

## 【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】	2021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】	酒井 隆
【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】	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、2.2%（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。）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」<sup>1</sup>または「償還前乗り換え」<sup>2</sup>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】

2021年11月23日から2022年5月20日までです。(注)

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。

(注) 繰上償還(信託終了)が決定した場合には、購入の申込期間は2022年1月19日までとなります。繰上償還(信託終了)については(12)その他をご参照ください。

(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。

## < 繰上償還(信託終了)の予定について >

当ファンドは、信託契約を解約し、繰上償還(信託終了)するための手続きを行います。

### 1. 繰上償還(信託終了)を行う理由

当ファンドは1989年2月23日に設定し、主としてわが国の上場株式に実質的に投資を行い、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ってまいりました。しかしながら、2021年7月末時点の受益権口数が約5.4億口と信託約款に定める繰上償還(信託終了)の目安となる口数(10億口)を下回っているため、信託約款の規定に基づき繰上償還(信託終了)する予定です。

### 2. 繰上償還(信託終了)までの主な日程

異議申立期間	2021年11月24日から2022年1月4日まで
繰上償還(信託終了)予定日	2022年2月22日

### 3. 異議申立てについて

- ・ 公告日(2021年11月24日)現在の当ファンドの受益者(2021年11月22日までに取得のお申込みをなされた方)で、繰上償還(信託終了)にご異議のある受益者の方は、異議申立期間中に、アセットマネジメントOne株式会社に対して書面をもって異議を申し立てることができます。

(注) 2021年11月23日以降のお申込みにより取得された受益権については、当該繰上償還(信託終了)に関する異議を申し立てる権利はございません。

- ・ 当ファンドの繰上償還(信託終了)に対し、ご異議を申し立てられた受益者の方の受益権口数が、2021年11月24日現在の当該信託契約にかかる受益権総口数の2分の1を超えない場合は、2022年2月22日をもって繰上償還を行います。なお、当該受益権口数が受益権総口数の2分の1を超えた場合には、繰上償還を行いません。

繰上償還(信託終了)にかかる異議申立ての結果は、2022年1月5日以降、委託会社のホームページ(<http://www.am-one.co.jp/>)でご覧いただくか、委託会社または販売会社へお問い合わせいただければご確認いただけます。

## 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	<b>年1回</b>	グローバル		
一般				
大型株	年2回	<b>日本</b>		日経225
中小型株	年4回	北米		
債券			<b>ファミリーファンド</b>	
一般	年6回（隔月）	欧州		<b>TOPIX</b>
公債				
社債	年12回（毎月）	アジア		
その他債券				
クレジット属性 （ ）	日々	オセアニア		
	その他（ ）	中南米		その他 （ ）
不動産投信		アフリカ		
<b>その他資産</b>				
<b>（投資信託証券</b>		中近東（中東）		
<b>（株式 一般）</b>			<b>ファンド・オブ・ファンズ</b>	
		エマージング		
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（<https://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。

※詳しくは後述の「ファンドの仕組み」をご覧ください。

●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

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

#### ・基準時の時価総額の修正方法

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

※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。

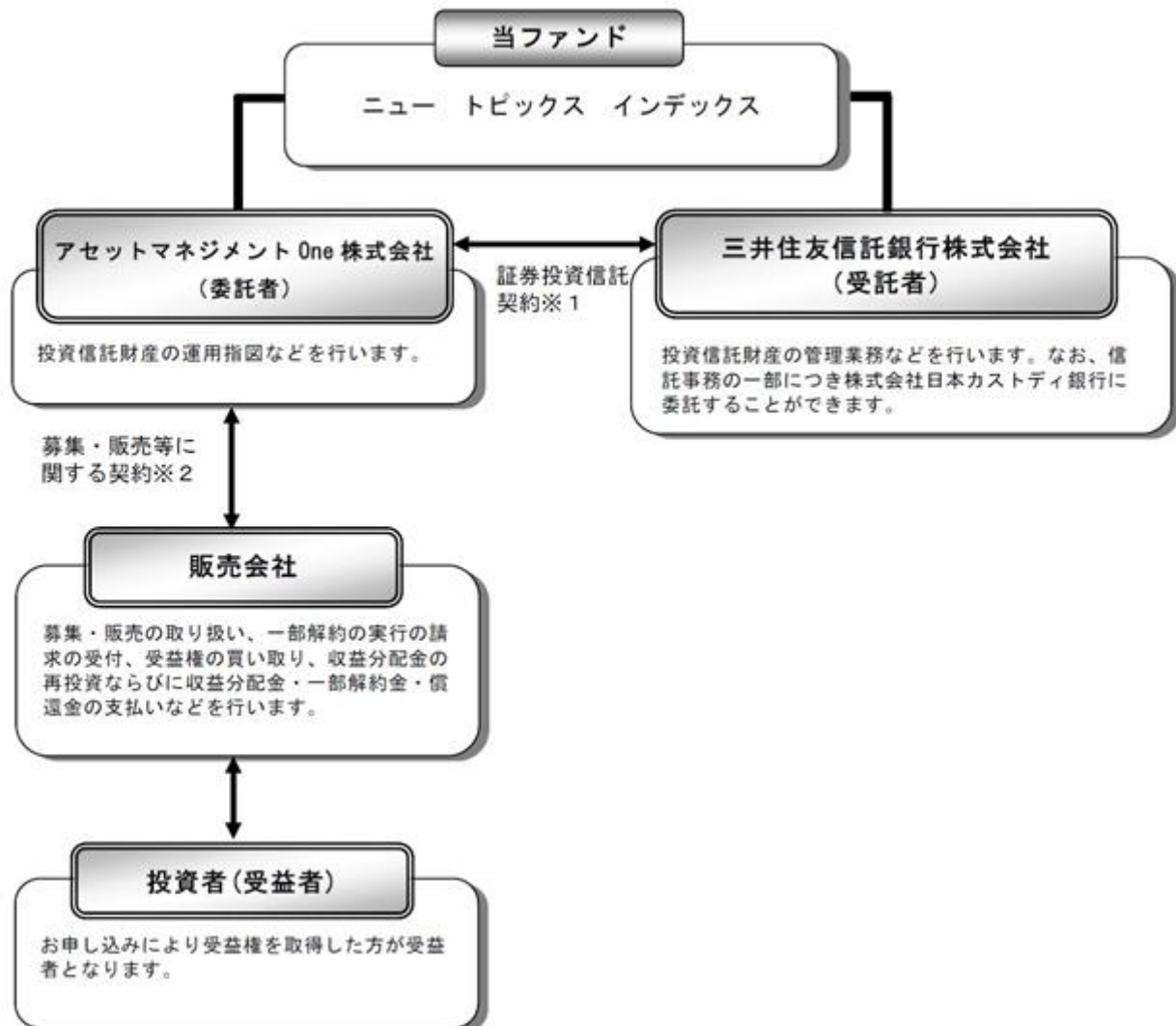
※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

### (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

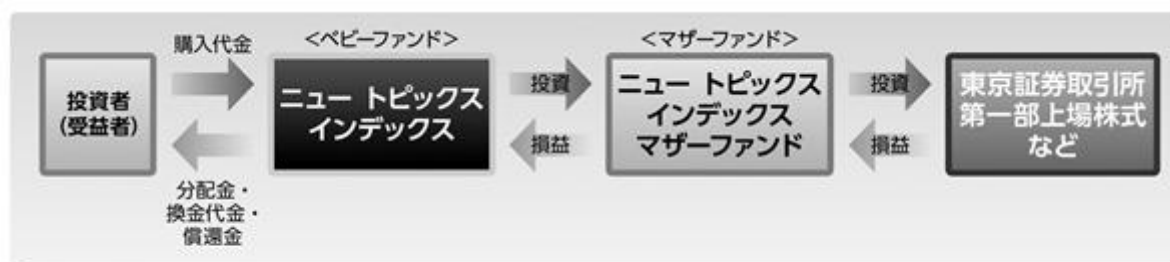
委託者と受託者との間において「証券投資信託契約（投資信託約款）」を締結しており、委託者および受託者の業務、受益者の権利、受益権、投資信託財産の運用・評価・管理、収益の分配、信託の期間・償還等を規定しています。

## 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（2021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 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 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。
1998年12月1日	
1999年10月1日	
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

（2021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 <sup>1</sup>	70.0% <sup>2</sup>
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% <sup>2</sup>

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## 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。

(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。

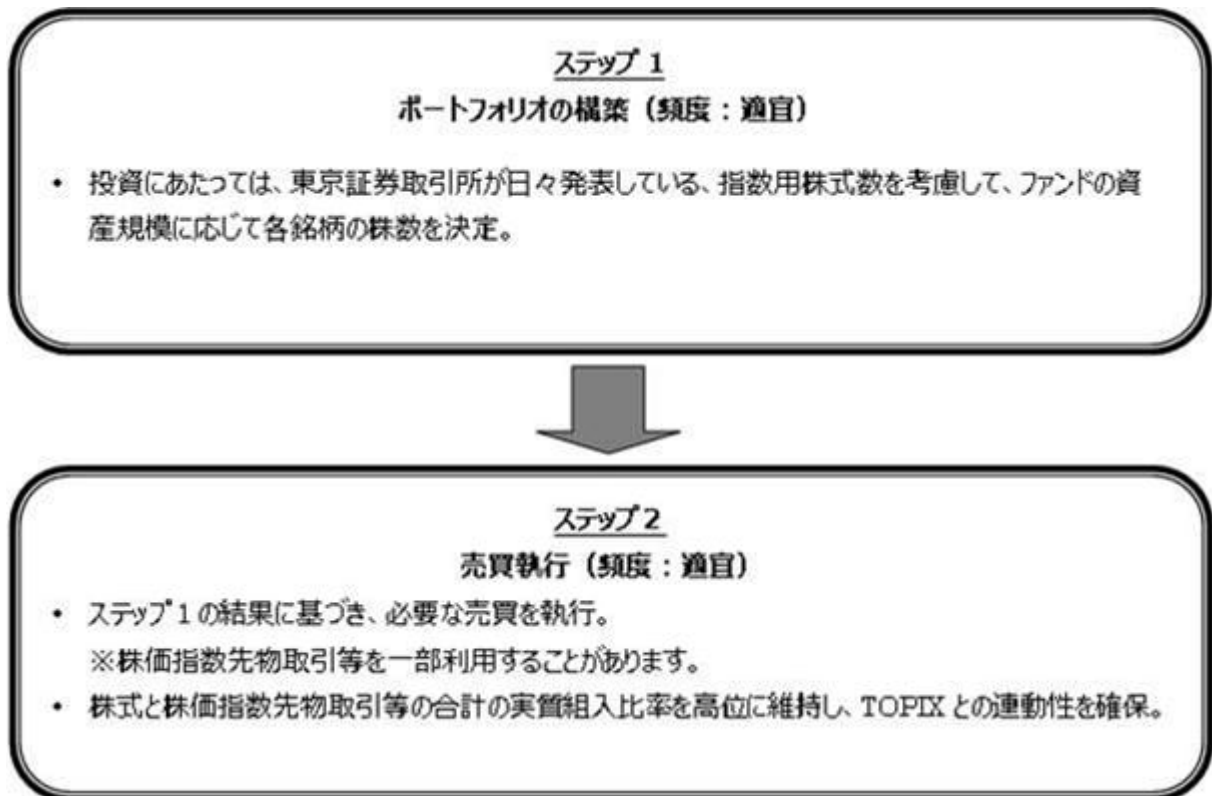
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

#### 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。



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2021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ません。）をもってマザーファンドの受益証券へ投資することを指図することができます。ただし、余裕金については、預金、指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）、コール・ローン、手形割引市場において売買される手形、貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるものにより運用することの指図ができます。

- 1．株券、新株引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券
- 2．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 3．外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の証券の性質を有するもの
- 4．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、第1号の証券または証書を以下「株式」といいます。

b. 先物

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

1. 先物取引の売り建ておよびコール・オプションの売り付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます)の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買い建ておよびプット・オプションの売り付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)を限度とし、余裕金ならびに当日の取得申込口数が一部解約の実行の請求にかかる口数を上回る口数に相当する金額であると委託者において判断した額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買い付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の投資信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

1. 先物取引の売り建ておよびコール・オプションの売り付けの指図は、建玉の合計額がヘッジ対象とする金利商品(以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買い建ておよびプット・オプションの売り付けの指図は、建玉の合計額が、余裕金の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買い付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の投資信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

c. スワップ

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

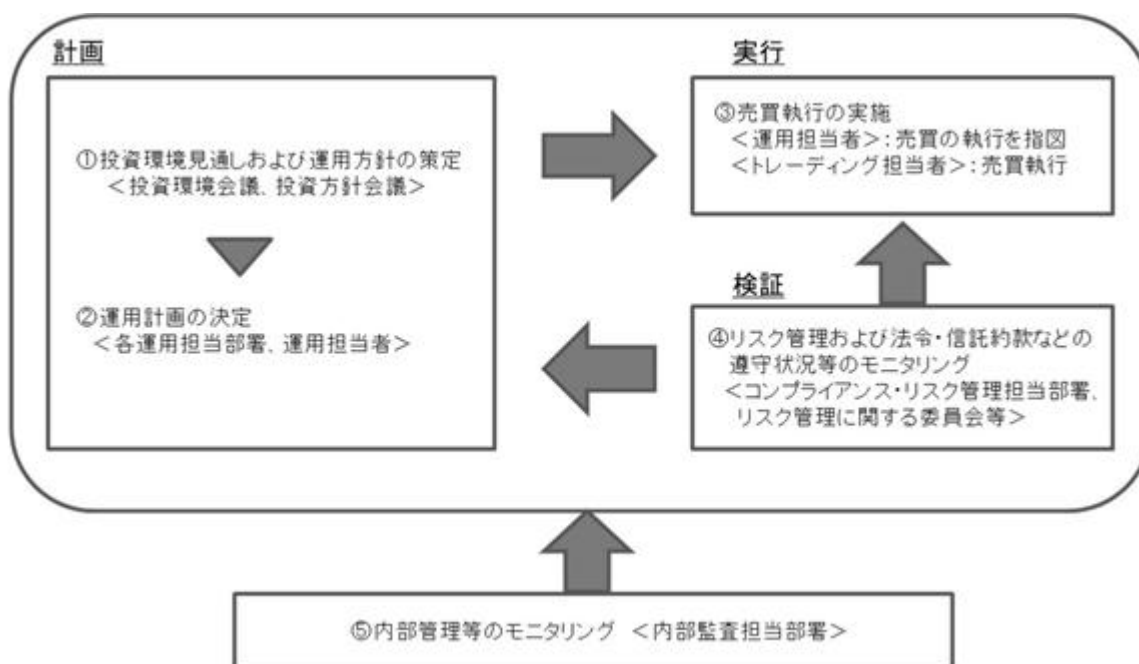
(ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。



- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記（ハ）において投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ヘ) 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとします。

### (3) 【運用体制】

#### 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。

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

#### 内部管理等のモニタリング

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

#### b．ファンドの関係法人に関する管理

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

#### c．運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2021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. 資金の借入れ
- (イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、投資信託財産において一部解約金の支払資金に不足額が生じるときは、資金借入れの指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受け取りの確定している資金の額の範囲内。
  2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内。
  3. 借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%以内。
- (ハ) 借入期間は、有価証券等の売却代金の入金日までに限るものとします。
- (ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

h . 受託者の自己または利害関係人等との取引

(イ) 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、受託者および受託者の利害関係人、信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の投資信託財産との間で、約款に定める範囲内の資産への投資を、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

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

投資する有価証券の発行者の財政難・経営不安・倒産等の発生は、基準価額の下落要因となります。

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

投資資産の市場規模が小さいことなどで希望する価格で売買できない場合は、基準価額の下落要因となります。

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．基準価額と東証株価指数のかい離

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

- ・ 信託報酬などの管理費用および株式売買委託手数料などの取引コストの負担
- ・ 東証株価指数の対象銘柄を当ファンドが全て組み入れているものではないことや当ファンドの先物取引の利用により、当ファンドと東証株価指数の構成に違いがあることによるもの
- ・ 東証株価指数と先物価格の連動性の差によるもの
- ・ 東証株価指数の算出株価と当ファンドの株式売買時の約定価格との差によるもの
- ・ 解約資金などに対応するため、当ファンドが現金を保有していることによるもの

e．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る有価証券などに売買が生じた場合、その売買による組入る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。

f．投資信託に関する一般的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。

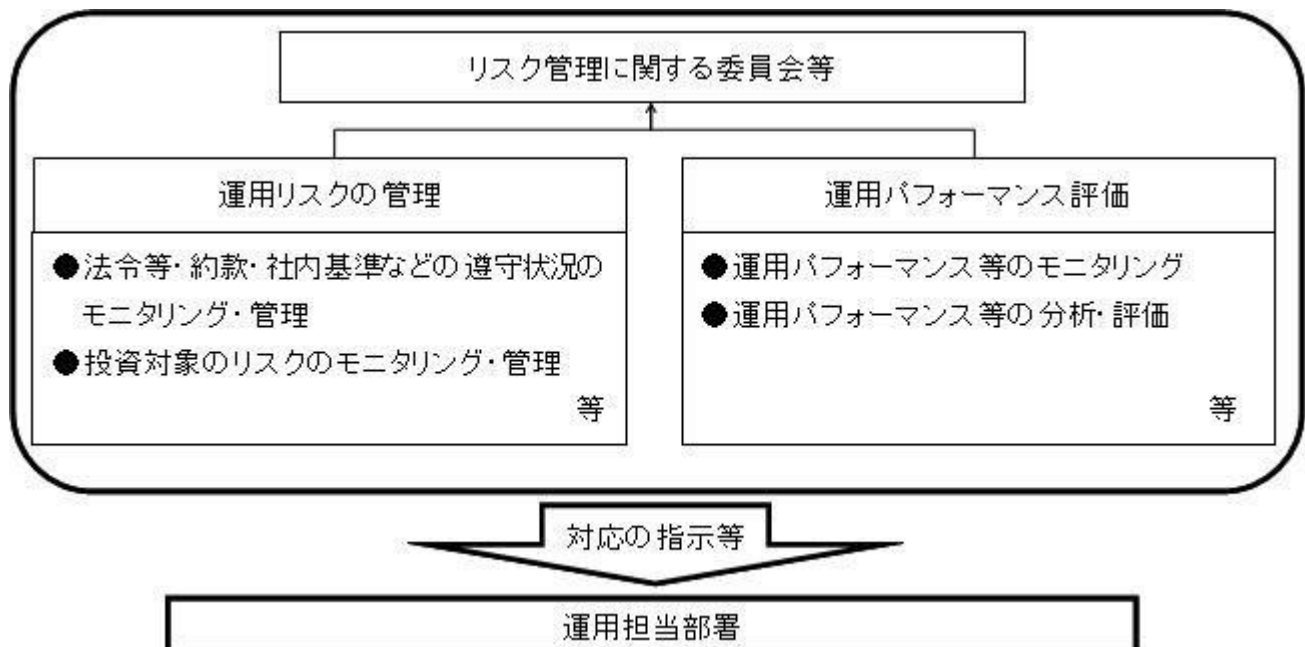
また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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が小さかった場合も同様です。

## (2) リスク管理体制

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

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



リスク管理体制は2021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。

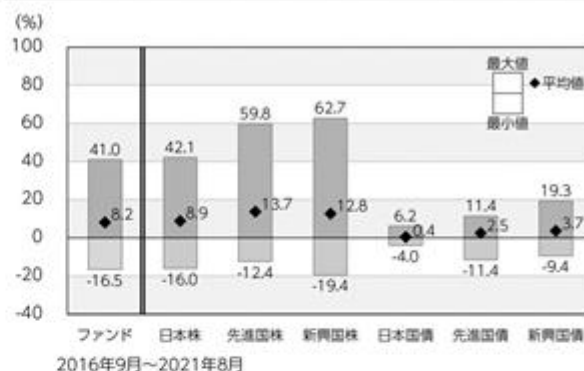


## <参考情報>

### 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



### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

\*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

\*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) <sup>*</sup> (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「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。
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)	「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。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「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。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(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、東証市場再編に伴い、2022年4月4日付で指数の算出要領が変更される予定です。

#### 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、2.2%（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」<sup>1</sup>または「償還前乗り換え」<sup>2</sup>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0.66% (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(ファンドの基準価額に反映)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信託報酬にかかる消費税等に相当する金額とともにファンドから支払われます。

2021年11月22日現在は、年率0.66% (税抜0.6%) になります。配分は以下の通りです。

支払先	内訳(税抜)	主な役務
委託会社	年率0.25%	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。

監査報酬は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)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当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額とともに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。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は、2021年8月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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】

2021年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	518,633,322	99.98
内 日本	518,633,322	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	84,040	0.02
純資産総額	518,717,362	100.00

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

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

(参考)

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

2021年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	2,424,180,850	96.20
内 日本	2,424,180,850	96.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	95,779,005	3.80
純資産総額	2,519,959,855	100.00

その他資産の投資状況

2021年8月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	78,580,000	3.12
内 日本	78,580,000	3.12

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

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

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

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

2021年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	ニュー トピックス イン デックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	189,075,218	2.6791 506,551,441	2.7430 518,633,322	- -	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年8月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.98
合計	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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

2021年8月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	9,200	7,884.64 72,538,700	9,592.00 88,246,400	- -	3.50
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	5,700	10,751.78 61,285,160	11,360.00 64,752,000	- -	2.57
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	900	57,700.00 51,930,000	66,130.00 59,517,000	- -	2.36
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	7,100	8,521.64 60,503,668	6,181.00 43,885,100	- -	1.74
5	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	6,200	4,587.12 28,440,200	6,500.00 40,300,000	- -	1.60
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	61,300	502.77 30,820,145	594.40 36,436,720	- -	1.45
7	ダイキン工業 日本	株式 機械	1,200	23,795.00 28,554,000	27,405.00 32,886,000	- -	1.31
8	HOYA 日本	株式 精密機器	1,800	13,920.00 25,056,000	17,780.00 32,004,000	- -	1.27
9	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	10,400	2,767.14 28,778,291	2,936.00 30,534,400	- -	1.21
10	信越化学工業 日本	株式 化学	1,600	19,061.94 30,499,106	18,205.00 29,128,000	- -	1.16
11	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	7,600	3,692.06 28,059,684	3,679.00 27,960,400	- -	1.11
12	日本電産 日本	株式 電気機器	2,200	14,050.00 30,910,000	12,620.00 27,764,000	- -	1.10
13	日立製作所 日本	株式 電気機器	4,400	4,388.19 19,308,043	6,085.00 26,774,000	- -	1.06
14	任天堂 日本	株式 その他製品	500	65,810.00 32,905,000	52,900.00 26,450,000	- -	1.05
15	村田製作所 日本	株式 電気機器	2,700	10,255.00 27,688,500	9,119.00 24,621,300	- -	0.98
16	KDDI 日本	株式 情報・通信業	7,200	3,239.13 23,321,800	3,370.00 24,264,000	- -	0.96
17	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	7,200	2,934.66 21,129,596	3,342.00 24,062,400	- -	0.95

18	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	500	42,250.00 21,125,000	47,240.00 23,620,000	- -	0.94
19	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	6,200	3,544.67 21,976,956	3,801.00 23,566,200	- -	0.94
20	S M C 日本	株式 機械	300	69,180.00 20,754,000	70,510.00 21,153,000	- -	0.84
21	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	6,300	3,138.32 19,771,476	3,311.00 20,859,300	- -	0.83
22	ファナック 日本	株式 電気機器	800	27,675.00 22,140,000	23,990.00 19,192,000	- -	0.76
23	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	12,200	1,439.97 17,567,649	1,543.00 18,824,600	- -	0.75
24	第一三共 日本	株式 医薬品	7,100	3,596.83 25,537,550	2,614.50 18,562,950	- -	0.74
25	三菱商事 日本	株式 卸売業	5,500	2,698.00 14,839,000	3,311.00 18,210,500	- -	0.72
26	三井物産 日本	株式 卸売業	7,100	2,014.98 14,306,400	2,429.00 17,245,900	- -	0.68
27	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	3,500	3,955.35 13,843,730	4,815.00 16,852,500	- -	0.67
28	富士通 日本	株式 電気機器	800	16,020.00 12,816,000	20,300.00 16,240,000	- -	0.64
29	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	3,000	5,643.00 16,929,000	5,377.00 16,131,000	- -	0.64
30	デンソー 日本	株式 輸送用機器	2,000	5,932.00 11,864,000	7,710.00 15,420,000	- -	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。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2021年8月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	96.20
合計	96.20

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

2021年8月31日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	17.71
情報・通信業		8.00
輸送用機器		7.54
化学		6.88
サービス業		5.67
機械		5.49
医薬品		5.10
銀行業		4.75
卸売業		4.62



小売業	4.22
食料品	3.36
陸運業	3.13
精密機器	2.94
建設業	2.17
その他製品	2.11
保険業	1.88
不動産業	1.85
電気・ガス業	1.12
その他金融業	1.07
鉄鋼	0.85
ガラス・土石製品	0.72
証券、商品先物取引業	0.71
ゴム製品	0.69
非鉄金属	0.64
金属製品	0.59
海運業	0.50
繊維製品	0.44
空運業	0.43
石油・石炭製品	0.38
パルプ・紙	0.23
鉱業	0.18
倉庫・運輸関連業	0.16
水産・農林業	0.08
合計	96.20

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(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】

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

2021年8月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0309月	買建	4	77,261,320	78,580,000	3.12

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

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

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日(2021年8月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第23計算期間末 (2012年 2月22日)	593	593	0.3475	0.3475
第24計算期間末 (2013年 2月22日)	642	642	0.4127	0.4127
第25計算期間末 (2014年 2月24日)	730	730	0.5277	0.5277
第26計算期間末 (2015年 2月23日)	760	761	0.6577	0.6587
第27計算期間末 (2016年 2月22日)	578	578	0.5760	0.5760
第28計算期間末 (2017年 2月22日)	634	634	0.7003	0.7003
第29計算期間末 (2018年 2月22日)	613	613	0.7956	0.7956
第30計算期間末 (2019年 2月22日)	528	528	0.7448	0.7448
第31計算期間末 (2020年2月25日)	507	507	0.7630	0.7630
第32計算期間末 (2021年2月22日)	527	527	0.9300	0.9300
2020年8月末日	490	-	0.7711	-
9月末日	492	-	0.7802	-
10月末日	477	-	0.7576	-
11月末日	515	-	0.8417	-
12月末日	517	-	0.8665	-
2021年1月末日	515	-	0.8677	-
2月末日	506	-	0.8948	-
3月末日	528	-	0.9455	-
4月末日	508	-	0.9182	-
5月末日	513	-	0.9303	-
6月末日	518	-	0.9408	-
7月末日	504	-	0.9200	-
8月末日	518	-	0.9489	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第23計算期間	0.0000
第24計算期間	0.0000
第25計算期間	0.0000
第26計算期間	0.0010
第27計算期間	0.0000
第28計算期間	0.0000

第29計算期間	0.0000
第30計算期間	0.0000
第31計算期間	0.0000
第32計算期間	0.0000
2021年2月23日～2021年8月22日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第23計算期間	12.3
第24計算期間	18.8
第25計算期間	27.9
第26計算期間	24.8
第27計算期間	12.4
第28計算期間	21.6
第29計算期間	13.6
第30計算期間	6.4
第31計算期間	2.4
第32計算期間	21.9
2021年2月23日～2021年8月22日	2.1

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

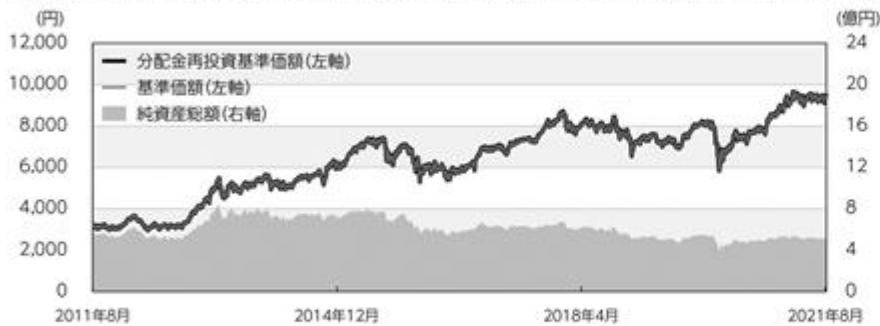
	設定口数	解約口数
第23計算期間	81,892,544	207,598,548
第24計算期間	40,997,313	190,689,671
第25計算期間	49,584,949	222,018,834
第26計算期間	51,024,990	279,051,207
第27計算期間	58,656,483	211,490,952
第28計算期間	36,193	97,137,242
第29計算期間	339,000	135,926,251
第30計算期間	1,897,256	63,352,275
第31計算期間	664,049	45,407,401
第32計算期間	834,462	98,576,559
2021年2月23日～ 2021年8月22日	0	20,342,613

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

## 参考情報

データの基準日:2021年8月31日

## 基準価額・純資産の推移 (2011年8月31日～2021年8月31日)



## 分配の推移 (税引前)

年月	分配額 (円)
2017年 2月	0円
2018年 2月	0円
2019年 2月	0円
2020年 2月	0円
2021年 2月	0円
直近10年間累計	10円

※分配金は1万口当たりです。

※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日:1989年2月23日)

## 主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	ニュートピックス インデックス マザーファンド	99.98

## ■ニュートピックス インデックス マザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。資産の種類の内書は、国/地域を表します。

## 資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	96.20
内 日本	96.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3.80
合計(純資産総額)	100.00

## その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	3.12

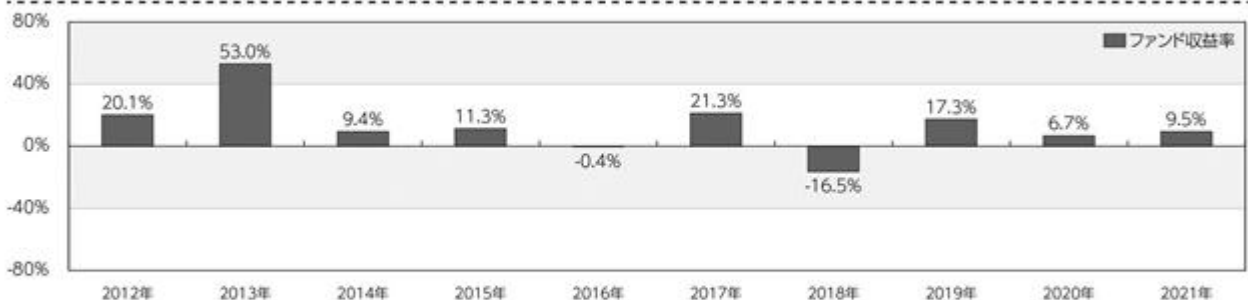
## 株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	17.71
2	情報・通信業	8.00
3	輸送用機器	7.54
4	化学	6.88
5	サービス業	5.67

## 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.50
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.57
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	2.36
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.74
5	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.60
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.45
7	ダイキン工業	株式	日本	機械	1.31
8	HOYA	株式	日本	精密機器	1.27
9	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.21
10	信越化学工業	株式	日本	化学	1.16

## 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。

※2021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。

○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。（注）

（注）繰上償還（信託終了）が決定した場合には、信託期間は2022年2月22日までとなります。

#### (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株式会社日本カストディ銀行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)における株式会社日本カストディ銀行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せん。）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)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32期計算期間(2020年2月26日から2021年2月22日まで)の財務諸表について、EY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31期 2020年2月25日現在	第32期 2021年2月22日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,852,148	1,732,876
親投資信託受益証券	507,259,961	527,423,387
流動資産合計	509,112,109	529,156,263
資産合計	509,112,109	529,156,263
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	296,819	276,733
未払委託者報酬	1,484,282	1,383,875
その他未払費用	4,345	3,852
流動負債合計	1,785,446	1,664,460
負債合計	1,785,446	1,664,460
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	664,937,247	567,195,150
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	157,610,584	39,703,347
(分配準備積立金)	176,271,085	226,570,759
元本等合計	507,326,663	527,491,803
純資産合計	507,326,663	527,491,803
負債純資産合計	509,112,109	529,156,263

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第31期 自 2019年2月23日 至 2020年2月25日	第32期 自 2020年2月26日 至 2021年2月22日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	16,463,953	104,336,426
<b>営業収益合計</b>	<b>16,463,953</b>	<b>104,336,426</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	508	106
受託者報酬	571,098	530,850
委託者報酬	2,855,623	2,654,648
その他費用	8,444	7,419
<b>営業費用合計</b>	<b>3,435,673</b>	<b>3,193,023</b>
営業利益又は営業損失( )	13,028,280	101,143,403
経常利益又は経常損失( )	13,028,280	101,143,403
当期純利益又は当期純損失( )	13,028,280	101,143,403
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	970,754	6,311,369
期首剰余金又は期首欠損金( )	181,081,020	157,610,584
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>11,586,754</b>	<b>23,381,274</b>
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,586,754	23,381,274
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	173,844	306,071
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	173,844	306,071
<b>分配金</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
期末剰余金又は期末欠損金( )	157,610,584	39,703,347

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第32期	
	自 2020年2月26日	至 2021年2月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月22日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2020年2月25日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第31期	第32期
	2020年2月25日現在	2021年2月22日現在
1. 期首元本額	709,680,599円	664,937,247円
期中追加設定元本額	664,049円	834,462円
期中一部解約元本額	45,407,401円	98,576,559円
2. 受益権の総数	664,937,247口	567,195,150口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は157,610,584円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は39,703,347円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第31期	第32期
	自 2019年2月23日 至 2020年2月25日	自 2020年2月26日 至 2021年2月22日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(85,644,300円)及び分配準備積立金(176,271,085円)より分配対象収益は261,915,385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。	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、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(76,400,978円)、信託約款に規定される収益調整金(73,244,895円)及び分配準備積立金(150,169,781円)より分配対象収益は299,815,654円(1万口当たり5,285.93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)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第31期	第32期
	自 2019年2月23日 至 2020年2月25日	自 2020年2月26日 至 2021年2月22日

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第31期 2020年2月25日現在	第32期 2021年2月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左



3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	---	----

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第31期 2020年2月25日現在	第32期 2021年2月22日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	15,290,035	97,643,653
合計	15,290,035	97,643,653

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第31期 2020年2月25日現在	第32期 2021年2月22日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7630円 (7,630円)	0.9300円 (9,300円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2021年2月22日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	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	196,865,883	527,423,387	
親投資信託受益証券	合計	196,865,883	527,423,387	
合計			527,423,387	

（注）親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券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、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

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)

2021年2月22日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	49,569,101
株式	2,495,973,460
派生商品評価勘定	3,649,340
未収配当金	3,504,628
差入委託証拠金	1,920,000
流動資産合計	2,554,616,529
資産合計	2,554,616,529
負債の部	
流動負債	
前受金	3,460,000
流動負債合計	3,460,000
負債合計	3,460,000
純資産の部	
元本等	
元本	952,244,011
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,598,912,518
元本等合計	2,551,156,529
純資産合計	2,551,156,529
負債純資産合計	2,554,616,529

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年2月26日 至 2021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、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2021年2月22日現在
1. 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	1,173,214,663円
同期中追加設定元本額	157,776,780円
同期中一部解約元本額	378,747,432円
元本の内訳	
ファンド名	
ニュー トピックス インデックス	196,865,883円
新光7資産バランスファンド	239,469,774円
ニュー トピックス インデックス(変額年金)	66,801,635円
世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	357,787,811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)	17,489,718円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	28,817,719円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	10,860,860円
グローバル・ナビ	16,145,111円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	4,427,984円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	12,292,457円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	1,285,059円
計	952,244,011円
2. 受益権の総数	952,244,011口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年2月26日 至 2021年2月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年2月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2021年2月22日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	85,469,422
合計	85,469,422

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2021年1月15日から2021年2月22日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	2021年2月22日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	35,140,000	-	38,790,000	3,650,000
合計	35,140,000	-	38,790,000	3,650,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

1. 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2021年2月22日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6791円 (26,791円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年2月22日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
日本水産	1,200	502.00	602,400	
マルハニチロ	200	2,480.00	496,000	
雪国まいたけ	100	1,768.00	176,800	
サカタのタネ	200	3,880.00	776,000	
ホクト	100	2,145.00	214,500	
ショーボンドホールディングス	200	4,730.00	946,000	
ミライト・ホールディングス	400	1,712.00	684,800	
タマホーム	100	1,898.00	189,800	
日本アクア	100	632.00	63,200	
TATERU	200	179.00	35,800	
スペースバリューホールディングス	200	814.00	162,800	
住石ホールディングス	200	124.00	24,800	
三井松島ホールディングス	100	932.00	93,200	
国際石油開発帝石	4,700	776.00	3,647,200	
石油資源開発	200	2,239.00	447,800	
K&Oエナジーグループ	100	1,464.00	146,400	
安藤・間	800	782.00	625,600	
東急建設	400	544.00	217,600	
コムシスホールディングス	500	3,250.00	1,625,000	
ピーアールホールディングス	200	684.00	136,800	
高松コンストラクショングループ	100	2,127.00	212,700	

ヤマウラ	100	953.00	95,300	
大成建設	900	3,790.00	3,411,000	
大林組	3,000	936.00	2,808,000	
清水建設	2,800	817.00	2,287,600	
飛鳥建設	100	1,119.00	111,900	
長谷工コーポレーション	1,000	1,354.00	1,354,000	
松井建設	100	716.00	71,600	
鹿島建設	2,200	1,421.00	3,126,200	
不動テトラ	100	1,805.00	180,500	
鉄建建設	100	1,966.00	196,600	
西松建設	200	2,596.00	519,200	
三井住友建設	700	460.00	322,000	
大豊建設	100	3,680.00	368,000	
前田建設工業	700	998.00	698,600	
佐田建設	100	427.00	42,700	
ナカノフドー建設	100	371.00	37,100	
奥村組	200	2,682.00	536,400	
東鉄工業	100	2,648.00	264,800	
戸田建設	1,200	743.00	891,600	
熊谷組	100	2,800.00	280,000	
矢作建設工業	100	847.00	84,700	
ピーエス三菱	100	685.00	68,500	
日本ハウスホールディングス	200	336.00	67,200	
大東建託	300	12,350.00	3,705,000	
新日本建設	100	846.00	84,600	
N I P P O	200	2,832.00	566,400	
前田道路	200	2,003.00	400,600	
東亜建設工業	100	2,170.00	217,000	
日本国土開発	300	558.00	167,400	
若築建設	100	1,277.00	127,700	
東洋建設	300	553.00	165,900	
五洋建設	1,300	795.00	1,033,500	
世紀東急工業	100	890.00	89,000	
住友林業	700	2,099.00	1,469,300	
日本基礎技術	100	498.00	49,800	
巴コーポレーション	100	397.00	39,700	
大和ハウス工業	2,700	3,200.00	8,640,000	
ライト工業	200	1,647.00	329,400	
積水ハウス	3,200	2,081.00	6,659,200	
日特建設	100	785.00	78,500	
北陸電気工事	100	1,192.00	119,200	
ユアテック	200	816.00	163,200	
日本リーテック	100	2,494.00	249,400	
中電工	100	2,211.00	221,100	
関電工	500	884.00	442,000	
きんでん	600	1,776.00	1,065,600	
東京エネシス	100	918.00	91,800	
住友電設	100	2,434.00	243,400	
日本電設工業	200	1,932.00	386,400	
協和エクシオ	500	2,722.00	1,361,000	

新日本空調	100	2,270.00	227,000	
日本工営	100	2,891.00	289,100	
九電工	200	3,390.00	678,000	
三機工業	200	1,296.00	259,200	
日揮ホールディングス	1,000	1,355.00	1,355,000	
ヤマト	100	669.00	66,900	
太平電業	100	2,663.00	266,300	
高砂熱学工業	300	1,596.00	478,800	
NECネットエスアイ	300	1,889.00	566,700	
明星工業	200	806.00	161,200	
大気社	100	2,947.00	294,700	
ダイダン	100	2,809.00	280,900	
日比谷総合設備	100	1,878.00	187,800	
ニッポン	300	1,609.00	482,700	
日清製粉グループ本社	1,100	1,727.00	1,899,700	
昭和産業	100	3,245.00	324,500	
鳥越製粉	100	859.00	85,900	
中部飼料	100	1,443.00	144,300	
フィード・ワン	100	914.00	91,400	
三井製糖	100	1,938.00	193,800	
塩水港精糖	100	228.00	22,800	
LIFULL	300	422.00	126,600	
ミクシィ	200	2,747.00	549,400	
ジェイエイシーリクルートメント	100	1,665.00	166,500	
日本M&Aセンター	700	6,090.00	4,263,000	
UTグループ	100	3,285.00	328,500	
タケエイ	100	1,272.00	127,200	
ビーネックスグループ	100	1,407.00	140,700	
コシダカホールディングス	200	551.00	110,200	
パソナグループ	100	1,923.00	192,300	
リンクアンドモチベーション	200	531.00	106,200	
GCA	100	796.00	79,600	
エス・エム・エス	300	3,700.00	1,110,000	
パーソルホールディングス	900	2,169.00	1,952,100	
リニカル	100	792.00	79,200	
クックパッド	300	311.00	93,300	
森永製菓	200	3,980.00	796,000	
江崎グリコ	300	4,480.00	1,344,000	
井村屋グループ	100	2,516.00	251,600	
不二家	100	2,278.00	227,800	
山崎製パン	700	1,887.00	1,320,900	
亀田製菓	100	4,810.00	481,000	
寿スピリッツ	100	6,820.00	682,000	
カルビー	400	2,903.00	1,161,200	
森永乳業	200	4,830.00	966,000	
六甲バター	100	1,738.00	173,800	
ヤクルト本社	700	5,530.00	3,871,000	
明治ホールディングス	600	6,970.00	4,182,000	
雪印メグミルク	200	2,189.00	437,800	
プリマハム	100	3,340.00	334,000	



日本ハム	400	4,665.00	1,866,000
丸大食品	100	1,698.00	169,800
S Foods	100	3,465.00	346,500
伊藤ハム米久ホールディングス	600	745.00	447,000
システナ	300	1,947.00	584,100
デジタルアーツ	100	10,990.00	1,099,000
日鉄ソリューションズ	100	3,225.00	322,500
総合警備保障	400	4,970.00	1,988,000
いちご	1,000	338.00	338,000
日本駐車場開発	900	142.00	127,800
カカクコム	700	3,530.00	2,471,000
セントケア・ホールディング	100	940.00	94,000
ルネサンス	100	1,174.00	117,400
ディップ	100	3,025.00	302,500
SBSホールディングス	100	2,541.00	254,100
デジタルホールディングス	100	1,971.00	197,100
新日本科学	100	650.00	65,000
ツクイホールディングス	200	924.00	184,800
ベネフィット・ワン	300	2,931.00	879,300
エムスリー	1,600	8,800.00	14,080,000
ツカダ・グローバルホールディング	100	354.00	35,400
アウトソーシング	500	1,483.00	741,500
ウェルネット	100	529.00	52,900
ディー・エヌ・エー	400	2,253.00	901,200
博報堂DYホールディングス	1,300	1,818.00	2,363,400
ぐるなび	200	637.00	127,400
タカミヤ	100	510.00	51,000
ジャパンベストレスキューシステム	100	886.00	88,600
ファンコミュニケーションズ	200	406.00	81,200
エスプール	200	1,018.00	203,600
ティア	100	529.00	52,900
バリューコマース	100	3,080.00	308,000
インフォマート	900	1,048.00	943,200
サッポロホールディングス	300	2,244.00	673,200
アサヒグループホールディングス	2,100	4,548.00	9,550,800
キリンホールディングス	4,000	2,115.00	8,460,000
宝ホールディングス	700	1,499.00	1,049,300
オエノンホールディングス	300	400.00	120,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	700	1,832.00	1,282,400
サントリー食品インターナショナル	600	3,770.00	2,262,000
ガイドグループホールディングス	100	5,410.00	541,000
伊藤園	300	6,310.00	1,893,000
キーコーヒー	100	2,157.00	215,700
日清オイリオグループ	100	3,195.00	319,500
不二製油グループ本社	200	3,190.00	638,000
ローソン	200	5,150.00	1,030,000
サンエー	100	4,220.00	422,000
カワチ薬品	100	2,974.00	297,400
エービーシー・マート	100	6,130.00	613,000

アスクル	100	3,735.00	373,500	
ゲオホールディングス	100	1,172.00	117,200	
アダストリア	100	2,056.00	205,600	
ジーフット	100	419.00	41,900	
くら寿司	100	7,640.00	764,000	
エレマテック	100	988.00	98,800	
パルグループホールディングス	100	1,640.00	164,000	
エディオン	400	1,076.00	430,400	
あらた	100	4,635.00	463,500	
サーラコーポレーション	200	584.00	116,800	
J Pホールディングス	300	293.00	87,900	
フジオフードグループ本社	100	1,296.00	129,600	
ひらまつ	200	180.00	36,000	
フィールズ	100	615.00	61,500	
双日	5,200	281.00	1,461,200	
アルフレッサホールディングス	1,000	2,171.00	2,171,000	
ハニーズホールディングス	100	1,033.00	103,300	
キッコーマン	700	7,400.00	5,180,000	
味の素	2,300	2,267.50	5,215,250	
キュービー	500	2,394.00	1,197,000	
ハウス食品グループ本社	400	3,720.00	1,488,000	
カゴメ	400	3,340.00	1,336,000	
アリアケジャパン	100	6,800.00	680,000	
ニチレイ	500	2,807.00	1,403,500	
横浜冷凍	200	901.00	180,200	
東洋水産	500	4,615.00	2,307,500	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	100	957.00	95,700	
日清食品ホールディングス	400	8,340.00	3,336,000	
フジッコ	100	2,003.00	200,300	
ロック・フィールド	100	1,555.00	155,500	
日本たばこ産業	5,100	1,936.50	9,876,150	
ケンコーマヨネーズ	100	2,024.00	202,400	
わらべや日洋ホールディングス	100	1,716.00	171,600	
なとり	100	2,019.00	201,900	
北の達人コーポレーション	300	636.00	190,800	
ユーグレナ	400	990.00	396,000	
A Dワークスグループ	200	157.00	31,400	
片倉工業	100	1,391.00	139,100	
グンゼ	100	3,790.00	379,000	
ヒューリック	2,000	1,199.00	2,398,000	
アルペン	100	2,320.00	232,000	
ラクーンホールディングス	100	2,231.00	223,100	
クオールホールディングス	100	1,445.00	144,500	
アルコニックス	100	1,633.00	163,300	
神戸物産	600	2,924.00	1,754,400	
ビックカメラ	600	1,184.00	710,400	
D C Mホールディングス	600	1,101.00	660,600	
ペッパーフードサービス	100	298.00	29,800	
Monotaro	700	6,860.00	4,802,000	
あいホールディングス	100	2,041.00	204,100	

アーランドサービスホールディングス	100	2,146.00	214,600	
J.フロントリテイリング	1,100	1,012.00	1,113,200	
ドトール・日レスホールディングス	100	1,655.00	165,500	
マツモトキヨシホールディングス	400	4,280.00	1,712,000	
ZOZO	600	3,590.00	2,154,000	
ココカラファイン	100	7,440.00	744,000	
三越伊勢丹ホールディングス	1,600	732.00	1,171,200	
東洋紡	400	1,342.00	536,800	
ユニチカ	300	446.00	133,800	
日清紡ホールディングス	600	804.00	482,400	
倉敷紡績	100	1,920.00	192,000	
ダイワボウホールディングス	100	8,130.00	813,000	
シキボウ	100	1,013.00	101,300	
日東紡績	100	4,390.00	439,000	
トヨタ紡織	300	1,733.00	519,900	
マクニカ・富士エレホールディングス	200	2,111.00	422,200	
ウエルシアホールディングス	500	3,615.00	1,807,500	
クリエイトSDホールディングス	100	3,395.00	339,500	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	200	790.00	158,000	
八洲電機	100	951.00	95,100	
メディアスホールディングス	100	841.00	84,100	
レスターホールディングス	100	2,055.00	205,500	
丸善CHIホールディングス	100	379.00	37,900	
TOKAIホールディングス	500	956.00	478,000	
三洋貿易	100	1,078.00	107,800	
シュッピン	100	1,103.00	110,300	
オイシックス・ラ・大地	100	2,921.00	292,100	
ウイン・パートナーズ	100	1,165.00	116,500	
ネクステージ	200	1,721.00	344,200	
ジョイフル本田	300	1,415.00	424,500	
ホットランド	100	1,227.00	122,700	
すかいらーくホールディングス	1,000	1,638.00	1,638,000	
綿半ホールディングス	100	1,262.00	126,200	
日本毛織	300	958.00	287,400	
ダイトウボウ	200	106.00	21,200	
ダイドーリミテッド	100	190.00	19,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	300	1,127.00	338,100	
野村不動産ホールディングス	600	2,415.00	1,449,000	
三重交通グループホールディングス	200	487.00	97,400	
サムティ	100	1,771.00	177,100	
ディア・ライフ	100	428.00	42,800	
日本商業開発	100	1,650.00	165,000	
プレサンスコーポレーション	200	1,503.00	300,600	
THEグローバル社	100	268.00	26,800	
日本管理センター	100	1,222.00	122,200	
フージャースホールディングス	200	692.00	138,400	
オープンハウス	300	4,100.00	1,230,000	

東急不動産ホールディングス	2,500	678.00	1,695,000
飯田グループホールディングス	800	2,449.00	1,959,200
ムゲンエステート	100	488.00	48,800
帝国繊維	100	2,275.00	227,500
日本コークス工業	800	104.00	83,200
あさひ	100	1,514.00	151,400
日本調剤	100	1,595.00	159,500
コスモス薬品	100	15,860.00	1,586,000
シップヘルスケアホールディングス	200	5,880.00	1,176,000
セブン&アイ・ホールディングス	3,700	4,202.00	15,547,400
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	500	840.00	420,000
ツルハホールディングス	200	14,110.00	2,822,000
サンマルクホールディングス	100	1,626.00	162,600
トリドールホールディングス	200	1,505.00	301,000
帝人	900	1,873.00	1,685,700
東レ	6,700	706.80	4,735,560
クラレ	1,500	1,196.00	1,794,000
旭化成	6,200	1,147.50	7,114,500
T O K Y O B A S E	100	722.00	72,200
稲葉製作所	100	1,427.00	142,700
トーカロ	200	1,403.00	280,600
S U M C O	1,200	2,520.00	3,024,000
日本フェルト	100	444.00	44,400
エコナックホールディングス	200	99.00	19,800
アツギ	100	546.00	54,600
J Mホールディングス	100	2,005.00	200,500
コメダホールディングス	200	1,938.00	387,600
アレンザホールディングス	100	1,376.00	137,600
パロックジャパンリミテッド	100	817.00	81,700
クスリのアオキホールディングス	100	8,840.00	884,000
共和レザー	100	667.00	66,700
スシローグローバルホールディングス	500	4,275.00	2,137,500
セーレン	200	1,909.00	381,800
小松マテーレ	200	1,024.00	204,800
ワコールホールディングス	200	2,223.00	444,600
ホギメディカル	100	3,185.00	318,500
T S Iホールディングス	300	278.00	83,400
ワールド	100	1,381.00	138,100
T I S	900	2,264.00	2,037,600
グリー	600	603.00	361,800
コーエーテクモホールディングス	200	6,370.00	1,274,000
ファインデックス	100	1,222.00	122,200
K L a b	200	867.00	173,400
ポルトウウィン・ビットクルーホールディングス	100	1,166.00	116,600
ネクソン	2,400	3,490.00	8,376,000
アイスタイル	300	551.00	165,300
エイチーム	100	1,238.00	123,800
エニグモ	100	1,242.00	124,200

テクノスジャパン	100	693.00	69,300	
コロブラ	300	910.00	273,000	
オルトプラス	100	443.00	44,300	
ブロードリーフ	500	513.00	256,500	
システム情報	100	1,065.00	106,500	
じげん	200	406.00	81,200	
ブイキューブ	100	2,769.00	276,900	
ディー・エル・イー	100	320.00	32,000	
フィックスターズ	100	1,003.00	100,300	
オプティム	100	3,180.00	318,000	
特種東海製紙	100	4,735.00	473,500	
ティーガイア	100	1,877.00	187,700	
日本アジアグループ	100	1,246.00	124,600	
テクマトリックス	100	1,751.00	175,100	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	200	2,363.00	472,600	
GMOペイメントゲートウェイ	200	15,830.00	3,166,000	
インターネットイニシアティブ	200	2,311.00	462,200	
さくらインターネット	100	681.00	68,100	
朝日ネット	100	838.00	83,800	
eBASE	100	930.00	93,000	
アバント	100	1,409.00	140,900	
フリービット	100	998.00	99,800	
コムチュア	100	2,887.00	288,700	
アステリア	100	916.00	91,600	
アイル	100	1,644.00	164,400	
王子ホールディングス	4,200	709.00	2,977,800	
日本製紙	400	1,406.00	562,400	
三菱製紙	100	361.00	36,100	
北越コーポレーション	700	514.00	359,800	
大王製紙	400	2,224.00	889,600	
メディカル・データ・ビジョン	100	2,158.00	215,800	
gumi	100	989.00	98,900	
オープンドア	100	2,335.00	233,500	
カナミックネットワーク	100	777.00	77,700	
レンゴー	1,000	879.00	879,000	
トーモク	100	1,869.00	186,900	
ザ・バック	100	2,737.00	273,700	
チェンジ	100	3,465.00	346,500	
シンクロ・フード	100	363.00	36,300	
AOI TYO HOLDINGS	100	477.00	47,700	
マクロミル	200	873.00	174,600	
昭和電工	700	2,592.00	1,814,400	
住友化学	7,300	522.00	3,810,600	
日産化学	500	6,240.00	3,120,000	
クレハ	100	7,190.00	719,000	
テイカ	100	1,440.00	144,000	
石原産業	200	821.00	164,200	
日本曹達	100	3,385.00	338,500	
東ソー	1,400	1,989.00	2,784,600	

トクヤマ	300	2,682.00	804,600
セントラル硝子	200	2,301.00	460,200
東亜合成	600	1,243.00	745,800
大阪ソーダ	100	2,643.00	264,300
関東電化工業	200	887.00	177,400
デンカ	300	4,120.00	1,236,000
イビデン	500	4,820.00	2,410,000
信越化学工業	1,700	18,740.00	31,858,000
堺化学工業	100	1,976.00	197,600
第一稀元素化学工業	100	1,046.00	104,600
エア・ウォーター	900	1,743.00	1,568,700
日本酸素ホールディングス	800	2,009.00	1,607,200
日本パーカライジング	500	1,101.00	550,500
高压ガス工業	100	739.00	73,900
四国化成工業	100	1,261.00	126,100
ステラ ケミファ	100	3,275.00	327,500
日本触媒	200	5,790.00	1,158,000
大日精化工業	100	2,404.00	240,400
カネカ	200	4,275.00	855,000
協和キリン	1,000	3,085.00	3,085,000
三菱瓦斯化学	900	2,597.00	2,337,300
三井化学	800	3,240.00	2,592,000
J S R	900	3,390.00	3,051,000
東京応化工業	200	6,810.00	1,362,000
大阪有機化学工業	100	3,840.00	384,000
三菱ケミカルホールディングス	6,200	731.50	4,535,300
K Hネオケム	200	2,508.00	501,600
ダイセル	1,300	775.00	1,007,500
住友ベークライト	100	4,435.00	443,500
積水化学工業	2,000	2,021.00	4,042,000
日本ゼオン	800	1,654.00	1,323,200
アイカ工業	300	3,840.00	1,152,000
宇部興産	500	2,141.00	1,070,500
積水樹脂	200	2,066.00	413,200
タキロンシーアイ	200	691.00	138,200
旭有機材	100	1,473.00	147,300
リケンテクノス	200	495.00	99,000
積水化成品工業	100	561.00	56,100
ダイキョーニシカワ	200	799.00	159,800
日本化薬	600	1,060.00	636,000
カーリットホールディングス	100	728.00	72,800
E P Sホールディングス	100	1,201.00	120,100
プレステージ・インターナショナル	300	764.00	229,200
プロトコーポレーション	100	1,171.00	117,100
野村総合研究所	1,700	3,565.00	6,060,500
サイバネットシステム	100	856.00	85,600
クイック	100	1,194.00	119,400
電通グループ	1,000	3,670.00	3,670,000
インテージホールディングス	100	1,197.00	119,700
ソースネクスト	400	337.00	134,800

シーティーエス	100	880.00	88,000	
インフォコム	100	2,808.00	280,800	
メディカルシステムネットワーク	100	732.00	73,200	
日本精化	100	1,417.00	141,700	
扶桑化学工業	100	3,970.00	397,000	
トリケミカル研究所	100	4,250.00	425,000	
ラクスル	100	3,810.00	381,000	
F I G	100	269.00	26,900	
A D E K A	400	1,863.00	745,200	
日油	400	5,850.00	2,340,000	
新日本理化	200	279.00	55,800	
ハリマ化成グループ	100	948.00	94,800	
イーソル	100	1,412.00	141,200	
アルテリア・ネットワークス	100	1,567.00	156,700	
花王	2,300	7,270.00	16,721,000	
三洋化成工業	100	5,230.00	523,000	
武田薬品工業	7,900	3,687.00	29,127,300	
アステラス製薬	8,200	1,779.00	14,587,800	
大日本住友製薬	700	1,701.00	1,190,700	
塩野義製薬	1,200	5,811.00	6,973,200	
わかもと製薬	100	245.00	24,500	
あすか製薬	100	1,411.00	141,100	
日本新薬	300	7,810.00	2,343,000	
中外製薬	3,000	5,250.00	15,750,000	
科研製薬	200	4,155.00	831,000	
エーザイ	1,000	7,625.00	7,625,000	
理研ビタミン	100	1,363.00	136,300	
ロート製薬	500	2,967.00	1,483,500	
小野薬品工業	2,200	3,055.00	6,721,000	
久光製薬	300	7,070.00	2,121,000	
有機合成薬品工業	100	296.00	29,600	
持田製薬	100	4,145.00	414,500	
参天製薬	1,700	1,572.00	2,672,400	
ツムラ	300	3,435.00	1,030,500	
日医工	300	1,106.00	331,800	
テルモ	2,900	4,278.00	12,406,200	
H . U . グループホールディングス	300	3,290.00	987,000	
キッセイ薬品工業	200	2,237.00	447,400	
生化学工業	200	1,061.00	212,200	
栄研化学	200	2,142.00	428,400	
鳥居薬品	100	3,005.00	300,500	
J C R ファーマ	300	3,270.00	981,000	
東和薬品	100	2,230.00	223,000	
富士製薬工業	100	1,280.00	128,000	
沢井製薬	200	4,895.00	979,000	
ゼリア新薬工業	200	2,024.00	404,800	
第一三共	8,200	3,261.00	26,740,200	
キョーリン製薬ホールディングス	200	1,931.00	386,200	
大幸薬品	100	1,322.00	132,200	
ダイト	100	3,590.00	359,000	

大塚ホールディングス	2,000	4,469.00	8,938,000
大正製薬ホールディングス	200	6,920.00	1,384,000
ペプチドリーム	500	5,420.00	2,710,000
大日本塗料	100	924.00	92,400
日本ペイントホールディングス	800	8,710.00	6,968,000
関西ペイント	1,000	2,917.00	2,917,000
神東塗料	100	201.00	20,100
中国塗料	200	936.00	187,200
日本特殊塗料	100	1,154.00	115,400
藤倉化成	100	525.00	52,500
太陽ホールディングス	100	5,890.00	589,000
D I C	400	2,860.00	1,144,000
サカタインクス	200	1,103.00	220,600
東洋インキS Cホールディングス	200	2,007.00	401,400
T & K T O K A	100	828.00	82,800
アルプス技研	100	2,027.00	202,700
サニックス	100	297.00	29,700
日本空調サービス	100	736.00	73,600
オリエンタルランド	1,000	18,040.00	18,040,000
フォーカスシステムズ	100	933.00	93,300
ダスキン	200	2,802.00	560,400
パーク24	500	2,234.00	1,117,000
明光ネットワークジャパン	100	569.00	56,900
クレスコ	100	1,386.00	138,600
フジ・メディア・ホールディングス	1,000	1,320.00	1,320,000
ラウンドワン	300	1,110.00	333,000
リゾートトラスト	400	1,747.00	698,800
オービック	300	19,350.00	5,805,000
ジャストシステム	100	6,970.00	697,000
T D C ソフト	100	949.00	94,900
Zホールディングス	12,800	661.00	8,460,800
ビー・エム・エル	100	3,650.00	365,000
トレンドマイクロ	500	5,640.00	2,820,000
りらいあコミュニケーションズ	100	1,396.00	139,600
リソー教育	500	334.00	167,000
日本オラクル	200	11,930.00	2,386,000
フューチャー	100	1,900.00	190,000
C A C H o l d i n g s	100	1,437.00	143,700
ユー・エス・エス	1,000	2,100.00	2,100,000
オービックビジネスコンサルタント	100	6,340.00	634,000
伊藤忠テクノソリューションズ	400	3,435.00	1,374,000
アイティフォー	100	863.00	86,300
東京個別指導学院	100	675.00	67,500
サイバーエージェント	600	6,990.00	4,194,000
楽天	4,200	1,145.00	4,809,000
モーニングスター	100	495.00	49,500
テー・オー・ダブリュー	200	304.00	60,800
大塚商会	500	5,140.00	2,570,000
サイボウズ	100	2,497.00	249,700
山田コンサルティンググループ	100	1,004.00	100,400



電通国際情報サービス	100	3,830.00	383,000	
A C C E S S	100	835.00	83,500	
デジタルガレージ	200	4,445.00	889,000	
イーエムシステムズ	200	856.00	171,200	
C I J	100	872.00	87,200	
日本エンタープライズ	100	255.00	25,500	
スカラ	100	723.00	72,300	
インテリジェント ウェイブ	100	688.00	68,800	
フルキャストホールディングス	100	1,980.00	198,000	
エン・ジャパン	200	3,370.00	674,000	
富士フイルムホールディングス	1,700	6,333.00	10,766,100	
コニカミノルタ	1,900	550.00	1,045,000	
資生堂	1,900	8,150.00	15,485,000	
ライオン	1,200	2,175.00	2,610,000	
高砂香料工業	100	2,609.00	260,900	
マンダム	200	1,870.00	374,000	
ミルボン	100	6,400.00	640,000	
ファンケル	300	4,080.00	1,224,000	
コーセー	200	18,100.00	3,620,000	
コタ	100	1,828.00	182,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	400	2,476.00	990,400	
ノエビアホールディングス	100	4,865.00	486,500	
エステー	100	1,973.00	197,300	
コニシ	200	1,678.00	335,600	
長谷川香料	200	1,951.00	390,200	
星光P M C	100	773.00	77,300	
小林製薬	300	10,990.00	3,297,000	
荒川化学工業	100	1,295.00	129,500	
メック	100	2,073.00	207,300	
タカラバイオ	200	3,085.00	617,000	
J C U	100	3,410.00	341,000	
新田ゼラチン	100	680.00	68,000	
デクセリアルズ	300	1,538.00	461,400	
アース製薬	100	6,070.00	607,000	
北興化学工業	100	1,046.00	104,600	
クミアイ化学工業	400	882.00	352,800	
日本農薬	200	530.00	106,000	
ニチレキ	100	1,538.00	153,800	
ユシロ化学工業	100	1,085.00	108,500	
富士石油	200	211.00	42,200	
出光興産	1,100	2,742.00	3,016,200	
E N E O Sホールディングス	14,300	462.90	6,619,470	
コスモエネルギーホールディングス	300	2,485.00	745,500	
横浜ゴム	500	1,961.00	980,500	
T O Y O T I R E	500	1,906.00	953,000	
ブリヂストン	2,500	4,199.00	10,497,500	
住友ゴム工業	900	1,194.00	1,074,600	
藤倉コンポジット	100	435.00	43,500	
オカモト	100	4,115.00	411,500	
アキレス	100	1,487.00	148,700	

ニッタ	100	2,396.00	239,600
住友理工	200	641.00	128,200
三ツ星ベルト	100	1,726.00	172,600
バンドー化学	200	737.00	147,400
A G C	900	3,905.00	3,514,500
日本板硝子	500	552.00	276,000
有沢製作所	100	982.00	98,200
日本電気硝子	400	2,502.00	1,000,800
住友大阪セメント	200	3,560.00	712,000
太平洋セメント	600	2,748.00	1,648,800
日本ヒューム	100	769.00	76,900
日本コンクリート工業	200	386.00	77,200
アジアパイルホールディングス	100	530.00	53,000
東海カーボン	900	1,515.00	1,363,500
日本カーボン	100	4,095.00	409,500
東洋炭素	100	1,987.00	198,700
ノリタケカンパニーリミテド	100	3,615.00	361,500
T O T O	700	6,850.00	4,795,000
日本碍子	1,000	1,881.00	1,881,000
日本特殊陶業	700	1,868.00	1,307,600
ダントーホールディングス	100	380.00	38,000
ヨータイ	100	1,038.00	103,800
東京窯業	100	324.00	32,400
フジインコーポレーテッド	100	4,225.00	422,500
ニチアス	200	2,486.00	497,200
日本製鉄	4,500	1,551.50	6,981,750
神戸製鋼所	1,700	636.00	1,081,200
中山製鋼所	100	401.00	40,100
合同製鐵	100	2,080.00	208,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	2,700	1,113.00	3,005,100
東京製鐵	400	722.00	288,800
共英製鋼	100	1,432.00	143,200
大和工業	200	2,712.00	542,400
淀川製鋼所	100	2,303.00	230,300
丸一鋼管	300	2,502.00	750,600
大同特殊鋼	200	4,695.00	939,000
日本冶金工業	100	2,119.00	211,900
山陽特殊製鋼	100	1,749.00	174,900
愛知製鋼	100	3,275.00	327,500
日立金属	900	1,722.00	1,549,800
大平洋金属	100	2,500.00	250,000
新日本電工	600	298.00	178,800
日本製鋼所	300	2,887.00	866,100
三菱製鋼	100	764.00	76,400
日亜鋼業	100	294.00	29,400
大紀アルミニウム工業所	100	802.00	80,200
日本軽金属ホールディングス	300	2,167.00	650,100
三井金属鉱業	300	3,885.00	1,165,500
東邦亜鉛	100	2,415.00	241,500

三菱マテリアル	600	2,598.00	1,558,800
住友金属鉱山	1,200	5,578.00	6,693,600
DOWAホールディングス	200	4,175.00	835,000
古河機械金属	200	1,352.00	270,400
エス・サイエンス	400	42.00	16,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	100	818.00	81,800
東邦チタニウム	200	981.00	196,200
UACJ	100	2,507.00	250,700
古河電気工業	300	2,871.00	861,300
住友電気工業	3,300	1,549.50	5,113,350
フジクラ	1,100	525.00	577,500
昭和電線ホールディングス	100	1,753.00	175,300
タツタ電線	200	651.00	130,200
平河ヒューテック	100	1,189.00	118,900
リョービ	100	1,306.00	130,600
アーレスティ	100	405.00	40,500
アサヒホールディングス	200	4,315.00	863,000
東洋製罐グループホールディングス	600	1,361.00	816,600
コロナ	100	951.00	95,100
横河ブリッジホールディングス	200	1,912.00	382,400
OSJBホールディングス	400	273.00	109,200
三和ホールディングス	900	1,315.00	1,183,500
文化シャッター	300	1,000.00	300,000
三協立山	100	828.00	82,800
アルインコ	100	974.00	97,400
LIXIL	1,300	3,025.00	3,932,500
日本フィルコン	100	500.00	50,000
ノーリツ	200	1,675.00	335,000
長府製作所	100	2,108.00	210,800
リンナイ	200	11,460.00	2,292,000
ユニプレス	200	962.00	192,400
日東精工	100	667.00	66,700
岡部	200	789.00	157,800
ジーテクト	100	1,448.00	144,800
東プレ	200	1,586.00	317,200
高周波熱錬	200	540.00	108,000
東京製綱	100	1,445.00	144,500
サンコール	100	487.00	48,700
モリテックスチール	100	420.00	42,000
パイオラックス	100	1,594.00	159,400
エイチワン	100	772.00	77,200
日本発条	900	812.00	730,800
三浦工業	400	6,140.00	2,456,000
タクマ	300	2,023.00	606,900
テクノプロ・ホールディングス	200	8,100.00	1,620,000
Keeper 技研	100	1,954.00	195,400
Gunosy	100	808.00	80,800
ジャパンマテリアル	300	1,464.00	439,200
ベクトル	100	1,198.00	119,800
チャーム・ケア・コーポレーション	100	1,427.00	142,700

I B J	100	1,024.00	102,400
N・フィールド	100	1,197.00	119,700
M&Aキャピタルパートナーズ	100	4,890.00	489,000
ウィルグループ	100	981.00	98,100
エスクロー・エージェント・ジャパン	100	304.00	30,400
リクルートホールディングス	6,500	5,475.00	35,587,500
エラン	100	1,400.00	140,000
ツガミ	200	1,635.00	327,000
オークマ	100	5,970.00	597,000
芝浦機械	100	2,956.00	295,600
アマダ	1,400	1,289.00	1,804,600
アイダエンジニアリング	200	957.00	191,400
F U J I	400	2,667.00	1,066,800
牧野フライス製作所	100	4,025.00	402,500
オーエスジー	500	1,973.00	986,500
旭ダイヤモンド工業	200	510.00	102,000
D M G 森精機	600	1,599.00	959,400
ソディック	200	991.00	198,200
ディスコ	100	35,500.00	3,550,000
パンチ工業	100	599.00	59,900
日本郵政	6,900	900.00	6,210,000
ベルシステム24ホールディングス	200	1,847.00	369,400
鎌倉新書	100	903.00	90,300
ソラスト	200	1,495.00	299,000
インソース	100	2,249.00	224,900
豊田自動織機	800	9,520.00	7,616,000
豊和工業	100	858.00	85,800
東洋機械金属	100	458.00	45,800
島精機製作所	100	2,304.00	230,400
オプトラン	100	2,775.00	277,500
イワキ	100	836.00	83,600
フリー	100	1,120.00	112,000
ヤマシンフィルタ	200	890.00	178,000
日阪製作所	100	841.00	84,100
やまびこ	200	1,177.00	235,400
ペガサスミシン製造	100	460.00	46,000
ナブテスコ	600	4,860.00	2,916,000
三井海洋開発	100	1,752.00	175,200
レオン自動機	100	1,135.00	113,500
S M C	300	65,860.00	19,758,000
オイレス工業	100	1,697.00	169,700
サトーホールディングス	100	2,497.00	249,700
技研製作所	100	5,190.00	519,000
日精樹脂工業	100	921.00	92,100
小松製作所	4,300	3,253.00	13,987,900
住友重機械工業	500	2,901.00	1,450,500
日立建機	400	3,325.00	1,330,000
日工	100	727.00	72,700
井関農機	100	1,541.00	154,100
T O W A	100	2,179.00	217,900

シンニッタン	100	219.00	21,900	
クボタ	5,000	2,471.50	12,357,500	
東洋エンジニアリング	100	506.00	50,600	
月島機械	200	1,293.00	258,600	
帝国電機製作所	100	1,210.00	121,000	
新東工業	200	759.00	151,800	
澁谷工業	100	3,530.00	353,000	
アイチコーポレーション	200	897.00	179,400	
小森コーポレーション	200	721.00	144,200	
鶴見製作所	100	1,727.00	172,700	
荏原製作所	400	4,110.00	1,644,000	
西島製作所	100	836.00	83,600	
北越工業	100	1,118.00	111,800	
ダイキン工業	1,200	22,100.00	26,520,000	
栗田工業	500	4,430.00	2,215,000	
椿本チエイン	100	2,941.00	294,100	
日機装	300	1,075.00	322,500	
木村化工機	100	657.00	65,700	
レイズネクスト	200	1,177.00	235,400	
アネスト岩田	200	1,087.00	217,400	
ダイフク	500	11,310.00	5,655,000	
加藤製作所	100	1,002.00	100,200	
タダノ	500	1,013.00	506,500	
フジテック	300	2,536.00	760,800	
C K D	200	2,475.00	495,000	
キトー	100	1,472.00	147,200	
平和	300	1,601.00	480,300	
理想科学工業	100	1,365.00	136,500	
S A N K Y O	200	2,954.00	590,800	
日本金銭機械	100	553.00	55,300	
マースグループホールディングス	100	1,595.00	159,500	
フクシマガリレイ	100	4,195.00	419,500	
竹内製作所	200	2,779.00	555,800	
アマノ	200	2,418.00	483,600	
J U K I	100	830.00	83,000	
サンデンホールディングス	100	436.00	43,600	
蛇の目ミシン工業	100	813.00	81,300	
ブラザー工業	1,200	2,262.00	2,714,400	
マックス	100	1,614.00	161,400	
モリタホールディングス	200	1,813.00	362,600	
グローリー	200	2,290.00	458,000	
新晃工業	100	1,975.00	197,500	
大和冷機工業	200	1,085.00	217,000	
セガサミーホールディングス	900	1,832.00	1,648,800	
T P R	100	1,523.00	152,300	
ツバキ・ナカシマ	200	1,274.00	254,800	
ホシザキ	300	9,650.00	2,895,000	
大豊工業	100	753.00	75,300	
日本精工	2,000	1,014.00	2,028,000	
N T N	2,200	315.00	693,000	

ジェイテクト	900	1,146.00	1,031,400
不二越	100	4,685.00	468,500
ミネベアミツミ	1,600	2,670.00	4,272,000
日本トムソン	300	569.00	170,700
THK	600	3,640.00	2,184,000
ユーシン精機	100	945.00	94,500
イーグル工業	100	1,153.00	115,300
前澤工業	100	572.00	57,200
日本ビラー工業	100	1,723.00	172,300
キッツ	300	582.00	174,600
日立製作所	4,600	4,934.00	22,696,400
三菱電機	9,500	1,601.50	15,214,250
富士電機	600	4,665.00	2,799,000
安川電機	1,000	5,670.00	5,670,000
シンフォニアテクノロジー	100	1,339.00	133,900
明電舎	200	2,372.00	474,400
デンヨー	100	2,117.00	211,700
ペイカレント・コンサルティング	100	21,270.00	2,127,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	300	2,241.00	672,300
日総工業	100	837.00	83,700
RPAホールディングス	100	639.00	63,900
三櫻工業	100	940.00	94,000
マキタ	1,200	4,695.00	5,634,000
東芝テック	100	3,860.00	386,000
マブチモーター	300	4,885.00	1,465,500
日本電産	2,300	14,650.00	33,695,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	100	895.00	89,500
トレックス・セミコンダクター	100	1,609.00	160,900
ダブル・スコープ	200	792.00	158,400
ダイヘン	100	4,680.00	468,000
ヤーマン	200	1,935.00	387,000
JVCケンウッド	800	193.00	154,400
ミマキエンジニアリング	100	569.00	56,900
日新電機	200	1,270.00	254,000
大崎電気工業	200	609.00	121,800
オムロン	800	9,420.00	7,536,000
日東工業	100	2,094.00	209,400
IDEC	100	1,881.00	188,100
ジーエス・ユアサコーポレーション	300	3,370.00	1,011,000
日本電気	1,200	6,290.00	7,548,000
富士通	900	15,905.00	14,314,500
沖電気工業	400	1,050.00	420,000
サンケン電気	100	5,580.00	558,000
アイホン	100	1,753.00	175,300
ルネサスエレクトロニクス	4,100	1,255.00	5,145,500
セイコーエプソン	1,200	1,768.00	2,121,600
ワコム	700	796.00	557,200
アルバック	200	5,110.00	1,022,000
EIZO	100	3,830.00	383,000

ジャパンディスプレイ	3,200	48.00	153,600	
日本信号	200	957.00	191,400	
京三製作所	200	426.00	85,200	
能美防災	100	2,256.00	225,600	
ホーチキ	100	1,294.00	129,400	
エレコム	100	4,980.00	498,000	
パナソニック	10,100	1,441.50	14,559,150	
シャープ	1,100	2,140.00	2,354,000	
アンリツ	600	2,380.00	1,428,000	
富士通ゼネラル	300	2,986.00	895,800	
ソニー	5,900	11,980.00	70,682,000	
T D K	500	16,260.00	8,130,000	
タムラ製作所	300	556.00	166,800	
アルプスアルパイン	800	1,437.00	1,149,600	
日本電波工業	100	694.00	69,400	
ローランド ディー・ジー・	100	1,909.00	190,900	
フォスター電機	100	1,307.00	130,700	
ヨコオ	100	2,997.00	299,700	
ティアック	100	126.00	12,600	
ホシデン	300	1,087.00	326,100	
ヒロセ電機	100	16,780.00	1,678,000	
日本航空電子工業	200	1,696.00	339,200	
T O A	100	903.00	90,300	
マクセルホールディングス	200	1,444.00	288,800	
古野電気	100	1,144.00	114,400	
スミダコーポレーション	100	1,027.00	102,700	
本多通信工業	100	523.00	52,300	
船井電機	100	482.00	48,200	
横河電機	1,000	2,143.00	2,143,000	
アズビル	600	5,010.00	3,006,000	
日本光電工業	400	3,020.00	1,208,000	
共和電業	100	385.00	38,500	
堀場製作所	200	6,740.00	1,348,000	
アドバンテスト	700	9,670.00	6,769,000	
エスベック	100	1,927.00	192,700	
キーエンス	900	56,750.00	51,075,000	
シスメックス	700	11,760.00	8,232,000	
日本マイクロニクス	200	1,888.00	377,600	
メガチップス	100	3,445.00	344,500	
O B A R A G R O U P	100	3,970.00	397,000	
I M A G I C A G R O U P	100	513.00	51,300	
デンソー	2,100	6,672.00	14,011,200	
コーセル	100	1,164.00	116,400	
イリソ電子工業	100	5,040.00	504,000	
オブテックスグループ	200	1,762.00	352,400	
レーザーテック	400	14,580.00	5,832,000	
スタンレー電気	700	3,440.00	2,408,000	
ウシオ電機	500	1,377.00	688,500	
岡谷電機産業	100	375.00	37,500	
ヘリオス テクノ ホールディング	100	344.00	34,400	

日本セラミック	100	2,740.00	274,000	
古河電池	100	1,588.00	158,800	
山一電機	100	1,480.00	148,000	
図研	100	2,950.00	295,000	
日本電子	200	4,315.00	863,000	
カシオ計算機	800	2,055.00	1,644,000	
ファナック	800	27,585.00	22,068,000	
日本シイエムケイ	200	437.00	87,400	
ローム	400	11,470.00	4,588,000	
浜松ホトニクス	700	6,820.00	4,774,000	
三井ハイテック	100	4,535.00	453,500	
新光電気工業	300	3,035.00	910,500	
京セラ	1,400	6,944.00	9,721,600	
太陽誘電	400	5,840.00	2,336,000	
村田製作所	2,800	9,882.00	27,669,600	
双葉電子工業	200	968.00	193,600	
日東電工	600	9,430.00	5,658,000	
東海理化電機製作所	300	1,806.00	541,800	
ニチコン	300	1,147.00	344,100	
日本ケミコン	100	1,847.00	184,700	
K O A	100	1,520.00	152,000	
三井E & Sホールディングス	400	441.00	176,400	
日立造船	800	707.00	565,600	
三菱重工業	1,500	3,055.00	4,582,500	
川崎重工業	700	2,307.00	1,614,900	
I H I	600	1,899.00	1,139,400	
名村造船所	300	193.00	57,900	
サノヤスホールディングス	100	152.00	15,200	
カーブスホールディングス	200	972.00	194,400	
三菱ロジスネクスト	100	1,154.00	115,400	
F P G	300	614.00	184,200	
じもとホールディングス	100	797.00	79,700	
全国保証	200	5,160.00	1,032,000	
めぶきフィナンシャルグループ	4,900	234.00	1,146,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	100	1,231.00	123,100	
九州フィナンシャルグループ	1,900	451.00	856,900	
かんぽ生命保険	1,200	2,172.00	2,606,400	
ゆうちょ銀行	2,700	1,006.00	2,716,200	
富山第一銀行	200	297.00	59,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	5,700	426.00	2,428,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	600	710.00	426,000	
アルヒ	100	1,641.00	164,100	
日産自動車	11,200	587.20	6,576,640	
いすゞ自動車	2,800	1,124.00	3,147,200	
トヨタ自動車	9,600	8,060.00	77,376,000	
日野自動車	1,200	1,017.00	1,220,400	
三菱自動車工業	3,500	293.00	1,025,500	
エフテック	100	667.00	66,700	



武蔵精密工業	200	1,897.00	379,400
日産車体	100	808.00	80,800
新明和工業	300	961.00	288,300
極東開発工業	200	1,605.00	321,000
トピー工業	100	1,448.00	144,800
曙ブレーキ工業	500	164.00	82,000
タチエス	100	1,101.00	110,100
NOK	500	1,473.00	736,500
フタバ産業	200	540.00	108,000
KYB	100	3,010.00	301,000
市光工業	100	763.00	76,300
大同メタル工業	200	558.00	111,600
プレス工業	500	332.00	166,000
ミクニ	100	287.00	28,700
太平洋工業	200	1,214.00	242,800
河西工業	100	418.00	41,800
アイシン精機	700	3,640.00	2,548,000
マツダ	3,000	859.00	2,577,000
今仙電機製作所	100	770.00	77,000
本田技研工業	7,500	2,977.50	22,331,250
スズキ	1,900	4,918.00	9,344,200
SUBARU	2,700	2,035.00	5,494,500
ヤマハ発動機	1,300	2,410.00	3,133,000
小糸製作所	600	7,750.00	4,650,000
TBK	100	438.00	43,800
エクセディ	100	1,645.00	164,500
ミツバ	200	624.00	124,800
豊田合成	300	2,856.00	856,800
愛三工業	100	578.00	57,800
日本プラスト	100	596.00	59,600
ヨロズ	100	1,309.00	130,900
エフ・シー・シー	200	1,743.00	348,600
シマノ	400	25,405.00	10,162,000
テイ・エス テック	200	3,050.00	610,000
関西みらいフィナンシャルグループ	400	611.00	244,400
三十三フィナンシャルグループ	100	1,369.00	136,900
第四北越フィナンシャルグループ	200	2,334.00	466,800
ひろぎんホールディングス	1,400	650.00	910,000
ジャムコ	100	888.00	88,800
小野建	100	1,323.00	132,300
ノジマ	200	2,911.00	582,200
佐島電機	100	807.00	80,700
カップ・クリエイト	100	1,511.00	151,100
伯東	100	1,282.00	128,200
コンドーテック	100	1,068.00	106,800
中山福	100	517.00	51,700
ライトオン	100	634.00	63,400
ナガイレーベン	100	2,785.00	278,500
三菱食品	100	2,962.00	296,200
良品計画	1,200	2,515.00	3,018,000

三城ホールディングス	100	303.00	30,300	
松田産業	100	1,941.00	194,100	
第一興商	100	4,115.00	411,500	
メディバルホールディングス	900	2,236.00	2,012,400	
アドヴァン	100	1,119.00	111,900	
アズワン	100	14,760.00	1,476,000	
シモジマ	100	1,399.00	139,900	
ドウシシャ	100	1,832.00	183,200	
コナカ	100	364.00	36,400	
G-7ホールディングス	100	2,315.00	231,500	
イオン北海道	100	1,154.00	115,400	
コジマ	200	645.00	129,000	
コーナン商事	100	3,015.00	301,500	
ネットワークシステムズ	400	3,300.00	1,320,000	
ワタミ	100	1,007.00	100,700	
システムソフト	200	135.00	27,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	1,900	2,550.00	4,845,000	
丸文	100	529.00	52,900	
西松屋チェーン	200	1,542.00	308,400	
ゼンショーホールディングス	500	2,885.00	1,442,500	
ハピネット	100	1,535.00	153,500	
幸楽苑ホールディングス	100	1,799.00	179,900	
日本ライフライン	300	1,320.00	396,000	
サイゼリヤ	100	2,195.00	219,500	
タカショー	100	806.00	80,600	
VTホールディングス	400	424.00	169,600	
アルゴグラフィックス	100	3,050.00	305,000	
IDOM	300	634.00	190,200	
日本エム・ディ・エム	100	2,006.00	200,600	
ユナイテッドアローズ	100	2,032.00	203,200	
進和	100	2,147.00	214,700	
ハイデイ日高	100	1,802.00	180,200	
シークス	100	1,756.00	175,600	
京都きもの友禅	100	251.00	25,100	
コロワイド	300	1,994.00	598,200	
ピーシーデポコーポレーション	100	532.00	53,200	
壱番屋	100	4,990.00	499,000	
スギホールディングス	200	7,450.00	1,490,000	
島津製作所	1,200	4,365.00	5,238,000	
JMS	100	983.00	98,300	
長野計器	100	1,006.00	100,600	
スター精密	100	1,618.00	161,800	
東京計器	100	927.00	92,700	
オーバル	100	305.00	30,500	
東京精密	200	5,130.00	1,026,000	
マニー	400	2,695.00	1,078,000	
ニコン	1,400	919.00	1,286,600	
トプコン	500	1,270.00	635,000	
オリンパス	5,300	2,240.50	11,874,650	

理研計器	100	2,791.00	279,100	
S C R E E Nホールディングス	200	9,370.00	1,874,000	
キヤノン電子	100	1,692.00	169,200	
タムロン	100	1,969.00	196,900	
H O Y A	1,900	13,060.00	24,814,000	
ノーリツ鋼機	100	2,385.00	238,500	
エー・アンド・デイ	100	1,223.00	122,300	
朝日インテック	1,000	3,280.00	3,280,000	
キヤノン	4,700	2,338.50	10,990,950	
リコー	2,400	948.00	2,275,200	
シチズン時計	1,200	388.00	465,600	
大研医器	100	573.00	57,300	
メニコン	100	6,810.00	681,000	
スノーピーク	100	3,170.00	317,000	
パラマウントベッドホールディングス	100	4,540.00	454,000	
トランザクション	100	1,168.00	116,800	
ニホンフラッシュ	100	1,226.00	122,600	
前田工織	100	2,966.00	296,600	
永大産業	100	302.00	30,200	
アートネイチャー	100	670.00	67,000	
バンダイナムコホールディングス	800	8,744.00	6,995,200	
共立印刷	200	126.00	25,200	
S H O E I	100	4,260.00	426,000	
フランスベッドホールディングス	100	962.00	96,200	
マーベラス	100	947.00	94,700	
パイロットコーポレーション	200	3,305.00	661,000	
萩原工業	100	1,496.00	149,600	
エイベックス	200	1,493.00	298,600	
トッパン・フォームズ	200	1,040.00	208,000	
フジシールインターナショナル	200	2,149.00	429,800	
タカラトミー	400	999.00	399,600	
廣濟堂	100	936.00	93,600	
レック	100	1,356.00	135,600	
三光合成	100	444.00	44,400	
プロネクス	100	1,208.00	120,800	
ホクシン	100	118.00	11,800	
大建工業	100	2,012.00	201,200	
きもと	100	197.00	19,700	
凸版印刷	1,400	1,681.00	2,353,400	
大日本印刷	1,100	1,943.00	2,137,300	
N I S S H A	200	1,441.00	288,200	
藤森工業	100	4,630.00	463,000	
前澤化成工業	100	968.00	96,800	
アシックス	800	1,777.00	1,421,600	
J S P	100	1,815.00	181,500	
ニチハ	100	3,045.00	304,500	
エフピコ	200	4,250.00	850,000	
ヤマハ	600	5,770.00	3,462,000	
クリナップ	100	510.00	51,000	
ビジョン	600	4,090.00	2,454,000	

天馬	100	2,150.00	215,000	
キングジム	100	887.00	88,700	
象印マホービン	300	1,824.00	547,200	
リンテック	200	2,415.00	483,000	
信越ポリマー	100	1,027.00	102,700	
東リ	200	245.00	49,000	
イトーキ	200	364.00	72,800	
任天堂	500	68,030.00	34,015,000	
三菱鉛筆	200	1,400.00	280,000	
タカラスタンダード	200	1,571.00	314,200	
コクヨ	500	1,423.00	711,500	
ナカバヤシ	100	620.00	62,000	
ニフコ	300	3,795.00	1,138,500	
オカムラ	400	1,073.00	429,200	
バルカー	100	2,123.00	212,300	
伊藤忠商事	6,500	3,250.00	21,125,000	
丸紅	9,200	786.60	7,236,720	
スクロール	100	1,251.00	125,100	
ヨンドシーホールディングス	100	1,957.00	195,700	
長瀬産業	500	1,740.00	870,000	
蝶理	100	1,581.00	158,100	
豊田通商	900	4,605.00	4,144,500	
オンワードホールディングス	600	276.00	165,600	
三共生興	100	499.00	49,900	
兼松	400	1,388.00	555,200	
美津濃	100	2,228.00	222,800	
三井物産	7,600	2,214.50	16,830,200	
東京エレクトロン	600	46,300.00	27,780,000	
カメイ	100	1,193.00	119,300	
セイコーホールディングス	100	1,680.00	168,000	
山善	400	1,010.00	404,000	
住友商事	5,900	1,565.50	9,236,450	
日本ユニシス	300	3,245.00	973,500	
三菱商事	5,700	2,982.50	17,000,250	
キヤノンマーケティングジャパン	200	2,387.00	477,400	
佐藤商事	100	999.00	99,900	
菱洋エレクトロ	100	2,831.00	283,100	
東京産業	100	673.00	67,300	
ユアサ商事	100	3,080.00	308,000	
トルク	100	257.00	25,700	
阪和興業	200	2,857.00	571,400	
正栄食品工業	100	3,910.00	391,000	
カナデン	100	1,266.00	126,600	
菱電商事	100	1,573.00	157,300	
ニプロ	700	1,388.00	971,600	
岩谷産業	200	6,360.00	1,272,000	
イワキ	100	620.00	62,000	
兼松エレクトロニクス	100	3,655.00	365,500	
三愛石油	200	1,077.00	215,400	
稲畑産業	200	1,532.00	306,400	

明和産業	100	472.00	47,200	
キムラタン	500	25.00	12,500	
ヤマエ久野	100	1,063.00	106,300	
ゴールドウイン	200	7,380.00	1,476,000	
ユニ・チャーム	2,000	4,644.00	9,288,000	
デサント	200	1,771.00	354,200	
ワキタ	200	1,018.00	203,600	
ヤマトインターナショナル	100	336.00	33,600	
東邦ホールディングス	300	1,969.00	590,700	
サンゲツ	300	1,604.00	481,200	
ミツウロコグループホールディングス	100	1,252.00	125,200	
伊藤忠エネクス	200	1,033.00	206,600	
サンリオ	300	1,722.00	516,600	
サンワテクノス	100	1,047.00	104,700	
リョーサン	100	2,274.00	227,400	
新光商事	100	777.00	77,700	
三信電気	100	2,029.00	202,900	
東陽テクニカ	100	1,131.00	113,100	
モスフードサービス	100	3,120.00	312,000	
加賀電子	100	2,388.00	238,800	
三益半導体工業	100	2,649.00	264,900	
ソーダニッカ	100	541.00	54,100	
立花エレテック	100	1,574.00	157,400	
木曽路	100	2,454.00	245,400	
SRSホールディングス	100	870.00	87,000	
千趣会	200	373.00	74,600	
タカキュー	100	146.00	14,600	
リテールパートナーズ	100	1,483.00	148,300	
ケーヨー	200	756.00	151,200	
上新電機	100	3,100.00	310,000	
日本瓦斯	200	5,020.00	1,004,000	
ロイヤルホールディングス	200	1,885.00	377,000	
いなげや	100	1,685.00	168,500	
チヨダ	100	1,001.00	100,100	
ライフコーポレーション	100	3,310.00	331,000	
リンガーハット	100	2,405.00	240,500	
MrMaxHD	100	768.00	76,800	
テンアライド	100	353.00	35,300	
AOKIホールディングス	200	653.00	130,600	
オークワ	100	1,195.00	119,500	
コメリ	100	2,949.00	294,900	
青山商事	200	778.00	155,600	
しまむら	100	11,430.00	1,143,000	
高島屋	700	1,052.00	736,400	
松屋	200	964.00	192,800	
エイチ・ツー・オーリテイリング	400	842.00	336,800	
丸井グループ	800	2,062.00	1,649,600	
クレディセゾン	500	1,323.00	661,500	
アクシアルリテイリング	100	4,790.00	479,000	
イオン	3,600	3,550.00	12,780,000	

イズミ	200	3,910.00	782,000
平和堂	200	2,059.00	411,800
フジ	100	1,984.00	198,400
ヤオコー	100	6,670.00	667,000
ゼビオホールディングス	100	931.00	93,100
ケーズホールディングス	800	1,523.00	1,218,400
PALTAC	100	5,690.00	569,000
三谷産業	100	432.00	43,200
日産東京販売ホールディングス	100	253.00	25,300
新生銀行	800	1,541.00	1,232,800
あおぞら銀行	600	2,301.00	1,380,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	64,100	563.30	36,107,530
りそなホールディングス	10,200	436.30	4,450,260
三井住友トラスト・ホールディングス	1,800	3,613.00	6,503,400
三井住友フィナンシャルグループ	6,500	3,763.00	24,459,500
千葉銀行	3,100	711.00	2,204,100
群馬銀行	1,900	348.00	661,200
武蔵野銀行	100	1,609.00	160,900
千葉興業銀行	200	272.00	54,400
筑波銀行	400	187.00	74,800
七十七銀行	300	1,442.00	432,600
青森銀行	100	2,462.00	246,200
秋田銀行	100	1,433.00	143,300
山形銀行	100	1,115.00	111,500
岩手銀行	100	2,142.00	214,200
東邦銀行	800	213.00	170,400
みちのく銀行	100	1,066.00	106,600
ふくおかフィナンシャルグループ	800	2,028.00	1,622,400
静岡銀行	2,300	798.00	1,835,400
十六銀行	100	2,000.00	200,000
スルガ銀行	800	361.00	288,800
八十二銀行	2,100	366.00	768,600
山梨中央銀行	100	906.00	90,600
大垣共立銀行	200	2,077.00	415,400
福井銀行	100	1,939.00	193,900
北國銀行	100	2,690.00	269,000
滋賀銀行	200	2,056.00	411,200
南都銀行	100	1,836.00	183,600
百五銀行	800	311.00	248,800
京都銀行	300	6,610.00	1,983,000
紀陽銀行	300	1,446.00	433,800
ほくほくフィナンシャルグループ	600	976.00	585,600
山陰合同銀行	600	497.00	298,200
中国銀行	800	870.00	696,000
伊予銀行	1,200	641.00	769,200
百十四銀行	100	1,599.00	159,900
四国銀行	100	736.00	73,600
阿波銀行	100	2,297.00	229,700
大分銀行	100	2,155.00	215,500
宮崎銀行	100	2,289.00	228,900

佐賀銀行	100	1,416.00	141,600
沖縄銀行	100	2,819.00	281,900
琉球銀行	200	789.00	157,800
セブン銀行	3,100	243.00	753,300
みずほフィナンシャルグループ	12,700	1,588.50	20,173,950
山口フィナンシャルグループ	1,200	673.00	807,600
芙蓉総合リース	100	7,190.00	719,000
みずほリース	100	3,375.00	337,500
東京センチュリー	200	7,350.00	1,470,000
SBIホールディングス	1,100	3,120.00	3,432,000
日本証券金融	400	611.00	244,400
アイフル	1,600	279.00	446,400
日本アジア投資	100	258.00	25,800
名古屋銀行	100	2,842.00	284,200
北洋銀行	1,400	237.00	331,800
愛媛銀行	100	1,001.00	100,100
京葉銀行	400	436.00	174,400
栃木銀行	500	180.00	90,000
東和銀行	200	695.00	139,000
福島銀行	100	275.00	27,500
リコーリース	100	3,300.00	330,000
イオンフィナンシャルサービス	600	1,397.00	838,200
アコム	1,900	473.00	898,700
ジャックス	100	2,083.00	208,300
オリエントコーポレーション	2,500	154.00	385,000
日立キャピタル	200	2,904.00	580,800
オリックス	5,800	1,784.00	10,347,200
三菱UFJリース	2,100	573.00	1,203,300
ジャフコグループ	100	6,860.00	686,000
トモニホールディングス	700	312.00	218,400
大和証券グループ本社	7,000	529.00	3,703,000
野村ホールディングス	14,300	632.10	9,039,030
岡三証券グループ	800	418.00	334,400
丸三証券	300	625.00	187,500
東洋証券	300	187.00	56,100
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,000	388.00	388,000
水戸証券	300	305.00	91,500
いちよし証券	200	637.00	127,400
松井証券	500	926.00	463,000
SOMPOホールディングス	1,700	4,124.00	7,010,800
日本取引所グループ	2,500	2,405.50	6,013,750
マネックスグループ	800	974.00	779,200
極東証券	100	831.00	83,100
岩井コスモホールディングス	100	1,597.00	159,700
藍澤証券	200	880.00	176,000
フィデアホールディングス	900	125.00	112,500
池田泉州ホールディングス	1,100	163.00	179,300
アニコムホールディングス	300	1,078.00	323,400

MS & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	2,300	3,133.00	7,205,900	
マネーパートナーズグループ	100	333.00	33,300	
スパークス・グループ	400	337.00	134,800	
第一生命ホールディングス	4,900	1,902.00	9,319,800	
東京海上ホールディングス	3,100	5,351.00	16,588,100	
イー・ギャランティ	100	2,172.00	217,200	
T & Dホールディングス	2,800	1,467.00	4,107,600	
三井不動産	4,300	2,395.00	10,298,500	
三菱地所	6,200	1,849.50	11,466,900	
平和不動産	200	3,575.00	715,000	
東京建物	900	1,560.00	1,404,000	
ダイビル	200	1,304.00	260,800	
京阪神ビルディング	200	1,535.00	307,000	
住友不動産	2,100	3,675.00	7,717,500	
テーオーシー	200	780.00	156,000	
レオパレス21	800	130.00	104,000	
スターツコーポレーション	100	2,896.00	289,600	
フジ住宅	100	654.00	65,400	
空港施設	100	524.00	52,400	
ゴールドクレスト	100	1,719.00	171,900	
リログループ	500	2,572.00	1,286,000	
日神グループホールディングス	100	441.00	44,100	
日本エスコン	200	769.00	153,800	
タカラレーベン	400	350.00	140,000	
A V A N T I A	100	889.00	88,900	
イオンモール	500	1,863.00	931,500	
ランド	5,100	10.00	51,000	
カチタス	200	3,025.00	605,000	
東祥	100	1,990.00	199,000	
トーセイ	100	1,027.00	102,700	
サンフロンティア不動産	100	928.00	92,800	
エフ・ジェー・ネクスト	100	1,126.00	112,600	
グランディハウス	100	457.00	45,700	
東武鉄道	1,000	3,040.00	3,040,000	
相鉄ホールディングス	300	2,473.00	741,900	
東急	2,400	1,453.00	3,487,200	
京浜急行電鉄	1,200	1,807.00	2,168,400	
小田急電鉄	1,500	3,225.00	4,837,500	
京王電鉄	500	8,380.00	4,190,000	
京成電鉄	700	3,790.00	2,653,000	
富士急行	100	5,790.00	579,000	
東日本旅客鉄道	1,700	7,625.00	12,962,500	
西日本旅客鉄道	800	6,312.00	5,049,600	
東海旅客鉄道	800	17,600.00	14,080,000	
西武ホールディングス	1,100	1,298.00	1,427,800	
鴻池運輸	200	1,090.00	218,000	
西日本鉄道	300	3,015.00	904,500	
ハマキョウレックス	100	3,345.00	334,500	
近鉄グループホールディングス	900	4,560.00	4,104,000	



阪急阪神ホールディングス	1,200	3,625.00	4,350,000
南海電気鉄道	400	2,611.00	1,044,400
京阪ホールディングス	400	4,910.00	1,964,000
名古屋鉄道	700	2,763.00	1,934,100
山陽電気鉄道	100	1,995.00	199,500
日本通運	300	7,990.00	2,397,000
ヤマトホールディングス	1,300	2,854.00	3,710,200
山九	200	4,470.00	894,000
日新	100	1,391.00	139,100
丸運	100	256.00	25,600
丸全昭和運輸	100	3,130.00	313,000
センコーグループホールディングス	500	1,040.00	520,000
ニッコンホールディングス	300	2,154.00	646,200
福山通運	100	4,335.00	433,500
セイノーホールディングス	700	1,534.00	1,073,800
日立物流	200	3,355.00	671,000
丸和運輸機関	200	2,177.00	435,400
C & F ロジホールディングス	100	1,796.00	179,600
日本郵船	800	3,055.00	2,444,000
商船三井	500	3,355.00	1,677,500
川崎汽船	300	2,065.00	619,500
明治海運	100	380.00	38,000
飯野海運	400	453.00	181,200
九州旅客鉄道	700	2,553.00	1,787,100
S Gホールディングス	1,700	2,655.00	4,513,500
日本航空	2,200	2,416.00	5,315,200
A N Aホールディングス	2,400	2,550.50	6,121,200
国際紙バルブ商事	200	244.00	48,800
ブックオフグループホールディングス	100	886.00	88,600
三菱倉庫	300	3,390.00	1,017,000
三井倉庫ホールディングス	100	2,240.00	224,000
住友倉庫	300	1,463.00	438,900
東陽倉庫	200	332.00	66,400
日本トランスシティ	200	569.00	113,800
中央倉庫	100	1,183.00	118,300
安田倉庫	100	946.00	94,600
宇徳	100	466.00	46,600
上組	500	2,008.00	1,004,000
近鉄エクスプレス	200	2,771.00	554,200
東海運	100	320.00	32,000
エーアイティー	100	1,072.00	107,200
T B Sホールディングス	600	2,053.00	1,231,800
日本テレビホールディングス	800	1,417.00	1,133,600
朝日放送グループホールディングス	100	723.00	72,300
テレビ朝日ホールディングス	300	2,164.00	649,200
スカパーJ S A Tホールディングス	600	460.00	276,000
テレビ東京ホールディングス	100	2,482.00	248,200
ビジョン	100	989.00	98,900
コネクシオ	100	1,396.00	139,600
日本通信	800	258.00	206,400

日本電信電話	10,900	2,818.50	30,721,650
KDDI	7,500	3,391.00	25,432,500
ソフトバンク	8,500	1,448.00	12,308,000
光通信	100	21,200.00	2,120,000
エムティーアイ	100	859.00	85,900
GMOインターネット	300	3,645.00	1,093,500
KADOKAWA	300	4,180.00	1,254,000
学研ホールディングス	100	1,585.00	158,500
ゼンリン	200	1,355.00	271,000
インプレスホールディングス	100	197.00	19,700
東京電力ホールディングス	8,100	358.00	2,899,800
中部電力	2,900	1,322.50	3,835,250
関西電力	3,600	1,072.50	3,861,000
中国電力	1,400	1,304.00	1,825,600
北陸電力	900	674.00	606,600
東北電力	2,200	945.00	2,079,000
四国電力	800	761.00	608,800
九州電力	2,100	930.00	1,953,000
北海道電力	900	465.00	418,500
沖縄電力	200	1,457.00	291,400
電源開発	800	1,761.00	1,408,800
エフオン	100	1,048.00	104,800
イーレックス	100	1,735.00	173,500
レノバ	200	3,375.00	675,000
東京瓦斯	1,800	2,313.00	4,163,400
大阪瓦斯	1,700	1,964.00	3,338,800
東邦瓦斯	500	6,470.00	3,235,000
北海道瓦斯	100	1,607.00	160,700
広島ガス	200	381.00	76,200
西部瓦斯	100	2,936.00	293,600
静岡ガス	300	957.00	287,100
メタウォーター	100	2,180.00	218,000
松竹	100	15,630.00	1,563,000
東宝	500	4,230.00	2,115,000
エイチ・アイ・エス	100	2,353.00	235,300
エヌ・ティ・ティ・データ	2,500	1,617.00	4,042,500
共立メンテナンス	200	3,890.00	778,000
イチネンホールディングス	100	1,330.00	133,000
建設技術研究所	100	2,384.00	238,400
スペース	100	883.00	88,300
アインホールディングス	100	7,140.00	714,000
東京都競馬	100	4,810.00	481,000
カナモト	200	2,398.00	479,600
DTS	200	2,406.00	481,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	400	6,510.00	2,604,000
シーイーシー	100	1,465.00	146,500
カプコン	400	6,700.00	2,680,000
西尾レントオール	100	2,704.00	270,400

アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	500	26.00	13,000	
日本空港ビルデング	300	5,230.00	1,569,000	
トランス・コスモス	100	2,772.00	277,200	
乃村工藝社	400	822.00	328,800	
ジャステック	100	1,252.00	125,200	
S C S K	200	6,560.00	1,312,000	
日本管財	100	2,127.00	212,700	
トーカイ	100	2,232.00	223,200	
セコム	900	9,677.00	8,709,300	
アイネス	100	1,397.00	139,700	
丹青社	200	823.00	164,600	
メイテック	100	5,830.00	583,000	
T K C	100	6,660.00	666,000	
富士ソフト	100	5,620.00	562,000	
応用地質	100	1,267.00	126,700	
船井総研ホールディングス	200	2,299.00	459,800	
N S D	300	1,914.00	574,200	
オオバ	100	742.00	74,200	
コナミホールディングス	300	7,460.00	2,238,000	
ベネッセホールディングス	300	2,149.00	644,700	
イオンディライト	100	3,135.00	313,500	
ダイセキ	200	3,465.00	693,000	
日鉄物産	100	3,935.00	393,500	
トラスコ中山	200	2,667.00	533,400	
ヤマダホールディングス	3,100	542.00	1,680,200	
オートバックスセブン	300	1,431.00	429,300	
モリト	100	614.00	61,400	
アークランドサカモト	100	1,613.00	161,300	
ニトリホールディングス	400	20,685.00	8,274,000	
グルメ杵屋	100	985.00	98,500	
愛眼	100	230.00	23,000	
吉野家ホールディングス	300	2,205.00	661,500	
加藤産業	100	3,695.00	369,500	
イノテック	100	1,243.00	124,300	
イエローハット	200	1,745.00	349,000	
J B C Cホールディングス	100	1,459.00	145,900	
J Kホールディングス	100	813.00	81,300	
サガミホールディングス	100	1,167.00	116,700	
日伝	100	2,199.00	219,900	
関西スーパーマーケット	100	1,145.00	114,500	
ミロク情報サービス	100	2,246.00	224,600	
北沢産業	100	270.00	27,000	
因幡電機産業	200	2,550.00	510,000	
王将フードサービス	100	5,850.00	585,000	
プレナス	100	1,923.00	192,300	
ミニストップ	100	1,429.00	142,900	
アークス	200	2,404.00	480,800	
パローホールディングス	200	2,347.00	469,400	
ミスミグループ本社	1,200	3,455.00	4,146,000	

アルテック	100	290.00	29,000	
ファーストリテイリング	100	104,900.00	10,490,000	
ソフトバンクグループ	7,400	10,530.00	77,922,000	
スズケン	400	4,265.00	1,706,000	
サンドラッグ	400	4,060.00	1,624,000	
サクスパー ホールディングス	100	639.00	63,900	
ジェコス	100	960.00	96,000	
グローセル	100	509.00	50,900	
ベルーナ	200	1,037.00	207,400	
合計	985,700		2,495,973,460	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

- ( 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)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33期中間計算期間(2021年2月23日から2021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。

## 【中間財務諸表】

## 【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32期 2021年2月22日現在	第33期中間計算期間末 2021年8月22日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,732,876	1,762,630
親投資信託受益証券	527,423,387	497,823,411
流動資産合計	529,156,263	499,586,041
資産合計	529,156,263	499,586,041
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	276,733	282,312
未払委託者報酬	1,383,875	1,411,708
未払利息	-	2
その他未払費用	3,852	3,915
流動負債合計	1,664,460	1,697,937
負債合計	1,664,460	1,697,937
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	567,195,150	546,852,537
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	39,703,347	48,964,433
(分配準備積立金)	226,570,759	218,444,752
元本等合計	527,491,803	497,888,104
純資産合計	527,491,803	497,888,104
負債純資産合計	529,156,263	499,586,041

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第32期中間計算期間 自 2020年2月26日 至 2020年8月25日	第33期中間計算期間 自 2021年2月23日 至 2021年8月22日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	8,049,343	8,690,976
<b>営業収益合計</b>	<b>8,049,343</b>	<b>8,690,976</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	99	17
受託者報酬	254,117	282,312
委託者報酬	1,270,773	1,411,708
その他費用	3,567	3,915
<b>営業費用合計</b>	<b>1,528,556</b>	<b>1,697,952</b>
営業利益又は営業損失( )	6,520,787	10,388,928
経常利益又は経常損失( )	6,520,787	10,388,928
中間純利益又は中間純損失( )	6,520,787	10,388,928
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	917,778	296,125
期首剰余金又は期首欠損金( )	157,610,584	39,703,347
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,102,288	1,423,967
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,102,288	1,423,967
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	306,071	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	306,071	-
<b>分配金</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
中間剰余金又は中間欠損金( )	143,375,802	48,964,433

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第33期中間計算期間	
	自	至
	2021年2月23日	2021年8月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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、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)

項目	第32期	第33期中間計算期間末
	2021年2月22日現在	2021年8月22日現在
1. 期首元本額	664,937,247円	567,195,150円
期中追加設定元本額	834,462円	-円
期中一部解約元本額	98,576,559円	20,342,613円
2. 受益権の総数	567,195,150口	546,852,537口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は39,703,347円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は48,964,433円であります。

(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

項目	第32期	第33期中間計算期間末
	2021年2月22日現在	2021年8月22日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、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	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左



3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	---	----

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第32期 2021年2月22日現在	第33期中間計算期間末 2021年8月22日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9300円 (9,300円)	0.9105円 (9,105円)

(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、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

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)

2021年8月22日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	87,605,075
株式	2,325,684,690
未収配当金	2,911,144
前払金	1,905,000
差入委託証拠金	3,120,000
流動資産合計	2,421,225,909
資産合計	2,421,225,909
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,466,320
未払利息	120
流動負債合計	2,466,440
負債合計	2,466,440
純資産の部	
元本等	
元本	919,187,382
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,499,572,087
元本等合計	2,418,759,469
純資産合計	2,418,759,469
負債純資産合計	2,421,225,909

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年2月23日 至 2021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、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	2021年8月22日現在
1. 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	952,244,011円
同期中追加設定元本額	23,618,872円
同期中一部解約元本額	56,675,501円
元本の内訳	
ファンド名	
ニュー トピックス インデックス	189,185,761円
新光7資産バランスファンド	239,469,774円
ニュー トピックス インデックス(変額年金)	66,508,265円
世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	343,301,974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)	13,969,349円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	23,898,694円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	10,230,158円
グローバル・ナビ	15,797,403円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	4,179,996円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	11,841,771円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	804,237円
計	919,187,382円
2. 受益権の総数	919,187,382口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年8月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	2021年8月22日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	77,725,000	-	75,260,000	2,465,000
合計	77,725,000	-	75,260,000	2,465,000

## (注)時価の算定方法

## 株価指数先物取引

- 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。  
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	2021年8月22日現在
1口当たり純資産額	2.6314円
(1万口当たり純資産額)	(26,314円)

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2021年8月31日現在

資産総額	518,999,014円
負債総額	281,652円
純資産総額( - )	518,717,362円
発行済数量	546,642,199口
1口当たり純資産額( / )	0.9489円

(参考)

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

2021年8月31日現在

資産総額	2,520,186,855円
負債総額	227,000円
純資産総額( - )	2,519,959,855円
発行済数量	918,700,806口
1口当たり純資産額( / )	2.7430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ます。

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

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

### (5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6) 受益権の再分割

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

### (7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額（2021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カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構（2021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）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っています。

2021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	26	1,416,324,156,163
追加型株式投資信託	830	15,897,211,446,199
単位型公社債投資信託	28	61,097,291,401
単位型株式投資信託	217	1,337,529,201,064
合計	1,101	18,712,162,094,827



### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第36期事業年度(自2020年4月1日至2021年3月31日)の財務諸表について、EY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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	32,932,013	36,734,502
金銭の信託	28,548,165	25,670,526
有価証券	996	-
未収委託者報酬	11,487,393	16,804,456
未収運用受託報酬	4,674,225	5,814,654
未収投資助言報酬	331,543	317,567
未収収益	11,674	7,412
前払費用	480,129	724,591
その他	2,815,351	2,419,487
流動資産計	81,281,494	88,493,198
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 1,006,793	1 915,815
器具備品	1 270,768	1 202,902
建設仮勘定	894	609
無形固定資産		
ソフトウェア	3,299,065	2,878,179
ソフトウェア仮勘定	221,784	1,109,723
電話加入権	3,931	3,931
投資その他の資産		
投資有価証券	261,361	261,360
関係会社株式	5,299,196	5,299,196
長期差入保証金	1,302,402	1,324,203
繰延税金資産	2,508,004	3,676,823
その他	111,162	591,970
固定資産計	14,285,364	16,264,717
資産合計	95,566,859	104,757,915

(単位:千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	3,702,906	3,730,283
未払金	4,803,140	7,337,541
未払収益分配金	966	846
未払償還金	9,999	9,999
未払手数料	4,582,140	6,889,193
その他未払金	210,034	437,502
未払費用	6,673,320	9,713,972
未払法人税等	4,090,268	4,199,922
未払消費税等	1,338,183	2,106,617
賞与引当金	1,373,328	1,789,597
役員賞与引当金	65,290	76,410
流動負債計	22,046,438	28,954,345
固定負債		
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
時効後支払損引当金	174,139	157,945
固定負債計	2,293,087	2,450,431
負債合計	24,339,526	31,404,777
(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	49,674,383	51,800,187
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	49,551,090	51,676,893
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	17,871,090	19,996,893
株主資本計	71,227,341	73,353,144
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	7	6
評価・換算差額等計	7	6
純資産合計	71,227,333	73,353,137
負債・純資産合計	95,566,859	104,757,915

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	84,426,075		89,905,293	
運用受託報酬	16,912,305		17,640,234	
投資助言報酬	1,208,954		1,103,477	
その他営業収益	68,156		781,735	
営業収益計		102,615,492		109,430,741
営業費用				
支払手数料	34,980,736		37,003,102	
広告宣伝費	340,791		424,598	
公告費	375		400	
調査費	25,132,268		30,794,092	
調査費	10,586,542		11,302,420	
委託調査費	14,545,725		19,491,671	
委託計算費	698,723		543,135	
営業雑経費	990,002		938,891	
通信費	44,209		46,358	
印刷費	738,330		680,272	
協会費	71,386		71,361	
諸会費	22,790		23,936	
支払販売手数料	113,286		116,962	
営業費用計		62,142,897		69,704,220
一般管理費				
給料	10,817,861		10,586,117	
役員報酬	174,795		163,394	
給料・手当	9,087,800		9,030,562	
賞与	1,555,264		1,392,160	
交際費	40,436		8,168	
寄付金	8,906		7,757	
旅費交通費	320,037		50,081	
租税公課	651,265		912,570	
不動産賃借料	1,479,503		1,499,753	
退職給付費用	505,189		524,845	
固定資産減価償却費	882,526		1,078,185	
福利厚生費	44,352		44,004	
修繕費	1,843		777	
賞与引当金繰入額	1,373,328		1,789,597	
役員賞与引当金繰入額	65,290		76,410	
機器リース料	233		208	
事務委託費	3,625,424		3,793,883	
事務用消耗品費	104,627		68,534	
器具備品費	1,620		548	
諸経費	197,094		152,830	
一般管理費計		20,119,543		20,594,276
営業利益		20,353,050		19,132,244

(単位:千円)

	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	4,440		27,079	
受取配当金	11,185		2,356	
時効成立分配金・償還金	49,164		362	
投資信託償還益	5,528		-	
為替差益	-		7,314	
金銭の信託運用益	-		1,229,697	
受取負担金	297,886		-	
雑収入	7,394		13,505	
時効後支払損引当金戻入額	3,473		13,011	
営業外収益計		379,073		1,293,326
営業外費用				
為替差損	19,750		-	
投資信託償還損	1		3	
金銭の信託運用損	169,505		-	
システム解約料	31,680		-	
早期割増退職金	-		48,755	
雑損失	104		5	
営業外費用計		221,042		48,764
経常利益		20,511,082		20,376,806
特別利益				
投資有価証券売却益	1,169,758		-	
特別利益計		1,169,758		-
特別損失				
固定資産除却損	1 16,085		1 1,511	
特別損失計		16,085		1,511
税引前当期純利益		21,664,754		20,375,294
法人税、住民税及び事業税		7,045,579		7,418,311
法人税等調整額		385,835		1,168,820
法人税等合計		6,659,743		6,249,491
当期純利益		15,005,011		14,125,803

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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				株主資本 合計
		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		利益剰余金 合計	
						別途 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	31,680,000	14,146,079	45,949,372	67,502,329
当期変動額									
剰余金の配当							11,280,000	11,280,000	11,280,000
当期純利益							15,005,011	15,005,011	15,005,011
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,725,011	3,725,011	3,725,011
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	846,755	846,755	68,349,085
当期変動額			
剰余金の配当			11,280,000
当期純利益			15,005,011
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	846,763	846,763	846,763
当期変動額合計	846,763	846,763	2,878,247
当期末残高	7	7	71,227,333

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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				株主資本 合計
		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		利益剰余金 合計	
						別途 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	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341
当期変動額									
剰余金の配当							12,000,000	12,000,000	12,000,000
当期純利益							14,125,803	14,125,803	14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,125,803	2,125,803	2,125,803
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	19,996,893	51,800,187	73,353,144

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	7	7	71,227,333
当期変動額			
剰余金の配当			12,000,000
当期純利益			14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	1	1	1
当期変動額合計	1	1	2,125,804
当期末残高	6	6	73,353,137

## 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、2016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）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、それぞれ発生翌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>
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。



(未適用の会計基準等)

## 1. 収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)

### (1) 概要

国際会計基準審議会( IASB )及び米国財務会計基準審議会( FASB )は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、2014年5月に「顧客との契約から生じる収益」( IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic 606 )を公表しており、IFRS第15号は2018年1月1日以後開始する事業年度から、Topic 606は2017年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわせない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

### (2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

## 2. 時価の算定に関する会計基準等

- ・「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)

### (1) 概要

国際会計基準審議会( IASB )及び米国財務会計基準審議会( FASB )が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス(国際財務報告基準( IFRS )においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」)を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされています。

### (2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

**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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
建物	320,020	407,133
器具備品	949,984	978,763

(損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第35期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)	第36期 (自2020年4月1日 至2021年3月31日)
建物	-	944
器具備品	9,609	566
ソフトウエア	6,475	-

(株主資本等変動計算書関係)

第35期(自2019年4月1日至2020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
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21日
	A種種類 株式				

## (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
2020年6月17日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種 類株式					

## 第36期(自2020年4月1日至2021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
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種類 株式				

(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  
2021年6月16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
2021年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種 類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

有価証券及び投資有価証券は、主にその他有価証券（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あります。

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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おります。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

取引実行担当所管からの報告に基づき、資金管理担当所管が資金繰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35期(2020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	32,932,013	32,932,013	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	28,548,165	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	11,487,393	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	4,674,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	2,988	2,988	-
資産計	77,644,787	77,644,787	-
(1) 未払手数料	4,582,140	4,582,140	-
負債計	4,582,140	4,582,140	-

第36期(2021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	36,734,502	36,734,502	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	25,670,526	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	16,804,456	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	5,814,654	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	1,990	1,990	-
資産計	85,026,130	85,026,130	-
(1) 未払手数料	6,889,193	6,889,193	-
負債計	6,889,193	6,889,193	-

(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、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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
非上場株式	259,369	259,369
関係会社株式	5,299,196	5,299,196

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 其他有価証券」には含めておりません。

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 第35期(2020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	32,932,013	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	996	994	997	-

## 第36期(2021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	36,734,502	-	-	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1,990	-	-

## (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35期の貸借対照表計上額5,299,196千円、第36期の貸借対照表計上額5,299,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

## 2. その他有価証券

第35期(2020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	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計			
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	2,988	3,000	11
小計	2,988	3,000	11
合計	2,988	3,000	11

(注)非上場株式(貸借対照表計上額259,369千円)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36期(2021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	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計			
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	1,990	2,000	9
小計	1,990	2,000	9
合計	1,990	2,000	9

(注)非上場株式(貸借対照表計上額259,369千円)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35期（自 2019年4月1日 至 2020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	1,298,377	1,169,758	-
投資信託	159,526	5,528	1

## 第36期（自 2020年4月1日 至 2021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	996	-	3

（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、償還によるものであります。

## （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。

## 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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,289,044	2,422,901
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の発生額	18,448	4,319
退職給付の支払額	187,749	245,143
過去勤務費用の発生額	-	1,567
その他	1,476	1,567
退職給付債務の期末残高	2,422,901	2,479,619

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

(千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未積立退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未認識数理計算上の差異	130,155	84,264
未認識過去勤務費用	173,798	102,868
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486



## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の費用処理額	38,861	41,571
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,362
その他	11,303	7,720
確定給付制度に係る退職給付費用	401,711	409,394

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、当事業年度において48,755千円を営業外費用に計上しております。

## (4) 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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	1.00% ~ 3.76%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度103,477千円、当事業年度100,806千円であります。

## (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35期	第36期
	(2020年3月31日現在)	(2021年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	221,053	260,377
未払事業所税	10,778	10,711
賞与引当金	420,513	547,974
未払法定福利費	78,439	92,748
未払給与	10,410	8,535
受取負担金	47,781	-
運用受託報酬	331,395	1,410,516
資産除去債務	14,116	18,079
減価償却超過額(一括償却資産)	50,942	25,808
減価償却超過額	82,684	51,986
繰延資産償却超過額(税法上)	323,132	301,965
退職給付引当金	648,821	701,959
時効後支払損引当金	53,321	48,362
ゴルフ会員権評価損	7,360	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
その他	11,532	5,283
その他有価証券評価差額金	3	2
繰延税金資産小計	2,508,004	3,676,823
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,508,004	3,676,823
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	2,508,004	3,676,823

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、2016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、2016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

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(\*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 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

## (2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

## (3) 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。

## (4) 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

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	94,605,736千円	84,609,003千円
資産合計	94,605,736千円	84,609,003千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	8,278,713千円	5,570,814千円
負債合計	8,278,713千円	5,570,814千円
純資産	86,327,023千円	79,038,188千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。

のれん	62,885,491千円	59,074,249千円
顧客関連資産	34,810,031千円	29,793,358千円

## (2) 損益計算書項目

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	8,954,439千円	8,823,626千円
経常利益	8,954,439千円	8,823,626千円
税引前当期純利益	9,111,312千円	8,823,626千円
当期純利益	7,536,465千円	7,288,834千円
1株当たり当期純利益	188,411円64銭	182,220円85銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,149,555千円	5,016,672千円

(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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)及び第36期(自 2020年4月1日 至 2021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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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	5,793,912	未払 手数料	1,112,061
	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	10,294,840	未払 手数料	1,231,431

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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	6,435,839	未払 手数料	1,457,765
	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	12,767,199	未払 手数料	2,524,882

## 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) 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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	1,780,683円32銭	1,833,828円44銭
1株当たり当期純利益金額	375,125円27銭	353,145円08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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
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	15,005,011千円	14,125,803千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510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) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記（3）（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

##### a. 名称

三井住友信託銀行株式会社

##### b. 資本金の額

2021年3月末日現在、342,037百万円

##### c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

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おります。
岡三にいがた証券株式会社	852	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2021年3月末日現在

( ) 新規の取得のお申込みのお取扱いを行っておりません。

### 2【関係業務の概要】

「受託会社」は以下の業務を行います。

- (1) 委託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。

### 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」と称して使用する場合があります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用する場合があります。

## 独立監査人の監査報告書

2021年5月26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  
東京事務所指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 丘本 正彦 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬 印

## 監査意見

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2020年4月1日から2021年3月31日までの第36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。

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2021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、全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。

## 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

## 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

#### 利害関係

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

以上

---

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

2021年4月2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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬 印  
業務執行社員

### 監査意見

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2020年2月26日から2021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。

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2021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、全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。

### 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、アセットマネジメントOne株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

### 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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 利害関係

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

以 上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2021年9月30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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬  
業務執行社員

## 中間監査意見

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2021年2月23日から2021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。

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2021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（2021年2月23日から2021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。

## 中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、アセットマネジメントOne株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。



監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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、監査人は、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。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。