

【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】	2018年11月22日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	三木谷 正直
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	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(2018年11月23日から2019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）アセットマネジメントOne株式会社（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/>

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。また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入(積立)をすることができる場合があります。

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】

2018年11月23日から2019年5月22日までです。

申込期間は上記期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

(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経由して、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】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(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。

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。

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 中近東(中東) エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	TOPIX その他 ()
不動産投信				
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))				
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。

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、1968年1月4日（基準時）の時価総額を100として1969年7月1日から株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」といいます。）が算出・公表しています。

東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXの商標は、株東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。

株東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

株東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（TOPIX）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

株東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

ニュー トピックス インデックス マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

株東京証券取引所は、ニュー トピックス インデックス マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、ニュー トピックス インデックス マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

株東京証券取引所は、委託会社またはニュー トピックス インデックス マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドの購入

者のニーズを、東証株価指数（TOPIX）の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所はニュー トピックス インデックス マザーファンドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

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	・基準時の時価総額の修正方法
$\text{毎日の指数} = \frac{\text{当日の時価総額}}{\text{基準時の時価総額}} \times 100$	$\text{修正後の基準時価総額} = \frac{\text{修正前日の時価総額} \pm \text{修正額}}{\text{修正前日の基準時価総額} \times \frac{\text{修正前日の時価総額}}{\text{修正前日の時価総額}}}$

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。

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。

（２）【ファンドの沿革】

1989年2月23日

投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始

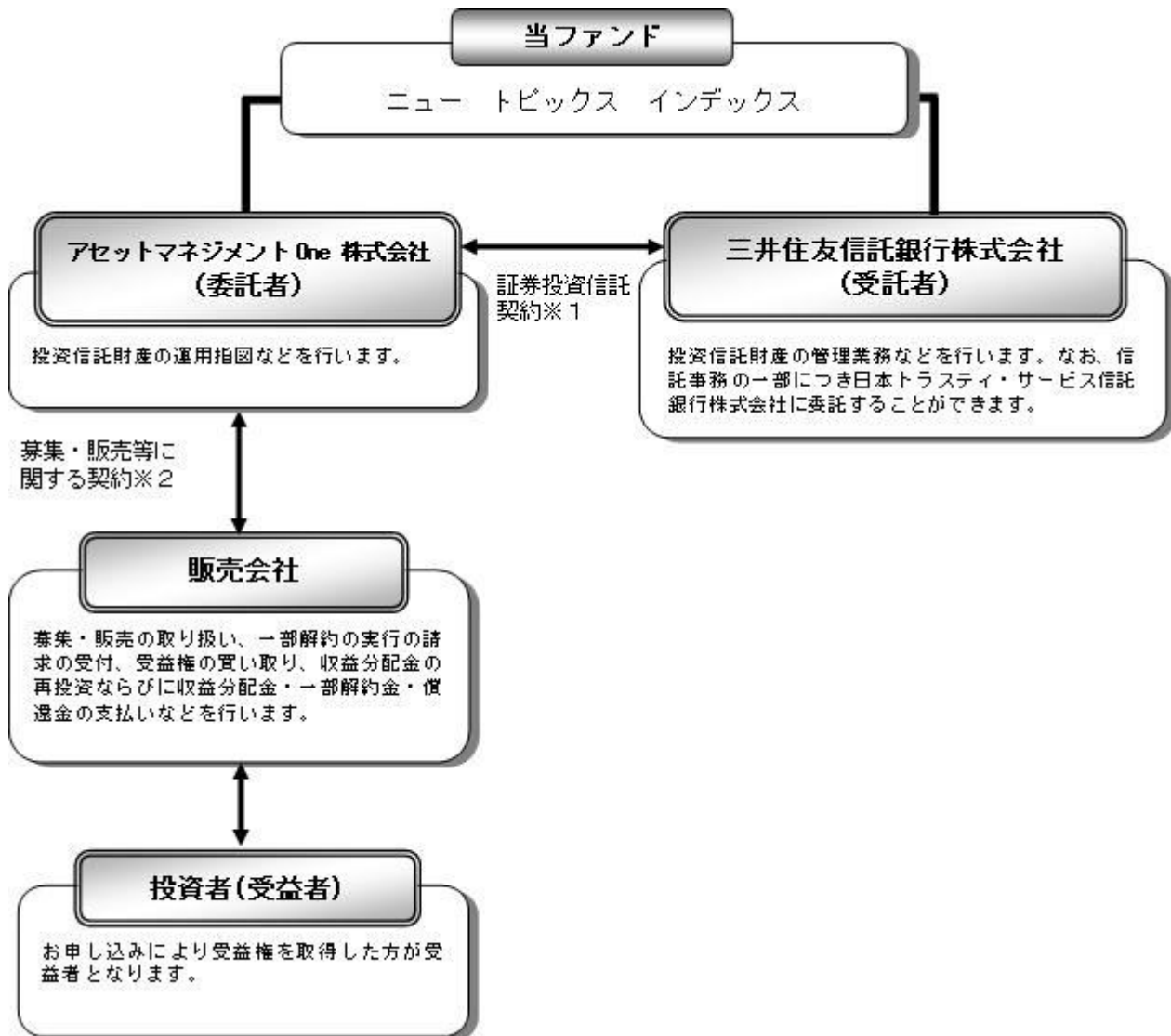
1999年1月20日

約款変更（運用の基本方針および信託期間の変更）

2001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
2016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

(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

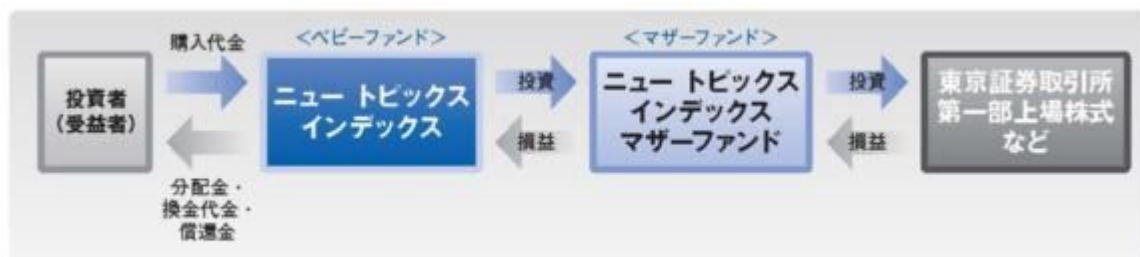
委託者と受託者との間において「証券投資信託契約（投資信託約款）」を締結しており、委託者および受託者の業務、受益者の権利、受益権、投資信託財産の運用・評価・管理、収益の分配、信託の期間・償還等を規定しています。

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。

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. 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2018年8月31日現在）

委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998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
1998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
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月1日	DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

（2018年8月31日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 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。

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。

運用プロセス

ニュー トピックス インデックス マザーファンドは、以下のプロセスにより「東証株価指数（TOPIX）」に連動する投資成果をめざした運用を行います。

ステップ 1

ポートフォリオの構築(頻度: 適宜)

- TOPIX に含まれる銘柄から、時価総額が小さい銘柄等を除外。
- 投資にあたっては、東京証券取引所が日々発表している、指数用株式数を考慮して、ファンドの資産規模に応じて各銘柄の株数を決定。



ステップ 2

売買執行(頻度: 適宜)

- ステップ 1 の結果に基づき、必要な売買を執行。
※ 株価指数先物取引等を一部利用することがあります。
- 株式と株価指数先物取引等の合計の実質組入比率を高位に維持し、TOPIX との連動性を確保。

なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは2018年8月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

(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、)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、)
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。

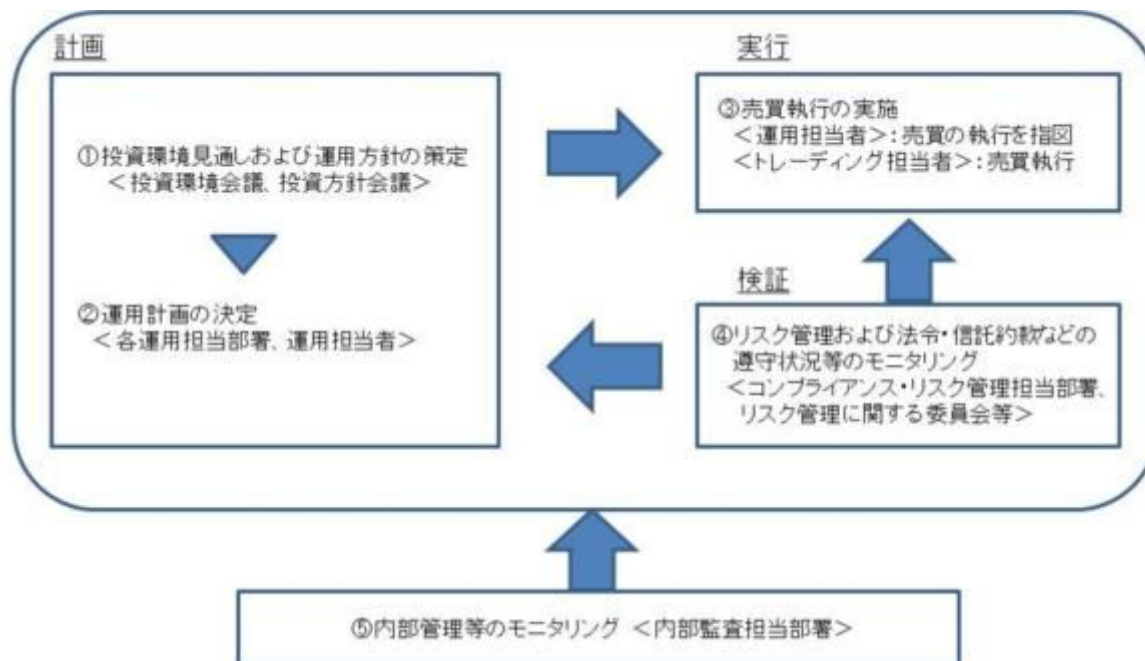
(ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

(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します。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署（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。

定期的に行わ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2018年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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、次期以降の分配金にあてるため、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．資金の借り入れ

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

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乖離

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乖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な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) 有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- (ハ) 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。
- (ニ) 投資信託財産の状況によっては、目指す運用が行われないことがあります。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。
- (ホ) 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。
- (ヘ) 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る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。
- (ト) 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。
- (チ) 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。

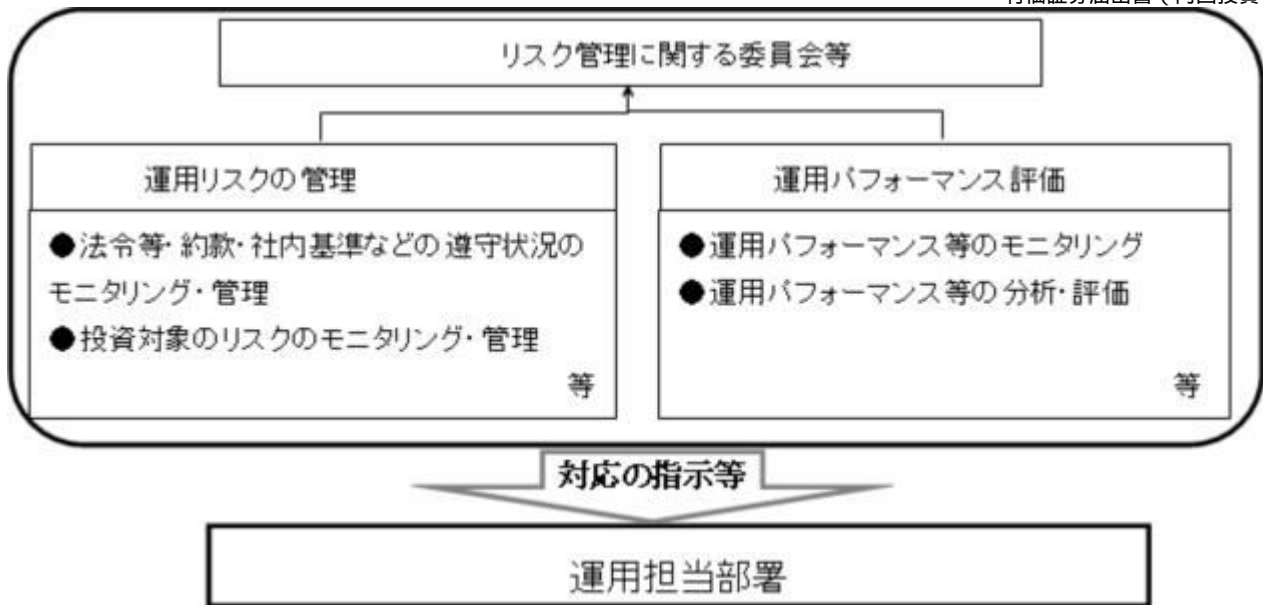
また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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小さかった場合も同様です。

(2) リスク管理体制

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

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



リスク管理体制は2018年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



*分配金再投資基準価額は、2013年9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、2013年9月から2018年8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。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



	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	65.0	57.1	37.2	9.3	29.1	21.4
最小値	△22.5	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	15.7	16.6	16.9	10.9	2.1	5.8	3.1

*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。
 *2013年9月から2018年8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。

分配金再投資基準価額は、新引前の分配金を再投資したものとみなして計算していますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

*各資産クラスの指数
 日本株・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
 先進国株・・・MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
 新興国株・・・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
 日本国債・・・NOMURA-BPI国債
 先進国債・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
 新興国債・・・JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)
 (注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

●「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。

●「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

●「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

●「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に關して一切責任を負いません。

●「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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

「各資産クラスの騰落率」は、データソースが提供する各指数をもとに、株式会社野村総合研究所が計算しております。株式会社野村総合研究所及び各指数のデータソースは、その内容について、信頼性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、株式会社野村総合研究所及び各指数のデータソースは、当該騰落率に關連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の費用について、何らの責任も負いません。

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】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.648%（税抜0.6%）以内

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

運用管理費用（信託報酬）は、毎日計上され、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ファンドから支払われます。

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.25%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.25%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.10%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

（4）【その他の手数料等】

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】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

a. 個人の受益者に対する課税

(イ) 収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(ロ) 解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

(ハ) 損益通算について

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

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

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度

です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した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が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

b. 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、2018年8月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

c. 個別元本について

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

(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。

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を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。

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

d. 収益分配金の課税について

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

ニュー トピックス インデックス

(平成30年 8月31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	598,451,050	99.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		569,271	0.09
純資産総額		599,020,321	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30年 8月31日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	7,808,796,750	96.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		243,551,593	3.02
純資産総額		8,052,348,343	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30年 8月31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	264,813,067	2.2474	595,140,887	2.2599	598,451,050	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30年 8月31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30年 8月31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	38,600	7,565.25	292,018,650	6,930.00	267,498,000	3.32
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	217,800	867.85	189,017,730	670.80	146,100,240	1.81
3	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	14,100	8,929.65	125,908,065	10,300.00	145,230,000	1.80
4	日本	株式	ソニー	電気機器	21,200	5,518.88	117,000,256	6,348.00	134,577,600	1.67
5	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	22,300	5,213.18	116,253,914	4,950.00	110,385,000	1.37
6	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	23,700	5,172.39	122,585,643	4,381.00	103,829,700	1.28
7	日本	株式	キーエンス	電気機器	1,600	65,648.70	105,037,920	62,890.00	100,624,000	1.24
8	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	28,500	3,956.00	112,746,000	3,292.00	93,822,000	1.16
9	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	425,000	216.26	91,910,500	195.10	82,917,500	1.02
10	日本	株式	KDDI	情報・通信業	27,400	2,763.45	75,718,530	2,941.00	80,583,400	1.00
11	日本	株式	任天堂	その他製品	2,000	44,620.00	89,240,000	40,160.00	80,320,000	0.99
12	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	23,400	2,750.31	64,357,254	3,387.00	79,255,800	0.98
13	日本	株式	三菱商事	卸売業	21,900	3,264.03	71,482,257	3,171.00	69,444,900	0.86
14	日本	株式	花王	化学	7,800	7,538.76	58,802,328	8,625.00	67,275,000	0.83
15	日本	株式	ファナック	電気機器	3,000	31,524.48	94,573,440	21,775.00	65,325,000	0.81
16	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	22,300	2,657.74	59,267,602	2,885.00	64,335,500	0.79
17	日本	株式	村田製作所	電気機器	3,300	15,407.52	50,844,816	19,185.00	63,310,500	0.78
18	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	2,800	20,844.08	58,363,424	22,315.00	62,482,000	0.77
19	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	11,800	5,371.54	63,384,172	5,237.00	61,796,600	0.76
20	日本	株式	日本電産	電気機器	3,800	16,825.60	63,937,280	16,105.00	61,199,000	0.76
21	日本	株式	ダイキン工業	機械	4,300	13,612.24	58,532,632	14,170.00	60,931,000	0.75
22	日本	株式	キヤノン	電気機器	17,100	4,265.28	72,936,288	3,563.00	60,927,300	0.75
23	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	13,100	4,580.73	60,007,563	4,525.00	59,277,500	0.73
24	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	31,200	1,444.21	45,059,352	1,882.00	58,718,400	0.72
25	日本	株式	信越化学工業	化学	5,500	11,895.22	65,423,710	10,425.00	57,337,500	0.71
26	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	5,600	11,444.33	64,088,248	10,055.00	56,308,000	0.69
27	日本	株式	日立製作所	電気機器	76,000	902.69	68,604,440	725.50	55,138,000	0.68
28	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	11,700	6,416.96	75,078,432	4,653.00	54,440,100	0.67

29	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	18,400	3,585.32	65,969,888	2,922.00	53,764,800	0.66
30	日本	株式	資生堂	化学	6,300	5,600.67	35,284,221	7,824.00	49,291,200	0.61

(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30年 8月31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	0.29
		建設業	2.82
		食料品	3.88
		繊維製品	0.59
		パルプ・紙	0.27
		化学	7.31
		医薬品	4.80
		石油・石炭製品	0.82
		ゴム製品	0.70
		ガラス・土石製品	0.96
		鉄鋼	1.03
		非鉄金属	0.78
		金属製品	0.59
		機械	5.02
		電気機器	13.50
		輸送用機器	8.35
		精密機器	1.74
		その他製品	2.10
		電気・ガス業	1.65
		陸運業	4.09
		海運業	0.18
		空運業	0.55
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	7.63
		卸売業	4.60
		小売業	4.61
銀行業	6.67		
証券、商品先物取引業	0.87		
保険業	2.26		
その他金融業	1.15		
不動産業	2.24		
サービス業	4.49		
合計			96.97

【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30年 8月31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	12	日本円	208,488,888	208,020,000	2.58

(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
第28計算期間末 (平成29年 2月22日)	634,966,163	634,966,163	0.7003	0.7003
第29計算期間末 (平成30年 2月22日)	613,527,006	613,527,006	0.7956	0.7956

平成29年 8月末日	615,370,197		0.7328
9月末日	628,708,506		0.7641
10月末日	638,571,296		0.8052
11月末日	644,010,255		0.8169
12月末日	650,631,610		0.8289
平成30年 1月末日	651,466,584		0.8370
2月末日	621,314,064		0.8057
3月末日	604,532,676		0.7889
4月末日	623,189,696		0.8167
5月末日	609,010,454		0.8028
6月末日	600,527,441		0.7957
7月末日	606,524,763		0.8057
8月末日	599,020,321		0.7973

【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
第28計算期間	平成28年 2月23日～平成29年 2月22日	0.0000
第29計算期間	平成29年 2月23日～平成30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
第28計算期間	平成28年 2月23日～平成29年 2月22日	21.6
第29計算期間	平成29年 2月23日～平成30年 2月22日	13.6
第30中間計算期間	平成30年 2月23日～平成30年 8月22日	1.9

(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
第28計算期間	平成28年 2月23日～平成29年 2月22日	36,193	97,137,242
第29計算期間	平成29年 2月23日～平成30年 2月22日	339,000	135,926,251
第30中間計算期間	平成30年 2月23日～平成30年 8月22日	0	18,853,547

参考情報

運用実績

データの基準日: 2018年8月31日

<基準価額・純資産の推移>

(2008年9月1日~2018年8月31日)

<分配の推移(税引前)>



2018年2月	0円
2017年2月	0円
2016年2月	0円
2015年2月	10円
2014年2月	0円
直近10年累計	15円

※分配金は1万円当たりです。

※基準価額は1万円当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※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。

<主要な資産の状況>

資産配分

資産	純資産比率
株式現物	96.88%
その他資産	3.12%
合計	100.00%
株式先物	2.58%

※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	13.50%
輸送用機器	8.35%
情報・通信業	7.63%
化学	7.31%
銀行業	6.67%
その他	53.48%
合計	96.97%

※東証93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。

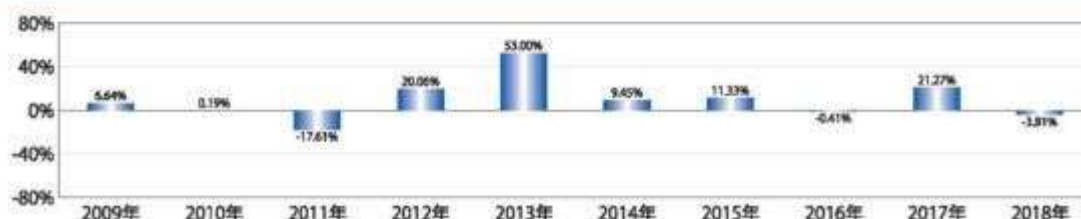
組入上位10銘柄(ニュー トピックス インデックス マザーファンド)

銘柄名	業種	純資産比率
トヨタ自動車	輸送用機器	3.32%
三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.81%
ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.80%
ソニー	電気機器	1.67%
日本電信電話	情報・通信業	1.37%
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.28%
キーエンス	電気機器	1.24%
本田技研工業	輸送用機器	1.16%
みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.02%
KDDI	情報・通信業	1.00%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産額に対する比率です。

組入銘柄数: 1,684銘柄

<年間収益率の推移(暦年ベース)>



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
 ※2018年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

・掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
 ・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。
 ・委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

- (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。
- (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。
- (ニ) 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。

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

投資対象	評価方法
マザーファンド受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における取引所の最終相場

(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/>

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

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。

受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

なお、「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

b．償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

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

c．一部解約請求権

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

d．帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

(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29期計算期間(平成29年2月23日から平成30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28期 平成29年 2月22日現在	第29期 平成30年 2月22日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,504,641	2,788,664
親投資信託受益証券	634,362,632	612,831,262
未収入金	1,010,000	-
流動資産合計	637,877,273	615,619,926
資産合計	637,877,273	615,619,926
負債の部		
流動負債		
未払解約金	879,006	-
未払受託者報酬	334,095	347,549
未払委託者報酬	1,670,407	1,737,670
未払利息	3	4
その他未払費用	27,599	7,697
流動負債合計	2,911,110	2,092,920
負債合計	2,911,110	2,092,920
純資産の部		
元本等		
元本	906,722,869	771,135,618
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	271,756,706	157,608,612
(分配準備積立金)	154,877,336	205,141,028
元本等合計	634,966,163	613,527,006
純資産合計	634,966,163	613,527,006
負債純資産合計	637,877,273	615,619,926

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第28期		第29期	
	自	平成28年 2月23日 至 平成29年 2月22日	自	平成29年 2月23日 至 平成30年 2月22日
営業収益				
受取利息		1		-
有価証券売買等損益		124,938,062		85,378,630
営業収益合計		124,938,063		85,378,630
営業費用				
支払利息		642		833
受託者報酬		646,309		682,108
委託者報酬		3,231,395		3,410,392
その他費用		51,574		35,338
営業費用合計		3,929,920		4,128,671
営業利益		121,008,143		81,249,959
経常利益		121,008,143		81,249,959
当期純利益		121,008,143		81,249,959
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		8,319,078		7,769,090
期首剰余金又は期首欠損金()		425,618,626		271,756,706
剰余金増加額又は欠損金減少額		41,186,768		40,738,653
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		41,186,768		40,738,653
剰余金減少額又は欠損金増加額		13,913		71,428
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		13,913		71,428
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		271,756,706		157,608,612

（ 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29期 自 平成29年 2月23日 至 平成30年 2月22日
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。

（ 貸借対照表に関する注記 ）

第28期 平成29年 2月22日現在	第29期 平成30年 2月22日現在
1. 計算期間末日における受益権の総数 906,722,869口	1. 計算期間末日における受益権の総数 771,135,618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 271,756,706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 157,608,612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 0.7003円 (1万口当たり純資産額) (7,003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 0.7956円 (1万口当たり純資産額) (7,956円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

区分	第28期 自 平成28年 2月23日 至 平成29年 2月22日	第29期 自 平成29年 2月23日 至 平成30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（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（37,950,509円）、信託約款に定める収益調整金（115,874,757円）及び分配準備積立金（116,926,827円）より分配対象収益は270,752,093円（1万口当たり2,986.04円）であります。分配を行っておりません。	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（73,481,128円）、信託約款に定める収益調整金（98,605,363円）及び分配準備積立金（131,659,900円）より分配対象収益は303,746,391円（1万口当たり3,938.94円）であります。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28期 自 平成28年 2月23日 至 平成29年 2月22日	第29期 自 平成29年 2月23日 至 平成30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	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。 リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。 市場リスク 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28期 平成29年 2月22日現在	第29期 平成30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ん。 2.時価の算定方法	1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2.時価の算定方法

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。 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。	同左
---	----

（関連当事者との取引に関する注記）

	第28期 自 平成28年 2月23日 至 平成29年 2月22日	第29期 自 平成29年 2月23日 至 平成30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	第28期 平成29年 2月22日現在	第29期 平成30年 2月22日現在
期首元本額	1,003,823,918円	906,722,869円
期中追加設定元本額	36,193円	339,000円
期中一部解約元本額	97,137,242円	135,926,251円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第28期 平成29年 2月22日現在	第29期 平成30年 2月22日現在
	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	116,089,975	77,006,117
合計	116,089,975	77,006,117

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	272,684,552	612,831,262	
合計		272,684,552	612,831,262	

(注1) 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29年 2月22日現在	平成30年 2月22日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	285,753,303	296,993,565
株式	11,461,688,510	9,643,949,470
派生商品評価勘定	10,929,480	289,676
未収入金	-	97,175,790
未収配当金	16,885,296	14,445,870
前払金	-	8,835,000
流動資産合計	11,775,256,589	10,061,689,371
資産合計	11,775,256,589	10,061,689,371
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	12,275,184
前受金	10,380,000	-
未払解約金	1,750,000	100,000,000
未払利息	450	519
流動負債合計	12,130,450	112,275,703
負債合計	12,130,450	112,275,703

平成29年 2月22日現在

平成30年 2月22日現在

純資産の部		
元本等		
元本	5,986,327,559	4,427,162,088
剰余金		
剰余金又は欠損金()	5,776,798,580	5,522,251,580
元本等合計	11,763,126,139	9,949,413,668
純資産合計	11,763,126,139	9,949,413,668
負債純資産合計	11,775,256,589	10,061,689,371

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29年 2月23日 至 平成30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29年 2月22日現在	平成30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 143,746,100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 166,825,050円
2. 計算日における受益権の総数 5,986,327,559口	2. 計算日における受益権の総数 4,427,162,088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 1.9650円 (1万口当たり純資産額) (19,650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 2.2474円 (1万口当たり純資産額) (22,474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28年 2月23日 至 平成29年 2月22日	自 平成29年 2月23日 至 平成30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>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスク 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29年 2月22日現在	平成30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28年 2月23日 至 平成29年 2月22日	自 平成29年 2月23日 至 平成30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29年 2月22日現在	平成30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	7,074,354,723円	5,986,327,559円
期中追加設定元本額	593,335,424円	287,704,543円
期中一部解約元本額	1,681,362,588円	1,846,870,014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	322,830,856円	272,684,552円
新光7資産バランスファンド	436,035,353円	330,753,274円

ニュー トピックス インデックス(変額年金)	193,784,171円	126,994,843円
新光世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	1,618,474,868円	911,941,867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)	1,349,113,073円	1,052,835,167円
新光世界バランス35VAT(適格機関投資家私募)	44,848,981円	34,755,866円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	1,455,260,337円	1,218,781,450円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	514,645,619円	431,936,520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)	3,411,504円	-円
グローバル・ナビ	18,182,458円	22,290,681円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	5,853,652円	4,729,036円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	20,053,296円	16,244,594円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	3,833,391円	3,214,238円
合計	5,986,327,559円	4,427,162,088円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成29年 2月22日現在	平成30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	91,907,283	699,924,978
合計	91,907,283	699,924,978

(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29年 2月22日現在				平成30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	285,185,520	-	296,115,000	10,929,480	308,465,508	-	296,480,000	11,985,508
東証株価指数先物	285,185,520	-	296,115,000	10,929,480	308,465,508	-	296,480,000	11,985,508
合計	285,185,520	-	296,115,000	10,929,480	308,465,508	-	296,480,000	11,985,508

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	200	3,870.00	774,000	
日本水産	4,900	535.00	2,621,500	
マルハニチロ	800	3,225.00	2,580,000	
カネコ種苗	100	1,589.00	158,900	
サカタのタネ	600	3,615.00	2,169,000	
ホクト	400	2,061.00	824,400	
ホクリヨウ	100	1,412.00	141,200	
日鉄鉱業	100	6,990.00	699,000	
三井松島産業	200	1,469.00	293,800	
国際石油開発帝石	21,200	1,296.50	27,485,800	
石油資源開発	700	2,507.00	1,754,900	
K&Oエナジーグループ	300	1,706.00	511,800	
ショーボンドホールディングス	400	7,480.00	2,992,000	
ミライト・ホールディングス	1,300	1,676.00	2,178,800	
インベスターズクラウド	400	2,076.00	830,400	
ダイセキ環境ソリューション	100	1,195.00	119,500	
安藤・間	3,400	786.00	2,672,400	
東急建設	1,700	1,255.00	2,133,500	
コムシスホールディングス	1,500	2,818.00	4,227,000	
ミサワホーム	400	895.00	358,000	
高松コンストラクショングループ	300	2,930.00	879,000	
東建コーポレーション	200	12,000.00	2,400,000	
ソネック	100	777.00	77,700	
ヤマウラ	200	971.00	194,200	
大成建設	4,300	5,220.00	22,446,000	
大林組	13,100	1,177.00	15,418,700	

清水建設	13,300	1,004.00	13,353,200
飛島建設	4,000	184.00	736,000
長谷工コーポレーション	5,100	1,540.00	7,854,000
松井建設	500	828.00	414,000
銭高組	100	5,630.00	563,000
鹿島建設	19,000	992.00	18,848,000
不動テトラ	3,300	193.00	636,900
鉄建建設	300	3,100.00	930,000
西松建設	1,000	2,679.00	2,679,000
三井住友建設	3,100	630.00	1,953,000
大豊建設	2,000	636.00	1,272,000
前田建設工業	3,100	1,274.00	3,949,400
佐田建設	300	482.00	144,600
ナカノフドー建設	300	620.00	186,000
奥村組	700	4,650.00	3,255,000
東鉄工業	500	3,360.00	1,680,000
イチケン	100	2,461.00	246,100
浅沼組	2,000	460.00	920,000
戸田建設	5,000	813.00	4,065,000
熊谷組	700	3,165.00	2,215,500
青木あすなろ建設	300	1,011.00	303,300
北野建設	1,000	439.00	439,000
植木組	100	2,665.00	266,500
三井ホーム	1,000	689.00	689,000
矢作建設工業	600	841.00	504,600
ピーエス三菱	500	861.00	430,500
日本ハウスホールディングス	800	646.00	516,800
大東建託	1,600	17,505.00	28,008,000
新日本建設	500	1,021.00	510,500
N I P P O	1,000	2,526.00	2,526,000
東亜道路工業	100	4,245.00	424,500
前田道路	1,000	2,362.00	2,362,000
日本道路	100	5,860.00	586,000
東亜建設工業	400	2,275.00	910,000
若築建設	200	1,701.00	340,200
東洋建設	1,400	552.00	772,800
五洋建設	5,200	779.00	4,050,800
世紀東急工業	600	702.00	421,200
福田組	100	6,520.00	652,000
住友林業	2,800	1,819.00	5,093,200
日本基礎技術	500	402.00	201,000
日成ビルド工業	600	1,262.00	757,200

バコーポレーション	500	582.00	291,000
大和ハウス工業	12,900	3,876.00	50,000,400
ライト工業	800	1,156.00	924,800
積水ハウス	14,200	1,838.00	26,099,600
日特建設	400	656.00	262,400
北陸電気工事	200	1,158.00	231,600
ユアテック	700	852.00	596,400
西部電気工業	100	2,771.00	277,100
四電工	100	2,775.00	277,500
中電工	600	3,010.00	1,806,000
関電工	1,700	1,216.00	2,067,200
きんでん	2,900	1,744.00	5,057,600
東京エネシス	500	1,189.00	594,500
トーエネック	100	3,200.00	320,000
住友電設	300	2,270.00	681,000
日本電設工業	700	2,209.00	1,546,300
協和エクシオ	1,600	2,827.00	4,523,200
新日本空調	300	1,619.00	485,700
N D S	100	4,525.00	452,500
九電工	900	5,040.00	4,536,000
三機工業	900	1,170.00	1,053,000
日揮	3,800	2,399.00	9,116,200
中外炉工業	100	2,327.00	232,700
ヤマト	400	817.00	326,800
太平電業	300	2,637.00	791,100
高砂熱学工業	1,200	1,977.00	2,372,400
朝日工業社	100	3,570.00	357,000
明星工業	800	768.00	614,400
大気社	600	3,700.00	2,220,000
ダイダン	300	2,459.00	737,700
日比谷総合設備	500	2,016.00	1,008,000
東芝プラントシステム	900	2,096.00	1,886,400
OSJBホールディングス	1,900	306.00	581,400
東洋エンジニアリング	500	997.00	498,500
千代田化工建設	2,800	1,062.00	2,973,600
新興プランテック	800	1,007.00	805,600
日本製粉	1,300	1,635.00	2,125,500
日清製粉グループ本社	4,800	2,076.00	9,964,800
昭和産業	400	2,799.00	1,119,600
鳥越製粉	300	972.00	291,600
中部飼料	500	2,038.00	1,019,000
フィード・ワン	2,600	244.00	634,400

日本甜菜製糖	200	2,381.00	476,200
三井製糖	300	4,220.00	1,266,000
塩水港精糖	500	279.00	139,500
日新製糖	200	2,206.00	441,200
森永製菓	900	5,020.00	4,518,000
中村屋	100	4,775.00	477,500
江崎グリコ	1,100	5,180.00	5,698,000
名糖産業	200	1,569.00	313,800
不二家	200	2,516.00	503,200
山崎製パン	3,200	2,085.00	6,672,000
モロゾフ	100	6,660.00	666,000
亀田製菓	200	5,180.00	1,036,000
寿スピリッツ	400	6,100.00	2,440,000
カルビー	1,800	3,620.00	6,516,000
森永乳業	800	4,340.00	3,472,000
六甲バター	200	2,337.00	467,400
ヤクルト本社	2,300	7,840.00	18,032,000
明治ホールディングス	2,600	7,890.00	20,514,000
雪印メグミルク	900	2,805.00	2,524,500
プリマハム	3,000	651.00	1,953,000
日本ハム	3,000	2,425.00	7,275,000
丸大食品	2,000	499.00	998,000
S Foods	300	4,280.00	1,284,000
伊藤ハム米久ホールディングス	2,500	917.00	2,292,500
サッポロホールディングス	1,400	3,150.00	4,410,000
アサヒグループホールディングス	8,200	5,499.00	45,091,800
キリンホールディングス	18,700	2,750.00	51,425,000
宝ホールディングス	2,900	1,321.00	3,830,900
オエノンホールディングス	1,100	410.00	451,000
養命酒製造	100	2,321.00	232,100
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	2,700	4,035.00	10,894,500
サントリー食品インターナショナル	3,000	5,050.00	15,150,000
ダイトーグループホールディングス	200	6,480.00	1,296,000
伊藤園	1,300	4,455.00	5,791,500
キーコーヒー	400	2,114.00	845,600
ユニカフェ	100	1,169.00	116,900
ジャパンフーズ	100	1,504.00	150,400
日清オイリオグループ	500	2,982.00	1,491,000
不二製油グループ本社	1,100	3,165.00	3,481,500
J - オイルミルズ	200	3,715.00	743,000
キッコーマン	3,000	4,180.00	12,540,000
味の素	9,000	1,940.00	17,460,000

キューピー	2,200	2,918.00	6,419,600
ハウス食品グループ本社	1,500	3,625.00	5,437,500
カゴメ	1,600	3,635.00	5,816,000
焼津水産化学工業	200	1,188.00	237,600
アリアケジャパン	400	8,130.00	3,252,000
ピエトロ	100	1,669.00	166,900
エバラ食品工業	100	2,146.00	214,600
ニチレイ	1,900	2,630.00	4,997,000
東洋水産	2,100	4,160.00	8,736,000
日清食品ホールディングス	1,700	7,410.00	12,597,000
一正蒲鉾	200	1,264.00	252,800
フジッコ	400	2,347.00	938,800
ロック・フィールド	400	2,121.00	848,400
日本たばこ産業	24,100	3,057.00	73,673,700
ケンコーマヨネーズ	300	3,655.00	1,096,500
わらべや日洋ホールディングス	300	2,560.00	768,000
なとり	200	1,960.00	392,000
ユーグレナ	1,500	975.00	1,462,500
ミヨシ油脂	100	1,404.00	140,400
理研ビタミン	100	4,065.00	406,500
片倉工業	500	1,368.00	684,000
ゲンゼ	300	5,780.00	1,734,000
東洋紡	1,500	2,046.00	3,069,000
ユニチカ	1,200	698.00	837,600
富士紡ホールディングス	200	4,385.00	877,000
倉敷紡績	4,000	347.00	1,388,000
シキボウ	200	1,374.00	274,800
日本毛織	1,100	1,082.00	1,190,200
帝国繊維	400	1,993.00	797,200
帝人	3,300	2,111.00	6,966,300
東レ	29,500	1,089.00	32,125,500
サカイオーベックス	100	2,783.00	278,300
住江織物	100	2,909.00	290,900
日本フェルト	200	522.00	104,400
アツギ	300	1,192.00	357,600
セーレン	900	2,075.00	1,867,500
ソトー	200	1,078.00	215,600
小松精練	600	1,024.00	614,400
ワコールホールディングス	1,100	3,155.00	3,470,500
ホギメディカル	300	8,510.00	2,553,000
T S Iホールディングス	1,500	756.00	1,134,000
三陽商会	200	2,473.00	494,600

オンワードホールディングス	2,400	917.00	2,200,800
ルックホールディングス	1,000	315.00	315,000
ゴールドウイン	100	11,960.00	1,196,000
デサント	900	1,740.00	1,566,000
キング	200	658.00	131,600
ヤマトインターナショナル	300	483.00	144,900
特種東海製紙	200	4,185.00	837,000
王子ホールディングス	17,000	703.00	11,951,000
日本製紙	1,800	2,094.00	3,769,200
北越紀州製紙	2,300	706.00	1,623,800
中越パルプ工業	200	1,945.00	389,000
大王製紙	1,600	1,522.00	2,435,200
レンゴー	3,900	898.00	3,502,200
トモク	200	2,053.00	410,600
ザ・パック	300	3,670.00	1,101,000
クラレ	6,900	1,846.00	12,737,400
旭化成	25,400	1,325.00	33,655,000
共和レザー	200	979.00	195,800
昭和電工	2,700	5,220.00	14,094,000
住友化学	30,000	656.00	19,680,000
住友精化	200	5,420.00	1,084,000
日産化学工業	2,400	3,995.00	9,588,000
クレハ	400	7,530.00	3,012,000
多木化学	100	4,390.00	439,000
テイカ	300	2,749.00	824,700
石原産業	700	1,465.00	1,025,500
片倉コープアグリ	100	1,245.00	124,500
日東エフシー	200	793.00	158,600
日本曹達	3,000	649.00	1,947,000
東ソー	5,900	2,202.00	12,991,800
トクヤマ	1,200	3,055.00	3,666,000
セントラル硝子	800	2,405.00	1,924,000
東亜合成	2,400	1,204.00	2,889,600
大阪ソーダ	400	2,802.00	1,120,800
関東電化工業	1,000	1,208.00	1,208,000
デンカ	1,500	3,875.00	5,812,500
信越化学工業	6,800	11,175.00	75,990,000
堺化学工業	300	3,050.00	915,000
エア・ウォーター	3,400	2,120.00	7,208,000
大陽日酸	3,100	1,563.00	4,845,300
日本化学工業	200	3,185.00	637,000
東邦アセチレン	100	1,520.00	152,000

日本パーカライジング	2,100	1,899.00	3,987,900
高压ガス工業	600	882.00	529,200
四国化成工業	600	1,496.00	897,600
ステラ ケミファ	200	2,740.00	548,000
保土谷化学工業	100	4,830.00	483,000
日本触媒	600	7,330.00	4,398,000
大日精化工業	300	4,640.00	1,392,000
カネカ	5,000	1,081.00	5,405,000
三菱瓦斯化学	3,400	2,599.00	8,836,600
三井化学	3,700	3,225.00	11,932,500
J S R	4,100	2,426.00	9,946,600
東京応化工業	700	4,030.00	2,821,000
大阪有機化学工業	300	1,531.00	459,300
三菱ケミカルホールディングス	27,300	1,078.00	29,429,400
K Hネオケム	600	3,080.00	1,848,000
ダイセル	5,500	1,185.00	6,517,500
住友ベークライト	3,000	925.00	2,775,000
積水化学工業	8,500	1,955.00	16,617,500
日本ゼオン	3,400	1,569.00	5,334,600
アイカ工業	1,100	4,080.00	4,488,000
宇部興産	2,100	3,375.00	7,087,500
積水樹脂	600	2,435.00	1,461,000
タキロンシーアイ	800	717.00	573,600
旭有機材	200	2,155.00	431,000
日立化成	2,000	2,357.00	4,714,000
ニチバン	200	3,205.00	641,000
リケンテクノス	900	518.00	466,200
大倉工業	1,000	565.00	565,000
積水化成成品工業	500	1,162.00	581,000
群栄化学工業	100	3,505.00	350,500
タイガースポリマー	200	864.00	172,800
ミライアル	100	2,020.00	202,000
ダイキョーニシカワ	800	1,898.00	1,518,400
日本化薬	2,600	1,354.00	3,520,400
カーリットホールディングス	400	1,196.00	478,400
日本精化	300	1,243.00	372,900
扶桑化学工業	300	2,887.00	866,100
A D E K A	1,800	1,892.00	3,405,600
日油	1,600	2,961.00	4,737,600
ハリマ化成グループ	300	883.00	264,900
花王	9,600	7,924.00	76,070,400
第一工業製薬	1,000	790.00	790,000

日華化学	100	1,167.00	116,700
ニイタカ	100	1,831.00	183,100
三洋化成工業	300	5,320.00	1,596,000
大日本塗料	500	1,590.00	795,000
日本ペイントホールディングス	3,100	3,770.00	11,687,000
関西ペイント	4,300	2,666.00	11,463,800
神東塗料	300	251.00	75,300
中国塗料	1,200	1,095.00	1,314,000
日本特殊塗料	300	2,012.00	603,600
藤倉化成	500	672.00	336,000
太陽ホールディングス	300	4,725.00	1,417,500
D I C	1,600	3,825.00	6,120,000
サカタインクス	800	1,383.00	1,106,400
東洋インキS Cホールディングス	4,000	663.00	2,652,000
T & K T O K A	300	1,366.00	409,800
富士フィルムホールディングス	8,100	4,323.00	35,016,300
資生堂	7,200	6,387.00	45,986,400
ライオン	5,400	2,085.00	11,259,000
高砂香料工業	200	3,175.00	635,000
マンダム	800	3,690.00	2,952,000
ミルボン	500	4,525.00	2,262,500
ファンケル	900	3,505.00	3,154,500
コーセー	700	20,060.00	14,042,000
コタ	200	1,934.00	386,800
シーズ・ホールディングス	500	6,080.00	3,040,000
ポーラ・オルビスホールディングス	1,700	4,500.00	7,650,000
ノエビアホールディングス	200	8,020.00	1,604,000
アジュバンコスメジャパン	100	1,110.00	111,000
エステー	300	2,363.00	708,900
アグロ カネショウ	200	2,244.00	448,800
コニシ	600	1,833.00	1,099,800
長谷川香料	500	1,986.00	993,000
星光P M C	200	1,067.00	213,400
小林製薬	1,100	6,980.00	7,678,000
荒川化学工業	300	1,918.00	575,400
メック	300	1,776.00	532,800
日本高純度化学	100	2,568.00	256,800
タカラバイオ	1,000	1,952.00	1,952,000
J C U	200	4,910.00	982,000
新田ゼラチン	300	777.00	233,100
デクセリアルズ	1,000	1,387.00	1,387,000
アース製薬	300	5,180.00	1,554,000

北興化学工業	400	761.00	304,400	
大成ラミック	100	3,155.00	315,500	
クミアイ化学工業	1,800	646.00	1,162,800	
日本農薬	1,000	610.00	610,000	
アキレス	300	2,167.00	650,100	
有沢製作所	700	957.00	669,900	
日東電工	2,900	8,497.00	24,641,300	
レック	200	3,110.00	622,000	
きもと	700	407.00	284,900	
藤森工業	300	3,630.00	1,089,000	
前澤化成工業	300	1,161.00	348,300	
JSP	200	3,215.00	643,000	
エフピコ	300	5,990.00	1,797,000	
天馬	300	2,202.00	660,600	
信越ポリマー	800	1,233.00	986,400	
東リ	1,000	386.00	386,000	
ニフコ	700	7,590.00	5,313,000	
日本バルカー工業	300	3,140.00	942,000	
ユニ・チャーム	8,200	2,968.00	24,337,600	
協和発酵キリン	4,900	2,260.00	11,074,000	
武田薬品工業	14,300	5,886.00	84,169,800	代用有価証券 2,600株
アステラス製薬	39,900	1,509.00	60,209,100	
大日本住友製薬	2,900	1,606.00	4,657,400	
塩野義製薬	5,600	5,460.00	30,576,000	
田辺三菱製薬	4,700	2,257.00	10,607,900	
あすか製薬	400	2,118.00	847,200	
日本新薬	1,000	5,910.00	5,910,000	
バイオフェルミン製薬	100	2,866.00	286,600	
中外製薬	4,100	5,440.00	22,304,000	
科研製薬	700	5,940.00	4,158,000	
エーザイ	4,700	5,570.00	26,179,000	
ロート製薬	2,100	3,005.00	6,310,500	
小野薬品工業	9,200	2,970.50	27,328,600	
久光製薬	1,100	7,360.00	8,096,000	
持田製薬	300	7,800.00	2,340,000	
参天製薬	7,400	1,708.00	12,639,200	
扶桑薬品工業	100	2,789.00	278,900	
日本ケミファ	100	4,415.00	441,500	
ツムラ	1,400	3,470.00	4,858,000	
日医工	1,000	1,677.00	1,677,000	
キッセイ薬品工業	700	2,901.00	2,030,700	
生化学工業	800	2,170.00	1,736,000	

栄研化学	300	5,130.00	1,539,000	
日水製薬	200	1,366.00	273,200	
鳥居薬品	200	2,855.00	571,000	
JCRファーマ	300	5,240.00	1,572,000	
東和薬品	200	6,890.00	1,378,000	
富士製薬工業	100	4,530.00	453,000	
沢井製薬	800	5,000.00	4,000,000	
ゼリア新薬工業	800	2,109.00	1,687,200	
第一三共	11,100	3,838.00	42,601,800	
キョーリン製薬ホールディングス	1,100	2,048.00	2,252,800	
大幸薬品	200	2,055.00	411,000	
ダイト	200	3,475.00	695,000	
大塚ホールディングス	8,100	5,251.00	42,533,100	
大正製薬ホールディングス	900	9,810.00	8,829,000	
ペプチドリーム	1,700	4,760.00	8,092,000	
昭和シェル石油	3,600	1,355.00	4,878,000	
ニチレキ	500	1,426.00	713,000	
ユシロ化学工業	200	1,863.00	372,600	
ビーピー・カストロール	200	1,721.00	344,200	
MORESCO	100	1,940.00	194,000	
出光興産	3,300	3,940.00	13,002,000	
JXTGホールディングス	62,000	653.30	40,504,600	
コスモエネルギーホールディングス	1,100	3,705.00	4,075,500	
横浜ゴム	2,300	2,605.00	5,991,500	
東洋ゴム工業	2,300	1,968.00	4,526,400	
ブリヂストン	13,700	4,740.00	64,938,000	
住友ゴム工業	4,000	2,048.00	8,192,000	
藤倉ゴム工業	300	806.00	241,800	
オカモト	1,000	1,119.00	1,119,000	
フコク	200	1,043.00	208,600	
ニッタ	400	4,100.00	1,640,000	
住友理工	800	1,067.00	853,600	
三ツ星ベルト	1,000	1,176.00	1,176,000	
バンドー化学	700	1,216.00	851,200	
日東紡績	600	2,504.00	1,502,400	
旭硝子	4,000	4,435.00	17,740,000	
日本板硝子	2,000	863.00	1,726,000	
日本山村硝子	2,000	183.00	366,000	
日本電気硝子	1,700	3,265.00	5,550,500	
オハラ	200	2,956.00	591,200	
住友大阪セメント	8,000	490.00	3,920,000	
太平洋セメント	2,500	3,925.00	9,812,500	

日本ヒューム	400	808.00	323,200
日本コンクリート工業	800	458.00	366,400
三谷セキサン	200	2,546.00	509,200
アジアパイルホールディングス	500	661.00	330,500
東海カーボン	3,500	1,969.00	6,891,500
日本カーボン	200	6,430.00	1,286,000
東洋炭素	300	3,985.00	1,195,500
ノリタケカンパニーリミテド	200	5,470.00	1,094,000
TOTO	3,000	5,680.00	17,040,000
日本碍子	4,700	1,991.00	9,357,700
日本特殊陶業	3,300	2,689.00	8,873,700
MARUWA	100	8,330.00	833,000
品川リフラクトリーズ	100	3,065.00	306,500
黒崎播磨	100	5,110.00	511,000
ヨータイ	200	942.00	188,400
東京窯業	500	454.00	227,000
ニッカトー	100	1,091.00	109,100
フジインコーポレーテッド	300	2,551.00	765,300
ニチアス	2,000	1,428.00	2,856,000
ニチハ	600	4,260.00	2,556,000
新日鐵住金	17,200	2,528.50	43,490,200
神戸製鋼所	7,000	1,192.00	8,344,000
中山製鋼所	500	701.00	350,500
合同製鐵	200	2,006.00	401,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	10,400	2,467.50	25,662,000
日新製鋼	1,100	1,468.00	1,614,800
東京製鐵	2,100	859.00	1,803,900
共英製鋼	400	1,898.00	759,200
大和工業	800	3,045.00	2,436,000
東京鐵鋼	200	1,702.00	340,400
大阪製鐵	300	2,127.00	638,100
淀川製鋼所	600	3,060.00	1,836,000
丸一鋼管	1,400	3,285.00	4,599,000
モリ工業	100	3,770.00	377,000
大同特殊鋼	700	5,800.00	4,060,000
日本冶金工業	3,200	325.00	1,040,000
山陽特殊製鋼	400	2,347.00	938,800
愛知製鋼	200	4,605.00	921,000
日立金属	4,100	1,373.00	5,629,300
大平洋金属	200	3,190.00	638,000
新日本電工	2,300	374.00	860,200
栗本鐵工所	200	2,105.00	421,000

三菱製鋼	300	2,626.00	787,800
日亜鋼業	600	354.00	212,400
日本精線	100	4,880.00	488,000
シンニッタン	300	874.00	262,200
新家工業	100	2,424.00	242,400
大紀アルミニウム工業所	600	792.00	475,200
日本軽金属ホールディングス	11,200	283.00	3,169,600
三井金属鉱業	1,000	5,170.00	5,170,000
東邦亜鉛	200	5,750.00	1,150,000
三菱マテリアル	2,500	3,340.00	8,350,000
住友金属鉱山	4,900	5,032.00	24,656,800
DOWAホールディングス	1,000	3,900.00	3,900,000
古河機械金属	600	2,245.00	1,347,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	400	2,722.00	1,088,800
東邦チタニウム	700	1,447.00	1,012,900
UACJ	600	2,540.00	1,524,000
古河電気工業	1,300	5,920.00	7,696,000
住友電気工業	14,400	1,660.50	23,911,200
フジクラ	4,600	761.00	3,500,600
タツタ電線	800	705.00	564,000
カナレ電気	100	2,163.00	216,300
平河ヒューテック	200	1,193.00	238,600
リョービ	500	2,883.00	1,441,500
アーレスティ	500	970.00	485,000
アサヒホールディングス	700	2,027.00	1,418,900
稲葉製作所	200	1,321.00	264,200
宮地エンジニアリンググループ	100	2,400.00	240,000
トーカロ	300	5,670.00	1,701,000
アルファC o	100	1,868.00	186,800
SUMCO	3,500	2,741.00	9,593,500
川田テクノロジーズ	100	5,900.00	590,000
東洋製罐グループホールディングス	2,600	1,545.00	4,017,000
ホッカンホールディングス	1,000	387.00	387,000
コロナ	200	1,348.00	269,600
横河ブリッジホールディングス	700	2,513.00	1,759,100
駒井ハルテック	100	2,686.00	268,600
三和ホールディングス	3,700	1,459.00	5,398,300
文化シャッター	1,100	991.00	1,090,100
三協立山	500	1,537.00	768,500
アルインコ	300	1,141.00	342,300
LIXILグループ	5,700	2,638.00	15,036,600
日本ファイルコン	300	656.00	196,800

ノーリツ	900	1,909.00	1,718,100
長府製作所	400	2,435.00	974,000
リンナイ	700	9,730.00	6,811,000
ダイニチ工業	200	886.00	177,200
日東精工	500	607.00	303,500
岡部	800	987.00	789,600
ジーテクト	400	2,133.00	853,200
東プレ	700	3,205.00	2,243,500
高周波熱錬	700	1,087.00	760,900
東京製綱	300	2,009.00	602,700
サンコール	200	791.00	158,200
モリテック スチール	200	996.00	199,200
パイオラックス	600	2,929.00	1,757,400
日本発條	3,800	1,063.00	4,039,400
アドバネクス	100	4,050.00	405,000
立川ブラインド工業	200	1,485.00	297,000
三益半導体工業	300	1,986.00	595,800
日本ドライケミカル	100	2,525.00	252,500
日本製鋼所	1,300	3,305.00	4,296,500
三浦工業	1,700	3,005.00	5,108,500
タクマ	1,300	1,293.00	1,680,900
ツガミ	1,000	1,479.00	1,479,000
オークマ	400	6,600.00	2,640,000
東芝機械	2,000	761.00	1,522,000
アマダホールディングス	5,900	1,408.00	8,307,200
アイダエンジニアリング	1,000	1,433.00	1,433,000
滝澤鉄工所	100	2,199.00	219,900
富士機械製造	1,200	2,151.00	2,581,200
牧野フライス製作所	2,000	1,070.00	2,140,000
オーエスジー	1,800	2,463.00	4,433,400
旭ダイヤモンド工業	1,100	1,276.00	1,403,600
D M G 森精機	2,100	2,151.00	4,517,100
ソディック	800	1,395.00	1,116,000
ディスコ	500	24,320.00	12,160,000
日東工器	200	2,861.00	572,200
日進工具	100	3,365.00	336,500
パンチ工業	300	1,279.00	383,700
富士ダイス	100	1,076.00	107,600
東洋機械金属	300	942.00	282,600
島精機製作所	500	6,780.00	3,390,000
フリュー	300	1,051.00	315,300
ヤマシンフィルタ	500	1,311.00	655,500

日阪製作所	600	1,091.00	654,600
やまびこ	700	1,646.00	1,152,200
平田機工	100	10,260.00	1,026,000
ペガサスマシン製造	400	745.00	298,000
ナブテスコ	2,100	4,410.00	9,261,000
三井海洋開発	400	2,644.00	1,057,600
レオン自動機	300	2,327.00	698,100
S M C	1,200	45,600.00	54,720,000
新川	300	1,198.00	359,400
ホソカワミクロン	100	7,650.00	765,000
ユニオンツール	200	3,865.00	773,000
オイレス工業	500	2,385.00	1,192,500
日精エー・エス・ピー機械	100	7,920.00	792,000
サトーホールディングス	500	3,620.00	1,810,000
技研製作所	200	2,831.00	566,200
日本エアージェット	100	969.00	96,900
日精樹脂工業	300	1,692.00	507,600
オカダアイヨン	100	1,637.00	163,700
小松製作所	18,800	3,934.00	73,959,200
住友重機械工業	2,200	4,180.00	9,196,000
日立建機	1,800	4,455.00	8,019,000
日工	100	2,454.00	245,400
巴工業	200	1,943.00	388,600
井関農機	400	2,182.00	872,800
T O W A	300	1,620.00	486,000
北川鉄工所	200	2,829.00	565,800
ローツェ	200	2,406.00	481,200
クボタ	20,800	1,935.00	40,248,000
荏原実業	100	2,140.00	214,000
三菱化工機	100	2,212.00	221,200
月島機械	800	1,433.00	1,146,400
帝国電機製作所	300	1,648.00	494,400
新東工業	900	1,236.00	1,112,400
澁谷工業	300	4,230.00	1,269,000
アイチ コーポレーション	700	738.00	516,600
小森コーポレーション	1,000	1,383.00	1,383,000
鶴見製作所	300	1,928.00	578,400
住友精密工業	1,000	409.00	409,000
酒井重工業	100	4,755.00	475,500
荏原製作所	1,600	3,940.00	6,304,000
石井鐵工所	100	2,030.00	203,000
西島製作所	400	990.00	396,000

北越工業	400	1,234.00	493,600
ダイキン工業	5,300	12,645.00	67,018,500
オルガノ	100	3,270.00	327,000
トーヨーカネツ	200	3,500.00	700,000
栗田工業	2,100	3,180.00	6,678,000
椿本チエイン	2,000	884.00	1,768,000
大同工業	100	1,559.00	155,900
アネスト岩田	700	1,132.00	792,400
ダイフク	2,000	6,800.00	13,600,000
加藤製作所	200	2,587.00	517,400
油研工業	100	3,150.00	315,000
タダノ	1,900	1,686.00	3,203,400
フジテック	1,200	1,400.00	1,680,000
C K D	1,100	2,685.00	2,953,500
キトー	300	2,087.00	626,100
平和	1,200	2,285.00	2,742,000
理想科学工業	400	2,197.00	878,800
S A N K Y O	1,000	3,855.00	3,855,000
日本金銭機械	400	1,319.00	527,600
マースエンジニアリング	200	2,491.00	498,200
福島工業	200	4,745.00	949,000
オーイズミ	200	529.00	105,800
ダイコク電機	200	1,745.00	349,000
竹内製作所	700	2,439.00	1,707,300
アマノ	1,200	2,947.00	3,536,400
J U K I	600	1,686.00	1,011,600
サンデンホールディングス	500	1,619.00	809,500
蛇の目マシン工業	400	765.00	306,000
マックス	600	1,497.00	898,200
グローリー	1,200	4,050.00	4,860,000
新晃工業	400	1,953.00	781,200
大和冷機工業	600	1,212.00	727,200
セガサミーホールディングス	3,900	1,570.00	6,123,000
日本ピストンリング	100	2,408.00	240,800
リケン	200	6,130.00	1,226,000
T P R	400	2,999.00	1,199,600
ツバキ・ナカシマ	400	3,090.00	1,236,000
ホシザキ	1,200	9,760.00	11,712,000
大豊工業	300	1,571.00	471,300
日本精工	8,000	1,622.00	12,976,000
N T N	9,000	473.00	4,257,000
ジェイテクト	4,100	1,647.00	6,752,700

不二越	4,000	665.00	2,660,000
日本トムソン	1,200	804.00	964,800
THK	2,400	4,710.00	11,304,000
ユーシン精機	200	3,535.00	707,000
前澤給装工業	200	1,890.00	378,000
イーグル工業	500	1,947.00	973,500
前澤工業	300	423.00	126,900
日本ピラー工業	400	1,682.00	672,800
キッツ	1,700	881.00	1,497,700
マキタ	5,100	5,060.00	25,806,000
日立造船	3,100	549.00	1,701,900
三菱重工業	6,500	4,320.00	28,080,000
IHI	3,000	3,465.00	10,395,000
スター精密	600	2,163.00	1,297,800
日清紡ホールディングス	2,400	1,626.00	3,902,400
イビデン	2,400	1,755.00	4,212,000
コニカミノルタ	9,100	968.00	8,808,800
ブラザー工業	4,700	2,584.00	12,144,800
ミネベアミツミ	7,200	2,354.00	16,948,800
日立製作所	93,000	824.60	76,687,800
三菱電機	38,900	1,799.00	69,981,100
富士電機	12,000	803.00	9,636,000
安川電機	4,500	4,930.00	22,185,000
シンフォニアテクノロジー	3,000	366.00	1,098,000
明電舎	3,000	404.00	1,212,000
山洋電気	200	8,060.00	1,612,000
デンヨー	400	1,822.00	728,800
東芝テック	3,000	656.00	1,968,000
マブチモーター	1,100	5,300.00	5,830,000
日本電産	4,700	16,410.00	77,127,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	100	2,916.00	291,600
東光高岳	200	1,611.00	322,200
ダブル・スコープ	600	1,502.00	901,200
ダイヘン	2,000	838.00	1,676,000
ヤーマン	600	1,725.00	1,035,000
JVCケンウッド	2,900	371.00	1,075,900
ミマキエンジニアリング	300	894.00	268,200
第一精工	200	2,774.00	554,800
日新電機	900	1,044.00	939,600
大崎電気工業	800	794.00	635,200
オムロン	4,100	6,310.00	25,871,000
日東工業	600	1,880.00	1,128,000

I D E C	500	2,813.00	1,406,500	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	7,000	599.00	4,193,000	
サクサホールディングス	100	2,169.00	216,900	
メルコホールディングス	200	3,675.00	735,000	
テクノメディカ	100	1,964.00	196,400	
日本電気	5,000	3,205.00	16,025,000	
富士通	40,000	635.60	25,424,000	
沖電気工業	1,600	1,457.00	2,331,200	
岩崎通信機	200	769.00	153,800	
電気興業	200	3,325.00	665,000	
サンケン電気	2,000	835.00	1,670,000	
ナカヨ	100	2,038.00	203,800	
アイホン	200	1,731.00	346,200	
ルネサスエレクトロニクス	2,000	1,218.00	2,436,000	
セイコーエプソン	5,800	2,028.00	11,762,400	
ワコム	3,000	550.00	1,650,000	
アルバック	900	6,270.00	5,643,000	
E I Z O	400	5,050.00	2,020,000	
ジャパンディスプレイ	8,000	218.00	1,744,000	
日本信号	1,100	1,065.00	1,171,500	
京三製作所	1,000	755.00	755,000	
能美防災	500	2,303.00	1,151,500	
ホーチキ	300	2,037.00	611,100	
エレコム	300	2,330.00	699,000	
パナソニック	44,400	1,623.50	72,083,400	代用有価証券 7,500株
シャープ	2,700	3,545.00	9,571,500	
アンリツ	2,800	1,344.00	3,763,200	
富士通ゼネラル	1,200	2,032.00	2,438,400	
ソニー	26,000	5,349.00	139,074,000	代用有価証券 3,700株
T D K	2,000	9,350.00	18,700,000	
帝国通信工業	200	1,413.00	282,600	
タムラ製作所	1,500	803.00	1,204,500	
アルプス電気	3,300	2,756.00	9,094,800	
パイオニア	6,500	195.00	1,267,500	
日本電波工業	400	687.00	274,800	
鈴木	200	1,292.00	258,400	
日本トリム	100	5,750.00	575,000	
ローランド ディー . ジー .	200	2,685.00	537,000	
フォスター電機	500	3,015.00	1,507,500	
クラリオン	2,000	336.00	672,000	
S M K	1,000	460.00	460,000	

ヨコオ	300	2,265.00	679,500
ホシデン	1,000	1,523.00	1,523,000
ヒロセ電機	600	15,130.00	9,078,000
日本航空電子工業	1,000	1,556.00	1,556,000
TOA	400	1,430.00	572,000
マクセルホールディングス	800	2,125.00	1,700,000
古野電気	500	744.00	372,000
アルパイン	900	2,108.00	1,897,200
スミダコーポレーション	400	1,633.00	653,200
アイコム	200	2,752.00	550,400
リオン	200	3,000.00	600,000
本多通信工業	300	1,233.00	369,900
船井電機	400	769.00	307,600
横河電機	3,900	2,211.00	8,622,900
新電元工業	100	8,150.00	815,000
アズビル	1,200	4,700.00	5,640,000
東亜ディーケーケー	200	1,252.00	250,400
日本光電工業	1,600	2,964.00	4,742,400
チノー	100	1,632.00	163,200
共和電業	400	451.00	180,400
日本電子材料	200	736.00	147,200
堀場製作所	800	7,710.00	6,168,000
アドバンテスト	2,200	2,222.00	4,888,400
エスペック	300	2,607.00	782,100
キーエンス	1,900	63,880.00	121,372,000
日置電機	200	3,575.00	715,000
シスメックス	3,000	8,680.00	26,040,000
日本マイクロニクス	700	1,099.00	769,300
メガチップス	300	3,735.00	1,120,500
OBARA GROUP	200	6,520.00	1,304,000
コーセル	500	1,636.00	818,000
イリソ電子工業	300	6,910.00	2,073,000
オブテックスグループ	300	5,770.00	1,731,000
千代田インテグレ	200	2,436.00	487,200
アイ・オー・データ機器	200	1,142.00	228,400
レーザーテック	800	4,390.00	3,512,000
スタンレー電気	3,000	4,130.00	12,390,000
岩崎電気	200	1,644.00	328,800
ウシオ電機	2,400	1,454.00	3,489,600
岡谷電機産業	200	750.00	150,000
ヘリオス テクノ ホールディング	300	1,011.00	303,300
日本セラミック	400	2,903.00	1,161,200

古河電池	300	1,036.00	310,800	
山一電機	300	1,831.00	549,300	
図研	300	1,807.00	542,100	
日本電子	1,000	826.00	826,000	
カシオ計算機	3,100	1,505.00	4,665,500	
ファナック	3,700	27,060.00	100,122,000	
日本シイエムケイ	700	974.00	681,800	
エンプラス	200	3,785.00	757,000	
ローム	1,700	10,950.00	18,615,000	
浜松ホトニクス	2,800	4,140.00	11,592,000	
三井ハイテック	500	2,042.00	1,021,000	
新光電気工業	1,500	882.00	1,323,000	
京セラ	6,400	6,156.00	39,398,400	
太陽誘電	1,700	1,768.00	3,005,600	
村田製作所	4,100	14,885.00	61,028,500	
双葉電子工業	600	2,234.00	1,340,400	
ニチコン	1,200	1,321.00	1,585,200	
日本ケミコン	300	2,743.00	822,900	
K O A	500	2,298.00	1,149,000	
市光工業	600	1,174.00	704,400	
小糸製作所	2,300	7,470.00	17,181,000	
ミツバ	700	1,374.00	961,800	
S C R E E Nホールディングス	700	9,450.00	6,615,000	
キャノン電子	400	2,554.00	1,021,600	
キャノン	20,900	3,941.00	82,366,900	代用有価証券 4,100株
リコー	11,700	1,151.00	13,466,700	
M U T O Hホールディングス	100	2,517.00	251,700	
東京エレクトロン	2,600	20,450.00	53,170,000	
トヨタ紡織	1,100	2,254.00	2,479,400	
ユニプレス	800	2,571.00	2,056,800	
豊田自動織機	3,100	6,730.00	20,863,000	
モリタホールディングス	600	1,980.00	1,188,000	
三櫻工業	500	751.00	375,500	
デンソー	8,600	6,208.00	53,388,800	
東海理化電機製作所	1,000	2,266.00	2,266,000	
三井造船	1,400	1,956.00	2,738,400	
川崎重工業	3,000	3,970.00	11,910,000	
名村造船所	1,200	620.00	744,000	
三菱ロジスネクスト	500	913.00	456,500	
日産自動車	45,800	1,112.00	50,929,600	
いすゞ自動車	11,300	1,720.50	19,441,650	

トヨタ自動車	47,200	7,235.00	341,492,000	代用有価証券 9,000株
日野自動車	5,500	1,409.00	7,749,500	
三菱自動車工業	14,400	810.00	11,664,000	
エフテック	200	1,311.00	262,200	
ファルテック	100	1,469.00	146,900	
武蔵精密工業	400	3,720.00	1,488,000	
日産車体	1,500	1,010.00	1,515,000	
新明和工業	1,700	941.00	1,599,700	
極東開発工業	700	1,672.00	1,170,400	
日信工業	800	1,888.00	1,510,400	
トピー工業	300	3,200.00	960,000	
ティラド	100	4,125.00	412,500	
曙ブレーキ工業	1,800	298.00	536,400	
タチエス	700	1,879.00	1,315,300	
N O K	2,100	2,256.00	4,737,600	
フタバ産業	1,200	937.00	1,124,400	
K Y B	400	5,440.00	2,176,000	
大同メタル工業	500	1,312.00	656,000	
プレス工業	2,100	669.00	1,404,900	
ミクニ	500	694.00	347,000	
太平洋工業	800	1,476.00	1,180,800	
ケーヒン	900	2,164.00	1,947,600	
河西工業	500	1,440.00	720,000	
アイシン精機	3,200	6,140.00	19,648,000	
マツダ	12,200	1,471.00	17,946,200	
今仙電機製作所	400	1,186.00	474,400	
本田技研工業	35,000	3,807.00	133,245,000	代用有価証券 6,000株
スズキ	7,700	5,934.00	45,691,800	
S U B A R U	12,100	3,687.00	44,612,700	
安永	200	2,473.00	494,600	
ヤマハ発動機	5,500	3,390.00	18,645,000	
ショーワ	1,000	1,634.00	1,634,000	
T B K	500	540.00	270,000	
エクセディ	500	3,415.00	1,707,500	
豊田合成	1,400	2,607.00	3,649,800	
愛三工業	700	1,232.00	862,400	
盟和産業	100	1,364.00	136,400	
ヨロズ	400	1,890.00	756,000	
エフ・シー・シー	600	3,105.00	1,863,000	
シマノ	1,600	15,210.00	24,336,000	
テイ・エス テック	900	4,360.00	3,924,000	

ジャムコ	200	2,373.00	474,600
テルモ	6,000	5,460.00	32,760,000
クリエートメディック	100	1,148.00	114,800
日機装	1,300	1,208.00	1,570,400
鳥津製作所	4,600	2,671.00	12,286,600
JMS	400	620.00	248,000
長野計器	300	1,214.00	364,200
ブイ・テクノロジー	100	25,580.00	2,558,000
東京計器	200	1,221.00	244,200
愛知時計電機	100	4,425.00	442,500
オーバル	400	295.00	118,000
東京精密	700	4,340.00	3,038,000
マニー	500	3,985.00	1,992,500
ニコン	6,800	2,167.00	14,735,600
トプコン	2,100	2,335.00	4,903,500
オリンパス	5,800	4,120.00	23,896,000
理研計器	400	2,289.00	915,600
タムロン	300	2,440.00	732,000
HOYA	7,900	5,463.00	43,157,700
ノーリツ鋼機	400	2,433.00	973,200
シチズン時計	4,600	815.00	3,749,000
リズム時計工業	100	2,213.00	221,300
大研医器	300	750.00	225,000
メニコン	500	2,618.00	1,309,000
松風	200	1,429.00	285,800
セイコーホールディングス	600	2,880.00	1,728,000
ニプロ	2,700	1,572.00	4,244,400
パラマウントベッドホールディングス	400	5,650.00	2,260,000
トランザクション	200	1,089.00	217,800
ニホンフラッシュ	200	2,691.00	538,200
前田工織	400	2,007.00	802,800
永大産業	1,000	562.00	562,000
アートネイチャー	400	775.00	310,000
バンダイナムコホールディングス	4,000	3,475.00	13,900,000
共立印刷	600	365.00	219,000
SHOEI	200	4,670.00	934,000
フランスベッドホールディングス	500	1,028.00	514,000
パイロットコーポレーション	700	5,480.00	3,836,000
萩原工業	200	1,774.00	354,800
トッパン・フォームズ	800	1,237.00	989,600
フジシールインターナショナル	900	3,475.00	3,127,500
タカラトミー	1,600	1,114.00	1,782,400

廣濟堂	400	517.00	206,800
A s - m e エステール	100	960.00	96,000
タカノ	200	954.00	190,800
プロネクサス	400	1,315.00	526,000
ウッドワン	100	1,445.00	144,500
大建工業	300	2,705.00	811,500
凸版印刷	11,000	923.00	10,153,000
大日本印刷	5,100	2,236.00	11,403,600
図書印刷	300	957.00	287,100
共同印刷	100	3,185.00	318,500
N I S S H A	800	2,939.00	2,351,200
宝印刷	200	1,854.00	370,800
アシックス	3,900	1,644.00	6,411,600
ツツミ	100	2,131.00	213,100
小松ウオール工業	100	2,599.00	259,900
ヤマハ	2,600	4,695.00	12,207,000
河合楽器製作所	100	3,850.00	385,000
クリナップ	400	843.00	337,200
ピジョン	2,300	4,410.00	10,143,000
キングジム	300	988.00	296,400
リンテック	900	3,020.00	2,718,000
イトーキ	800	724.00	579,200
任天堂	2,400	47,180.00	113,232,000
三菱鉛筆	600	2,407.00	1,444,200
タカラスタANDARD	800	1,831.00	1,464,800
コクヨ	1,900	1,972.00	3,746,800
ナカバヤシ	400	617.00	246,800
グローブライド	200	2,327.00	465,400
岡村製作所	1,400	1,499.00	2,098,600
美津濃	400	3,200.00	1,280,000
東京電力ホールディングス	31,000	401.00	12,431,000
中部電力	11,900	1,437.50	17,106,250
関西電力	15,900	1,262.00	20,065,800
中国電力	5,400	1,226.00	6,620,400
北陸電力	3,800	830.00	3,154,000
東北電力	9,100	1,362.00	12,394,200
四国電力	3,500	1,194.00	4,179,000
九州電力	8,600	1,187.00	10,208,200
北海道電力	3,900	629.00	2,453,100
沖縄電力	600	2,834.00	1,700,400
電源開発	3,100	2,703.00	8,379,300
エフオン	200	1,176.00	235,200

イーレックス	600	795.00	477,000
東京瓦斯	8,300	2,644.00	21,945,200
大阪瓦斯	7,500	2,128.00	15,960,000
東邦瓦斯	1,900	3,100.00	5,890,000
北海道瓦斯	1,000	294.00	294,000
広島ガス	800	405.00	324,000
西部瓦斯	500	2,768.00	1,384,000
静岡ガス	1,100	875.00	962,500
メタウォーター	200	3,075.00	615,000
SBSホールディングス	400	1,339.00	535,600
東武鉄道	4,200	3,285.00	13,797,000
相鉄ホールディングス	1,200	2,822.00	3,386,400
東京急行電鉄	10,600	1,708.00	18,104,800
京浜急行電鉄	5,300	1,921.00	10,181,300
小田急電鉄	5,800	2,183.00	12,661,400
京王電鉄	2,200	4,660.00	10,252,000
京成電鉄	2,700	3,450.00	9,315,000
富士急行	500	2,801.00	1,400,500
新京成電鉄	100	2,259.00	225,900
東日本旅客鉄道	7,000	10,065.00	70,455,000
西日本旅客鉄道	3,500	7,397.00	25,889,500
東海旅客鉄道	3,500	19,750.00	69,125,000
西武ホールディングス	5,000	1,845.00	9,225,000
鴻池運輸	500	1,898.00	949,000
西日本鉄道	1,100	2,884.00	3,172,400
ハマキョウレックス	300	3,455.00	1,036,500
サカイ引越センター	200	5,570.00	1,114,000
近鉄グループホールディングス	3,700	4,115.00	15,225,500
阪急阪神ホールディングス	4,900	3,920.00	19,208,000
南海電気鉄道	1,700	2,704.00	4,596,800
京阪ホールディングス	1,600	3,360.00	5,376,000
名古屋鉄道	2,900	2,726.00	7,905,400
山陽電気鉄道	300	2,754.00	826,200
日本通運	1,400	7,140.00	9,996,000
ヤマトホールディングス	6,500	2,711.00	17,621,500
山九	900	5,080.00	4,572,000
丸運	200	354.00	70,800
丸全昭和運輸	1,000	516.00	516,000
センコーグループホールディングス	2,200	744.00	1,636,800
トナミホールディングス	100	5,410.00	541,000
ニッコンホールディングス	1,400	2,701.00	3,781,400
福山通運	500	4,700.00	2,350,000

セイノーホールディングス	2,800	1,865.00	5,222,000
神奈川中央交通	100	3,720.00	372,000
日立物流	800	2,665.00	2,132,000
丸和運輸機関	200	3,735.00	747,000
C & F ロジホールディングス	400	1,513.00	605,200
九州旅客鉄道	3,100	3,330.00	10,323,000
S Gホールディングス	2,600	2,300.00	5,980,000
日本郵船	3,100	2,299.00	7,126,900
商船三井	2,300	3,340.00	7,682,000
川崎汽船	1,700	2,585.00	4,394,500
N S ユナイテッド海運	200	2,242.00	448,400
飯野海運	1,900	555.00	1,054,500
日本航空	6,800	4,010.00	27,268,000
A N A ホールディングス	7,200	4,206.00	30,283,200
トランコム	100	7,050.00	705,000
日新	300	2,799.00	839,700
三菱倉庫	1,300	2,482.00	3,226,600
三井倉庫ホールディングス	2,000	353.00	706,000
住友倉庫	3,000	735.00	2,205,000
澁澤倉庫	200	1,913.00	382,600
東陽倉庫	700	348.00	243,600
日本トランスシティ	1,000	441.00	441,000
中央倉庫	200	1,083.00	216,600
川西倉庫	100	2,043.00	204,300
安田倉庫	300	959.00	287,700
宇徳	300	503.00	150,900
上組	2,300	2,341.00	5,384,300
キムラユニティー	100	1,119.00	111,900
キューソー流通システム	100	2,554.00	255,400
近鉄エクスプレス	700	2,084.00	1,458,800
東海運	200	419.00	83,800
エーアイティー	300	1,134.00	340,200
内外トランスライン	100	1,834.00	183,400
日本コンセプト	100	1,522.00	152,200
N E C ネットズエスアイ	400	2,782.00	1,112,800
システナ	300	4,430.00	1,329,000
デジタルアーツ	200	3,940.00	788,000
新日鉄住金ソリューションズ	600	2,850.00	1,710,000
キューブシステム	200	796.00	159,200
コア	200	1,292.00	258,400
ソフトクリエイイトホールディングス	200	1,476.00	295,200
T I S	1,300	3,925.00	5,102,500

電算システム	100	1,924.00	192,400
グリー	2,000	660.00	1,320,000
コーエーテクモホールディングス	600	2,239.00	1,343,400
三菱総合研究所	200	3,465.00	693,000
A G S	200	839.00	167,800
ヒト・コミュニケーションズ	100	1,881.00	188,100
K L a b	700	1,638.00	1,146,600
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	300	2,266.00	679,800
ネクソン	4,200	3,910.00	16,422,000
アイスタイル	1,000	1,519.00	1,519,000
エイチーム	300	2,690.00	807,000
テクノスジャパン	300	921.00	276,300
コロプラ	1,200	964.00	1,156,800
ブロードリーフ	900	1,216.00	1,094,400
ハーツユナイテッドグループ	200	1,597.00	319,400
ベリサーブ	100	3,175.00	317,500
ティーガイア	400	2,938.00	1,175,200
豆蔵ホールディングス	300	1,200.00	360,000
テクマトリックス	200	1,765.00	353,000
プロシップ	100	2,214.00	221,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	10,300	375.00	3,862,500
GMOペイメントゲートウェイ	300	9,160.00	2,748,000
インターネットイニシアティブ	600	2,294.00	1,376,400
GMOクラウド	100	2,330.00	233,000
S R Aホールディングス	200	3,345.00	669,000
M i n o r iソリューションズ	100	1,558.00	155,800
朝日ネット	300	514.00	154,200
コムチュア	200	3,475.00	695,000
g u m i	400	1,056.00	422,400
オープンドア	200	2,166.00	433,200
アカツキ	100	6,010.00	601,000
L I N E	1,200	4,365.00	5,238,000
オークネット	100	1,399.00	139,900
A O I T Y O Holdings	300	1,228.00	368,400
マクロミル	400	2,883.00	1,153,200
フェイス	100	1,153.00	115,300
ハイマックス	100	1,703.00	170,300
野村総合研究所	2,500	4,605.00	11,512,500
サイバネットシステム	300	748.00	224,400
インテージホールディングス	400	1,196.00	478,400
東邦システムサイエンス	100	820.00	82,000
クレスコ	100	3,855.00	385,500

フジ・メディア・ホールディングス	4,000	1,865.00	7,460,000
オービック	1,200	8,610.00	10,332,000
ジャストシステム	600	2,425.00	1,455,000
TDCソフト	200	1,176.00	235,200
ヤフー	27,500	515.00	14,162,500
トレンドマイクロ	1,900	6,070.00	11,533,000
インフォメーション・ディベロプメント	100	1,396.00	139,600
日本オラクル	600	8,370.00	5,022,000
アルファシステムズ	100	2,371.00	237,100
フューチャー	500	1,218.00	609,000
CAC Holdings	300	1,116.00	334,800
ソフトバンク・テクノロジー	200	1,986.00	397,200
トーセ	100	1,993.00	199,300
オービックビジネスコンサルタント	200	6,270.00	1,254,000
伊藤忠テクノソリューションズ	900	4,290.00	3,861,000
アイティフォー	500	753.00	376,500
東計電算	100	3,345.00	334,500
大塚商会	1,100	9,490.00	10,439,000
サイボウズ	500	550.00	275,000
電通国際情報サービス	200	2,606.00	521,200
デジタルガレージ	700	3,185.00	2,229,500
EMシステムズ	100	2,452.00	245,200
ウェザーニューズ	100	3,250.00	325,000
C I J	300	698.00	209,400
WOWOW	200	3,400.00	680,000
イマジカ・ロボットホールディングス	300	1,164.00	349,200
ネットワンシステムズ	1,600	1,615.00	2,584,000
アルゴグラフィックス	200	3,495.00	699,000
マーベラス	600	918.00	550,800
エイベックス	700	1,607.00	1,124,900
日本ユニシス	1,100	2,205.00	2,425,500
兼松エレクトロニクス	200	3,235.00	647,000
東京放送ホールディングス	2,300	2,491.00	5,729,300
日本テレビホールディングス	3,500	2,022.00	7,077,000
朝日放送	400	892.00	356,800
テレビ朝日ホールディングス	1,000	2,268.00	2,268,000
スカパーJ S A Tホールディングス	2,900	489.00	1,418,100
テレビ東京ホールディングス	300	2,667.00	800,100
日本BS放送	100	1,346.00	134,600
ビジョン	100	2,803.00	280,300
コネクシオ	300	2,345.00	703,500
日本通信	3,400	120.00	408,000

日本電信電話	27,400	4,875.00	133,575,000
KDDI	34,300	2,608.50	89,471,550
光通信	500	15,350.00	7,675,000
NTTドコモ	28,200	2,668.00	75,237,600
エムティーアイ	500	646.00	323,000
GMOインターネット	1,400	1,863.00	2,608,200
カドカワ	1,100	1,217.00	1,338,700
学研ホールディングス	100	5,040.00	504,000
ゼンリン	500	3,440.00	1,720,000
アイネット	200	1,546.00	309,200
松竹	300	15,240.00	4,572,000
東宝	2,500	3,500.00	8,750,000
東映	100	11,380.00	1,138,000
エヌ・ティ・ティ・データ	11,800	1,089.00	12,850,200
ピー・シー・エー	100	1,844.00	184,400
ビジネスブレイン太田昭和	100	1,973.00	197,300
DTS	400	3,795.00	1,518,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1,800	4,455.00	8,019,000
シーイーシー	200	3,220.00	644,000
カプコン	800	4,335.00	3,468,000
ジャステック	200	1,287.00	257,400
SCSK	900	4,295.00	3,865,500
日本システムウエア	100	2,596.00	259,600
アイネス	500	1,070.00	535,000
TKC	400	4,530.00	1,812,000
富士ソフト	500	4,010.00	2,005,000
NSD	600	2,189.00	1,313,400
コナミホールディングス	1,600	5,630.00	9,008,000
福井コンピュータホールディングス	100	2,417.00	241,700
JBCCHホールディングス	300	1,106.00	331,800
ミロク情報サービス	300	3,210.00	963,000
ソフトバンクグループ	17,300	8,775.00	151,807,500
高千穂交易	100	1,253.00	125,300
伊藤忠食品	100	5,800.00	580,000
エレマテック	200	2,571.00	514,200
JALUX	100	3,080.00	308,000
あらた	200	4,990.00	998,000
トーマンデバイス	100	2,895.00	289,500
東京エレクトロン デバイス	100	2,145.00	214,500
フィールズ	300	1,199.00	359,700
双日	22,700	334.00	7,581,800
アルフレッサ ホールディングス	4,300	2,322.00	9,984,600

横浜冷凍	900	1,084.00	975,600
ラサ商事	200	927.00	185,400
アルコニックス	400	2,376.00	950,400
神戸物産	200	4,195.00	839,000
ペッパーフードサービス	200	5,000.00	1,000,000
あいホールディングス	600	2,972.00	1,783,200
ディーブイエックス	100	1,240.00	124,000
ダイワボウホールディングス	300	4,250.00	1,275,000
マクニカ・富士エレホールディングス	700	2,871.00	2,009,700
バイタルケーエスケー・ホールディングス	700	1,027.00	718,900
八洲電機	300	884.00	265,200
UKCホールディングス	200	2,345.00	469,000
OCHIホールディングス	100	1,457.00	145,700
TOKAIホールディングス	2,000	1,146.00	2,292,000
三洋貿易	200	2,313.00	462,600
ウイン・パートナーズ	300	1,693.00	507,900
シップヘルスケアホールディングス	800	3,780.00	3,024,000
明治電機工業	100	1,963.00	196,300
デリカフーズホールディングス	100	1,431.00	143,100
コメダホールディングス	700	2,121.00	1,484,700
富士興産	100	624.00	62,400
小野建	300	1,947.00	584,100
佐島電機	300	1,075.00	322,500
伯東	200	1,639.00	327,800
コンドーテック	300	970.00	291,000
中山福	200	783.00	156,600
ナガイレーベン	500	2,766.00	1,383,000
三菱食品	400	3,110.00	1,244,000
松田産業	300	1,942.00	582,600
第一興商	600	5,580.00	3,348,000
メディバルホールディングス	3,800	2,118.00	8,048,400
SPK	100	3,035.00	303,500
萩原電気	100	3,420.00	342,000
アズワン	300	6,950.00	2,085,000
スズデン	100	1,727.00	172,700
尾家産業	100	1,339.00	133,900
シモジマ	200	1,115.00	223,000
ドウシシャ	400	2,389.00	955,600
小津産業	100	2,235.00	223,500
高速	200	1,221.00	244,200
たけびし	100	1,829.00	182,900
黒田電気	300	2,714.00	814,200

リックス	100	2,176.00	217,600	
丸文	300	1,060.00	318,000	
ハピネット	300	1,735.00	520,500	
橋本総業ホールディングス	100	1,856.00	185,600	
日本ライフライン	1,100	3,370.00	3,707,000	
エクセル	200	2,908.00	581,600	
マルカキカイ	100	2,096.00	209,600	
I D O M	1,200	714.00	856,800	
日本エム・ディ・エム	300	996.00	298,800	
進和	200	2,258.00	451,600	
ダイトロン	200	2,395.00	479,000	
シークス	200	4,900.00	980,000	
田中商事	100	796.00	79,600	
オーハシテクニカ	200	1,753.00	350,600	
白銅	100	2,453.00	245,300	
伊藤忠商事	28,100	2,014.00	56,593,400	
丸紅	31,500	799.00	25,168,500	
長瀬産業	2,300	1,825.00	4,197,500	
蝶理	200	1,919.00	383,800	
豊田通商	4,300	4,000.00	17,200,000	
三共生興	700	515.00	360,500	
兼松	1,600	1,418.00	2,268,800	
三井物産	32,500	1,913.50	62,188,750	
日本紙パルプ商事	200	4,290.00	858,000	
日立ハイテクノロジーズ	1,300	5,050.00	6,565,000	
カメイ	500	1,628.00	814,000	
東都水産	100	1,977.00	197,700	
O U Gホールディングス	100	2,680.00	268,000	
スターゼン	100	5,230.00	523,000	
山善	1,500	1,194.00	1,791,000	
椿本興業	100	3,305.00	330,500	
住友商事	24,100	1,831.50	44,139,150	
内田洋行	200	3,220.00	644,000	
三菱商事	26,900	2,969.00	79,866,100	代用有価証券 5,200株
第一実業	200	3,205.00	641,000	
キャノンマーケティングジャパン	1,100	2,952.00	3,247,200	
西華産業	200	2,594.00	518,800	
佐藤商事	300	1,139.00	341,700	
菱洋エレクトロ	400	1,883.00	753,200	
東京産業	400	593.00	237,200	
ユアサ商事	400	3,730.00	1,492,000	
小林産業	300	351.00	105,300	

阪和興業	700	4,855.00	3,398,500
正栄食品工業	200	3,990.00	798,000
カナデン	400	1,338.00	535,200
菱電商事	300	1,850.00	555,000
フルサト工業	200	1,766.00	353,200
岩谷産業	800	4,050.00	3,240,000
極東貿易	1,000	463.00	463,000
イワキ	1,000	424.00	424,000
三愛石油	1,000	1,466.00	1,466,000
稲畑産業	900	1,563.00	1,406,700
明和産業	400	496.00	198,400
ワキタ	800	1,285.00	1,028,000
東邦ホールディングス	1,100	2,499.00	2,748,900
サンゲツ	1,300	2,253.00	2,928,900
ミツウロコグループホールディングス	600	755.00	453,000
シナネンホールディングス	200	2,695.00	539,000
伊藤忠エネクス	800	1,022.00	817,600
サンリオ	1,100	1,942.00	2,136,200
サンワテクノス	200	2,123.00	424,600
リョーサン	500	3,950.00	1,975,000
新光商事	400	1,933.00	773,200
トーヨー	200	2,435.00	487,000
三信電気	400	1,917.00	766,800
東陽テクニカ	400	957.00	382,800
モスフードサービス	500	3,220.00	1,610,000
加賀電子	300	2,751.00	825,300
ソーダニッカ	400	687.00	274,800
立花エレテック	300	2,190.00	657,000
フォーバル	200	968.00	193,600
PALTAC	500	5,330.00	2,665,000
三谷産業	400	443.00	177,200
ヤマタネ	200	1,964.00	392,800
日鉄住金物産	300	5,990.00	1,797,000
トラスコ中山	800	2,839.00	2,271,200
オートバックスセブン	1,500	2,084.00	3,126,000
モリト	300	972.00	291,600
加藤産業	600	3,655.00	2,193,000
イノテック	300	1,252.00	375,600
イエローハット	400	3,215.00	1,286,000
JKホールディングス	400	886.00	354,400
日伝	300	2,154.00	646,200
杉本商事	200	1,843.00	368,600

因幡電機産業	500	4,965.00	2,482,500
バイテックホールディングス	200	1,648.00	329,600
ミスミグループ本社	4,400	3,100.00	13,640,000
タキヒヨー	100	2,323.00	232,300
蔵王産業	100	1,887.00	188,700
スズケン	1,700	4,200.00	7,140,000
ジェコス	300	1,255.00	376,500
ルネサスイーストン	400	739.00	295,600
ローソン	1,000	7,240.00	7,240,000
サンエー	300	5,440.00	1,632,000
カワチ薬品	300	2,611.00	783,300
エービーシー・マート	700	6,720.00	4,704,000
ハードオフコーポレーション	200	1,164.00	232,800
アスクル	300	3,945.00	1,183,500
ゲオホールディングス	700	2,015.00	1,410,500
アダストリア	600	2,410.00	1,446,000
ジーフット	200	781.00	156,200
くらコーポレーション	200	6,490.00	1,298,000
キャンドウ	200	1,744.00	348,800
パルグループホールディングス	200	3,050.00	610,000
エディオン	1,500	1,309.00	1,963,500
サーラコーポレーション	700	675.00	472,500
ワッツ	200	1,069.00	213,800
ハローズ	100	2,477.00	247,700
あみやき亭	100	5,240.00	524,000
ひらまつ	500	551.00	275,500
大黒天物産	100	5,240.00	524,000
ハニーズホールディングス	400	1,018.00	407,200
アルペン	300	2,478.00	743,400
クオール	400	2,276.00	910,400
ジンズ	300	5,240.00	1,572,000
ビックカメラ	2,200	1,654.00	3,638,800
DCMホールディングス	2,100	1,070.00	2,247,000
MonotaRO	1,400	3,430.00	4,802,000
アーランドサービスホールディングス	300	2,240.00	672,000
J.フロント リテイリング	4,600	1,963.00	9,029,800
ドトール・日レスホールディングス	700	2,524.00	1,766,800
マツモトキヨシホールディングス	1,600	4,495.00	7,192,000
ブロンコビリー	200	3,320.00	664,000
スタートトゥデイ	3,800	2,915.00	11,077,000
トレジャー・ファクトリー	100	861.00	86,100
物語コーポレーション	100	9,870.00	987,000

ココカラファイン	400	6,970.00	2,788,000
三越伊勢丹ホールディングス	7,200	1,262.00	9,086,400
ウエルシアホールディングス	1,000	4,680.00	4,680,000
クリエイティブSDホールディングス	600	2,694.00	1,616,400
丸善CHホールディングス	400	343.00	137,200
チムニー	100	2,892.00	289,200
シュッピン	200	1,269.00	253,800
ネクステージ	400	1,071.00	428,400
ジョイフル本田	600	3,435.00	2,061,000
鳥貴族	100	2,963.00	296,300
すかいらーく	2,400	1,459.00	3,501,600
綿半ホールディングス	100	3,870.00	387,000
ヨシックス	100	3,910.00	391,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,300	1,114.00	1,448,200
ブックオフコーポレーション	200	843.00	168,600
あさひ	300	1,319.00	395,700
日本調剤	100	3,450.00	345,000
コスモス薬品	200	19,680.00	3,936,000
トーエル	200	1,001.00	200,200
オンリー	100	913.00	91,300
セブン&アイ・ホールディングス	16,000	4,504.00	72,064,000
薬王堂	200	3,480.00	696,000
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	1,000	1,231.00	1,231,000
ツルハホールディングス	800	15,230.00	12,184,000
サンマルクホールディングス	300	3,185.00	955,500
フェリシモ	100	1,268.00	126,800
トリドールホールディングス	500	3,680.00	1,840,000
TOKYO BASE	100	4,210.00	421,000
クスリのアオキホールディングス	300	5,890.00	1,767,000
スシローグローバルホールディングス	400	4,565.00	1,826,000
LIXILピバ	400	2,146.00	858,400
総合メディカル	200	6,110.00	1,222,000
はるやまホールディングス	200	1,070.00	214,000
ノジマ	700	2,521.00	1,764,700
カップ・クリエイティブ	500	1,270.00	635,000
ライトオン	300	933.00	279,900
良品計画	500	35,550.00	17,775,000
三城ホールディングス	500	520.00	260,000
アドヴァン	400	1,069.00	427,600
アルビス	100	3,115.00	311,500
コナカ	500	578.00	289,000

G-7ホールディングス	100	2,449.00	244,900
イオン北海道	400	818.00	327,200
ヒマラヤ	100	1,297.00	129,700
コーナン商事	500	2,559.00	1,279,500
エコス	200	1,301.00	260,200
ワタミ	500	1,307.00	653,500
ドンキホーテホールディングス	2,500	5,940.00	14,850,000
西松屋チェーン	800	1,246.00	996,800
ゼンショーホールディングス	2,000	2,227.00	4,454,000
ハークスレイ	100	1,112.00	111,200
サイゼリヤ	600	3,005.00	1,803,000
V Tホールディングス	1,300	557.00	724,100
魚力	100	1,201.00	120,100
フジ・コーポレーション	100	2,560.00	256,000
ユナイテッドアローズ	500	4,210.00	2,105,000
ハイデイ日高	400	3,355.00	1,342,000
京都きもの友禅	200	785.00	157,000
コロワイド	1,300	2,440.00	3,172,000
ピーシーデポコーポレーション	600	788.00	472,800
壱番屋	300	4,580.00	1,374,000
P L A N T	100	1,375.00	137,500
スギホールディングス	800	5,790.00	4,632,000
スクロール	600	456.00	273,600
ヨンドシーホールディングス	400	2,677.00	1,070,800
ユニー・ファミリーマートホールディングス	1,200	7,970.00	9,564,000
木曾路	500	2,730.00	1,365,000
ケーヨー	700	626.00	438,200
上新電機	500	3,770.00	1,885,000
日本瓦斯	700	4,495.00	3,146,500
ロイヤルホールディングス	700	2,827.00	1,978,900
いなげや	400	1,798.00	719,200
島忠	900	3,530.00	3,177,000
チヨダ	500	2,735.00	1,367,500
ライフコーポレーション	300	2,884.00	865,200
リンガーハット	500	2,437.00	1,218,500
MrMaxHD	500	752.00	376,000
AOKIホールディングス	800	1,724.00	1,379,200
オークワ	1,000	1,121.00	1,121,000
コメリ	600	3,075.00	1,845,000
青山商事	700	4,465.00	3,125,500
しまむら	400	12,860.00	5,144,000
はせがわ	200	484.00	96,800

高島屋	6,000	1,091.00	6,546,000
松屋	800	1,554.00	1,243,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,800	2,090.00	3,762,000
近鉄百貨店	100	3,995.00	399,500
パルコ	400	1,470.00	588,000
丸井グループ	3,700	2,017.00	7,462,900
アクシアル リテイリング	300	4,345.00	1,303,500
イオン	14,700	1,845.00	27,121,500
イズミ	700	7,000.00	4,900,000
平和堂	800	2,431.00	1,944,800
フジ	500	2,253.00	1,126,500
ヤオコー	400	5,840.00	2,336,000
ゼビオホールディングス	500	2,194.00	1,097,000
ケーズホールディングス	1,600	2,979.00	4,766,400
日産東京販売ホールディングス	600	401.00	240,600
Genky DrugStores	100	3,370.00	337,000
アインホールディングス	500	6,880.00	3,440,000
元気寿司	100	2,758.00	275,800
ヤマダ電機	12,800	686.00	8,780,800
アークランドサカモト	600	1,753.00	1,051,800
ニトリホールディングス	1,500	17,450.00	26,175,000
ケーユーホールディングス	200	1,090.00	218,000
吉野家ホールディングス	1,300	1,977.00	2,570,100
松屋フーズ	200	3,920.00	784,000
サガミチェーン	500	1,384.00	692,000
関西スーパーマーケット	300	1,129.00	338,700
王将フードサービス	300	5,020.00	1,506,000
プレナス	400	2,114.00	845,600
ミニストップ	300	2,180.00	654,000
アークス	700	2,532.00	1,772,400
パローホールディングス	900	2,942.00	2,647,800
ベルク	200	6,080.00	1,216,000
大庄	200	1,707.00	341,400
ファーストリテイリング	600	42,330.00	25,398,000
サンドラッグ	1,600	4,840.00	7,744,000
サクスパー ホールディングス	400	1,155.00	462,000
ヤマザワ	100	1,733.00	173,300
やまや	100	2,994.00	299,400
ベルーナ	900	1,251.00	1,125,900
じもとホールディングス	2,600	187.00	486,200
めぶきフィナンシャルグループ	19,900	434.00	8,636,600
東京ＴＹフィナンシャルグループ	500	2,738.00	1,369,000

九州フィナンシャルグループ	6,300	599.00	3,773,700
ゆうちょ銀行	10,900	1,458.00	15,892,200
富山第一銀行	1,000	506.00	506,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	23,300	621.00	14,469,300
西日本フィナンシャルホールディングス	2,600	1,308.00	3,400,800
新生銀行	3,300	1,674.00	5,524,200
あおぞら銀行	2,300	4,395.00	10,108,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	270,800	764.60	207,053,680
りそなホールディングス	42,100	616.90	25,971,490
三井住友トラスト・ホールディングス	7,500	4,346.00	32,595,000
三井住友フィナンシャルグループ	29,000	4,685.00	135,865,000
第四銀行	500	4,890.00	2,445,000
北越銀行	400	2,394.00	957,600
千葉銀行	14,000	880.00	12,320,000
群馬銀行	7,800	649.00	5,062,200
武蔵野銀行	600	3,610.00	2,166,000
千葉興業銀行	1,100	501.00	551,100
筑波銀行	1,600	356.00	569,600
七十七銀行	1,200	2,677.00	3,212,400
青森銀行	300	3,350.00	1,005,000
秋田銀行	200	2,868.00	573,600
山形銀行	400	2,366.00	946,400
岩手銀行	300	4,280.00	1,284,000
東邦銀行	3,400	393.00	1,336,200
東北銀行	200	1,470.00	294,000
みちのく銀行	200	1,794.00	358,800
ふくおかフィナンシャルグループ	16,000	560.00	8,960,000
静岡銀行	10,000	1,093.00	10,930,000
十六銀行	500	2,873.00	1,436,500
スルガ銀行	3,900	1,872.00	7,300,800
八十二銀行	6,900	638.00	4,402,200
山梨中央銀行	2,000	436.00	872,000
大垣共立銀行	600	2,737.00	1,642,200
福井銀行	300	2,575.00	772,500
北國銀行	400	4,355.00	1,742,000
清水銀行	100	2,987.00	298,700
富山銀行	100	3,940.00	394,000
滋賀銀行	4,000	559.00	2,236,000
南都銀行	400	2,974.00	1,189,600
百五銀行	3,700	526.00	1,946,200
京都銀行	1,500	5,930.00	8,895,000
紀陽銀行	1,400	1,750.00	2,450,000

三重銀行	200	2,337.00	467,400
ほくほくフィナンシャルグループ	2,600	1,535.00	3,991,000
広島銀行	5,700	844.00	4,810,800
山陰合同銀行	2,300	1,022.00	2,350,600
中国銀行	2,700	1,331.00	3,593,700
鳥取銀行	100	1,732.00	173,200
伊予銀行	5,500	856.00	4,708,000
百十四銀行	4,000	356.00	1,424,000
四国銀行	600	1,528.00	916,800
阿波銀行	3,000	666.00	1,998,000
大分銀行	200	4,090.00	818,000
宮崎銀行	300	3,430.00	1,029,000
佐賀銀行	200	2,516.00	503,200
十八銀行	2,000	288.00	576,000
沖縄銀行	400	4,340.00	1,736,000
琉球銀行	700	1,611.00	1,127,700
セブン銀行	14,400	379.00	5,457,600
みずほフィナンシャルグループ	520,800	198.40	103,326,720
高知銀行	100	1,366.00	136,600
山口フィナンシャルグループ	4,000	1,278.00	5,112,000
長野銀行	100	1,888.00	188,800
名古屋銀行	300	3,975.00	1,192,500
北洋銀行	5,800	367.00	2,128,600
愛知銀行	100	5,320.00	532,000
第三銀行	200	1,653.00	330,600
中京銀行	200	2,323.00	464,600
大光銀行	100	2,393.00	239,300
愛媛銀行	500	1,267.00	633,500
トマト銀行	100	1,570.00	157,000
みなと銀行	300	2,072.00	621,600
京葉銀行	3,000	494.00	1,482,000
関西アーバン銀行	500	1,414.00	707,000
栃木銀行	2,000	421.00	842,000
北日本銀行	100	3,020.00	302,000
東和銀行	700	1,365.00	955,500
福島銀行	400	794.00	317,600
大東銀行	200	1,403.00	280,600
トモニホールディングス	3,200	489.00	1,564,800
フィデアホールディングス	3,700	197.00	728,900
池田泉州ホールディングス	4,100	418.00	1,713,800
F P G	1,300	1,410.00	1,833,000
S B Iホールディングス	4,300	2,415.00	10,384,500

ジャフコ	500	5,330.00	2,665,000
大和証券グループ本社	33,000	711.90	23,492,700
野村ホールディングス	65,900	646.20	42,584,580
岡三証券グループ	3,000	678.00	2,034,000
丸三証券	1,200	1,025.00	1,230,000
東洋証券	1,000	307.00	307,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	4,200	775.00	3,255,000
光世証券	100	1,385.00	138,500
水戸証券	1,200	408.00	489,600
いちよし証券	800	1,259.00	1,007,200
松井証券	1,900	1,048.00	1,991,200
マネックスグループ	4,100	377.00	1,545,700
カブドットコム証券	2,500	373.00	932,500
極東証券	500	1,564.00	782,000
岩井コスモホールディングス	400	1,378.00	551,200
藍澤証券	700	784.00	548,800
かんぽ生命保険	1,400	2,745.00	3,843,000
SOMPOホールディングス	7,500	4,091.00	30,682,500
アニコムホールディングス	300	3,475.00	1,042,500
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	10,000	3,328.00	33,280,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	3,100	2,001.00	6,203,100
第一生命ホールディングス	21,700	2,150.50	46,665,850
東京海上ホールディングス	14,400	4,936.00	71,078,400
T&Dホールディングス	11,900	1,803.00	21,455,700
全国保証	1,100	4,710.00	5,181,000
クレディセゾン	2,900	1,851.00	5,367,900
芙蓉総合リース	400	7,120.00	2,848,000
興銀リース	700	2,752.00	1,926,400
東京センチュリー	800	6,030.00	4,824,000
日本証券金融	1,600	655.00	1,048,000
アイフル	6,400	368.00	2,355,200
リコーリース	300	3,595.00	1,078,500
イオンフィナンシャルサービス	2,700	2,506.00	6,766,200
アコム	7,700	477.00	3,672,900
ジャックス	500	2,470.00	1,235,000
オリエントコーポレーション	8,300	170.00	1,411,000
日立キャピタル	1,100	2,783.00	3,061,300
オリックス	25,600	1,895.50	48,524,800
三菱UFJリース	9,700	673.00	6,528,100
日本取引所グループ	11,300	1,852.00	20,927,600
イー・ギャランティ	100	4,185.00	418,500
アサックス	100	1,912.00	191,200

NECキャピタルソリューション	200	2,113.00	422,600
いちご	5,500	448.00	2,464,000
日本駐車場開発	4,600	184.00	846,400
ヒューリック	8,000	1,181.00	9,448,000
三栄建築設計	200	2,152.00	430,400
スター・マイカ	100	1,907.00	190,700
野村不動産ホールディングス	2,500	2,612.00	6,530,000
三重交通グループホールディングス	800	531.00	424,800
サムティ	300	1,824.00	547,200
日本商業開発	200	1,886.00	377,200
プレサンスコーポレーション	500	1,651.00	825,500
ユニゾホールディングス	400	2,904.00	1,161,600
日本管理センター	300	1,745.00	523,500
サンセイランディック	100	1,398.00	139,800
フージャースホールディングス	900	772.00	694,800
オープンハウス	600	6,710.00	4,026,000
東急不動産ホールディングス	9,300	805.00	7,486,500
飯田グループホールディングス	3,200	1,967.00	6,294,400
ムゲンエステート	200	1,298.00	259,600
ファーストブラザーズ	100	1,429.00	142,900
シーアールイー	100	1,674.00	167,400
ケイアイスター不動産	100	2,787.00	278,700
パーク24	2,100	2,545.00	5,344,500
パラカ	100	2,407.00	240,700
三井不動産	19,100	2,556.00	48,819,600
三菱地所	28,500	1,855.00	52,867,500
平和不動産	700	2,003.00	1,402,100
東京建物	4,200	1,658.00	6,963,600
ダイビル	1,000	1,316.00	1,316,000
京阪神ビルディング	600	844.00	506,400
住友不動産	9,000	3,875.00	34,875,000
大京	600	2,227.00	1,336,200
テオーシー	1,300	841.00	1,093,300
東京楽天地	100	5,140.00	514,000
レオパレス21	4,600	811.00	3,730,600
スターツコーポレーション	500	2,827.00	1,413,500
フジ住宅	500	879.00	439,500
空港施設	400	627.00	250,800
明和地所	200	813.00	162,600
ゴールドクレスト	300	2,190.00	657,000
日本エスリード	100	2,204.00	220,400
日神不動産	500	798.00	399,000

日本エスコン	700	996.00	697,200
タカラレーベン	1,800	486.00	874,800
サンヨーハウジング名古屋	200	1,236.00	247,200
イオンモール	2,500	2,179.00	5,447,500
ファースト住建	100	1,754.00	175,400
トーセイ	500	1,357.00	678,500
エヌ・ティ・ティ都市開発	2,400	1,300.00	3,120,000
サンフロンティア不動産	500	1,210.00	605,000
エフ・ジェー・ネクスト	300	860.00	258,000
グランディハウス	300	473.00	141,900
日本空港ビルデング	1,100	4,030.00	4,433,000
日本工営	200	2,918.00	583,600
L I F U L L	1,300	1,083.00	1,407,900
ジェイエイシーリクルートメント	300	2,265.00	679,500
日本M&Aセンター	1,300	6,770.00	8,801,000
タケエイ	400	1,267.00	506,800
トラスト・テック	200	3,230.00	646,000
コシダカホールディングス	200	7,000.00	1,400,000
パソナグループ	400	2,271.00	908,400
リンクアンドモチベーション	700	1,085.00	759,500
G C A	400	955.00	382,000
エス・エム・エス	700	4,375.00	3,062,500
パーソルホールディングス	3,400	2,783.00	9,462,200
リニカル	200	1,406.00	281,200
クックパッド	1,200	602.00	722,400
アイ・ケイ・ケイ	200	751.00	150,200
学情	200	1,587.00	317,400
スタジオアリス	200	2,693.00	538,600
シミックホールディングス	200	2,653.00	530,600
N J S	100	1,662.00	166,200
総合警備保障	1,500	5,080.00	7,620,000
カカクコム	2,900	1,835.00	5,321,500
セントケア・ホールディング	200	730.00	146,000
ルネサンス	200	1,761.00	352,200
ディップ	500	3,315.00	1,657,500
ツクイ	900	835.00	751,500
エムスリー	3,900	4,365.00	17,023,500
ツカダ・グローバルホールディング	300	619.00	185,700
アウトソーシング	1,100	2,106.00	2,316,600
ウェルネット	400	1,161.00	464,400
ワールドホールディングス	100	3,745.00	374,500
ディー・エヌ・エー	2,000	1,911.00	3,822,000

博報堂DYホールディングス	5,200	1,551.00	8,065,200
ぐるなび	600	1,443.00	865,800
エスアールジータカミヤ	400	670.00	268,000
ファンコミュニケーションズ	1,000	757.00	757,000
ライク	100	1,956.00	195,600
WDBホールディングス	200	4,135.00	827,000
ティア	200	1,045.00	209,000
バリューコマース	300	1,355.00	406,500
インフォマート	1,900	902.00	1,713,800
J Pホールディングス	1,200	315.00	378,000
E P Sホールディングス	600	2,291.00	1,374,600
レグス	100	919.00	91,900
プレステージ・インターナショナル	800	1,411.00	1,128,800
アミューズ	200	3,960.00	792,000
クイック	200	2,063.00	412,600
ケネディクス	4,900	693.00	3,395,700
電通	4,500	4,970.00	22,365,000
ぴあ	100	5,440.00	544,000
イオンファンタジー	100	5,000.00	500,000
シーティーエス	400	820.00	328,000
ネクシィーズグループ	100	1,730.00	173,000
みらかホールディングス	1,100	4,120.00	4,532,000
アルプス技研	300	2,270.00	681,000
ダイオーズ	100	1,330.00	133,000
日本空調サービス	400	745.00	298,000
オリエンタルランド	4,400	10,725.00	47,190,000
ダスキン	1,000	2,662.00	2,662,000
明光ネットワークジャパン	500	1,293.00	646,500
ファルコホールディングス	200	1,730.00	346,000
ラウンドワン	1,200	1,837.00	2,204,400
リゾートトラスト	1,600	2,415.00	3,864,000
ビー・エム・エル	500	2,687.00	1,343,500
りらいあコミュニケーションズ	600	1,347.00	808,200
リソー教育	600	824.00	494,400
早稲田アカデミー	100	1,711.00	171,100
ユー・エス・エス	4,500	2,150.00	9,675,000
東京個別指導学院	100	1,320.00	132,000
サイバーエージェント	2,400	4,440.00	10,656,000
楽天	19,000	927.10	17,614,900
クリーク・アンド・リバー社	200	970.00	194,000
テー・オー・ダブリュー	400	912.00	364,800
セントラルスポーツ	100	3,985.00	398,500

フルキャストホールディングス	300	2,557.00	767,100
テクノプロ・ホールディングス	700	6,280.00	4,396,000
ジャパンマテリアル	300	4,145.00	1,243,500
ベクトル	400	2,091.00	836,400
ウチヤマホールディングス	200	661.00	132,200
I B J	300	1,130.00	339,000
アサンテ	100	1,881.00	188,100
M & A キャピタルパートナーズ	100	8,020.00	802,000
日本ビューホテル	100	1,507.00	150,700
リクルートホールディングス	28,600	2,629.50	75,203,700
日本郵政	21,100	1,292.00	27,261,200
ベルシステム24ホールディングス	600	1,507.00	904,200
ソラスト	200	2,900.00	580,000
リログループ	2,000	2,922.00	5,844,000
東祥	200	3,900.00	780,000
エイチ・アイ・エス	600	3,870.00	2,322,000
共立メンテナンス	700	4,630.00	3,241,000
イチネンホールディングス	400	1,520.00	608,000
建設技術研究所	300	1,325.00	397,500
スペース	200	1,355.00	271,000
燦ホールディングス	100	2,655.00	265,500
タナベ経営	100	1,848.00	184,800
ナガワ	100	4,285.00	428,500
よみうりランド	100	4,755.00	475,500
東京都競馬	300	3,770.00	1,131,000
常磐興産	100	1,888.00	188,800
カナモト	600	3,370.00	2,022,000
東京ドーム	1,500	987.00	1,480,500
西尾レントオール	300	3,330.00	999,000
トランス・コスモス	400	2,863.00	1,145,200
乃村工藝社	900	2,156.00	1,940,400
藤田観光	100	3,245.00	324,500
KNT-CTホールディングス	200	1,785.00	357,000
日本管財	400	2,130.00	852,000
トーカイ	400	2,599.00	1,039,600
セコム	3,900	7,750.00	30,225,000
セントラル警備保障	200	2,630.00	526,000
丹青社	800	1,046.00	836,800
メイテック	400	6,140.00	2,456,000
応用地質	400	1,445.00	578,000
船井総研ホールディングス	800	2,172.00	1,737,600
進学会ホールディングス	200	594.00	118,800

いであ	100	1,103.00	110,300	
ベネッセホールディングス	1,400	3,930.00	5,502,000	
イオンディライト	500	3,825.00	1,912,500	
ナック	200	966.00	193,200	
ニチイ学館	700	1,199.00	839,300	
ダイセキ	600	3,120.00	1,872,000	
ステップ	100	1,807.00	180,700	
合 計	4,619,400		9,643,949,470	

(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。

【中間財務諸表】

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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30期中間計算期間(平成30年2月23日から平成30年8月22日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【ニュー トピックス インデックス】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第30期中間計算期間末 平成30年 8月22日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,450,329
親投資信託受益証券	586,612,038
流動資産合計	589,062,367
資産合計	589,062,367
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	325,892
未払委託者報酬	1,629,394
未払利息	5
その他未払費用	5,149
流動負債合計	1,960,440
負債合計	1,960,440
純資産の部	
元本等	
元本	752,282,071
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	165,180,144
(分配準備積立金)	200,125,511
元本等合計	587,101,927
純資産合計	587,101,927
負債純資産合計	589,062,367

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第30期中間計算期間
	自 平成30年 2月23日
	至 平成30年 8月22日
営業収益	
有価証券売買等損益	9,459,224
その他収益	2,034
営業収益合計	9,457,190
営業費用	
支払利息	521
受託者報酬	325,892
委託者報酬	1,629,394
その他費用	5,149
営業費用合計	1,960,956
営業利益	11,418,146
経常利益	11,418,146
中間純利益	11,418,146
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	6,777
期首剰余金又は期首欠損金()	157,608,612
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,853,391
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,853,391
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金()	165,180,144

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第30期中間計算期間 自 平成30年 2月23日 至 平成30年 8月22日
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。

(中間貸借対照表に関する注記)

第30期中間計算期間末 平成30年 8月22日現在	
1. 中間計算期間末日における受益権の総数	752,282,071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 165,180,144円	
3. 中間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	0.7804円
(1万口当たり純資産額)	(7,804円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第30期中間計算期間末 平成30年 8月22日現在	
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。
2. 時価の算定方法	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。 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。
3. 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。

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	第30期中間計算期間末 平成30年 8月22日現在
期首元本額	771,135,618円
期中追加設定元本額	- 円
期中一部解約元本額	18,853,547円

2 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。

（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、中間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30年 8月22日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	245,726,464
株式	7,740,433,260
派生商品評価勘定	54,676
未収入金	40,676,554
未収配当金	10,972,210
前払金	7,730,000
流動資産合計	8,045,593,164
資産合計	
8,045,593,164	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,163,888
未払解約金	60,000,000
未払利息	561
流動負債合計	66,164,449
負債合計	
66,164,449	
純資産の部	
元本等	
元本	3,607,930,856
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,371,497,859

平成30年 8月22日現在

元本等合計	7,979,428,715
純資産合計	7,979,428,715
負債純資産合計	8,045,593,164

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30年 2月23日 至 平成30年 8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30年 8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	156,875,950円
2. 計算日における受益権の総数	3,607,930,856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	2.2116円
(1万口当たり純資産額)	(22,116円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

平成30年 8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	
ん。	
2. 時価の算定方法	

株式

「（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。

派生商品評価勘定

「（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。

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。

3.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。

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成30年 8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	4,427,162,088円
期中追加設定元本額	101,594,118円
期中一部解約元本額	920,825,350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	265,243,280円
新光7資産バランスファンド	330,753,274円
ニュー トピックス インデックス（変額年金）	115,123,265円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	630,588,064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）	575,028,755円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	33,964,166円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	1,189,083,794円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	423,764,209円
グローバル・ナビ	21,109,849円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	4,777,923円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	15,635,085円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	2,859,192円
合計	3,607,930,856円

2 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30年 8月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	226,524,212	-	220,415,000	6,109,212

東証株価指数先物	226,524,212	-	220,415,000	6,109,212
合計	226,524,212	-	220,415,000	6,109,212

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。

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30年 8月31日現在)

資産総額	599,115,431円
負債総額	95,110円
純資産総額（ - ）	599,020,321円
発行済口数	751,282,071口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7973円
（1万口当たり純資産額）	（7,973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30年 8月31日現在)

資産総額	8,075,674,367円
負債総額	23,326,024円
純資産総額（ - ）	8,052,348,343円
発行済口数	3,563,141,976口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2599円
（1万口当たり純資産額）	（22,599円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2018年8月31日現在）

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

直近5力年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2018年8月31日現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2018年8月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	1,207,316,840,603
追加型株式投資信託	853	13,043,312,848,128
単位型公社債投資信託	48	194,109,113,884
単位型株式投資信託	146	978,340,252,718
合計	1,085	15,423,079,055,333

3【委託会社等の経理状況】

- 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第33期事業年度（自平成29年4月1日至平成30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。

（1）【貸借対照表】

（単位：千円）

	第32期 （平成29年3月31日現在）	第33期 （平成30年3月31日現在）
（資産の部）		
流動資産		
現金・預金	27,972,477	49,071,217
金銭の信託	12,366,219	12,083,824
有価証券	297,560	-

未収委託者報酬		10,164,041		11,769,015
未収運用受託報酬		7,250,239		4,574,225
未収投資助言報酬		316,414		341,689
未収収益		52,278		59,526
前払費用		533,411		569,431
繰延税金資産		678,104		842,996
その他		445,717		427,238
	流動資産計	60,076,462		79,739,165
固定資産				
有形固定資産		1,900,343		1,643,826
建物	1	1,243,812	1	1,156,953
器具備品	1	656,235	1	476,504
建設仮勘定		295		10,368
無形固定資産		1,614,084		1,934,700
商標権		5		-
ソフトウェア		1,511,558		1,026,319
ソフトウェア仮勘定		98,483		904,389
電話加入権		3,934		3,931
電信電話専用施設利用権		103		60
投資その他の資産		10,055,336		7,427,316
投資有価証券		3,265,786		1,721,433
関係会社株式		3,306,296		3,229,196
長期差入保証金		1,800,827		1,518,725
前払年金費用		686,322		-
繰延税金資産		893,887		856,537
その他		102,215		101,425
	固定資産計	13,569,764		11,005,844
資産合計		73,646,227		90,745,010

(単位：千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,169,128	1,003,550
未払金	4,745,195	5,081,728
未払収益分配金	1,027	1,031
未払償還金	57,332	57,275
未払手数料	4,062,695	4,629,133
その他未払金	624,140	394,288
未払費用	7,030,589	7,711,038

未払法人税等	1,915,556	5,153,972
未払消費税等	891,476	1,660,259
賞与引当金	1,432,264	1,393,911
役員賞与引当金	27,495	49,986
本社移転費用引当金	-	156,587
流動負債計	17,211,706	22,211,034
固定負債		
退職給付引当金	1,305,273	1,637,133
時効後支払損引当金	216,466	199,026
本社移転費用引当金	942,315	-
固定負債計	2,464,055	1,836,160
負債合計	19,675,761	24,047,195
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	31,899,643	44,349,855
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	31,776,350	44,226,562
別途積立金	24,580,000	24,580,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	6,696,350	19,146,562
株主資本計	53,452,601	65,902,812
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	517,864	795,002
評価・換算差額等計	517,864	795,002
純資産合計	53,970,465	66,697,815
負債・純資産合計	73,646,227	90,745,010

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	56,355,754	84,705,447
運用受託報酬	12,834,241	19,124,427
投資助言報酬	1,002,482	1,217,672
その他営業収益	378,715	117,586

	営業収益計		70,571,194		105,165,133
営業費用					
支払手数料		24,957,038		37,242,284	
広告宣伝費		838,356		379,873	
公告費		991		1,485	
調査費		15,105,578		23,944,438	
調査費		7,780,474		10,677,166	
委託調査費		7,325,104		13,267,272	
委託計算費		891,379		1,073,938	
営業雑経費		1,102,921		1,215,963	
通信費		51,523		48,704	
印刷費		926,453		947,411	
協会費		37,471		64,331	
諸会費		74		22,412	
支払販売手数料		87,399		133,104	
	営業費用計		42,896,265		63,857,984
一般管理費					
給料		8,517,089		11,304,873	
役員報酬		220,145		189,022	
給料・手当		7,485,027		9,565,921	
賞与		811,916		1,549,929	
交際費		66,813		58,863	
寄付金		13,467		5,150	
旅費交通費		297,237		395,605	
租税公課		430,779		625,498	
不動産賃借料		1,961,686		1,534,255	
退職給付費用		358,960		595,876	
固定資産減価償却費		825,593		1,226,472	
福利厚生費		39,792		49,797	
修繕費		27,435		4,620	
賞与引当金繰入額		1,432,264		1,393,911	
役員賞与引当金繰入額		27,495		49,986	
役員退職慰労金		63,072		-	
機器リース料		210		148	
事務委託費		1,530,113		3,037,804	
事務用消耗品費		127,265		144,804	
器具備品費		271,658		5,253	
諸経費		129,981		149,850	
	一般管理費計		16,120,918		20,582,772
営業利益			11,554,010		20,724,376

(単位：千円)

	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		537		1,430
受取配当金		51,036		74,278
時効成立分配金・償還金		103		256
為替差益		7,025		8,530
投資信託解約益		2		236,398
投資信託償還益		-		93,177
雑収入	1	18,213	1	10,306

時効後支払損引当金戻入額		-		17,429	
営業外収益計			76,918		441,807
営業外費用					
投資信託解約損		31,945		4,138	
投資信託償還損		47,201		17,065	
金銭の信託運用損		552,635		99,303	
時効成立後支払分配金・償還金		39		-	
時効後支払損引当金繰入額		209,210		-	
営業外費用計			841,031		120,507
経常利益			10,789,897		21,045,676
特別利益					
固定資産売却益	2	2,348		1	
投資有価証券売却益		-		479,323	
関係会社株式売却益	1	-		1,492,680	
貸倒引当金戻入益		8,883		-	
訴訟損失引当金戻入益		21,677		-	
本社移転費用引当金戻入額		-		138,294	
その他特別利益		746		350	
特別利益計			33,655		2,110,649
特別損失					
固定資産除却損	3	23,600		36,992	
固定資産売却損	4	10,323		134	
投資有価証券評価損		12,085		-	
ゴルフ会員権評価損		4,832		-	
訴訟和解金		30,000		-	
本社移転費用	5	1,511,622		-	
退職給付制度終了損		-		690,899	
システム移行損失		-		76,007	
その他特別損失		-		50	
特別損失計			1,592,463		804,083
税引前当期純利益			9,231,089		22,352,243
法人税、住民税及び事業税			2,965,061		6,951,863
法人税等調整額			177,275		249,832
法人税等合計			2,787,786		6,702,031
当期純利益			6,443,302		15,650,211

(3) 【株主資本等変動計算書】

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金			
					別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	2,428,478	-	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047
当期変動額									
剰余金の配当									2,544,000
別途積立金の 積立						2,550,000			2,550,000
当期純利益									6,443,302

合併による増加			17,124,479	17,124,479					
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	17,124,479	17,124,479	-	2,550,000	-	-	1,349,302
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775
当期変動額					
剰余金の配当	2,544,000	2,544,000			2,544,000
別途積立金の積立	-	-			-
当期純利益	6,443,302	6,443,302			6,443,302
合併による増加		17,124,479			17,124,479
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)		-	363,907	363,907	363,907
当期変動額合計	3,899,302	21,023,782	363,907	363,907	21,387,689
当期末残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465

第33期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金				利益剰余金			
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350
当期変動額									
剰余金の配当									3,200,000
当期純利益									15,650,211
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	-	12,450,211
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562

株主資本	評価・換算差額等
------	----------

	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産 合計
	利益剰余金 合計				
当期首残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465
当期変動額					
剰余金の配当	3,200,000	3,200,000			3,200,000
当期純利益	15,650,211	15,650,211			15,650,211
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)		-	277,137	277,137	277,137
当期変動額合計	12,450,211	12,450,211	277,137	277,137	12,727,349
当期末残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の際事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

会計上の見積りの変更

第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）
<p>当社は、当事業年度においてシステム統合計画を決定したことに伴い、利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。</p> <p>これにより、従来の方法と比べて、当事業年度末の減価償却費が413,260千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ同額減少しております。</p>

追加情報

第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）
<p>当社は、平成29年10月1日付で確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行したことにより、「退職給付制度間の移行等に関する会計処理」（企業会計基準適用指針第1号 平成28年12月16日）及び「退職給付制度間の移行等の会計処理に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第2号 平成19年2月7日）を適用し、確定給付年金制度の終了の処理を行いました。</p> <p>本移行に伴う影響額は、特別損失に退職給付制度終了損として690,899千円を計上しております。</p>

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
建物	53,098	140,580
器具備品	734,064	847,466

(損益計算書関係)

1. 関係会社に対する事項

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
雑収入	8,183	-
関係会社株式売却益	-	1,492,680

2. 固定資産売却益の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	546	-
車両運搬具	696	-
器具備品	1,104	1

3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	-	298
器具備品	4,727	8,217
ソフトウェア	2,821	28,472
電話加入権	16,052	3

4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	543	-
器具備品	9,779	134

5. 本社移転費用の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
本社移転費用引当金繰入額	942,315	-
旧本社不動産賃借料	418,583	-
賃貸借契約解約損	150,723	-

(株主資本等変動計算書関係)

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度 増加株式数（株）	当事業年度 減少株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
普通株式	24,000	490	-	24,490
A種種類株式	-	15,510	-	15,510
合計	24,000	16,000	-	40,000

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総 額（千円）	1株当たり配 当額（円）	基準日	効力発生日
平成29年6月21日 定時株主総会	普通 株式 A種種類 株式	利益 剰余金	3,200,000	80,000	平成29年3月31日	平成29年6月22日

第33期（自平成29年4月1日 至平成30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	24,490	-	-	24,490
A種種類株式	15,510	-	-	15,510
合計	40,000	-	-	40,000

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29年6月21日 定時株主総会	普通株式 A種種類 株式	3,200,000	80,000	平成29年3月31日	平成29年6月22日

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

平成30年6月20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30年6月20日 定時株主総会	普通株式 A種種類株式	利益 剰余金	12,520,000	313,000	平成30年3月31日	平成30年6月21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、短期的な預金等に限定しております。

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第32期（平成29年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）

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

第33期（平成30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	49,071,217	49,071,217	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	12,083,824	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	11,769,015	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	4,574,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	1,448,968	1,448,968	-
資産計	78,947,251	78,947,251	-
(1) 未払手数料	4,629,133	4,629,133	-
負債計	4,629,133	4,629,133	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
非上場株式	337,468	272,464
関係会社株式	3,306,296	3,229,196

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第32期(平成29年3月31日現在)

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

第33期(平成30年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	49,071,217	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	-	3,995	-	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第32期の貸借対照表計上額3,306,296千円、第33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。

2. その他有価証券

第32期(平成29年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	609,710	146,101	463,608
投資信託	2,384,278	2,091,387	292,891
小計	2,993,988	2,237,489	756,499
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	231,889	241,951	10,061
小計	231,889	241,951	10,061
合計	3,225,878	2,479,440	746,438

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額337,468千円)については、市場価格がなく、時価を把握すること

が極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第33期（平成30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	1,267,157	146,101	1,121,055
投資信託	177,815	153,000	24,815
小計	1,444,972	299,101	1,145,870
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,995	4,000	4
小計	3,995	4,000	4
合計	1,448,968	303,101	1,145,866

（注）非上場株式（貸借対照表計上額272,464千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

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

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

第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

区分	売却額 （千円）	売却益の合計額 （千円）	売却損の合計額 （千円）
株式	544,326	479,323	-
投資信託	2,480,288	329,576	21,204

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

4. 減損処理を行った有価証券

第32期において、有価証券について12,085千円（その他有価証券）減損処理を行っております。

第33期において、該当事項はありません。

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

なお、当社は平成29年10月1日付で、確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行するとともに、

退職一時金制度を改定しました。

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32期	第33期
	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,086,550	2,718,372
勤務費用	189,127	269,128
利息費用	10,905	7,523
数理計算上の差異の発生額	89,303	61,792
退職給付の支払額	144,062	111,758
合併による増加	1,486,547	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	-	1,316,796
退職一時金制度改定に伴う増加額	-	526,345
退職給付債務の期末残高	2,718,372	2,154,607

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第32期	第33期
	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
年金資産の期首残高	-	1,363,437
期待運用収益	16,033	17,042
数理計算上の差異の発生額	1,894	-
事業主からの拠出額	37,402	36,672
退職給付の支払額	28,876	-
合併による増加	1,336,984	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	-	1,417,152
年金資産の期末残高	1,363,437	-

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

(千円)

	第32期	第33期
	(平成29年3月31日現在)	(平成30年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	1,275,346	-
年金資産	1,363,437	-
	88,090	-
非積立型制度の退職給付債務	1,443,026	2,154,607
未積立退職給付債務	1,354,935	2,154,607
未認識数理計算上の差異	430,203	204,636
未認識過去勤務費用	4,852	312,836
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	919,879	1,637,133
退職給付引当金	1,245,019	1,637,133
前払年金費用	325,140	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	919,879	1,637,133

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
勤務費用	189,127	269,128
利息費用	10,905	7,523
期待運用収益	16,033	17,042
数理計算上の差異の費用処理額	78,229	88,417
過去勤務費用の費用処理額	4,852	39,611
退職一時金制度改定に伴う費用処理額	-	70,560
その他	7,498	1,620
確定給付制度に係る退職給付費用	274,580	456,577
制度移行に伴う損失(注)	-	690,899

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
株式	31.5%	-
債券	29.0%	-
共同運用資産	24.1%	-
生命保険一般勘定	10.5%	-
現金及び預金	4.6%	-
合計	100.0%	-

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
割引率	0.02% ~ 1.09%	0.09%
長期期待運用収益率	2.50%	-
予想昇給率	1.00% ~ 8.73%	1.00% ~ 4.42%

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	-	300,927
退職給付費用	22,562	53,156
退職給付の支払額	-	-
制度への拠出額	36,177	35,640
合併による増加	287,313	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	-	391,600
退職一時金制度改定に伴う振替額	-	108,189
退職給付引当金の期末残高	300,927	-

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

	(千円)	
	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	789,261	-
年金資産	1,150,443	-
	361,181	-
非積立型制度の退職給付債務	60,254	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	300,927	-
退職給付引当金	60,254	-
前払年金費用	361,181	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	300,927	-

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度 22,562千円 当事業年度53,156千円

4. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度61,817千円、当事業年度86,141千円であります。

(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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	124,081	290,493
未払事業所税	11,054	11,683
賞与引当金	441,996	426,815
未払法定福利費	84,152	81,186
資産除去債務	86,421	90,524
減価償却超過額（一括償却資産）	10,666	11,331
減価償却超過額	116,920	176,791
繰延資産償却超過額（税法上）	32,949	34,977
退職給付引当金	399,808	501,290
時効後支払損引当金	66,282	60,941
ゴルフ会員権評価損	14,295	13,173
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	69,683	28,976
未払給与	12,344	9,186
本社移転費用引当金	289,865	47,947
その他	14,309	29,193
繰延税金資産小計	1,941,573	1,981,254
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,941,573	1,981,254

繰延税金負債		
前払年金費用	210,151	-
その他有価証券評価差額金	159,429	281,720
繰延税金負債合計	369,581	281,720
繰延税金資産の純額	1,571,992	1,699,533

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

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率	50.00%
MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率	20.00%
MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率	70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成30年3月31日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212,500千円
取得原価		144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん	のれん	76,224,837千円
b. 発生原因	被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。	
c. のれんの償却方法及び償却期間	20年間の均等償却	

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額	資産合計	40,451,657千円
	うち現金・預金	11,605,537千円
	うち金銭の信託	11,792,364千円
b. 負債の額	負債合計	9,256,209千円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539,592千円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額		53,030,000千円
b. 主要な種類別の内訳		
	顧客関連資産	53,030,000千円
c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間		
	顧客関連資産	16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	114,270,495千円
資産合計	114,270,495千円

流動負債	- 千円
固定負債	13,059,836千円
負債合計	13,059,836千円
純資産	101,210,659千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額70,507,975千円及び顧客関連資産の金額45,200,838千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	9,012,128千円
経常利益	9,012,128千円
税引前当期純利益	9,012,128千円
当期純利益	7,419,617千円
1株当たり当期純利益	185,490円43銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額3,811,241千円及び顧客関連資産の償却額5,233,360千円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)及び第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	4,530,351	未払 手数料	767,732
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託 財産の運 用	信託元本の 払戻(純 額) 信託報酬の 支払	100,000 7,080	金銭の 信託	12,366,219
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	5,061,766	未払 手数料	1,166,212
	みずほ信 託銀行株 式会社	東京都 中央区	2,473 億円	信託銀 行業	-	-	投資一任 契約の締 結	運用受託報 酬の受取	2,520,431	未収運 用受託 報酬	2,722,066

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,470,802	未払 手数料	894,336
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	9,079,083	未払 手数料	1,549,208

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) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

(注3) 運用受託報酬は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

	第32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)	第33期 (自 平成29年4月 1日 至 平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	1,349,261円64銭	1,667,445円37銭
1株当たり当期純利益金額	201,491円22銭	391,255円29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32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)	第33期 (自 平成29年4月 1日 至 平成30年3月31日)
当期純利益金額	6,443,302千円	15,650,211千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	6,443,302千円	15,650,211千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	31,978株	40,000株
(うち普通株式)	(24,244株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(7,734株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品

取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2018年6月20日付で、総則の「目的」に関する事項の定款の変更を行いました。

委託会社は、株式会社みずほ銀行から、みずほグローバルオルタナティブインベストメンツ株式会社(以下「MGAI」といいます。)の発行済株式の全てについて2018年11月1日付で譲り受け、MGAIを100%子会社(新商号:アセットマネジメントOneオルタナティブインベストメンツ株式会社)としました。

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

- (1) 三井住友信託銀行株式会社(「受託者」)

a. 資本金の額

2018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2018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	300	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。

（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) 目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載する場合があります。また、以下の内容を記載することがあります。
 - ・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
 - ・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) 有価証券届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」に記載の内容について、投資家の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関する箇所に記載することがあります。また、第二部「ファンド情報」第1「ファンドの状況」5「運用状況」について、有価証券届出書提出後の随時入手可能な直近の情報および同情報についての表での表示に加えて、グラフで表示した情報を目論見書に記載することがあります。
- (3) 投資信託説明書(請求目論見書)に約款の全文を掲載します。
- (4) 目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (5) 目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成30年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の平成30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

（注2）XBRL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30年4月6日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニュー トピックス インデックスの平成29年2月23日から平成30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30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

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成30年10月5日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニュー トピックス インデックスの平成30年2月23日から平成30年8月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ニュー トピックス インデックスの平成30年8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中間計算期間(平成30年2月23日から平成30年8月22日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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