

【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28年9月15日提出
【発行者名】	D I A Mアセットマネジメント株式会社（平成28年10月1日より、アセットマネジメントOne株式会社（予定））
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 西 恵正（平成28年10月1日より、取締役社長 西 恵正（予定））
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内三丁目3番1号（平成28年10月1日より、東京都千代田区丸の内一丁目8番2号（予定））
【事務連絡者氏名】	上野 圭子
【電話番号】	03-3287-3110（平成28年10月1日より、03-6774-5100（予定））
【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】	ニュー トピックス インデックス
【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28年10月1日から平成29年5月22日まで) 3兆円を上限とします。
【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】

ニュー トピックス インデックス

(以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。)

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

(イ) 追加型株式投資信託（契約型）の受益権です。

(ロ) 当初元本は1口当たり1円です。

(ハ) D I A Mアセットマネジメント株式会社（平成28年10月1日より、アセットマネジメントOne株式会社となります（予定）。以下、新会社名を記載します。）（以下「委託者」または「委託会社」といいます。）の依頼により信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付け、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付けはありません。

ファンドの受益権は、「社債、株式等の振替に関する法律」（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関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。）。委託者は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

3兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

(イ) 発行価格は、取得申込受付日の基準価額です。

なお、ファンドの基準価額については1万口当たりの価額を発表します。

「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た金額（純資産総額）をそのときの受益権口数で除した1口当たりの純資産価額をいいます。基準価額は、組み入れる有価証券等の値動きにより日々変動します。

(ロ) 基準価額は毎営業日に算出されますので、販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

(注) 委託者に対する照会先の情報は、平成28年10月1日現在（予定）のものです。（以下同じ）。

基準価額は、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、お問い合わせいただけます基準価額は、前日以前のものとなります。

（５）【申込手数料】

申込手数料は、取得申込受付日の基準価額に、2.16%（税抜2.0%）を上限として販売会社がそれぞれ独自に定める手数料率を乗じて得た金額となります。商品および投資環境の説明・情報提供、購入の事務手続きなどの対価として販売会社にお支払いいただきます。当該手数料には消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）（8%）が含まれません。

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

ファンドの受益権の取得申込者が「償還乗り換え」¹または「償還前乗り換え」²によりファンドの受益権を取得する場合、申込手数料の優遇を受けることができる場合があります。

ただし、上記の申込手数料の優遇に関しては、優遇制度の取り扱い、優遇の内容、優遇を受けるための条件等は販売会社ごとに異なりますので、詳しくは各販売会社でご確認ください。

- 1 「償還乗り換え」とは、取得申込受付日前の一定期間内に既に償還となった証券投資信託の償還金等をもって、その支払いを行った販売会社でファンドの受益権を取得する場合をいいます。
- 2 「償還前乗り換え」とは、償還することが決定している証券投資信託の償還日前の一定期間内において、当該証券投資信託の一部解約金をもって、その支払いを行った販売会社でファンドの受益権を取得する場合をいいます。

（６）【申込単位】

お申込単位は、販売会社またはお申込コースにより異なります。

お申込コースには、収益の分配時に分配金を受け取るコース（「分配金受取コース」）と、分配金が税引き後無手数料で再投資されるコース（「分配金再投資コース」）の2コースがあります。ただし、販売会社によっては、どちらか一方のみの取り扱いとなる場合があります。

詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

（７）【申込期間】

平成28年10月1日から平成29年5月22日までです。

なお、申込期間は原則として更新されます。

（ 8 ）【申込取扱場所】

申し込みの取扱場所（販売会社）については、下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

（ 9 ）【払込期日】

ファンドの受益権の取得申込者は、申込金額に手数料および当該手数料にかかる消費税等を加算した金額を販売会社が指定する期日までに支払うものとします。

各取得申込受付日ごとの申込金額の総額は、販売会社によって、当該追加信託が行われる日に委託者の指定する口座を經由して、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託者」または「受託会社」といいます。）の指定するファンドの口座に払い込まれます。

（ 10 ）【払込取扱場所】

払い込みの取り扱いを行う場所は、販売会社となります。詳しくは販売会社でご確認ください。

（ 11 ）【振替機関に関する事項】

ファンドの振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

（ 12 ）【その他】

（イ）申込証拠金

ありません。

（ロ）日本以外の地域における発行

ありません。

（ハ）振替受益権について

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

ファンドの分配金、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。

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】

a. ファンドの目的及び基本的性格

当ファンドは追加型投信 / 国内 / 株式 / インデックス型に属し、主としてわが国の株式に実質的に投資し、わが国の株式市場の動きと投資信託財産の長期的な成長をとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）をモデルとして運用を行います。

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品分類において、以下のように分類・区分されます。

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)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
		不動産投信	
追加型	内外	その他資産 ()	特殊型
		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。

商品分類の定義

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の投資信託財産とともに運用されるファンドをいう。
国内	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
株式	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の定義

その他資産(投資信託証券(株式 一般))	投資信託証券への投資を通じて、実質的に株式 一般に投資を行います。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
日本	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズ)にのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。

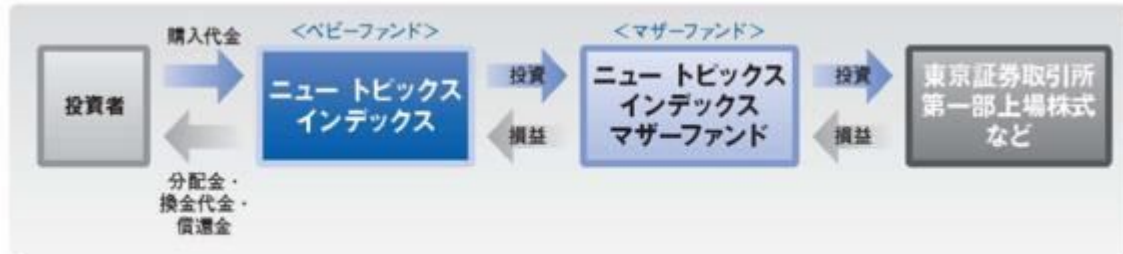
当ファンドはファミリーファンド方式で運用します。このため、組み入れている資産を示す「属性区分表」の投資対象資産(その他資産(投資信託証券))と、収益の源泉となる資産を示す「商品分類表」の投資対象資産(株式)とは異なります。

商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)をご参照ください。

ファンドの仕組み

当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

「ファミリーファンド方式」とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をベビーファンド（当ファンド）としてとりまとめ、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行う仕組みです。マザーファンドの損益はベビーファンドに反映されます。



※ベビーファンド（当ファンド）で東京証券取引所第一部上場株式などを直接組み入れる場合があります。

b. ファンドの特色

主としてニュー トピックス インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」という場合があります。）を通じて東京証券取引所第一部上場株式に投資し、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。

当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

当ファンドおよびマザーファンドにおける株式の運用については、原則として東京証券取引所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい、約200銘柄以上の株式に分散投資を行います。

資金の流出入に伴う売買にあたっては、原則として東京証券取引所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら、当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい売買を行います。

株式の実質組入比率は、高位を保ちますので、基準価額は大きく変動することがあります。

東証株価指数（TOPIX）とは

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銘柄の時価総額を指数化し、株価の変動をとらえようとするものです。東証株価指数は、昭和43年1月4日（基準時）の時価総額を100として昭和44年7月1日から株式会社東京証券取引所が算出・公表しています。

東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関わるすべての権利は株式会社東京証券取引所が有しています。株式会社東京証券取引所は、TOPIXの算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの算出若しくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行う権利を有しています。

株式会社東京証券取引所は、当ファンドの設定または売買に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

東証株価指数（TOPIX）の特徴

1. 東証第一部上場の全銘柄を対象として算出しますので、市場全体の動きを確実に表しま

す。

2. 各銘柄の上場株式数を考慮していますので、一部の小型値がさ株の動きに影響されにくい性質です。

なお、新規上場、上場廃止、増資などの市場変動以外の要因により、時価総額が変わる場合には、基準時の時価総額を修正して指数の連続性を維持します。

・東証株価指数(TOPIX)の算出方法

$$\text{毎日の指数} = \frac{\text{当日の時価総額}}{\text{基準時の時価総額}} \times 100$$

・基準時の時価総額の修正方法

$$\text{修正後の基準時価総額} = \text{修正前日の基準時価総額} \times \frac{\text{修正前日の時価総額} \pm \text{修正額}}{\text{修正前日の時価総額}}$$

市況動向に急激な変化が生じたときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限

株式への投資割合	株式への実質投資割合には制限を設けません。
同一銘柄の株式への投資割合	同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資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割合	外貨建資産への投資は行いません。

分配方針

原則として、年1回(毎年2月22日。休業日の場合は翌営業日。)の決算時に、収益の分配を行います。



分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。

分配金額は、運用実績を考慮し、原則として利子・配当等収益を中心に決定いたします。

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

運用状況により分配金額は変動します。また、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。

上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

c. 信託金限度額

委託者は、受託者と合意のうえ、金1,000億円を限度として信託金を追加することができます。

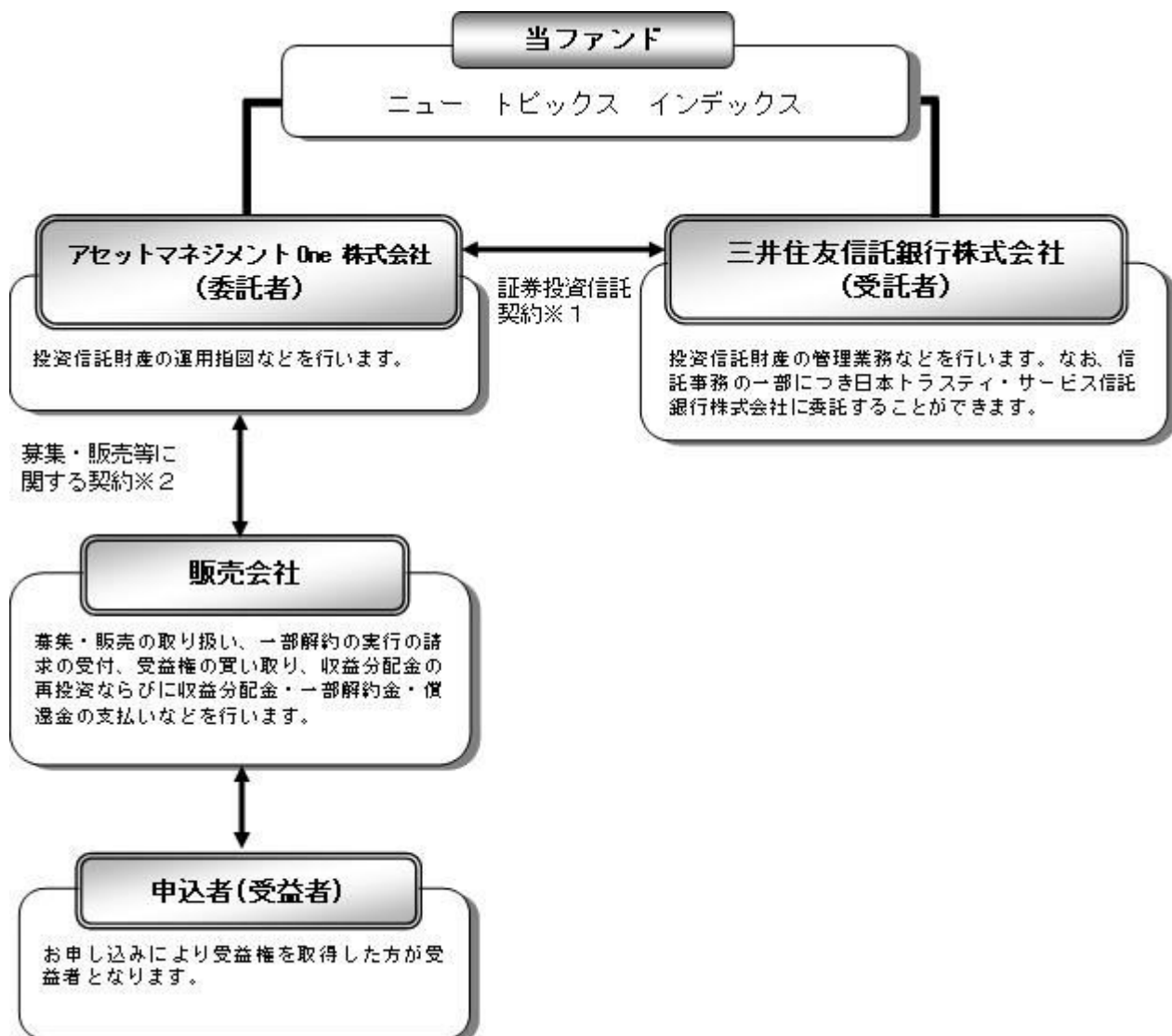
委託者は、受託者と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。

(2) 【ファンドの沿革】

平成元年2月23日	投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
平成11年1月20日	約款変更（運用の基本方針および信託期間の変更）
平成12年11月15日	関東財務局長に対して有価証券届出書提出
平成13年12月20日	新たな投資対象として「ニュー トピックス インデックス マ ザーファンド」を加える旨の約款変更の届出
平成28年10月1日	ファンドの委託会社としての業務を新光投信株式会社からアセッ トマネジメントOne株式会社に承継（予定）

(3) 【ファンドの仕組み】

a. ファンドの仕組み



1 証券投資信託契約

委託者と受託者との間において「証券投資信託契約（投資信託約款）」を締結しており、委託者および受託者の業務、受益者の権利、受益権、投資信託財産の運用・評価・管理、収益の分配、信託の期間・償還等を規定しています。

2 募集・販売等に関する契約

委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

b. 委託会社の概況

(イ) 資本金の額 20億円（平成28年10月1日現在（予定））

(ロ) 委託会社の沿革

昭和60年7月1日	会社設立
平成10年3月31日	証券投資信託法に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
平成10年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
平成11年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブルリュ・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D I A M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	D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更（予定）

(ハ) 大株主の状況

（平成28年10月1日現在（予定））

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

a. 基本方針

当ファンドは、わが国の株式市場の動きと投資信託財産の長期的な成長をとらえることを目標に、東証株価指数をモデルとして運用を行います。

b. 運用の方法

(イ) 主要投資対象

ニュー トピックス インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券ならびに東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とします。

(ロ) 投資態度

主としてマザーファンドへの投資を通してわが国の上場株式へ投資します。株式への投資にあたっては、投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行います。

- (a) 株式の運用につきましては、原則として東京証券取引所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい、約200銘柄以上の株式に分散投資を行います。
- (b) 資金の流入に伴う売買にあたっては、原則として東京証券取引所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら、当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい売買を行います。
- (c) 株式の実質組入比率は、高位を保ちます。

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、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、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の有価証券指数等先物取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。

株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の投資信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の投資信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。ただし、市況動向に急激な変化が生じたときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用ができない場合があります。

(八) 主な投資制限

株式への実質投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資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。

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投資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したがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

マザーファンドの運用方針

ニュー トピックス 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、東証株価指数に連動する投資成果をめざした運用を行います。

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投資対象とします。

(2) 投資態度

投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、原則として東京証券取引所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら当社独自のポートフォリオ構築モデ

ルにしたがい、約200銘柄以上の株式に分散投資を行います。

資金の流出入に伴う売買にあたっては、原則として東京証券取引所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら、当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい売買を行います。

株式の組入比率は、高位を保ちます。

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、有価証券先物取引等を行うことができます。

投資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、スワップ取引を行うことができます。

株式以外の資産への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。ただし、市況動向に急激な変化が生じたときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用ができ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。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資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。

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投資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したがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3. 収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

(2) 【投資対象】

a. 運用の指図範囲

委託者は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）で市場性のあるものに投資することを指図します。また、保有する有価証券（投資信託及び投資法人に関する法律施行規則に規定するものに限りません。）をもってマザーファンドの受益証券へ投資することを指図することができます。ただし、余裕金については、預金、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。）、コール・ローン、手形割引市場において売買される手形、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号で定めるものにより運用することの指図ができます。

1. 株券、新株引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の証券の性質を有するもの
4. 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せん。）
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

なお、第1号の証券または証書を以下「株式」といいます。

b. 先物

(イ) 委託者は、投資信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所ならびに外国の市場における邦貨建ての株式、株価指数にかかる先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イおよびロに掲げるものをいいます。）およびオプション取引（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。）を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売り建ておよびコール・オプションの売り付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買い建ておよびプット・オプションの売り付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）を限度とし、余裕金ならびに当日の取得申込口数が一部解約の実行の請求にかかる口数を上回る口数に相当する金額であると委託者において判断した額の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買い付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の投資信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

(ロ) 委託者は、投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、現物オプション取引は預金に限るものとします。

1. 先物取引の売り建ておよびコール・オプションの売り付けの指図は、建玉の合計額がヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買い建ておよびプット・オプションの売り付けの指図は、建玉の合計額が、余裕金の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買い付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の投資信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

c. スワップ

(イ) 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件を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。

(ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その

超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

(ニ) 上記(ハ)において投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

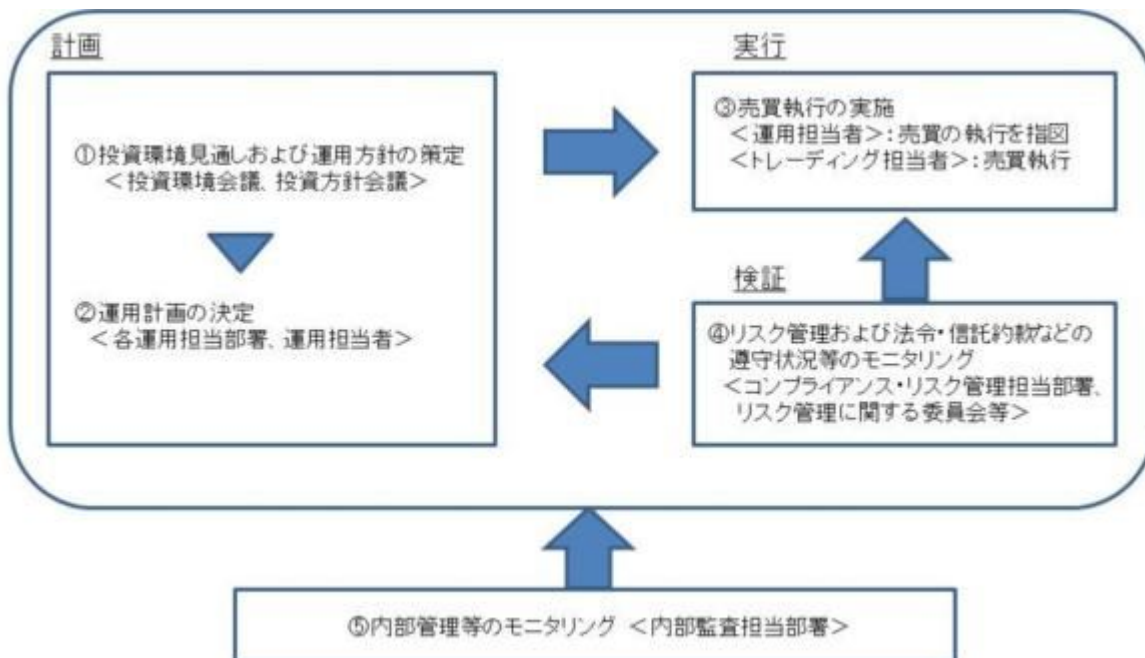
(ホ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

(ヘ) 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとします。

(3) 【運用体制】

委託会社（平成28年10月1日現在（予定））における当ファンドの運用体制については、以下のとおりです。

a. ファンドの運用体制



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。

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b．ファンドの関係法人に関する管理

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

c．運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は、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】

a．収益分配は年1回、原則として、2月22日（該当日が休業日の場合は翌営業日。）の決算時に以下の方針に基づき収益の分配を行います。

- 1．分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- 2．分配金額は、運用実績を考慮し、原則として利子・配当等収益を中心に決定します。
- 3．留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

b．投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

- 1．配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の配当金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
- 2．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

- c．毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。
- d．「分配金受取コース」の受益者の分配金は原則として、決算日から起算して5営業日まで、受益者に支払われます。なお、平成19年1月4日以降においても、時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引き換えに受益者に支払われます。
「分配金再投資コース」の受益者の分配金は、税金を差し引いた後、別に定める契約に基づき、全額再投資されます。

(5) 【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

- a．株式への投資割合
株式への実質投資割合には制限を設けません。
- b．同一銘柄への投資割合
委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資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。
投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- c．外貨建資産への投資割合
外貨建資産への投資は行いません。
- d．投資する株式の範囲
委託者が投資することを指図する株式は、わが国の取引所に上場されている株式の発行会社の発行する株式とします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。
- e．信用取引の指図範囲
 - (イ) 委託者は、投資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、株券の引き渡しまたは買い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。
 - (ロ) 信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - 1．投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - 2．株式分割により取得する株券
 - 3．有償増資により取得する株券
 - 4．売出しにより取得する株券
 - 5．投資信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。以下同じ。）の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
 - 6．投資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、または投資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（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券
- f．有価証券の貸し付けの指図および範囲

- (イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式を下記(ロ)の範囲内で貸し付けの指図をすることができます。
- (ロ) 株式の貸し付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- (ハ) 上記(ロ)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、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。
- (ニ) 委託者は、有価証券の貸し付けにあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

g. 資金の借入れ

- (イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、投資信託財産において一部解約金の支払資金に不足額が生じるときは、資金借入れ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。
- (ロ) 資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
 1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受け取りの確定している資金の額の範囲内。
 2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内。
 3. 借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%以内。
- (ハ) 借入期間は、有価証券等の売却代金の入金日までに限るものとします。
- (ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

h. 受託者の自己または利害関係人等との取引

- (イ) 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人、信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の投資信託財産との間で、約款に定める範囲内での資産への投資を、信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない限り行うことができます。
- (ロ) 上記(イ)の取り扱いは、約款に定める範囲内での委託者の指図による取引についても同様とします。

i. デリバティブ取引等に係る投資制限

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

j. 信用リスク集中回避のための投資制限

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投資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、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

法令に定める投資制限

a. 同一の法人の発行する株式

委託者は、同一の法人の発行する株式を、その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、投資信託財産をもって取得することを受託者に指図しないものとします。

(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

3【投資リスク】

(1) ファンドのもつリスク

当ファンドは、株式など値動きのある証券に、マザーファンドを通じてまたは直接投資します。これらの投資対象証券には、主として次のような性質があり、当ファンドの基準価額を変動させる要因となります。

これらの運用による損益は、すべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。なお、投資信託は預貯金とは異なります。

a．株価変動リスク

株価変動リスクとは、株式市場が国内外の政治、経済、社会情勢の変化、金利動向、発行企業の業績・経営状況の変化、市場の需給関係などの影響を受けて下落するリスクをいいます。当ファンドは、株式にマザーファンドを通じてまたは直接投資し、株式の実質組入比率を原則として高位に保ちますので、株式市場の動きにより、当ファンドの基準価額は変動します。一般に株式市場が下落した場合には、その影響を受け当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

b．信用リスク

信用リスクとは、当ファンドがマザーファンドを通じてまたは直接投資する短期金融商品の発行体が財政難、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発生した場合、または予想される場合には、短期金融商品の価格は下落します。また、発行体の格付けの変更に伴い価格が下落するリスクもあります。

また、当ファンドがマザーファンドを通じてまたは直接投資する株式の発行企業が、業績悪化、経営不振あるいは倒産などに陥った場合には、その企業の株式の価値が大きく減少すること、もしくは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。これらの影響を受け当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

c．流動性リスク

流動性リスクとは、有価証券などを売買しようとする場合、需要または供給が乏しいために、有価証券などを希望する時期に、希望する価格で、希望する数量を売買することができないリスクをいいます。当ファンドまたはマザーファンドが売買しようとする有価証券などの市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合、希望する売買が希望する価格でできない可能性があります。特に流動性の低い有価証券などを売却する場合には、その影響を受け当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

d．金利変動リスク

金利変動リスクとは、金利変動により債券価格が変動するリスクをいいます。金利水準の大きな変動は、株式市場に影響を及ぼす場合があり、債券市場のほかに株式市場を通じても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。

e．基準価額と東証株価指数のかい離

当ファンドは、東証株価指数との連動を目指して運用を行いますが、当ファンドの基準価額の値動きと東証株価指数の動向との間には若干のかい離が生ずることがあります。これは主に次の要因によるものです。

- ・ 信託報酬などの管理費用および株式売買委託手数料などの取引コストの負担
- ・ 東証株価指数の対象銘柄を当ファンドが全て組み入れているものではないことや当ファンドの先物取引の利用により、当ファンドと東証株価指数の構成に違いがあることによるもの

- ・東証株価指数と先物価格の連動性の差によるもの
- ・東証株価指数の算出株価と当ファンドの株式売買時の約定価格との差によるもの
- ・解約資金などに対応するため、当ファンドが現金を保有していることによるもの

f．他のベビーファンドの影響

当ファンドが投資対象とするマザーファンドを同じく投資対象としている他のファンド（ベビーファンド）において、設定・解約や資産構成の変更などによりマザーファンドの組入有価証券などに売買が生じた場合、その売買による組入有価証券などの価格の変化や売買手数料などの負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。これにより、マザーファンドの基準価額が下落した場合には、その影響を受け当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

g．投資信託に関する一般的ナリスクおよびその他の留意点

(イ) 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。

(ロ) 法令や税制が変更される場合に、投資信託を保有する受益者が不利益を被る可能性があります。

(ハ) 投資信託財産の状況によっては、目指す運用が行われなことがあるあります。また、投資信託財産の減少の状況によっては、委託者が目的とする運用が困難と判断した場合、安定運用に切り替えることがあります。

(ニ) 投資した資産の流動性が低下し、当該資産の売却・換金が困難になる場合などがあります。その結果、投資者の換金請求に伴う資金の手当てに支障が生じる場合などには、換金のお申し込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた換金のお申し込みを取り消す場合があります。

(ホ) 短期間に相当金額の解約申込があった場合には、解約資金を手当てするために組入有価証券を市場実勢より大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となり、損失を被ることがあります。

(ヘ) 証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化もしくは政策の変更などの諸事情により閉鎖されることがあります。これにより当ファンドの運用が影響を被って基準価額の下落につながる可能性があります。

(ト) 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。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。

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。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払い戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

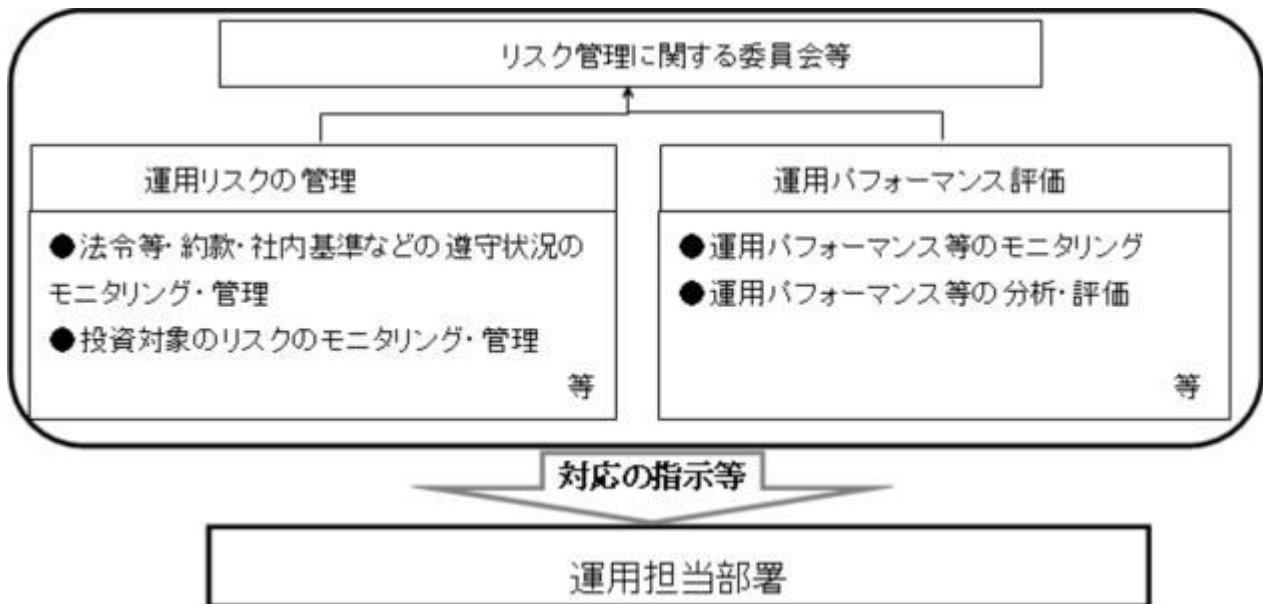
(2) リスク管理体制

委託会社（平成28年10月1日現在（予定））における当ファンドの投資リスクに対する管理体制については、以下のとおりです。

- ・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、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及び分配金再投資基準価額の推移

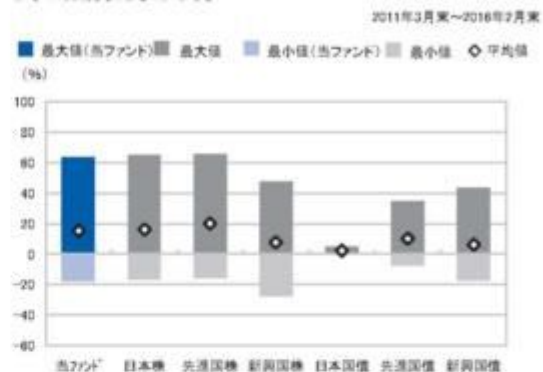


※分配金再投資基準価額は、2011年3月末の基準価額を10,000として指数化しております。
 ※年間騰落率は、2011年3月から2016年2月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

※分配金再投資基準価額は、取引前の分配金を当ファンドに再投資したとみなして計算した理論上のものであり、実際の基準価額とは異なります。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。



※最大の騰落率(当ファンド) 最大の騰落率 最小の騰落率(当ファンド) 最小の騰落率 ○平均値

当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	63.7	66.0	85.7	47.4	5.1	34.9
最小値	△17.6	△17.0	△15.6	△27.4	0.4	△7.5
平均値	15.3	16.2	20.0	7.7	2.3	10.3

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※2011年3月から2016年2月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

※決算日に対応した数値とは異なります。

※当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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-KOKUSAI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・グローバル・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(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)(配当込み)

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Index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。

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)

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)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Index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。

NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、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。

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。

なお、シティ世界国債インデックスに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。

JPモルガン・グローバル・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)

JPモルガン・グローバル・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、JPモルガン・グローバル・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。
 本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込手数料は、取得申込受付日の基準価額に、2.16%（税抜2.0%）を上限として販売会社がそれぞれ独自に定める手数料率を乗じて得た金額となります。商品および投資環境の説明・情報提供、購入の事務手続きなどの対価として販売会社にお支払いいただきます。当該手数料には消費税等（8%）が含まれます。

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

ファンドの受益権の取得申込者が「償還乗り換え」¹または「償還前乗り換え」²によりファンドの受益権を取得する場合、申込手数料の優遇を受けることができる場合があります。

ただし、上記の申込手数料の優遇に関しては、優遇制度の取り扱い、優遇の内容、優遇を受けるための条件等は販売会社ごとに異なりますので、詳しくは各販売会社でご確認ください。

1「償還乗り換え」とは、取得申込受付日前の一定期間内に既に償還となった証券投資信託の償還金等をもって、その支払いを行った販売会社でファンドの受益権を取得する場合をいいます。

2「償還前乗り換え」とは、償還することが決定している証券投資信託の償還日前の一定期間内において、当該証券投資信託の一部解約金をもって、その支払いを行った販売会社でファンドの受益権を取得する場合をいいます。

（2）【換金（解約）手数料】

換金時の手数料はありません。

（3）【信託報酬等】

日々のファンドの純資産総額に年率0.648%（税抜0.6%）以内を乗じて得た額とします。

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投資信託財産から支払われます。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

< 信託報酬の配分 >

委託者	年率0.25%（税抜）	委託した資金の運用、基準価額の算出などの対価
販売会社	年率0.25%（税抜）	購入後の情報提供、運用報告書など各種書類の送付、分配金・償還金・換金代金支払などの事務手続きなどの対価
受託者	年率0.10%（税抜）	運用財産の管理、委託者からの指図の実行などの対価

（4）【その他の手数料等】

a. 投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、監査法人に支払うファンド

の監査報酬、当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額および受託者の立て替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支払われます。

監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、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投資信託財産中から支払われます。

b．証券取引に伴う手数料・税金等、当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、投資信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料にかかる消費税等、資産を外国で保管する場合の費用および先物取引・オプション取引等に要する費用についても投資信託財産が負担します。

c．「その他の手数料等」については、定率でないもの、定時に見直されるもの、売買条件などに応じて異なるものなどがあるため、当該費用および合計額などを表示することができません。

手数料などの合計額については、購入金額や保有期間などに応じて異なりますので、表示することができません。

(5) 【課税上の取扱い】

a．個人の受益者の場合

(イ) 収益分配金の取り扱い

収益分配金のうち課税対象となる普通分配金については、配当所得として課税され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率で源泉徴収されます。なお、元本払戻金（特別分配金）は課税されません。確定申告を行い、総合課税（配当控除の適用があります。）・申告分離課税のいずれかを選択することもできます。

(ロ) 一部解約金・償還金の取り扱い

一部解約時および償還時の譲渡益（解約価額または償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した額）については、譲渡所得とみなされ、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。なお、特定口座（源泉徴収あり）の利用も可能です。

買取請求によるご換金につきましては、販売会社にお問い合わせください。

(ハ) 損益通算について

一部解約時、償還時に生じた損失（譲渡損）は、確定申告を行うことにより上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額（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、）から差し引くこと（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。一部解約時、償還時に生じた差益（譲渡益）は、上場株式等の譲渡損と損益通算ができます。

また、特定口座（源泉徴収あり）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行うことが可能です（申告不要）。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

< 少額投資非課税制度「愛称：N I S A（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアN I S A（ジュニアニーサ）」をご利用の場合 >

「N I S A（ニーサ）」および「ジュニアN I S A（ジュニアニーサ）」は、上場株式や公募株式投資信託などについての非課税制度です。N I S AおよびジュニアN I S Aをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方です。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

い。

b．法人の受益者の場合

収益分配金のうち課税対象となる普通分配金および一部解約金・償還金の個別元本超過額については15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。なお、元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

源泉徴収された所得税は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

なお、益金不算入制度は適用されません。

買取請求によるご換金につきましては、販売会社にお問い合わせください。

c．個別元本について

（イ）追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

（ロ）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。

（ハ）受益者が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ごとに、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ごとに、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」の両コースで取得する場合はコース別に、個別元本の算出が行われる場合があります。

（ニ）受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、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、「d．収益分配金の課税について」をご参照ください。）

d．収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、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）」（受益者ごとの元本の一部払い戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、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、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、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。

ただし、課税対象となります分配金は普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）に関しましては非課税扱いとなります。

上記は平成28年4月1日現在のものです。税法が改正された場合等は、上記「（5）課税上の取扱い」の内容が変更される場合があります。税金の取り扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

（1）【投資状況】

ニュー トピックス インデックス

(平成28年 2月29日現在)

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	575,289,682	99.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		547,298	0.09
純資産総額		575,836,980	100.00

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

(参考)ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(平成28年 2月29日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	11,063,536,760	95.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		580,419,619	4.98
純資産総額		11,643,956,379	100.00

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

ニュー トピックス インデックス

イ. 評価額上位銘柄明細

(平成28年 2月29日現在)

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	ニュー トピックス インデック ス マザーファンド	358,972,721	1.6054	576,294,807	1.6026	575,289,682	99.90

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

ロ. 種類別投資比率

(平成28年 2月29日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.90
合計	99.90

（参考）ニュー トピックス インデックス マザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

（平成28年 2月29日現在）

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	72,000	6,768.81	487,354,900	5,897.00	424,584,000	3.64
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	458,500	673.81	308,944,295	486.60	223,106,100	1.91
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	44,200	4,724.14	208,807,100	4,806.00	212,425,200	1.82
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	32,400	5,488.77	177,836,200	5,574.00	180,597,600	1.55
5	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	38,400	4,117.05	158,095,000	4,490.00	172,416,000	1.48
6	日本	株式	KDDI	情報・通信業	58,100	2,868.89	166,682,700	2,878.00	167,211,800	1.43
7	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	52,100	3,468.57	180,712,800	2,887.00	150,412,700	1.29
8	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	45,800	4,155.74	190,333,200	3,164.00	144,911,200	1.24
9	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	805,500	222.25	179,026,080	166.10	133,793,550	1.14
10	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	24,200	5,555.97	134,454,700	5,371.00	129,978,200	1.11
11	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	44,100	2,445.43	107,843,700	2,641.50	116,490,150	1.00
12	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	67,900	1,609.86	109,309,950	1,624.00	110,269,600	0.94
13	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	23,900	5,042.28	120,510,500	4,495.00	107,430,500	0.92
14	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	5,200	20,314.40	105,634,900	20,215.00	105,118,000	0.90
15	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	10,600	10,404.62	110,289,000	9,916.00	105,109,600	0.90
16	日本	株式	キャノン	電気機器	31,200	3,299.81	102,954,200	3,163.00	98,685,600	0.84
17	日本	株式	ファナック	電気機器	5,900	18,623.20	109,876,900	16,600.00	97,940,000	0.84
18	日本	株式	ソニー	電気機器	40,900	2,601.86	106,416,100	2,387.00	97,628,300	0.83
19	日本	株式	花王	化学	16,300	5,684.87	92,663,500	5,699.00	92,893,700	0.79
20	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	23,200	4,140.82	96,067,200	3,936.00	91,315,200	0.78
21	日本	株式	三菱地所	不動産業	42,000	2,314.45	97,207,000	2,093.50	87,927,000	0.75
22	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	81,300	1,120.53	91,099,450	1,024.50	83,291,850	0.71
23	日本	株式	村田製作所	電気機器	6,100	14,406.18	87,877,700	13,565.00	82,746,500	0.71
24	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	20,500	3,973.13	81,449,200	3,953.00	81,036,500	0.69
25	日本	株式	三井不動産	不動産業	30,000	2,809.60	84,288,000	2,623.00	78,690,000	0.67
26	日本	株式	三菱商事	卸売業	42,900	1,853.04	79,495,600	1,807.00	77,520,300	0.66
27	日本	株式	キーエンス	電気機器	1,300	57,316.92	74,512,000	58,410.00	75,933,000	0.65
28	日本	株式	三菱電機	電気機器	62,000	1,115.93	69,188,000	1,144.00	70,928,000	0.60
29	日本	株式	日立製作所	電気機器	148,000	608.40	90,044,000	477.90	70,729,200	0.60
30	日本	株式	富士重工業	輸送用機器	18,300	4,438.50	81,224,700	3,696.00	67,636,800	0.58

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。なお、投資比率は小数第3位以下を切り捨てているため、合計と一致しない場合があります。

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

(平成28年 2月29日現在)

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	0.27
		建設業	3.00
		食料品	4.87
		繊維製品	0.69
		パルプ・紙	0.24
		化学	5.71
		医薬品	5.55
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.93
		ガラス・土石製品	0.80
		鉄鋼	1.08
		非鉄金属	0.81
		金属製品	0.61
		機械	4.30
		電気機器	10.82
		輸送用機器	9.37
		精密機器	1.53
		その他製品	1.48
		電気・ガス業	2.13
		陸運業	4.65
		海運業	0.20
		空運業	0.67
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	7.93
		卸売業	3.95
		小売業	4.58
		銀行業	7.02
		証券、商品先物取引業	1.02
		保険業	2.33
その他金融業	1.29		
不動産業	2.67		
サービス業	3.55		
合計			95.01

【投資不動産物件】

ニュー トピックス インデックス

該当事項はありません。

（参考）ニュー トピックス 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】

ニュー トピックス インデックス

該当事項はありません。

（参考）ニュー トピックス インデックス マザーファンド

（平成28年 2月29日現在）

資産の種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	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	45	日本円	610,575,240	579,600,000	4.97

（注）時価評価にあたっては、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

ニュー トピックス インデックス

期別	純資産総額（円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第18計算期間末 （平成19年 2月22日）	1,745,592,667	1,748,019,715	0.7192	0.7202
第19計算期間末 （平成20年 2月22日）	1,294,179,992	1,294,179,992	0.5307	0.5307
第20計算期間末 （平成21年 2月23日）	620,776,863	620,776,863	0.2993	0.2993
第21計算期間末 （平成22年 2月22日）	679,340,171	679,340,171	0.3730	0.3730
第22計算期間末 （平成23年 2月22日）	726,273,934	727,190,192	0.3963	0.3968
第23計算期間末 （平成24年 2月22日）	593,090,852	593,090,852	0.3475	0.3475
第24計算期間末 （平成25年 2月22日）	642,548,912	642,548,912	0.4127	0.4127
第25計算期間末 （平成26年 2月24日）	730,711,923	730,711,923	0.5277	0.5277
第26計算期間末 （平成27年 2月23日）	760,691,078	761,847,736	0.6577	0.6587
第27計算期間末 （平成28年 2月22日）	578,205,292	578,205,292	0.5760	0.5760
平成27年 2月末日	769,728,626		0.6670	
3月末日	759,509,589		0.6802	
4月末日	765,620,256		0.7019	
5月末日	788,646,653		0.7375	
6月末日	761,627,785		0.7186	

7月末日	770,419,116		0.7311
8月末日	708,700,313		0.6769
9月末日	664,538,415		0.6261
10月末日	738,974,763		0.6910
11月末日	705,348,457		0.7005
12月末日	689,473,081		0.6863
平成28年 1月末日	637,447,915		0.6349
2月末日	575,836,980		0.5749

【分配の推移】

ニュー トピックス インデックス

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第18計算期間	平成18年 2月23日～平成19年 2月22日	0.0010
第19計算期間	平成19年 2月23日～平成20年 2月22日	0.0000
第20計算期間	平成20年 2月23日～平成21年 2月23日	0.0000
第21計算期間	平成21年 2月24日～平成22年 2月22日	0.0000
第22計算期間	平成22年 2月23日～平成23年 2月22日	0.0005
第23計算期間	平成23年 2月23日～平成24年 2月22日	0.0000
第24計算期間	平成24年 2月23日～平成25年 2月22日	0.0000
第25計算期間	平成25年 2月23日～平成26年 2月24日	0.0000
第26計算期間	平成26年 2月25日～平成27年 2月23日	0.0010
第27計算期間	平成27年 2月24日～平成28年 2月22日	0.0000

【収益率の推移】

ニュー トピックス インデックス

期	計算期間	収益率（%）
第18計算期間	平成18年 2月23日～平成19年 2月22日	12.5
第19計算期間	平成19年 2月23日～平成20年 2月22日	26.2
第20計算期間	平成20年 2月23日～平成21年 2月23日	43.6
第21計算期間	平成21年 2月24日～平成22年 2月22日	24.6
第22計算期間	平成22年 2月23日～平成23年 2月22日	6.4
第23計算期間	平成23年 2月23日～平成24年 2月22日	12.3
第24計算期間	平成24年 2月23日～平成25年 2月22日	18.8
第25計算期間	平成25年 2月23日～平成26年 2月24日	27.9
第26計算期間	平成26年 2月25日～平成27年 2月23日	24.8
第27計算期間	平成27年 2月24日～平成28年 2月22日	12.4

(注)収益率は各計算期間における騰落率を表示しており、当該計算期間の分配金額を加算して計算しています。

(4)【設定及び解約の実績】

ニュー トピックス インデックス

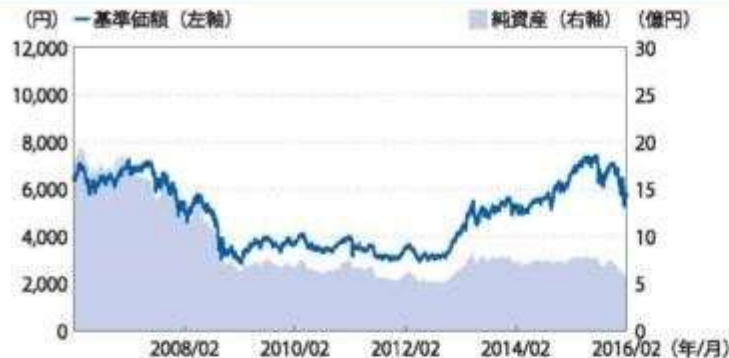
期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第18計算期間	平成18年 2月23日～平成19年 2月22日	690,890,595	1,040,773,062
第19計算期間	平成19年 2月23日～平成20年 2月22日	360,894,633	349,513,711
第20計算期間	平成20年 2月23日～平成21年 2月23日	190,700,853	555,185,759
第21計算期間	平成21年 2月24日～平成22年 2月22日	76,039,340	328,939,043
第22計算期間	平成22年 2月23日～平成23年 2月22日	296,866,516	285,394,408
第23計算期間	平成23年 2月23日～平成24年 2月22日	81,892,544	207,598,548
第24計算期間	平成24年 2月23日～平成25年 2月22日	40,997,313	190,689,671
第25計算期間	平成25年 2月23日～平成26年 2月24日	49,584,949	222,018,834
第26計算期間	平成26年 2月25日～平成27年 2月23日	51,024,990	279,051,207
第27計算期間	平成27年 2月24日～平成28年 2月22日	58,656,483	211,490,952

参考情報

運用実績

2016年2月29日現在

<基準価額・純資産の推移> (2006年3月1日～2016年2月29日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。換金時の費用・税金などは考慮していません。
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

<分配の推移>

2016年2月	0円
2015年2月	10円
2014年2月	0円
2013年2月	0円
2012年2月	0円
直近10年累計	25円

※分配は1万口当たり・税引前の金額です。
 ※分配の推移は、前年の分配の水準を指標・保証するものではありません。分配が行われない場合もあります。

<主要な資産の状況>

資産配分

資産	純資産比率
株式現物	94.92%
その他資産	5.08%
合計	100.00%
株式先物	4.97%

※マザーファンドの保有口数に基づき計算した実質組入比率を記載しています。

業種別配分(ニュー トピックス インデックス マザーファンド)

業種	純資産比率
電気機器	10.82%
輸送用機器	9.37%
情報・通信業	7.93%
銀行業	7.02%
化学	5.71%
その他	54.13%
合計	95.01%

※東証33業種分類にしたがって記載しています。
 ※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

組入上位10銘柄(ニュー トピックス インデックス マザーファンド)

銘柄名	業種	純資産比率
トヨタ自動車	輸送用機器	3.64%
三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.91%
日本電信電話	情報・通信業	1.82%
ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.55%
日本たばこ産業	食料品	1.48%
KDDI	情報・通信業	1.43%
本田技研工業	輸送用機器	1.29%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.24%
みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.14%
武田薬品工業	医薬品	1.11%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

組入銘柄数: 1,621銘柄

<年間収益率の推移>

暦年ベース



※当ファンドの収益率は、税引前の分配金を単純に合算して計算しています。

※ベンチマークは東証株価指数(TOPIX)です。

※2016年については、年初から2月末までの収益率を記載しています。

- 当ページの図表は過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。
- ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
- 表中の純資産比率は小数第3位を切り捨てて求めたものであり、各比率の合計と合計欄の数値が一致しない場合があります。
- 最新の運用実績は、表紙に記載する委託会社のホームページなどでご確認ください。

6

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- (イ) 取得申込者は、「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」について、販売会社ごとに定める申込単位で、取得申込受付日の基準価額で購入することができます。ただし、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は1口単位となります。
- 取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込金額に手数料および当該手数料にかかる消費税等を加算した金額を販売会社が指定する期日までに支払うものとします。
- (ロ) 「分配金再投資コース」での取得申込者は販売会社との間で「ニュー トピックス インデックス自動継続投資約款」（別の名称で同様の権利義務を規定する約款を含みます。）にしたがって契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。
- (ハ) 取得申し込みの受付は、原則として営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合の申込受付日は翌営業日となります。ただし、受付時間は販売会社によって異なる場合があります。

2【換金（解約）手続等】

a. 一部解約（解約請求によるご解約）

- (イ) 受益者は、「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」の両コースとも、販売会社が定める単位で一部解約の実行を請求することができます。

なお、受付は原則として営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合の申込受付日は翌営業日となります。ただし、受付時間は販売会社によって異なる場合があります。

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

上記の解約単位は、解約時の最低申込単位であり、販売会社によって異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

- (ロ) 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。

平成18年12月29日時点での保護預かりをご利用の方の受益証券は、原則として一括して全て振替受益権へ移行しました。受益証券をお手許で保有されている方で、平成19年1月4日以降も引き続き保有された場合は、解約のお申し込みに際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご留意ください。

- (ハ) 委託者は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。また、社振法の規定にしたがい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。

- (二) 一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。

一部解約に関して課税対象者にかかる所得税および地方税（法人の受益者の場合は所得税のみ）に相当する金額が控除されます。

なお、一部解約の価額は、毎営業日に算出されますので、販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

基準価額につきましては、アセットマネジメントOne株式会社のインターネットホームページ（<http://www.am-one.co.jp/>）または、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、お問い合わせいただけます基準価額および一部解約の価額は、前日以前のものとなります。

- (ホ)一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、4営業日目から販売会社において受益者に支払われます。
- (ヘ)委託者は、取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止することができます。
- (ト)上記(ヘ)により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。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、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に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、当該計算日の基準価額とします。

b. 受益権の買い取り

- (イ)販売会社は、受益者の請求があるときは、「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」の両コースとも、販売会社が定める単位でその受益権を買い取ります。

なお、受付は原則として営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合の申込受付日は翌営業日となります。ただし、受付時間は販売会社によって異なる場合があります。

上記の換金単位は、換金時の最低申込単位であり、販売会社によって異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

- (ロ)受益権の買取価額は、買取約定日の基準価額から、当該買い取りに関して当該買い取りを行う販売会社にかかる源泉徴収税額に相当する金額を控除した額とします。

< 買取請求時の税相当額 >

買取請求時に一定の条件を満たしていない場合、買取請求時の手取額は、対象となる基準価額から、当該買い取りを行う販売会社にかかる源泉徴収税額に相当する金額を控除した金額となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

税法が改正された場合等は、上記の税金にかかる内容が変更される場合があります。

なお、買取価額は毎営業日に算出されますので、販売会社にお問い合わせください。

- (ハ)買取代金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として4営業日目から販売会社において受益者に支払われます。
- (ニ)販売会社は、取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託者との協議に基づいて受益権の買い取りを中止することができます。
- (ホ)上記(ニ)により受益権の買い取りが中止された場合には、受益者は買取中止以前に行った当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、買取価額は、買取中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買い取りを受け付けたものとして、上記(ロ)の規定に準じて計算された価額とします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

基準価額は、毎営業日に算出されますので、販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社
コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

基準価額は、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、お問い合わせいただけます基準価額は、前日以前のものとなります。

当ファンドの主な投資対象の評価方法は以下のとおりです。

投資対象	評価方法
親投資信託受益証券	原則として基準価額計算日の基準価額で評価
株式	原則として基準価額計算日の取引所の最終相場で評価

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

当ファンドの信託期間は、原則として無期限です。

（４）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年2月23日から翌年2月22日までとします。

上記にかかわらず、上記の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日以降の営業日で該当日に最も近い日とし、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】

a．信託の終了（投資信託契約の解約）

（イ）委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより、受益権の総口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、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。

委託者は、上記の規定によりこの投資信託契約を解約しようとするときは、約款第41条第2項から第5項の規定にしたがいます。

（ロ）委託者は、信託期間中において、この投資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、対象インデックスが改廃の場合またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、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。

委託者は、上記の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約にかかる全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

上記の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

上記の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、投資信託契約の解約をしません。

委託者は、上記の規定により、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

約款第41条第3項から第5項までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

(ハ) 委託者は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

(ニ) 委託者が監督官庁より登録の取り消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

上記の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、約款第46条第4項に該当する場合を除き、当該委託者と受託者との間において存続します。

(ホ) 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、下記「b. 投資信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託者を選任します。

委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

b. 投資信託約款の変更

(イ) 委託者は、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、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更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。

委託者は、上記の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款にかかる全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

上記の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

上記の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、投資信託約款の変更をしません。

委託者は、上記の規定により、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(ロ) 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、上記(イ)の規定にしたがいます。

c. 異議申し立ておよび受益権の買取請求

投資信託契約の解約または投資信託約款の変更でその内容が重大な場合において、一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

上記の買取請求に関する手続きについては、上記「a. 信託の終了」または「b. 投資信託約款の変更」で規定する公告または書面に記載します。

d．運用報告書

委託者は、毎決算時および償還時に交付運用報告書を作成し、知っている受益者に対し、販売会社を通じて交付します。

運用報告書（全体版）は、下記「e．公告」に記載の委託者のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

e．公告

委託者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/>（平成28年10月1日現在（予定））

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。

f．委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

委託者は、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、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

g．信託事務処理の再信託

（イ）受託者は、当ファンドにかかる信託事務処理の一部について日本トラスティ・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。

（ロ）上記（イ）における日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

h．信託業務の委託等

（イ）受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

- 1．委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
- 2．委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
- 3．委託される投資信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行う体制が整備されていること
- 4．内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

（ロ）受託者は、上記（イ）に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が上記（イ）各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

（ハ）上記（イ）および（ロ）にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限ります。）を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

- 1．投資信託財産の保存にかかる業務
- 2．投資信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
- 3．委託者のみの指図により投資信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為にかかる業務
- 4．受託者が行う業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

i．関係法人との契約の更改

委託者と販売会社との間において締結している「証券投資信託に関する基本契約」の有効期間は契約の締結日から1年ですが、期間満了前に委託者、販売会社いずれからも別段の意思表示のないときは自動的に1年間更新されるものとし、その後も同様とします。

4【受益者の権利等】

a．収益分配金請求権

収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）に受益者に支払います。なお、平成19年1月4日以降においても、時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引き換えに受益者に支払います。

受益者が、収益分配金について、支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

上記にかかわらず、「分配金再投資コース」の受益者の収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に再投資されます。

b．一部解約請求権

受益者は、一部解約の実行を請求することができます。

一部解約金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、4営業日目から販売会社において受益者に支払います。

c．償還金請求権

償還金は信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日まで）に受益者に支払います。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

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年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

第3【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」という。）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27期計算期間（平成27年2月24日から平成28年2月22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る監査を受けております。

1【財務諸表】

【ニュー トピックス インデックス】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

	第26期 平成27年 2月23日現在	第27期 平成28年 2月22日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	2,753,577
コール・ローン	4,234,080	-
親投資信託受益証券	759,967,174	577,684,570
未収入金	2,670,000	-
未収利息	5	-
流動資産合計	766,871,259	580,438,147
資産合計	766,871,259	580,438,147
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,156,658	-
未払解約金	2,630,800	-
未払受託者報酬	395,483	367,640
未払委託者報酬	1,977,371	1,838,167
その他未払費用	19,869	27,048
流動負債合計	6,180,181	2,232,855
負債合計	6,180,181	2,232,855
純資産の部		
元本等		
元本	1,156,658,387	1,003,823,918
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	395,967,309	425,618,626
(分配準備積立金)	157,752,216	129,453,575
元本等合計	760,691,078	578,205,292
純資産合計	760,691,078	578,205,292
負債純資産合計	766,871,259	580,438,147

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第26期		第27期	
	自	平成26年 2月25日 至 平成27年 2月23日	自	平成27年 2月24日 至 平成28年 2月22日
営業収益				
受取利息		689		806
有価証券売買等損益		167,257,835		68,572,604
営業収益合計		167,258,524		68,571,798
営業費用				
受託者報酬		780,637		780,267
委託者報酬		3,903,115		3,901,221
その他費用		37,587		55,865
営業費用合計		4,721,339		4,737,353
営業利益		162,537,185		73,309,151
経常利益		162,537,185		73,309,151
当期純利益		162,537,185		73,309,151
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		12,386,089		9,437,059
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		653,972,681		395,967,309
剰余金増加額又は欠損金減少額		131,764,807		72,330,557
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		131,764,807		72,330,557
剰余金減少額又は欠損金増加額		22,753,873		19,235,664
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		22,753,873		19,235,664
分配金		1,156,658		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		395,967,309		425,618,626

（ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	第27期	
	自 平成27年 2月24日 至 平成28年 2月22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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間に関する事項 前計算期間終了日に該当する日が休業日のため、当計算期間は平成27年 2月24日から平成28年 2月22日までとなっております。	

（貸借対照表に関する注記）

第26期 平成27年 2月23日現在		第27期 平成28年 2月22日現在	
1. 計算期間末日における受益権の総数	1,156,658,387口	1. 計算期間末日における受益権の総数	1,003,823,918口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 395,967,309円		2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 425,618,626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口当たり純資産額 0.6577円 (1万口当たり純資産額) (6,577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口当たり純資産額 0.5760円 (1万口当たり純資産額) (5,760円)	

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第26期		第27期	
	自 平成26年 2月25日 至 平成27年 2月23日		自 平成27年 2月24日 至 平成28年 2月22日	
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（682円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（62,687,546円）、信託約款に定める収益調整金（139,220,765円）及び分配準備積立金（96,220,646円）より分配対象収益は298,129,639円（1万口当たり2,577.50円）であり、うち1,156,658円（1万口当たり10円）を分配しております。		計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、信託約款に定める収益調整金（128,279,416円）及び分配準備積立金（129,453,575円）より分配対象収益は257,732,991円（1万口当たり2,567.50円）ですが、分配を行っておりません。	

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	第26期 自 平成26年 2月25日 至 平成27年 2月23日	第27期 自 平成27年 2月24日 至 平成28年 2月22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項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2.金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、親投資信託受益証券であり、株価変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。	同左
3.金融商品に係るリスクの管理体制	コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。 また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。 市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。 信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。 流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。	同左
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

第26期 平成27年 2月23日現在	第27期 平成28年 2月22日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左

<p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に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>	<p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p>
---	----------------------------

（関連当事者との取引に関する注記）

	<p>第26期 自 平成26年 2月25日 至 平成27年 2月23日</p>	<p>第27期 自 平成27年 2月24日 至 平成28年 2月22日</p>
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	<p>第26期 平成27年 2月23日現在</p>	<p>第27期 平成28年 2月22日現在</p>
期首元本額	1,384,684,604円	1,156,658,387円
期中追加設定元本額	51,024,990円	58,656,483円
期中一部解約元本額	279,051,207円	211,490,952円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	<p>第26期 平成27年 2月23日現在</p>	<p>第27期 平成28年 2月22日現在</p>
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	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	154,188,375	78,192,886
合計	154,188,375	78,192,886

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（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

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	359,838,402	577,684,570	
	合計	359,838,402	577,684,570	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「ニュー トピックス 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、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成27年 2月23日現在	平成28年 2月22日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	604,429,004
コール・ローン	723,710,898	-
株式	14,001,117,470	10,736,117,080
派生商品評価勘定	38,152,240	353,520
未収入金	811,840	-
未収配当金	17,691,447	15,842,158
未収利息	959	-
前払金	-	69,130,000
流動資産合計	14,781,484,854	11,425,871,762
資産合計	14,781,484,854	11,425,871,762
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	68,359,280
前受金	39,032,000	-

	平成27年 2月23日現在	平成28年 2月22日現在
未払解約金	15,800,000	500,000
流動負債合計	54,832,000	68,859,280
負債合計	54,832,000	68,859,280
純資産の部		
元本等		
元本	8,086,291,839	7,074,354,723
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,640,361,015	4,282,657,759
元本等合計	14,726,652,854	11,357,012,482
純資産合計	14,726,652,854	11,357,012,482
負債純資産合計	14,781,484,854	11,425,871,762

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成27年 2月24日 至 平成28年 2月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成27年 2月23日現在	平成28年 2月22日現在
1. 担保資産 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り差入を行っております。 株式 186,716,000円	1. 担保資産 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り差入を行っております。 株式 124,307,550円
2. 計算日における受益権の総数 8,086,291,839口	2. 計算日における受益権の総数 7,074,354,723口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.8212円 (1万口当たり純資産額) (18,212円)	3. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.6054円 (1万口当たり純資産額) (16,054円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成26年 2月25日 至 平成27年 2月23日	自 平成27年 2月24日 至 平成28年 2月22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項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため、デリバティブ取引を行っております。</p>	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、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>当ファンドが投資している有価証券は、株式であり、株価変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。株価指数先物取引には株価の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	<p>コンプライアンス・リスク管理部門、運用企画部門において、投資対象の各種リスクのモニタリング、管理等を行い、運用部門への指示、牽制を行っております。</p> <p>また、社内の委員会において、各種リスクの評価、モニタリング結果の報告を行い、必要に応じ運用部門へ改善指示を行います。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	同左

4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
---------------------------	---	----

金融商品の時価等に関する事項

平成27年 2月23日現在	平成28年 2月22日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に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>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成26年 2月25日 至 平成27年 2月23日	自 平成27年 2月24日 至 平成28年 2月22日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成27年 2月23日現在	平成28年 2月22日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	9,761,400,233円	8,086,291,839円
期中追加設定元本額	341,377,783円	1,119,429,868円
期中一部解約元本額	2,016,486,177円	2,131,366,984円
同期末における元本の内訳		
ニュー トピックス インデックス	417,289,246円	359,838,402円
新光7資産バランスファンド	647,001,440円	491,333,859円

ニュー トピックス インデックス（変額年金）	538,680,947円	262,215,791円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	2,090,771,664円	1,992,396,278円
新光ワールドバランスファンドVA（適格機関投資家私募）	1,902,911,990円	1,652,595,295円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	65,781,238円	50,388,963円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	1,735,083,012円	1,617,731,626円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	627,997,616円	591,680,114円
世界アセット・アロケーション・ファンド（適格機関投資家私募）	3,083,191円	845,094円
グローバル・ナビ	26,399,517円	22,668,704円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	5,996,555円	6,511,372円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	20,603,414円	21,172,983円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	4,692,009円	4,976,242円
合計	8,086,291,839円	7,074,354,723円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成27年 2月23日現在	平成28年 2月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	1,351,972,631	864,887,811
合計	1,351,972,631	864,887,811

(注)「当期間」とは、当該親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間を指しております。

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

種類	平成27年 2月23日現在				平成28年 2月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
	うち1年超				うち1年超			
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	668,492,760	-	706,645,000	38,152,240	678,065,760	-	610,060,000	68,005,760
東証株価指数先物	668,492,760	-	706,645,000	38,152,240	678,065,760	-	610,060,000	68,005,760
合計	668,492,760	-	706,645,000	38,152,240	678,065,760	-	610,060,000	68,005,760

時価の算定方法

先物取引

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	3,000	262.00	786,000	
日本水産	7,200	546.00	3,931,200	
マルハニチロ	1,300	2,236.00	2,906,800	
サカタのタネ	900	2,755.00	2,479,500	
ホクト	600	2,023.00	1,213,800	
日鉄鉱業	2,000	410.00	820,000	
三井松島産業	4,000	118.00	472,000	
国際石油開発帝石	33,100	824.90	27,304,190	
日本海洋掘削	200	2,029.00	405,800	
石油資源開発	1,000	2,544.00	2,544,000	
K & O エナジーグループ	400	1,225.00	490,000	
ショーボンドホールディングス	700	3,840.00	2,688,000	
ミライト・ホールディングス	1,900	795.00	1,510,500	
タマホーム	500	418.00	209,000	
ダイセキ環境ソリューション	100	1,037.00	103,700	
安藤・間	4,200	518.00	2,175,600	
東急建設	2,000	823.00	1,646,000	
コムシスホールディングス	2,700	1,698.00	4,584,600	
ミサワホーム	700	660.00	462,000	
高松コンストラクショングループ	500	2,147.00	1,073,500	
東建コーポレーション	300	8,570.00	2,571,000	
大成建設	33,000	692.00	22,836,000	
大林組	18,900	989.00	18,692,100	
清水建設	19,000	865.00	16,435,000	
飛鳥建設	4,800	154.00	739,200	
長谷工コーポレーション	7,300	946.00	6,905,800	

松井建設	700	667.00	466,900
銭高組	1,000	442.00	442,000
鹿島建設	29,000	644.00	18,676,000
不動テトラ	4,400	114.00	501,600
大末建設	200	737.00	147,400
鉄建建設	4,000	257.00	1,028,000
西松建設	7,000	429.00	3,003,000
三井住友建設	24,100	92.00	2,217,200
大豊建設	2,000	426.00	852,000
前田建設工業	4,000	751.00	3,004,000
佐田建設	400	403.00	161,200
ナカノフドー建設	500	526.00	263,000
奥村組	6,000	556.00	3,336,000
東鉄工業	800	3,030.00	2,424,000
イチケン	1,000	298.00	298,000
戸田建設	7,000	455.00	3,185,000
熊谷組	9,000	296.00	2,664,000
青木あすなろ建設	400	664.00	265,600
北野建設	1,000	267.00	267,000
植木組	1,000	214.00	214,000
三井ホーム	1,000	506.00	506,000
矢作建設工業	900	731.00	657,900
ピーエス三菱	700	419.00	293,300
日本ハウスホールディングス	1,300	399.00	518,700
大東建託	2,300	15,190.00	34,937,000
新日本建設	700	520.00	364,000
N I P P O	1,000	1,689.00	1,689,000
東亜道路工業	1,000	350.00	350,000
前田道路	2,000	1,717.00	3,434,000
日本道路	2,000	556.00	1,112,000
東亜建設工業	5,000	243.00	1,215,000
若築建設	4,000	115.00	460,000
東洋建設	2,000	417.00	834,000
五洋建設	7,000	468.00	3,276,000
大林道路	700	731.00	511,700
世紀東急工業	1,000	467.00	467,000
福田組	1,000	912.00	912,000
住友林業	4,300	1,274.00	5,478,200
日本基礎技術	700	447.00	312,900
日成ビルド工業	2,000	369.00	738,000
巴コーポレーション	800	373.00	298,400
パナホーム	2,000	823.00	1,646,000

大和ハウス工業	18,600	3,064.00	56,990,400
ライト工業	1,200	1,096.00	1,315,200
積水ハウス	21,000	1,803.50	37,873,500
日特建設	700	398.00	278,600
北陸電気工事	200	765.00	153,000
ユアテック	1,000	787.00	787,000
西部電気工業	1,000	410.00	410,000
中電工	900	2,341.00	2,106,900
関電工	3,000	839.00	2,517,000
きんでん	3,800	1,449.00	5,506,200
東京エネシス	1,000	873.00	873,000
トーエネック	1,000	679.00	679,000
住友電設	500	1,333.00	666,500
日本電設工業	1,000	2,136.00	2,136,000
協和エクシオ	2,500	1,261.00	3,152,500
新日本空調	500	961.00	480,500
N D S	1,000	282.00	282,000
九電工	1,000	2,244.00	2,244,000
三機工業	1,400	937.00	1,311,800
日揮	6,000	1,710.00	10,260,000
中外炉工業	2,000	176.00	352,000
ヤマト	600	429.00	257,400
太平電業	1,000	890.00	890,000
高砂熱学工業	1,900	1,528.00	2,903,200
朝日工業社	1,000	447.00	447,000
明星工業	1,100	412.00	453,200
大気社	800	2,538.00	2,030,400
ダイダン	1,000	754.00	754,000
日比谷総合設備	800	1,631.00	1,304,800
東芝プラントシステム	1,000	1,261.00	1,261,000
OSJBホールディングス	1,300	219.00	284,700
東洋エンジニアリング	3,000	263.00	789,000
千代田化工建設	5,000	847.00	4,235,000
新興プランテック	1,300	880.00	1,144,000
日本製粉	4,000	805.00	3,220,000
日清製粉グループ本社	6,900	1,871.00	12,909,900
昭和産業	3,000	452.00	1,356,000
鳥越製粉	500	639.00	319,500
中部飼料	600	793.00	475,800
日本甜菜製糖	3,000	187.00	561,000
三井製糖	2,000	480.00	960,000
森永製菓	6,000	642.00	3,852,000

中村屋	1,000	463.00	463,000
江崎グリコ	1,500	6,060.00	9,090,000
名糖産業	300	1,300.00	390,000
不二家	4,000	190.00	760,000
山崎製パン	5,000	2,155.00	10,775,000
モロゾフ	1,000	421.00	421,000
亀田製菓	300	4,300.00	1,290,000
寿スピリッツ	100	5,470.00	547,000
カルビー	2,300	4,645.00	10,683,500
森永乳業	6,000	536.00	3,216,000
六甲バター	300	1,791.00	537,300
ヤクルト本社	3,400	5,560.00	18,904,000
明治ホールディングス	3,700	9,330.00	34,521,000
雪印メグミルク	1,500	2,719.00	4,078,500
プリマハム	4,000	278.00	1,112,000
日本ハム	5,000	2,538.00	12,690,000
伊藤ハム	3,000	706.00	2,118,000
丸大食品	3,000	422.00	1,266,000
米久	200	2,566.00	513,200
S Foods	400	2,149.00	859,600
サッポロホールディングス	10,000	549.00	5,490,000
アサヒグループホールディングス	11,800	3,497.00	41,264,600
キリンホールディングス	25,500	1,499.00	38,224,500
宝ホールディングス	4,600	821.00	3,776,600
オエノンホールディングス	2,000	205.00	410,000
養命酒製造	200	1,915.00	383,000
コカ・コーラウエスト	2,100	2,598.00	5,455,800
コカ・コーライーストジャパン	2,200	2,052.00	4,514,400
サントリー食品インターナショナル	4,300	4,990.00	21,457,000
ダイトードリンコ	300	5,120.00	1,536,000
伊藤園	1,900	3,245.00	6,165,500
キーコーヒー	600	1,801.00	1,080,600
日清オイリオグループ	3,000	454.00	1,362,000
不二製油グループ本社	1,700	1,949.00	3,313,300
J - オイルミルズ	3,000	340.00	1,020,000
キッコーマン	5,000	3,810.00	19,050,000
味の素	13,000	2,880.50	37,446,500
キューピー	3,200	2,554.00	8,172,800
ハウス食品グループ本社	2,100	2,205.00	4,630,500
カゴメ	2,300	2,139.00	4,919,700
焼津水産化学工業	300	1,005.00	301,500
アリアケジャパン	500	6,380.00	3,190,000

エバラ食品工業	200	1,947.00	389,400
ニチレイ	7,000	887.00	6,209,000
東洋水産	3,100	4,165.00	12,911,500
日清食品ホールディングス	2,700	5,410.00	14,607,000
永谷園ホールディングス	1,000	1,038.00	1,038,000
一正蒲鉾	200	863.00	172,600
フジッコ	600	2,199.00	1,319,400
ロック・フィールド	300	2,996.00	898,800
日本たばこ産業	37,200	4,542.00	168,962,400
ケンコーマヨネーズ	200	2,318.00	463,600
わらべや日洋	300	2,354.00	706,200
なとり	300	1,592.00	477,600
ユーグレナ	2,100	1,521.00	3,194,100
理研ビタミン	200	3,740.00	748,000
片倉工業	700	1,181.00	826,700
ゲンゼ	5,000	286.00	1,430,000
東洋紡	23,000	157.00	3,611,000
ユニチカ	17,000	51.00	867,000
富士紡ホールディングス	3,000	204.00	612,000
倉敷紡績	6,000	175.00	1,050,000
日本毛織	2,000	741.00	1,482,000
ダイドーリミテッド	700	467.00	326,900
帝国繊維	600	1,474.00	884,400
帝人	24,000	379.00	9,096,000
東レ	43,000	913.80	39,293,400
サカイオーベックス	2,000	168.00	336,000
住江織物	1,000	286.00	286,000
芦森工業	1,000	149.00	149,000
アツギ	5,000	109.00	545,000
ダイニック	1,000	151.00	151,000
セーレン	1,500	1,064.00	1,596,000
小松精練	900	578.00	520,200
ワコールホールディングス	3,000	1,311.00	3,933,000
ホギメディカル	400	5,540.00	2,216,000
T S Iホールディングス	2,600	729.00	1,895,400
三陽商会	3,000	257.00	771,000
オンワードホールディングス	4,000	705.00	2,820,000
ルック	1,000	143.00	143,000
ゴールドウイン	200	4,570.00	914,000
デサント	1,300	1,713.00	2,226,900
特種東海製紙	3,000	368.00	1,104,000
王子ホールディングス	24,000	430.00	10,320,000

日本製紙	3,000	1,825.00	5,475,000
三菱製紙	9,000	80.00	720,000
北越紀州製紙	3,600	617.00	2,221,200
中越パルプ工業	2,000	159.00	318,000
巴川製紙所	1,000	176.00	176,000
大王製紙	2,600	872.00	2,267,200
レンゴー	5,000	539.00	2,695,000
トーモク	2,000	250.00	500,000
ザ・パック	400	2,642.00	1,056,800
クラレ	9,300	1,239.00	11,522,700
旭化成	37,000	656.10	24,275,700
共和レザー	400	826.00	330,400
昭和電工	39,000	113.00	4,407,000
住友化学	43,000	502.00	21,586,000
住友精化	1,000	587.00	587,000
日産化学工業	3,500	2,563.00	8,970,500
クレハ	4,000	361.00	1,444,000
テイカ	1,000	526.00	526,000
石原産業	11,000	73.00	803,000
片倉コープアグリ	1,000	217.00	217,000
日東エフシー	300	835.00	250,500
日本曹達	4,000	505.00	2,020,000
東ソー	16,000	428.00	6,848,000
トクヤマ	10,000	140.00	1,400,000
セントラル硝子	6,000	543.00	3,258,000
東亜合成	3,700	880.00	3,256,000
大阪ソーダ	3,000	414.00	1,242,000
関東電化工業	1,000	877.00	877,000
デンカ	12,000	401.00	4,812,000
信越化学工業	10,500	5,675.00	59,587,500
日本カーバイド工業	2,000	119.00	238,000
堺化学工業	2,000	297.00	594,000
エア・ウォーター	5,000	1,583.00	7,915,000
大陽日酸	4,500	1,006.00	4,527,000
日本化学工業	2,000	193.00	386,000
日本パーカライズニング	3,000	972.00	2,916,000
高压ガス工業	1,000	586.00	586,000
四国化成工業	1,000	869.00	869,000
戸田工業	1,000	317.00	317,000
ステラ ケミファ	300	2,301.00	690,300
保土谷化学工業	2,000	174.00	348,000
日本触媒	900	6,790.00	6,111,000

大日精化工業	2,000	442.00	884,000
カネカ	8,000	864.00	6,912,000
三菱瓦斯化学	10,000	571.00	5,710,000
三井化学	25,000	396.00	9,900,000
J S R	5,500	1,577.00	8,673,500
東京応化工業	1,200	2,964.00	3,556,800
大阪有機化学工業	400	615.00	246,000
三菱ケミカルホールディングス	39,400	610.00	24,034,000
日本合成化学工業	1,000	662.00	662,000
ダイセル	8,300	1,515.00	12,574,500
住友ベークライト	5,000	483.00	2,415,000
積水化学工業	13,300	1,279.00	17,010,700
日本ゼオン	5,000	696.00	3,480,000
アイカ工業	1,800	2,186.00	3,934,800
宇部興産	31,000	192.00	5,952,000
積水樹脂	900	1,344.00	1,209,600
タキロン	1,000	543.00	543,000
旭有機材工業	2,000	202.00	404,000
日立化成	2,900	1,869.00	5,420,100
ニチバン	1,000	624.00	624,000
リケンテクノス	1,000	359.00	359,000
大倉工業	1,000	272.00	272,000
積水化成成品工業	2,000	347.00	694,000
群栄化学工業	2,000	267.00	534,000
タイガースポリマー	300	607.00	182,100
ミライアル	200	859.00	171,800
ダイキョーニシカワ	800	1,534.00	1,227,200
日本化薬	4,000	1,141.00	4,564,000
カーリットホールディングス	500	488.00	244,000
日本精化	500	721.00	360,500
A D E K A	2,900	1,495.00	4,335,500
日油	4,000	792.00	3,168,000
新日本理化	900	144.00	129,600
ハリマ化成グループ	500	506.00	253,000
花王	15,800	5,848.00	92,398,400
第一工業製薬	1,000	312.00	312,000
三洋化成工業	2,000	766.00	1,532,000
大日本塗料	3,000	198.00	594,000
日本ペイントホールディングス	4,500	2,372.00	10,674,000
関西ペイント	6,600	1,689.00	11,147,400
中国塗料	2,000	713.00	1,426,000
日本特殊塗料	400	991.00	396,400

藤倉化成	800	516.00	412,800
太陽ホールディングス	400	3,685.00	1,474,000
D I C	24,000	242.00	5,808,000
サカティクス	1,200	1,137.00	1,364,400
東洋インキS Cホールディングス	6,000	447.00	2,682,000
T & K T O K A	400	909.00	363,600
富士フィルムホールディングス	13,400	4,269.00	57,204,600
資生堂	11,100	2,426.00	26,928,600
ライオン	7,000	1,224.00	8,568,000
高砂香料工業	400	2,271.00	908,400
マンダム	500	4,640.00	2,320,000
ミルボン	300	4,390.00	1,317,000
ファンケル	1,400	1,391.00	1,947,400
コーセー	1,000	9,560.00	9,560,000
コタ	200	1,423.00	284,600
シーズ・ホールディングス	700	1,841.00	1,288,700
ポーラ・オルビスホールディングス	600	8,600.00	5,160,000
ノエビアホールディングス	400	3,020.00	1,208,000
エステー	400	1,095.00	438,000
アグロ カネショウ	200	882.00	176,400
コニシ	500	2,617.00	1,308,500
長谷川香料	700	1,449.00	1,014,300
星光P M C	300	914.00	274,200
小林製薬	900	9,690.00	8,721,000
荒川化学工業	500	927.00	463,500
メック	500	841.00	420,500
日本高純度化学	200	2,024.00	404,800
J C U	200	3,290.00	658,000
新田ゼラチン	400	711.00	284,400
デクセリアルズ	1,300	1,027.00	1,335,100
アース製薬	400	4,050.00	1,620,000
イハラケミカル工業	900	1,236.00	1,112,400
北興化学工業	1,000	292.00	292,000
大成ラミック	200	3,015.00	603,000
クミアイ化学工業	1,200	1,148.00	1,377,600
日本農薬	1,300	589.00	765,700
アキレス	5,000	146.00	730,000
有沢製作所	900	560.00	504,000
日東電工	4,500	5,982.00	26,919,000
レック	200	1,258.00	251,600
きもと	1,000	167.00	167,000
藤森工業	500	2,443.00	1,221,500

前澤化成工業	400	975.00	390,000	
J S P	400	2,239.00	895,600	
エフピコ	500	4,400.00	2,200,000	
天馬	500	1,907.00	953,500	
信越ポリマー	1,200	581.00	697,200	
東リ	2,000	291.00	582,000	
ニフコ	1,100	5,060.00	5,566,000	
日本バルカー工業	2,000	276.00	552,000	
ユニ・チャーム	11,900	2,415.00	28,738,500	
協和発酵キリン	7,000	1,616.00	11,312,000	
武田薬品工業	23,400	5,417.00	126,757,800	代用有価証券 2,600株
アステラス製薬	65,800	1,577.00	103,766,600	
大日本住友製薬	4,200	1,236.00	5,191,200	
塩野義製薬	8,600	4,764.00	40,970,400	
田辺三菱製薬	6,800	2,031.00	13,810,800	
わかもと製薬	1,000	268.00	268,000	
あすか製薬	700	1,176.00	823,200	
日本新薬	1,300	3,880.00	5,044,000	
ビオフェルミン製薬	100	3,510.00	351,000	
中外製薬	5,900	3,370.00	19,883,000	
科研製薬	1,000	7,200.00	7,200,000	
エーザイ	7,200	7,000.00	50,400,000	
ロート製薬	2,900	2,061.00	5,976,900	
小野薬品工業	2,700	19,715.00	53,230,500	
久光製薬	1,800	5,020.00	9,036,000	
持田製薬	400	8,540.00	3,416,000	
参天製薬	10,800	1,742.00	18,813,600	
扶桑薬品工業	2,000	252.00	504,000	
日本ケミファ	1,000	480.00	480,000	
ツムラ	1,800	2,793.00	5,027,400	
日医工	1,400	2,731.00	3,823,400	
キッセイ薬品工業	1,000	2,647.00	2,647,000	
生化学工業	1,100	1,336.00	1,469,600	
栄研化学	500	2,138.00	1,069,000	
日水製薬	200	1,231.00	246,200	
鳥居薬品	400	2,341.00	936,400	
J C R ファーマ	500	2,008.00	1,004,000	
東和薬品	300	5,220.00	1,566,000	
富士製薬工業	200	2,024.00	404,800	
沢井製薬	1,000	7,620.00	7,620,000	
ゼリア新薬工業	1,200	1,389.00	1,666,800	
第一三共	19,800	2,259.00	44,728,200	

キョーリン製薬ホールディングス	1,600	2,127.00	3,403,200
大幸薬品	300	1,345.00	403,500
ダイト	200	2,705.00	541,000
大塚ホールディングス	12,600	4,152.00	52,315,200
大正製薬ホールディングス	1,400	8,910.00	12,474,000
日本コークス工業	4,700	76.00	357,200
昭和シェル石油	5,900	936.00	5,522,400
ニチレキ	1,000	745.00	745,000
東燃ゼネラル石油	9,000	900.00	8,100,000
ユシロ化学工業	300	1,232.00	369,600
ピーピー・カストロール	200	1,227.00	245,400
富士石油	1,400	276.00	386,400
MORESCO	200	1,472.00	294,400
出光興産	3,100	1,796.00	5,567,600
JXホールディングス	69,600	445.20	30,985,920
コスモエネルギーホールディングス	1,800	1,188.00	2,138,400
横浜ゴム	3,500	1,903.00	6,660,500
東洋ゴム工業	2,700	1,711.00	4,619,700
ブリヂストン	19,800	3,991.00	79,021,800
住友ゴム工業	5,500	1,657.00	9,113,500
藤倉ゴム工業	500	453.00	226,500
オカモト	2,000	938.00	1,876,000
フコク	200	851.00	170,200
ニッタ	600	2,912.00	1,747,200
住友理工	1,300	994.00	1,292,200
三ツ星ベルト	1,000	873.00	873,000
バンドー化学	2,000	431.00	862,000
日東紡績	4,000	363.00	1,452,000
旭硝子	31,000	545.00	16,895,000
日本板硝子	28,000	72.00	2,016,000
石塚硝子	1,000	217.00	217,000
日本山村硝子	2,000	164.00	328,000
日本電気硝子	12,000	532.00	6,384,000
住友大阪セメント	12,000	412.00	4,944,000
太平洋セメント	37,000	228.00	8,436,000
デイ・シイ	500	316.00	158,000
日本ヒューム	600	547.00	328,200
日本コンクリート工業	1,200	250.00	300,000
三谷セキサン	300	1,372.00	411,600
アジアパイルホールディングス	700	358.00	250,600
東海カーボン	5,000	273.00	1,365,000
日本カーボン	3,000	214.00	642,000

東洋炭素	300	1,453.00	435,900
ノリタケカンパニーリミテド	3,000	243.00	729,000
TOTO	4,300	3,235.00	13,910,500
日本碍子	7,000	2,055.00	14,385,000
日本特殊陶業	5,100	2,165.00	11,041,500
MARUWA	200	2,489.00	497,800
品川リフラクトリーズ	1,000	203.00	203,000
黒崎播磨	1,000	234.00	234,000
フジインコーポレーテッド	500	1,165.00	582,500
ニチアス	3,000	628.00	1,884,000
ニチハ	800	1,529.00	1,223,200
新日鐵住金	26,500	1,874.00	49,661,000
神戸製鋼所	108,000	86.00	9,288,000
合同製鐵	3,000	192.00	576,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	16,100	1,292.50	20,809,250
日新製鋼	2,700	1,166.00	3,148,200
東京製鐵	3,200	724.00	2,316,800
共英製鋼	600	1,701.00	1,020,600
大和工業	1,300	2,307.00	2,999,100
東京鐵鋼	1,000	389.00	389,000
大阪製鐵	400	1,727.00	690,800
淀川製鋼所	900	2,451.00	2,205,900
東洋鋼板	1,400	301.00	421,400
丸一鋼管	2,000	3,125.00	6,250,000
モリ工業	1,000	307.00	307,000
大同特殊鋼	10,000	409.00	4,090,000
日本冶金工業	4,300	113.00	485,900
山陽特殊製鋼	3,000	479.00	1,437,000
愛知製鋼	3,000	423.00	1,269,000
日立金属	6,700	1,192.00	7,986,400
大太平洋金属	4,000	312.00	1,248,000
新日本電工	3,300	165.00	544,500
栗本鐵工所	3,000	156.00	468,000
三菱製鋼	4,000	175.00	700,000
日亜鋼業	800	262.00	209,600
シンニッタン	500	588.00	294,000
大紀アルミニウム工業所	1,000	257.00	257,000
日本軽金属ホールディングス	13,300	168.00	2,234,400
三井金属鉱業	15,000	160.00	2,400,000
東邦亜鉛	3,000	281.00	843,000
三菱マテリアル	37,000	311.00	11,507,000
住友金属鉱山	16,000	1,160.50	18,568,000

DOWAホールディングス	8,000	602.00	4,816,000
古河機械金属	9,000	160.00	1,440,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	600	1,632.00	979,200
東邦チタニウム	1,000	865.00	865,000
UACJ	8,000	214.00	1,712,000
古河電気工業	18,000	231.00	4,158,000
住友電気工業	23,500	1,340.50	31,501,750
フジクラ	8,000	466.00	3,728,000
昭和電線ホールディングス	7,000	55.00	385,000
タツタ電線	1,200	329.00	394,800
カナレ電気	100	1,693.00	169,300
リョービ	4,000	407.00	1,628,000
アーレスティ	700	655.00	458,500
アサヒホールディングス	900	1,440.00	1,296,000
稲葉製作所	300	1,158.00	347,400
宮地エンジニアリンググループ	2,000	138.00	276,000
トーカロ	400	1,884.00	753,600
アルファC o	200	1,060.00	212,000
SUMCO	4,600	763.00	3,509,800
川田テクノロジーズ	100	3,150.00	315,000
東洋製罐グループホールディングス	4,200	1,971.00	8,278,200
ホッカンホールディングス	2,000	289.00	578,000
コロナ	300	1,000.00	300,000
横河ブリッジホールディングス	1,100	1,058.00	1,163,800
駒井ハルテック	1,000	224.00	224,000
三和ホールディングス	5,900	719.00	4,242,100
文化シャッター	1,600	905.00	1,448,000
三協立山	800	1,299.00	1,039,200
アルインコ	300	987.00	296,100
LIXILグループ	8,200	2,393.00	19,622,600
日本フィルコン	400	416.00	166,400
ノーリツ	1,200	1,894.00	2,272,800
長府製作所	600	2,490.00	1,494,000
リンナイ	1,100	9,740.00	10,714,000
ダイニチ工業	300	609.00	182,700
日東精工	1,000	302.00	302,000
岡部	1,200	678.00	813,600
ジーテクト	600	1,172.00	703,200
東プレ	1,100	2,055.00	2,260,500
高周波熱錬	1,100	817.00	898,700
東京製綱	4,000	139.00	556,000
サンコール	300	473.00	141,900

パイオラックス	300	5,230.00	1,569,000
日本発條	5,500	1,020.00	5,610,000
中央発條	1,000	263.00	263,000
アドバネクス	100	1,253.00	125,300
立川ブラインド工業	200	685.00	137,000
三益半導体工業	400	1,026.00	410,400
日本製鋼所	10,000	380.00	3,800,000
三浦工業	2,600	1,810.00	4,706,000
タクマ	2,000	870.00	1,740,000
ツガミ	2,000	399.00	798,000
オークマ	4,000	862.00	3,448,000
東芝機械	3,000	370.00	1,110,000
アマダホールディングス	8,600	1,089.00	9,365,400
アイダエンジニアリング	1,500	864.00	1,296,000
滝澤鉄工所	2,000	124.00	248,000
富士機械製造	1,900	1,077.00	2,046,300
牧野フライス製作所	3,000	722.00	2,166,000
オーエスジー	2,700	1,912.00	5,162,400
旭ダイヤモンド工業	1,600	976.00	1,561,600
D M G 森精機	3,200	973.00	3,113,600
ソディック	1,100	738.00	811,800
ディスコ	700	10,780.00	7,546,000
日東工器	300	2,071.00	621,300
パンチ工業	200	690.00	138,000
豊和工業	300	540.00	162,000
東洋機械金属	400	322.00	128,800
島精機製作所	800	1,716.00	1,372,800
日阪製作所	700	805.00	563,500
やまびこ	1,100	750.00	825,000
ペガサスミシン製造	600	490.00	294,000
ナブテスコ	3,100	2,219.00	6,878,900
三井海洋開発	700	1,475.00	1,032,500
レオン自動機	500	605.00	302,500
S M C	1,800	27,365.00	49,257,000
新川	500	398.00	199,000
ホソカワミクロン	1,000	528.00	528,000
ユニオンツール	300	2,430.00	729,000
オイレス工業	800	1,777.00	1,421,600
日精エー・エス・ビー機械	200	1,806.00	361,200
サトーホールディングス	800	2,492.00	1,993,600
日精樹脂工業	400	680.00	272,000
ワイエイシイ	200	619.00	123,800

小松製作所	28,800	1,741.50	50,155,200
住友重機械工業	17,000	464.00	7,888,000
日立建機	2,600	1,637.00	4,256,200
日工	1,000	325.00	325,000
巴工業	200	1,423.00	284,600
井関農機	6,000	180.00	1,080,000
TOWA	600	692.00	415,200
丸山製作所	1,000	165.00	165,000
北川鉄工所	3,000	206.00	618,000
クボタ	28,200	1,449.00	40,861,800
荏原実業	200	1,210.00	242,000
三菱化工機	2,000	223.00	446,000
月島機械	1,100	1,007.00	1,107,700
帝国電機製作所	400	662.00	264,800
新東工業	1,300	909.00	1,181,700
澁谷工業	500	1,332.00	666,000
アイチ コーポレーション	800	772.00	617,600
小森コーポレーション	1,400	1,202.00	1,682,800
鶴見製作所	400	1,758.00	703,200
住友精密工業	1,000	344.00	344,000
酒井重工業	1,000	176.00	176,000
荏原製作所	13,000	426.00	5,538,000
西島製作所	600	969.00	581,400
北越工業	600	642.00	385,200
ダイキン工業	8,200	7,809.00	64,033,800
オルガノ	1,000	413.00	413,000
トーヨーカネツ	3,000	240.00	720,000
栗田工業	3,500	2,546.00	8,911,000
椿本チエイン	3,000	627.00	1,881,000
大同工業	1,000	190.00	190,000
日本コンベヤ	2,000	118.00	236,000
木村化工機	500	360.00	180,000
アネスト岩田	900	863.00	776,700
ダイフク	3,000	1,754.00	5,262,000
加藤製作所	1,000	374.00	374,000
油研工業	1,000	186.00	186,000
タダノ	3,000	974.00	2,922,000
フジテック	1,600	1,173.00	1,876,800
C K D	1,600	781.00	1,249,600
キトー	700	743.00	520,100
平和	1,700	2,360.00	4,012,000
理想科学工業	600	1,786.00	1,071,600

SANKYO	1,600	4,250.00	6,800,000
日本金銭機械	500	989.00	494,500
マースエンジニアリング	300	1,947.00	584,100
福島工業	300	2,264.00	679,200
ダイコク電機	200	1,218.00	243,600
竹内製作所	800	1,437.00	1,149,600
アマノ	1,700	1,583.00	2,691,100
JUKI	800	862.00	689,600
サンデンホールディングス	3,000	291.00	873,000
蛇の目マシン工業	500	537.00	268,500
マックス	1,000	1,190.00	1,190,000
グローリー	1,900	3,790.00	7,201,000
新晃工業	400	1,696.00	678,400
大和冷機工業	900	920.00	828,000
セガサミーホールディングス	6,000	1,196.00	7,176,000
日本ピストンリング	200	1,503.00	300,600
リケン	3,000	355.00	1,065,000
T P R	700	2,652.00	1,856,400
ホンザキ電機	1,200	8,590.00	10,308,000
大豊工業	500	1,087.00	543,500
日本精工	11,500	1,048.00	12,052,000
NTN	14,000	362.00	5,068,000
ジェイテクト	6,000	1,550.00	9,300,000
不二越	5,000	378.00	1,890,000
日本トムソン	2,000	379.00	758,000
THK	3,700	1,969.00	7,285,300
ユーシン精機	200	1,724.00	344,800
前澤給装工業	200	1,369.00	273,800
イーグル工業	700	1,402.00	981,400
日本ピラー工業	600	912.00	547,200
キッツ	2,700	470.00	1,269,000
日立工機	1,500	740.00	1,110,000
マキタ	3,700	6,760.00	25,012,000
日立造船	4,400	514.00	2,261,600
三菱重工業	100,000	409.90	40,990,000
I H I	43,000	190.00	8,170,000
日清紡ホールディングス	3,100	1,110.00	3,441,000
イビデン	3,400	1,353.00	4,600,200
コニカミノルタ	14,000	922.00	12,908,000
ブラザー工業	7,300	1,198.00	8,745,400
ミネベア	9,000	792.00	7,128,000
日立製作所	143,000	476.60	68,153,800

東芝	118,000	183.50	21,653,000
三菱電機	60,000	1,134.00	68,040,000
富士電機	17,000	382.00	6,494,000
東洋電機製造	1,000	319.00	319,000
安川電機	7,000	1,281.00	8,967,000
シンフォニアテクノロジー	4,000	144.00	576,000
明電舎	5,000	464.00	2,320,000
オリジン電気	1,000	255.00	255,000
山洋電気	1,000	500.00	500,000
デンヨー	500	1,171.00	585,500
東芝テック	4,000	352.00	1,408,000
芝浦メカトロニクス	1,000	191.00	191,000
マブチモーター	1,600	4,620.00	7,392,000
日本電産	6,800	7,372.00	50,129,600
東光高岳	300	1,337.00	401,100
ダイヘン	3,000	454.00	1,362,000
田淵電機	600	437.00	262,200
JVCケンウッド	4,100	294.00	1,205,400
ミマキエンジニアリング	400	429.00	171,600
第一精工	200	1,285.00	257,000
日新電機	1,300	917.00	1,192,100
大崎電気工業	1,000	717.00	717,000
オムロン	6,400	3,070.00	19,648,000
日東工業	900	1,799.00	1,619,100
I D E C	700	1,023.00	716,100
ジーエス・ユアサ コーポレーション	11,000	448.00	4,928,000
サクサホールディングス	1,000	191.00	191,000
メルコホールディングス	300	2,237.00	671,100
テクノメディカ	100	2,235.00	223,500
日本電気	77,000	273.00	21,021,000
富士通	54,000	414.20	22,366,800
沖電気工業	24,000	152.00	3,648,000
電気興業	1,000	551.00	551,000
サンケン電気	3,000	303.00	909,000
アイホン	300	1,933.00	579,900
ルネサスエレクトロニクス	2,900	659.00	1,911,100
セイコーエプソン	8,400	1,799.00	15,111,600
ワコム	4,400	484.00	2,129,600
アルバック	1,000	3,280.00	3,280,000
アクセル	300	860.00	258,000
E I Z O	600	2,990.00	1,794,000
ジャパンディスプレイ	10,500	211.00	2,215,500

日本信号	1,500	799.00	1,198,500	
京三製作所	1,000	321.00	321,000	
能美防災	600	1,353.00	811,800	
ホーチキ	400	1,134.00	453,600	
エレコム	500	1,618.00	809,000	
日本無線	1,000	267.00	267,000	
パナソニック	64,100	845.10	54,170,910	代用有価証券 7,500株
シャープ	47,000	173.00	8,131,000	
アンリツ	3,400	638.00	2,169,200	
富士通ゼネラル	2,000	1,488.00	2,976,000	
日立国際電気	1,000	1,266.00	1,266,000	
ソニー	39,600	2,488.00	98,524,800	代用有価証券 3,700株
T D K	3,400	5,740.00	19,516,000	
帝国通信工業	1,000	163.00	163,000	
ミツミ電機	2,100	487.00	1,022,700	
タムラ製作所	2,000	271.00	542,000	
アルプス電気	4,800	1,804.00	8,659,200	
池上通信機	2,000	128.00	256,000	
パイオニア	9,100	244.00	2,220,400	
日本電波工業	500	675.00	337,500	
日本トリム	200	4,335.00	867,000	
ローランド ディー . ジー .	300	2,334.00	700,200	
フォスター電機	700	2,138.00	1,496,600	
クラリオン	3,000	351.00	1,053,000	
S M K	2,000	529.00	1,058,000	
ヨコオ	400	541.00	216,400	
東光	1,000	358.00	358,000	
ホシデン	1,700	661.00	1,123,700	
ヒロセ電機	900	12,610.00	11,349,000	
日本航空電子工業	2,000	1,151.00	2,302,000	
T O A	700	1,012.00	708,400	
日立マクセル	900	1,627.00	1,464,300	
古野電気	700	698.00	488,600	
ユニデンホールディングス	2,000	113.00	226,000	
アルパイン	1,300	1,270.00	1,651,000	
スミダコーポレーション	500	708.00	354,000	
アイコム	300	2,196.00	658,800	
リオン	200	1,560.00	312,000	
船井電機	600	963.00	577,800	
横河電機	5,600	1,124.00	6,294,400	
新電元工業	2,000	361.00	722,000	

アズビル	1,800	2,777.00	4,998,600
日本光電工業	2,300	2,826.00	6,499,800
チノー	200	1,005.00	201,000
共和電業	700	363.00	254,100
堀場製作所	1,000	3,655.00	3,655,000
アドバンテスト	3,800	1,025.00	3,895,000
小野測器	300	707.00	212,100
エスペック	600	1,343.00	805,800
パナソニック デバイスSUNX	500	544.00	272,000
キーエンス	1,300	58,580.00	76,154,000
日置電機	300	2,239.00	671,700
シスメックス	4,400	6,660.00	29,304,000
メガチップス	600	1,063.00	637,800
O B A R A G R O U P	400	4,150.00	1,660,000
コーセル	800	998.00	798,400
新日本無線	400	373.00	149,200
オブテックス	400	2,770.00	1,108,000
千代田インテグレ	300	2,538.00	761,400
レーザーテック	700	1,419.00	993,300
スタンレー電気	4,000	2,534.00	10,136,000
岩崎電気	2,000	174.00	348,000
ウシオ電機	3,400	1,578.00	5,365,200
ヘリオス テクノ ホールディング	500	382.00	191,000
日本セラミック	300	1,820.00	546,000
遠藤照明	300	1,027.00	308,100
日本デジタル研究所	500	1,569.00	784,500
山一電機	500	572.00	286,000
図研	400	1,163.00	465,200
日本電子	2,000	524.00	1,048,000
カシオ計算機	5,600	2,102.00	11,771,200
ファナック	5,700	17,040.00	97,128,000
日本シイエムケイ	1,200	390.00	468,000
エンブラス	300	3,815.00	1,144,500
大真空	1,000	203.00	203,000
ローム	2,800	4,685.00	13,118,000
浜松ホトニクス	4,400	2,805.00	12,342,000
三井ハイテック	800	528.00	422,400
新光電気工業	2,100	648.00	1,360,800
京セラ	9,200	4,927.00	45,328,400
太陽誘電	2,700	1,111.00	2,999,700
村田製作所	5,900	13,435.00	79,266,500
ユーシン	700	659.00	461,300

双葉電子工業	1,000	1,504.00	1,504,000	
北陸電気工業	2,000	124.00	248,000	
ニチコン	1,800	733.00	1,319,400	
日本ケミコン	5,000	142.00	710,000	
K O A	800	864.00	691,200	
市光工業	1,000	184.00	184,000	
小糸製作所	3,400	4,930.00	16,762,000	
ミツバ	1,000	1,497.00	1,497,000	
スター精密	1,100	1,273.00	1,400,300	
S C R E E Nホールディングス	6,000	812.00	4,872,000	
キャノン電子	500	1,643.00	821,500	
キャノン	30,200	3,311.00	99,992,200	代用有価証券 4,100株
リコー	18,200	1,134.00	20,638,800	
M U T O Hホールディングス	1,000	233.00	233,000	
東京エレクトロン	5,000	7,053.00	35,265,000	
トヨタ紡織	2,000	1,763.00	3,526,000	
鬼怒川ゴム工業	1,000	524.00	524,000	
ユニプレス	1,200	1,783.00	2,139,600	
豊田自動織機	5,100	4,780.00	24,378,000	
モリタホールディングス	1,000	1,244.00	1,244,000	
三櫻工業	700	564.00	394,800	
デンソー	13,900	4,200.00	58,380,000	
東海理化電機製作所	1,600	2,357.00	3,771,200	
三井造船	22,000	147.00	3,234,000	
川崎重工業	44,000	303.00	13,332,000	
名村造船所	1,700	675.00	1,147,500	
日本車輛製造	2,000	243.00	486,000	
ニチユ三菱フォークリフト	600	431.00	258,600	
近畿車輛	1,000	298.00	298,000	
日産自動車	78,800	979.20	77,160,960	
いすゞ自動車	16,300	1,137.50	18,541,250	
トヨタ自動車	69,800	5,980.00	417,404,000	代用有価証券 9,000株
日野自動車	8,000	1,182.00	9,456,000	
三菱自動車工業	22,300	809.00	18,040,700	
エフテック	300	1,059.00	317,700	
武蔵精密工業	600	2,105.00	1,263,000	
日産車体	2,700	1,133.00	3,059,100	
新明和工業	2,000	767.00	1,534,000	
極東開発工業	1,100	1,032.00	1,135,200	
日信工業	1,300	1,442.00	1,874,600	
トビー工業	5,000	214.00	1,070,000	

ティラド	2,000	168.00	336,000	
曙ブレーキ工業	2,800	240.00	672,000	
タチエス	900	1,495.00	1,345,500	
N O K	2,700	1,850.00	4,995,000	
フタバ産業	1,700	463.00	787,100	
K Y B	6,000	294.00	1,764,000	
シロキ工業	1,000	331.00	331,000	
大同メタル工業	800	779.00	623,200	
プレス工業	3,000	391.00	1,173,000	
ミクニ	500	340.00	170,000	
カルソニックカンセイ	4,000	814.00	3,256,000	
太平洋工業	1,200	1,001.00	1,201,200	
ケーヒン	1,300	1,585.00	2,060,500	
河西工業	700	1,235.00	864,500	
アイシン精機	5,600	4,480.00	25,088,000	
富士機工	600	410.00	246,000	
マツダ	17,800	1,614.50	28,738,100	
ダイハツ工業	6,700	1,586.00	10,626,200	
今仙電機製作所	500	1,016.00	508,000	
本田技研工業	50,500	2,925.00	147,712,500	代用有価証券 6,000株
スズキ	11,700	2,809.50	32,871,150	
富士重工業	17,700	3,693.00	65,366,100	
ヤマハ発動機	7,900	1,783.00	14,085,700	
ショーワ	1,500	926.00	1,389,000	
T B K	700	369.00	258,300	
エクセディ	800	2,272.00	1,817,600	
豊田合成	2,000	2,235.00	4,470,000	
愛三工業	1,000	887.00	887,000	
ヨロズ	500	2,172.00	1,086,000	
エフ・シー・シー	900	1,860.00	1,674,000	
シマノ	2,300	18,470.00	42,481,000	
タカタ	1,000	507.00	507,000	
テイ・エス テック	1,300	2,553.00	3,318,900	
ジャムコ	200	2,489.00	497,800	
テルモ	8,600	3,885.00	33,411,000	
日機装	2,100	834.00	1,751,400	
島津製作所	7,000	1,787.00	12,509,000	
J M S	1,000	290.00	290,000	
長野計器	400	598.00	239,200	
ブイ・テクノロジー	100	3,675.00	367,500	
東京計器	2,000	154.00	308,000	
愛知時計電機	1,000	299.00	299,000	

東京精密	1,100	2,141.00	2,355,100
マニー	500	1,662.00	831,000
ニコン	10,500	1,692.00	17,766,000
トプコン	1,900	1,185.00	2,251,500
オリンパス	8,400	4,100.00	34,440,000
理研計器	500	1,044.00	522,000
タムロン	500	1,718.00	859,000
H O Y A	13,100	4,150.00	54,365,000
ノーリツ鋼機	500	418.00	209,000
エー・アンド・デイ	500	378.00	189,000
シチズンホールディングス	6,900	626.00	4,319,400
リズム時計工業	2,000	142.00	284,000
大研医器	400	900.00	360,000
メニコン	300	3,060.00	918,000
松風	300	1,310.00	393,000
セイコーホールディングス	4,000	398.00	1,592,000
ニプロ	4,200	1,075.00	4,515,000
パラマウントベッドホールディングス	600	3,745.00	2,247,000
ニホンフラッシュ	200	980.00	196,000
前田工織	600	982.00	589,200
永大産業	1,000	391.00	391,000
アートネイチャー	400	960.00	384,000
ダンロップスポーツ	400	934.00	373,600
バンダイナムコホールディングス	5,800	2,345.00	13,601,000
共立印刷	900	282.00	253,800
フランスベッドホールディングス	800	964.00	771,200
パイロットコーポレーション	1,000	3,965.00	3,965,000
萩原工業	100	1,976.00	197,600
トッパン・フォームズ	1,000	1,325.00	1,325,000
フジシールインターナショナル	700	3,650.00	2,555,000
タカラトミー	1,800	843.00	1,517,400
廣済堂	500	308.00	154,000
プロネクサス	500	1,112.00	556,000
ウッドワン	1,000	242.00	242,000
大建工業	2,000	239.00	478,000
凸版印刷	16,000	972.00	15,552,000
大日本印刷	17,000	990.00	16,830,000
図書印刷	1,000	461.00	461,000
共同印刷	2,000	338.00	676,000
日本写真印刷	900	1,736.00	1,562,400
宝印刷	300	1,259.00	377,700
アシックス	5,200	2,032.00	10,566,400

ツツミ	300	2,449.00	734,700
小松ウオール工業	200	1,667.00	333,400
ヤマハ	4,100	3,180.00	13,038,000
河合楽器製作所	200	1,897.00	379,400
クリナップ	700	723.00	506,100
ピジョン	3,200	2,637.00	8,438,400
キングジム	500	736.00	368,000
リンテック	1,300	2,125.00	2,762,500
T A S A K I	100	1,308.00	130,800
イトーキ	1,200	697.00	836,400
任天堂	3,500	16,495.00	57,732,500
三菱鉛筆	400	4,360.00	1,744,000
タカラスタンド	2,000	968.00	1,936,000
コクヨ	2,900	1,107.00	3,210,300
ナカバヤシ	1,000	260.00	260,000
グローブライド	300	1,423.00	426,900
岡村製作所	2,000	993.00	1,986,000
美津濃	3,000	503.00	1,509,000
アデランス	1,000	565.00	565,000
東京電力	47,600	560.00	26,656,000
中部電力	17,200	1,428.50	24,570,200
関西電力	22,900	1,236.00	28,304,400
中国電力	7,800	1,518.00	11,840,400
北陸電力	5,500	1,640.00	9,020,000
東北電力	14,000	1,458.00	20,412,000
四国電力	5,100	1,625.00	8,287,500
九州電力	12,400	1,086.00	13,466,400
北海道電力	5,300	967.00	5,125,100
沖縄電力	600	2,781.00	1,668,600
電源開発	4,800	3,450.00	16,560,000
東京瓦斯	63,000	540.90	34,076,700
大阪瓦斯	58,000	441.60	25,612,800
東邦瓦斯	14,000	795.00	11,130,000
北海道瓦斯	1,000	274.00	274,000
広島ガス	1,000	405.00	405,000
西部瓦斯	6,000	254.00	1,524,000
静岡ガス	1,600	724.00	1,158,400
メタウォーター	400	2,384.00	953,600
S B S ホールディングス	600	646.00	387,600
東武鉄道	30,000	600.00	18,000,000
相鉄ホールディングス	10,000	701.00	7,010,000
東京急行電鉄	33,000	954.00	31,482,000

京浜急行電鉄	15,000	1,015.00	15,225,000
小田急電鉄	18,000	1,369.00	24,642,000
京王電鉄	16,000	1,077.00	17,232,000
京成電鉄	8,000	1,653.00	13,224,000
富士急行	2,000	1,233.00	2,466,000
新京成電鉄	1,000	419.00	419,000
東日本旅客鉄道	10,300	9,953.00	102,515,900
西日本旅客鉄道	5,400	6,814.00	36,795,600
東海旅客鉄道	5,000	20,755.00	103,775,000
西武ホールディングス	4,500	2,355.00	10,597,500
鴻池運輸	800	1,274.00	1,019,200
西日本鉄道	7,000	838.00	5,866,000
ハマキョウレックス	400	1,828.00	731,200
サカイ引越センター	200	2,673.00	534,600
近鉄グループホールディングス	56,000	490.00	27,440,000
阪急阪神ホールディングス	38,000	722.00	27,436,000
南海電気鉄道	13,000	672.00	8,736,000
京阪電気鉄道	13,000	789.00	10,257,000
神戸電鉄	1,000	355.00	355,000
名古屋鉄道	20,000	554.00	11,080,000
山陽電気鉄道	2,000	455.00	910,000
日本通運	22,000	516.00	11,352,000
ヤマトホールディングス	10,400	2,366.50	24,611,600
山九	7,000	528.00	3,696,000
丸全昭和運輸	2,000	399.00	798,000
センコー	3,000	711.00	2,133,000
トナミホールディングス	1,000	258.00	258,000
ニッコンホールディングス	1,800	1,959.00	3,526,200
福山通運	3,000	534.00	1,602,000
セイノーホールディングス	4,000	1,198.00	4,792,000
神奈川中央交通	1,000	685.00	685,000
日立物流	1,200	1,731.00	2,077,200
丸和運輸機関	100	2,169.00	216,900
C & F ロジホールディングス	500	848.00	424,000
日本郵船	50,000	213.00	10,650,000
商船三井	27,000	209.00	5,643,000
川崎汽船	25,000	189.00	4,725,000
N S ユナイテッド海運	3,000	152.00	456,000
飯野海運	2,900	430.00	1,247,000
乾汽船	400	768.00	307,200
日本航空	10,700	4,192.00	44,854,400
A N A ホールディングス	104,000	325.90	33,893,600

トランコム	200	6,340.00	1,268,000
日新	2,000	275.00	550,000
三菱倉庫	4,000	1,493.00	5,972,000
三井倉庫ホールディングス	3,000	273.00	819,000
住友倉庫	4,000	550.00	2,200,000
澁澤倉庫	1,000	276.00	276,000
東陽倉庫	1,000	231.00	231,000
日本トランスシティ	1,000	353.00	353,000
ケイヒン	1,000	145.00	145,000
中央倉庫	300	912.00	273,600
安田倉庫	400	697.00	278,800
東洋埠頭	2,000	144.00	288,000
宇徳	500	313.00	156,500
上組	7,000	1,050.00	7,350,000
キューソー流通システム	200	2,074.00	414,800
郵船ロジスティクス	500	1,204.00	602,000
近鉄エクスプレス	1,000	1,494.00	1,494,000
エーアイティー	300	1,014.00	304,200
N E C ネットズエスアイ	700	1,736.00	1,215,200
システナ	500	1,515.00	757,500
デジタルアーツ	300	1,936.00	580,800
新日鉄住金ソリューションズ	900	1,969.00	1,772,100
コア	200	1,316.00	263,200
ソフトクリエイトホールディングス	200	772.00	154,400
I Tホールディングス	1,800	2,511.00	4,519,800
電算システム	200	1,528.00	305,600
グリー	3,400	541.00	1,839,400
コーエーテクモホールディングス	1,300	1,679.00	2,182,700
三菱総合研究所	200	3,480.00	696,000
ファインデックス	400	1,014.00	405,600
K L a b	900	494.00	444,600
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	400	970.00	388,000
ネクソン	5,300	1,661.00	8,803,300
アイスタイル	800	778.00	622,400
エイチーム	200	1,431.00	286,200
コロプラ	1,500	1,979.00	2,968,500
ブロードリーフ	600	1,280.00	768,000
ハーツユナイテッドグループ	200	1,915.00	383,000
ブイキューブ	300	1,287.00	386,100
VOYAGE GROUP	100	1,076.00	107,600
ティーガイア	600	1,204.00	722,400
豆蔵ホールディングス	400	645.00	258,000

テクマトリックス	200	1,486.00	297,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	9,700	284.00	2,754,800
GMOペイメントゲートウェイ	500	6,110.00	3,055,000
インターネットイニシアティブ	900	2,168.00	1,951,200
S R Aホールディングス	300	2,256.00	676,800
朝日ネット	500	483.00	241,500
コムチュア	100	1,967.00	196,700
g u m i	600	640.00	384,000
フェイス	100	1,193.00	119,300
野村総合研究所	3,900	3,845.00	14,995,500
インテージホールディングス	300	1,426.00	427,800
クレスコ	100	1,757.00	175,700
フジ・メディア・ホールディングス	5,800	1,314.00	7,621,200
オービック	1,900	5,570.00	10,583,000
ジャストシステム	1,000	851.00	851,000
ヤフー	39,700	433.00	17,190,100
トレンドマイクロ	2,700	3,860.00	10,422,000
日本オラクル	900	5,380.00	4,842,000
アルファシステムズ	200	1,733.00	346,600
フューチャーアーキテクト	700	802.00	561,400
C A C H o l d i n g s	400	723.00	289,200
オービックビジネスコンサルタント	300	4,510.00	1,353,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,300	2,276.00	2,958,800
アイティフォー	700	455.00	318,500
東計電算	100	1,924.00	192,400
大塚商会	1,500	5,470.00	8,205,000
サイボウズ	700	303.00	212,100
電通国際情報サービス	300	2,103.00	630,900
E Mシステムズ	100	2,568.00	256,800
ウェザーニューズ	200	3,545.00	709,000
C I J	500	437.00	218,500
WOWOW	300	2,564.00	769,200
イマジカ・ロボット ホールディングス	500	389.00	194,500
ネットワンシステムズ	2,400	588.00	1,411,200
アルゴグラフィックス	300	1,686.00	505,800
マーベラス	900	821.00	738,900
エイベックス・グループ・ホールディングス	1,000	1,302.00	1,302,000
日本ユニシス	1,500	1,395.00	2,092,500
兼松エレクトロニクス	300	1,834.00	550,200
東京放送ホールディングス	3,300	1,762.00	5,814,600
日本テレビホールディングス	5,100	1,976.00	10,077,600
朝日放送	500	684.00	342,000

テレビ朝日ホールディングス	1,500	2,024.00	3,036,000
スカパーJ S A Tホールディングス	4,200	683.00	2,868,600
テレビ東京ホールディングス	500	1,847.00	923,500
コネクシオ	500	1,077.00	538,500
日本通信	2,900	171.00	495,900
日本電信電話	42,800	4,812.00	205,953,600
K D D I	56,300	3,013.00	169,631,900
光通信	700	7,780.00	5,446,000
N T T ドコモ	42,700	2,642.00	112,813,400
エムティーアイ	700	735.00	514,500
G M O インターネット	2,100	1,218.00	2,557,800
カドカワ	1,700	1,812.00	3,080,400
学研ホールディングス	2,000	237.00	474,000
ゼンリン	700	1,852.00	1,296,400
昭文社	300	626.00	187,800
アイネット	300	1,090.00	327,000
松竹	4,000	1,020.00	4,080,000
東宝	4,000	2,816.00	11,264,000
東映	2,000	879.00	1,758,000
A O I P r o .	300	1,004.00	301,200
エヌ・ティ・ティ・データ	3,400	5,620.00	19,108,000
D T S	600	2,089.00	1,253,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2,300	2,920.00	6,716,000
シーイーシー	400	1,093.00	437,200
カブコン	1,400	2,404.00	3,365,600
ジャステック	400	914.00	365,600
S C S K	1,300	4,380.00	5,694,000
日本システムウエア	200	872.00	174,400
アイネス	800	1,089.00	871,200
T K C	500	3,145.00	1,572,500
富士ソフト	800	2,335.00	1,868,000
N S D	1,200	1,658.00	1,989,600
コナミホールディングス	2,500	2,844.00	7,110,000
J B C C ホールディングス	500	636.00	318,000
ミロク情報サービス	400	917.00	366,800
ソフトバンクグループ	31,400	5,095.00	159,983,000
高千穂交易	200	871.00	174,200
伊藤忠食品	100	4,185.00	418,500
エレマテック	300	2,149.00	644,700
J A L U X	200	2,047.00	409,400
あらた	200	2,170.00	434,000
東京エレクトロン デバイス	200	1,503.00	300,600

フィールズ	400	1,733.00	693,200
双日	34,900	225.00	7,852,500
アルフレッサ ホールディングス	7,000	1,995.00	13,965,000
横浜冷凍	1,400	1,021.00	1,429,400
アルコニックス	300	1,432.00	429,600
神戸物産	400	2,374.00	949,600
あい ホールディングス	1,000	2,793.00	2,793,000
ダイワボウホールディングス	5,000	200.00	1,000,000
マクニカ・富士エレホールディングス	1,000	1,326.00	1,326,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	1,000	957.00	957,000
八洲電機	400	519.00	207,600
U K Cホールディングス	400	2,065.00	826,000
T O K A Iホールディングス	2,400	567.00	1,360,800
三洋貿易	300	1,290.00	387,000
ウイン・パートナーズ	200	1,449.00	289,800
シップヘルスケアホールディングス	1,100	2,791.00	3,070,100
明治電機工業	200	1,026.00	205,200
小野建	500	961.00	480,500
佐島電機	400	689.00	275,600
伯東	400	931.00	372,400
コンドーテック	400	765.00	306,000
中山福	300	747.00	224,100
ナガイレーベン	800	1,993.00	1,594,400
三菱食品	600	2,968.00	1,780,800
松田産業	400	1,220.00	488,000
メディバルホールディングス	5,500	1,739.00	9,564,500
アドヴァン	600	1,048.00	628,800
S P K	100	1,905.00	190,500
萩原電気	100	1,847.00	184,700
アズワン	400	3,925.00	1,570,000
シモジマ	400	1,081.00	432,400
ドウシシャ	700	2,142.00	1,499,400
小津産業	100	2,158.00	215,800
高速	300	856.00	256,800
たけびし	200	962.00	192,400
黒田電気	1,000	1,623.00	1,623,000
丸文	500	705.00	352,500
ハピネット	500	931.00	465,500
エクセル	300	1,294.00	388,200
マルカキカイ	200	1,386.00	277,200
ガリバーインターナショナル	1,500	1,116.00	1,674,000
日本エム・ディ・エム	500	566.00	283,000

進和	300	1,408.00	422,400	
ダイトエレクトロン	300	718.00	215,400	
シークス	400	2,833.00	1,133,200	
オーハシテクニカ	300	1,258.00	377,400	
白銅	200	1,012.00	202,400	
伊藤忠商事	43,500	1,378.50	59,964,750	
丸紅	54,500	584.40	31,849,800	
高島	1,000	165.00	165,000	
長瀬産業	3,300	1,170.00	3,861,000	
蝶理	400	1,428.00	571,200	
豊田通商	6,200	2,330.00	14,446,000	
三共生興	800	389.00	311,200	
兼松	12,000	151.00	1,812,000	
三井物産	50,100	1,313.00	65,781,300	
日本紙パルプ商事	3,000	316.00	948,000	
日立ハイテクノロジーズ	1,900	3,030.00	5,757,000	
カメイ	700	983.00	688,100	
OUGホールディングス	1,000	215.00	215,000	
スターゼン	200	3,145.00	629,000	
山善	2,100	907.00	1,904,700	
椿本興業	1,000	286.00	286,000	
住友商事	34,900	1,136.50	39,663,850	
内田洋行	1,000	390.00	390,000	
三菱商事	41,600	1,872.00	77,875,200	代用有価証券 5,200株
第一実業	1,000	456.00	456,000	
キャノンマーケティングジャパン	1,600	1,946.00	3,113,600	
西華産業	2,000	217.00	434,000	
佐藤商事	500	622.00	311,000	
菱洋エレクトロ	600	1,095.00	657,000	
東京産業	500	393.00	196,500	
ユアサ商事	500	2,442.00	1,221,000	
神鋼商事	1,000	198.00	198,000	
阪和興業	6,000	435.00	2,610,000	
カナデン	500	811.00	405,500	
菱電商事	1,000	624.00	624,000	
フルサト工業	300	1,563.00	468,900	
岩谷産業	7,000	609.00	4,263,000	
すてきナイスグループ	2,000	132.00	264,000	
ニチモウ	1,000	175.00	175,000	
極東貿易	1,000	223.00	223,000	
三愛石油	1,000	869.00	869,000	
稲畑産業	1,300	1,194.00	1,552,200	

明和産業	500	374.00	187,000
ワキタ	1,200	825.00	990,000
東邦ホールディングス	1,800	2,327.00	4,188,600
サンゲツ	2,000	1,950.00	3,900,000
ミツウロコグループホールディングス	900	557.00	501,300
シナネンホールディングス	1,000	440.00	440,000
伊藤忠エネクス	1,400	817.00	1,143,800
サンリオ	1,700	2,100.00	3,570,000
サンワテクノス	400	676.00	270,400
リョーサン	900	2,821.00	2,538,900
新光商事	600	1,030.00	618,000
トーホー	200	2,212.00	442,400
三信電気	800	837.00	669,600
東陽テクニカ	800	1,086.00	868,800
モスフードサービス	700	3,105.00	2,173,500
加賀電子	500	1,291.00	645,500
ソーダニッカ	600	450.00	270,000
立花エレテック	400	1,091.00	436,400
PALTA C	900	1,739.00	1,565,100
三谷産業	600	310.00	186,000
ヤマタネ	3,000	160.00	480,000
日鉄住金物産	4,000	336.00	1,344,000
トラスコ中山	600	3,910.00	2,346,000
オートバックスセブン	2,100	1,945.00	4,084,500
加藤産業	900	2,722.00	2,449,800
イノテック	500	440.00	220,000
イエローハット	500	1,900.00	950,000
J Kホールディングス	600	456.00	273,600
日伝	200	2,817.00	563,400
杉本商事	300	1,260.00	378,000
因幡電機産業	800	3,445.00	2,756,000
バイテックホールディングス	200	950.00	190,000
ミスミグループ本社	6,200	1,545.00	9,579,000
タキヒヨー	1,000	460.00	460,000
スズケン	2,500	3,715.00	9,287,500
ジェコス	400	895.00	358,000
ローソン	2,100	9,170.00	19,257,000
サンエー	400	4,805.00	1,922,000
カワチ薬品	400	1,936.00	774,400
エービーシー・マート	700	6,760.00	4,732,000
ハードオフコーポレーション	300	1,631.00	489,300
アスクル	700	3,415.00	2,390,500

ゲオホールディングス	1,000	1,683.00	1,683,000
アダストリア	500	5,920.00	2,960,000
くらコーポレーション	300	5,200.00	1,560,000
キャンドウ	300	1,460.00	438,000
パル	300	2,551.00	765,300
エディオン	2,300	856.00	1,968,800
サーラコーポレーション	500	583.00	291,500
ワッツ	200	781.00	156,200
あみやき亭	100	4,325.00	432,500
ひらまつ	800	653.00	522,400
ゲンキー	100	2,802.00	280,200
大黒天物産	100	4,710.00	471,000
ハニーズ	500	1,212.00	606,000
アルペン	500	1,777.00	888,500
クオール	600	1,423.00	853,800
ジェイアイエヌ	400	4,745.00	1,898,000
ビックカメラ	2,900	889.00	2,578,100
D C Mホールディングス	2,700	840.00	2,268,000
MonotaRO	2,000	2,412.00	4,824,000
アーランドサービス	200	2,857.00	571,400
J.フロント リテイリング	7,000	1,337.00	9,359,000
ドトール・日レスホールディングス	1,000	1,798.00	1,798,000
マツモトキヨシホールディングス	1,100	5,180.00	5,698,000
ブロンコビリー	200	2,661.00	532,200
スタートトゥデイ	1,700	3,390.00	5,763,000
トレジャー・ファクトリー	200	1,197.00	239,400
物語コーポレーション	100	5,220.00	522,000
ココカラファイン	600	4,385.00	2,631,000
三越伊勢丹ホールディングス	11,000	1,315.00	14,465,000
ウエルシアホールディングス	500	5,610.00	2,805,000
クリエイティブSDホールディングス	800	2,418.00	1,934,400
丸善C H Iホールディングス	600	331.00	198,600
チムニー	100	2,715.00	271,500
ジョイフル本田	900	2,210.00	1,989,000
キリン堂ホールディングス	200	1,007.00	201,400
ホットランド	100	1,040.00	104,000
すかいらーく	1,700	1,500.00	2,550,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,800	946.00	1,702,800
ブックオフコーポレーション	300	905.00	271,500
あさひ	400	1,301.00	520,400
日本調剤	100	3,605.00	360,500
コスモス薬品	300	16,660.00	4,998,000

トーエル	300	700.00	210,000
セブン&アイ・ホールディングス	23,200	4,556.00	105,699,200
葉王堂	100	2,582.00	258,200
クリエイティブ・レストラン・ホールディングス	500	2,945.00	1,472,500
ツルハホールディングス	1,300	9,520.00	12,376,000
サンマルクホールディングス	400	2,896.00	1,158,400
トリドール	700	2,252.00	1,576,400
クスリのアオキ	500	4,890.00	2,445,000
メディカルシステムネットワーク	600	425.00	255,000
総合メディカル	300	3,445.00	1,033,500
カッパ・クリエイティブ	800	1,126.00	900,800
ライトオン	400	1,458.00	583,200
良品計画	600	23,850.00	14,310,000
三城ホールディングス	700	445.00	311,500
アルビス	100	1,903.00	190,300
コナカ	700	533.00	373,100
G - 7ホールディングス	200	1,121.00	224,200
イオン北海道	400	518.00	207,200
コジマ	800	228.00	182,400
ヒマラヤ	200	1,006.00	201,200
コーナン商事	800	1,547.00	1,237,600
エコス	200	1,180.00	236,000
ワタミ	700	1,076.00	753,200
ドンキホーテホールディングス	3,600	3,705.00	13,338,000
西松屋チェーン	1,100	972.00	1,069,200
ゼンショーホールディングス	2,800	1,393.00	3,900,400
幸楽苑ホールディングス	300	1,563.00	468,900
ハークスレイ	200	1,051.00	210,200
サイゼリヤ	900	2,299.00	2,069,100
V Tホールディングス	1,900	569.00	1,081,100
魚力	200	1,210.00	242,000
ユナイテッドアローズ	800	5,080.00	4,064,000
ハイデイ日高	400	3,495.00	1,398,000
京都きもの友禅	400	842.00	336,800
コロワイド	1,800	1,730.00	3,114,000
壱番屋	300	5,920.00	1,776,000
スギホールディングス	1,000	5,430.00	5,430,000
スクロール	800	404.00	323,200
ヨンドシーホールディングス	400	2,437.00	974,800
ファミリーマート	1,700	5,560.00	9,452,000
木曽路	700	2,229.00	1,560,300
サトレストランシステムズ	700	780.00	546,000

千趣会	1,100	705.00	775,500
ケーヨー	900	503.00	452,700
上新電機	1,000	853.00	853,000
日本瓦斯	600	2,080.00	1,248,000
ロイヤルホールディングス	900	2,017.00	1,815,300
いなげや	600	1,230.00	738,000
島忠	1,400	2,469.00	3,456,600
チヨダ	700	2,816.00	1,971,200
ライフコーポレーション	300	2,336.00	700,800
リンガーハット	500	2,411.00	1,205,500
テンアライド	500	363.00	181,500
A O K Iホールディングス	1,300	1,238.00	1,609,400
オークワ	1,000	1,005.00	1,005,000
コメリ	900	2,173.00	1,955,700
青山商事	1,100	4,175.00	4,592,500
しまむら	600	12,060.00	7,236,000
高島屋	8,000	920.00	7,360,000
松屋	1,100	850.00	935,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,800	1,850.00	5,180,000
近鉄百貨店	2,000	306.00	612,000
パルコ	500	866.00	433,000
丸井グループ	6,800	1,500.00	10,200,000
アクシアル リテイリング	400	3,370.00	1,348,000
イオン	22,800	1,425.50	32,501,400
ユニーグループ・ホールディングス	5,300	749.00	3,969,700
イズミ	1,100	4,325.00	4,757,500
東武ストア	1,000	297.00	297,000
平和堂	1,100	2,095.00	2,304,500
フジ	600	2,056.00	1,233,600
ヤオコー	600	4,125.00	2,475,000
ゼビオホールディングス	800	1,754.00	1,403,200
ケーズホールディングス	1,200	3,480.00	4,176,000
O l y m p i cグループ	300	567.00	170,100
日産東京販売ホールディングス	900	283.00	254,700
アインホールディングス	700	4,945.00	3,461,500
元気寿司	200	2,143.00	428,600
ヤマダ電機	16,800	518.00	8,702,400
アークランドサカモト	1,000	1,035.00	1,035,000
ニトリホールディングス	2,400	8,420.00	20,208,000
ケーユーホールディングス	300	695.00	208,500
吉野家ホールディングス	2,000	1,429.00	2,858,000
松屋フーズ	300	2,812.00	843,600

サガミチェーン	700	1,216.00	851,200
関西スーパーマーケット	500	773.00	386,500
王将フードサービス	400	3,910.00	1,564,000
プレナス	600	1,953.00	1,171,800
ミニストップ	400	2,039.00	815,600
アークス	1,000	2,299.00	2,299,000
パローホールディングス	1,200	2,417.00	2,900,400
ベルク	300	3,815.00	1,144,500
大庄	300	1,432.00	429,600
ファーストリテイリング	1,100	31,760.00	34,936,000
サンドラッグ	1,200	7,560.00	9,072,000
サクスパー ホールディングス	500	1,498.00	749,000
ヤマザワ	100	1,664.00	166,400
やまや	100	1,870.00	187,000
ベルーナ	1,400	504.00	705,600
じもとホールディングス	4,000	145.00	580,000
足利ホールディングス	4,100	316.00	1,295,600
東京ＴＹフィナンシャルグループ	800	2,597.00	2,077,600
九州フィナンシャルグループ	8,500	659.00	5,601,500
ゆうちょ銀行	10,600	1,191.00	12,624,600
新生銀行	48,000	141.00	6,768,000
あおぞら銀行	35,000	357.00	12,495,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	444,300	477.30	212,064,390
りそなホールディングス	64,800	389.60	25,246,080
三井住友トラスト・ホールディングス	116,000	324.50	37,642,000
三井住友フィナンシャルグループ	44,300	3,026.00	134,051,800
第四銀行	7,000	368.00	2,576,000
北越銀行	6,000	182.00	1,092,000
西日本シティ銀行	18,000	200.00	3,600,000
千葉銀行	21,000	538.00	11,298,000
横浜銀行	37,000	504.20	18,655,400
常陽銀行	20,000	385.00	7,700,000
群馬銀行	12,000	487.00	5,844,000
武蔵野銀行	900	2,894.00	2,604,600
千葉興業銀行	1,500	447.00	670,500
筑波銀行	2,300	279.00	641,700
七十七銀行	9,000	402.00	3,618,000
青森銀行	4,000	295.00	1,180,000
秋田銀行	4,000	268.00	1,072,000
山形銀行	3,000	377.00	1,131,000
岩手銀行	400	3,705.00	1,482,000
東邦銀行	5,000	323.00	1,615,000

東北銀行	3,000	140.00	420,000
みちのく銀行	3,000	166.00	498,000
ふくおかフィナンシャルグループ	24,000	352.00	8,448,000
静岡銀行	16,000	822.00	13,152,000
十六銀行	7,000	361.00	2,527,000
スルガ銀行	5,300	1,820.00	9,646,000
八十二銀行	10,000	504.00	5,040,000
山梨中央銀行	3,000	392.00	1,176,000
大垣共立銀行	7,000	343.00	2,401,000
福井銀行	5,000	186.00	930,000
北國銀行	6,000	277.00	1,662,000
清水銀行	200	2,108.00	421,600
滋賀銀行	5,000	448.00	2,240,000
南都銀行	5,000	301.00	1,505,000
百五銀行	5,000	393.00	1,965,000
京都銀行	11,000	727.00	7,997,000
紀陽銀行	2,200	1,184.00	2,604,800
三重銀行	2,000	191.00	382,000
ほくほくフィナンシャルグループ	38,000	167.00	6,346,000
広島銀行	16,000	410.00	6,560,000
山陰合同銀行	3,400	652.00	2,216,800
中国銀行	3,900	1,176.00	4,586,400
鳥取銀行	2,000	159.00	318,000
伊予銀行	5,900	772.00	4,554,800
百十四銀行	6,000	316.00	1,896,000
四国銀行	4,000	207.00	828,000
阿波銀行	5,000	502.00	2,510,000
大分銀行	3,000	339.00	1,017,000
宮崎銀行	4,000	260.00	1,040,000
佐賀銀行	3,000	200.00	600,000
十八銀行	3,000	230.00	690,000
沖縄銀行	400	3,455.00	1,382,000
琉球銀行	1,100	1,133.00	1,246,300
セブン銀行	20,700	483.00	9,998,100
みずほフィナンシャルグループ	780,100	166.30	129,730,630
山口フィナンシャルグループ	5,000	1,050.00	5,250,000
長野銀行	2,000	176.00	352,000
名古屋銀行	5,000	356.00	1,780,000
北洋銀行	8,300	276.00	2,290,800
愛知銀行	200	4,375.00	875,000
第三銀行	3,000	140.00	420,000
中京銀行	2,000	192.00	384,000

東日本銀行	3,000	271.00	813,000
大光銀行	2,000	190.00	380,000
愛媛銀行	3,000	208.00	624,000
トマト銀行	2,000	146.00	292,000
みなと銀行	5,000	152.00	760,000
京葉銀行	5,000	420.00	2,100,000
関西アーバン銀行	800	1,045.00	836,000
栃木銀行	3,000	418.00	1,254,000
北日本銀行	200	2,609.00	521,800
東和銀行	8,000	81.00	648,000
福島銀行	7,000	71.00	497,000
大東銀行	3,000	177.00	531,000
トモニホールディングス	4,200	331.00	1,390,200
フィデアホールディングス	3,400	172.00	584,800
池田泉州ホールディングス	5,900	387.00	2,283,300
F P G	1,600	957.00	1,531,200
S B Iホールディングス	6,700	1,016.00	6,807,200
ジャフコ	900	3,175.00	2,857,500
大和証券グループ本社	52,000	671.80	34,933,600
野村ホールディングス	106,600	494.10	52,671,060
岡三証券グループ	5,000	532.00	2,660,000
丸三証券	1,600	1,199.00	1,918,400
東洋証券	2,000	289.00	578,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	6,400	523.00	3,347,200
光世証券	1,000	138.00	138,000
水戸証券	1,700	323.00	549,100
いちよし証券	1,200	1,078.00	1,293,600
松井証券	2,800	963.00	2,696,400
だいこう証券ビジネス	300	770.00	231,000
マネックスグループ	6,500	283.00	1,839,500
カブドットコム証券	4,900	330.00	1,617,000
極東証券	700	1,327.00	928,900
岩井コスモホールディングス	500	1,055.00	527,500
藍澤証券	800	564.00	451,200
マネースクウェアHD	200	995.00	199,000
マネーパートナーズグループ	500	308.00	154,000
かんぽ生命保険	1,700	2,377.00	4,040,900
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	12,300	3,075.00	37,822,500
アニコムホールディングス	400	2,493.00	997,200
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	16,500	2,972.00	49,038,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	5,300	1,552.00	8,225,600
第一生命保険	35,500	1,306.00	46,363,000

東京海上ホールディングス	22,400	3,791.00	84,918,400
T & Dホールディングス	20,200	1,116.50	22,553,300
全国保証	1,400	3,310.00	4,634,000
クレディセゾン	4,200	1,854.00	7,786,800
アクリーティブ	500	368.00	184,000
芙蓉総合リース	600	4,605.00	2,763,000
興銀リース	1,000	1,885.00	1,885,000
東京センチュリーリース	1,300	3,740.00	4,862,000
日本証券金融	2,400	479.00	1,149,600
アイフル	9,300	294.00	2,734,200
ポケットカード	600	440.00	264,000
リコーリース	400	3,170.00	1,268,000
イオンフィナンシャルサービス	3,600	2,500.00	9,000,000
アコム	11,100	468.00	5,194,800
ジャックス	3,000	375.00	1,125,000
オリエントコーポレーション	23,900	191.00	4,564,900
日立キャピタル	1,300	2,371.00	3,082,300
オリックス	39,200	1,429.50	56,036,400
三菱UFJリース	14,000	481.00	6,734,000
日本取引所グループ	16,300	1,729.00	28,182,700
イー・ギャランティ	200	2,161.00	432,200
NECキャピタルソリューション	200	1,547.00	309,400
日本駐車場開発	6,100	119.00	725,900
ヒューリック	11,500	989.00	11,373,500
三栄建築設計	200	1,200.00	240,000
野村不動産ホールディングス	3,700	1,979.00	7,322,300
三重交通グループホールディングス	1,000	441.00	441,000
日本商業開発	200	1,747.00	349,400
プレサンスコーポレーション	200	3,545.00	709,000
ユニゾホールディングス	300	3,920.00	1,176,000
日本管理センター	400	1,739.00	695,600
フージャースホールディングス	800	427.00	341,600
オープンハウス	800	2,106.00	1,684,800
東急不動産ホールディングス	13,400	707.00	9,473,800
飯田グループホールディングス	5,100	2,052.00	10,465,200
パーク24	2,800	2,943.00	8,240,400
バラカ	200	1,331.00	266,200
三井不動産	29,000	2,652.00	76,908,000
三菱地所	41,000	2,144.50	87,924,500
平和不動産	1,000	1,184.00	1,184,000
東京建物	6,000	1,327.00	7,962,000
ダイビル	1,400	931.00	1,303,400

京阪神ビルディング	900	571.00	513,900
住友不動産	13,000	3,085.00	40,105,000
大京	10,000	182.00	1,820,000
テーオーシー	2,100	901.00	1,892,100
東京楽天地	1,000	473.00	473,000
レオパレス21	6,500	668.00	4,342,000
スターツコーポレーション	600	2,307.00	1,384,200
フジ住宅	700	678.00	474,600
空港施設	700	499.00	349,300
住友不動産販売	400	2,135.00	854,000
ゴールドクレスト	400	1,616.00	646,400
日本エスリード	200	1,037.00	207,400
日神不動産	700	359.00	251,300
タカラレーベン	2,500	595.00	1,487,500
サンヨーハウジング名古屋	300	1,015.00	304,500
イオンモール	3,600	1,589.00	5,720,400
ファースト住建	200	1,285.00	257,000
トーセイ	800	650.00	520,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	3,400	1,096.00	3,726,400
サンフロンティア不動産	700	1,005.00	703,500
エフ・ジェー・ネクスト	500	497.00	248,500
グランディハウス	500	364.00	182,000
日本空港ビルデング	1,800	4,010.00	7,218,000
日本工営	2,000	360.00	720,000
ネクスト	1,700	1,030.00	1,751,000
ジェイエシーリクルートメント	300	1,074.00	322,200
日本M&Aセンター	900	5,110.00	4,599,000
アコーディア・ゴルフ	1,600	1,098.00	1,756,800
タケエイ	500	727.00	363,500
トラスト・テック	100	2,388.00	238,800
パソナグループ	500	632.00	316,000
GCAサヴィアン	500	877.00	438,500
エス・エム・エス	700	1,802.00	1,261,400
テンプホールディングス	4,100	1,458.00	5,977,800
リニカル	300	1,552.00	465,600
クックパッド	1,300	2,016.00	2,620,800
エスクリ	200	570.00	114,000
学情	200	1,019.00	203,800
スタジオアリス	300	2,232.00	669,600
シミックホールディングス	300	1,558.00	467,400
総合警備保障	2,000	5,790.00	11,580,000
カカコム	4,300	1,978.00	8,505,400

アイロムグループ	200	748.00	149,600
ルネサンス	300	1,205.00	361,500
ディップ	600	2,179.00	1,307,400
オプトホールディング	400	587.00	234,800
新日本科学	600	365.00	219,000
ツクイ	700	1,337.00	935,900
エムスリー	5,100	2,699.00	13,764,900
ツカダ・グローバルホールディング	400	673.00	269,200
アウトソーシング	300	2,905.00	871,500
ウェルネット	200	3,145.00	629,000
ディー・エヌ・エー	2,600	1,745.00	4,537,000
博報堂D Yホールディングス	8,100	1,261.00	10,214,100
ぐるなび	700	2,515.00	1,760,500
エスアールジータカミヤ	500	318.00	159,000
ファンコミュニケーションズ	1,400	652.00	912,800
WDBホールディングス	200	872.00	174,400
バリューコマース	500	342.00	171,000
J Pホールディングス	1,500	258.00	387,000
E P Sホールディングス	700	1,357.00	949,900
プレステージ・インターナショナル	500	1,207.00	603,500
アミューズ	200	4,110.00	822,000
ドリームインキュベータ	200	2,166.00	433,200
クイック	300	711.00	213,300
ケネディクス	7,900	464.00	3,665,600
電通	6,500	5,540.00	36,010,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	300	461.00	138,300
ぴあ	200	2,163.00	432,600
イオンファンタジー	200	2,126.00	425,200
みらかホールディングス	1,500	4,760.00	7,140,000
アルプス技研	200	2,191.00	438,200
日本空調サービス	300	1,111.00	333,300
オリエンタルランド	6,300	8,010.00	50,463,000
ダスキン	1,700	2,160.00	3,672,000
明光ネットワークジャパン	700	1,132.00	792,400
ファルコホールディングス	300	1,267.00	380,100
ラウンドワン	1,800	691.00	1,243,800
リゾートトラスト	2,500	2,513.00	6,282,500
ビー・エム・エル	300	4,095.00	1,228,500
りらいあコミュニケーションズ	1,000	982.00	982,000
ユー・エス・エス	7,100	1,719.00	12,204,900
サイバーエージェント	1,400	5,130.00	7,182,000
楽天	27,400	999.60	27,389,040

テー・オー・ダブリュー	400	582.00	232,800
セントラルスポーツ	200	2,272.00	454,400
フルキャストホールディングス	500	667.00	333,500
テクノプロ・ホールディングス	900	3,070.00	2,763,000
ジャパンマテリアル	200	2,216.00	443,200
ベクトル	200	2,588.00	517,600
アサンテ	200	1,496.00	299,200
N・フィールド	200	1,098.00	219,600
リクルートホールディングス	11,800	3,380.00	39,884,000
日本郵政	12,900	1,391.00	17,943,900
リロ・ホールディング	200	12,850.00	2,570,000
東祥	200	3,945.00	789,000
エイチ・アイ・エス	1,000	3,260.00	3,260,000
共立メンテナンス	400	8,500.00	3,400,000
イチネンホールディングス	600	905.00	543,000
建設技術研究所	300	914.00	274,200
スペース	300	1,239.00	371,700
よみうりランド	1,000	419.00	419,000
東京都競馬	4,000	212.00	848,000
常磐興産	2,000	149.00	298,000
カナモト	800	2,479.00	1,983,200
東京ドーム	5,000	521.00	2,605,000
西尾レントオール	500	2,598.00	1,299,000
トランス・コスモス	700	2,419.00	1,693,300
乃村工藝社	1,300	1,433.00	1,862,900
藤田観光	2,000	552.00	1,104,000
KNT-CTホールディングス	3,000	170.00	510,000
日本管財	500	1,756.00	878,000
トーカイ	300	3,070.00	921,000
セコム	6,100	8,120.00	49,532,000
セントラル警備保障	300	2,114.00	634,200
丹青社	1,100	670.00	737,000
メイテック	700	3,980.00	2,786,000
アサツー ディ・ケイ	1,000	2,859.00	2,859,000
応用地質	600	1,224.00	734,400
船井総研ホールディングス	800	1,399.00	1,119,200
進学会	300	622.00	186,600
ベネッセホールディングス	2,000	3,535.00	7,070,000
イオンディライト	600	3,635.00	2,181,000
ナック	400	834.00	333,600
ニチイ学館	1,000	789.00	789,000
ダイセキ	1,100	1,757.00	1,932,700

ステップ	200	991.00	198,200	
合 計	9,106,100		10,736,117,080	

(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

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ニュー トピックス インデックス

(平成28年 2月29日現在)

資産総額	577,210,404円
負債総額	1,373,424円
純資産総額（ - ）	575,836,980円
発行済口数	1,001,582,225口
1口当たり純資産額（ / ）	0.5749円
（1万口当たり純資産額）	（5,749円）

(参考)ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(平成28年 2月29日現在)

資産総額	12,036,738,843円
負債総額	392,782,464円
純資産総額（ - ）	11,643,956,379円
発行済口数	7,265,578,599口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6026円
（1万口当たり純資産額）	（16,026円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

委託者は、このファンド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。

(1) 投資信託受益証券の名義書換等

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡

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り替えの申請をするものとしてします。

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。

上記の振り替えについて、委託者は、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、委託者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、委託者および受託者に対抗することができません。

(6) 受益権の再分割

委託者は、受託者と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、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) 償還金

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て）に支払います。

(8) 質権口記載また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】

a. 資本金の額（平成28年10月1日現在（予定））

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

種類株式の発行が可能

直近5カ年における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 会社の機構（平成28年10月1日現在（予定））

（イ）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。

（ロ）投資運用の意思決定機構

1. 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。

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。

委託会社は、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更する予定です。

平成28年5月31日現在におけるD I A Mアセットマネジメント株式会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（円）
追加型公社債投資信託	0	0
追加型株式投資信託	379	5,885,771,137,238
単位型公社債投資信託	43	313,084,944,195
単位型株式投資信託	6	74,158,972,183
合計	428	6,273,015,053,616

（ご参考）

平成28年5月31日現在におけるみずほ投信投資顧問株式会社および新光投信株式会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

・みずほ投信投資顧問株式会社

基本的性格	本数	純資産総額（円）
追加型公社債投資信託	15	329,653,710,450
追加型株式投資信託	231	2,186,251,331,253
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	5	11,626,381,586
合計	251	2,527,531,423,289

・新光投信株式会社

基本的性格	本数	純資産総額（円）
追加型公社債投資信託	26	669,428,600,763
追加型株式投資信託	244	3,203,001,207,380
単位型公社債投資信託	4	17,754,535,219
単位型株式投資信託	72	256,599,381,477

合計	346	4,146,783,724,839
----	-----	-------------------

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるD I A Mアセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第31期事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

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

委託会社の財務諸表に引き続き、みずほ投信投資顧問株式会社の第53期事業年度の財務諸表及び新光投信株式会社の第56期事業年度の財務諸表を参考として添付しております。

（1）【貸借対照表】

（単位：千円）

	第30期 （平成27年3月31日現在）	第31期 （平成28年3月31日現在）
（資産の部）		
流動資産		
現金・預金	12,051,921	12,951,736
金銭の信託	14,169,657	13,094,914
前払費用	57,309	44,951
未収委託者報酬	4,622,292	4,460,404
未収運用受託報酬	1,737,052	1,859,778
未収投資助言報酬	2 312,206	2 277,603
未収収益	260,845	205,097
繰延税金資産	411,797	341,078
その他	46,782	40,689
流動資産計	33,669,865	33,276,255
固定資産		
有形固定資産	432,933	658,607
建物	1 138,967	1 29,219

車両運搬具	1	941	1	549
器具備品	1	243,908	1	184,683
建設仮勘定		49,116		444,155
無形固定資産		1,912,472		1,706,201
商標権	1	101	1	7
ソフトウェア	1	1,702,633	1	1,645,861
ソフトウェア仮勘定		202,399		53,036
電話加入権		7,148		7,148
電信電話専用施設利用権	1	188	1	146
投資その他の資産		4,343,365		6,497,772
投資有価証券		613,137		458,701
関係会社株式		2,316,596		3,229,196
繰延税金資産		582,861		679,092
差入保証金		733,907		2,040,945
その他		96,862		89,835
固定資産計		6,688,771		8,862,580
資産合計		40,358,637		42,138,836

(単位：千円)

	第30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,605,579	966,681
未払金	2,515,377	2,055,332
未払償還金	49,873	49,873
未払手数料	1,836,651	1,744,274
その他未払金	628,852	261,185
未払費用	2 2,196,267	2 3,076,566
未払法人税等	1,539,263	1,223,957
未払消費税等	671,243	352,820
賞与引当金	722,343	728,769
その他	30,000	-
流動負債計	9,280,074	8,404,128
固定負債		
退職給付引当金	868,928	997,396
役員退職慰労引当金	110,465	154,535
固定負債計	979,394	1,151,932
負債合計	10,259,468	9,556,060
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000

資本剰余金	2,428,478	2,428,478
資本準備金	2,428,478	2,428,478
利益剰余金	25,417,784	28,000,340
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金		
別途積立金	19,480,000	22,030,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	5,314,491	5,347,047
株主資本計	29,846,262	32,428,818
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	252,905	153,956
評価・換算差額等計	252,905	153,956
純資産合計	30,099,168	32,582,775
負債・純資産合計	40,358,637	42,138,836

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第30期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	28,170,831		30,188,445	
運用受託報酬	7,064,021		7,595,678	
投資助言報酬	1,032,659		993,027	
その他営業収益	828,240		724,211	
営業収益計		37,095,752		39,501,363
営業費用				
支払手数料	12,416,659		12,946,176	
広告宣伝費	527,620		468,931	
公告費	288		258	
調査費	6,317,052		7,616,390	
調査費	4,129,778		4,969,812	
委託調査費	2,187,273		2,646,578	
委託計算費	385,121		412,257	
営業雑経費	488,963		548,183	
通信費	34,089		34,855	
印刷費	414,215		436,756	
協会費	24,177		23,698	
諸会費	37		40	
支払販売手数料	16,443		52,833	
営業費用計		20,135,705		21,992,198
一般管理費				
給料	5,260,910		5,382,757	
役員報酬	242,666		242,446	
給料・手当	4,378,307		4,431,015	
賞与	639,936		709,295	
交際費	37,625		43,975	
寄付金	2,697		2,628	
旅費交通費	242,164		254,276	
租税公課	127,947		180,892	
不動産賃借料	686,770		1,128,367	
退職給付費用	218,863		226,460	

固定資産減価償却費	628,056		902,248	
福利厚生費	33,310		36,173	
修繕費	13,807		31,617	
賞与引当金繰入額	722,343		728,769	
役員退職慰労引当金繰入額	50,327		49,320	
役員退職慰労金	25,501		5,250	
機器リース料	87		140	
事務委託費	231,303		251,913	
事務用消耗品費	67,208		70,839	
器具備品費	5,869		14,182	
諸経費	135,032		214,532	
一般管理費計		8,489,827		9,524,346
営業利益		8,470,220		7,984,819

(単位：千円)

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

法人税等合計		2,940,256		2,584,730
当期純利益		5,126,003		5,126,556

(3) 【株主資本等変動計算書】

第30期（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当期変動額合計	9,746	2,807,749
当期末残高	252,905	30,099,168

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当期末残高	153,956	32,582,775
-------	---------	------------

重要な会計方針

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

未適用の会計基準等

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

（1）概要

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

（2）適用予定日

平成28年4月1日以後に開始する事業年度の期首から適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、評価中であります。

会計上の見積りの変更

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

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

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

追加情報

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

2. 関係会社項目

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

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

2. 固定資産売却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第30期(自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

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

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券の主な内容は、政策投資目的で保有している株式であります。

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

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

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

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第30期（平成27年3月31日現在）

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

第31期（平成28年3月31日現在）

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

(1) 未払法人税等	1,223,957	1,223,957	-
負債計	1,223,957	1,223,957	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 投資有価証券

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

負 債

(1) 未払法人税等

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第30期（平成27年3月31日現在）

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

第31期（平成28年3月31日現在）

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

（注4）社債、新株予約権付社債及び長期借入金の決算日後の返済予定額
該当事項はありません。

（有価証券関係）

1. 売買目的有価証券

該当事項はありません。

2. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

3. 子会社株式及び関連会社株式

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

4. その他有価証券

第30期（平成27年3月31日現在）

（千円）

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

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

第31期（平成28年3月31日現在）

（千円）

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

貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他（投資信託）	-	-	-
小計	-	-	-
合計	381,005	159,101	221,903

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

5. 当該事業年度中に売却した満期保有目的の債券
該当事項はありません。

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

7. 減損処理を行った有価証券
該当事項はありません。

（金銭の信託関係）

1. 運用目的の金銭の信託

第30期（平成27年3月31日現在）

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

第31期（平成28年3月31日現在）

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

2. 満期保有目的の金銭の信託
該当事項はありません。

3. その他の金銭の信託
該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
該当事項はありません。

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(千円)	
	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,079,828	973,035
会計方針の変更による累積的影響額	203,600	-
会計方針の変更を反映した期首残高	876,227	973,035
勤務費用	128,297	134,944
利息費用	7,798	8,660
数理計算上の差異の発生額	10,345	21,441
退職給付の支払額	49,633	51,531
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	973,035	1,086,550

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

	(千円)	
	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	973,035	1,086,550
未積立退職給付債務	973,035	1,086,550
未認識数理計算上の差異	89,550	79,449
未認識過去勤務費用	14,556	9,704
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	868,928	997,396
退職給付引当金	868,928	997,396
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	868,928	997,396

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(千円)	
	第30期 (自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)
勤務費用	128,297	134,944
利息費用	7,798	8,660

数理計算上の差異の費用処理額	33,455	31,542
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
確定給付制度に係る退職給付費用	174,402	179,999

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるた

め、注記を省略しております。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

（１）サービスごとの情報

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

（注）一般企業の売上高に代えて、営業収益を記載しております。

（２）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者との取引）

(1)親会社及び法人主要株主等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の 内容又 は職業	議決権等の 所有(被所 有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
その他 の関係 会社	第一生命 保険株式 会社	東京 都千 代田 区	3,431 億円	生命保 険業	(被所有) 直接50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用の 助言	資産運用の 助言の顧問 料の受入	862,448	未収投 資助言 報酬	237,575

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2)子会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

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

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

（注3）増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3)兄弟会社等

第30期（自平成26年4月1日 至平成27年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売代行手数料	2,217,439	未払手数料	306,365
								預金の預入(純額)	551,351	現金・預金	11,276,198
								受取利息	2,139	未収収益	71
関係会社の子会社	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社	東京都千代田区	2億円	金融技術研究等	-	兼務1名	当社預り資産の助言	当社預り資産の助言の顧問料の支払	407,531	未払費用	240,725
								業務委託料の支払	8,540	未払金	6,501
関係会社の子会社	資産管理サービス信託銀行株式会社	東京都中央区	500億円	資産管理等	-	-	当社信託財産の運用	信託元本の追加(純額)	3,500,000	金銭の信託	14,169,657
								信託報酬の支払	8,254		

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	-	兼務1名	当社設定投資信託の販売、預金取引	投資信託の販売代行手数料	3,023,040	未払手数料	372,837
								預金の預入(純額)	879,733	現金・預金	12,155,931
								受取利息	1,787	未収収益	123

の 関 係 会 社 の 子 会 社	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社	東京都千代田区	2億円	金融技術研究等	-	兼務 1名	当社預り資産の助言	当社預り資産の助言の顧問料の支払 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	-	-	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

取引条件及び取引条件の決定方針等

- （注1）投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- （注2）資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- （注3）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。
- （注4）預金取引は、市場金利を勘案した利率が適用されております。
- （注5）信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

（1株当たり情報）

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

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

（参考）みずほ投信投資顧問株式会社の経理状況

当該（参考）において、みずほ投信投資顧問株式会社を「当社」という。

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

基づいて作成しております。

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

独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

みずほ投信投資顧問株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

(1)貸借対照表

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

純資産の部		
株主資本		
資本金	2,045,600	2,045,600
資本剰余金		
資本準備金	2,266,400	2,266,400
その他資本剰余金	2,450,074	2,450,074
資本剰余金合計	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		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	17,538,139		17,358,667	
運用受託報酬	4,463,429		5,050,661	
営業収益合計	22,001,569		22,409,329	
営業費用				
支払手数料	8,480,510		7,999,728	
広告宣伝費	247,790		205,521	
公告費	1,140		152	
調査費				
調査費	1,259,067		1,312,466	
委託調査費	4,883,037		5,299,598	
図書費	4,308		3,703	
調査費合計	6,146,412		6,615,769	
委託計算費	101,919		116,405	
営業雑経費				
通信費	59,454		46,151	
印刷費	128,143		246	
協会費	18,777		20,221	
諸会費	2,540		2,317	
その他	855,319		958,635	
営業雑経費合計	1,064,234		1,027,572	
営業費用合計	16,042,008		15,965,148	
一般管理費				
給料				
役員報酬	142,983		143,812	
給料手当	1,832,723		1,905,880	
賞与	295,180		304,122	

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

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				

株主資本以外の項目の当期変動額（純額）				
当期変動額合計				
当期末残高	2,045,600	2,266,400	2,450,074	4,716,474

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産（リース資産を除く）

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

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

(3) リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定率法を採用しております。

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

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

(3) 退職給付引当金（前払年金費用）

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

(4) 役員退職慰労引当金

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

(5) 時効後支払損引当金

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

5. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

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

6. ヘッジ会計の方法

(1) ヘッジ会計の方法

時価ヘッジによっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段...株価指数先物取引

ヘッジ対象...有価証券

(3) ヘッジ方針

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

(4) ヘッジの有効性評価の方法

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

7. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

未適用の会計基準等

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

1. 概要

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

2. 適用予定日

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

3. 当該会計基準等の適用による影響

当該適用指針の適用による影響は、軽微であります。

会計上の見積りの変更に関する注記

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

追加情報

DIAMアセットマネジメント株式会社（代表取締役社長 西 恵正）、みずほ信託銀行株式会社（取締役社長 中野 武夫）、みずほ投信投資顧問株式会社（取締役社長 中村 英剛）及び新光投信株式会社（取締役社長 後藤

修一）間での平成27年9月30日付統合基本合意書に基づき、資産運用機能の統合に向けた協議・準備を進めてまいりましたが、平成28年3月3日付で新会社に係わる以下事項につき内定いたしました。

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

注記事項

（貸借対照表関係）

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

（損益計算書関係）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1 減損損失

当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

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

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

2 事業再構築費用

事業再構築に伴うグループ会社への転籍関連費用であります。

3 外国税負担損失

証券投資信託に係る外国税負担額であります。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当するものではありません。

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

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

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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

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

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 その他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
預金	20,800,853	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,827,951	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,812,198	-	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの 証券投資信託	127,840	-	-	-	-	3,300,657
合計	24,568,844	-	-	-	-	3,300,657

当事業年度(平成28年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
預金	20,902,546	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	2,183,032	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,713,643	-	-	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの 証券投資信託	82,540	-	-	-	-	2,395,185
合計	24,881,762	-	-	-	-	2,395,185

(有価証券関係)

1 その他有価証券

前事業年度(平成27年3月31日)

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

当事業年度(平成28年3月31日)

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

2 当事業年度中に売却したその他有価証券
該当するものはありません。

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

（デリバティブ取引関係）

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
株式関連

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

（注）時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
株式関連

前事業年度（平成27年3月31日）

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

（注）時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

当事業年度（平成28年3月31日）

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

（注）時価の算定方法

取引所の価格に基づき算定しております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度		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		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	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		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				
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）

該当するものではありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

上記の取引については、一般取引条件と同様に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

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

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

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。

(参考)新光投信株式会社の経理状況

1. 財務諸表の作成方法について

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

なお、財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

2. 監査証明について

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

独立監査人の監査報告書

平成28年6月10日

新光投信株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 伊藤 志保

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 福村 寛

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するため

に、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以 上

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

(1) 貸借対照表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,427,042	14,861,160
有価証券	3,200,000	3,500,000
貯蔵品	5,117	4,282
立替金	23,184	14,857
前払金	64,821	67,307
前払費用	18,242	17,989
未収入金	872	153
未収委託者報酬	3,187,770	2,884,368
未収運用受託報酬	99,054	82,656
未収収益	6,338	8,528
繰延税金資産	372,215	326,063
流動資産合計	20,404,659	21,767,367
固定資産		
有形固定資産		
建物（純額）	2 12,687	2 0
構築物（純額）	2 1,444	2 0
器具・備品（純額）	2 86,688	2 44,868
有形固定資産合計	100,820	44,868
無形固定資産		

電話加入権	91	91
ソフトウェア	85,517	55,116
ソフトウェア仮勘定	669	1,944
無形固定資産合計	86,278	57,152
投資その他の資産		
投資有価証券	5,101,854	2,858,652
関係会社株式	77,100	77,100
長期差入保証金	124,246	23,339
長期繰延税金資産	-	29,604
前払年金費用	396,211	378,381
その他	6,632	6,632
投資その他の資産合計	5,706,044	3,373,710
固定資産合計	5,893,143	3,475,731
資産合計	26,297,802	25,243,098

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	17,893	19,103
リース債務	345	-
未払金		
未払収益分配金	160	152
未払償還金	5,083	4,216
未払手数料	1 1,558,682	1 1,360,372
その他未払金	952,018	516,568
未払金合計	2,515,945	1,881,309
未払費用	722,806	746,430
未払法人税等	1,222,883	857,031
賞与引当金	451,000	547,750
役員賞与引当金	66,000	44,000
外国税支払損失引当金	184,111	-
訴訟損失引当金	30,000	40,000
流動負債合計	5,210,985	4,135,625
固定負債		
繰延税金負債	89,752	-
退職給付引当金	155,806	146,617
役員退職慰労引当金	39,333	48,333
執行役員退職慰労引当金	63,916	85,916
固定負債合計	348,809	280,867
負債合計	5,559,794	4,416,492
純資産の部		
株主資本		

資本金	4,524,300	4,524,300
資本剰余金		
資本準備金	2,761,700	2,761,700
資本剰余金合計	2,761,700	2,761,700
利益剰余金		
利益準備金	360,493	360,493
その他利益剰余金		
別途積立金	8,900,000	8,900,000
繰越利益剰余金	3,981,245	4,185,368
利益剰余金合計	13,241,738	13,445,861
自己株式	72,415	-
株主資本合計	20,455,322	20,731,861
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	282,685	94,744
評価・換算差額等合計	282,685	94,744
純資産合計	20,738,008	20,826,605
負債純資産合計	26,297,802	25,243,098

(2) 損益計算書

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成26年4月 1日 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	164,657
その他特別損失		22,227		-
特別損失合計		305,082		310,625
税引前当期純利益		5,629,593		5,575,383
法人税、住民税及び事業税		2,111,379		1,832,729
法人税等調整額		66,999		19,773
法人税等合計		2,044,380		1,852,503
当期純利益		3,585,212		3,722,880

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度（自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本			評価・換算差額等	純資産合計
	利益剰余金	自 己 株 式	株 主 資 本 合 計	その他有価証 券評価差額金	
	利 益 剰余金 合 計				
当期首残高	12,149,658	72,415	19,363,242	50,874	19,414,117

会計方針の変更による 累積的影響額	46,276		46,276		46,276
会計方針の変更を反映した 当期首残高	12,195,935	72,415	19,409,519	50,874	19,460,393
当期変動額					
剰余金の配当	2,539,409		2,539,409		2,539,409
当期純利益	3,585,212		3,585,212		3,585,212
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）				231,810	231,810
当期変動額合計	1,045,803	-	1,045,803	231,810	1,277,614
当期末残高	13,241,738	72,415	20,455,322	282,685	20,738,008

当事業年度（自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本				評価・換算 差額等	純資産合計
	利益剰余金		自 己 株 式	株 主 資 本 合 計		
	その他利益 剰余金 繰 越 利 益 剰余金	利 益 剰余金 合 計			その他有価 証券評価差 額金	
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

（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 その他有価証券	8,102,802	8,102,802	-
(3) 未収委託者報酬	3,187,770	3,187,770	-

当事業年度（平成28年3月31日）

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

(注) 1. 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金及び預金

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

(2) 有価証券及び投資有価証券

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

(3) 未収委託者報酬

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

(注) 2. 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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

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

(注) 3 . 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

(有価証券関係)

1 . 関連会社株式

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

2 . その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券 国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-
	その他	-	-	-
	(3) その他	2,787,026	2,215,104	571,921
	小計	2,787,026	2,215,104	571,921
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの	(1) 株式	-	-	-
	(2) 債券 国債・地方債等	-	-	-
	社債	-	-	-

	その他	-	-	-
	(3)その他	5,315,776	5,470,388	154,612
	小計	5,315,776	5,470,388	154,612
合計		8,102,802	7,685,493	417,309

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

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

3．売却したその他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1)株式	-	-	-

(2)債券			
国債・地方債等	-	-	-
社債	-	-	-
その他	-	-	-
(3)その他	2,209,763	225,965	60,150
合計	2,209,763	225,965	60,150

4．減損処理を行った有価証券

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

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

（退職給付関係）

1．採用している退職給付制度の概要

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

2．確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

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

(5) 年金資産に関する事項

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

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な

資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

(注) 繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

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

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

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下で

あるため注記を省略しております。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の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

4【利害関係人との取引制限】

委託者は、「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若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、若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、若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、委託者の親法人等（委託者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（委託者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) 委託者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、運用財産の額若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、委託者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、若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】

a．定款の変更等

平成28年9月7日付で、株式に関する事項等の定款の変更を行いました。

b．訴訟事件その他の重要事項

委託会社は、平成28年10月1日にみずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）と統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更する予定です（関係当局の認可等を前提とします）。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 三井住友信託銀行株式会社（「受託者」）

a. 資本金の額

平成28年3月末日現在、342,037百万円

b. 事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むと共に、金融機関の信託業務の兼営に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額及び事業の内容は以下の「販売会社一覧表」のとおりです。

販売会社一覧表

（資本金の額は平成28年3月末日現在）

名称	資本金の額 (単位:百万円)	事業の内容
みずほ証券株式会社	125,167	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三にいがた証券株式会社	852	同上
株式会社しん証券さかもと	450	同上

2【関係業務の概要】

「受託者」は以下の業務を行います。

- (1) 委託者の指図に基づく投資信託財産の保管、管理
- (2) 投資信託財産の計算
- (3) その他上記業務に付随する一切の業務

「販売会社」は以下の業務を行います。

- (1) 募集・販売の取り扱い
- (2) 受益者に対する一部解約事務
- (3) 受益権の買い取り
- (4) 受益者に対する一部解約金、収益分配金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益権の取得申込者に対する目論見書の交付
- (7) 受益者に対する運用報告書の交付
- (8) 所得税および地方税の源泉徴収
- (9) その他上記業務に付随する一切の業務

3【資本関係】

該当事項はありません（平成28年10月1日現在（予定））。

（持株比率5%以上を記載します。）

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・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事務の一部（投資信託財産の管理）を原信託受託者から再信託受託者（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原投資信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙などに委託会社の名称、ロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、ファンドの形態などを記載することがあります。また、以下の内容を記載することがあります。
- ・ 交付目論見書または請求目論見書である旨
 - ・ 金融商品取引法上の目論見書である旨
 - ・ 委託会社の金融商品取引業者登録番号
 - ・ 詳細情報の入手方法
委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など
請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
 - ・ 目論見書の使用開始日
 - ・ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
 - ・ ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
 - ・ 投資信託の財産は、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
 - ・ 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
 - ・ 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載
- (2) 目論見書は別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。
- (3) 目論見書は電子媒体などとして使用される他、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (4) 本書の記載内容について、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (5) 目論見書に記載された運用実績のデータは、随時更新される場合があります。
- (6) 請求目論見書にファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

平成28年5月31日

D I A Mアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山内 正彦 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山野 浩 印

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

（注２）X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成28年4月5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、「ファンドの経理状況」に掲げられているニュー トピックス インデックスの平成27年2月24日から平成28年2月22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、ニュー トピックス インデックスの平成28年2月22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

新光投信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

- () 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。