ	14,000	1,747.00	24,458,000
スノーピーク	300	3,185.00	955,500
パラマウントベッドホールディングス	1,900	4,960.00	9,424,000
トランザクション	1,000	941.00	941,000
SHO - B I	900	470.00	423,000
ニホンフラッシュ	900	1,518.00	1,366,200
前田工織	2,000	1,454.00	2,908,000
永大産業	3,000	529.00	1,587,000
アートネイチャー	2,100	757.00	1,589,700
ダンロップスポーツ	1,300	1,064.00	1,383,200
バンダイナムコホールディングス	22,300	3,630.00	80,949,000
アイフィスジャパン	500	445.00	222,500
共立印刷	3,400	345.00	1,173,000
SHOE I	900	2,905.00	2,614,500
フランスベッドホールディングス	2,600	960.00	2,496,000
パイロットコーポレーション	3,500	4,775.00	16,712,500
萩原工業	600	2,725.00	1,635,000
トッパン・フォームズ	3,700	1,189.00	4,399,300
フジシールインターナショナル	4,500	2,762.00	12,429,000
タカラトミー	8,000	1,171.00	9,368,000
廣済堂	2,200	380.00	836,000
A s - m e エステール	600	710.00	426,000
アーク	9,200	107.00	984,400
タカノ	900	1,049.00	944,100
プロネクサス	1,800	1,375.00	2,475,000
ホクシン	2,200	185.00	407,000
ウッドワン	3,000	309.00	927,000
大建工業	1,400	2,205.00	3,087,000
凸版印刷	57,000	1,176.00	67,032,000
大日本印刷	58,000	1,276.00	74,008,000
図書印刷	3,000	513.00	1,539,000
共同印刷	6,000	389.00	2,334,000
日本写真印刷	3,500	2,900.00	10,150,000
光村印刷	3,000	265.00	795,000
宝印刷	1,000	1,750.00	1,750,000
アシックス	20,100	1,996.00	40,119,600
ツツミ	800	2,147.00	1,717,600
小松ウオール工業	600	2,112.00	1,267,200
ヤマハ	13,600	3,630.00	49,368,000
河合楽器製作所	800	2,438.00	1,950,400
クリナップ	2,400	836.00	2,006,400



ビジョン	12,200	3,530.00	43,066,000
兼松サステック	2,000	227.00	454,000
キングジム	1,800	900.00	1,620,000
リンテック	4,800	2,594.00	12,451,200
TASAKI	600	2,199.00	1,319,400
イトーキ	4,300	792.00	3,405,600
任天堂	12,500	28,810.00	360,125,000
三菱鉛筆	1,700	6,330.00	10,761,000
タカラスタンダード	4,100	1,892.00	7,757,200
コクヨ	10,500	1,529.00	16,054,500
ナカバヤシ	4,000	273.00	1,092,000
グロープライド	1,000	1,981.00	1,981,000
岡村製作所	7,000	1,042.00	7,294,000
美津濃	11,000	592.00	6,512,000
東京電力ホールディングス	171,500	450.00	77,175,000
中部電力	66,500	1,482.50	98,586,250
関西電力	82,500	1,531.00	126,307,500
中国電力	28,000	1,226.00	34,328,000
北陸電力	19,900	1,034.00	20,576,600
東北電力	50,400	1,568.00	79,027,200
四国電力	18,400	1,373.00	25,263,200
九州電力	44,800	1,270.00	56,896,000
北海道電力	19,400	833.00	16,160,200
沖縄電力	3,000	2,684.00	8,052,000
電源開発	16,100	2,783.00	44,806,300
エフオン	1,000	930.00	930,000
イーレックス	2,500	1,397.00	3,492,500
東京瓦斯	217,000	537.70	116,680,900
大阪瓦斯	196,000	419.50	82,222,000
東邦瓦斯	51,000	816.00	41,616,000
北海道瓦斯	5,000	274.00	1,370,000
広島ガス	4,100	360.00	1,476,000
西部瓦斯	22,000	263.00	5,786,000
静岡ガス	6,200	768.00	4,761,600
メタウォーター	1,100	3,000.00	3,300,000
SBSホールディングス	2,000	840.00	1,680,000
東武鉄道	108,000	573.00	61,884,000
相鉄ホールディングス	33,000	540.00	17,820,000
東京急行電鉄	110,000	825.00	90,750,000
京浜急行電鉄	55,000	1,346.00	74,030,000
小田急電鉄	32,600	2,197.00	71,622,200
京王電鉄	57,000	902.00	51,414,000

京成電鉄	15,200	2,739.00	41,632,800
富士急行	6,000	1,049.00	6,294,000
新京成電鉄	2,000	418.00	836,000
東日本旅客鉄道	39,000	10,310.00	402,090,000
西日本旅客鉄道	19,400	7,619.00	147,808,600
東海旅客鉄道	16,800	19,010.00	319,368,000
西武ホールディングス	27,900	2,038.00	56,860,200
鴻池運輸	2,800	1,575.00	4,410,000
西日本鉄道	25,000	484.00	12,100,000
ハマキョウレックス	1,300	2,441.00	3,173,300
サカイ引越センター	900	3,755.00	3,379,500
近鉄グループホールディングス	204,000	420.00	85,680,000
阪急阪神ホールディングス	25,500	3,805.00	97,027,500
南海電気鉄道	43,000	571.00	24,553,000
京阪ホールディングス	45,000	728.00	32,760,000
神戸電鉄	6,000	385.00	2,310,000
名古屋鉄道	74,000	522.00	38,628,000
山陽電気鉄道	7,000	598.00	4,186,000
日本通運	75,000	639.00	47,925,000
ヤマトホールディングス	36,200	2,500.50	90,518,100
山九	27,000	729.00	19,683,000
丸運	1,300	264.00	343,200
丸全昭和運輸	6,000	454.00	2,724,000
センコーグループホールディングス	9,600	758.00	7,276,800
トナミホールディングス	4,000	397.00	1,588,000
ニッコンホールディングス	6,800	2,470.00	16,796,000
日本石油輸送	100	2,601.00	260,100
福山通運	12,000	708.00	8,496,000
セイノーホールディングス	14,300	1,348.00	19,276,400
神奈川中央交通	2,000	726.00	1,452,000
日立物流	4,300	2,528.00	10,870,400
丸和運輸機関	500	2,769.00	1,384,500
C & F ロジホールディングス	2,100	1,579.00	3,315,900
九州旅客鉄道	20,000	3,600.00	72,000,000
日本郵船	172,000	219.00	37,668,000
商船三井	107,000	334.00	35,738,000
川崎汽船	78,000	290.00	22,620,000
NSユナイテッド海運	9,000	250.00	2,250,000
飯野海運	10,400	469.00	4,877,600
共栄タンカー	2,000	233.00	466,000
乾汽船	1,400	955.00	1,337,000
日本航空	35,400	3,407.00	120,607,800

ANAホールディングス	376,000	338.20	127,163,200
パスコ	2,000	366.00	732,000
トランコム	600	5,890.00	3,534,000
日新	8,000	400.00	3,200,000
三菱倉庫	13,000	1,451.00	18,863,000
三井倉庫ホールディングス	12,000	324.00	3,888,000
住友倉庫	15,000	697.00	10,455,000
澁澤倉庫	5,000	359.00	1,795,000
東陽倉庫	3,600	313.00	1,126,800
日本トランスシティ	4,000	495.00	1,980,000
ケイヒン	4,000	160.00	640,000
中央倉庫	1,000	1,093.00	1,093,000
安田倉庫	1,700	742.00	1,261,400
東洋埠頭	6,000	179.00	1,074,000
宇徳	1,600	416.00	665,600
上組	24,000	1,053.00	25,272,000
サンリツ	800	511.00	408,800
キムラユニティー	500	1,189.00	594,500
キューソー流通システム	600	2,689.00	1,613,400
郵船ロジスティクス	2,000	1,124.00	2,248,000
近鉄エクスプレス	3,700	1,815.00	6,715,500
東海運	1,600	464.00	742,400
エーアイティー	1,200	1,039.00	1,246,800
内外トランスライン	600	1,172.00	703,200
NECネットエスアイ	2,200	2,418.00	5,319,600
システナ	1,600	1,950.00	3,120,000
デジタルアーツ	900	3,255.00	2,929,500
新日鉄住金ソリューションズ	3,300	2,528.00	8,342,400
キューブシステム	1,200	753.00	903,600
コア	900	1,339.00	1,205,100
ソフトクリエイトホールディングス	1,000	1,411.00	1,411,000
T I S	6,600	2,944.00	19,430,400
ネオス	600	448.00	268,800
電算システム	700	1,706.00	1,194,200
グリー	12,200	849.00	10,357,800
コーエーテクモホールディングス	4,700	2,219.00	10,429,300
三菱総合研究所	900	3,180.00	2,862,000
ボルテージ	400	1,452.00	580,800
電算	200	2,243.00	448,600
A G S	500	1,898.00	949,000
ファインデックス	1,500	1,021.00	1,531,500
ヒト・コミュニケーションズ	500	1,790.00	895,000

ブレインパッド	500	1,113.00	556,500
K L a b	3,900	905.00	3,529,500
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,500	1,450.00	2,175,000
イーブックイニシアティブジャパン	300	1,298.00	389,400
ネクソン	21,900	2,015.00	44,128,500
アイスタイル	4,200	1,035.00	4,347,000
エムアップ	600	845.00	507,000
エイチーム	1,300	2,891.00	3,758,300
テクノスジャパン	1,500	1,053.00	1,579,500
コロブラ	6,400	1,049.00	6,713,600
モバイルクリエイト	1,600	369.00	590,400
ブロードリーフ	5,000	731.00	3,655,000
ハーツユナイテッドグループ	1,100	1,453.00	1,598,300
メディアドゥ	600	2,748.00	1,648,800
ブイキューブ	1,200	593.00	711,600
サイバーリンクス	300	1,056.00	316,800
ディー・エル・イー	1,000	581.00	581,000
フィックスターズ	300	2,894.00	868,200
VOYAGE GROUP	1,000	2,323.00	2,323,000
オプティム	400	2,890.00	1,156,000
セレス	500	1,498.00	749,000
ベリサーブ	200	3,035.00	607,000
ティーガイア	2,000	1,942.00	3,884,000
豆蔵ホールディングス	1,500	894.00	1,341,000
テクマトリックス	1,300	1,512.00	1,965,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41,900	266.00	11,145,400
GMOペイメントゲートウェイ	1,400	5,640.00	7,896,000
ザッパラス	1,200	508.00	609,600
システムリサーチ	200	2,042.00	408,400
インターネットイニシアティブ	3,000	2,106.00	6,318,000
さくらインターネット	1,600	855.00	1,368,000
GMOクラウド	500	2,245.00	1,122,500
SRAホールディングス	1,000	3,040.00	3,040,000
Minorityソリューションズ	400	1,356.00	542,400
朝日ネット	1,800	520.00	936,000
アドソル日進	600	1,279.00	767,400
フリービット	1,500	943.00	1,414,500
コムチュア	300	3,985.00	1,195,500
サイバーコム	400	984.00	393,600
メディカル・データ・ビジョン	600	1,898.00	1,138,800
gumi	2,300	1,104.00	2,539,200

ショーケース・ティービー	300	1,279.00	383,700
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	300	1,939.00	581,700
P C Iホールディングス	300	2,593.00	777,900
パイブドHD	400	1,057.00	422,800
アイビーシー	200	928.00	185,600
オーブンドア	300	3,125.00	937,500
L I N E	4,500	3,735.00	16,807,500
A O I T Y O H o l d i n g s	1,700	831.00	1,412,700
ソルクシーズ	1,100	570.00	627,000
フェイス	600	1,209.00	725,400
ハイマックス	200	1,541.00	308,200
野村総合研究所	14,900	4,050.00	60,345,000
サイバネットシステム	1,700	736.00	1,251,200
C Eホールディングス	300	1,052.00	315,600
インテージホールディングス	1,100	2,180.00	2,398,000
東邦システムサイエンス	600	676.00	405,600
ソースネクスト	1,200	551.00	661,200
フォーカスシステムズ	1,200	541.00	649,200
クレスコ	500	2,992.00	1,496,000
フジ・メディア・ホールディングス	20,800	1,644.00	34,195,200
オービック	6,900	6,280.00	43,332,000
ジャストシステム	3,200	1,403.00	4,489,600
T D Cソフトウェアエンジニアリング	900	1,309.00	1,178,100
ヤフー	143,100	480.00	68,688,000
トレンドマイクロ	10,600	5,130.00	54,378,000
インフォメーション・ディベロプメント	600	1,268.00	760,800
日本オラクル	3,200	6,710.00	21,472,000
アルファシステムズ	600	1,988.00	1,192,800
フューチャー	2,700	873.00	2,357,100
C A C H o l d i n g s	1,500	1,119.00	1,678,500
ソフトバンク・テクノロジー	500	4,025.00	2,012,500
トーセ	500	853.00	426,500
オービックビジネスコンサルタント	1,000	5,500.00	5,500,000
伊藤忠テクノソリューションズ	4,500	3,590.00	16,155,000
アイティフォー	2,600	581.00	1,510,600
東計電算	300	2,344.00	703,200
エクスネット	400	926.00	370,400
大塚商会	5,400	6,530.00	35,262,000
サイボウズ	2,700	456.00	1,231,200
ソフトブレーン	2,800	525.00	1,470,000
電通国際情報サービス	1,200	2,432.00	2,918,400
デジタルガレージ	3,900	2,392.00	9,328,800

EMシステムズ	700	1,886.00	1,320,200
ウェザーニューズ	700	3,850.00	2,695,000
CIJ	1,700	567.00	963,900
東洋ビジネスエンジニアリング	200	1,668.00	333,600
日本エンタープライズ	2,300	259.00	595,700
WOWOW	900	3,800.00	3,420,000
スカラ	1,400	842.00	1,178,800
日本コロムビア	800	698.00	558,400
イマジカ・ロボットホールディングス	1,800	746.00	1,342,800
ネットワンシステムズ	8,700	1,027.00	8,934,900
システムソフト	5,200	140.00	728,000
アルゴグラフィックス	900	2,639.00	2,375,100
マーベラス	3,400	938.00	3,189,200
エイベックス・グループ・ホールディングス	3,700	1,690.00	6,253,000
日本ユニシス	5,500	1,650.00	9,075,000
兼松エレクトロニクス	1,200	3,400.00	4,080,000
東京放送ホールディングス	13,200	2,044.00	26,980,800
日本テレビホールディングス	18,200	1,932.00	35,162,400
朝日放送	1,900	780.00	1,482,000
テレビ朝日ホールディングス	5,500	2,113.00	11,621,500
スカパーJ S A Tホールディングス	13,100	536.00	7,021,600
テレビ東京ホールディングス	1,600	2,544.00	4,070,400
日本BS放送	700	1,150.00	805,000
ビジョン	300	3,945.00	1,183,500
U - N E X T	600	994.00	596,400
ワイヤレスゲート	900	1,430.00	1,287,000
コネクシオ	1,700	1,834.00	3,117,800
日本通信	16,800	177.00	2,973,600
クロップス	600	615.00	369,000
日本電信電話	160,000	4,980.00	796,800,000
K D D I	197,300	3,015.00	594,859,500
光通信	2,400	10,880.00	26,112,000
N T T ドコモ	146,500	2,707.50	396,648,750
エムティーアイ	2,700	640.00	1,728,000
G M O インターネット	7,300	1,391.00	10,154,300
アイドママーケティングコミュニケーション	300	728.00	218,400
カドカワ	5,800	1,576.00	9,140,800
学研ホールディングス	700	3,140.00	2,198,000
ゼンリン	2,700	2,178.00	5,880,600
昭文社	1,200	740.00	888,000
インプレスホールディングス	1,900	137.00	260,300

アイネット	1,100	1,336.00	1,469,600
松竹	13,000	1,308.00	17,004,000
東宝	13,100	3,260.00	42,706,000
東映	7,000	1,014.00	7,098,000
エヌ・ティ・ティ・データ	12,300	5,610.00	69,003,000
ピー・シー・エー	300	1,500.00	450,000
ビジネスブレイン太田昭和	300	1,052.00	315,600
D T S	2,100	3,030.00	6,363,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,700	3,500.00	26,950,000
シーイーシー	1,200	2,227.00	2,672,400
カプコン	4,700	2,488.00	11,693,600
アイ・エス・ビー	500	1,083.00	541,500
ジャステック	1,200	1,227.00	1,472,400
S C S K	5,400	4,735.00	25,569,000
日本システムウエア	700	1,603.00	1,122,100
アイネス	2,600	1,117.00	2,904,200
T K C	1,800	3,125.00	5,625,000
富士ソフト	3,000	3,045.00	9,135,000
N S D	4,200	1,825.00	7,665,000
コナミホールディングス	9,000	4,850.00	43,650,000
福井コンピュータホールディングス	600	2,958.00	1,774,800
J B C C ホールディングス	1,700	859.00	1,460,300
ミロク情報サービス	2,000	2,193.00	4,386,000
ソフトバンクグループ	89,800	8,620.00	774,076,000
ハウスイ	4,000	122.00	488,000
高千穂交易	800	1,032.00	825,600
伊藤忠食品	500	4,800.00	2,400,000
エレマテック	800	1,853.00	1,482,400
J A L U X	600	2,716.00	1,629,600
あらた	900	3,145.00	2,830,500
トーメンデバイス	400	2,243.00	897,200
東京エレクトロン デバイス	800	1,635.00	1,308,000
フィールズ	1,500	1,244.00	1,866,000
双日	118,200	294.00	34,750,800
アルフレッサ ホールディングス	23,600	2,102.00	49,607,200
横浜冷凍	4,900	1,139.00	5,581,100
山下医科器械	200	1,799.00	359,800
ラサ商事	1,000	795.00	795,000
ラクーン	1,400	523.00	732,200
アルコニックス	1,100	1,994.00	2,193,400
神戸物産	1,100	4,205.00	4,625,500
あい ホールディングス	2,800	2,877.00	8,055,600

ディーブイエックス	700	1,410.00	987,000
ダイワボウホールディングス	17,000	394.00	6,698,000
マクニカ・富士エレホールディングス	3,700	1,805.00	6,678,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,800	1,005.00	3,819,000
八洲電機	1,500	668.00	1,002,000
メディアスホールディングス	300	2,825.00	847,500
U K Cホールディングス	1,300	2,183.00	2,837,900
O C H Iホールディングス	600	1,348.00	808,800
T O K A Iホールディングス	8,800	883.00	7,770,400
大阪工機	300	750.00	225,000
三洋貿易	1,100	2,142.00	2,356,200
ビューティガレージ	300	1,594.00	478,200
ウイン・パートナーズ	1,400	1,009.00	1,412,600
ミタチ産業	500	681.00	340,500
シップヘルスケアホールディングス	3,800	3,075.00	11,685,000
明治電機工業	600	1,299.00	779,400
デリカフーズ	500	1,148.00	574,000
スターティア	500	529.00	264,500
コメダホールディングス	3,700	1,899.00	7,026,300
富士興産	900	498.00	448,200
協栄産業	4,000	169.00	676,000
小野建	1,700	1,538.00	2,614,600
佐鳥電機	1,500	822.00	1,233,000
エコートレーディング	700	718.00	502,600
伯東	1,400	1,410.00	1,974,000
コンドーテック	1,600	944.00	1,510,400
中山福	1,100	858.00	943,800
ナガイレーベン	2,600	2,626.00	6,827,600
三菱食品	2,200	3,685.00	8,107,000
松田産業	1,500	1,561.00	2,341,500
第一興商	3,200	4,920.00	15,744,000
メディパルホールディングス	20,000	1,910.00	38,200,000
S P K	400	2,649.00	1,059,600
萩原電気	700	2,274.00	1,591,800
アズワン	1,500	5,370.00	8,055,000
スズデン	700	1,084.00	758,800
尾家産業	700	1,157.00	809,900
シモジマ	1,200	1,179.00	1,414,800
ドウシシャ	2,400	2,317.00	5,560,800
小津産業	500	2,261.00	1,130,500
高速	1,100	1,128.00	1,240,800
たけびし	700	1,506.00	1,054,200



黒田電気	2,700	2,344.00	6,328,800
リックス	500	1,706.00	853,000
丸文	1,800	747.00	1,344,600
ハピネット	1,700	1,888.00	3,209,600
橋本総業ホールディングス	400	1,541.00	616,400
日本ライフライン	2,300	2,944.00	6,771,200
エクセル	900	1,509.00	1,358,100
マルカキカイ	700	1,884.00	1,318,800
I D O M	5,500	604.00	3,322,000
日本エム・ディ・エム	1,600	855.00	1,368,000
進和	1,100	1,994.00	2,193,400
ダイトロン	900	1,207.00	1,086,300
シークス	1,400	4,600.00	6,440,000
田中商事	600	701.00	420,600
オーハシテクニカ	1,000	1,428.00	1,428,000
白銅	500	1,700.00	850,000
伊藤忠商事	145,900	1,640.50	239,348,950
丸紅	196,700	701.60	138,004,720
高島	4,000	204.00	816,000
長瀬産業	12,000	1,627.00	19,524,000
蝶理	1,200	2,095.00	2,514,000
豊田通商	22,200	3,650.00	81,030,000
三共生興	3,000	393.00	1,179,000
兼松	42,000	235.00	9,870,000
ツカモトコーポレーション	5,000	122.00	610,000
三井物産	180,300	1,617.00	291,545,100
日本紙パルプ商事	10,000	399.00	3,990,000
日立ハイテクノロジーズ	6,900	4,645.00	32,050,500
カメイ	2,600	1,275.00	3,315,000
東都水産	300	1,881.00	564,300
O U Gホールディングス	4,000	265.00	1,060,000
スターゼン	900	4,615.00	4,153,500
山善	7,600	1,094.00	8,314,400
椿本興業	2,000	448.00	896,000
住友商事	125,700	1,542.50	193,892,250
内田洋行	900	2,662.00	2,395,800
三菱商事	149,600	2,462.50	368,390,000
第一実業	5,000	736.00	3,680,000
キャノンマーケティングジャパン	5,700	2,437.00	13,890,900
西華産業	6,000	366.00	2,196,000
佐藤商事	1,600	904.00	1,446,400
菱洋エレクトロ	1,800	1,729.00	3,112,200

東京産業	2,200	469.00	1,031,800
ユアサ商事	1,900	3,320.00	6,308,000
神鋼商事	500	2,616.00	1,308,000
小林産業	1,800	297.00	534,600
阪和興業	20,000	823.00	16,460,000
カナデン	1,700	1,128.00	1,917,600
菱電商事	3,000	745.00	2,235,000
フルサト工業	1,000	1,728.00	1,728,000
岩谷産業	22,000	676.00	14,872,000
すてきなイスグループ	9,000	161.00	1,449,000
極東貿易	3,000	251.00	753,000
イワキ	3,000	330.00	990,000
三愛石油	5,300	995.00	5,273,500
稲畑産業	4,700	1,471.00	6,913,700
G S Iクレオス	6,000	151.00	906,000
明和産業	1,900	426.00	809,400
ワキタ	4,300	1,301.00	5,594,300
東邦ホールディングス	6,400	2,492.00	15,948,800
サンゲツ	6,800	2,021.00	13,742,800
ミツウロコグループホールディングス	3,300	731.00	2,412,300
シナネンホールディングス	800	2,247.00	1,797,600
伊藤忠エネクス	4,400	953.00	4,193,200
サンリオ	6,200	2,110.00	13,082,000
サンワテクノス	1,200	1,321.00	1,585,200
リョーサン	2,900	3,850.00	11,165,000
新光商事	2,100	1,335.00	2,803,500
トーホー	900	2,850.00	2,565,000
三信電気	2,300	1,394.00	3,206,200
東陽テクニカ	2,300	1,101.00	2,532,300
モスフードサービス	2,600	3,565.00	9,269,000
加賀電子	1,800	2,075.00	3,735,000
ソーダニッカ	2,200	524.00	1,152,800
立花エレテック	1,300	1,451.00	1,886,300
フォーバル	800	649.00	519,200
P A L T A C	3,200	3,450.00	11,040,000
三谷産業	2,200	394.00	866,800
ヤマタネ	1,000	1,577.00	1,577,000
丸紅建材リース	2,000	232.00	464,000
日鉄住金物産	1,700	4,740.00	8,058,000
トラスコ中山	4,600	2,545.00	11,707,000
オートバックスセブン	7,400	1,705.00	12,617,000
モリト	1,700	940.00	1,598,000

加藤産業	3,100	2,843.00	8,813,300
イノテック	1,800	657.00	1,182,600
イエローハット	1,900	2,647.00	5,029,300
J Kホールディングス	2,000	681.00	1,362,000
日伝	800	3,555.00	2,844,000
北沢産業	2,500	218.00	545,000
杉本商事	1,100	1,553.00	1,708,300
因幡電機産業	2,700	4,210.00	11,367,000
バイテックホールディングス	900	1,364.00	1,227,600
ミスミグループ本社	22,500	2,221.00	49,972,500
タキヒヨー	3,000	462.00	1,386,000
蔵王産業	300	1,513.00	453,900
スズケン	9,100	3,860.00	35,126,000
ジェコス	1,300	1,209.00	1,571,700
ルネサスイーストン	1,900	602.00	1,143,800
ローソン	6,300	7,510.00	47,313,000
サンエー	1,500	5,220.00	7,830,000
カワチ薬品	1,600	2,844.00	4,550,400
エービーシー・マート	3,600	6,460.00	23,256,000
ハードオフコーポレーション	800	1,070.00	856,000
アスクル	2,100	3,395.00	7,129,500
ゲオホールディングス	3,400	1,263.00	4,294,200
アダストリア	3,100	2,986.00	9,256,600
ジーフット	1,100	769.00	845,900
くらコーポレーション	1,300	4,600.00	5,980,000
キャンドウ	1,100	1,716.00	1,887,600
パルグループホールディングス	1,000	2,989.00	2,989,000
エディオン	7,800	1,103.00	8,603,400
サーラコーポレーション	2,600	653.00	1,697,800
ワッツ	800	1,274.00	1,019,200
ハローズ	700	2,365.00	1,655,500
あみやき亭	400	4,130.00	1,652,000
ひらまつ	2,800	657.00	1,839,600
ゲンキー	800	2,931.00	2,344,800
大黒天物産	500	5,600.00	2,800,000
ハニーズホールディングス	2,000	1,160.00	2,320,000
ファーマライズホールディングス	600	532.00	319,200
アルペン	1,600	2,066.00	3,305,600
クオール	2,300	1,552.00	3,569,600
ジンス	1,400	6,180.00	8,652,000
ビックカメラ	11,500	1,134.00	13,041,000
D C Mホールディングス	12,200	995.00	12,139,000

MonotaRO	7,100	3,680.00	26,128,000
東京一番フーズ	600	569.00	341,400
ダイヤモンドダイニング	500	2,319.00	1,159,500
きちり	600	663.00	397,800
アークランドサービスホールディングス	800	3,485.00	2,788,000
J.フロント リテイリング	25,300	1,684.00	42,605,200
ドトール・日レスホールディングス	3,500	2,403.00	8,410,500
マツモトキヨシホールディングス	3,800	5,810.00	22,078,000
ブロンコピリー	1,000	2,575.00	2,575,000
スタートトゥデイ	18,200	2,650.00	48,230,000
トレジャー・ファクトリー	600	782.00	469,200
物語コーポレーション	600	5,160.00	3,096,000
ココカラファイン	2,100	5,360.00	11,256,000
三越伊勢丹ホールディングス	39,800	1,269.00	50,506,200
Hamee	600	1,091.00	654,600
ウエルシアホールディングス	5,300	3,640.00	19,292,000
クリエイトSDホールディングス	2,900	2,669.00	7,740,100
丸善CHIホールディングス	2,500	353.00	882,500
ミサワ	500	426.00	213,000
ティーライフ	300	1,731.00	519,300
エー・ピーカンパニー	400	952.00	380,800
チムニー	600	2,879.00	1,727,400
シュッピン	800	1,777.00	1,421,600
ネクステージ	800	1,486.00	1,188,800
ジョイフル本田	3,200	3,825.00	12,240,000
鳥貴族	700	2,478.00	1,734,600
キリン堂ホールディングス	700	857.00	599,900
ホットランド	1,000	1,190.00	1,190,000
すかいらーく	8,600	1,726.00	14,843,600
綿半ホールディングス	800	1,862.00	1,489,600
ヨシックス	300	1,311.00	393,300
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	6,600	1,117.00	7,372,200
ブックオフコーポレーション	1,300	791.00	1,028,300
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	810.00	648,000
B E E N O S	300	1,345.00	403,500
あさひ	1,600	1,420.00	2,272,000
日本調剤	700	4,015.00	2,810,500
コスモス薬品	1,000	23,330.00	23,330,000
トーエル	1,000	908.00	908,000
一六堂	500	384.00	192,000
オンリー	400	893.00	357,200
セブン&アイ・ホールディングス	83,400	4,865.00	405,741,000

薬王堂	1,000	3,045.00	3,045,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	5,300	924.00	4,897,200
ツルハホールディングス	4,000	11,670.00	46,680,000
サンマルクホールディングス	1,300	3,445.00	4,478,500
フェリシモ	600	1,044.00	626,400
トリドールホールディングス	2,500	2,743.00	6,857,500
T O K Y O B A S E	300	3,310.00	993,000
サツドラホールディングス	300	2,171.00	651,300
ダイユー・リックホールディングス	700	766.00	536,200
パロックジャパンリミテッド	1,600	1,211.00	1,937,600
クスリのアオキホールディングス	1,600	4,865.00	7,784,000
メディカルシステムネットワーク	2,400	517.00	1,240,800
総合メディカル	1,000	4,570.00	4,570,000
はるやまホールディングス	900	996.00	896,400
ノジマ	3,100	1,748.00	5,418,800
カッパ・クリエイト	2,900	1,298.00	3,764,200
ライトオン	1,800	980.00	1,764,000
良品計画	2,600	26,590.00	69,134,000
三城ホールディングス	2,500	478.00	1,195,000
アドヴァン	2,000	1,207.00	2,414,000
アルビス	500	4,090.00	2,045,000
コナカ	2,500	610.00	1,525,000
ハウス オブ ローゼ	300	1,569.00	470,700
G - 7ホールディングス	600	2,513.00	1,507,800
イオン北海道	2,100	603.00	1,266,300
コジマ	3,900	299.00	1,166,100
ヒマラヤ	600	838.00	502,800
コーナン商事	2,900	2,251.00	6,527,900
エコス	800	1,199.00	959,200
マルシェ	700	829.00	580,300
ドンキホーテホールディングス	12,900	4,110.00	53,019,000
西松屋チェーン	3,600	1,199.00	4,316,400
ゼンショーホールディングス	10,400	1,927.00	20,040,800
幸楽苑ホールディングス	1,400	1,823.00	2,552,200
ハークスレイ	400	1,173.00	469,200
サイゼリヤ	3,000	3,255.00	9,765,000
V Tホールディングス	6,700	589.00	3,946,300
魚力	600	1,284.00	770,400
フジ・コーポレーション	300	1,992.00	597,600
ユナイテッドアローズ	2,700	3,600.00	9,720,000
ハイデイ日高	2,200	2,445.00	5,379,000
京都市もの友禅	1,200	950.00	1,140,000

コロワイド	6,700	1,862.00	12,475,400
ピーシーデポコーポレーション	2,700	572.00	1,544,400
杏番屋	1,400	3,640.00	5,096,000
トップカルチャー	900	485.00	436,500
P L A N T	400	1,221.00	488,400
スギホールディングス	4,400	5,750.00	25,300,000
ヴィア・ホールディングス	1,600	1,127.00	1,803,200
スクロール	3,200	383.00	1,225,600
ヨンドシーホールディングス	2,000	2,745.00	5,490,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	8,800	6,500.00	57,200,000
木曽路	2,500	2,652.00	6,630,000
サトレストラシステムズ	2,600	868.00	2,256,800
千趣会	3,700	822.00	3,041,400
タカキュー	1,800	196.00	352,800
ケーヨー	3,600	665.00	2,394,000
上新電機	5,000	1,233.00	6,165,000
日本瓦斯	3,700	3,190.00	11,803,000
ベスト電器	7,500	165.00	1,237,500
ロイヤルホールディングス	3,300	2,223.00	7,335,900
東天紅	2,000	174.00	348,000
いなげや	2,200	1,633.00	3,592,600
島忠	5,100	2,655.00	13,540,500
チヨダ	2,300	2,887.00	6,640,100
ライフコーポレーション	1,500	3,000.00	4,500,000
リンガーハット	2,300	2,346.00	5,395,800
M r M a x	2,600	490.00	1,274,000
テンアライド	2,600	392.00	1,019,200
A O K Iホールディングス	4,000	1,394.00	5,576,000
オークワ	3,000	1,207.00	3,621,000
コメリ	3,100	2,926.00	9,070,600
青山商事	4,100	4,010.00	16,441,000
しまむら	2,300	15,400.00	35,420,000
はせがわ	1,200	458.00	549,600
高島屋	34,000	1,078.00	36,652,000
松屋	4,400	1,034.00	4,549,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	10,300	2,001.00	20,610,300
近鉄百貨店	8,000	355.00	2,840,000
パルコ	2,000	1,207.00	2,414,000
丸井グループ	21,100	1,576.00	33,253,600
アクシアル リテイリング	1,500	4,470.00	6,705,000
イオン	82,100	1,703.50	139,857,350
イズミ	4,000	5,680.00	22,720,000

東武ストア	200	2,913.00	582,600
平和堂	4,000	2,526.00	10,104,000
フジ	2,200	2,990.00	6,578,000
ヤオコー	2,200	4,500.00	9,900,000
ゼビオホールディングス	2,800	1,922.00	5,381,600
ケーズホールディングス	8,400	2,211.00	18,572,400
Olympicグループ	1,400	572.00	800,800
日産東京販売ホールディングス	2,900	483.00	1,400,700
アインホールディングス	2,600	8,090.00	21,034,000
元気寿司	500	2,218.00	1,109,000
ヤマダ電機	66,800	590.00	39,412,000
アークランドサカモト	3,300	1,463.00	4,827,900
ニトリホールディングス	8,600	14,790.00	127,194,000
グルメ杵屋	1,000	1,085.00	1,085,000
愛眼	2,900	198.00	574,200
ケーユーホールディングス	900	992.00	892,800
吉野家ホールディングス	7,100	1,845.00	13,099,500
松屋フーズ	1,000	4,435.00	4,435,000
サガミチェーン	2,500	1,398.00	3,495,000
関西スーパーマーケット	1,700	1,611.00	2,738,700
王将フードサービス	1,500	4,320.00	6,480,000
プレナス	2,200	2,364.00	5,200,800
ミニストップ	1,600	2,220.00	3,552,000
アークス	3,700	2,451.00	9,068,700
パローホールディングス	4,300	2,816.00	12,108,800
藤久	200	1,746.00	349,200
ベルク	900	5,290.00	4,761,000
大庄	1,200	1,619.00	1,942,800
ファーストリテイリング	3,300	37,590.00	124,047,000
サンドラッグ	7,600	4,090.00	31,084,000
サックスパーホールディングス	1,900	1,317.00	2,502,300
ヤマザワ	400	1,789.00	715,600
やまや	400	1,654.00	661,600
ベルーナ	4,300	1,076.00	4,626,800
島根銀行	400	1,367.00	546,800
じもとホールディングス	14,300	203.00	2,902,900
めぶきフィナンシャルグループ	96,200	463.00	44,540,600
東京ＴＹフィナンシャルグループ	2,900	3,440.00	9,976,000
九州フィナンシャルグループ	32,800	734.00	24,075,200
ゆうちょ銀行	56,400	1,427.00	80,482,800
富山第一銀行	5,000	552.00	2,760,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	129,400	542.30	70,173,620

西日本フィナンシャルホールディングス	13,700	1,141.00	15,631,700
新生銀行	190,000	214.00	40,660,000
あおぞら銀行	126,000	417.00	52,542,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,511,700	734.30	1,110,041,310
りそなホールディングス	233,400	616.30	143,844,420
三井住友トラスト・ホールディングス	41,600	4,015.00	167,024,000
三井住友フィナンシャルグループ	159,600	4,241.00	676,863,600
第四銀行	24,000	467.00	11,208,000
北越銀行	2,100	2,956.00	6,207,600
千葉銀行	77,000	773.00	59,521,000
群馬銀行	44,900	625.00	28,062,500
武蔵野銀行	3,200	3,485.00	11,152,000
千葉興業銀行	5,600	669.00	3,746,400
筑波銀行	8,500	327.00	2,779,500
七十七銀行	32,000	503.00	16,096,000
青森銀行	15,000	400.00	6,000,000
秋田銀行	13,000	366.00	4,758,000
山形銀行	11,000	509.00	5,599,000
岩手銀行	1,300	4,700.00	6,110,000
東邦銀行	18,000	425.00	7,650,000
東北銀行	10,000	157.00	1,570,000
みちのく銀行	13,000	189.00	2,457,000
ふくおかフィナンシャルグループ	81,000	531.00	43,011,000
静岡銀行	53,000	970.00	51,410,000
十六銀行	27,000	372.00	10,044,000
スルガ銀行	20,400	2,416.00	49,286,400
八十二銀行	38,900	673.00	26,179,700
山梨中央銀行	12,000	517.00	6,204,000
大垣共立銀行	31,000	335.00	10,385,000
福井銀行	17,000	288.00	4,896,000
北國銀行	21,000	438.00	9,198,000
清水銀行	700	3,675.00	2,572,500
富山銀行	400	4,535.00	1,814,000
滋賀銀行	19,000	602.00	11,438,000
南都銀行	1,900	4,420.00	8,398,000
百五銀行	18,000	471.00	8,478,000
京都銀行	36,000	908.00	32,688,000
紀陽銀行	7,500	1,823.00	13,672,500
三重銀行	900	2,387.00	2,148,300
ほくほくフィナンシャルグループ	13,300	1,848.00	24,578,400
広島銀行	59,000	501.00	29,559,000
山陰合同銀行	12,000	933.00	11,196,000



中国銀行	14,300	1,720.00	24,596,000
鳥取銀行	600	1,778.00	1,066,800
伊予銀行	29,000	806.00	23,374,000
百十四銀行	22,000	389.00	8,558,000
四国銀行	15,000	351.00	5,265,000
阿波銀行	17,000	773.00	13,141,000
大分銀行	11,000	449.00	4,939,000
宮崎銀行	13,000	366.00	4,758,000
佐賀銀行	12,000	305.00	3,660,000
十八銀行	12,000	349.00	4,188,000
沖縄銀行	1,900	4,500.00	8,550,000
琉球銀行	4,100	1,643.00	6,736,300
セブン銀行	74,900	380.00	28,462,000
みずほフィナンシャルグループ	2,708,400	209.90	568,493,160
高知銀行	7,000	129.00	903,000
山口フィナンシャルグループ	19,000	1,277.00	24,263,000
長野銀行	600	2,022.00	1,213,200
名古屋銀行	1,600	4,320.00	6,912,000
北洋銀行	32,700	438.00	14,322,600
愛知銀行	700	6,530.00	4,571,000
第三銀行	1,100	1,754.00	1,929,400
中京銀行	800	2,378.00	1,902,400
大光銀行	7,000	258.00	1,806,000
愛媛銀行	2,600	1,411.00	3,668,600
トマト銀行	700	1,643.00	1,150,100
みなと銀行	1,800	2,217.00	3,990,600
京葉銀行	16,000	502.00	8,032,000
関西アーバン銀行	2,800	1,443.00	4,040,400
栃木銀行	11,100	566.00	6,282,600
北日本銀行	600	3,335.00	2,001,000
東和銀行	38,000	121.00	4,598,000
大東銀行	11,000	169.00	1,859,000
トモニホールディングス	16,600	621.00	10,308,600
フィデアホールディングス	19,700	221.00	4,353,700
池田泉州ホールディングス	21,200	493.00	10,451,600
F P G	7,100	1,042.00	7,398,200
S B Iホールディングス	22,600	1,541.00	34,826,600
ジャフコ	3,300	4,255.00	14,041,500
大和証券グループ本社	181,000	694.20	125,650,200
野村ホールディングス	408,700	708.70	289,645,690
岡三証券グループ	17,000	681.00	11,577,000
丸三証券	6,400	900.00	5,760,000

東洋証券	8,000	271.00	2,168,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	22,900	597.00	13,671,300
光世証券	6,000	172.00	1,032,000
水戸証券	6,500	316.00	2,054,000
いちよし証券	4,500	941.00	4,234,500
松井証券	11,500	922.00	10,603,000
だいこう証券ビジネス	1,100	651.00	716,100
マネックスグループ	21,700	293.00	6,358,100
カブドットコム証券	15,100	363.00	5,481,300
極東証券	2,700	1,713.00	4,625,100
岩井コスモホールディングス	1,900	1,100.00	2,090,000
藍澤證券	3,700	680.00	2,516,000
マネーパートナーズグループ	2,600	502.00	1,305,200
かんぼ生命保険	7,600	2,601.00	19,767,600
S O M P Oホールディングス	41,700	4,426.00	184,564,200
アニコム ホールディングス	1,400	2,692.00	3,768,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	59,600	3,778.00	225,168,800
ソニーフィナンシャルホールディングス	19,200	1,848.00	35,481,600
第一生命ホールディングス	120,300	2,001.50	240,780,450
東京海上ホールディングス	80,200	4,870.00	390,574,000
T & Dホールディングス	72,800	1,722.00	125,361,600
アドバンスクリエイト	500	2,003.00	1,001,500
全国保証	5,600	4,120.00	23,072,000
クレディセゾン	15,200	2,110.00	32,072,000
アクリーティブ	1,700	373.00	634,100
芙蓉総合リース	2,300	5,220.00	12,006,000
興銀リース	3,800	2,483.00	9,435,400
東京センチュリー	4,000	3,970.00	15,880,000
日本証券金融	8,800	614.00	5,403,200
アイフル	33,600	345.00	11,592,000
ポケットカード	1,600	690.00	1,104,000
リコーリース	1,600	3,680.00	5,888,000
イオンフィナンシャルサービス	12,700	2,191.00	27,825,700
アコム	40,200	503.00	20,220,600
ジャックス	11,000	485.00	5,335,000
オリエントコーポレーション	43,300	204.00	8,833,200
日立キャピタル	4,700	2,804.00	13,178,800
アプラスフィナンシャル	10,000	112.00	1,120,000
オリックス	141,100	1,757.00	247,912,700
三菱UFJリース	50,700	605.00	30,673,500
日本取引所グループ	62,000	1,644.00	101,928,000

イー・ギャランティ	600	2,501.00	1,500,600
アサックス	300	1,643.00	492,900
NECキャピタルソリューション	800	1,801.00	1,440,800
いちご	19,000	330.00	6,270,000
日本駐車場開発	24,100	151.00	3,639,100
ヒューリック	41,600	1,079.00	44,886,400
三栄建築設計	800	1,567.00	1,253,600
野村不動産ホールディングス	13,300	1,999.00	26,586,700
三重交通グループホールディングス	3,700	381.00	1,409,700
サムティ	1,600	1,139.00	1,822,400
ディア・ライフ	1,700	388.00	659,600
日本商業開発	1,100	1,913.00	2,104,300
プレサンスコーポレーション	3,100	1,368.00	4,240,800
ユニゾホールディングス	1,700	3,080.00	5,236,000
THEグローバル社	1,000	579.00	579,000
日本管理センター	1,400	1,338.00	1,873,200
サンセイランディック	400	782.00	312,800
エストラスト	500	680.00	340,000
フージャースホールディングス	2,600	681.00	1,770,600
オープンハウス	3,200	2,887.00	9,238,400
東急不動産ホールディングス	48,800	633.00	30,890,400
飯田グループホールディングス	16,600	1,829.00	30,361,400
ムゲンエステート	1,000	850.00	850,000
ファーストブラザーズ	300	1,512.00	453,600
ハウスドゥ	300	1,872.00	561,600
シーアールイー	300	1,628.00	488,400
ケイアイスター不動産	500	1,631.00	815,500
パーク24	10,100	2,953.00	29,825,300
パラカ	600	2,236.00	1,341,600
三井不動産	105,700	2,604.00	275,242,800
三菱地所	148,400	2,278.50	338,129,400
平和不動産	3,900	1,850.00	7,215,000
東京建物	23,200	1,575.00	36,540,000
ダイビル	5,300	1,138.00	6,031,400
京阪神ビルディング	3,400	670.00	2,278,000
住友不動産	48,000	3,171.00	152,208,000
大京	37,000	240.00	8,880,000
テーオーシー	7,700	1,074.00	8,269,800
東京楽天地	3,000	538.00	1,614,000
レオパレス21	25,200	608.00	15,321,600
スターツコーポレーション	2,700	2,553.00	6,893,100
フジ住宅	2,600	740.00	1,924,000

空港施設	2,500	612.00	1,530,000
明和地所	1,200	742.00	890,400
住友不動産販売	1,800	3,895.00	7,011,000
ゴールドクレスト	1,800	2,064.00	3,715,200
日本エスリード	800	1,488.00	1,190,400
日神不動産	2,400	639.00	1,533,600
日本エスコン	3,500	404.00	1,414,000
タカラレーベン	8,600	551.00	4,738,600
サンヨーハウジング名古屋	1,000	1,032.00	1,032,000
イオンモール	12,900	2,040.00	26,316,000
ファースト住建	700	1,478.00	1,034,600
トーセイ	2,800	807.00	2,259,600
穴吹興産	200	2,763.00	552,600
エヌ・ティ・ティ都市開発	12,600	1,033.00	13,015,800
サンフロンティア不動産	2,100	1,015.00	2,131,500
エフ・ジェー・ネクスト	1,700	997.00	1,694,900
インテリックス	600	858.00	514,800
グランディハウス	1,700	423.00	719,100
日本空港ビルデング	6,400	4,035.00	25,824,000
日本工営	1,400	3,055.00	4,277,000
L i f u l l	5,200	796.00	4,139,200
ジェイエシーリクルートメント	1,300	1,709.00	2,221,700
日本M & Aセンター	6,100	4,020.00	24,522,000
中広	200	738.00	147,600
タケエイ	1,900	1,025.00	1,947,500
トラスト・テック	800	2,026.00	1,620,800
コシダカホールディングス	1,000	2,720.00	2,720,000
パソナグループ	1,700	873.00	1,484,100
C D S	500	1,138.00	569,000
リンクアンドモチベーション	5,000	716.00	3,580,000
G C A	1,900	941.00	1,787,900
エス・エム・エス	3,000	3,020.00	9,060,000
テンブホールディングス	16,300	2,188.00	35,664,400
リニカル	1,300	1,489.00	1,935,700
クックパッド	4,700	912.00	4,286,400
エスクリ	800	798.00	638,400
アイ・ケイ・ケイ	1,000	780.00	780,000
学情	900	1,346.00	1,211,400
スタジオアリス	900	2,400.00	2,160,000
シミックホールディングス	1,100	1,468.00	1,614,800
N J S	500	1,394.00	697,000
総合警備保障	7,700	4,995.00	38,461,500

カカココム	15,100	1,651.00	24,930,100
アイロムグループ	700	1,300.00	910,000
セントケア・ホールディング	300	1,587.00	476,100
サイネックス	200	1,145.00	229,000
ルネサンス	1,100	1,899.00	2,088,900
ディップ	2,700	2,481.00	6,698,700
オプトホールディング	1,600	1,348.00	2,156,800
ツクイ	5,100	623.00	3,177,300
キャリアデザインセンター	400	1,183.00	473,200
エムスリー	18,300	2,945.00	53,893,500
ツカダ・グローバルホールディング	1,600	579.00	926,400
アウトソーシング	1,400	4,365.00	6,111,000
ウェルネット	1,600	1,470.00	2,352,000
ワールドホールディングス	600	2,198.00	1,318,800
ディー・エヌ・エー	9,500	2,459.00	23,360,500
博報堂DYホールディングス	29,200	1,421.00	41,493,200
ぐるなび	3,100	2,283.00	7,077,300
エスアールジータカミヤ	2,300	560.00	1,288,000
ジャパンベストレスキューシステム	2,500	274.00	685,000
ファンコミュニケーションズ	5,400	924.00	4,989,600
ライク	400	2,645.00	1,058,000
ビジネス・ブレークスルー	1,000	390.00	390,000
WDBホールディングス	800	1,597.00	1,277,600
ティア	1,100	795.00	874,500
CDG	200	1,832.00	366,400
バリューコマース	2,000	587.00	1,174,000
インフォマート	9,000	717.00	6,453,000
JPホールディングス	6,300	310.00	1,953,000
EPSホールディングス	2,900	1,672.00	4,848,800
レッグス	500	767.00	383,500
プレステージ・インターナショナル	4,000	1,042.00	4,168,000
アミューズ	1,200	2,542.00	3,050,400
ドリームインキュベータ	700	2,170.00	1,519,000
クイック	1,100	1,334.00	1,467,400
ケネディクス	26,900	527.00	14,176,300
電通	23,500	6,530.00	153,455,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,100	946.00	1,040,600
ぴあ	600	2,979.00	1,787,400
イオンファンタジー	600	3,035.00	1,821,000
シーティーエス	1,100	785.00	863,500
ネクシィーズグループ	800	1,533.00	1,226,400
みらかホールディングス	5,400	5,330.00	28,782,000

アルプス技研	800	3,745.00	2,996,000
ダイオーズ	400	1,065.00	426,000
日本空調サービス	1,900	694.00	1,318,600
オリエンタルランド	22,800	6,698.00	152,714,400
ダスキン	5,200	2,599.00	13,514,800
明光ネットワークジャパン	2,500	1,457.00	3,642,500
ファルコホールディングス	1,000	1,583.00	1,583,000
ラウンドワン	6,700	951.00	6,371,700
リゾートトラスト	8,200	1,968.00	16,137,600
ビー・エム・エル	2,800	2,512.00	7,033,600
ワタベウェディング	500	673.00	336,500
りらいあコミュニケーションズ	3,600	1,120.00	4,032,000
リソー教育	3,600	795.00	2,862,000
早稲田アカデミー	300	1,259.00	377,700
ユー・エス・エス	25,500	2,036.00	51,918,000
東京個別指導学院	700	1,344.00	940,800
サイバーエージェント	12,700	3,500.00	44,450,000
楽天	108,000	1,150.00	124,200,000
クリーク・アンド・リバー社	1,100	1,006.00	1,106,600
テー・オー・ダブリュー	1,700	787.00	1,337,900
セントラルスポーツ	700	3,415.00	2,390,500
フルキャストホールディングス	2,200	1,119.00	2,461,800
リソルホールディングス	2,000	349.00	698,000
テクノプロ・ホールディングス	3,400	4,340.00	14,756,000
アトラ	300	643.00	192,900
インターワークス	400	1,133.00	453,200
Keep 技研	300	1,949.00	584,700
ファーストロジック	200	2,494.00	498,800
デザインワン・ジャパン	400	1,421.00	568,400
イー・ガーディアン	1,000	1,810.00	1,810,000
リブセンス	1,500	505.00	757,500
ジャパンマテリアル	1,500	1,850.00	2,775,000
ベクトル	1,700	1,568.00	2,665,600
ウチヤマホールディングス	1,100	455.00	500,500
サクセスホールディングス	200	1,560.00	312,000
キャリアリンク	500	584.00	292,000
IBJ	1,700	591.00	1,004,700
アサンテ	800	1,747.00	1,397,600
N・フィールド	1,000	1,359.00	1,359,000
バリューHR	200	2,855.00	571,000
M&Aキャピタルパートナーズ	400	4,785.00	1,914,000
ライドオン・エクスプレス	600	886.00	531,600

ERIホールディングス	600	862.00	517,200
アビスト	300	3,935.00	1,180,500
ウィルグループ	900	845.00	760,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	500	1,952.00	976,000
日本ビューホテル	500	1,384.00	692,000
リクルートホールディングス	46,100	5,960.00	274,756,000
エラン	300	2,035.00	610,500
土木管理総合試験所	300	695.00	208,500
日本郵政	55,000	1,409.00	77,495,000
ベルシステム24ホールディングス	3,300	1,092.00	3,603,600
一蔵	200	1,154.00	230,800
LITALICO	300	1,672.00	501,600
エボラブルアジア	400	2,845.00	1,138,000
ソラスト	1,400	1,529.00	2,140,600
リログループ	10,600	2,001.00	21,210,600
東祥	600	4,865.00	2,919,000
エイチ・アイ・エス	3,500	2,780.00	9,730,000
ラックランド	400	2,088.00	835,200
共立メンテナンス	3,500	3,345.00	11,707,500
イチネンホールディングス	2,100	1,195.00	2,509,500
建設技術研究所	1,300	1,164.00	1,513,200
スペース	1,000	1,437.00	1,437,000
燦ホールディングス	400	1,729.00	691,600
スバル興業	1,000	492.00	492,000
東京テアトル	10,000	149.00	1,490,000
タナベ経営	400	1,368.00	547,200
ナガワ	400	3,980.00	1,592,000
よみうりランド	4,000	442.00	1,768,000
東京都競馬	15,000	261.00	3,915,000
常磐興産	900	1,773.00	1,595,700
カナモト	3,000	3,110.00	9,330,000
東京ドーム	8,600	1,049.00	9,021,400
西尾レントオール	1,700	3,500.00	5,950,000
トランス・コスモス	2,400	2,534.00	6,081,600
乃村工藝社	4,500	2,210.00	9,945,000
藤田観光	7,000	359.00	2,513,000
KNT-CTホールディングス	12,000	146.00	1,752,000
日本管財	1,800	1,920.00	3,456,000
トーカイ	900	4,275.00	3,847,500
白洋舎	200	2,948.00	589,600
セコム	21,900	8,485.00	185,821,500
セントラル警備保障	1,000	1,844.00	1,844,000

	丹青社	3,600	1,101.00	3,963,600	
	メイテック	2,400	5,000.00	12,000,000	
	アサツー ディ・ケイ	3,500	2,995.00	10,482,500	
	応用地質	2,000	1,449.00	2,898,000	
	船井総研ホールディングス	2,600	2,249.00	5,847,400	
	進学会	1,000	586.00	586,000	
	オオバ	1,700	526.00	894,200	
	いであ	400	1,160.00	464,000	
	学究社	500	1,602.00	801,000	
	ベネッセホールディングス	7,100	3,560.00	25,276,000	
	イオンディライト	2,400	3,540.00	8,496,000	
	ナック	1,300	978.00	1,271,400	
	ニチイ学館	3,800	881.00	3,347,800	
	ダイセキ	3,700	2,549.00	9,431,300	
	ステップ	700	1,488.00	1,041,600	
小計	銘柄数：1,944 組入時価比率：97.2%	30,376,653		46,777,512,321	100.0%
合計		30,376,653		46,777,512,321	

（注1）比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## (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」に記載しております。

## MHAM外国株式インデックスマザーファンド

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

（単位：円）

（平成29年 5月 8日現在）

### 資産の部

#### 流動資産



(平成29年 5月 8日現在)

預金	739,639,147
コール・ローン	38,605,123
株式	32,182,164,284
投資信託受益証券	10,712,377
投資証券	847,296,300
派生商品評価勘定	17,361,870
未収入金	513,974
未収配当金	55,848,918
前払金	92,738,072
差入委託証拠金	49,245,025
流動資産合計	34,034,125,090
資産合計	34,034,125,090
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	707,654
未払解約金	23,234,212
未払利息	85
流動負債合計	23,941,951
負債合計	23,941,951
純資産の部	
元本等	
元本	20,537,714,304
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	13,472,468,835
元本等合計	34,010,183,139
純資産合計	34,010,183,139
負債純資産合計	34,034,125,090

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	(自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資信託受益証券、投資証券  原則として時価で評価しております。
2 派生商品等の評価基準及び評価方法	先物取引  原則として時価で評価しております。
3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は計算期間末日に残高がある場合、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
4 収益・費用の計上基準	受取配当金

項目	(自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)
	<p>受取配当金は、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。</p> <p>有価証券売買等損益、派生商品取引等損益及び為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成29年 5月 8日現在)
1 計算期間末日における受益権の総数	20,537,714,304口
2 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産の額 1.6560円
	(1万口当たり純資産の額) (16,560円)

## (金融商品に関する注記)

## 1.金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)
1 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。</p>
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>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。</p> <p>なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。</p> <p>これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>当ファンドは信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っており、当該デリバティブ取引は対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>また、外貨建証券の売買等の決済に伴い必要となる外貨の売買のために、為替予約取引を行っております。</p>

項目	(自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>
4 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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る場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、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。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年 5月 8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	<p>貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>株式、投資信託受益証券、投資証券</p> <p>わが国の金融商品取引所または海外取引所に上場されている有価証券 当該有価証券については、原則として上記の取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できない場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p>

項目	(平成29年 5月 8日現在)
	先物取引  デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務  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、時価は帳簿価額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。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

(自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	4,710,048,978
投資信託受益証券	790,841
投資証券	11,943,645
合計	4,698,896,174

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 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)

(平成29年 5月 8日現在)

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	940,916,788	-	957,571,004	16,654,216
	合計	940,916,788	-	957,571,004	16,654,216

## (注) 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については、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により評価しております。

## (その他の注記)

項目	期別
	(平成29年 5月 8日現在)
期首	平成28年 5月10日
親投資信託の期首における元本額	30,025,705,147円
期中追加設定元本額	9,128,794,713円
期中一部解約元本額	18,616,785,556円
期末元本額及びその内訳として当該親投資信託受益証券を投資対象とする委託者指図型投資信託ごとの元本額	
期末元本額	20,537,714,304円
動的パッケージファンド<DC年金>	18,583,164円
コア資産形成ファンド	18,848,969円
MHAM外国株式インデックスファンド(ファンドラップ)	13,737,267,753円
MHAM 外国株式インデックス・ラップ	29,538,353円
MHAM外国株式インデックスファンド	287,250,630円
MHAM外国株式インデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ)	33,502,818円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	4,796,958,192円
MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,615,764,425円

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

(平成29年 5月 8日現在)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米・ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	5,026	52.59	264,317.34	
	ANTERO RESOURCES CORP	1,418	21.25	30,132.50	
	APACHE CORPORATION	3,352	49.29	165,220.08	
	BAKER HUGHES INC	3,538	59.33	209,909.54	
	CABOT OIL & GAS CORP	3,897	24.17	94,190.49	
	CHENIERE ENERGY INC	1,716	46.82	80,343.12	
	CHEVRON CORP	16,578	105.79	1,753,786.62	
	CIMAREX ENERGY CO	814	120.30	97,924.20	
	CONCHO RESOURCES INC	1,263	129.57	163,646.91	
	CONOCOPHILLIPS	10,858	46.77	507,828.66	
	CONTINENTAL RESOURCES INC	803	41.34	33,196.02	
	CORE LABORATORIES N.V.	411	113.43	46,619.73	

DEVON ENERGY CORPORATION	4,192	38.02	159,379.84
DIAMONDBACK ENERGY INC	748	99.65	74,538.20
EOG RESOURCES INC	5,031	90.88	457,217.28
EQT CORP	1,638	58.22	95,364.36
EXXON MOBIL CORPORATION	36,450	82.02	2,989,629.00
HALLIBURTON CO	7,566	45.58	344,858.28
HELMERICH & PAYNE	841	59.63	50,148.83
HESS CORP	2,507	47.42	118,881.94
HOLLY FRONTIER CORP	1,587	26.94	42,753.78
KINDER MORGAN INC	16,501	20.19	333,155.19
MARATHON OIL CORP	7,405	14.29	105,817.45
MARATHON PETROLEUM CORP	4,720	50.66	239,115.20
MURPHY OIL CORP	1,449	26.18	37,934.82
NATIONAL OILWELL VARCO INC	3,253	34.35	111,740.55
NEWFIELD EXPLORATION CO	1,681	34.59	58,145.79
NOBLE ENERGY INC	3,921	31.03	121,668.63
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	6,675	60.40	403,170.00
ONEOK INC	1,916	50.64	97,026.24
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	1,903	31.29	59,544.87
PHILLIPS 66	4,096	79.35	325,017.60
PIONEER NATURAL RESOURCES COMPANY	1,524	169.61	258,485.64
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	1,310	29.17	38,212.70
RANGE RESOURCES	1,803	26.22	47,274.66
SCHLUMBERGER LTD	12,226	71.97	879,905.22
TARGA RESOURCES CORP	1,569	50.37	79,030.53
TECHNIPFMC PLC	3,853	31.93	123,026.29
TESORO CORP	1,074	80.86	86,843.64
VALERO ENERGY CORP	3,918	65.34	256,002.12
WEATHERFORD INTL PLC	8,041	5.21	41,893.61
WILLIAMS COS INC	7,089	30.25	214,442.25
AIR PRODUCTS & CHEMICAL INC	1,816	147.22	267,351.52
ALBEMARLE CORP	1,019	110.01	112,100.19
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	589	123.45	72,712.05
AVERY DENNISON CORP	791	84.17	66,578.47
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	2,028	31.21	63,293.88

BALL CORP	1,504	80.04	120,380.16
CELANESE CORP-SERIES A	1,205	86.40	104,112.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,927	28.42	54,765.34
CROWN HOLDINGS	1,244	56.79	70,646.76
DOW CHEMICAL	9,837	63.09	620,616.33
DU PONT (E.I.)DE NEMOURS	7,640	81.14	619,909.60
EASTMAN CHEMICAL CO	1,224	79.61	97,442.64
ECOLAB INC	2,306	126.47	291,639.82
FMC CORP	1,162	73.29	85,162.98
FREEMONT-MCMORAN INC	11,000	11.80	129,800.00
INTERNATIONAL FLAV&F	746	139.27	103,895.42
INTERNATIONAL PAPER CO	3,559	53.44	190,192.96
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,084	84.16	259,549.44
MARTIN MARIETTA MATERIALS	494	237.55	117,349.70
MONSANTO CO	3,848	116.20	447,137.60
MOSAIC CO/THE	2,786	23.45	65,331.70
NEWMONT MINING CORP	4,863	32.73	159,165.99
NUCOR CORPORATION	2,796	60.47	169,074.12
PACKAGING CORP OF AMERICA	788	102.20	80,533.60
PPG INDUSTRIES INC	2,320	110.56	256,499.20
PRAXAIR INC	2,517	129.48	325,901.16
SEALED AIR CORP	1,695	45.79	77,614.05
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	711	338.24	240,488.64
VALSPAR CORP/THE	652	112.48	73,336.96
VULCAN MATERIALS CO	1,142	127.74	145,879.08
WESTROCK CO	2,124	55.02	116,862.48
WR GRACE&CO	713	70.34	50,152.42
3M CO	5,291	199.40	1,055,025.40
ACUITY BRANDS INC	396	185.20	73,339.20
AERCAP HOLDINGS NV	1,267	44.99	57,002.33
AGCO CORP	589	64.00	37,696.00
AMETEK INC	1,993	60.19	119,958.67
ARCONIC INC	4,084	27.30	111,493.20
BOEING CO	5,153	185.01	953,356.53
CATERPILLAR INC	5,140	99.64	512,149.60

CUMMINS INC	1,370	155.48	213,007.60
DEERE & COMPANY	2,360	113.11	266,939.60
DOVER CORP	1,451	78.76	114,280.76
EATON CORP PLC	4,031	76.86	309,822.66
EMERSON ELECTRIC CO	5,615	58.94	330,948.10
FASTENAL CO	2,669	45.68	121,919.92
FLOWSERVE CORP	1,240	49.98	61,975.20
FLUOR CORP	1,309	48.18	63,067.62
FORTIVE CORP	2,610	63.14	164,795.40
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	1,415	63.48	89,824.20
GENERAL DYNAMICS CORP	2,268	195.97	444,459.96
GENERAL ELECTRIC CO	77,857	29.22	2,274,981.54
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	6,366	131.41	836,556.06
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	420	195.50	82,110.00
ILLINOIS TOOL WORKS	2,756	139.60	384,737.60
INGERSOLL-RAND PLC	2,320	90.01	208,823.20
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,126	54.66	61,547.16
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,200	63.75	140,250.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,000	41.94	83,880.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	8,232	41.97	345,497.04
L3 TECHNOLOGIES INC	697	169.00	117,793.00
LOCKHEED MARTIN CORP	2,318	273.03	632,883.54
MASCO CORP	3,080	36.92	113,713.60
MIDDLEBY CORP	540	141.07	76,177.80
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,467	248.91	365,150.97
PACCAR INC	3,045	67.04	204,136.80
PARKER HANNIFIN CORP	1,149	159.20	182,920.80
PENTAIR PLC	1,616	66.43	107,350.88
RAYTHEON COMPANY	2,576	159.41	410,640.16
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,109	156.39	173,436.51
ROCKWELL COLLINS INC.	1,459	104.06	151,823.54
ROPER INDUSTRIES INC	867	220.90	191,520.30
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,486	39.69	58,979.34
SMITH (A.O.)CORP	1,278	55.33	70,711.74
SNAP-ON INC	534	170.45	91,020.30



STANLEY BLACK & DECKER INC	1,313	138.61	181,994.93
TEXTRON INC	2,487	46.62	115,943.94
TRANSDIGM GROUP INC	475	254.98	121,115.50
UNITED RENTALS INC	759	108.96	82,700.64
UNITED TECHNOLOGIES CORP	6,882	121.35	835,130.70
WABCO HOLDINGS INC	512	118.85	60,851.20
WABTEC CORPORATION	840	83.00	69,720.00
WW GRAINGER INC	518	189.23	98,021.14
XYLEM INC	1,612	52.30	84,307.60
CINTAS CORP	745	122.99	91,627.55
DUN & BRADSTREET CORP	316	113.17	35,761.72
EQUIFAX INC	1,009	138.81	140,059.29
IHS MARKIT LTD	3,266	43.73	142,822.18
MANPOWERGROUP INC	631	103.78	65,485.18
NIELSEN HOLDINGS PLC	3,301	40.20	132,700.20
REPUBLIC SERVICES INC	2,038	63.23	128,862.74
ROBERT HALF INTL INC	1,212	46.91	56,854.92
STERICYCLE INC	748	87.00	65,076.00
VERISK ANALYTICS INC	1,323	79.76	105,522.48
WASTE CONNECTIONS INC	1,551	92.90	144,087.90
WASTE MANAGEMENT INC	3,884	73.39	285,046.76
AMERCO	51	369.46	18,842.46
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	1,277	44.51	56,839.27
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,294	73.35	94,914.90
CSX CORP	8,218	52.50	431,445.00
DELTA AIR LINES INC	1,726	48.70	84,056.20
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,586	54.39	86,262.54
FEDEX CORP	2,209	192.42	425,055.78
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	820	88.73	72,758.60
KANSAS CITY SOUTHERN	942	91.62	86,306.04
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	726	81.69	59,306.94
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,512	117.01	293,929.12
SOUTHWEST AIRLINES CO	1,421	58.40	82,986.40
UNION PACIFIC CORP	7,248	110.72	802,498.56
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	772	75.30	58,131.60

UNITED PARCEL SERVICE -CL B	6,071	107.43	652,207.53
AUTOLIV INC	815	103.83	84,621.45
BORGWARNER INC	1,696	41.73	70,774.08
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	2,327	87.70	204,077.90
FORD MOTOR CO	32,587	11.14	363,019.18
GENERAL MOTORS CO	12,225	33.77	412,838.25
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	2,450	35.34	86,583.00
HARLEY-DAVIDSON INC	1,554	56.19	87,319.26
LEAR CORP	598	140.84	84,222.32
TESLA INC	1,132	308.35	349,052.20
COACH INC	2,395	42.66	102,170.70
D R HORTON INC	3,249	32.60	105,917.40
GARMIN LTD	943	52.49	49,498.07
HANESBRANDS INC	3,572	21.46	76,655.12
HASBRO INC	1,039	100.20	104,107.80
LEGGETT & PLATT INC	1,198	53.79	64,440.42
LENNAR CORP	1,918	49.79	95,497.22
LULULEMON ATHLETICA INC	933	51.95	48,469.35
MATTEL INC	2,730	22.12	60,387.60
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	1,448	38.10	55,168.80
MOHAWK INDUSTRIES INC	575	232.20	133,515.00
NEWELL BRANDS INC	3,712	46.39	172,199.68
NIKE INC CLASS-B	11,753	53.95	634,074.35
POLARIS INDUSTRIES INC	570	85.90	48,963.00
PULTE GROUP INC	2,408	22.34	53,794.72
PVH CORP	753	102.60	77,257.80
RALPH LAUREN CORP	428	82.11	35,143.08
TOLL BROTHERS INC	1,478	36.61	54,109.58
UNDER ARMOUR INC -CLASS C	2,131	19.09	40,680.79
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	1,241	20.59	25,552.19
VF CORP	3,010	54.47	163,954.70
WHIRLPOOL CORP	641	185.14	118,674.74
ARAMARK	2,064	36.72	75,790.08
CARNIVAL CORP	2,942	63.02	185,404.84
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	249	475.30	118,349.70

DARDEN RESTAURANTS INC	1,072	87.33	93,617.76
DOMINO'S PIZZA INC	423	193.12	81,689.76
H&R BLOCK INC	2,080	25.27	52,561.60
HILTON WORLDWIDE HOLDING	1,851	61.07	113,040.57
LAS VEGAS SANDS CORP	3,902	58.75	229,242.50
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	2,883	97.05	279,795.15
MCDONALD'S CORP	7,307	143.96	1,051,915.72
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT	2,100	22.34	46,914.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	4,018	30.85	123,955.30
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	1,340	55.49	74,356.60
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,566	108.62	170,098.92
STARBUCKS CORP	12,805	60.95	780,464.75
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	894	96.07	85,886.58
WYNN RESORTS LTD	706	122.14	86,230.84
YUM! BRANDS INC	2,961	69.30	205,197.30
21ST CENTURY FOX IN	9,169	29.14	267,184.66
21ST CENTURY FOX NEWS CORP	4,066	28.58	116,206.28
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	3,540	65.20	230,808.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,900	334.78	636,082.00
COMCAST CORP CL-A	41,920	39.01	1,635,299.20
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	1,451	27.09	39,307.59
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	1,812	26.46	47,945.52
DISH NETWORK CORP-A	1,962	61.60	120,859.20
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	3,647	24.28	88,549.16
LIBERTY BROADBAND-C	930	87.75	81,607.50
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC-C	1,106	21.14	23,380.84
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,161	34.27	74,057.47
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	5,450	33.58	183,011.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	1,815	37.51	68,080.65
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	683	37.69	25,742.27
NEWS CORP-CL A	3,532	12.69	44,821.08
OMNICOM GROUP	2,032	83.69	170,058.08
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE-CL A	748	72.50	54,230.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	15,253	4.89	74,587.17
TEGNA INC	1,790	25.75	46,092.50

THE WALT DISNEY COMPANY	13,297	111.99	1,489,131.03
TIME WARNER INC	6,808	98.37	669,702.96
VIACOM INC-CLASS B	3,062	36.82	112,742.84
ADVANCE AUTO PARTS INC	593	144.98	85,973.14
AMAZON.COM INC	3,552	934.15	3,318,100.80
AUTONATION INC	617	40.74	25,136.58
AUTOZONE INC	252	705.31	177,738.12
BED BATH & BEYOND INC	1,460	37.34	54,516.40
BEST BUY CO INC	2,559	51.62	132,095.58
CARMAX INC	1,764	59.71	105,328.44
DICK'S SPORTING GOODS INC	721	51.10	36,843.10
DOLLAR GENERAL CORP	2,448	73.62	180,221.76
DOLLAR TREE INC	2,021	82.00	165,722.00
EXPEDIA INC	1,109	140.38	155,681.42
FOOT LOCKER INC	1,234	76.76	94,721.84
GAP INC/THE	2,064	26.33	54,345.12
GENUINE PARTS CO	1,276	92.73	118,323.48
HOME DEPOT INC	10,711	155.73	1,668,024.03
KOHL'S CORP	1,573	40.12	63,108.76
L BRANDS INC	2,278	51.08	116,360.24
LIBERTY INTERACTIVE CORP	3,548	21.18	75,146.64
LKQ CORP	2,834	31.52	89,327.68
LOWE'S COS INC	7,645	86.00	657,470.00
MACYS INC	2,634	28.97	76,306.98
NETFLIX INC	3,759	156.60	588,659.40
NORDSTROM INC	1,128	49.01	55,283.28
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	821	252.70	207,466.70
ROSS STORES INC	3,519	64.70	227,679.30
SIGNET JEWELERS LTD	582	65.01	37,835.82
STAPLES INC	5,670	9.59	54,375.30
TARGET CORP	4,769	57.32	273,359.08
THE PRICELINE GROUP	434	1,903.65	826,184.10
TIFFANY & CO	1,143	92.49	105,716.07
TJX COMPANIES INC	5,717	78.69	449,870.73
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,266	61.95	78,428.70

TRIPADVISOR INC	1,000	46.17	46,170.00
ULTA BEAUTY INC	512	295.47	151,280.64
COSTCO WHOLESALE CORP	3,838	180.20	691,607.60
CVS HEALTH CORP	9,384	81.06	760,667.04
KROGER CO	7,971	29.35	233,948.85
RITE AID CORP	8,874	4.11	36,472.14
SYSCO CORP	4,665	55.31	258,021.15
WAL-MART STORES INC	13,603	76.50	1,040,629.50
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	8,092	85.89	695,021.88
WHOLE FOODS MARKET INC	2,637	36.87	97,226.19
ALTRIA GROUP INC	17,152	70.92	1,216,419.84
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	4,959	42.43	210,410.37
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	1,969	49.01	96,500.69
BUNGE LTD	1,253	69.53	87,121.09
CAMPBELL SOUP CO	1,618	57.40	92,873.20
COCA-COLA COMPANY	36,074	43.69	1,576,073.06
CONAGRA BRANDS INC	3,567	37.74	134,618.58
CONSTELLATION BRNDS INC-A	1,585	178.51	282,938.35
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	1,674	91.21	152,685.54
GENERAL MILLS INC	5,207	57.30	298,361.10
HERSHEY CO/THE	1,277	107.55	137,341.35
HORMEL FOODS CORP	2,549	34.75	88,577.75
INGREDION INC	573	120.61	69,109.53
JM SMUCKER CO/THE	1,036	126.08	130,618.88
KELLOGG CO	2,301	70.69	162,657.69
KRAFT HEINZ CO/THE	5,329	89.63	477,638.27
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,044	100.16	104,567.04
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	1,625	88.85	144,381.25
MOLSON COORS BREWING CO	1,667	93.12	155,231.04
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	13,626	44.83	610,853.58
MONSTER BEVERAGE CORP	3,579	47.45	169,823.55
PEPSICO INC	12,624	113.22	1,429,289.28
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	13,649	112.25	1,532,100.25
REYNOLDS AMERICAN INC	7,466	64.77	483,572.82
TYSON FOODS INC	2,501	63.33	158,388.33

CHURCH & DWIGHT CO INC	2,312	50.78	117,403.36
CLOROX COMPANY	1,193	132.89	158,537.77
COLGATE-PALMOLIVE CO	7,437	71.81	534,050.97
COTY INC-CL A	4,607	18.07	83,248.49
EDGEWELL PERSONAL CARE INC	568	74.78	42,475.04
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	1,938	92.86	179,962.68
KIMBERLY-CLARK CORP	3,138	128.59	403,515.42
PROCTER & GAMBLE CO	22,503	86.50	1,946,509.50
SPECTRUM BRANDS HLD INC	240	129.64	31,113.60
ABBOTT LABORATORIES	15,140	44.64	675,849.60
AETNA INC	3,050	140.77	429,348.50
ALIGN TECHNOLOGY INC	680	138.03	93,860.40
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,408	85.89	120,933.12
ANTHEM INC	2,336	180.30	421,180.80
BARD C R INC	642	308.05	197,768.10
BAXTER INTERNATIONAL INC	4,273	55.95	239,074.35
BECTON DICKINSON	1,888	185.40	350,035.20
BOSTON SCIENTIFIC CORP	11,951	26.51	316,821.01
CARDINAL HEALTH INC	2,812	72.47	203,785.64
CENTENE CORP	1,454	76.88	111,783.52
CERNER CORP	2,688	64.89	174,424.32
CIGNA CORP	2,293	160.25	367,453.25
COOPER COS INC/THE	457	205.71	94,009.47
DANAHER CORPORATION	5,468	83.86	458,546.48
DAVITA INC	1,359	65.45	88,946.55
DENTSPLY SIRONA INC	1,954	65.59	128,162.86
DEXCOM INC	792	76.21	60,358.32
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,903	110.58	210,433.74
ENVISION HEALTHCARE CORP	1,004	57.55	57,780.20
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	5,428	61.58	334,256.24
HCA HOLDINGS INC	2,582	83.50	215,597.00
HENRY SCHEIN INC	716	178.35	127,698.60
HOLOGIC INC	2,346	45.04	105,663.84
HUMANA INC	1,296	229.76	297,768.96
IDEXX LABORATORIES INC	772	162.47	125,426.84

INTUITIVE SURGICAL INC	333	850.54	283,229.82
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	916	142.38	130,420.08
MCKESSON CORP	2,023	141.47	286,193.81
MEDNAX INC	882	55.32	48,792.24
MEDTRONIC PLC	12,267	84.00	1,030,428.00
PATTERSON COS INC	688	45.37	31,214.56
QUEST DIAGNOSTICS	1,220	107.09	130,649.80
RESMED INC	1,170	69.39	81,186.30
STRYKER CORP	2,958	135.96	402,169.68
TELEFLEX INC	413	200.34	82,740.42
UNITEDHEALTH GROUP INC	8,466	174.12	1,474,099.92
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	822	121.99	100,275.78
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	871	92.13	80,245.23
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	1,755	116.54	204,527.70
ABBVIE INC	14,309	66.99	958,559.91
AGILENT TECHNOLOGIES INC	2,844	56.64	161,084.16
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	1,953	128.82	251,585.46
ALKERMES PLC	1,333	59.69	79,566.77
ALLERGAN PLC	3,302	244.94	808,791.88
AMGEN INC	6,548	163.81	1,072,627.88
BIOGEN INC	1,916	262.15	502,279.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,549	94.23	145,962.27
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	14,710	55.15	811,256.50
CELGENE CORP	6,823	122.41	835,203.43
ELI LILLY & CO	8,744	82.51	721,467.44
GILEAD SCIENCES INC	11,603	67.80	786,683.40
ILLUMINA INC	1,324	187.14	247,773.36
INCYTE CORP	1,528	122.41	187,042.48
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	513	159.06	81,597.78
JOHNSON & JOHNSON	23,944	123.51	2,957,323.44
MALLINCKRODT PLC	1,001	46.63	46,676.63
MERCK & CO. INC	24,267	63.97	1,552,359.99
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	233	544.14	126,784.62
MYLAN NV	4,157	37.90	157,550.30
PERRIGO CO PLC	1,232	73.41	90,441.12

PFIZER INC	53,425	33.48	1,788,669.00
QUINTILES IMS HOLDINGS	1,351	83.30	112,538.30
REGENERON PHARMACEUTICALS	677	429.00	290,433.00
SEATTLE GENETICS INC	917	61.82	56,688.94
TARO PHARMACEUTICAL INDUS	118	114.80	13,546.40
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	7,907	31.14	246,223.98
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	3,477	171.06	594,775.62
UNITED THERAPEUTICS CORP	364	122.84	44,713.76
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2,150	114.84	246,906.00
WATERS CORP	749	174.00	130,326.00
ZOETIS INC	4,127	59.47	245,432.69
BANK OF AMERICA CORP	88,881	23.74	2,110,034.94
BB & T CORP	7,103	43.73	310,614.19
CIT GROUP INC	1,659	46.64	77,375.76
CITIGROUP INC	25,081	60.24	1,510,879.44
CITIZENS FINANCIAL GROUP	4,369	36.97	161,521.93
COMERICA INC	1,461	71.60	104,607.60
FIFTH THIRD BANCORP	6,744	24.80	167,251.20
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,348	94.54	127,439.92
HUNTINGTON BANCSHARES INC	9,705	12.99	126,067.95
JPMORGAN CHASE & CO	31,483	87.00	2,739,021.00
KEYCORP	9,405	18.73	176,155.65
M & T BANK CORP	1,226	158.93	194,848.18
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	4,622	13.24	61,195.28
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	2,802	17.43	48,838.86
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4,298	123.12	529,169.76
REGIONS FINANCIAL CORP	11,007	14.28	157,179.96
SIGNATURE BANK	478	136.98	65,476.44
SUNTRUST BANKS INC	4,307	57.84	249,116.88
US BANCORP	14,958	51.77	774,375.66
WELLS FARGO & COMPANY	42,008	55.11	2,315,060.88
AFFILIATED MANAGERS GROUP	478	154.71	73,951.38
ALLY FINANCIAL INC	3,579	19.71	70,542.09
AMERICAN EXPRESS COMPANY	6,833	78.32	535,160.56
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,355	128.82	174,551.10



BANK OF NEW YORK MELLON CORP	9,327	47.65	444,431.55
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	10,773	166.55	1,794,243.15
BLACKROCK INC	1,068	383.76	409,855.68
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	4,229	82.27	347,919.83
CME GROUP INC	2,936	118.76	348,679.36
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3,535	60.30	213,160.50
E*TRADE FINANCIAL CORP	2,289	35.80	81,946.20
EATON VANCE CORP	1,095	43.59	47,731.05
FRANKLIN RESOURCES INC	3,307	42.77	141,440.39
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,144	226.87	713,279.28
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	5,226	60.46	315,963.96
INVESCO LTD	3,538	32.38	114,560.44
LEUCADIA NATIONAL CORP	3,110	25.76	80,113.60
MOODYS CORP	1,509	118.23	178,409.07
MORGAN STANLEY	12,332	43.08	531,262.56
MSCI INC	776	99.54	77,243.04
NASDAQ INC	1,112	67.91	75,515.92
NAVIENT CORP	2,663	14.98	39,891.74
NORTHERN TRUST CORPORATION	1,873	90.53	169,562.69
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,190	76.00	90,440.00
S&P GLOBAL INC	2,292	137.55	315,264.60
SCHWAB CHARLES CORP	10,468	40.13	420,080.84
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,270	51.41	65,290.70
STATE STREET CORP	3,404	83.60	284,574.40
SYNCHRONY FINANCIAL	7,119	28.61	203,674.59
T ROWE PRICE GROUP INC	2,129	71.90	153,075.10
TD AMERITRADE HOLDING CORP	2,346	38.96	91,400.16
VOYA FINANCIAL INC	1,893	36.76	69,586.68
AFLAC INC	3,592	74.35	267,065.20
ALLEGHANY CORP	126	591.29	74,502.54
ALLSTATE CORP	3,283	85.45	280,532.35
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	9,040	62.71	566,898.40
AON PLC	2,316	122.27	283,177.32
ARCH CAPITAL GROUP	1,040	97.22	101,108.80
ARTHUR J GALLAGHER & CO	1,585	55.71	88,300.35

ASSURANT INC	504	103.92	52,375.68
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	733	65.57	48,062.81
CHUBB LTD	4,096	137.75	564,224.00
CINCINNATI FINL CORP	1,476	70.83	104,545.08
EVEREST RE GROUP LTD	332	246.42	81,811.44
FNF GROUP	2,299	41.54	95,500.46
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	3,194	49.50	158,103.00
LINCOLN NATIONAL CORP	2,049	67.58	138,471.42
LOEWS CORP	2,566	47.01	120,627.66
MARKEL CORP	129	970.23	125,159.67
MARSH & MCLENNAN COS	4,500	74.51	335,295.00
METLIFE INC	8,215	52.62	432,273.30
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2,459	64.34	158,212.06
PROGRESSIVE CORP	4,940	40.74	201,255.60
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	3,768	108.73	409,694.64
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	557	126.87	70,666.59
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	405	140.32	56,829.60
TORCHMARK CORP	1,001	76.83	76,906.83
TRAVELERS COS INC/THE	2,500	121.30	303,250.00
UNUM GROUP	1,903	46.58	88,641.74
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,130	144.20	162,946.00
WR BERKLEY CORP	857	67.50	57,847.50
XL GROUP PLC	2,301	42.37	97,493.37
CBRE GROUP INC	2,807	36.77	103,213.39
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	10,900	7.72	84,148.00
JONES LANG LASALLE INC	434	125.21	54,341.14
ACCENTURE PLC-CL A	5,450	121.52	662,284.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	5,269	53.83	283,630.27
ADOBE SYSTEMS INC	4,364	134.84	588,441.76
AKAMA I TECHNOLOGIES	1,572	52.13	81,948.36
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	449	255.49	114,715.01
ALPHABET INC-CL A	2,604	950.28	2,474,529.12
ALPHABET INC-CL C	2,733	927.13	2,533,846.29
ANSYS INC	776	121.20	94,051.20
AUTODESK INC	1,753	93.24	163,449.72

AUTOMATIC DATA PROCESSING	3,958	99.29	392,989.82
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	1,019	68.91	70,219.29
CA INC	2,972	32.69	97,154.68
CADENCE DESIGN SYS INC	2,611	33.04	86,267.44
CDK GLOBAL INC	1,152	61.87	71,274.24
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,148	106.00	121,688.00
CITRIX SYSTEMS INC	1,419	87.48	124,134.12
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	5,321	63.22	336,393.62
COSTAR GROUP INC	298	252.80	75,334.40
DELL TECHNOLOGIES INC	1,948	67.29	131,080.92
DXC TECHNOLOGY CO	2,536	78.39	198,797.04
EBAY INC	9,174	33.50	307,329.00
ELECTRONIC ARTS INC	2,680	95.74	256,583.20
FACEBOOK INC-A	20,589	150.24	3,093,291.36
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	2,731	83.05	226,809.55
FIRST DATA CORP	2,991	16.00	47,856.00
FISERV INC	1,868	120.00	224,160.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	799	133.40	106,586.60
FORTINET INC	1,280	40.08	51,302.40
GARTNER INC	755	113.22	85,481.10
GLOBAL PAYMENTS INC	1,339	86.07	115,247.73
INTL BUSINESS MACHINES CORP	7,944	155.05	1,231,717.20
INTUIT INC	2,183	126.14	275,363.62
MASTERCARD INC-CLASS A	8,462	117.50	994,285.00
MERCADOLIBRE INC	376	275.16	103,460.16
MICROSOFT CORP	64,977	69.00	4,483,413.00
MOBILEYE NV	1,523	61.90	94,273.70
NUANCE COMMUNICATIONS INC	2,318	18.09	41,932.62
ORACLE CORPORATION	27,096	45.58	1,235,035.68
PAYCHEX INC	2,746	58.87	161,657.02
PAYPAL HOLDINGS INC	9,444	49.30	465,589.20
RED HAT INC	1,550	88.61	137,345.50
SABRE CORP	1,852	24.69	45,725.88
SALESFORCE.COM INC	5,672	86.97	493,293.84
SERVICENOW INC	1,403	98.07	137,592.21

SPLUNK INC	1,254	66.94	83,942.76
SYMANTEC CORP	5,235	32.30	169,090.50
SYNOPSYS INC	1,337	74.28	99,312.36
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	1,509	57.46	86,707.14
TWITTER INC	4,866	18.69	90,945.54
VANTIV INC -CL A	1,291	63.85	82,430.35
VERISIGN INC	871	89.60	78,041.60
VISA INC-CLASS A SHARES	16,427	92.09	1,512,762.43
VMWARE INC-CLASS A	567	93.97	53,280.99
WESTERN UNION CO	4,590	19.39	89,000.10
WORKDAY INC	1,014	91.86	93,146.04
YAHOO! INC	7,952	48.49	385,592.48
ZILLOW GROUP INC-C	938	43.97	41,243.86
AMPHENOL CORP-CL A	2,765	72.13	199,439.45
APPLE INC	46,910	148.96	6,987,713.60
ARROW ELECTRONICS INC	865	76.54	66,207.10
AVNET INC	1,199	37.28	44,698.72
CDW CORP/DE	1,220	58.76	71,687.20
CISCO SYSTEMS INC	44,073	34.39	1,515,670.47
CORNING INC	8,170	28.91	236,194.70
F5 NETWORKS INC	591	128.57	75,984.87
FLEX LTD	4,977	15.16	75,451.32
FLIR SYSTEMS INC	1,122	36.95	41,457.90
HARRIS CORP	1,116	110.72	123,563.52
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	14,434	18.83	271,792.22
HP INC	14,996	18.91	283,574.36
JUNIPER NETWORKS INC	3,153	30.55	96,324.15
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,327	84.44	112,051.88
NETAPP INC	2,426	40.16	97,428.16
PALO ALTO NETWORKS INC	752	116.31	87,465.12
SEAGATE TECHNOLOGY	2,729	43.55	118,847.95
TE CONNECTIVITY LTD	3,103	75.45	234,121.35
TRIMBLE INC	2,123	36.00	76,428.00
WESTERN DIGITAL CORP	2,471	90.72	224,169.12
XEROX CORP	6,559	7.07	46,372.13

AT & T INC	53,998	38.56	2,082,162.88
CENTURYLINK INC	4,764	23.60	112,430.40
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	11,416	1.46	16,667.36
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	2,761	57.64	159,144.04
SPRINT CORP	6,813	8.04	54,776.52
T-MOBILE US INC	2,504	66.49	166,490.96
VERIZON COMMUNICATIONS	35,864	46.69	1,674,490.16
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	1,454	33.86	49,232.44
AES CORP	5,570	11.32	63,052.40
ALLIANT ENERGY CORP	2,150	40.06	86,129.00
AMEREN CORPORATION	2,004	54.78	109,779.12
AMERICAN ELECTRIC POWER	4,223	68.41	288,895.43
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,533	76.65	117,504.45
ATMOS ENERGY CORP	901	82.17	74,035.17
CALPINE CORPORATION	3,424	10.02	34,308.48
CENTERPOINT ENERGY INC	3,348	28.05	93,911.40
CMS ENERGY CORP	2,401	45.44	109,101.44
CONSOLIDATED EDISON INC	2,692	79.81	214,848.52
DOMINION RESOURCES INC/VA	5,498	78.23	430,108.54
DTE ENERGY COMPANY	1,527	104.54	159,632.58
DUKE ENERGY CORP	5,985	82.98	496,635.30
EDISON INTERNATIONAL	2,916	79.70	232,405.20
ENERGY CORP	1,608	77.36	124,394.88
EVERSOURCE ENERGY	2,689	59.55	160,129.95
EXELON CORP	8,028	34.34	275,681.52
FIRSTENERGY CORP	3,651	28.83	105,258.33
NEXTERA ENERGY INC	4,099	134.33	550,618.67
NISOURCE INC	3,103	24.53	76,116.59
OGE ENERGY CORP	1,634	34.29	56,029.86
PG & E CORPORATION	4,510	67.14	302,801.40
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	962	84.87	81,644.94
PPL CORPORATION	6,122	38.53	235,880.66
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	4,424	43.81	193,815.44
SCANA CORP	1,269	65.94	83,677.86
SEMPRA ENERGY	2,115	112.15	237,197.25

	SOUTHERN CO	8,728	50.07	437,010.96	
	UGI CORP	1,474	49.51	72,977.74	
	WEC ENERGY GROUP INC	2,756	61.60	169,769.60	
	WESTAR ENERGY INC	1,162	52.52	61,028.24	
	XCEL ENERGY INC	4,481	45.05	201,869.05	
	ADVANCED MICRO DEVICES	6,815	10.19	69,444.85	
	ANALOG DEVICES INC	3,238	75.79	245,408.02	
	APPLIED MATERIALS INC	9,455	41.83	395,502.65	
	BROADCOM LTD	3,533	226.45	800,047.85	
	INTEL CORP	41,651	36.82	1,533,589.82	
	KLA-TENCOR CORP	1,424	100.94	143,738.56	
	LAM RESEARCH CORP	1,456	150.31	218,851.36	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	3,748	15.16	56,819.68	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC	2,530	45.51	115,140.30	
	MICROCHIP TECHNOLOGY	1,949	75.17	146,506.33	
	MICRON TECHNOLOGY INC	9,172	28.20	258,650.40	
	NVIDIA CORPORATION	4,728	103.86	491,050.08	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	2,573	106.58	274,230.34	
	QORVO INC	1,092	66.90	73,054.80	
	QUALCOMM INC	12,984	54.93	713,211.12	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,599	101.46	162,234.54	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	8,760	79.63	697,558.80	
	XILINX INC	2,263	63.39	143,451.57	
小計	銘柄数：595	2,740,576		185,360,219.78	
				(20,897,511,177)	
	組入時価比率：61.4%			64.9%	
カナダ・ドル	ALTAGAS LTD	1,500	31.31	46,965.00	
	ARC RESOURCES LTD	2,600	17.80	46,280.00	
	CAMECO CORP	3,900	13.27	51,753.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	9,900	42.28	418,572.00	
	CENOVUS ENERGY INC	8,899	12.92	114,975.08	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	5,400	13.11	70,794.00	
	ENBRIDGE INC	14,381	56.59	813,820.79	
	ENCANA CORP	9,100	14.97	136,227.00	
	HUSKY ENERGY INC	3,079	15.83	48,740.57	

IMPERIAL OIL LTD	2,800	39.34	110,152.00
INTER PIPELINE LTD	3,500	28.03	98,105.00
KEYERA CORP	1,700	40.38	68,646.00
PEMBINA PIPELINE CORP	3,406	43.47	148,058.82
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	1,700	25.68	43,656.00
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	2,122	29.14	61,835.08
SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	2,200	25.96	57,112.00
SUNCOR ENERGY INC	14,568	42.61	620,742.48
TOURMALINE OIL CORP	2,100	27.69	58,149.00
TRANSCANADA CORP	7,500	63.99	479,925.00
VERESEN INC	2,900	18.52	53,708.00
VERMILION ENERGY INC	1,200	48.08	57,696.00
AGNICO EAGLE MINES	2,000	63.75	127,500.00
AGRIUM INC	1,100	124.96	137,456.00
BARRICK GOLD CORP	10,300	22.06	227,218.00
CCL INDUSTRIES INC CL B	200	314.77	62,954.00
ELDORADO GOLD CORP	6,300	4.66	29,358.00
FRANCO-NEVADA CORP	1,600	90.64	145,024.00
GOLDCORP INC	7,300	18.61	135,853.00
KINROSS GOLD CORP	11,144	5.17	57,614.48
METHANEX CORP	900	59.01	53,109.00
POTASH CORP SASKATCHEWAN	7,695	22.49	173,060.55
SILVER WHEATON CORP	4,200	26.62	111,804.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	5,100	25.30	129,030.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	9,100	3.57	32,487.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	700	60.58	42,406.00
YAMANA GOLD INC	6,800	3.38	22,984.00
CAE INC	2,300	21.73	49,979.00
FINNING INTERNATIONAL INC	1,400	25.95	36,330.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	1,400	54.54	76,356.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	6,800	101.87	692,716.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,200	211.27	253,524.00
LINAMAR CORP	500	59.12	29,560.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,300	57.77	190,641.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,000	39.18	78,360.00

RESTAURANT BRANDS INERNATIONAL INC	1,900	80.37	152,703.00
SHAW COMMUNICATIONS INC	3,600	29.11	104,796.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	532	166.29	88,466.28
DOLLARAMA INC	900	122.63	110,367.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	3,800	64.81	246,278.00
EMPIRE CO LTD	1,700	21.50	36,550.00
GEORGE WESTON LTD	500	124.22	62,110.00
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	800	22.50	18,000.00
LOBLAW COMPANIES LTD	1,894	77.99	147,713.06
METRO INC	2,200	46.41	102,102.00
SAPUTO INC	2,400	45.06	108,144.00
BANK OF MONTREAL	5,707	96.32	549,698.24
BANK OF NOVA SCOTIA	10,639	76.72	816,224.08
CANADIAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	3,600	108.67	391,212.00
NATIONAL BANK OF CANADA	2,900	53.13	154,077.00
ROYAL BANK OF CANADA	13,122	93.74	1,230,056.28
TORONTO DOMINION BK	16,374	64.09	1,049,409.66
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	7,950	51.55	409,822.50
CI FINANCIAL CORP	2,373	26.53	62,955.69
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	3,700	11.45	42,365.00
IGM FINANCIAL INC	800	40.10	32,080.00
ONEX CORPORATION	700	99.61	69,727.00
THOMSON REUTERS CORP	3,000	61.23	183,690.00
FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD	200	621.21	124,242.00
GREAT-WEST LIFECO INC	2,600	34.47	89,622.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE & FIN	1,000	57.77	57,770.00
INTACT FINANCIAL CORP	1,200	92.41	110,892.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	17,810	24.55	437,235.50
POWER CORP OF CANADA	3,564	31.19	111,161.16
POWER FINANCIAL CORP	2,400	34.16	81,984.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	5,300	48.82	258,746.00
FIRST CAPITAL REALTY INC	1,200	20.17	24,204.00
CGI GROUP INC	2,000	65.80	131,600.00
CONSTELLATION SOFTWARE	200	689.21	137,842.00
OPEN TEXT CORP	2,400	47.58	114,192.00



	BLACKBERRY LIMITED	4,900	12.96	63,504.00	
	BCE INC	1,300	62.11	80,743.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	3,100	62.71	194,401.00	
	TELUS CORP	600	45.48	27,288.00	
	ATCO LTD/CANADA	600	50.30	30,180.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD	1,100	39.35	43,285.00	
	EMERA INC	600	47.39	28,434.00	
	FORTIS INC	3,400	44.66	151,844.00	
	HYDRO ONE LTD	1,500	24.05	36,075.00	
小計	銘柄数：88	345,859		15,005,028.30	
				(1,238,214,935)	
	組入時価比率：3.6%			3.8%	
ユーロ	ENAGAS	2,021	25.31	51,151.51	
	ENI SPA	22,182	14.59	323,635.38	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	4,543	13.93	63,283.99	
	KONINKLIJKE VOPAK NV	775	42.98	33,313.37	
	NESTE OYJ	1,162	38.65	44,911.30	
	OMV AG	1,276	42.28	53,955.66	
	REPSOL SA	10,404	14.59	151,794.36	
	SAIPEM SPA	44,883	0.39	17,903.82	
	SNAM SPA	22,347	4.22	94,438.42	
	TENARIS SA	4,214	14.11	59,459.54	
	TOTAL SA	19,934	48.00	956,832.00	
	AIR LIQUIDE	3,388	115.15	390,128.20	
	AKZO NOBEL	2,206	79.40	175,156.40	
	ARCELORMITTAL(NA)	15,965	7.20	115,027.82	
	ARKEMA	578	99.73	57,643.94	
	BASF SE	8,047	90.14	725,356.58	
	COVESTRO AG	760	72.11	54,803.60	
	CRH PLC(IE)	7,580	34.53	261,737.40	
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,315	31.13	40,942.52	
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	645	48.69	31,405.05	
	HEIDELBERGCEMENT AG	1,343	89.40	120,064.20	
	IMERYS SA	272	78.81	21,436.32	
	K+S AG	1,604	22.68	36,378.72	

KONINKLIJKE DSM NV	1,567	66.20	103,735.40
LANXESS	889	69.01	61,349.89
LINDE AG	1,652	174.00	287,448.00
SOLVAY SA	647	124.50	80,551.50
STORA ENSO OYJ-R SHS	5,038	11.09	55,871.42
SYMRISE AG	1,171	65.02	76,138.42
THYSSENKRUPP AG	3,478	22.51	78,307.17
UMICORE	870	54.93	47,789.10
UPM-KYMMENE OYJ	4,462	24.55	109,542.10
VOESTALPINE AG	1,181	39.02	46,082.62
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERVICIOS,S.A.	1,887	35.00	66,045.00
AIRBUS SE	5,092	75.88	386,380.96
ALSTOM	1,324	29.81	39,468.44
ANDRITZ AG	618	54.80	33,866.40
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	823	33.74	27,772.13
BOUYGUES	1,822	38.54	70,219.88
BRENNTAG AG	1,407	56.09	78,918.63
CNH INDUSTRIAL NV	8,784	10.04	88,191.36
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	4,368	52.28	228,359.04
DASSAULT AVIATION SA	18	1,289.65	23,213.70
EIFFAGE	463	78.80	36,484.40
FERROVIAL SA	4,416	19.73	87,149.76
GEA GROUP AG	1,539	39.00	60,021.00
HOCHTIEF AG	198	171.55	33,966.90
KONE OYJ-B	2,911	42.62	124,066.82
KONINKLIJKE PHILIPS NV	8,309	33.16	275,526.44
LEGRAND SA	2,393	61.74	147,743.82
LEONARDO SPA	3,672	15.34	56,328.48
MAN SE	265	97.53	25,845.45
METSO OYJ	871	32.70	28,481.70
OSRAM LICHT AG	805	66.47	53,508.35
PRYSMIAN SPA	1,523	26.80	40,816.40
REXEL SA	2,928	16.39	48,004.56
SAFRAN SA	2,742	78.13	214,232.46
SCHNEIDER ELECTRIC SE	4,889	74.50	364,230.50

SIEMENS AG	6,715	132.00	886,380.00
THALES SA	894	98.76	88,291.44
VINCI S.A	4,457	79.50	354,331.50
WARTSILA OYJ	1,296	55.50	71,928.00
ZARDOYA OTIS SA	1,853	8.71	16,139.63
ZODIAC AEROSPACE	1,769	22.87	40,457.03
BUREAU VERITAS SA	2,206	21.68	47,837.11
EDENRED	1,788	24.30	43,457.34
RANDSTAD HOLDING NV	1,102	56.05	61,767.10
RELX NV	8,543	18.09	154,542.87
SOCIETE BIC SA	238	105.60	25,132.80
WOLTERS KLUWER	2,715	39.62	107,581.87
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	6,065	16.41	99,526.65
ADP	241	128.50	30,968.50
AENA SA	614	164.35	100,910.90
ATLANTIA SPA	3,582	24.34	87,185.88
BOLLORE	7,730	3.96	30,618.53
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,924	16.31	31,390.06
DEUTSCHE POST AG-REG	8,581	33.08	283,902.38
FRAPORT AG	243	74.21	18,033.03
GROUPE EUROTUNNEL SE	4,606	10.41	47,971.49
INTL CONSOLIDATED AIRLINES	7,898	7.13	56,328.53
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,891	89.10	257,588.10
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(PFD)	475	76.98	36,565.50
CONTINENTAL AG	956	207.60	198,465.60
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	8,434	68.52	577,897.68
FERRARI NV	1,123	74.75	83,944.25
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	8,269	10.28	85,005.32
MICHELIN(CGDE)-B	1,535	120.75	185,351.25
NOKIAN RENKAAT OYJ	1,111	38.58	42,862.38
PEUGEOT SA	4,503	19.48	87,718.44
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	1,419	53.80	76,342.20
RENAULT SA	1,642	85.45	140,308.90
SCHAEFFLER AG	1,379	15.84	21,850.25
VALEO SA	2,170	67.12	145,650.40

VOLKSWAGEN AG	273	147.50	40,267.50
VOLKSWAGEN AG-PFD	1,660	144.20	239,372.00
ADIDAS AG	1,677	184.15	308,819.55
CHRISTIAN DIOR SE	482	253.50	122,187.00
HERMES INTERNATIONAL	230	448.95	103,258.50
HUGO BOSS AG	579	69.18	40,055.22
KERING	662	293.35	194,197.70
LUXOTTICA GROUP SPA	1,525	54.05	82,426.25
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON	2,434	238.10	579,535.40
SEB SA	168	156.05	26,216.40
ACCOR SA	1,346	42.04	56,585.84
PADDY POWER BETFAIR PLC	686	95.67	65,629.62
SODEXO	842	118.55	99,819.10
ALTICE NV -A	3,443	23.08	79,464.44
ALTICE NV B-W/I	741	23.10	17,117.10
AXEL SPRINGER SE	375	52.80	19,800.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	1,651	22.04	36,388.04
JC DECAUX SA	601	30.77	18,492.77
LAGARDERE S.C.A	1,011	28.85	29,167.35
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	2,154	40.78	87,840.12
PUBLICIS GROUPE	1,731	65.29	113,016.99
RTL GROUP	247	71.54	17,670.38
SES	2,972	21.10	62,709.20
TELENET GROUP HOLDING NV	345	56.73	19,571.85
VIVENDI	9,233	18.74	173,072.58
INDITEX	9,697	36.31	352,146.55
ZALANDO SE	878	40.77	35,796.06
CARREFOUR SA	5,187	21.73	112,739.44
CASINO GUICHARD PERRACHON	550	56.93	31,311.50
COLRUYT SA	549	47.32	25,978.68
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	6,308	5.52	34,870.62
JERONIMO MARTINS	2,116	17.08	36,151.86
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	10,993	19.60	215,462.80
METRO AG	1,688	29.90	50,471.20
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	6,721	109.30	734,605.30

COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	1,882	36.25	68,231.91
DANONE	5,200	65.01	338,052.00
HEINEKEN HOLDING NV	863	80.14	69,160.82
HEINEKEN NV	2,094	84.41	176,754.54
KERRY GROUP PLC-A(IE)	1,470	81.50	119,805.00
PERNOD-RICARD SA	1,913	119.30	228,220.90
REMY COINTREAU	220	97.00	21,340.00
BEIERSDORF AG	799	93.59	74,778.41
HENKEL AG & CO KGAA	916	109.35	100,164.60
HENKEL AG & KGAA VORZUG	1,557	126.05	196,259.85
L'OREAL	2,188	188.55	412,547.40
UNILEVER NV-CVA	14,327	48.12	689,486.87
ESSILOR INTERNATIONAL	1,821	120.25	218,975.25
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	1,863	84.55	157,516.65
FRESENIUS SE & CO KGAA	3,626	78.89	286,055.14
BAYER AG	7,275	115.10	837,352.50
EUROFINS SCIENTIFIC	96	467.85	44,913.60
GRIFOLS SA	2,436	25.20	61,387.20
MERCK KGAA	1,093	108.00	118,044.00
ORION OYJ	866	55.65	48,192.90
QIAGEN N.V.	2,030	29.04	58,951.20
SANOFI	10,213	89.69	916,003.97
UCB SA	1,052	74.01	77,858.52
ABN AMRO GROUP NV-CVA	2,535	25.69	65,124.15
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	59,220	7.80	461,916.00
BANCO DE SABADELL SA	44,346	1.88	83,636.55
BANCO SANTANDER SA	128,904	6.29	811,708.48
BANK OF IRELAND(IE)	246,375	0.25	63,811.12
BANKINTER SA	6,711	8.62	57,889.08
BNP PARIBAS	9,323	67.88	632,845.24
CAIXABANK	32,197	4.42	142,600.51
COMMERZBANK AG	8,822	9.60	84,691.20
CREDIT AGRICOLE SA	9,895	14.48	143,279.60
ERSTE GROUP BANK AG	2,566	32.55	83,523.30
ING GROEP NV-CVA	34,141	15.75	537,891.45

INTESA SANPAOLO	113,877	2.84	323,638.43
INTESA SANPAOLO-RSP	6,928	2.64	18,345.34
KBC GROEP NV	2,280	70.19	160,033.20
MEDIOBANCA SPA	5,597	9.18	51,380.46
NATIXIS	9,283	6.57	61,045.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	742	22.09	16,390.78
SOCIETE GENERALE	6,872	51.88	356,519.36
UNICREDIT SPA	16,555	16.22	268,522.10
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	18,177	17.41	316,552.45
DEUTSCHE BOERSE AG	1,746	92.52	161,539.92
EURAZEO	311	64.92	20,190.12
EXOR NV	1,083	53.75	58,211.25
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	691	86.66	59,882.06
WENDEL SA	300	133.15	39,945.00
AEGON NV	14,597	4.88	71,364.73
AGEAS	1,805	39.04	70,476.22
ALLIANZ SE-REG	4,014	173.90	698,034.60
ASSICURAZIONI GENERALI	9,850	15.25	150,212.50
AXA	16,993	25.00	424,825.00
CNP ASSURANCES	1,505	20.10	30,258.02
HANNOVER RUECK SE	534	114.95	61,383.30
MAPFRE SA	11,067	3.28	36,299.76
MUNCHENER RUECKVER AG-REG	1,402	180.30	252,780.60
NN GROUP NV	2,988	32.41	96,841.08
POSTE ITALIANE SPA	4,471	6.38	28,524.98
SAMPO OYJ-A SHS	4,012	45.69	183,308.28
SCOR SE	1,351	35.92	48,534.67
UNIPOLSAI SPA	9,364	2.19	20,525.88
DEUTSCHE WOHNEN AG	3,233	32.34	104,571.38
VONOVIA SE	3,929	34.08	133,919.96
AMADEUS IT GROUP SA	4,020	51.07	205,301.40
ATOS SE	734	126.75	93,034.50
CAP GEMINI SA	1,398	96.22	134,515.56
DASSAULT SYSTEMES SA	1,133	83.40	94,492.20
GEMALTO	782	54.79	42,845.78

SAP SE	8,625	93.84	809,370.00
UNITED INTERNET AG	1,086	43.23	46,947.78
INGENICO GROUP	511	87.10	44,508.10
NOKIA OYJ	52,857	5.59	295,470.63
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	28,701	16.61	476,723.61
ELISA OYJ	1,292	33.10	42,765.20
ILIAD SA	217	229.85	49,877.45
KONINKLIJKE KPN NV	31,765	2.83	89,894.95
ORANGE S.A	17,516	15.00	262,740.00
PROXIMUS	1,378	29.60	40,788.80
SFR GROUP SA	773	31.52	24,364.96
TELECOM ITALIA SPA	97,695	0.88	86,508.92
TELECOM ITALIA-RSP	66,016	0.72	47,795.58
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	7,686	4.29	33,011.37
TELEFONICA SA	40,091	10.50	420,955.50
E.ON SE	20,161	7.06	142,457.62
EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA	19,479	3.25	63,404.14
ELECTRICITE DE FRANCE	3,604	8.80	31,715.20
ENDESA SA	2,694	22.59	60,870.93
ENEL SPA	66,161	4.57	302,885.05
ENGIE	14,443	13.83	199,746.69
FORTUM OYJ	3,381	13.87	46,894.47
GAS NATURAL SDG SA	3,025	21.05	63,676.25
IBERDROLA SA	49,530	6.89	341,558.88
INNOGY SE	1,372	33.72	46,263.84
RED ELECTRICA CORP	3,980	18.99	75,600.10
RWE AG	4,153	15.38	63,873.14
SUEZ	3,308	16.49	54,565.46
TERNA SPA	13,764	4.85	66,755.40
VEOLIA ENVIRONNEMENT	4,545	18.78	85,355.10
ASML HOLDING NV	3,270	122.70	401,229.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	10,177	18.78	191,124.06
STMICROELECTRONICS NV	5,784	15.05	87,049.20
小計	銘柄数：231	1,978,687	34,832,829.28 (4,308,124,325)

	組入時価比率：12.7%			13.4%
英・ポンド	BP PLC	166,043	4.51	749,435.08
	PETROFAC LTD	2,990	8.02	23,994.75
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	38,352	20.67	792,927.60
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	32,923	21.17	697,144.52
	ANGLO AMERICAN PLC	12,873	10.30	132,656.26
	ANTOFAGASTA PLC	4,105	7.69	31,567.45
	BHP BILLITON PLC	18,740	11.40	213,636.00
	CRODA INTERNATIONAL PLC	1,012	38.35	38,810.20
	FRESNILLO PLC	1,763	14.19	25,016.97
	GLENCORE PLC	109,081	2.89	315,298.63
	JOHNSON MATTHEY PLC	1,532	31.19	47,783.08
	MONDI PLC	3,459	20.44	70,701.96
	RANDGOLD RESOURCES LTD	879	68.70	60,387.30
	RIO TINTO PLC	10,969	29.79	326,766.51
	ASSTEAD GROUP PLC	4,206	16.10	67,716.60
	BAE SYSTEMS PLC	27,301	6.47	176,773.97
	BUNZL PLC	3,158	24.08	76,044.64
	COBHAM PLC	21,046	1.39	29,380.21
	DCC PLC	768	73.40	56,371.20
	IMI PLC	2,439	13.03	31,780.17
	MEGGITT PLC	6,417	4.80	30,801.60
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	16,749	8.53	142,952.71
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS-C SHARE	1,189,179	0.00	1,189.17
	SMITHS GROUP PLC	3,575	16.84	60,203.00
	TRAVIS PERKINS PLC	2,275	16.81	38,242.75
	WEIR GROUP PLC/THE	2,049	18.89	38,705.61
	WOLSELEY PLC	2,088	50.65	105,757.20
	BABCOCK INTL GROUP PLC	2,173	9.15	19,893.81
	CAPITA PLC	5,084	5.75	29,233.00
	EXPERIAN PLC	8,031	16.93	135,964.83
	G4S PLC	14,462	3.18	46,090.39
	INTERTEK GROUP PLC	1,494	41.60	62,150.40
RELX PLC	9,196	15.96	146,768.16	
EASYJET PLC	1,407	12.60	17,728.20	



ROYAL MAIL PLC	8,654	4.13	35,784.29
GKN PLC	16,058	3.59	57,712.45
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	8,750	5.90	51,668.75
BERKELEY GROUP HOLDINGS	1,145	33.11	37,910.95
BURBERRY GROUP PLC	4,098	16.26	66,633.48
PERSIMMON PLC	2,680	23.91	64,078.80
TAYLOR WIMPEY PLC	28,373	1.96	55,611.08
CARNIVAL PLC	1,737	48.23	83,775.51
COMPASS GROUP PLC	14,583	15.69	228,807.27
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	1,501	41.20	61,841.20
MERLIN ENTERTAINMENTS	6,924	5.05	34,966.20
TUI AG-DI	4,671	11.86	55,398.06
WHITBREAD PLC	1,605	40.65	65,243.25
WILLIAM HILL PLC	9,202	2.94	27,081.48
ITV PLC	29,909	2.01	60,356.36
PEARSON PLC	6,868	7.39	50,788.86
SKY PLC	8,611	9.92	85,464.17
WPP PLC	11,434	16.77	191,748.18
DIXONS CARPHONE PLC	8,985	3.24	29,174.29
KINGFISHER PLC	18,136	3.37	61,190.86
MARKS & SPENCER GROUP PLC	14,164	3.75	53,143.32
NEXT PLC	1,157	42.34	48,987.38
J SAINSBURY PLC	14,102	2.65	37,370.30
TESCO PLC	72,870	1.79	130,765.21
WM MORRISON SUPERMARKETS	18,508	2.39	44,252.62
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,092	27.72	85,710.24
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC(GB)	16,392	52.87	866,645.04
COCA-COLA HBC AG-CDI	1,634	21.64	35,359.76
DIAGEO PLC	22,116	22.77	503,691.90
IMPERIAL BRANDS PLC	8,367	36.27	303,471.09
TATE & LYLE PLC	3,984	7.68	30,597.12
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	5,540	71.70	397,218.00
UNILEVER PLC	11,281	39.88	449,886.28
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	3,507	8.07	28,319.02
SMITH & NEPHEW PLC	7,506	13.06	98,028.36

ASTRAZENECA PLC	11,132	46.05	512,684.26
GLAXOSMITHKLINE PLC	42,924	15.88	681,633.12
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	1,257	19.73	24,800.61
SHIRE PLC	7,953	46.53	370,092.85
BARCLAYS PLC	149,092	2.06	307,651.34
HSBC HOLDINGS PLC	174,194	6.58	1,147,241.68
LLOYDS BANKING GROUP PLC	565,799	0.70	396,059.30
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	30,113	2.69	81,003.97
STANDARD CHARTERED PLC	29,397	7.17	210,923.47
3I GROUP PLC	8,312	8.17	67,909.04
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	9,458	2.94	27,891.64
HARGREAVES LANSDOWN PLC	2,606	13.88	36,171.28
INVESTEC PLC	6,237	5.75	35,862.75
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	2,707	33.90	91,767.30
PROVIDENT FINANCIAL PLC	1,160	31.94	37,050.40
SCHRODERS PLC	1,315	32.20	42,343.00
ADMIRAL GROUP PLC	1,978	20.87	41,280.86
AVIVA PLC	35,642	5.32	189,615.44
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	10,742	3.56	38,284.48
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	52,517	2.50	131,712.63
OLD MUTUAL PLC	43,919	1.92	84,368.39
PRUDENTIAL PLC	22,679	17.59	398,923.61
RSA INSURANCE GROUP PLC	8,109	6.21	50,356.89
ST JAMES'S PLACE PLC	4,589	11.69	53,645.41
STANDARD LIFE PLC	16,225	3.79	61,508.97
AUTO TRADER GROUP PLC	8,486	4.10	34,860.48
SAGE GROUP PLC/THE	10,149	7.00	71,043.00
WORLDPAY GROUP PLC	15,430	3.14	48,481.06
BT GROUP PLC	76,018	3.09	235,313.71
INMARSAT PLC	3,936	7.61	29,952.96
VODAFONE GROUP PLC	233,901	2.04	479,380.09
CENTRICA PLC	50,773	1.98	100,885.95
NATIONAL GRID PLC	32,726	10.20	333,968.83
SEVERN TRENT	1,964	23.73	46,605.72
SSE PLC	8,818	14.24	125,568.32

小計	UNITED UTILITIES GROUP PLC	6,529	9.95	64,996.19
	銘柄数：105	3,814,748		16,050,394.06 (2,344,962,572)
	組入時価比率：6.9%			7.3%
スイス・フラン	LONZA GROUP RTS	539	14.75	7,950.25
	EMS-CHEMIE HOLDING AG	69	650.00	44,850.00
	GIVAUDAN-REG	81	1,954.00	158,274.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	4,004	57.10	228,628.40
	SIKA AG-BR	19	6,490.00	123,310.00
	SYNGENTA AG	807	461.20	372,188.40
	ABB LTD-REG	16,426	24.46	401,779.96
	GEBERIT AG-REG	310	461.40	143,034.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	182	201.50	36,673.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	378	206.20	77,943.60
	ADECCO GROUP AG-REG	1,420	75.20	106,784.00
	SGS SA-REGB	50	2,258.00	112,900.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	457	154.90	70,789.30
	CIE FINANCIERE RICHEMON	4,588	85.10	390,438.80
	SWATCH GROUP AG/THE	363	80.75	29,312.25
	THE SWATCH GROUP AG-B	283	412.40	116,709.20
	DUFREY AG-REG	430	158.90	68,327.00
	ARYZTA AG	584	36.21	21,146.64
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	17	1,397.00	23,749.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT	1	67,285.00	67,285.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	9	5,705.00	51,345.00
	NESTLE SA-REG	27,406	80.00	2,192,480.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	428	151.20	64,713.60
	ACTELION LTD-REG	871	276.00	240,396.00
	GALENICA AG-REG	28	1,165.00	32,620.00
	LONZA GROUP AG-REG	539	188.40	101,547.60
	NOVARTIS AG-REG	19,680	76.85	1,512,408.00
	ROCHE HOLDING AG-GENUSS CHEIN	6,191	268.90	1,664,759.90
	CREDIT SUISSE GROUP AG	17,564	15.55	273,120.20
	JULIUS BAER GROUP LTD	1,851	52.10	96,437.10
PARGESA HOLDING SA	308	75.00	23,100.00	

	PARTNERS GROUP HOLDING AG	149	615.50	91,709.50	
	UBS GROUP AG	32,283	17.40	561,724.20	
	BALOISE-HOLDING AG	429	145.70	62,505.30	
	SWISS LIFE HOLDING	305	334.40	101,992.00	
	SWISS RE LTD	2,898	89.45	259,226.10	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,328	277.80	368,918.40	
	SWISS PRIME SITE	561	87.50	49,087.50	
	SWISSCOM AG-REG	234	448.90	105,042.60	
小計	銘柄数：39	144,070		10,455,205.80	
				(1,190,847,940)	
	組入時価比率：3.5%			3.7%	
スウェーデン・ クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	1,726	166.40	287,206.40	
	BOLIDEN AB	2,666	242.80	647,304.80	
	ALFA LAVAL AB	2,448	180.00	440,640.00	
	ASSA ABLOY AB-B	9,082	196.00	1,780,072.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	6,068	332.10	2,015,182.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	3,175	295.20	937,260.00	
	SANDVIK AB	9,250	141.10	1,305,175.00	
	SKANSKA AB-B SHS	2,935	212.30	623,100.50	
	SKF AB-B SHARES	3,587	191.00	685,117.00	
	VOLVO AB-B SHS	13,969	145.00	2,025,505.00	
	SECURITAS AB-B SHS	2,411	137.60	331,753.60	
	ELECTROLUX AB-SER B	2,219	270.50	600,239.50	
	HUSQVARNA AB-B SHS	3,422	90.60	310,033.20	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	8,542	215.70	1,842,509.40	
	ICA GRUPPEN AB	665	306.50	203,822.50	
	SWEDISH MATCH AB	1,625	284.60	462,475.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	5,189	296.50	1,538,538.50	
	GETINGE AB-B SHS	1,640	177.90	291,756.00	
	NORDEA BANK AB	27,406	112.50	3,083,175.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	14,049	105.60	1,483,574.40	
	SVENSKA HANDELSBANKEN AB-SHS	13,580	127.40	1,730,092.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	8,192	213.00	1,744,896.00	
	INDUSTRIVARDEN AB	1,222	213.40	260,774.80	
	INVESTOR AB-B SHS	3,816	406.70	1,551,967.20	

小計	KINNEVIK AB	1,990	243.50	484,565.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	221	663.50	146,633.50	
	ERICSSON LM-B SHS	26,843	58.45	1,568,973.35	
	HEXAGON AB-B SHS	2,394	393.80	942,757.20	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	562	472.00	265,264.00	
	TELE2 AB-B SHS	3,094	93.90	290,526.60	
	TELIA COMPANY AB	23,045	37.35	860,730.75	
	銘柄数：31	207,033		30,741,621.00	(393,492,748)
組入時価比率：1.2%				1.2%	
ノルウェー・クローネ	STATOIL ASA	10,362	146.60	1,519,069.20	
	NORSK HYDRO ASA	11,847	46.79	554,321.13	
	YARA INTERNATIONAL ASA	1,632	321.20	524,198.40	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	881	196.00	172,676.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	517	217.70	112,550.90	
	MARINE HARVEST	3,277	150.10	491,877.70	
	ORKLA ASA	6,976	79.55	554,940.80	
	DNB ASA	8,402	142.30	1,195,604.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	1,544	136.50	210,756.00	
	TELENOR ASA	6,492	138.60	899,791.20	
	銘柄数：10	51,930		6,235,785.93	(81,751,153)
組入時価比率：0.2%				0.3%	
デンマーク・クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	905	465.50	421,277.50	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,084	291.20	606,860.80	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,002	621.00	1,243,242.00	
	ISS A/S	1,550	283.70	439,735.00	
	A P MOELLER-MAERSK A/S-B	59	11,580.00	683,220.00	
	AP MOLLER - MAERSK A/S	30	11,110.00	333,300.00	
	DSV A/S	1,622	391.10	634,364.20	
	PANDORA A/S	968	747.00	723,096.00	
	CARLSBERG AS-B	850	699.00	594,150.00	
	COLOPLAST-B	1,106	554.50	613,277.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,225	160.10	196,122.50	

	GENMAB A/S	529	1,367.00	723,143.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	16,849	278.00	4,684,022.00	
	DANSKE BANK A/S	6,083	255.00	1,551,165.00	
	TRYG A/S	689	132.40	91,223.60	
	TDC A/S	7,522	38.40	288,844.80	
	DONG ENERGY A/S	1,321	273.10	360,765.10	
小計	銘柄数：17	45,394		14,187,808.50	
				(235,943,255)	
	組入時価比率：0.7%			0.7%	
オーストラリア・ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	2,461	31.29	77,004.69	
	OIL SEARCH LIMITED	12,883	7.15	92,113.45	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	15,293	7.34	112,250.62	
	SANTOS LTD	17,424	3.53	61,506.72	
	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	6,532	31.59	206,345.88	
	ALUMINA LTD	21,716	1.68	36,591.46	
	AMCOR LTD	10,660	15.27	162,778.20	
	BHP BILLITON LTD	28,518	22.62	645,077.16	
	BORAL LTD	9,067	6.42	58,210.14	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	13,263	4.82	63,927.66	
	INCITEC PIVOT LTD	15,431	3.64	56,168.84	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	3,688	22.16	81,726.08	
	NEWCREST MINING LIMITED	6,377	20.08	128,050.16	
	ORICA LIMITED	3,461	18.15	62,817.15	
	RIO TINTO LIMITED	3,720	57.15	212,598.00	
	SOUTH32 LTD	51,266	2.62	134,316.92	
	CIMIC GROUP LIMITED	827	37.44	30,962.88	
	BRAMBLES LIMITED	14,854	10.22	151,807.88	
	SEEK LTD	2,746	17.59	48,302.14	
	AURIZON HOLDINGS LTD	17,923	5.30	94,991.90	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	4,134	4.52	18,685.68	
	SYDNEY AIRPORT CO LTD	9,839	7.07	69,561.73	
	TRANSURBAN GROUP	17,607	12.34	217,270.38	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	4,630	20.15	93,294.50	
	CROWN RESORTS LTD	3,647	12.48	45,514.56	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES	641	61.50	39,421.50	

FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	787	35.51	27,946.37
TABCORP HOLDINGS LIMITED	6,031	4.74	28,586.94
TATTS GROUP LTD	12,822	4.33	55,519.26
REA GROUP LTD	514	63.69	32,736.66
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	5,160	4.35	22,446.00
WESFARMERS LTD	9,746	43.29	421,904.34
WOOLWORTHS LIMITED	11,079	26.25	290,823.75
COCA-COLA AMATIL LIMITED	4,565	9.60	43,824.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	6,426	12.50	80,325.00
COCHLEAR LTD	454	143.45	65,126.30
HEALTHSCOPE LTD	15,913	2.15	34,212.95
RAMSAY HEALTH CARE LTD	1,282	70.20	89,996.40
SONIC HEALTHCARE LTD	3,411	22.50	76,747.50
CSL LIMITED	3,942	133.62	526,730.04
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	25,817	30.65	791,291.05
BANK OF QUEENSLAND LTD	3,432	11.68	40,085.76
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	4,132	12.04	49,749.28
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	15,198	84.40	1,282,711.20
NATIONAL AUSTRALIA BANK LIMITED	23,325	32.52	758,529.00
WESTPAC BANKING CORPORATION	29,517	33.86	999,445.62
AMP LTD	26,617	5.34	142,134.78
ASX LTD	1,545	51.46	79,505.70
CHALLENGER LTD	5,023	13.44	67,509.12
MACQUARIE GROUP LTD	2,803	94.89	265,976.67
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	20,909	6.32	132,144.88
MEDIABANK PRIVATE LTD	24,215	2.94	71,192.10
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	12,484	12.94	161,542.96
SUNCORP GROUP LTD	11,399	14.18	161,637.82
LENLEASE GROUP	4,688	16.49	77,305.12
COMPUTERSHARE LTD	4,758	14.86	70,703.88
TELSTRA CORP LTD	36,766	4.40	161,770.40
TPG TELECOM LTD	2,902	5.78	16,773.56
TPG TELECOM LTD RTS	261	0.53	138.33
VOCUS GROUP LTD	4,401	2.37	10,430.37
AGL ENERGY LTD	6,025	27.61	166,350.25

小計	APA GROUP	9,675	9.43	91,235.25	
	AUSNET SERVICES	15,201	1.74	26,449.74	
	銘柄数：63	671,833		10,422,834.63	(869,994,006)
	組入時価比率：2.6%				2.7%
ニュージーランド・ドル	FLETCHER BUILDING LIMITED	5,598	8.55	47,862.90	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	8,330	7.04	58,643.20	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	3,105	8.48	26,330.40	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	15,484	3.65	56,594.02	
	CONTACT ENERGY LTD	6,718	5.17	34,732.06	
	MERCURY NZ LTD	3,877	3.24	12,561.48	
	MERIDIAN ENERGY LTD	13,531	2.83	38,292.73	
	銘柄数：7	56,643		275,016.79	(21,390,805)
	組入時価比率：0.1%				0.1%
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	23,628	97.10	2,294,278.80	
	NWS HOLDINGS LTD	11,000	14.62	160,820.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	11,000	11.14	122,540.00	
	MTR CORP	12,500	45.10	563,750.00	
	LI & FUNG LTD	52,000	3.24	168,480.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	12,500	34.35	429,375.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	5,500	31.30	172,150.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	20,128	40.50	815,184.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	5,200	17.02	88,504.00	
	SANDS CHINA LTD	20,200	34.80	702,960.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	10,000	11.30	113,000.00	
	SJM HOLDINGS LTD	16,000	7.08	113,280.00	
	WYNN MACAU LTD	16,400	16.18	265,352.00	
	WH GROUP LIMITED	69,500	6.79	471,905.00	
	BANK OF EAST ASIA	12,120	32.15	389,658.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	34,000	32.40	1,101,600.00	
	HANG SENG BANK LTD	6,800	161.60	1,098,880.00	
	FIRST PACIFIC CO	18,000	5.95	107,100.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	10,500	189.30	1,987,650.00	
AIA GROUP LTD	105,787	54.60	5,775,970.20		



	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	23,628	56.20	1,327,893.60	
	HANG LUNG GROUP LTD	8,000	31.50	252,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	21,000	19.22	403,620.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	9,732	48.40	471,028.80	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	6,000	36.45	218,700.00	
	KERRY PROPERTIES LIMITED	4,500	28.70	129,150.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	46,000	9.45	434,700.00	
	SINO LAND CO	28,000	13.00	364,000.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	13,000	116.60	1,515,800.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	4,500	74.00	333,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	10,800	25.45	274,860.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	12,385	65.75	814,313.75	
	WHEELOCK AND COMPANY LTD	7,887	59.50	469,276.50	
	PCCW LTD	37,000	4.38	162,060.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	6,000	67.20	403,200.00	
	CLP HOLDINGS LIMITED	14,000	81.60	1,142,400.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS AND HK ELECTRIC	23,500	7.06	165,910.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	65,442	15.46	1,011,733.32	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	12,500	70.90	886,250.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,800	116.20	209,160.00	
小計	銘柄数：40	828,437		27,931,492.97	
				(404,448,018)	
	組入時価比率：1.2%			1.3%	
シンガポール・ドル	KEPPEL CORP LTD	12,200	6.56	80,032.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	10,700	3.18	34,026.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	13,200	3.85	50,820.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	16,100	1.24	19,964.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	21,000	2.73	57,330.00	
	SATS LTD	4,900	5.14	25,186.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	4,900	10.42	51,058.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	55,500	1.08	60,217.50	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	13,700	3.40	46,580.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	1,000	46.56	46,560.00	
	GOLDEN AGRI RESOURCES LIMITED	70,429	0.36	25,354.44	

	WILMAR INTERNATIONAL LTD	16,900	3.47	58,643.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	15,100	20.42	308,342.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	28,100	10.22	287,182.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	12,000	23.35	280,200.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	6,800	7.43	50,524.00	
	CAPITALAND LTD	23,800	3.62	86,156.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	3,600	10.69	38,484.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	25,300	2.92	73,876.00	
	UOL GROUP LTD	3,900	7.10	27,690.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	70,500	3.75	264,375.00	
	STARHUB LTD	4,200	2.77	11,634.00	
小計	銘柄数：22	433,829		1,984,233.94	
				(159,056,192)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
イスラエル・新 シェケル	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	360	222.50	80,100.00	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	4,641	15.10	70,079.10	
	ELBIT SYSTEMS LTD	190	422.00	80,180.00	
	BANK HAPOALIM LTD	9,735	23.37	227,506.95	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	13,037	17.37	226,452.69	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,198	61.30	73,437.40	
	AZRIELI GROUP	521	205.50	107,065.50	
	NICE LTD	560	263.00	147,280.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	23,588	6.29	148,368.52	
小計	銘柄数：9	53,830		1,160,470.16	
				(36,427,158)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
合計		11,372,869		32,182,164,284	
				(32,182,164,284)	

(注1) 比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(注2) 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注3) 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

## (2) 株式以外の有価証券

(平成29年 5月 8日現在)

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DUET GROUP	22,065	66,636.30	
		小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.0%	22,065	66,636.30 (5,562,131) 0.6%
	香港・ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	36,000	355,680.00	
		小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.0%	36,000	355,680.00 (5,150,246) 0.6%
	合計			10,712,377 (10,712,377)	
	投資証券	米・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	2,789	56,309.91
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT			734	84,285.22	
AMERICAN TOWER CORP			3,737	480,914.53	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT (REIT)			8,710	100,513.40	
AVALONBAY COMMUNITIES INC			1,217	234,576.75	
BOSTON PROPERTIES INC			1,340	166,026.00	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC			2,823	54,596.82	
CAMDEN PROPERTY TRUST			823	67,782.28	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A			4,402	57,886.30	
CROWN CASTLE INTL CORP			3,161	303,203.12	
DIGITAL REALTY TRUST INC			1,338	152,277.78	
DUKE REALTY CORP			3,213	89,546.31	
EQUINIX INC			670	285,587.50	
EQUITY RESIDENTIAL			3,140	205,638.60	
ESSEX PROPERTY TRUST			579	144,964.23	
EXTRA SPACE STORAGE INC			1,094	80,288.66	
FEDERAL REALTY INVS TRUST(REIT)			657	87,236.46	
GGP INC			5,000	111,350.00	
HCP INC			4,134	124,392.06	
HOST HOTELS & RESORTS INC			6,750	122,377.50	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST			46,700	18,680.00	
IRON MOUNTAIN INC			2,111	74,433.86	
KIMCO REALTY CORP			3,655	72,880.70	

	LIBERTY PROPERTY TRUST	1,368	56,101.68	
	MACERICH CO/THE	988	60,900.32	
	MED-AMERICA APARTMENT COMM	948	94,847.40	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1,321	53,328.77	
	PROLOGIS INC	4,721	258,049.86	
	PUBLIC STORAGE	1,328	276,556.00	
	REALTY INCOME CORP	2,214	125,356.68	
	REGENCY CENTERS CORP	1,328	83,225.76	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,059	137,267.58	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	2,764	454,733.28	
	SL GREEN REALTY CORP	884	93,270.84	
	UDR INC	2,187	83,062.26	
	VENTAS INC	3,033	193,353.75	
	VEREIT INC	8,819	69,229.15	
	VORNADO REALTY TRUST	1,462	139,913.40	
	WELLTOWER INC	3,203	223,569.40	
	WEYERHAEUSER CO	6,660	223,443.00	
小計	銘柄数：40	153,064	5,801,957.12	
			(654,112,645)	
	組入時価比率：1.9%		76.4%	
カナダ・ドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,400	32,074.00	
	RIOCAN REIT	1,300	33,436.00	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	600	18,954.00	
小計	銘柄数：3	3,300	84,464.00	
			(6,969,969)	
	組入時価比率：0.0%		0.8%	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	331	27,939.71	
	GECINA SA	373	50,261.75	
	ICADE	370	25,977.70	
	KLEPIERRE	1,996	73,802.10	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	901	206,869.60	
小計	銘柄数：5	3,971	384,850.86	
			(47,598,354)	
	組入時価比率：0.1%		5.5%	
英・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	7,955	52,741.65	
	HAMMERSON PLC	7,175	42,189.00	

小計	INTU PROPERTIES PLC	8,879	23,946.66
	LAND SECURITIES GROUP PLC	7,155	79,420.50
	SEGRO PLC	8,781	42,903.96
	銘柄数：5	39,945	241,201.77 (35,239,578)
	組入時価比率：0.1%		4.1%
オーストラリア・ドル	DEXUS PROPERTY GROUP	8,806	90,261.50
	GOODMAN GROUP	16,041	132,017.43
	GPT GROUP	15,557	81,985.39
	MIRVAC GROUP	27,176	62,504.80
	SCENTRE GROUP	46,439	197,365.75
	STOCKLAND	20,811	100,517.13
	VICINITY CENTRES	26,812	76,146.08
	WESTFIELD CORP	17,362	155,389.90
	小計	銘柄数：8	179,004
	組入時価比率：0.2%		8.7%
香港・ドル	LINK REIT	19,000	1,058,300.00
小計	銘柄数：1	19,000	1,058,300.00 (15,324,184)
	組入時価比率：0.0%		1.8%
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TR	21,800	55,808.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	21,000	33,705.00
	CAPITALAND MALL TRUST	20,700	40,365.00
	SUNTEC REIT	20,100	35,376.00
	小計	銘柄数：4	83,600
	組入時価比率：0.0%		1.5%
合計			847,296,300 (847,296,300)
合計			858,008,677 (858,008,677)

(注1) 比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(注2) 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

(注3) 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

## 有価証券明細表注記

## 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米・ドル	株式 595銘柄	97.0%			63.2%
	投資証券 40銘柄			3.0%	2.0%
カナダ・ドル	株式 88銘柄	99.4%			3.8%
	投資証券 3銘柄			0.6%	0.0%
ユーロ	株式 231銘柄	98.9%			13.1%
	投資証券 5銘柄			1.1%	0.1%
英・ポンド	株式 105銘柄	98.5%			7.1%
	投資証券 5銘柄			1.5%	0.1%
スイス・フラン	株式 39銘柄	100.0%			3.6%
スウェーデン・ク ローナ	株式 31銘柄	100.0%			1.2%
ノルウェー・クロー ネ	株式 10銘柄	100.0%			0.2%
デンマーク・クロー ネ	株式 17銘柄	100.0%			0.7%
オーストラリア・ド ル	株式 63銘柄	91.5%			2.7%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.6%		0.0%
	投資証券 8銘柄			7.9%	0.2%
ニュージーランド・ ドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港・ドル	株式 40銘柄	95.2%			1.3%
	投資信託受 益証券 1銘柄		1.2%		0.0%
	投資証券 1銘柄			3.6%	0.0%
シンガポール・ドル	株式 22銘柄	92.3%			0.5%
	投資証券 4銘柄			7.7%	0.0%
イスラエル・新シェ ケル	株式 9銘柄	100.0%			0.1%

## 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」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は平成29年 5月31日現在です。

### 【純資産額計算書】

動的パッケージファンド<DC年金>

資産総額	223,697,875円
負債総額	351,100円
純資産総額（ - ）	223,346,775円
発行済口数	223,135,845口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0009円

（参考）MHAM日本債券インデックスマザーファンド

資産総額	105,528,729,584円
負債総額	202,128,325円
純資産総額（ - ）	105,326,601,259円
発行済口数	85,972,420,454口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2251円

（参考）MHAM外国債券インデックスマザーファンド

資産総額	11,301,000,593円
負債総額	57,124円
純資産総額（ - ）	11,300,943,469円
発行済口数	9,209,654,752口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2271円

（参考）MHAM TOPIXマザーファンド

資産総額	46,828,406,035円
負債総額	8,327,584円
純資産総額（ - ）	46,820,078,451円
発行済口数	26,302,866,530口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7800円

（参考）MHAM外国株式インデックスマザーファンド



資産総額	33,049,150,994円
負債総額	15,515,172円
純資産総額（ - ）	33,033,635,822円
発行済口数	20,103,542,287口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6432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、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

##### (2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

##### (3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

##### (4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

##### (5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額(平成29年5月末日現在)

資本金	20億円
発行する株式の総数	100,000株（普通株式 上限100,000株、A種種類株式 上限30,000株）
発行済株式の総数	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	

過去5年間における資本金の額の増減はありません。

###### (2) 会社の機構(平成29年5月末日現在)

###### 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5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	1,129,717,130,409
追加型株式投資信託	878	11,742,802,037,081
単位型公社債投資信託	57	312,878,263,207
単位型株式投資信託	121	821,984,601,232
合計	1,094	14,007,382,031,929

## 3【委託会社等の経理状況】

- 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。
- 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。
- 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 準備金	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		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	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの：移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法によっております。 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。 (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。
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業年金制度（キャッシュバランスタイプ）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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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おります。

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おります。

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。

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 其他有価証券」には

含めておりません。

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

（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「その他有価証券」には含めておりません。

## 3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

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（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	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)
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す。

## （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				
	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



その他の関係会社の子会社	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社	東京都千代田区	2億円	金融技術研究等	-	兼務1名	当社預り資産の助言 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 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す。

## 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&amp;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、分析的な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：D I A M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：D I A Mアセットマネジメント株式会社）は、平成28年7月13日付の「統合契約書」に基づき、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、みずほ信託銀行株式会社及び新光投信株式会社と統合した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

#### 利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。

#### (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								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益 準備金	その他利益剰余金					
				別途積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	123,293	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	<p>(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。</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>...</td> <td>6～18年</td> </tr> <tr> <td>車両運搬具</td> <td>...</td> <td>6年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>...</td> <td>3～20年</td> </tr> </table> <p>(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。</p>	建物	...	6～18年	車両運搬具	...	6年	器具備品	...	3～20年
建物	...	6～18年								
車両運搬具	...	6年								
器具備品	...	3～20年								
5．引当金の計上基準	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>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、それぞれ発生翌会計期間から費用処理</p> <p>過去勤務費用：発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理</p> <p>(4)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。</p>									
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>
------------------------------------------------

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。
2. 当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。  
 これに伴い、当中間会計期間末日までに217,608千円を支給し、役員退職慰労引当金全額を取り崩しております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

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

(中間損益計算書関係)

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第32期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

## （金融商品関係）

第32期中間会計期間末（平成28年9月30日現在）

## 金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

## （注1）金融商品の時価の算定方法

## 資 産

## （1）現金・預金

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

## （2）金銭の信託

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

## （3）投資有価証券

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

## 負 債

## （1）未払法人税等

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

## （注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把

握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貸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いません。		

(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IA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	公認会計士	湯原	尚 印
業務執行社員			
指定有限責任社員	公認会計士	山野	浩 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、「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) XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。

## (1)貸借対照表

	(単位： 千円)	
	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	20,801,864	20,903,257
有価証券	127,840	82,540
前払費用	156,891	157,231
未収委託者報酬	1,827,951	2,183,032
未収運用受託報酬	1,812,198	1,713,643
繰延税金資産	185,882	162,369
その他流動資産	159,069	293,051
貸倒引当金	1,092	1,185
流動資産合計	25,070,606	25,493,940
固定資産		
有形固定資産		
建物(純額)	124,850	100,000
工具、器具及び備品(純額)	71,443	90,655
リース資産(純額)	2,140	818
有形固定資産合計	198,434	191,474
無形固定資産		
電話加入権	12,747	12,747
その他無形固定資産	65	35
無形固定資産合計	12,812	12,782
投資その他の資産		
投資有価証券	3,987,168	3,260,206
長期差入保証金	360,258	340,503
前払年金費用	331,766	346,659
会員権	8,400	8,400
その他	23,186	19,551
貸倒引当金	19,534	19,404
投資その他の資産合計	4,691,245	3,955,916
固定資産合計	4,902,492	4,160,172
資産合計	29,973,099	29,654,112
負債の部		
流動負債		
預り金	77,889	29,699
リース債務	2,648	1,202
未払金		
未払収益分配金	746	833
未払償還金	5,716	3,906
未払手数料	819,341	838,064
その他未払金	86,205	9,022
未払金合計	912,009	851,826
未払費用	2,038,097	1,896,033

未払法人税等	393,574	570,376
未払消費税等	426,857	227,078
賞与引当金	328,900	318,000
その他流動負債	3,075	999
流動負債合計	4,183,052	3,895,216
固定負債		
リース債務	2,088	886
役員退職慰労引当金	104,240	147,427
時効後支払損引当金	8,128	6,471
繰延税金負債	306,725	38,000
その他固定負債	6,926	1,931
固定負債合計	428,109	194,716
負債合計	4,611,161	4,089,932
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,045,600	2,045,600
資本剰余金		
資本準備金	2,266,400	2,266,400
その他資本剰余金	2,450,074	2,450,074
資本剰余金合計	4,716,474	4,716,474
利益剰余金		
利益準備金	128,584	128,584
その他利益剰余金		
配当準備積立金	104,600	104,600
退職慰労積立金	100,000	100,000
別途積立金	9,800,000	9,800,000
繰越利益剰余金	7,739,742	8,908,993
利益剰余金合計	17,872,927	19,042,177
自己株式	-	377,863
株主資本合計	24,635,002	25,426,389
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	726,935	137,791
評価・換算差額等合計	726,935	137,791
純資産合計	25,361,937	25,564,180
負債純資産合計	29,973,099	29,654,112

## (2) 損益計算書

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	17,538,139	17,358,667
運用受託報酬	4,463,429	5,050,661
営業収益合計	22,001,569	22,409,329
営業費用		
支払手数料	8,480,510	7,999,728
広告宣伝費	247,790	205,521
公告費	1,140	152
調査費		
調査費	1,259,067	1,312,466
委託調査費	4,883,037	5,299,598
図書費	4,308	3,703
調査費合計	6,146,412	6,615,769
委託計算費	101,919	116,405

営業雑経費		
通信費	59,454	46,151
印刷費	128,143	246
協会費	18,777	20,221
諸会費	2,540	2,317
その他	855,319	958,635
営業雑経費合計	1,064,234	1,027,572
営業費用合計	16,042,008	15,965,148
一般管理費		
給料		
役員報酬	142,983	143,812
給料手当	1,832,723	1,905,880
賞与	295,180	304,122
給料合計	2,270,886	2,353,814
交際費	775	775
寄付金	-	221
旅費交通費	91,851	87,228
租税公課	51,783	76,075
不動産賃借料	339,964	305,351
退職給付費用	126,451	119,608
福利厚生費	368,622	370,689
貸倒引当金繰入	-	93
賞与引当金繰入	319,122	301,698
役員退職慰労引当金繰入	27,249	47,768
固定資産減価償却費	31,216	44,257
諸経費	358,817	269,502
一般管理費合計	3,986,740	3,977,085
営業利益	1,972,819	2,467,095
営業外収益		
受取配当金	7,027	4,242
受取利息	7,340	7,633
有価証券解約益	953	50,674
有価証券償還益	-	56,303
時効到来償還金等	21,856	1,962
時効後支払損引当金戻入額	-	1,311
雑収入	51,171	20,993
営業外収益合計	88,349	143,121
営業外費用		
有価証券解約損	-	278
有価証券償還損	2,197	2,641
ヘッジ会計に係る損失	2,240	-
時効後支払損引当金繰入額	17,685	-
雑損失	63,198	6,767
営業外費用合計	85,321	9,688
経常利益	1,975,847	2,600,528
特別利益		
投資有価証券売却益	10,500	-
特別利益合計	10,500	-
特別損失		
減損損失	1	51,292
事業再構築費用	2	125,173
外国税負担損失	3	53,547
貸倒引当金繰入		19,534
特別損失合計		249,548
税引前当期純利益	1,736,799	2,600,528
法人税、住民税及び事業税	616,760	839,827
法人税等調整額	16,247	40,166
法人税等合計	633,008	879,993
当期純利益	1,103,790	1,720,534

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位: 千円)

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

	株主資本						
	利益剰余金						株主資本合計
	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		
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」としてグループピングを行い、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）

該当するものではありません。

### （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

#### 1. 発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末



普通株式(株)	1,052,070	-	-	1,052,070
---------	-----------	---	---	-----------

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

## 1. 発行済株式に関する事項

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

## 2. 自己株式に関する事項

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

## (変動事由の概要)

平成28年1月6日の株主総会決議による自己株式の取得 13,662株

## 3. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

## (リース取引関係)

## 1. ファイナンス・リース取引(借主側)

所有権移転外ファイナンス・リース取引

リース資産の内容

有形固定資産

主として、事務用機器及び車両運搬具であります。

リース資産の減価償却の方法

重要な会計方針「3. 固定資産の減価償却方法」に記載のとおりであります。

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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、定期的に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います。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 その他有価証券	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 その他有価証券	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	投資有価証券	131,145	-	3,325
	売建 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	投資有価証券	117,467	-	147
	売建 買建	投資有価証券	179,836	-	1,711
合計			297,303	-	1,564

(注) 時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

(退職給付関係)

### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

### 2. 確定給付制度

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

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

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

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

#### (3) 退職給付費用

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

### 3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

#### 1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
繰延税金資産		
有価証券償却超過額	4,795千円	4,551千円

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

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

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

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

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

#### （資産除去債務関係）

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

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

#### （セグメント情報等）

##### [セグメント情報]

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

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

##### [関連情報]

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

##### 1. 製品及びサービスごとの情報

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

##### 2. 地域ごとの情報

###### （1）売上高

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

###### （2）有形固定資産

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

##### 3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

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

当事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 売上高

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

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

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

## [ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当するものはありません。

## (関連当事者情報)

## 1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

上記の取引については、一般取引条件と同様に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ  
（東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

## （1株当たり情報）

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

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

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		12,767
投資その他の資産		
投資有価証券		815,525
繰延税金資産		73,719
その他		638,830
貸倒引当金		19,404
投資その他の資産合計		1,508,671
固定資産合計		1,584,410
資産合計		10,266,360
負債の部		
流動負債		
未払金		793,859
未払費用		1,675,771
未払法人税等		253,697
賞与引当金		319,200
その他		221,869
流動負債合計		3,264,398



固定負債	
役員退職慰労引当金	57,860
時効後支払損引当金	7,256
固定負債合計	65,116
負債合計	3,329,515
純資産の部	
株主資本	
資本金	2,045,600
資本剰余金	
資本準備金	2,266,400
その他資本剰余金	1,103,259
資本剰余金合計	3,369,659
利益剰余金	
利益準備金	128,584
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	1,777,567
利益剰余金合計	1,906,152
自己株式	377,863
株主資本合計	6,943,548
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	6,703
評価・換算差額等合計	6,703
純資産合計	6,936,845
負債純資産合計	10,266,360

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第54期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

(単位： 千円)

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

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

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

## 重要な会計方針

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却方法

## (1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

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

## (2) 賞与引当金

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

## (3) 退職給付引当金（前払年金費用）

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

## (4) 役員退職慰労引当金（執行役員に対する退職慰労引当金）

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

## (5) 時効後支払損引当金

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

## 4. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

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

## 5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

## 追加情報

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

## 注記事項

（中間貸借対照表関係）

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

（中間損益計算書関係）

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第54期中間会計期間(自平成28年4月1日至平成28年9月30日)

## 1 発行済株式に関する事項

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

## 2 自己株式に関する事項

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

## 3 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

(金融商品関係)

第54期中間会計期間(平成28年9月30日)

## 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位: 千円)

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

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

## 資 産

## (1) 現金及び預金

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

## (2) 未収委託者報酬及び(3) 未収運用受託報酬

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

## (4) 投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

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

## 負 債

## (1) 未払手数料

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

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

区分	中間貸借対照表計上額（千円）
非上場株式	60,720

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

（有価証券関係）

第54期中間会計期間（平成28年9月30日）

1 その他有価証券

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

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第54期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第54期中間会計期間（自平成28年4月1日至平成28年9月30日）

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

（１）売上高

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

（２）有形固定資産

有形固定資産はすべて本邦に所在しております。

3 主要な顧客ごとの情報

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

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

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

（１株当たり情報）

1株当たり純資産額は、以下のとおりであります。

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

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

#### (重要な後発事象)

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

##### 1. 企業結合日

平成28年10月1日

##### 2. 企業結合の方法

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

#### (参考) 新光投信株式会社の経理状況

##### 1. 財務諸表の作成方法について

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

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

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

##### 2. 監査証明について

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

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

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

新光投信株式会社  
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 伊藤 志保

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 福村 寛

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

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

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

#### 強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

#### 利害関係

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

以上

- ( ) 1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. X B R Lデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月13日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている新光投信株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第57期事業年度の間会計期間(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) XBR 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

当事業年度



(平成27年3月31日)

(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

当事業年度

(平成27年3月31日)

(平成28年3月31日)

## 負債の部

## 流動負債

預り金	17,893	19,103
リース債務	345	-

未払金				
未払収益分配金		160		152
未払償還金		5,083		4,216
未払手数料	1	1,558,682	1	1,360,372
その他未払金		952,018		516,568
未払金合計		2,515,945		1,881,309
未払費用		722,806		746,430
未払法人税等		1,222,883		857,031
賞与引当金		451,000		547,750
役員賞与引当金		66,000		44,000
外国税支払損失引当金		184,111		-
訴訟損失引当金		30,000		40,000
流動負債合計		5,210,985		4,135,625
固定負債				
繰延税金負債		89,752		-
退職給付引当金		155,806		146,617
役員退職慰労引当金		39,333		48,333
執行役員退職慰労引当金		63,916		85,916
固定負債合計		348,809		280,867
負債合計		5,559,794		4,416,492
純資産の部				
株主資本				
資本金		4,524,300		4,524,300
資本剰余金				
資本準備金		2,761,700		2,761,700
資本剰余金合計		2,761,700		2,761,700
利益剰余金				
利益準備金		360,493		360,493
その他利益剰余金				
別途積立金		8,900,000		8,900,000
繰越利益剰余金		3,981,245		4,185,368
利益剰余金合計		13,241,738		13,445,861
自己株式		72,415		-
株主資本合計		20,455,322		20,731,861
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		282,685		94,744
評価・換算差額等合計		282,685		94,744
純資産合計		20,738,008		20,826,605
負債純資産合計		26,297,802		25,243,098

## (2) 損益計算書

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)		(自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		35,876,795		39,283,623
運用受託報酬		238,412		232,145
営業収益合計		36,115,207		39,515,769
営業費用				
支払手数料	1	18,252,669	1	19,472,734
広告宣伝費		456,430		507,020
公告費		548		469
調査費				
調査費		623,792		841,825
委託調査費		5,966,340		7,419,125
図書費		5,254		4,879
調査費合計		6,595,388		8,265,830
委託計算費		1,352,318		1,711,366
営業雑経費				
通信費		32,335		30,454
印刷費		103,093		1,022
協会費		18,150		19,367
諸会費		3,300		3,117
その他		41,594		44,518
営業雑経費合計		198,475		98,480
営業費用合計		26,855,830		30,055,901
一般管理費				
給料				
役員報酬		96,445		91,205
給料・手当		1,368,552		1,480,875
賞与		336,076		428,776
給料合計		1,801,073		2,000,857
交際費		11,426		10,708
寄付金		3,198		2,346
旅費交通費		100,386		109,240
租税公課		68,508		90,795
不動産賃借料		206,753		205,671
賞与引当金繰入		451,000		547,750
役員賞与引当金繰入		66,000		22,000
役員退職慰労引当金繰入		24,930		22,210
退職給付費用		191,900		169,238
減価償却費		70,676		102,532
諸経費		573,824		647,510
一般管理費合計		3,569,678		3,930,859
営業利益		5,689,698		5,529,008

(単位：千円)

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

## (3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本
--	------

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

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

当事業年度（自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本				
		資本剰余金		利益剰余金	
		その他	資本		その他利益剰余金

	資本金	資本 準備金	資本 剰余金	剰余金 合計	利益 準備金	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	利益 剰余金 合計				
	繰越 利益 剰余金					
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、通常の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 其他有価証券	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 其他有価証券	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 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)

	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 其他有価証券	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
	(1) 株式	-	-	-

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	(2)債券			
	国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3)その他	5,040,450	5,153,936	113,485
	小計	5,040,450	5,153,936	113,485
合計		6,159,600	6,023,210	136,389

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

### 3. 売却したその他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

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

当事業年度(平成28年3月31日)

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

### 4. 減損処理を行った有価証券

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

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

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

(退職給付関係)

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

## (2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

## (4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

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

## (5)年金資産に関する事項

	前事業年度	当事業年度
	(平成27年3月31日)	(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	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)
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

当事業年度

(平成27年3月31日)

(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の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。

	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	1 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、記載しておりません。

#### (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執行役員に対して、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

平成28年9月7日付で、株式に関する事項等の定款の変更を行いました。

平成28年10月1日に、DIAMアセットマネジメント株式会社は、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更しました。なお、当該統合に伴い、監査等委員会設置会社に移行しました。

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

#### 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

名称		資本金の額 (百万円)	事業の内容
(1) 受託会社	みずほ信託銀行株式会社	247,369	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を行っています。
(2) 販売会社	株式会社みずほ銀行	1,404,065	銀行法に基づき監督官庁の免許を受け、銀行業を営んでいます。

(注) 資本金の額 平成29年3月末日現在

## 2【関係業務の概要】

## (1) 受託会社

当ファンドの受託会社として、信託財産を保管・管理し、受益権設定にかかる振替機関への通知等を行います。

## (2) 販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、販売、一部解約の実行の請求の受付けならびに収益分配金の再投資、償還金および一部解約金の支払い等を行います。

## 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。)

## &lt;参考：再信託受託会社の概要&gt;

名称 : 資産管理サービス信託銀行株式会社

業務の概要 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（資産管理サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

## 第3【その他】

(1) 目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載する場合があります。

(2) 有価証券届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」に記載の内容について、投資家の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関する箇所に記載することがあります。また、第二部「ファンド情報」第1「ファンドの状況」5「運用状況」について、有価証券届出書提出後の随時入手可能な直近の情報および同情報についての表での表示に加えて、グラフで表示した情報を目論見書に添付することがあります。

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

(4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。

(6)ファンドは、投資信託評価会社よりファンドの評価を取得し、販売用資料等に使用することがあります。また、販売用資料等において、ファンドの運用実績を表示することがあります。

(7)交付目論見書に以下の内容を記載することがあります。

- ・委託会社の金融商品取引業者登録番号は「金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第324号」であること。
- ・投資信託説明書（交付目論見書）の使用開始日。
- ・ご購入の際には投資信託説明書（交付目論見書）を十分お読みいただきたい旨。
- ・ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨。
- ・ファンドに関する投資信託説明書（請求目論見書）を含む詳細な情報は委託会社のホームページにおいて閲覧することができる旨。約款の全文は投資信託説明書（請求目論見書）に掲載されている旨。
- ・ファンドにおいて投資家が支払うべき対価（手数料等）の概要として、有価証券届出書第二部「ファンド情報」第1「ファンドの状況」4「手数料等及び税金」を要約した内容、およびその他の費用ならびに手数料等の金額・合計額（それらの上限額を含む。）またはそれらの計算方法については、あらかじめ表示できない旨およびその理由。

## 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7月6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

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、「ファンドの経理状況」に掲げられている動的パッケージファンド<DC年金>の平成28年5月10日から平成29年5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、動的パッケージファンド<DC年金>の平成29年5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、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。