

## 【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】	2019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】	継続募集額(2019年11月23日から2020年5月25日まで) 3兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

ニュー トピックス インデックス

(以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。)

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

(イ) 追加型株式投資信託(契約型)の受益権です。

(ロ) 当初元本は1口当たり1円です。

(ハ) アセットマネジメントOne株式会社(以下「委託者」または「委託会社」といいます。)の依頼により信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付け、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付けはありません。

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

### (3)【発行(売出)価額の総額】

3兆円を上限とします。

### (4)【発行(売出)価格】

(イ) 発行価格は、取得申込受付日の基準価額です。

なお、ファンドの基準価額については1万口当たりの価額を発表します。

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

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

### (5)【申込手数料】

申込手数料は、取得申込受付日の基準価額に、2.2%(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はいいです。

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はいいです。

#### （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】

2019年11月23日から2020年5月25日までです。

申込期間は上記期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

#### （8）【申込取扱場所】

申し込みの取扱場所（販売会社）については、下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

( 9 ) 【払込期日】

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

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

( 10 ) 【払込取扱場所】

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

( 11 ) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

( 12 ) 【その他】

(イ) 申込証拠金

ありません。

(ロ) 日本以外の地域における発行

ありません。

(ハ) 振替受益権について

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

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

a. ファンドの目的及び基本的性格

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

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

委託者は、受託者と合意のうえ、上記の限度額を変更することができます。

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類の定義

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

インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
---------	--

### 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般	<b>年1回</b>	グローバル		
大型株	年2回	<b>日本</b>		日経225
中小型株	年4回	北米		
債券 一般	年6回（隔月）	欧州	<b>ファミリーファンド</b>	
公債				<b>TOPIX</b>
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		
不動産投信	その他（ ）	中南米		その他 （ ）
		アフリカ		
<b>その他資産</b> <b>（投資信託証券</b> <b>（株式 一般））</b>		中近東（中東）	ファンド・オブ・ファンズ	
		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。

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

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

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

### 東証株価指数（TOPIX）とは

東証株価指数（TOPIX）は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての銘柄の時価総額を指数化し、株価の変動をとらえようとするものです。東証株価指数は、1968年1月4日（基準時）の時価総額を100として1969年7月1日から株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」といいます。）が算出・公表しています。

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

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

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

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

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

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

株東京証券取引所は、委託会社またはニュー トピックス インデックス マザーファン

ドおよびニュー トピックス インデックス マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

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

### 東証株価指数(TOPIX)の特徴

1. 東証第一部上場の全銘柄を対象として算出しますので、市場全体の動きを確実に表します。
2. 各銘柄の上場株式数を考慮していますので、一部の小型値がさ株の動きに影響されにくい性質です。

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

・東証株価指数(TOPIX)の算出方法	・基準時の時価総額の修正方法
$\text{毎日の指数} = \frac{\text{当日の時価総額}}{\text{基準時の時価総額}} \times 100$	$\text{修正後の基準時価総額} = \frac{\text{修正前日の時価総額} \pm \text{修正額}}{\text{修正前日の基準時価総額} \times \frac{\text{修正前日の時価総額}}{\text{修正前日の時価総額}}}$

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

## 分配方針

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

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

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

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

運用状況により分配金額は変動します。また、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

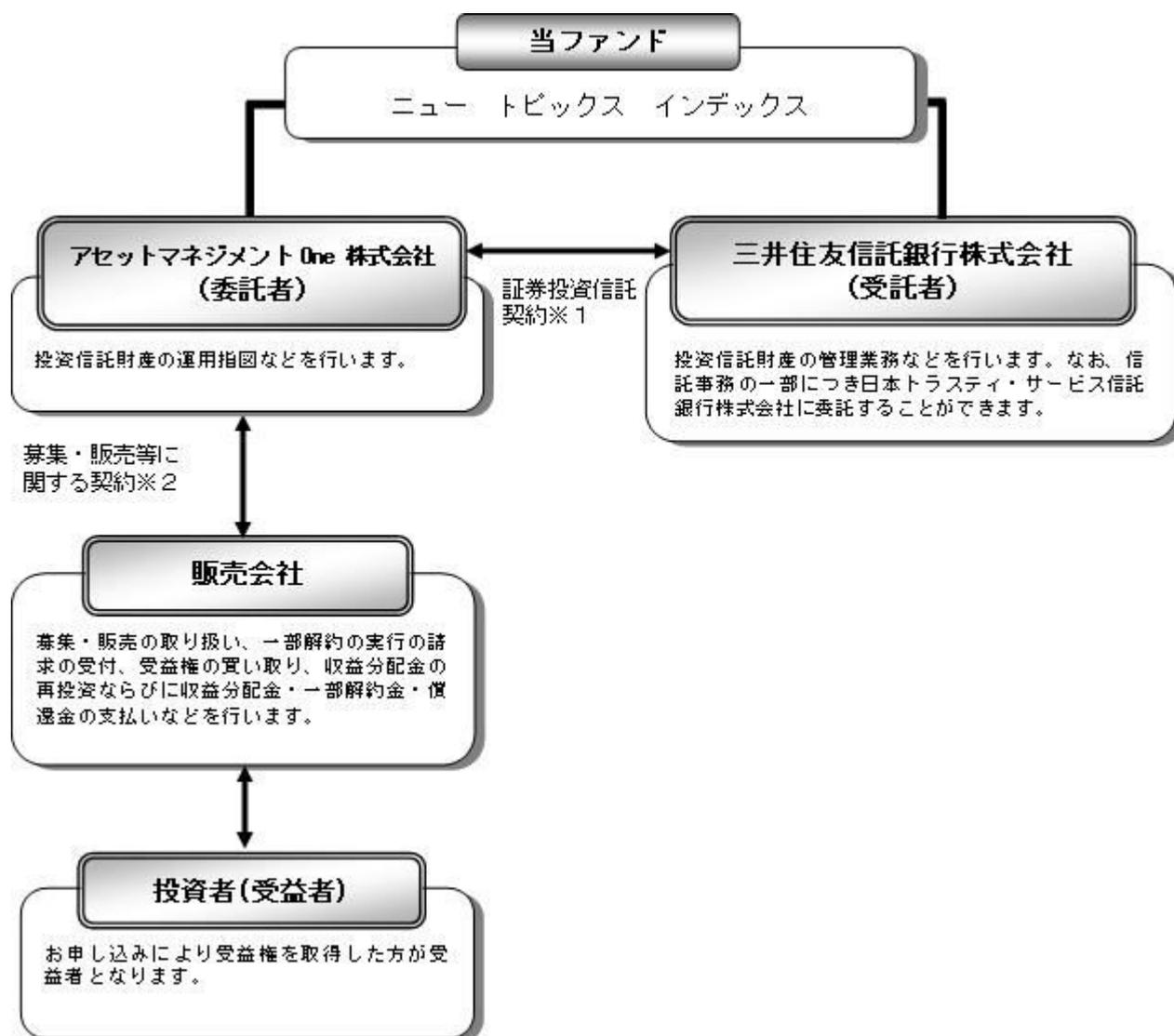
将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

### (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

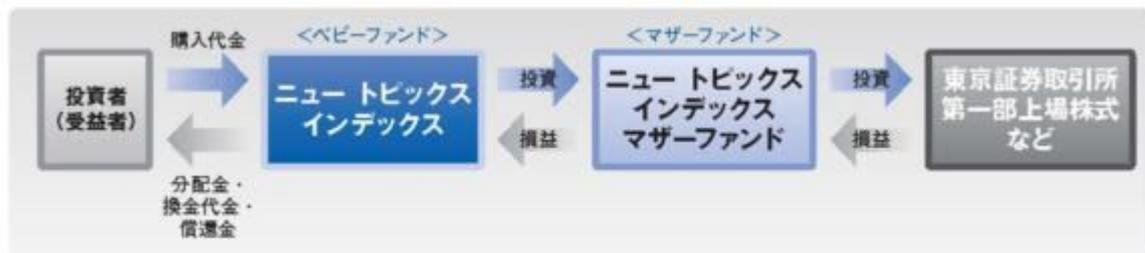
委託者と受託者との間において「証券投資信託契約（投資信託約款）」を締結しており、委託者および受託者の業務、受益者の権利、受益権、投資信託財産の運用・評価・管理、収益の分配、信託の期間・償還等を規定しています。

## 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（2019年8月30日現在）

### 委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブルユー・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月1日	DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

### 大株主の状況

（2019年8月30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。

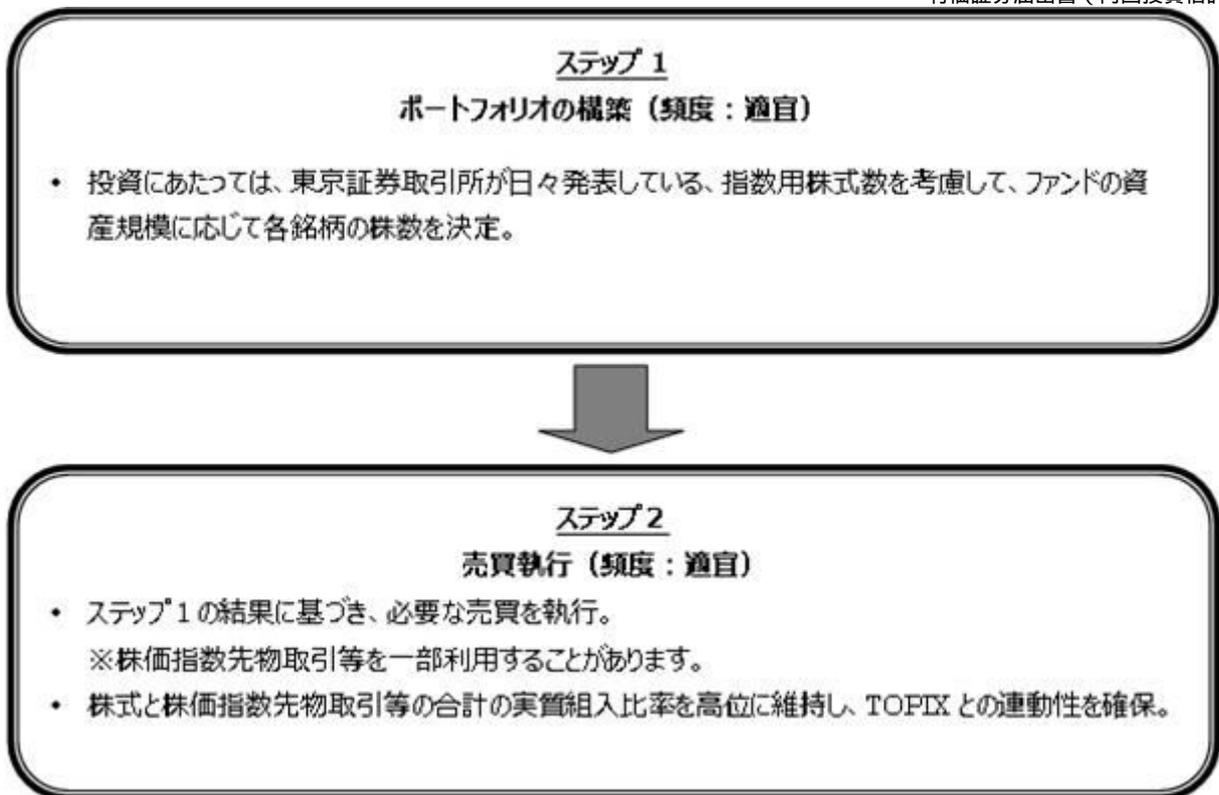
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### 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2019年8月30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す。）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す。）
- 5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、第1号の証券または証書を以下「株式」といいます。

### b．先物

- （イ）委託者は、投資信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所ならびに外国の市場における邦貨建ての株式、株価指数にかかる先物取引

(金融商品取引法第28条第8項第3号イおよびロに掲げるものをいいます。)およびオプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

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

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

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

#### c. スワップ

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

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

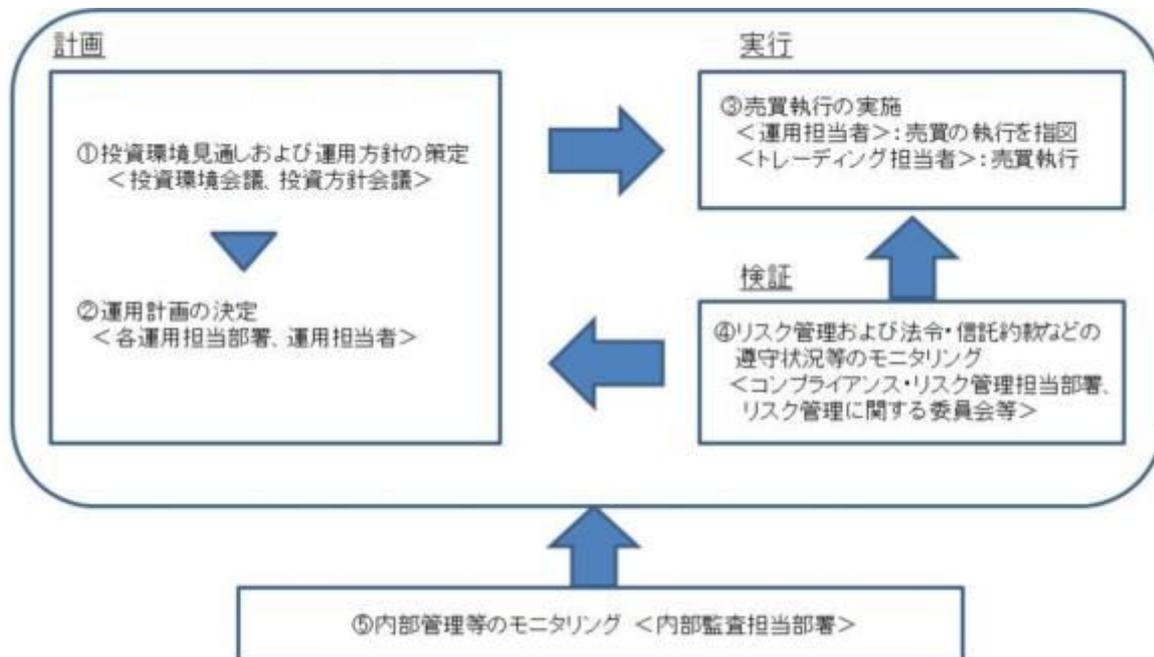
(ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

- (ホ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとしします。
- (ヘ) 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとしします。

### (3) 【運用体制】

#### a. ファンドの運用体制



#### 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

#### 運用計画の決定

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

#### 売買執行の実施

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

#### モニタリング

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

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

#### 内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2019年8月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

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

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

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

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

c. 毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

d. 「分配金受取コース」の受益者の分配金は原則として、決算日から起算して5営業日までに、受益者に支払われます。

「分配金再投資コース」の受益者の分配金は、税金を差し引いた後、別に定める契約に基づき、全額再投資されます。

(5) 【投資制限】

## 投資信託約款に定める投資制限

### a．株式への投資割合

株式への実質投資割合には制限を設けません。

### b．同一銘柄への投資割合

委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該株式の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

投資信託財産に属するとみなした額とは、投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

### c．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資は行いません。

### d．投資する株式の範囲

委託者が投資することを指図する株式は、わが国の取引所に上場されている株式の発行会社の発行する株式とします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。

### e．信用取引の指図範囲

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(ロ) 信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

- 1．投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
- 2．株式分割により取得する株券
- 3．有償増資により取得する株券
- 4．売出しにより取得する株券
- 5．投資信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。以下同じ。）の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
- 6．投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

### f．有価証券の貸し付けの指図および範囲

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式を下記(ロ)の範囲内で貸し付けの指図をすることができます。

(ロ) 株式の貸し付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

(ハ) 上記(ロ)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(ニ) 委託者は、有価証券の貸し付けにあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

### g．資金の借り入れ

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、投資信託財産において一部解約金の支払資金に不足額が生じるときは、資金借り入れの指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

(ロ) 資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受け取りの確定している資金の額の範囲内。
2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内。
3. 借入指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%以内。

(ハ) 借入期間は、有価証券等の売却代金の入金日までに限るものとします。

(ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

h. 受託者の自己または利害関係人等との取引

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

(ロ) 上記(イ)の取り扱いは、約款に定める範囲内での委託者の指図による取引についても同様とします。

i. デリバティブ取引等に係る投資制限

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

j. 信用リスク集中回避のための投資制限

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

法令に定める投資制限

a. 同一の法人の発行する株式

委託者は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託者に指図しないものとします。

(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのもつリスク

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

a. 株価変動リスク

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との間には若干のかい離が生ずることがあります。これは主に次の要因によるものです。

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

#### 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有価証券などに売買が生じた場合、その売買による組入有価証券などの価格の変化や売買手数料などの負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。これにより、マザーファンドの基準価額が下落した場合には、その影響を受け当ファンドの基準価額

が下落する可能性があります。

f．投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

- (イ) 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- (ロ) 有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴いません。
- (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。

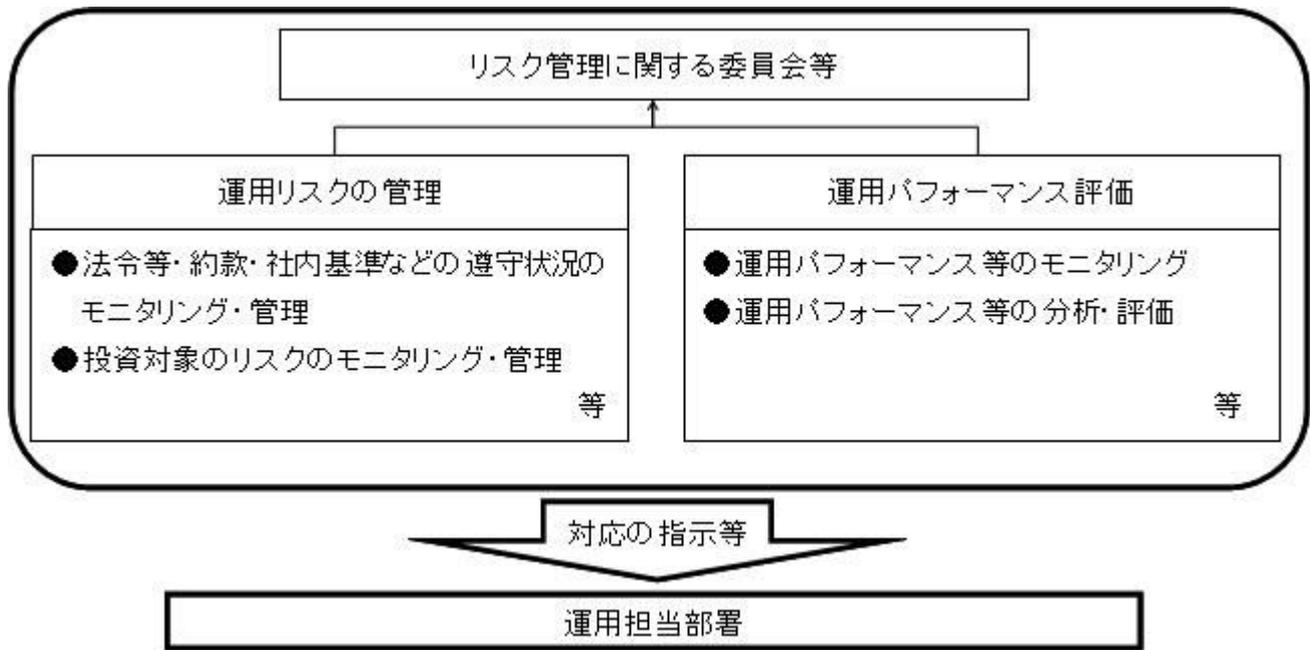
また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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。

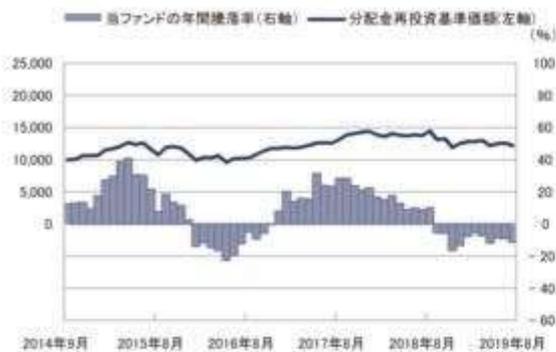


リスク管理体制は2019年8月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <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

2014年9月末～2019年8月末



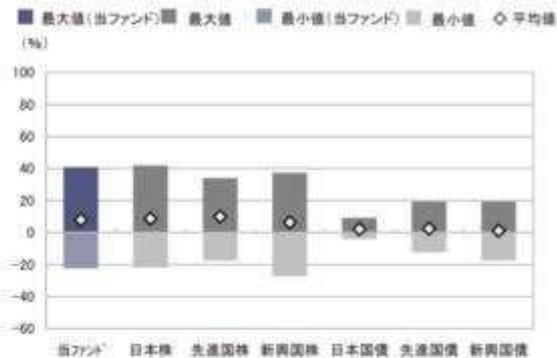
\*分配金再投資基準価額は、2014年9月末の基準価額を10,000として指数化しております。

\*年間騰落率は、2014年9月から2019年8月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

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

### 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

2014年9月末～2019年8月末



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	40.9	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値	△22.5	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	8.0	8.8	10.1	6.3	2.1	2.5	1.3

\*全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

\*2014年9月から2019年8月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

\*決算日に対応した数値とは異なります。

\*当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

### 各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。
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・ディバースィファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド」は、JPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(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。

## 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。

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。

2020年1月1日以降の分配時において、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、2019年8月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

c．個別元本について

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

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

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

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

d．収益分配金の課税について

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

ニュー トピックス インデックス

(令和 1年 8月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	485,084,013	99.91
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		398,540	0.08
純資産総額		485,482,553	100.00

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

(参考)ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(令和 1年 8月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	4,286,289,965	94.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		273,481,233	5.99
純資産総額		4,559,771,198	100.00

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

ニュー トピックス インデックス

イ. 評価額上位銘柄明細

(令和 1年 8月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	ニュー トピックス インデック ス マザーファンド	240,569,338	2.1176	509,429,631	2.0164	485,084,013	99.91

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

ロ. 種類別投資比率

(令和 1年 8月30日現在)

種類	投資比率(%)
----	---------

親投資信託受益証券	99.91
合計	99.91

## (参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

## イ. 評価額上位銘柄明細

(令和 1年 8月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	22,200	6,821.00	151,426,200	6,960.00	154,512,000	3.38
2	日本	株式	ソニー	電気機器	13,300	5,316.55	70,710,115	6,042.00	80,358,600	1.76
3	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	15,500	3,849.00	59,659,500	4,824.00	74,772,000	1.63
4	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	135,000	564.58	76,218,300	510.40	68,904,000	1.51
5	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	13,300	4,585.35	60,985,155	5,096.00	67,776,800	1.48
6	日本	株式	キーエンス	電気機器	1,000	53,560.00	53,560,000	62,900.00	62,900,000	1.37
7	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	17,400	4,468.53	77,752,422	3,590.00	62,466,000	1.36
8	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	13,800	3,818.00	52,688,400	3,484.00	48,079,200	1.05
9	日本	株式	KDDI	情報・通信業	16,000	2,663.72	42,619,520	2,835.00	45,360,000	0.99
10	日本	株式	任天堂	その他製品	1,100	30,330.00	33,363,000	40,290.00	44,319,000	0.97
11	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	13,600	2,852.00	38,787,200	3,219.00	43,778,400	0.96
12	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	16,800	3,170.00	53,256,000	2,523.50	42,394,800	0.92
13	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	266,500	174.09	46,394,985	154.70	41,227,550	0.90
14	日本	株式	第一三共	医薬品	5,700	3,632.00	20,702,400	7,018.00	40,002,600	0.87
15	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	7,000	5,185.00	36,295,000	5,472.00	38,304,000	0.84
16	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	1,800	23,790.00	42,822,000	21,015.00	37,827,000	0.82
17	日本	株式	花王	化学	4,800	7,475.00	35,880,000	7,674.00	36,835,200	0.80
18	日本	株式	信越化学工業	化学	3,400	8,610.00	29,274,000	10,715.00	36,431,000	0.79
19	日本	株式	ダイキン工業	機械	2,700	12,150.00	32,805,000	13,155.00	35,518,500	0.77
20	日本	株式	三菱商事	卸売業	13,700	3,091.00	42,346,700	2,585.00	35,414,500	0.77
21	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	3,500	9,945.00	34,807,500	10,115.00	35,402,500	0.77
22	日本	株式	ファナック	電気機器	1,900	17,185.00	32,651,500	18,455.00	35,064,500	0.76
23	日本	株式	資生堂	化学	4,000	6,103.14	24,412,560	8,690.00	34,760,000	0.76
24	日本	株式	HOYA	精密機器	4,000	6,412.00	25,648,000	8,649.00	34,596,000	0.75
25	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	2,200	11,100.00	24,420,000	15,470.00	34,034,000	0.74
26	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	12,400	2,575.00	31,930,000	2,682.00	33,256,800	0.72
27	日本	株式	日本電産	電気機器	2,400	12,290.00	29,496,000	13,855.00	33,252,000	0.72
28	日本	株式	日立製作所	電気機器	9,000	3,346.00	30,114,000	3,629.00	32,661,000	0.71
29	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	20,700	1,370.47	28,368,729	1,490.50	30,853,350	0.67
30	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	8,200	4,834.00	39,638,800	3,757.00	30,807,400	0.67

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

(令和1年8月30日現在)

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.25
		建設業	2.68
		食料品	3.82
		繊維製品	0.60
		パルプ・紙	0.22
		化学	6.82
		医薬品	5.37
		石油・石炭製品	0.50
		ゴム製品	0.72
		ガラス・土石製品	0.75
		鉄鋼	0.72
		非鉄金属	0.66
		金属製品	0.52
		機械	4.65
		電気機器	12.96
		輸送用機器	7.32
		精密機器	2.07
		その他製品	2.09
		電気・ガス業	1.62
		陸運業	4.52
		海運業	0.14
		空運業	0.51
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	8.46
		卸売業	4.58
		小売業	4.46
		銀行業	5.39
		証券、商品先物取引業	0.71
		保険業	2.16
その他金融業	1.06		
不動産業	2.39		
サービス業	4.85		
合計			94.00

## 【投資不動産物件】

ニュー トピックス インデックス

該当事項はありません。

（参考）ニュー トピックス インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

ニュー トピックス インデックス

該当事項はありません。

（参考）ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(令和 1年 8月30日現在)

資産の種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建		9日本円	138,667,916	135,900,000	2.98

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

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

ニュー トピックス インデックス

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第21計算期間末 （平成22年 2月22日）	679	679	0.3730	0.3730
第22計算期間末 （平成23年 2月22日）	726	727	0.3963	0.3968
第23計算期間末 （平成24年 2月22日）	593	593	0.3475	0.3475
第24計算期間末 （平成25年 2月22日）	642	642	0.4127	0.4127
第25計算期間末 （平成26年 2月24日）	730	730	0.5277	0.5277
第26計算期間末 （平成27年 2月23日）	760	761	0.6577	0.6587
第27計算期間末 （平成28年 2月22日）	578	578	0.5760	0.5760
第28計算期間末 （平成29年 2月22日）	634	634	0.7003	0.7003
第29計算期間末 （平成30年 2月22日）	613	613	0.7956	0.7956
第30計算期間末 （平成31年 2月22日）	528	528	0.7448	0.7448
平成30年 8月末日	599		0.7973	

9月末日	620	0.8412
10月末日	558	0.7618
11月末日	565	0.7715
12月末日	507	0.6922
平成31年 1月末日	515	0.7257
2月末日	528	0.7442
3月末日	525	0.7444
4月末日	532	0.7564
令和 1年 5月末日	491	0.7069
6月末日	503	0.7258
7月末日	502	0.7319
8月末日	485	0.7069

## 【分配の推移】

## ニュー トピックス インデックス

期	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第21計算期間	平成21年 2月24日～平成22年 2月22日	0.0000
第22計算期間	平成22年 2月23日～平成23年 2月22日	0.0005
第23計算期間	平成23年 2月23日～平成24年 2月22日	0.0000
第24計算期間	平成24年 2月23日～平成25年 2月22日	0.0000
第25計算期間	平成25年 2月23日～平成26年 2月24日	0.0000
第26計算期間	平成26年 2月25日～平成27年 2月23日	0.0010
第27計算期間	平成27年 2月24日～平成28年 2月22日	0.0000
第28計算期間	平成28年 2月23日～平成29年 2月22日	0.0000
第29計算期間	平成29年 2月23日～平成30年 2月22日	0.0000
第30計算期間	平成30年 2月23日～平成31年 2月22日	0.0000

## 【収益率の推移】

## ニュー トピックス インデックス

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

第28計算期間	平成28年 2月23日～平成29年 2月22日	21.6
第29計算期間	平成29年 2月23日～平成30年 2月22日	13.6
第30計算期間	平成30年 2月23日～平成31年 2月22日	6.4
第31中間計算期間	平成31年 2月23日～令和 1年 8月22日	6.0

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

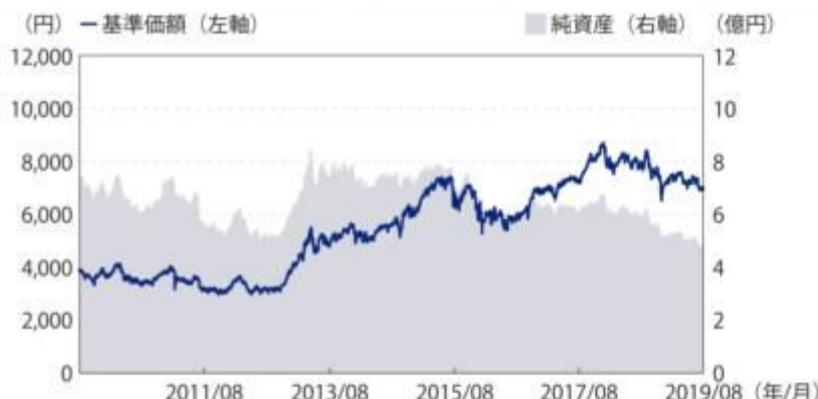
#### (4)【設定及び解約の実績】

##### ニュー トピックス インデックス

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第21計算期間	平成21年 2月24日～平成22年 2月22日	76,039,340	328,939,043
第22計算期間	平成22年 2月23日～平成23年 2月22日	296,866,516	285,394,408
第23計算期間	平成23年 2月23日～平成24年 2月22日	81,892,544	207,598,548
第24計算期間	平成24年 2月23日～平成25年 2月22日	40,997,313	190,689,671
第25計算期間	平成25年 2月23日～平成26年 2月24日	49,584,949	222,018,834
第26計算期間	平成26年 2月25日～平成27年 2月23日	51,024,990	279,051,207
第27計算期間	平成27年 2月24日～平成28年 2月22日	58,656,483	211,490,952
第28計算期間	平成28年 2月23日～平成29年 2月22日	36,193	97,137,242
第29計算期間	平成29年 2月23日～平成30年 2月22日	339,000	135,926,251
第30計算期間	平成30年 2月23日～平成31年 2月22日	1,897,256	63,352,275
第31中間計算期間	平成31年 2月23日～令和 1年 8月22日	355,692	23,303,963

#### 参考情報

## 基準価額・純資産の推移 (2009年9月1日～2019年8月30日)



## 分配の推移(税引前)

年	分配額 (円)
2019年 2月	0円
2018年 2月	0円
2017年 2月	0円
2016年 2月	0円
2015年 2月	10円
直近10年累計	15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。  
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

## 主要な資産の状況

## 資産配分

資産	純資産比率(%)
株式現物	93.92
その他資産	6.08
合計	100.00
株式先物	2.97

※マザーファンドの保有口数に基づき計算した実質組入比率を記載しています。

## 業種別配分(ニュートピックス インデックス マザーファンド)

業種	純資産比率(%)
電気機器	12.96
情報・通信業	8.46
輸送用機器	7.32
化学	6.82
銀行業	5.39
その他	53.03
合計	94.00

※東証33業種分類にしたがって記載しています。

※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

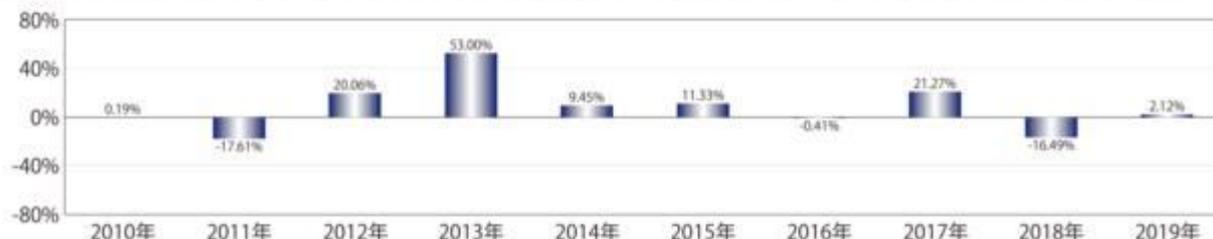
## 組入上位10銘柄(ニュートピックス インデックス マザーファンド)

銘柄名	業種	純資産比率(%)
トヨタ自動車	輸送用機器	3.38
ソニー	電気機器	1.76
ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.63
三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.51
日本電信電話	情報・通信業	1.48
キーエンス	電気機器	1.37
武田薬品工業	医薬品	1.36
三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.05
KDDI	情報・通信業	0.99
任天堂	その他製品	0.97

※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

組入銘柄数:1,713銘柄

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。  
 ※2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

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

○表中の純資産比率は小数第3位を切り捨てて求めたものであり、各比率の合計と合計欄の数値が一致しない場合があります。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

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

## 2【換金(解約)手続等】

### a. 一部解約(解約請求によるご解約)

- (イ) 受益者は、「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」の両コースとも、販売会社が定める単位で一部解約の実行を請求することができます。
- なお、受付は原則として営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合の申込受付日は翌営業日となります。ただし、受付時間は販売会社によって異なる場合があります。
- また、投資信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。
- 上記の解約単位は、解約時の最低申込単位であり、販売会社によって異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- (ロ) 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- (ハ) 委託者は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。また、社振法の規定にしたがい振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- (ニ) 一部解約の価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。
- 一部解約に関して課税対象者にかかる所得税および地方税(法人の受益者の場合は所得税のみ)に相当する金額が控除されます。
- なお、一部解約の価額は、毎営業日に算出されますので、販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

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

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

付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、当該計算日の基準価額とします。

#### b. 受益権の買い取り

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

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

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

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

< 買取請求時の税相当額 >

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

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

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

(ハ) 買取代金は、受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として4営業日目から販売会社において受益者に支払われます。

(ニ) 販売会社は、取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託者との協議に基づいて受益権の買い取りを中止することができます。

(ホ) 上記(ニ)により受益権の買い取りが中止された場合には、受益者は買取中止以前に行った当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、買取価額は、買取中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買い取りを受け付けたものとして、上記(ロ)の規定に準じて計算された価額とします。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

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

## &lt; 主な投資対象の時価評価方法の原則 &gt;

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

## (2) 【保管】

該当事項はありません。

## (3) 【信託期間】

当ファンドの信託期間は、原則として無期限です。

## (4) 【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年2月23日から翌年2月22日までとします。

上記にかかわらず、上記の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日以降の営業日で該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

## (5) 【その他】

## a. 信託の終了（投資信託契約の解約）

(イ) 委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより、受益権の総口数が10億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

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

(ロ) 委託者は、信託期間中において、この投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃の場合またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

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

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

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

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

約款第41条第3項から第5項までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを

得ない事情が生じている場合であって、一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

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

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

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

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

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

#### b. 投資信託約款の変更

(イ) 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

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

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

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

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

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

#### c. 異議申し立ておよび受益権の買取請求

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

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

#### d. 運用報告書

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

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

交付します。

e．公告

委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

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

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

f．委託者の事業の譲渡および承継に伴う取り扱い

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

委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この投資信託契約に関する事業を承継させることがあります。

g．信託事務処理の再信託

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

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

h．信託業務の委託等

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

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

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

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

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

i．関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

a．収益分配金請求権

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

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

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

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

b．償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

c．一部解約請求権

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

d．帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第30期計算期間(平成30年2月23日から平成31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29期 平成30年 2月22日現在	第30期 平成31年 2月22日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,788,664	2,189,761
親投資信託受益証券	612,831,262	528,226,008
流動資産合計	615,619,926	530,415,769
資産合計	615,619,926	530,415,769
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	347,549	301,944
未払委託者報酬	1,737,670	1,509,658
未払利息	4	3
その他未払費用	7,697	4,585
流動負債合計	2,092,920	1,816,190
負債合計	2,092,920	1,816,190
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	771,135,618	709,680,599
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	157,608,612	181,081,020
( 分配準備積立金 )	205,141,028	188,316,724
元本等合計	613,527,006	528,599,579
純資産合計	613,527,006	528,599,579
負債純資産合計	615,619,926	530,415,769

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第29期		第30期	
	自	平成29年 2月23日 至 平成30年 2月22日	自	平成30年 2月23日 至 平成31年 2月22日
営業収益				
有価証券売買等損益		85,378,630		33,565,254
その他収益		-		2,034
営業収益合計		85,378,630		33,563,220
営業費用				
支払利息		833		1,021
受託者報酬		682,108		627,836
委託者報酬		3,410,392		3,139,052
その他費用		35,338		9,734
営業費用合計		4,128,671		3,777,643
営業利益		81,249,959		37,340,863
経常利益		81,249,959		37,340,863
当期純利益		81,249,959		37,340,863
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		7,769,090		1,346,964
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		271,756,706		157,608,612
剰余金増加額又は欠損金減少額		40,738,653		12,950,461
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		40,738,653		12,950,461
剰余金減少額又は欠損金増加額		71,428		428,970
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		71,428		428,970
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		157,608,612		181,081,020

## （ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

区分	第30期 自 平成30年 2月23日 至 平成31年 2月22日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（ 貸借対照表に関する注記 ）

第29期 平成30年 2月22日現在	第30期 平成31年 2月22日現在
1. 計算期間末日における受益権の総数 771,135,618口	1. 計算期間末日における受益権の総数 709,680,599口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 157,608,612円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 181,081,020円
3. 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.7956円 (1万口当たり純資産額) (7,956円)	3. 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 0.7448円 (1万口当たり純資産額) (7,448円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

区分	第29期 自 平成29年 2月23日 至 平成30年 2月22日	第30期 自 平成30年 2月23日 至 平成31年 2月22日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（73,481,128円）、信託約款に定める収益調整金（98,605,363円）及び分配準備積立金（131,659,900円）より分配対象収益は303,746,391円（1万口当たり3,938.94円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、信託約款に定める収益調整金（91,223,094円）及び分配準備積立金（188,316,724円）より分配対象収益は279,539,818円（1万口当たり3,938.95円）であります。分配を行っておりません。

（ 金融商品に関する注記 ）

金融商品の状況に関する事項

区分	第29期 自 平成29年 2月23日 至 平成30年 2月22日	第30期 自 平成30年 2月23日 至 平成31年 2月22日

1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2.金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、親投資信託受益証券であり、株価変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。	同左
3.金融商品に係るリスクの管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。 リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。 市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。 信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。 流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。	同左
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

第29期 平成30年 2月22日現在	第30期 平成31年 2月22日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2.時価の算定方法	1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2.時価の算定方法

親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
---	----

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

	第29期 自 平成29年 2月23日 至 平成30年 2月22日	第30期 自 平成30年 2月23日 至 平成31年 2月22日
	該当事項はありません。	同左

## ( その他の注記 )

## 1 元本の移動

区分	第29期 平成30年 2月22日現在	第30期 平成31年 2月22日現在
期首元本額	906,722,869円	771,135,618円
期中追加設定元本額	339,000円	1,897,256円
期中一部解約元本額	135,926,251円	63,352,275円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第29期 平成30年 2月22日現在	第30期 平成31年 2月22日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	77,006,117	32,328,152
合計	77,006,117	32,328,152

## 3 デリバティブ取引等関係

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## ( 4 ) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	249,445,603	528,226,008	
合計		249,445,603	528,226,008	

（注1）券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）

当ファンドは、「ニュー トピックス インデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## ニュー トピックス インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

平成31年 2月22日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	188,185,620
株式	6,676,960,460
派生商品評価勘定	5,301,760
未収入金	64,935,289
未収配当金	11,353,354
流動資産合計	6,946,736,483
資産合計	
6,946,736,483	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,972
前受金	5,755,000
未払解約金	26,000,000
未払利息	300
流動負債合計	31,771,272
負債合計	
31,771,272	
純資産の部	

平成31年 2月22日現在

元本等	
元本	3,265,398,218
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,649,566,993
元本等合計	6,914,965,211
純資産合計	6,914,965,211
負債純資産合計	6,946,736,483

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成30年 2月23日 至 平成31年 2月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成31年 2月22日現在	
1. 担保資産	
先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り差入を行っております。	
株式	148,016,250円
2. 計算日における受益権の総数	3,265,398,218口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.1176円
(1万口当たり純資産額)	(21,176円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成30年 2月23日 至 平成31年 2月22日

1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため、デリバティブ取引を行っております。
2.金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、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。 当ファンドが投資している有価証券は、株式であり、株価変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。株価指数先物取引は株価の変動によるリスクを有しております。
3.金融商品に係るリスクの管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。 リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。 市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。 信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。 流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

平成31年 2月22日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
2.時価の算定方法	ん。
株式	「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。
派生商品評価勘定	「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりま
	す。

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成30年 2月23日 至 平成31年 2月22日
	該当事項はありません。

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成31年 2月22日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,427,162,088円
期中追加設定元本額	362,714,923円
期中一部解約元本額	1,524,478,793円
同期末における元本の内訳	
ニュー トピックス インデックス	249,445,603円
新光7資産バランスファンド	325,349,085円
ニュー トピックス インデックス（変額年金）	110,231,019円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	511,515,717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）	325,083,757円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	19,196,963円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	1,239,498,424円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	441,103,365円
グローバル・ナビ	20,211,430円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	5,136,236円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	15,553,418円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	3,073,201円
合計	3,265,398,218円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成31年 2月22日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	329,594,315
合計	329,594,315

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

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

種類	平成31年 2月22日現在		
	契約額等（円）	時価（円）	評価損益（円）
	うち1年超		

市場取引				
株価指数先物取引				
買建	203,559,212	-	208,845,000	5,285,788
東証株価指数先物	203,559,212	-	208,845,000	5,285,788
合計	203,559,212	-	208,845,000	5,285,788

## 時価の算定方法

## 先物取引

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

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	100	2,993.00	299,300	
日本水産	4,000	715.00	2,860,000	
マルハニチロ	600	3,705.00	2,223,000	
カネコ種苗	100	1,332.00	133,200	
サカタのタネ	500	3,735.00	1,867,500	
ホクト	300	1,949.00	584,700	
ホクリヨウ	100	628.00	62,800	
日鉄鉱業	100	4,585.00	458,500	
三井松島ホールディングス	200	1,442.00	288,400	
国際石油開発帝石	15,900	1,135.00	18,046,500	
石油資源開発	600	2,315.00	1,389,000	
K&Oエナジーグループ	200	1,501.00	300,200	
ヒノキヤグループ	100	2,295.00	229,500	
ショーボンドホールディングス	300	7,880.00	2,364,000	
ミライト・ホールディングス	1,100	1,648.00	1,812,800	
日本アクア	100	517.00	51,700	

ファーストコーポレーション	100	748.00	74,800	
TATERU	500	272.00	136,000	
スペースバリューホールディングス	500	880.00	440,000	
ダイセキ環境ソリューション	100	635.00	63,500	
安藤・間	2,500	760.00	1,900,000	
東急建設	1,200	949.00	1,138,800	
コムシスホールディングス	1,400	2,938.00	4,113,200	
ミサワホーム	300	742.00	222,600	
ピーアールホールディングス	300	353.00	105,900	
高松コンストラクショングループ	200	2,670.00	534,000	
東建コーポレーション	100	6,680.00	668,000	
ヤマウラ	200	977.00	195,400	
大成建設	3,200	5,090.00	16,288,000	
大林組	9,800	1,047.00	10,260,600	
清水建設	10,000	949.00	9,490,000	
飛島建設	300	1,490.00	447,000	
長谷工コーポレーション	4,100	1,379.00	5,653,900	
松井建設	400	739.00	295,600	
鹿島建設	7,700	1,577.00	12,142,900	
不動テトラ	200	1,566.00	313,200	
大末建設	100	949.00	94,900	
鉄建建設	200	2,671.00	534,200	
西松建設	700	2,535.00	1,774,500	
三井住友建設	2,400	706.00	1,694,400	
大豊建設	200	3,175.00	635,000	
前田建設工業	2,300	1,170.00	2,691,000	
佐田建設	200	376.00	75,200	
ナカノフドー建設	200	502.00	100,400	
奥村組	500	3,400.00	1,700,000	
東鉄工業	400	2,955.00	1,182,000	
イチケン	100	1,936.00	193,600	
浅沼組	100	2,649.00	264,900	
戸田建設	3,800	690.00	2,622,000	
熊谷組	500	3,315.00	1,657,500	
青木あすなる建設	200	1,009.00	201,800	
北野建設	100	3,140.00	314,000	

矢作建設工業	400	755.00	302,000	
ピーエス三菱	300	614.00	184,200	
日本ハウスホールディングス	600	435.00	261,000	
大東建託	1,200	15,875.00	19,050,000	
新日本建設	400	1,042.00	416,800	
N I P P O	900	2,078.00	1,870,200	
東亜道路工業	100	3,050.00	305,000	
前田道路	1,000	2,110.00	2,110,000	
日本道路	100	6,460.00	646,000	
東亜建設工業	300	1,643.00	492,900	
若築建設	200	1,504.00	300,800	
東洋建設	1,200	428.00	513,600	
五洋建設	3,900	543.00	2,117,700	
世紀東急工業	500	627.00	313,500	
福田組	100	4,380.00	438,000	
住友林業	2,300	1,431.00	3,291,300	
日本基礎技術	300	380.00	114,000	
巴コーポレーション	400	388.00	155,200	
大和ハウス工業	9,000	3,408.00	30,672,000	
ライト工業	600	1,513.00	907,800	
積水ハウス	10,000	1,638.00	16,380,000	
日特建設	300	608.00	182,400	
北陸電気工事	200	924.00	184,800	
ユアテック	500	894.00	447,000	
中電工	400	2,308.00	923,200	
関電工	1,500	1,031.00	1,546,500	
きんでん	2,200	1,779.00	3,913,800	
東京エネシス	300	974.00	292,200	
トーエネック	100	3,195.00	319,500	
住友電設	200	1,863.00	372,600	
日本電設工業	600	2,268.00	1,360,800	
協和エクシオ	1,300	2,853.00	3,708,900	
新日本空調	300	1,893.00	567,900	
九電工	600	3,820.00	2,292,000	
三機工業	700	1,169.00	818,300	
日揮	2,800	1,656.00	4,636,800	

中外炉工業	100	1,764.00	176,400	
ヤマト	300	470.00	141,000	
太平電業	200	2,562.00	512,400	
高砂熱学工業	800	1,790.00	1,432,000	
朝日工業社	100	2,947.00	294,700	
明星工業	600	734.00	440,400	
大氣社	400	3,240.00	1,296,000	
ダイダン	200	2,446.00	489,200	
日比谷総合設備	300	1,879.00	563,700	
東芝プラントシステム	700	2,070.00	1,449,000	
OSJBホールディングス	1,400	278.00	389,200	
東洋エンジニアリング	400	750.00	300,000	
千代田化工建設	2,400	304.00	729,600	
新興プランテック	600	1,233.00	739,800	
日本製粉	1,000	1,886.00	1,886,000	
日清製粉グループ本社	3,300	2,383.00	7,863,900	
昭和産業	300	3,020.00	906,000	
鳥越製粉	300	793.00	237,900	
中部飼料	400	1,092.00	436,800	
フィード・ワン	2,000	178.00	356,000	
日本甜菜製糖	200	1,886.00	377,200	
三井製糖	200	2,809.00	561,800	
塩水港精糖	300	225.00	67,500	
日新製糖	100	2,089.00	208,900	
森永製菓	700	4,855.00	3,398,500	
中村屋	100	4,285.00	428,500	
江崎グリコ	900	5,590.00	5,031,000	
名糖産業	100	1,374.00	137,400	
井村屋グループ	100	2,435.00	243,500	
不二家	200	2,244.00	448,800	
山崎製パン	2,400	1,906.00	4,574,400	
亀田製菓	200	5,310.00	1,062,000	
寿スピリッツ	300	4,380.00	1,314,000	
カルビー	1,300	3,075.00	3,997,500	
森永乳業	600	3,465.00	2,079,000	
六甲バター	200	1,994.00	398,800	

ヤクルト本社	2,200	7,430.00	16,346,000	
明治ホールディングス	2,100	8,740.00	18,354,000	
雪印メグミルク	700	2,716.00	1,901,200	
プリマハム	400	2,093.00	837,200	
日本ハム	1,300	4,290.00	5,577,000	
丸大食品	300	1,885.00	565,500	
S Foods	300	4,145.00	1,243,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	1,900	665.00	1,263,500	
サッポロホールディングス	1,100	2,463.00	2,709,300	
アサヒグループホールディングス	6,100	4,821.00	29,408,100	
キリンホールディングス	13,200	2,494.50	32,927,400	
宝ホールディングス	2,200	1,251.00	2,752,200	
オエノンホールディングス	800	383.00	306,400	
養命酒製造	100	2,134.00	213,400	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	2,200	3,050.00	6,710,000	
サントリー食品インターナショナル	2,000	5,050.00	10,100,000	
ダイドーグループホールディングス	200	5,400.00	1,080,000	
伊藤園	900	5,160.00	4,644,000	
キーコーヒー	300	2,039.00	611,700	
ユニカフェ	100	1,013.00	101,300	
日清オイリオグループ	400	3,420.00	1,368,000	
不二製油グループ本社	700	3,820.00	2,674,000	
J - オイルミルズ	200	3,985.00	797,000	
キッコーマン	1,900	5,620.00	10,678,000	
味の素	6,500	1,688.50	10,975,250	
キューピー	1,600	2,569.00	4,110,400	
ハウス食品グループ本社	1,100	4,430.00	4,873,000	
カゴメ	1,200	2,915.00	3,498,000	
焼津水産化学工業	100	1,201.00	120,100	
アリアケジャパン	300	5,940.00	1,782,000	
エバラ食品工業	100	2,183.00	218,300	
ニチレイ	1,500	2,812.00	4,218,000	
東洋水産	1,500	4,140.00	6,210,000	
イトアンド	100	1,690.00	169,000	
日清食品ホールディングス	1,200	7,620.00	9,144,000	

永谷園ホールディングス	200	2,369.00	473,800
一正蒲鉾	100	1,096.00	109,600
フジッコ	300	2,255.00	676,500
ロック・フィールド	300	1,602.00	480,600
日本たばこ産業	16,900	2,890.00	48,841,000
ケンコーマヨネーズ	200	2,235.00	447,000
わらべや日洋ホールディングス	200	1,928.00	385,600
なとり	200	1,673.00	334,600
イフジ産業	100	702.00	70,200
ピクルスコーポレーション	100	1,898.00	189,800
北の達人コーポレーション	1,100	485.00	533,500
ユーグレナ	1,200	768.00	921,600
ミヨシ油脂	100	1,058.00	105,800
理研ビタミン	100	3,600.00	360,000
片倉工業	400	1,251.00	500,400
ゲンゼ	200	5,050.00	1,010,000
東洋紡	1,200	1,563.00	1,875,600
ユニチカ	800	487.00	389,600
富士紡ホールディングス	100	2,822.00	282,200
倉敷紡績	300	2,256.00	676,800
シキボウ	100	1,025.00	102,500
日本毛織	900	904.00	813,600
帝国繊維	300	2,425.00	727,500
帝人	2,300	1,867.00	4,294,100
東レ	22,100	781.60	17,273,360
サカイオーベックス	100	1,857.00	185,700
住江織物	100	2,703.00	270,300
日本フェルト	200	459.00	91,800
アツギ	200	966.00	193,200
セーレン	700	1,887.00	1,320,900
ソトー	100	982.00	98,200
小松マテーレ	500	813.00	406,500
ワコールホールディングス	800	2,767.00	2,213,600
ホギメディカル	400	3,765.00	1,506,000
T S Iホールディングス	1,100	699.00	768,900
マツオカコーポレーション	100	3,245.00	324,500

ワールド	300	2,007.00	602,100
三陽商会	200	1,738.00	347,600
オンワードホールディングス	1,700	666.00	1,132,200
ルックホールディングス	100	1,355.00	135,500
ゴールドウイン	300	13,790.00	4,137,000
デサント	700	2,403.00	1,682,100
キング	200	586.00	117,200
ヤマトインターナショナル	200	427.00	85,400
特種東海製紙	200	3,910.00	782,000
王子ホールディングス	12,800	665.00	8,512,000
日本製紙	1,400	2,129.00	2,980,600
北越コーポレーション	1,900	618.00	1,174,200
中越パルプ工業	100	1,365.00	136,500
大王製紙	1,400	1,296.00	1,814,400
レンゴー	2,900	960.00	2,784,000
トモク	200	1,680.00	336,000
ザ・バック	200	3,175.00	635,000
クラレ	4,800	1,523.00	7,310,400
旭化成	20,300	1,201.50	24,390,450
共和レザー	200	792.00	158,400
昭和電工	1,900	3,975.00	7,552,500
住友化学	22,500	560.00	12,600,000
住友精化	100	4,420.00	442,000
日産化学	1,800	5,930.00	10,674,000
クレハ	300	6,920.00	2,076,000
多木化学	100	5,520.00	552,000
テイカ	200	2,138.00	427,600
石原産業	500	1,185.00	592,500
片倉コープアグリ	100	1,156.00	115,600
日東エフシー	200	774.00	154,800
日本曹達	500	2,942.00	1,471,000
東ソー	4,400	1,652.00	7,268,800
トクヤマ	800	2,824.00	2,259,200
セントラル硝子	600	2,547.00	1,528,200
東亜合成	1,800	1,270.00	2,286,000
大阪ソーダ	300	2,797.00	839,100

関東電化工業	700	882.00	617,400
デンカ	1,100	3,385.00	3,723,500
信越化学工業	5,000	9,529.00	47,645,000
日本カーバイド工業	100	1,512.00	151,200
堺化学工業	200	2,367.00	473,400
第一稀元素化学工業	200	910.00	182,000
エア・ウォーター	2,300	1,815.00	4,174,500
大陽日酸	2,400	1,593.00	3,823,200
日本化学工業	100	2,365.00	236,500
日本パーカラライジング	1,600	1,450.00	2,320,000
高压ガス工業	500	830.00	415,000
四国化成工業	500	1,307.00	653,500
ステラ ケミファ	200	3,225.00	645,000
保土谷化学工業	100	3,180.00	318,000
日本触媒	500	7,530.00	3,765,000
大日精化工業	200	3,165.00	633,000
カネカ	800	4,320.00	3,456,000
三菱瓦斯化学	2,900	1,768.00	5,127,200
三井化学	2,600	2,785.00	7,241,000
J S R	2,900	1,863.00	5,402,700
東京応化工業	500	3,350.00	1,675,000
大阪有機化学工業	300	1,226.00	367,800
三菱ケミカルホールディングス	19,100	826.00	15,776,600
K Hネオケム	400	2,988.00	1,195,200
ダイセル	4,400	1,158.00	5,095,200
住友ベークライト	500	4,300.00	2,150,000
積水化学工業	6,200	1,742.00	10,800,400
日本ゼオン	2,600	1,159.00	3,013,400
アイカ工業	900	3,850.00	3,465,000
宇部興産	1,400	2,569.00	3,596,600
積水樹脂	500	2,100.00	1,050,000
タキロンシーアイ	600	612.00	367,200
旭有機材	200	1,674.00	334,800
日立化成	1,300	2,034.00	2,644,200
ニチバン	200	2,211.00	442,200
リケンテクノス	800	470.00	376,000

大倉工業	100	1,846.00	184,600
積水化成成品工業	400	964.00	385,600
群栄化学工業	100	2,772.00	277,200
タイガースポリマー	200	629.00	125,800
ミライアル	100	1,164.00	116,400
ダイキアクシス	100	1,011.00	101,100
ダイキョーニシカワ	600	1,265.00	759,000
竹本容器	100	1,450.00	145,000
森六ホールディングス	200	2,587.00	517,400
日本化薬	1,800	1,334.00	2,401,200
カーリットホールディングス	300	831.00	249,300
日本精化	200	1,254.00	250,800
扶桑化学工業	300	2,207.00	662,100
トリケミカル研究所	100	5,030.00	503,000
A D E K A	1,400	1,699.00	2,378,600
日油	1,100	3,765.00	4,141,500
ハリマ化成グループ	200	1,070.00	214,000
花王	7,100	8,522.00	60,506,200
第一工業製薬	100	3,125.00	312,500
石原ケミカル	100	1,834.00	183,400
日華化学	100	957.00	95,700
三洋化成工業	200	5,490.00	1,098,000
有機合成薬品工業	200	198.00	39,600
大日本塗料	300	1,104.00	331,200
日本ペイントホールディングス	2,400	4,150.00	9,960,000
関西ペイント	3,200	2,095.00	6,704,000
神東塗料	200	174.00	34,800
中国塗料	900	1,005.00	904,500
日本特殊塗料	200	1,367.00	273,400
藤倉化成	400	621.00	248,400
太陽ホールディングス	200	3,730.00	746,000
D I C	1,300	3,580.00	4,654,000
サカタインクス	600	1,199.00	719,400
東洋インキSCホールディングス	600	2,611.00	1,566,600
T & K T O K A	200	1,053.00	210,600
富士フイルムホールディングス	6,100	5,019.00	30,615,900

資生堂	5,800	7,291.00	42,287,800	
ライオン	4,100	2,250.00	9,225,000	
高砂香料工業	200	3,565.00	713,000	
マンダム	700	2,771.00	1,939,700	
ミルボン	400	5,130.00	2,052,000	
ファンケル	1,300	2,551.00	3,316,300	
コーセー	500	18,480.00	9,240,000	
コタ	100	1,486.00	148,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	1,200	3,195.00	3,834,000	
ノエビアホールディングス	200	5,360.00	1,072,000	
アジュバンコスメジャパン	100	981.00	98,100	
エステー	200	1,913.00	382,600	
アグロ カネショウ	100	2,049.00	204,900	
コニシ	500	1,635.00	817,500	
長谷川香料	300	1,740.00	522,000	
星光PMC	200	812.00	162,400	
小林製薬	800	9,000.00	7,200,000	
荒川化学工業	300	1,422.00	426,600	
メック	200	1,158.00	231,600	
日本高純度化学	100	2,353.00	235,300	
タカラバイオ	800	2,407.00	1,925,600	
JCU	400	1,849.00	739,600	
新田ゼラチン	200	704.00	140,800	
デクセリアルズ	800	822.00	657,600	
アース製薬	200	5,030.00	1,006,000	
北興化学工業	300	557.00	167,100	
大成ラミック	100	2,815.00	281,500	
クミアイ化学工業	1,200	709.00	850,800	
日本農薬	700	475.00	332,500	
アキレス	200	2,028.00	405,600	
有沢製作所	500	818.00	409,000	
日東電工	2,200	5,929.00	13,043,800	
レック	300	1,634.00	490,200	
きもと	500	185.00	92,500	
藤森工業	300	3,045.00	913,500	
前澤化成工業	200	1,027.00	205,400	

J S P	200	2,459.00	491,800	
エフピコ	200	6,700.00	1,340,000	
天馬	200	2,049.00	409,800	
信越ポリマー	500	827.00	413,500	
東リ	700	276.00	193,200	
ニフコ	1,200	2,846.00	3,415,200	
バルカー	200	2,289.00	457,800	
ユニ・チャーム	6,200	3,533.00	21,904,600	
協和発酵キリン	3,600	2,101.00	7,563,600	
武田薬品工業	18,500	4,415.00	81,677,500	2,600株 代用有価証券
アステラス製薬	26,900	1,703.00	45,810,700	
大日本住友製薬	2,200	2,760.00	6,072,000	
塩野義製薬	3,800	7,014.00	26,653,200	
田辺三菱製薬	3,000	1,534.00	4,602,000	
わかもと製薬	300	280.00	84,000	
あすか製薬	400	1,257.00	502,800	
日本新薬	800	6,800.00	5,440,000	
中外製薬	3,000	7,450.00	22,350,000	
科研製薬	500	5,200.00	2,600,000	
エーザイ	3,500	8,922.00	31,227,000	
ロート製薬	1,500	2,893.00	4,339,500	
小野薬品工業	6,900	2,265.00	15,628,500	
久光製薬	900	5,450.00	4,905,000	
持田製薬	200	11,380.00	2,276,000	
参天製薬	5,500	1,643.00	9,036,500	
扶桑薬品工業	100	2,584.00	258,400	
ツムラ	900	3,450.00	3,105,000	
日医工	700	1,587.00	1,110,900	
キッセイ薬品工業	500	2,887.00	1,443,500	
生化学工業	600	1,321.00	792,600	
栄研化学	500	2,564.00	1,282,000	
日水製薬	100	1,187.00	118,700	
鳥居薬品	200	2,360.00	472,000	
J C R ファーマ	200	5,970.00	1,194,000	
東和薬品	100	8,830.00	883,000	

富士製薬工業	200	1,862.00	372,400
沢井製薬	600	5,990.00	3,594,000
ゼリア新薬工業	600	1,877.00	1,126,200
第一三共	8,300	3,935.00	32,660,500
キョーリン製薬ホールディングス	600	2,195.00	1,317,000
大幸薬品	100	1,823.00	182,300
ダイト	200	2,755.00	551,000
大塚ホールディングス	5,600	4,536.00	25,401,600
大正製薬ホールディングス	700	11,110.00	7,777,000
ペプチドリーム	1,500	5,050.00	7,575,000
昭和シェル石油	2,700	1,701.00	4,592,700
ニチレキ	400	1,107.00	442,800
ユシロ化学工業	200	1,321.00	264,200
ピーピー・カストロール	100	1,346.00	134,600
MORESCO	100	1,601.00	160,100
出光興産	2,300	4,025.00	9,257,500
JXTGホールディングス	49,000	542.80	26,597,200
コスモエネルギーホールディングス	800	2,382.00	1,905,600
横浜ゴム	1,700	2,275.00	3,867,500
TOYO TIRE	1,500	1,362.00	2,043,000
ブリヂストン	9,000	4,416.00	39,744,000
住友ゴム工業	2,600	1,395.00	3,627,000
藤倉ゴム工業	300	432.00	129,600
オカモト	200	5,800.00	1,160,000
フコク	100	876.00	87,600
ニッタ	300	3,840.00	1,152,000
住友理工	600	1,025.00	615,000
三ツ星ベルト	400	2,173.00	869,200
バンドー化学	600	1,164.00	698,400
日東紡績	400	1,968.00	787,200
AGC	2,900	3,830.00	11,107,000
日本板硝子	1,400	968.00	1,355,200
日本山村硝子	100	1,514.00	151,400
日本電気硝子	1,300	3,015.00	3,919,500
オハラ	100	1,800.00	180,000
住友大阪セメント	600	4,675.00	2,805,000

太平洋セメント	1,800	3,715.00	6,687,000	
日本ヒューム	300	825.00	247,500	
日本コンクリート工業	600	285.00	171,000	
三谷セキサン	100	2,906.00	290,600	
アジアパイルホールディングス	400	635.00	254,000	
東海カーボン	2,600	1,589.00	4,131,400	
日本カーボン	100	5,280.00	528,000	
東洋炭素	200	2,142.00	428,400	
ノリタケカンパニーリミテド	200	5,320.00	1,064,000	
TOTO	2,200	4,305.00	9,471,000	
日本碍子	3,600	1,698.00	6,112,800	
日本特殊陶業	2,500	2,359.00	5,897,500	
MARUWA	100	6,060.00	606,000	
品川リフラクトリーズ	100	3,415.00	341,500	
黒崎播磨	100	5,840.00	584,000	
ヨータイ	300	600.00	180,000	
イソライト工業	100	568.00	56,800	
東京窯業	400	400.00	160,000	
ニッカトー	100	1,048.00	104,800	
フジインコーポレーテッド	300	2,334.00	700,200	
クニミネ工業	100	824.00	82,400	
ニチアス	800	2,082.00	1,665,600	
ニチハ	400	3,045.00	1,218,000	
新日鐵住金	13,400	2,019.00	27,054,600	
神戸製鋼所	5,300	872.00	4,621,600	
中山製鋼所	400	496.00	198,400	
合同製鐵	100	1,743.00	174,300	
ジェイ エフ イー ホールディングス	7,800	1,924.50	15,011,100	
東京製鐵	1,500	886.00	1,329,000	
共英製鋼	300	1,750.00	525,000	
大和工業	600	3,030.00	1,818,000	
東京鐵鋼	100	1,188.00	118,800	
大阪製鐵	200	1,855.00	371,000	
淀川製鋼所	400	2,217.00	886,800	
丸一鋼管	1,000	3,305.00	3,305,000	
モリ工業	100	2,599.00	259,900	

大同特殊鋼	500	4,680.00	2,340,000	
日本冶金工業	2,400	246.00	590,400	
山陽特殊製鋼	400	2,549.00	1,019,600	
愛知製鋼	200	3,555.00	711,000	
日立金属	3,100	1,116.00	3,459,600	
大太平洋金属	200	2,953.00	590,600	
新日本電工	1,700	234.00	397,800	
栗本鐵工所	100	1,516.00	151,600	
三菱製鋼	200	1,658.00	331,600	
日亜鋼業	400	339.00	135,600	
エンビプロ・ホールディングス	100	575.00	57,500	
シンニッタン	400	345.00	138,000	
新家工業	100	1,656.00	165,600	
大紀アルミニウム工業所	500	623.00	311,500	
日本軽金属ホールディングス	7,900	246.00	1,943,400	
三井金属鉱業	800	2,690.00	2,152,000	
東邦亜鉛	200	3,250.00	650,000	
三菱マテリアル	1,900	3,095.00	5,880,500	
住友金属鉱山	3,900	3,281.00	12,795,900	
D O W Aホールディングス	700	3,550.00	2,485,000	
古河機械金属	500	1,469.00	734,500	
大阪チタニウムテクノロジーズ	300	1,756.00	526,800	
東邦チタニウム	500	949.00	474,500	
U A C J	400	2,208.00	883,200	
C Kサンエツ	100	3,575.00	357,500	
古河電気工業	800	3,515.00	2,812,000	
住友電気工業	10,800	1,548.00	16,718,400	
フジクラ	3,500	488.00	1,708,000	
タツタ電線	600	507.00	304,200	
平河ヒューテック	100	1,646.00	164,600	
リョービ	400	2,731.00	1,092,400	
アーレスティ	400	696.00	278,400	
アサヒホールディングス	500	2,189.00	1,094,500	
稲葉製作所	200	1,247.00	249,400	
宮地エンジニアリンググループ	100	2,064.00	206,400	
トーカロ	700	911.00	637,700	

アルファCo	100	1,370.00	137,000	
SUMCO	3,200	1,520.00	4,864,000	
川田テクノロジーズ	100	6,790.00	679,000	
RS Technologies	100	3,170.00	317,000	
東洋製罐グループホールディングス	1,800	2,331.00	4,195,800	
ホッカンホールディングス	100	1,741.00	174,100	
コロナ	200	1,051.00	210,200	
横河ブリッジホールディングス	500	1,975.00	987,500	
駒井ハルテック	100	1,973.00	197,300	
三和ホールディングス	3,000	1,288.00	3,864,000	
文化シャッター	800	833.00	666,400	
三協立山	400	1,483.00	593,200	
アルインコ	200	986.00	197,200	
LIXILグループ	4,300	1,522.00	6,544,600	
日本フィルコン	200	543.00	108,600	
ノーリツ	600	1,634.00	980,400	
長府製作所	300	2,207.00	662,100	
リンナイ	500	7,320.00	3,660,000	
ダイニチ工業	200	736.00	147,200	
日東精工	400	548.00	219,200	
岡部	600	965.00	579,000	
ジーテクト	300	1,696.00	508,800	
東プレ	500	2,392.00	1,196,000	
高周波熱錬	600	890.00	534,000	
東京製綱	200	1,030.00	206,000	
サンコール	200	691.00	138,200	
パイオラックス	500	2,326.00	1,163,000	
エイチワン	300	1,109.00	332,700	
日本発條	2,900	1,052.00	3,050,800	
立川ブラインド工業	100	1,215.00	121,500	
三益半導体工業	300	1,484.00	445,200	
日本ドライケミカル	100	1,204.00	120,400	
日本製鋼所	900	2,041.00	1,836,900	
三浦工業	1,200	2,603.00	3,123,600	
タクマ	1,100	1,471.00	1,618,100	
ツガミ	600	768.00	460,800	

オークマ	400	6,150.00	2,460,000	
東芝機械	300	2,281.00	684,300	
アマダホールディングス	4,400	1,152.00	5,068,800	
アイダエンジニアリング	800	829.00	663,200	
滝澤鉄工所	100	1,715.00	171,500	
F U J I	900	1,595.00	1,435,500	
牧野フライス製作所	300	4,575.00	1,372,500	
オーエスジー	1,400	2,244.00	3,141,600	
旭ダイヤモンド工業	800	818.00	654,400	
D M G 森精機	1,800	1,475.00	2,655,000	
ソディック	600	834.00	500,400	
ディスコ	400	16,070.00	6,428,000	
日東工器	200	2,330.00	466,000	
日進工具	100	2,437.00	243,700	
パンチ工業	200	632.00	126,400	
富士ダイス	100	715.00	71,500	
東洋機械金属	200	610.00	122,000	
島精機製作所	400	3,830.00	1,532,000	
オプトラン	300	2,231.00	669,300	
フリー	200	1,030.00	206,000	
ヤマシンフィルタ	500	725.00	362,500	
日阪製作所	400	900.00	360,000	
やまびこ	600	1,074.00	644,400	
平田機工	100	6,660.00	666,000	
ペガサスミシン製造	300	671.00	201,300	
ナブテスコ	1,600	2,985.00	4,776,000	
三井海洋開発	300	3,015.00	904,500	
レオン自動機	300	1,619.00	485,700	
S M C	900	39,790.00	35,811,000	
ホソカワミクロン	100	4,905.00	490,500	
ユニオンツール	100	3,040.00	304,000	
オイレス工業	400	1,930.00	772,000	
日精エー・エス・ビー機械	100	3,965.00	396,500	
サトーホールディングス	300	2,689.00	806,700	
技研製作所	200	3,375.00	675,000	
日本エアージェット	100	598.00	59,800	

カワタ	100	1,417.00	141,700
日精樹脂工業	200	913.00	182,600
オカダアイヨン	100	1,484.00	148,400
小松製作所	13,200	2,824.50	37,283,400
住友重機械工業	1,700	3,900.00	6,630,000
日立建機	1,200	2,912.00	3,494,400
日工	100	2,195.00	219,500
巴工業	100	2,336.00	233,600
井関農機	300	1,630.00	489,000
TOWA	200	677.00	135,400
丸山製作所	100	1,306.00	130,600
北川鉄工所	100	2,413.00	241,300
ローツェ	100	1,699.00	169,900
クボタ	15,600	1,571.50	24,515,400
荏原実業	100	2,163.00	216,300
三菱化工機	100	1,551.00	155,100
月島機械	600	1,388.00	832,800
帝国電機製作所	200	1,238.00	247,600
新東工業	700	1,021.00	714,700
澁谷工業	300	3,345.00	1,003,500
アイチ コーポレーション	500	715.00	357,500
小森コーポレーション	800	1,213.00	970,400
鶴見製作所	200	1,811.00	362,200
酒井重工業	100	2,319.00	231,900
荏原製作所	1,300	3,165.00	4,114,500
西島製作所	300	939.00	281,700
北越工業	300	1,157.00	347,100
ダイキン工業	4,000	12,125.00	48,500,000
オルガノ	100	3,085.00	308,500
トーヨーカネツ	100	2,239.00	223,900
栗田工業	1,600	2,922.00	4,675,200
椿本チエイン	400	4,100.00	1,640,000
大同工業	100	896.00	89,600
木村化工機	200	383.00	76,600
アネスト岩田	500	1,007.00	503,500
ダイフク	1,600	5,650.00	9,040,000

サムコ	100	942.00	94,200
加藤製作所	100	2,732.00	273,200
タダノ	1,400	1,162.00	1,626,800
フジテック	1,100	1,236.00	1,359,600
C K D	800	1,036.00	828,800
キトー	200	1,782.00	356,400
平和	800	2,206.00	1,764,800
理想科学工業	300	1,911.00	573,300
S A N K Y O	700	4,085.00	2,859,500
日本金銭機械	300	1,083.00	324,900
マースグループホールディングス	200	2,151.00	430,200
福島工業	200	3,910.00	782,000
オーイズミ	100	368.00	36,800
ダイコク電機	100	1,495.00	149,500
竹内製作所	500	2,035.00	1,017,500
アマノ	800	2,376.00	1,900,800
J U K I	400	1,330.00	532,000
サンデンホールディングス	400	835.00	334,000
蛇の目ミシン工業	300	487.00	146,100
マックス	400	1,481.00	592,400
グローリー	800	2,670.00	2,136,000
新晃工業	300	1,582.00	474,600
大和冷機工業	400	1,234.00	493,600
セガサミーホールディングス	2,900	1,313.00	3,807,700
日本ピストンリング	100	1,694.00	169,400
リケン	100	5,330.00	533,000
T P R	400	2,409.00	963,600
ツバキ・ナカシマ	400	1,987.00	794,800
ホシザキ	900	7,790.00	7,011,000
大豊工業	200	984.00	196,800
日本精工	6,000	1,051.00	6,306,000
N T N	6,300	356.00	2,242,800
ジェイテクト	2,800	1,391.00	3,894,800
不二越	300	4,515.00	1,354,500
日本トムソン	900	558.00	502,200
T H K	1,800	2,846.00	5,122,800

ユーシン精機	200	1,063.00	212,600	
前澤給装工業	100	1,883.00	188,300	
イーグル工業	400	1,305.00	522,000	
前澤工業	200	356.00	71,200	
日本ピラー工業	300	1,405.00	421,500	
キット	1,200	834.00	1,000,800	
マキタ	3,500	4,035.00	14,122,500	
日立造船	2,300	357.00	821,100	
三菱重工業	4,900	4,434.00	21,726,600	
I H I	2,200	2,987.00	6,571,400	
スター精密	500	1,703.00	851,500	
日清紡ホールディングス	1,600	974.00	1,558,400	
イビデン	1,800	1,566.00	2,818,800	
コニカミノルタ	6,400	1,087.00	6,956,800	
ブラザー工業	3,800	2,080.00	7,904,000	
ミネベアミツミ	5,400	1,793.00	9,682,200	
日立製作所	13,100	3,452.00	45,221,200	
三菱電機	29,100	1,418.00	41,263,800	
富士電機	1,900	3,535.00	6,716,500	
東洋電機製造	100	1,313.00	131,300	
安川電機	3,400	3,310.00	11,254,000	
シンフォニアテクノロジー	400	1,363.00	545,200	
明電舎	600	1,632.00	979,200	
オリジン電気	100	2,295.00	229,500	
山洋電気	100	4,120.00	412,000	
デンヨー	300	1,436.00	430,800	
東芝テック	400	3,010.00	1,204,000	
マブチモーター	800	3,860.00	3,088,000	
日本電産	3,500	13,635.00	47,722,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	200	1,826.00	365,200	
トレックス・セミコンダクター	100	1,123.00	112,300	
東光高岳	100	1,404.00	140,400	
ダブル・スコープ	400	1,420.00	568,000	
宮越ホールディングス	100	1,080.00	108,000	
ダイヘン	300	2,734.00	820,200	
ヤーマン	400	1,333.00	533,200	

JVCケンウッド	2,200	266.00	585,200	
ミマキエンジニアリング	300	759.00	227,700	
第一精工	100	1,002.00	100,200	
日新電機	700	1,013.00	709,100	
大崎電気工業	600	681.00	408,600	
オムロン	3,100	4,940.00	15,314,000	
日東工業	500	2,238.00	1,119,000	
I D E C	400	2,103.00	841,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,000	2,272.00	2,272,000	
サクサホールディングス	100	1,836.00	183,600	
メルコホールディングス	100	3,895.00	389,500	
テクノメディカ	100	2,063.00	206,300	
日本電気	3,800	3,745.00	14,231,000	
富士通	2,800	7,561.00	21,170,800	
沖電気工業	1,300	1,307.00	1,699,100	
岩崎通信機	100	824.00	82,400	
電気興業	200	2,655.00	531,000	
サンケン電気	300	2,268.00	680,400	
ナカヨ	100	1,402.00	140,200	
アイホン	200	1,730.00	346,000	
ルネサスエレクトロニクス	3,000	688.00	2,064,000	
セイコーエプソン	3,600	1,657.00	5,965,200	
ワコム	2,100	460.00	966,000	
アルバック	600	3,195.00	1,917,000	
E I Z O	300	4,625.00	1,387,500	
ジャパンディスプレイ	6,900	71.00	489,900	
日本信号	700	983.00	688,100	
京三製作所	600	404.00	242,400	
能美防災	400	2,003.00	801,200	
ホーチキ	200	1,156.00	231,200	
エレコム	300	3,350.00	1,005,000	
パナソニック	33,300	1,044.50	34,781,850	代用有価証券 7,500株
シャープ	2,900	1,370.00	3,973,000	
アンリツ	1,900	2,216.00	4,210,400	
富士通ゼネラル	900	1,497.00	1,347,300	

				代用有価証券
ソニー	19,500	5,313.00	103,603,500	3,700株
T D K	1,500	8,850.00	13,275,000	
帝国通信工業	100	1,192.00	119,200	
タムラ製作所	1,100	587.00	645,700	
アルプスアルパイン	3,000	2,320.00	6,960,000	
鈴木	200	666.00	133,200	
日本トリム	100	5,440.00	544,000	
ローランド ディー . ジー .	100	2,200.00	220,000	
フォスター電機	300	1,584.00	475,200	
S M K	100	2,649.00	264,900	
ヨコオ	200	1,610.00	322,000	
ホシデン	900	914.00	822,600	
ヒロセ電機	400	11,690.00	4,676,000	
日本航空電子工業	700	1,460.00	1,022,000	
T O A	300	1,028.00	308,400	
マクセルホールディングス	600	1,633.00	979,800	
古野電気	400	959.00	383,600	
スミダコーポレーション	200	1,483.00	296,600	
アイコム	200	2,214.00	442,800	
リオン	100	1,872.00	187,200	
本多通信工業	200	568.00	113,600	
船井電機	300	789.00	236,700	
横河電機	2,900	2,158.00	6,258,200	
新電元工業	100	4,395.00	439,500	
アズビル	1,900	2,455.00	4,664,500	
東亜ディーケーケー	100	855.00	85,500	
日本光電工業	1,300	3,305.00	4,296,500	
チノー	100	1,276.00	127,600	
共和電業	300	377.00	113,100	
日本電子材料	100	713.00	71,300	
堀場製作所	600	5,840.00	3,504,000	
アドバンテスト	2,000	2,607.00	5,214,000	
小野測器	100	618.00	61,800	
エスペック	300	2,094.00	628,200	
キーエンス	1,400	65,230.00	91,322,000	

日置電機	200	4,460.00	892,000	
シスメックス	2,300	6,804.00	15,649,200	
日本マイクロニクス	500	783.00	391,500	
メガチップス	200	2,213.00	442,600	
O B A R A G R O U P	200	3,925.00	785,000	
原田工業	100	945.00	94,500	
コーセル	400	1,168.00	467,200	
イリソ電子工業	300	4,915.00	1,474,500	
オブテックスグループ	500	2,042.00	1,021,000	
千代田インテグレ	100	2,144.00	214,400	
アイ・オー・データ機器	100	1,177.00	117,700	
レーザーテック	600	4,065.00	2,439,000	
スタンレー電気	2,100	3,190.00	6,699,000	
岩崎電気	100	1,375.00	137,500	
ウシオ電機	1,800	1,294.00	2,329,200	
岡谷電機産業	200	390.00	78,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	300	705.00	211,500	
日本セラミック	300	2,836.00	850,800	
古河電池	200	746.00	149,200	
山一電機	200	1,159.00	231,800	
図研	200	1,581.00	316,200	
日本電子	600	1,850.00	1,110,000	
カシオ計算機	2,600	1,528.00	3,972,800	
ファナック	2,800	19,455.00	54,474,000	
日本シイエムケイ	700	647.00	452,900	
エンプラス	100	3,020.00	302,000	
ローム	1,400	7,310.00	10,234,000	
浜松ホトニクス	2,100	3,995.00	8,389,500	
三井ハイテック	300	1,014.00	304,200	
新光電気工業	1,000	818.00	818,000	
京セラ	4,400	6,221.00	27,372,400	
太陽誘電	1,300	2,314.00	3,008,200	
村田製作所	3,100	17,600.00	54,560,000	
双葉電子工業	500	1,739.00	869,500	
ニチコン	900	990.00	891,000	
日本ケミコン	200	2,126.00	425,200	

K O A	400	1,622.00	648,800	
市光工業	400	684.00	273,600	
小糸製作所	1,700	6,590.00	11,203,000	
ミツバ	500	717.00	358,500	
S C R E E Nホールディングス	500	4,610.00	2,305,000	
キャノン電子	300	1,815.00	544,500	
キャノン	15,700	3,230.00	50,711,000	代用有価証券 4,100株
リコー	8,800	1,138.00	10,014,400	
象印マホービン	500	1,212.00	606,000	
東京エレクトロン	1,900	15,490.00	29,431,000	
トヨタ紡織	1,000	1,832.00	1,832,000	
ユニプレス	600	2,024.00	1,214,400	
豊田自動織機	2,400	5,630.00	13,512,000	
モリタホールディングス	500	1,829.00	914,500	
三櫻工業	400	559.00	223,600	
デンソー	6,400	4,798.00	30,707,200	
東海理化電機製作所	800	2,021.00	1,616,800	
三井E & Sホールディングス	1,100	1,236.00	1,359,600	
川崎重工業	2,300	2,855.00	6,566,500	
名村造船所	900	420.00	378,000	
三菱ロジスネクスト	300	1,466.00	439,800	
日産自動車	34,400	947.60	32,597,440	
いすゞ自動車	9,200	1,595.00	14,674,000	
トヨタ自動車	32,500	6,720.00	218,400,000	代用有価証券 9,000株
日野自動車	3,600	1,031.00	3,711,600	
三菱自動車工業	10,800	623.00	6,728,400	
エフテック	200	994.00	198,800	
ファルテック	100	910.00	91,000	
武蔵精密工業	700	1,541.00	1,078,700	
日産車体	600	998.00	598,800	
新明和工業	1,300	1,368.00	1,778,400	
極東開発工業	600	1,487.00	892,200	
日信工業	500	1,570.00	785,000	
トピー工業	200	2,379.00	475,800	
ティラド	100	2,299.00	229,900	

タチエス	500	1,670.00	835,000	
N O K	1,600	1,785.00	2,856,000	
フタバ産業	800	601.00	480,800	
K Y B	300	3,030.00	909,000	
大同メタル工業	500	794.00	397,000	
プレス工業	1,400	613.00	858,200	
ミクニ	400	491.00	196,400	
太平洋工業	600	1,737.00	1,042,200	
ケーヒン	700	1,938.00	1,356,600	
河西工業	400	939.00	375,600	
アイシン精機	2,400	4,315.00	10,356,000	
マツダ	9,100	1,286.50	11,707,150	
今仙電機製作所	300	1,032.00	309,600	
本田技研工業	24,600	3,125.00	76,875,000	代用有価証券 6,000株
スズキ	5,300	5,741.00	30,427,300	
S U B A R U	9,000	2,822.50	25,402,500	
安永	100	1,541.00	154,100	
ヤマハ発動機	4,100	2,252.00	9,233,200	
ショーワ	700	1,597.00	1,117,900	
T B K	300	434.00	130,200	
エクセディ	400	2,629.00	1,051,600	
豊田合成	900	2,467.00	2,220,300	
愛三工業	500	756.00	378,000	
日本プラスト	200	839.00	167,800	
ヨロズ	300	1,604.00	481,200	
エフ・シー・シー	500	2,644.00	1,322,000	
シマノ	1,200	17,440.00	20,928,000	
テイ・エス テック	700	3,280.00	2,296,000	
ジャムコ	100	2,575.00	257,500	
テルモ	4,100	6,668.00	27,338,800	
クリエートメディック	100	998.00	99,800	
日機装	900	1,195.00	1,075,500	
島津製作所	3,700	2,795.00	10,341,500	
J M S	300	651.00	195,300	
長野計器	200	795.00	159,000	

ブイ・テクノロジー	100	14,920.00	1,492,000	
東京計器	200	1,134.00	226,800	
インターアクション	100	1,735.00	173,500	
オーバル	300	246.00	73,800	
東京精密	500	2,937.00	1,468,500	
マニー	400	5,030.00	2,012,000	
ニコン	5,100	1,714.00	8,741,400	
トプコン	1,600	1,521.00	2,433,600	
オリンパス	4,300	4,865.00	20,919,500	
理研計器	300	2,216.00	664,800	
タムロン	300	2,071.00	621,300	
HOYA	5,900	6,768.00	39,931,200	
シード	100	1,272.00	127,200	
ノーリツ鋼機	200	2,170.00	434,000	
朝日インテック	1,200	5,630.00	6,756,000	
シチズン時計	3,200	639.00	2,044,800	
リズム時計工業	100	1,679.00	167,900	
大研医器	200	592.00	118,400	
メニコン	400	2,888.00	1,155,200	
松風	100	1,321.00	132,100	
セイコーホールディングス	400	2,543.00	1,017,200	
ニプロ	2,000	1,475.00	2,950,000	
中本パックス	100	1,713.00	171,300	
スノーピーク	100	1,390.00	139,000	
パラマウントベッドホールディングス	300	5,030.00	1,509,000	
トランザクション	200	718.00	143,600	
SHO-BI	100	362.00	36,200	
ニホンフラッシュ	100	1,988.00	198,800	
前田工織	300	2,743.00	822,900	
永大産業	400	435.00	174,000	
アートネイチャー	300	642.00	192,600	
バンダイナムコホールディングス	3,000	4,810.00	14,430,000	
アイフィスジャパン	100	571.00	57,100	
共立印刷	500	224.00	112,000	
SHOEI	100	4,060.00	406,000	
フランスベッドホールディングス	400	856.00	342,400	

パイロットコーポレーション	500	5,130.00	2,565,000	
萩原工業	200	1,635.00	327,000	
トッパン・フォームズ	600	944.00	566,400	
フジシールインターナショナル	700	4,165.00	2,915,500	
タカラトミー	1,200	1,114.00	1,336,800	
エステールホールディングス	100	673.00	67,300	
タカノ	100	877.00	87,700	
プロネクサス	300	1,231.00	369,300	
大建工業	200	1,901.00	380,200	
凸版印刷	4,100	1,769.00	7,252,900	
大日本印刷	4,100	2,573.00	10,549,300	
図書印刷	300	956.00	286,800	
共同印刷	100	2,463.00	246,300	
N I S S H A	600	1,312.00	787,200	
宝印刷	100	1,616.00	161,600	
アシックス	2,900	1,454.00	4,216,600	
ツツミ	100	2,046.00	204,600	
小松ウオール工業	100	1,951.00	195,100	
ヤマハ	1,700	5,480.00	9,316,000	
河合楽器製作所	100	3,350.00	335,000	
クリナップ	300	624.00	187,200	
ビジョン	1,800	4,705.00	8,469,000	
キングジム	200	814.00	162,800	
リンテック	700	2,477.00	1,733,900	
イトーキ	500	558.00	279,000	
任天堂	1,800	30,030.00	54,054,000	
三菱鉛筆	500	2,231.00	1,115,500	
タカラスタANDARD	600	1,689.00	1,013,400	
コクヨ	1,400	1,695.00	2,373,000	
ナカバヤシ	300	559.00	167,700	
グローブライド	100	2,775.00	277,500	
オカムラ	1,000	1,311.00	1,311,000	
美津濃	300	2,581.00	774,300	
東京電力ホールディングス	23,300	673.00	15,680,900	
中部電力	8,900	1,781.50	15,855,350	
関西電力	11,900	1,650.00	19,635,000	

中国電力	4,000	1,461.00	5,844,000
北陸電力	2,900	951.00	2,757,900
東北電力	6,800	1,457.00	9,907,600
四国電力	2,600	1,424.00	3,702,400
九州電力	6,000	1,319.00	7,914,000
北海道電力	2,700	810.00	2,187,000
沖縄電力	500	2,092.00	1,046,000
電源開発	2,300	2,815.00	6,474,500
エフオン	100	855.00	85,500
イーレックス	500	886.00	443,000
レノバ	400	1,100.00	440,000
東京瓦斯	5,700	3,057.00	17,424,900
大阪瓦斯	5,700	2,242.00	12,779,400
東邦瓦斯	1,400	4,890.00	6,846,000
北海道瓦斯	200	1,456.00	291,200
広島ガス	600	350.00	210,000
西部瓦斯	300	2,466.00	739,800
静岡ガス	900	894.00	804,600
メタウォーター	100	3,085.00	308,500
SBSホールディングス	300	1,933.00	579,900
東武鉄道	3,100	3,100.00	9,610,000
相鉄ホールディングス	1,000	3,265.00	3,265,000
東京急行電鉄	7,900	1,854.00	14,646,600
京浜急行電鉄	4,000	1,839.00	7,356,000
小田急電鉄	4,700	2,542.00	11,947,400
京王電鉄	1,600	6,390.00	10,224,000
京成電鉄	2,200	3,760.00	8,272,000
富士急行	400	3,920.00	1,568,000
新京成電鉄	100	2,096.00	209,600
東日本旅客鉄道	5,200	10,545.00	54,834,000
西日本旅客鉄道	2,600	8,272.00	21,507,200
東海旅客鉄道	2,600	24,885.00	64,701,000
西武ホールディングス	3,700	1,986.00	7,348,200
鴻池運輸	500	1,788.00	894,000
西日本鉄道	800	2,661.00	2,128,800
ハマキョウレックス	200	4,475.00	895,000

サカイ引越センター	200	6,560.00	1,312,000	
近鉄グループホールディングス	2,800	4,925.00	13,790,000	
阪急阪神ホールディングス	3,700	4,050.00	14,985,000	
南海電気鉄道	1,200	2,969.00	3,562,800	
京阪ホールディングス	1,200	4,525.00	5,430,000	
神戸電鉄	100	3,960.00	396,000	
名古屋鉄道	2,200	3,025.00	6,655,000	
山陽電気鉄道	200	2,176.00	435,200	
日本通運	1,100	6,650.00	7,315,000	
ヤマトホールディングス	4,800	2,876.00	13,804,800	
山九	800	5,410.00	4,328,000	
丸運	200	307.00	61,400	
丸全昭和運輸	200	2,816.00	563,200	
センコーグループホールディングス	1,500	934.00	1,401,000	
トナミホールディングス	100	6,330.00	633,000	
ニッコンホールディングス	1,000	2,839.00	2,839,000	
福山通運	400	4,530.00	1,812,000	
セイノーホールディングス	2,100	1,558.00	3,271,800	
エスライン	100	1,137.00	113,700	
神奈川中央交通	100	3,755.00	375,500	
日立物流	600	3,310.00	1,986,000	
丸和運輸機関	100	3,565.00	356,500	
C & F ロジホールディングス	300	1,272.00	381,600	
九州旅客鉄道	2,300	3,720.00	8,556,000	
S Gホールディングス	2,600	3,160.00	8,216,000	
日本郵船	2,300	1,802.00	4,144,600	
商船三井	1,600	2,642.00	4,227,200	
川崎汽船	800	1,580.00	1,264,000	
N S ユナイテッド海運	200	2,561.00	512,200	
飯野海運	1,300	394.00	512,200	
乾汽船	200	699.00	139,800	
日本航空	5,100	4,084.00	20,828,400	
A N Aホールディングス	5,000	4,112.00	20,560,000	
パスコ	100	926.00	92,600	
トランコム	100	6,940.00	694,000	
日新	200	1,926.00	385,200	

三菱倉庫	1,000	2,790.00	2,790,000
三井倉庫ホールディングス	300	1,939.00	581,700
住友倉庫	1,000	1,432.00	1,432,000
澁澤倉庫	200	1,660.00	332,000
東陽倉庫	500	327.00	163,500
日本トランスシティ	600	448.00	268,800
ケイヒン	100	1,397.00	139,700
中央倉庫	200	1,062.00	212,400
川西倉庫	100	1,277.00	127,700
安田倉庫	200	908.00	181,600
東洋埠頭	100	1,493.00	149,300
宇徳	200	550.00	110,000
上組	1,700	2,529.00	4,299,300
キムラユニティー	100	1,120.00	112,000
キューソー流通システム	100	2,126.00	212,600
近鉄エクスプレス	500	1,784.00	892,000
東海運	200	288.00	57,600
エーアイティー	200	1,097.00	219,400
内外トランスライン	100	1,505.00	150,500
日本コンセプト	100	1,012.00	101,200
NEC ネットエスアイ	300	2,570.00	771,000
システナ	1,000	1,148.00	1,148,000
デジタルアーツ	200	8,500.00	1,700,000
新日鉄住金ソリューションズ	400	2,993.00	1,197,200
キューブシステム	200	841.00	168,200
コア	100	1,360.00	136,000
ソフトクリエイイトホールディングス	100	1,564.00	156,400
T I S	1,000	5,270.00	5,270,000
電算システム	100	2,532.00	253,200
グリー	2,000	466.00	932,000
コーエーテクモホールディングス	600	1,885.00	1,131,000
三菱総合研究所	100	3,270.00	327,000
A G S	200	702.00	140,400
ファインデックス	200	787.00	157,400
ヒト・コミュニケーションズ	100	1,616.00	161,600
ブレインパッド	100	4,950.00	495,000

K L a b	500	803.00	401,500
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	400	858.00	343,200
ネクソン	7,300	1,617.00	11,804,100
アイスタイル	700	722.00	505,400
エムアップ	100	2,111.00	211,100
エイチーム	200	1,883.00	376,600
テクノスジャパン	200	764.00	152,800
コロブラ	800	699.00	559,200
ブロードリーフ	1,400	584.00	817,600
デジタルハーツホールディングス	100	1,286.00	128,600
じげん	300	651.00	195,300
フィックスターズ	300	1,244.00	373,200
C A R T A H O L D I N G S	200	1,050.00	210,000
オブティム	100	3,825.00	382,500
セレス	100	1,942.00	194,200
ティーガイア	300	2,008.00	602,400
豆蔵ホールディングス	200	1,014.00	202,800
テクマトリックス	200	1,825.00	365,000
プロシップ	100	1,352.00	135,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	6,900	304.00	2,097,600
GMOペイメントゲートウェイ	500	6,290.00	3,145,000
ザッパラス	100	387.00	38,700
インターネットイニシアティブ	500	2,477.00	1,238,500
さくらインターネット	300	545.00	163,500
ヴィンクス	100	1,119.00	111,900
GMOクラウド	100	3,430.00	343,000
S R Aホールディングス	200	2,654.00	530,800
M i n o r iソリューションズ	100	1,648.00	164,800
朝日ネット	200	517.00	103,400
e B A S E	100	1,737.00	173,700
アバント	100	1,414.00	141,400
アドソル日進	100	1,704.00	170,400
コムチュア	200	3,115.00	623,000
サイバーコム	100	2,522.00	252,200
メディカル・データ・ビジョン	300	1,115.00	334,500

モバイルファクトリー	100	1,446.00	144,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	100	1,479.00	147,900
ネオジャパン	100	976.00	97,600
オープンドア	100	3,180.00	318,000
アカツキ	100	5,780.00	578,000
LINE	900	4,010.00	3,609,000
オークネット	200	1,011.00	202,200
AOI TYO Holdings	300	786.00	235,800
マクロミル	500	1,396.00	698,000
フェイス	100	776.00	77,600
野村総合研究所	1,800	4,495.00	8,091,000
サイバネットシステム	200	598.00	119,600
インテージホールディングス	400	852.00	340,800
東邦システムサイエンス	100	913.00	91,300
ソースネクスト	1,100	512.00	563,200
FIG	300	365.00	109,500
フォーカスシステムズ	200	999.00	199,800
クレスコ	100	3,390.00	339,000
フジ・メディア・ホールディングス	3,000	1,651.00	4,953,000
オービック	1,000	10,510.00	10,510,000
ジャストシステム	400	2,749.00	1,099,600
TDCソフト	200	930.00	186,000
ヤフー	18,600	310.00	5,766,000
トレンドマイクロ	1,500	5,380.00	8,070,000
インフォメーション・ディベロプメント	100	1,389.00	138,900
日本オラクル	600	8,260.00	4,956,000
アルファシステムズ	100	2,657.00	265,700
フューチャー	400	1,743.00	697,200
CAC Holdings	200	1,227.00	245,400
ソフトバンク・テクノロジー	100	2,065.00	206,500
オービックビジネスコンサルタント	300	4,460.00	1,338,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,300	2,635.00	3,425,500
アイティフォー	300	834.00	250,200
エックスネット	100	854.00	85,400
大塚商会	1,500	4,055.00	6,082,500

サイボウズ	300	635.00	190,500
ソフトブレーン	200	503.00	100,600
電通国際情報サービス	200	3,630.00	726,000
デジタルガレージ	600	2,981.00	1,788,600
EMシステムズ	200	1,251.00	250,200
ウェザーニューズ	100	3,110.00	311,000
C I J	200	814.00	162,800
日本エンタープライズ	300	176.00	52,800
WOWOW	100	3,055.00	305,500
スカラ	200	827.00	165,400
ネットワンシステムズ	1,000	2,582.00	2,582,000
アルゴグラフィックス	100	4,925.00	492,500
マーベラス	400	901.00	360,400
エイベックス	500	1,421.00	710,500
日本ユニシス	900	2,816.00	2,534,400
兼松エレクトロニクス	200	3,355.00	671,000
東京放送ホールディングス	1,900	2,054.00	3,902,600
日本テレビホールディングス	2,600	1,787.00	4,646,200
朝日放送グループホールディングス	300	781.00	234,300
テレビ朝日ホールディングス	800	2,027.00	1,621,600
スカパーJ S A Tホールディングス	2,200	501.00	1,102,200
テレビ東京ホールディングス	200	2,489.00	497,800
日本BS放送	100	1,073.00	107,300
ビジョン	100	4,625.00	462,500
コネクシオ	200	1,435.00	287,000
日本通信	2,500	126.00	315,000
日本電信電話	19,600	4,702.00	92,159,200
K D D I	25,200	2,718.00	68,493,600
ソフトバンク	22,700	1,352.00	30,690,400
光通信	300	20,090.00	6,027,000
N T T ドコモ	20,500	2,608.00	53,464,000
エムティーアイ	300	633.00	189,900
G M O インターネット	1,000	1,850.00	1,850,000
アイドママーケティングコミュニケーション	100	493.00	49,300
カドカワ	800	1,250.00	1,000,000
学研ホールディングス	100	5,490.00	549,000

ゼンリン	600	3,135.00	1,881,000	
アイネット	200	1,397.00	279,400	
松竹	200	11,650.00	2,330,000	
東宝	1,900	4,080.00	7,752,000	
東映	100	13,350.00	1,335,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	7,600	1,217.00	9,249,200	
D T S	300	4,100.00	1,230,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1,300	3,270.00	4,251,000	
シーイーシー	300	2,308.00	692,400	
カプコン	1,200	2,190.00	2,628,000	
アイ・エス・ビー	100	2,213.00	221,300	
ジャステック	200	978.00	195,600	
S C S K	800	4,905.00	3,924,000	
日本システムウエア	100	1,923.00	192,300	
アイネス	400	1,298.00	519,200	
T K C	200	3,810.00	762,000	
富士ソフト	400	4,285.00	1,714,000	
N S D	500	2,440.00	1,220,000	
コナミホールディングス	1,200	4,505.00	5,406,000	
福井コンピュータホールディングス	100	1,903.00	190,300	
J B C Cホールディングス	200	1,607.00	321,400	
ミロク情報サービス	300	2,844.00	853,200	
ソフトバンクグループ	11,900	10,275.00	122,272,500	
高千穂交易	100	1,006.00	100,600	
伊藤忠食品	100	4,860.00	486,000	
エレマテック	100	1,863.00	186,300	
J A L U X	100	2,521.00	252,100	
あらた	200	4,340.00	868,000	
東京エレクトロン デバイス	100	1,823.00	182,300	
フィールズ	300	723.00	216,900	
双日	15,800	418.00	6,604,400	
アルフレッサ ホールディングス	3,200	3,210.00	10,272,000	
横浜冷凍	800	910.00	728,000	
ラサ商事	200	856.00	171,200	
アルコニックス	300	1,267.00	380,100	
神戸物産	400	3,710.00	1,484,000	

あい ホールディングス	400	1,953.00	781,200	
ディーブイエックス	100	1,146.00	114,600	
ダイワボウホールディングス	300	6,500.00	1,950,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	800	1,579.00	1,263,200	
ラクト・ジャパン	100	8,570.00	857,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	500	1,087.00	543,500	
八洲電機	200	842.00	168,400	
メディアスホールディングス	200	735.00	147,000	
U K Cホールディングス	200	2,060.00	412,000	
ジュテックホールディングス	100	1,051.00	105,100	
O C H Iホールディングス	100	1,220.00	122,000	
T O K A Iホールディングス	1,500	913.00	1,369,500	
三洋貿易	100	2,157.00	215,700	
ウイン・パートナーズ	200	1,178.00	235,600	
シップヘルスケアホールディングス	600	4,255.00	2,553,000	
明治電機工業	100	1,807.00	180,700	
デリカフーズホールディングス	100	1,329.00	132,900	
コメダホールディングス	700	2,128.00	1,489,600	
富士興産	100	669.00	66,900	
小野建	300	1,603.00	480,900	
佐島電機	200	986.00	197,200	
伯東	200	1,236.00	247,200	
コンドーテック	200	1,040.00	208,000	
中山福	200	552.00	110,400	
ナガイレーベン	400	2,355.00	942,000	
三菱食品	300	2,873.00	861,900	
松田産業	200	1,470.00	294,000	
第一興商	400	5,470.00	2,188,000	
メディバルホールディングス	3,100	2,600.00	8,060,000	
S P K	100	2,331.00	233,100	
萩原電気ホールディングス	100	3,025.00	302,500	
アズワン	200	8,340.00	1,668,000	
スズデン	100	1,754.00	175,400	
尾家産業	100	1,319.00	131,900	
シモジマ	200	1,117.00	223,400	
ドウシシャ	300	1,718.00	515,400	

小津産業	100	1,878.00	187,800
高速	200	1,174.00	234,800
たけびし	100	1,470.00	147,000
リックス	100	1,662.00	166,200
丸文	300	720.00	216,000
ハピネット	200	1,452.00	290,400
橋本総業ホールディングス	100	1,492.00	149,200
日本ライフライン	900	1,768.00	1,591,200
タカショー	100	425.00	42,500
エクセル	100	2,358.00	235,800
マルカキカイ	100	2,122.00	212,200
I D O M	1,000	369.00	369,000
日本エム・ディ・エム	200	1,102.00	220,400
進和	200	2,220.00	444,000
ダイトロン	100	1,748.00	174,800
シークス	400	1,717.00	686,800
田中商事	100	614.00	61,400
オーハシテクニカ	200	1,444.00	288,800
白銅	100	1,641.00	164,100
伊藤忠商事	20,100	2,018.00	40,561,800
丸紅	28,300	807.00	22,838,100
長瀬産業	1,600	1,665.00	2,664,000
蝶理	200	1,552.00	310,400
豊田通商	3,200	3,575.00	11,440,000
三共生興	500	447.00	223,500
兼松	1,100	1,302.00	1,432,200
ツカモトコーポレーション	100	1,059.00	105,900
三井物産	23,600	1,776.50	41,925,400
日本紙パルプ商事	200	4,100.00	820,000
日立ハイテクノロジーズ	900	4,295.00	3,865,500
カメイ	400	1,253.00	501,200
スターゼン	100	3,990.00	399,000
山善	1,100	1,187.00	1,305,700
椿本興業	100	3,735.00	373,500
住友商事	17,000	1,625.00	27,625,000
内田洋行	100	2,535.00	253,500

				代用有価証券
三菱商事	20,100	3,187.00	64,058,700	5,200株
第一実業	100	3,460.00	346,000	
キャノンマーケティングジャパン	800	2,080.00	1,664,000	
西華産業	200	1,513.00	302,600	
佐藤商事	300	950.00	285,000	
菱洋エレクトロ	300	1,563.00	468,900	
東京産業	300	547.00	164,100	
ユアサ商事	300	3,320.00	996,000	
神鋼商事	100	2,568.00	256,800	
小林産業	200	286.00	57,200	
阪和興業	500	3,325.00	1,662,500	
正栄食品工業	200	3,070.00	614,000	
カナデン	300	1,268.00	380,400	
菱電商事	200	1,478.00	295,600	
フルサト工業	200	1,677.00	335,400	
岩谷産業	600	3,620.00	2,172,000	
極東貿易	100	1,709.00	170,900	
イワキ	300	412.00	123,600	
三愛石油	800	994.00	795,200	
稲畑産業	700	1,577.00	1,103,900	
G S Iクレオス	100	1,196.00	119,600	
明和産業	300	466.00	139,800	
ワキタ	600	1,221.00	732,600	
東邦ホールディングス	800	2,760.00	2,208,000	
サンゲツ	900	2,075.00	1,867,500	
ミツウロコグループホールディングス	400	813.00	325,200	
シナネンホールディングス	100	2,247.00	224,700	
伊藤忠エネクス	600	944.00	566,400	
サンリオ	900	2,320.00	2,088,000	
サンワテクノス	200	979.00	195,800	
リョーサン	300	3,115.00	934,500	
新光商事	300	1,898.00	569,400	
トーヨー	100	2,040.00	204,000	
三信電気	200	1,838.00	367,600	
東陽テクニカ	300	912.00	273,600	

モスフードサービス	400	2,769.00	1,107,600	
加賀電子	300	2,125.00	637,500	
ソーダニッカ	300	562.00	168,600	
立花エレテック	200	1,722.00	344,400	
フォーバル	100	835.00	83,500	
PALTAC	500	5,720.00	2,860,000	
三谷産業	300	291.00	87,300	
太平洋興発	100	767.00	76,700	
西本Wismettacホールディングス	100	4,365.00	436,500	
国際紙パルプ商事	500	294.00	147,000	
ヤマタネ	100	1,652.00	165,200	
日鉄住金物産	200	4,770.00	954,000	
泉州電業	100	2,733.00	273,300	
トラスコ中山	600	3,100.00	1,860,000	
オートバックスセブン	1,100	1,842.00	2,026,200	
モリト	200	782.00	156,400	
加藤産業	400	3,630.00	1,452,000	
イノテック	200	1,048.00	209,600	
イエローハット	300	2,924.00	877,200	
J Kホールディングス	300	619.00	185,700	
日伝	200	1,592.00	318,400	
杉本商事	200	1,815.00	363,000	
因幡電機産業	400	4,500.00	1,800,000	
バイテックホールディングス	100	2,041.00	204,100	
東テク	100	2,276.00	227,600	
ミスミグループ本社	3,600	2,759.00	9,932,400	
タキヒヨー	100	1,790.00	179,000	
スズケン	1,300	5,880.00	7,644,000	
ジェコス	200	1,074.00	214,800	
ルネサスイーストン	300	446.00	133,800	
ローソン	700	6,820.00	4,774,000	
サンエー	200	4,385.00	877,000	
カワチ薬品	200	2,091.00	418,200	
エービーシー・マート	400	6,500.00	2,600,000	
ハードオフコーポレーション	100	819.00	81,900	
アスクル	300	2,480.00	744,000	

ゲオホールディングス	400	1,612.00	644,800
アダストリア	400	1,894.00	757,600
ジーフット	200	678.00	135,600
くらコーポレーション	200	5,730.00	1,146,000
キャンドウ	100	1,597.00	159,700
パルグループホールディングス	100	3,145.00	314,500
エディオン	1,200	973.00	1,167,600
サーラコーポレーション	600	581.00	348,600
ワッツ	100	735.00	73,500
ハローズ	100	2,114.00	211,400
あみやき亭	100	3,665.00	366,500
ひらまつ	600	347.00	208,200
大黒天物産	100	4,020.00	402,000
ハニーズホールディングス	300	972.00	291,600
アルペン	200	1,644.00	328,800
ハブ	100	965.00	96,500
クオールホールディングス	400	1,455.00	582,000
ジーンズ	200	5,370.00	1,074,000
ビックカメラ	1,500	1,255.00	1,882,500
DCMホールディングス	1,500	1,111.00	1,666,500
ペッパーフードサービス	200	2,761.00	552,200
Monotaro	1,800	2,451.00	4,411,800
アークランドサービスホールディングス	200	2,033.00	406,600
J.フロント リテイリング	3,700	1,231.00	4,554,700
ドトール・日レスホールディングス	500	2,173.00	1,086,500
マツモトキヨシホールディングス	1,200	3,870.00	4,644,000
ブロンコビリー	100	2,688.00	268,800
ZOZO	3,100	1,952.00	6,051,200
トレジャー・ファクトリー	100	752.00	75,200
物語コーポレーション	100	9,890.00	989,000
ココカラファイン	300	4,860.00	1,458,000
三越伊勢丹ホールディングス	5,400	1,104.00	5,961,600
Hamee	100	822.00	82,200
ウエルシアホールディングス	800	4,025.00	3,220,000
クリエイティブSDホールディングス	400	2,827.00	1,130,800
丸善CHIホールディングス	300	340.00	102,000

チムニー	100	2,670.00	267,000	
シュッピン	200	780.00	156,000	
ネクステージ	400	975.00	390,000	
ジョイフル本田	800	1,410.00	1,128,000	
鳥貴族	100	1,780.00	178,000	
すかいらーくホールディングス	2,700	1,711.00	4,619,700	
綿半ホールディングス	100	2,254.00	225,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	800	1,193.00	954,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	100	608.00	60,800	
B E E N O S	100	1,153.00	115,300	
あさひ	200	1,470.00	294,000	
日本調剤	100	3,960.00	396,000	
コスモス薬品	100	20,500.00	2,050,000	
トーエル	100	726.00	72,600	
セブン&アイ・ホールディングス	12,000	4,952.00	59,424,000	
薬王堂	100	2,568.00	256,800	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	800	1,281.00	1,024,800	
ツルハホールディングス	600	9,880.00	5,928,000	
サンマルクホールディングス	200	2,573.00	514,600	
フェリシモ	100	1,132.00	113,200	
トリドールホールディングス	400	2,303.00	921,200	
T O K Y O B A S E	300	896.00	268,800	
ジャパンミート	100	1,757.00	175,700	
ダイユー・リックホールディングス	200	1,003.00	200,600	
バロックジャパンリミテッド	200	919.00	183,800	
クスリのアオキホールディングス	300	7,740.00	2,322,000	
スシローグローバルホールディングス	300	7,180.00	2,154,000	
L I X I L ビバ	200	1,461.00	292,200	
はるやまホールディングス	100	858.00	85,800	
ノジマ	500	1,984.00	992,000	
ライトオン	200	817.00	163,400	
良品計画	400	26,580.00	10,632,000	
三城ホールディングス	400	398.00	159,200	
アドヴァン	400	987.00	394,800	
アルビス	100	2,330.00	233,000	

コナカ	400	438.00	175,200
G-7ホールディングス	100	2,261.00	226,100
イオン北海道	300	787.00	236,100
ヒマラヤ	100	999.00	99,900
コーナン商事	400	2,844.00	1,137,600
エコス	100	1,697.00	169,700
ワタミ	400	1,657.00	662,800
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	1,700	6,620.00	11,254,000
西松屋チェーン	600	909.00	545,400
ゼンショーホールディングス	1,400	2,529.00	3,540,600
ハークスレイ	100	1,143.00	114,300
サイゼリヤ	500	2,021.00	1,010,500
V Tホールディングス	1,000	412.00	412,000
魚力	100	1,455.00	145,500
フジ・コーポレーション	100	2,123.00	212,300
ユナイテッドアローズ	300	3,510.00	1,053,000
ハイデイ日高	400	2,325.00	930,000
コロワイド	1,000	2,378.00	2,378,000
ピーシーデポコーポレーション	400	446.00	178,400
壱番屋	200	4,835.00	967,000
P L A N T	100	1,006.00	100,600
スギホールディングス	600	4,765.00	2,859,000
スクロール	400	398.00	159,200
ヨンドシーホールディングス	300	2,143.00	642,900
ユニー・ファミリーマートホールディングス	800	12,570.00	10,056,000
木曽路	400	2,563.00	1,025,200
S R Sホールディングス	300	1,019.00	305,700
ケーヨー	500	551.00	275,500
上新電機	300	2,314.00	694,200
日本瓦斯	500	4,000.00	2,000,000
ロイヤルホールディングス	500	2,695.00	1,347,500
いなげや	300	1,306.00	391,800
島忠	600	2,959.00	1,775,400
チヨダ	300	1,891.00	567,300
ライフコーポレーション	200	2,420.00	484,000

リンガーハット	400	2,384.00	953,600
MrMaxHD	400	511.00	204,400
AOKIホールディングス	600	1,252.00	751,200
オークワ	400	1,135.00	454,000
コメリ	400	2,751.00	1,100,400
青山商事	500	2,737.00	1,368,500
しまむら	300	9,180.00	2,754,000
はせがわ	200	393.00	78,600
高島屋	2,300	1,486.00	3,417,800
松屋	600	1,065.00	639,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,500	1,534.00	2,301,000
近鉄百貨店	100	3,300.00	330,000
パルコ	300	1,146.00	343,800
丸井グループ	2,400	2,007.00	4,816,800
アクシアル リテイリング	200	3,450.00	690,000
イオン	11,000	2,388.50	26,273,500
イズミ	600	5,190.00	3,114,000
平和堂	600	2,427.00	1,456,200
フジ	300	1,877.00	563,100
ヤオコー	300	5,800.00	1,740,000
ゼビオホールディングス	300	1,300.00	390,000
ケーズホールディングス	3,000	1,010.00	3,030,000
日産東京販売ホールディングス	400	325.00	130,000
Genky DrugStores	100	2,565.00	256,500
総合メディカルホールディングス	200	1,914.00	382,800
ブックオフグループホールディングス	100	800.00	80,000
アインホールディングス	400	7,350.00	2,940,000
元気寿司	100	3,830.00	383,000
ヤマダ電機	8,700	531.00	4,619,700
アークランドサカモト	500	1,427.00	713,500
ニトリホールディングス	1,200	14,150.00	16,980,000
グルメ杵屋	200	1,164.00	232,800
愛眼	200	318.00	63,600
ケーユーホールディングス	100	835.00	83,500
吉野家ホールディングス	1,000	1,848.00	1,848,000
松屋フーズホールディングス	100	3,680.00	368,000

サガミホールディングス	400	1,361.00	544,400
関西スーパーマーケット	200	1,004.00	200,800
王将フードサービス	200	7,450.00	1,490,000
プレナス	300	1,810.00	543,000
ミニストップ	200	1,921.00	384,200
アークス	500	2,540.00	1,270,000
パローホールディングス	600	2,688.00	1,612,800
ベルク	100	5,030.00	503,000
大庄	200	1,557.00	311,400
ファーストリテイリング	400	51,110.00	20,444,000
サンドラッグ	1,100	3,400.00	3,740,000
サクスパー ホールディングス	200	1,110.00	222,000
ヤマザワ	100	1,795.00	179,500
ベルーナ	700	898.00	628,600
めぶきフィナンシャルグループ	14,900	302.00	4,499,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	400	1,566.00	626,400
九州フィナンシャルグループ	4,700	451.00	2,119,700
ゆうちょ銀行	8,100	1,249.00	10,116,900
富山第一銀行	700	387.00	270,900
コンコルディア・フィナンシャルグループ	18,300	454.00	8,308,200
西日本フィナンシャルホールディングス	1,800	978.00	1,760,400
関西みらいフィナンシャルグループ	1,300	818.00	1,063,400
三十三フィナンシャルグループ	200	1,612.00	322,400
第四北越フィナンシャルグループ	500	3,560.00	1,780,000
新生銀行	2,100	1,511.00	3,173,100
あおぞら銀行	1,600	3,250.00	5,200,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	200,100	580.40	116,138,040
りそなホールディングス	31,500	507.40	15,983,100
三井住友トラスト・ホールディングス	5,600	4,173.00	23,368,800
三井住友フィナンシャルグループ	20,300	4,002.00	81,240,600
千葉銀行	10,200	675.00	6,885,000
群馬銀行	5,700	471.00	2,684,700
武蔵野銀行	400	2,352.00	940,800
千葉興業銀行	800	332.00	265,600
筑波銀行	1,200	202.00	242,400
七十七銀行	900	1,800.00	1,620,000

青森銀行	200	2,851.00	570,200	
秋田銀行	200	2,197.00	439,400	
山形銀行	300	1,936.00	580,800	
岩手銀行	200	3,265.00	653,000	
東邦銀行	2,600	307.00	798,200	
東北銀行	100	1,086.00	108,600	
みちのく銀行	200	1,616.00	323,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	2,300	2,442.00	5,616,600	
静岡銀行	7,200	874.00	6,292,800	
十六銀行	400	2,298.00	919,200	
スルガ銀行	2,900	549.00	1,592,100	
八十二銀行	5,200	462.00	2,402,400	
山梨中央銀行	400	1,405.00	562,000	
大垣共立銀行	500	2,255.00	1,127,500	
福井銀行	200	1,581.00	316,200	
北國銀行	300	3,420.00	1,026,000	
富山銀行	100	3,170.00	317,000	
滋賀銀行	600	2,606.00	1,563,600	
南都銀行	300	2,190.00	657,000	
百五銀行	2,600	382.00	993,200	
京都銀行	1,000	4,595.00	4,595,000	
紀陽銀行	1,000	1,544.00	1,544,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,900	1,229.00	2,335,100	
広島銀行	4,200	631.00	2,650,200	
山陰合同銀行	1,700	804.00	1,366,800	
中国銀行	1,900	1,055.00	2,004,500	
鳥取銀行	100	1,410.00	141,000	
伊予銀行	3,800	611.00	2,321,800	
百十四銀行	300	2,415.00	724,500	
四国銀行	400	1,042.00	416,800	
阿波銀行	500	2,958.00	1,479,000	
大分銀行	200	3,335.00	667,000	
宮崎銀行	200	2,683.00	536,600	
佐賀銀行	200	1,811.00	362,200	
十八銀行	200	2,715.00	543,000	
沖縄銀行	300	3,375.00	1,012,500	

琉球銀行	700	1,173.00	821,100
セブン銀行	9,700	331.00	3,210,700
みずほフィナンシャルグループ	390,400	175.30	68,437,120
山口フィナンシャルグループ	3,600	1,050.00	3,780,000
長野銀行	100	1,574.00	157,400
名古屋銀行	200	3,485.00	697,000
北洋銀行	4,300	301.00	1,294,300
愛知銀行	100	3,445.00	344,500
中京銀行	100	2,178.00	217,800
大光銀行	100	1,706.00	170,600
愛媛銀行	400	1,097.00	438,800
トマト銀行	100	1,060.00	106,000
京葉銀行	1,300	693.00	900,900
栃木銀行	1,500	239.00	358,500
北日本銀行	100	2,063.00	206,300
東和銀行	500	706.00	353,000
トモニホールディングス	2,200	403.00	886,600
フィデアホールディングス	2,800	131.00	366,800
池田泉州ホールディングス	3,100	298.00	923,800
F P G	900	1,026.00	923,400
マーキュリアインベストメント	100	677.00	67,700
S B Iホールディングス	3,400	2,315.00	7,871,000
ジャフコ	500	3,895.00	1,947,500
大和証券グループ本社	23,100	573.00	13,236,300
野村ホールディングス	50,600	438.50	22,188,100
岡三証券グループ	2,400	484.00	1,161,600
丸三証券	900	811.00	729,900
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	3,400	492.00	1,672,800
水戸証券	800	262.00	209,600
いちよし証券	600	858.00	514,800
松井証券	1,400	1,197.00	1,675,800
だいこう証券ビジネス	100	441.00	44,100
マネックスグループ	2,700	429.00	1,158,300
極東証券	400	1,173.00	469,200
岩井コスモホールディングス	300	1,287.00	386,100
藍澤証券	500	697.00	348,500

かんぼ生命保険	1,100	2,466.00	2,712,600	
S O M P Oホールディングス	5,100	4,134.00	21,083,400	
アニコム ホールディングス	200	2,966.00	593,200	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	7,500	3,347.00	25,102,500	
ソニーフィナンシャルホールディングス	2,400	2,109.00	5,061,600	
第一生命ホールディングス	16,300	1,699.00	27,693,700	
東京海上ホールディングス	10,400	5,503.00	57,231,200	
T & Dホールディングス	8,900	1,361.50	12,117,350	
アドバンスクリエイト	100	1,728.00	172,800	
全国保証	800	4,005.00	3,204,000	
アルヒ	300	2,312.00	693,600	
クレディセゾン	2,000	1,611.00	3,222,000	
芙蓉総合リース	300	5,740.00	1,722,000	
興銀リース	500	2,687.00	1,343,500	
東京センチュリー	600	5,010.00	3,006,000	
日本証券金融	1,300	613.00	796,900	
アイフル	4,400	303.00	1,333,200	
リコーリース	200	3,485.00	697,000	
イオンフィナンシャルサービス	1,800	2,175.00	3,915,000	
アコム	5,800	380.00	2,204,000	
ジャックス	300	1,890.00	567,000	
オリエントコーポレーション	7,800	118.00	920,400	
日立キャピタル	700	2,577.00	1,803,900	
オリックス	19,200	1,614.50	30,998,400	
三菱UFJリース	6,500	553.00	3,594,500	
九州リースサービス	100	694.00	69,400	
日本取引所グループ	7,800	1,968.00	15,350,400	
イー・ギャランティ	300	1,057.00	317,100	
アサックス	100	552.00	55,200	
N E Cキャピタルソリューション	100	1,655.00	165,500	
いちご	3,700	379.00	1,402,300	
日本駐車場開発	3,500	155.00	542,500	
ヒューリック	6,000	1,015.00	6,090,000	
三栄建築設計	100	1,664.00	166,400	
スター・マイカ	100	1,365.00	136,500	

野村不動産ホールディングス	1,900	2,087.00	3,965,300
三重交通グループホールディングス	600	605.00	363,000
サムティ	400	1,517.00	606,800
ディア・ライフ	400	432.00	172,800
日本商業開発	200	1,531.00	306,200
プレサンスコーポレーション	500	1,405.00	702,500
ユニゾホールディングス	400	2,171.00	868,400
日本管理センター	200	776.00	155,200
サンセイランディック	100	748.00	74,800
フージャースホールディングス	600	677.00	406,200
オープンハウス	500	3,980.00	1,990,000
東急不動産ホールディングス	7,700	617.00	4,750,900
飯田グループホールディングス	2,400	2,027.00	4,864,800
ファーストブラザーズ	100	1,119.00	111,900
ハウスドゥ	200	1,505.00	301,000
シーアールイー	100	932.00	93,200
ケイアイスター不動産	100	1,724.00	172,400
パーク24	1,700	2,675.00	4,547,500
パラカ	100	1,904.00	190,400
三井不動産	15,200	2,637.00	40,082,400
三菱地所	20,100	1,883.00	37,848,300
平和不動産	500	2,073.00	1,036,500
東京建物	3,100	1,276.00	3,955,600
ダイビル	800	1,065.00	852,000
京阪神ビルディング	500	918.00	459,000
住友不動産	6,500	4,234.00	27,521,000
テオーシー	700	788.00	551,600
レオパレス21	3,500	207.00	724,500
スターツコーポレーション	400	2,402.00	960,800
フジ住宅	400	864.00	345,600
空港施設	300	542.00	162,600
明和地所	200	609.00	121,800
ゴールドクレスト	200	1,609.00	321,800
日本エスリード	100	1,639.00	163,900
日神不動産	400	478.00	191,200
日本エスコン	500	757.00	378,500

タカラレーベン	1,300	354.00	460,200
サンヨーハウジング名古屋	200	946.00	189,200
イオンモール	1,400	1,871.00	2,619,400
ファースト住建	100	1,244.00	124,400
カチタス	300	3,655.00	1,096,500
トーセイ	400	1,029.00	411,600
サンフロンティア不動産	400	1,244.00	497,600
エフ・ジェー・ネクスト	300	872.00	261,600
ランドビジネス	100	789.00	78,900
グランディハウス	300	443.00	132,900
日本空港ビルデング	900	4,325.00	3,892,500
日本工営	200	2,527.00	505,400
L I F U L L	1,100	653.00	718,300
ジェイエイシーリクルートメント	200	2,482.00	496,400
日本M&Aセンター	2,100	2,859.00	6,003,900
メンバーズ	100	1,557.00	155,700
タケエイ	300	817.00	245,100
トラスト・テック	200	3,495.00	699,000
コシダカホールディングス	700	1,639.00	1,147,300
パソナグループ	300	1,428.00	428,400
C D S	100	1,259.00	125,900
リンクアンドモチベーション	500	911.00	455,500
G C A	300	893.00	267,900
エス・エム・エス	1,000	1,954.00	1,954,000
パーソルホールディングス	2,800	1,854.00	5,191,200
リニカル	200	1,724.00	344,800
クックパッド	900	287.00	258,300
アイ・ケイ・ケイ	100	738.00	73,800
学情	100	1,304.00	130,400
スタジオアリス	100	2,307.00	230,700
シミックホールディングス	200	1,667.00	333,400
N J S	100	1,510.00	151,000
総合警備保障	1,100	4,855.00	5,340,500
カカコム	2,100	2,081.00	4,370,100
セントケア・ホールディング	200	561.00	112,200
ルネサンス	200	2,010.00	402,000

ディップ	400	2,047.00	818,800
オプトホールディング	200	1,671.00	334,200
ツクイ	700	713.00	499,100
キャリアデザインセンター	100	1,197.00	119,700
エムスリー	5,900	1,734.00	10,230,600
ツカダ・グローバルホールディング	200	617.00	123,400
アウトソーシング	1,500	1,422.00	2,133,000
ウェルネット	300	1,088.00	326,400
ワールドホールディングス	100	2,022.00	202,200
ディー・エヌ・エー	1,500	1,696.00	2,544,000
博報堂DYホールディングス	3,900	1,783.00	6,953,700
ぐるなび	400	720.00	288,000
エスアールジータカミヤ	300	672.00	201,600
ジャパンベストレスキューシステム	200	1,344.00	268,800
ファンコミュニケーションズ	800	529.00	423,200
ライク	100	981.00	98,100
WDBホールディングス	100	2,808.00	280,800
ティア	100	658.00	65,800
バリューコマース	200	2,169.00	433,800
インフォマート	1,500	1,249.00	1,873,500
J Pホールディングス	800	277.00	221,600
E P Sホールディングス	400	1,799.00	719,600
レグス	100	927.00	92,700
プレステージ・インターナショナル	500	1,324.00	662,000
アミューズ	200	2,483.00	496,600
ドリームインキュベータ	100	1,500.00	150,000
クイック	200	1,578.00	315,600
ケネディクス	2,400	545.00	1,308,000
電通	3,400	4,905.00	16,677,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	100	1,748.00	174,800
ぴあ	100	4,025.00	402,500
イオンファンタジー	100	2,803.00	280,300
シーティーエス	300	712.00	213,600
ネクシィーズグループ	100	1,713.00	171,300
みらかホールディングス	800	2,956.00	2,364,800
アルプス技研	200	1,983.00	396,600

ダイオーズ	100	1,367.00	136,700
日本空調サービス	300	684.00	205,200
オリエンタルランド	3,300	12,210.00	40,293,000
ダスキン	700	2,756.00	1,929,200
明光ネットワークジャパン	400	942.00	376,800
ファルコホールディングス	200	1,423.00	284,600
ラウンドワン	900	1,437.00	1,293,300
リゾートトラスト	1,200	1,574.00	1,888,800
ビー・エム・エル	400	3,315.00	1,326,000
りらいあコミュニケーションズ	500	998.00	499,000
リソー教育	1,400	471.00	659,400
ユー・エス・エス	3,400	2,012.00	6,840,800
東京個別指導学院	100	1,198.00	119,800
サイバーエージェント	1,700	3,375.00	5,737,500
楽天	13,000	840.00	10,920,000
クリーク・アンド・リバー社	200	1,125.00	225,000
テー・オー・ダブリュー	200	768.00	153,600
セントラルスポーツ	100	3,450.00	345,000
フルキャストホールディングス	300	2,213.00	663,900
エン・ジャパン	300	3,725.00	1,117,500
テクノプロ・ホールディングス	600	5,960.00	3,576,000
アイ・アールジャパンホールディングス	100	1,448.00	144,800
KeePer 技研	100	1,152.00	115,200
ファーストロジック	100	686.00	68,600
Gunosy	200	2,480.00	496,000
イー・ガーディアン	100	2,111.00	211,100
リブセンス	200	282.00	56,400
ジャパンマテリアル	800	1,421.00	1,136,800
ベクトル	300	1,454.00	436,200
ウチヤマホールディングス	100	445.00	44,500
ライクキッズネクスト	100	855.00	85,500
キャリアリンク	100	407.00	40,700
I B J	200	871.00	174,200
アサンテ	100	2,237.00	223,700
M&Aキャピタルパートナーズ	100	5,200.00	520,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	100	1,187.00	118,700

エスクロー・エージェント・ジャパン	400	257.00	102,800	
日本ビューホテル	100	1,137.00	113,700	
リクルートホールディングス	19,900	3,016.00	60,018,400	
エラン	200	1,492.00	298,400	
土木管理総合試験所	100	517.00	51,700	
日本郵政	22,800	1,338.00	30,506,400	
ベルシステム24ホールディングス	500	1,528.00	764,000	
鎌倉新書	200	1,886.00	377,200	
LITALICO	100	1,957.00	195,700	
ストライク	100	2,087.00	208,700	
ソラスト	700	1,166.00	816,200	
セラク	100	592.00	59,200	
インソース	100	2,360.00	236,000	
アイモバイル	100	866.00	86,600	
キャリアインデックス	100	907.00	90,700	
MS - Japan	100	1,766.00	176,600	
グリーンズ	100	1,419.00	141,900	
日総工産	100	2,586.00	258,600	
キュービーネットホールディングス	100	2,068.00	206,800	
スプリックス	100	2,728.00	272,800	
アドバンテッジリスクマネジメント	100	937.00	93,700	
リログループ	1,500	2,990.00	4,485,000	
東祥	200	3,470.00	694,000	
エイチ・アイ・エス	500	4,280.00	2,140,000	
ラックランド	100	1,963.00	196,300	
共立メンテナンス	400	5,200.00	2,080,000	
イチネンホールディングス	300	1,317.00	395,100	
建設技術研究所	200	1,528.00	305,600	
スペース	200	1,349.00	269,800	
長大	100	803.00	80,300	
燦ホールディングス	100	2,510.00	251,000	
東京テアトル	100	1,285.00	128,500	
タナベ経営	100	1,232.00	123,200	
ナガワ	100	5,560.00	556,000	
よみうりランド	100	4,215.00	421,500	
東京都競馬	200	3,625.00	725,000	

常磐興産	100	1,631.00	163,100	
カナモト	400	2,928.00	1,171,200	
東京ドーム	1,000	1,009.00	1,009,000	
西尾レントオール	300	3,420.00	1,026,000	
トランス・コスモス	300	2,185.00	655,500	
乃村工藝社	700	3,200.00	2,240,000	
藤田観光	100	2,658.00	265,800	
日本管財	300	1,927.00	578,100	
トーカイ	300	2,865.00	859,500	
セコム	3,000	9,573.00	28,719,000	
セントラル警備保障	100	4,265.00	426,500	
丹青社	500	1,267.00	633,500	
メイテック	400	4,955.00	1,982,000	
応用地質	300	1,156.00	346,800	
船井総研ホールディングス	600	2,510.00	1,506,000	
進学会ホールディングス	100	559.00	55,900	
オオバ	200	620.00	124,000	
いであ	100	988.00	98,800	
学究社	100	1,355.00	135,500	
ベネッセホールディングス	1,000	3,080.00	3,080,000	
イオンディライト	300	4,070.00	1,221,000	
ナック	200	1,049.00	209,800	
ニチイ学館	400	1,217.00	486,800	
ダイセキ	500	2,696.00	1,348,000	
ステップ	100	1,407.00	140,700	
合 計	3,318,500		6,676,960,460	

## (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

「注記表(デリバティブ取引等関係)」に記載しております。

【中間財務諸表】

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第31期中間計算期間(平成31年2月23日から令和1年8月22日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【ニュー トピックス インデックス】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第31期中間計算期間末 令和 1年 8月22日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,085,235
親投資信託受益証券	480,513,195
流動資産合計	482,598,430
資産合計	482,598,430
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	274,279
未払委託者報酬	1,371,341
未払利息	4
その他未払費用	4,099
流動負債合計	1,649,723
負債合計	1,649,723
純資産の部	
元本等	
元本	686,732,328
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	205,783,621
( 分配準備積立金 )	182,132,888
元本等合計	480,948,707
純資産合計	480,948,707
負債純資産合計	482,598,430

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第31期中間計算期間 自 平成31年 2月23日 至 令和 1年 8月22日
営業収益	
有価証券売買等損益	29,032,813
営業収益合計	29,032,813
営業費用	
支払利息	383
受託者報酬	274,279
委託者報酬	1,371,341
その他費用	4,099
営業費用合計	1,650,102
営業利益	30,682,915
経常利益	30,682,915
中間純利益	30,682,915
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	138,186
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	181,081,020
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,946,380
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,946,380
剰余金減少額又は欠損金増加額	104,252
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	104,252
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	205,783,621

## (3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第31期中間計算期間 自 平成31年 2月23日 至 令和 1年 8月22日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

第31期中間計算期間末 令和 1年 8月22日現在	
1. 中間計算期間末日における受益権の総数	686,732,328口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 205,783,621円	
3. 中間計算期間末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額	0.7003円
(1万口当たり純資産額)	(7,003円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第31期中間計算期間末 令和 1年 8月22日現在	
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	中間貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。
2. 時価の算定方法	親投資信託受益証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価として おります。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する 場合があります。

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

区分	第31期中間計算期間末 令和 1年 8月22日現在
期首元本額	709,680,599円
期中追加設定元本額	355,692円
期中一部解約元本額	23,303,963円

## 2 デリバティブ取引等関係

## 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

## （参考）

当ファンドは、「ニュー トピックス インデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## ニュー トピックス インデックス マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

令和 1年 8月22日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	170,930,946
株式	4,583,116,780
派生商品評価勘定	199,352
未収配当金	9,107,111
前払金	4,290,000
流動資産合計	4,767,644,189
<b>資産合計</b>	<b>4,767,644,189</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,051,944
未払解約金	58,000,000
未払利息	345
流動負債合計	62,052,289
<b>負債合計</b>	<b>62,052,289</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	2,355,865,067
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,349,726,833

令和 1年 8月22日現在

元本等合計	4,705,591,900
純資産合計	4,705,591,900
負債純資産合計	4,767,644,189

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成31年 2月23日 至 令和 1年 8月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

令和 1年 8月22日現在	
1. 担保資産	
先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り差入を行っております。	
株式	138,663,250円
2. 計算日における受益権の総数	2,355,865,067口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.9974円
(1万口当たり純資産額)	(19,974円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

令和 1年 8月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	

## 株式

「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。

## 派生商品評価勘定

「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

## 3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

区分	令和 1年 8月22日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	3,265,398,218円
期中追加設定元本額	72,059,786円
期中一部解約元本額	981,592,937円
同期末における元本の内訳	
ニュー トピックス インデックス	240,569,338円
新光7資産バランスファンド	325,349,085円
ニュー トピックス インデックス（変額年金）	98,708,582円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	445,639,977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）	104,591,896円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	647,660,651円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	450,832,850円
グローバル・ナビ	19,739,443円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	5,136,236円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	14,543,927円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	3,093,082円
合計	2,355,865,067円

## 2 デリバティブ取引等関係

## 取引の時価等に関する事項

## （株式関連）

種類	令和 1年 8月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	123,652,592	-	119,800,000	3,852,592
東証株価指数先物	123,652,592	-	119,800,000	3,852,592

合計	123,652,592	-	119,800,000	3,852,592
----	-------------	---	-------------	-----------

## 時価の算定方法

## 先物取引

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

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## ニュー トピックス インデックス

(令和 1年 8月30日現在)

資産総額	485,550,850円
負債総額	68,297円
純資産総額（ - ）	485,482,553円
発行済口数	686,777,543口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7069円
（1万口当たり純資産額）	（7,069円）

## (参考)ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(令和 1年 8月30日現在)

資産総額	4,643,316,830円
負債総額	83,545,632円
純資産総額（ - ）	4,559,771,198円
発行済口数	2,261,290,162口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0164円
（1万口当たり純資産額）	（20,164円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

## (2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

## (3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

## (4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額（2019年8月30日現在）

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

直近5力年の資本金の増減：該当事項はありません。

###### (2) 会社の機構（2019年8月30日現在）

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

###### 2. 運用計画、売買計画の決定

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年8月30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	1,154,407,417,273
追加型株式投資信託	873	13,507,385,911,626
単位型公社債投資信託	41	118,024,810,741
単位型株式投資信託	167	1,260,959,327,482
合計	1,107	16,040,777,467,122

## 3【委託会社等の経理状況】

- 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第34期事業年度（自2018年4月1日至2019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33期 （2018年3月31日現在）	第34期 （2019年3月31日現在）
（資産の部）		
流動資産		
現金・預金	49,071,217	41,087,475
金銭の信託	12,083,824	18,773,228
有価証券	-	153,518
未収委託者報酬	11,769,015	12,438,085

未収運用受託報酬		4,574,225		3,295,109
未収投資助言報酬		341,689		327,064
未収収益		59,526		56,925
前払費用		569,431		573,874
その他		427,238		491,914
	流動資産計	78,896,169		77,197,195
固定資産				
有形固定資産		1,643,826		1,461,316
建物	1	1,156,953	1	1,096,916
器具備品	1	476,504	1	364,399
建設仮勘定		10,368		-
無形固定資産		1,934,700		2,411,540
ソフトウェア		1,026,319		885,545
ソフトウェア仮勘定		904,389		1,522,040
電話加入権		3,931		3,931
電信電話専用施設利用権		60		23
投資その他の資産		8,270,313		9,269,808
投資有価証券		1,721,433		1,611,931
関係会社株式		3,229,196		4,499,196
長期差入保証金		1,518,725		1,312,328
繰延税金資産		1,699,533		1,748,459
その他		101,425		97,892
	固定資産計	11,848,840		13,142,665
資産合計		90,745,010		90,339,861

(単位：千円)

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,003,550	2,183,889
未払金	5,081,728	5,697,942
未払収益分配金	1,031	1,053
未払償還金	57,275	48,968
未払手数料	4,629,133	4,883,723
その他未払金	394,288	764,196
未払費用	7,711,038	6,724,986
未払法人税等	5,153,972	3,341,238
未払消費税等	1,660,259	576,632
賞与引当金	1,393,911	1,344,466
役員賞与引当金	49,986	48,609

本社移転費用引当金	156,587	-
流動負債計	22,211,034	19,917,766
固定負債		
退職給付引当金	1,637,133	1,895,158
時効後支払損引当金	199,026	177,851
固定負債計	1,836,160	2,073,009
負債合計	24,047,195	21,990,776
(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	44,349,855	45,949,372
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	44,226,562	45,826,079
別途積立金	24,580,000	31,680,000
研究開発積立金	300,000	-
運用責任準備積立金	200,000	-
繰越利益剰余金	19,146,562	14,146,079
株主資本計	65,902,812	67,502,329
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	795,002	846,755
評価・換算差額等計	795,002	846,755
純資産合計	66,697,815	68,349,085
負債・純資産合計	90,745,010	90,339,861

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第33期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	84,705,447		84,812,585	
運用受託報酬	19,124,427		16,483,356	
投資助言報酬	1,217,672		1,235,553	
その他営業収益	117,586		113,622	
営業収益計		105,165,133		102,645,117
営業費用				
支払手数料	37,242,284		36,100,556	
広告宣伝費	379,873		387,028	
公告費	1,485		375	
調査費	23,944,438		24,389,003	
調査費	10,677,166		9,956,757	

委託調査費	13,267,272		14,432,246	
委託計算費	1,073,938		936,075	
営業雑経費	1,215,963		1,254,114	
通信費	48,704		47,007	
印刷費	947,411		978,185	
協会費	64,331		63,558	
諸会費	22,412		22,877	
支払販売手数料	133,104		142,485	
営業費用計		63,857,984		63,067,153
一般管理費				
給料	11,304,873		10,859,354	
役員報酬	189,022		189,198	
給料・手当	9,565,921		9,098,957	
賞与	1,549,929		1,571,197	
交際費	58,863		60,115	
寄付金	5,150		7,255	
旅費交通費	395,605		361,479	
租税公課	625,498		588,172	
不動産賃借料	1,534,255		1,511,876	
退職給付費用	595,876		521,184	
固定資産減価償却費	1,226,472		590,667	
福利厚生費	49,797		45,292	
修繕費	4,620		16,247	
賞与引当金繰入額	1,393,911		1,344,466	
役員賞与引当金繰入額	49,986		48,609	
機器リース料	148		130	
事務委託費	3,037,804		3,302,806	
事務用消耗品費	144,804		131,074	
器具備品費	5,253		8,112	
諸経費	149,850		188,367	
一般管理費計		20,582,772		19,585,212
営業利益		20,724,376		19,992,752

(単位：千円)

	第33期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	1,430		1,749	
受取配当金	74,278		73,517	
時効成立分配金・償還金	256		8,582	
為替差益	8,530		-	
投資信託解約益	236,398		-	
投資信託償還益	93,177		-	
受取負担金	-		177,066	
雑収入	10,306		24,919	
時効後支払損引当金戻入額	17,429		19,797	
営業外収益計		441,807		305,633
営業外費用				
為替差損	-		17,542	
投資信託解約損	4,138		-	
投資信託償還損	17,065		-	
金銭の信託運用損	99,303		175,164	
雑損失	-		5,659	
営業外費用計		120,507		198,365

経常利益		21,045,676		20,100,019
特別利益				
固定資産売却益		1		-
投資有価証券売却益		479,323		353,644
関係会社株式売却益	1	1,492,680	1	-
本社移転費用引当金戻入額		138,294		-
その他特別利益		350		-
特別利益計		2,110,649		353,644
特別損失				
固定資産除却損	2	36,992	2	19,121
固定資産売却損		134		-
退職給付制度終了損		690,899		-
システム移行損失		76,007		-
その他特別損失		50		-
特別損失計		804,083		19,121
税引前当期純利益		22,352,243		20,434,543
法人税、住民税及び事業税		6,951,863		6,386,793
法人税等調整額		249,832		71,767
法人税等合計		6,702,031		6,315,026
当期純利益		15,650,211		14,119,516

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:千円)

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

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465
当期変動額					
剰余金の配当	3,200,000	3,200,000			3,200,000
当期純利益	15,650,211	15,650,211			15,650,211

株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)		-	277,137	277,137	277,137
当期変動額合計	12,450,211	12,450,211	277,137	277,137	12,727,349
当期末残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金			
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562
当期変動額									
剰余金の配当									12,520,000
当期純利益									14,119,516
別途積立金 の積立						7,100,000			
研究開発 積立金の取崩							300,000		
運用責任準備 積立金の取崩								200,000	
繰越利益剰余金 の取崩									6,600,000
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	7,100,000	300,000	200,000	5,000,483
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	-	-	14,146,079

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815
当期変動額					
剰余金の配当	12,520,000	12,520,000			12,520,000
当期純利益	14,119,516	14,119,516			14,119,516
別途積立金 の積立	7,100,000	7,100,000			7,100,000
研究開発 積立金の取崩	300,000	300,000			300,000

運用責任準備 積立金の取崩	200,000	200,000			200,000
繰越利益剰余金 の取崩	6,600,000	6,600,000			6,600,000
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)		-	51,753	51,753	51,753
当期変動額合計	1,599,516	1,599,516	51,753	51,753	1,651,270
当期末残高	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085

## 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> <p>(5) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

## 表示方法の変更

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）
<p>「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。</p> <p>この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」842,996千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,699,533千円に含めて表示しております。</p>

## 注記事項

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
建物	140,580	229,897
器具備品	847,466	927,688

（損益計算書関係）

1. 関係会社に対する事項

（千円）

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
関係会社株式売却益	1,492,680	-

2. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
建物	298	1,550
器具備品	8,217	439
ソフトウェア	28,472	17,130
電話加入権	3	-

(株主資本等変動計算書関係)

第33期(自 2017年4月1日 至 2018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
2017年6月21日 定時株主総会	普通株式	3,200,000	80,000	2017年3月31日	2017年6月22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
2018年6月20日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018年6月21日
	A種種 類株式					

第34期(自 2018年4月1日 至 2019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
2018年6月20日 定時株主総会	普通株式	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018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

2019年6月20日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の 原資	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月20日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21日
	A種種類 株式					

## (金融商品関係)

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

#### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

#### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

#### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

### 第33期(2018年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	49,071,217	49,071,217	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	12,083,824	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	11,769,015	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	4,574,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	1,448,968	1,448,968	-
資産計	78,947,251	78,947,251	-
(1) 未払手数料	4,629,133	4,629,133	-
負債計	4,629,133	4,629,133	-

### 第34期(2019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	41,087,475	41,087,475	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	18,773,228	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	12,438,085	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	3,295,109	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	1,488,684	1,488,684	-
資産計	77,082,582	77,082,582	-
(1) 未払手数料	4,883,723	4,883,723	-
負債計	4,883,723	4,883,723	-

#### (注1) 金融商品の時価の算定方法

##### 資 産

##### (1) 現金・預金

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

##### (2) 金銭の信託

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

##### (3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

## (5) 有価証券及び投資有価証券

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

## 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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
非上場株式	272,464	276,764
関係会社株式	3,229,196	4,499,196

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33期(2018年3月31日現在)

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

第34期(2019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	41,087,475	-	-	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	153,518	1,995	996	-

(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33期の貸借対照表計上額3,229,196千円、第34期の貸借対照表計上額4,499,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2. 其他有価証券

第33期(2018年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	1,267,157	146,101	1,121,055
投資信託	177,815	153,000	24,815
小計	1,444,972	299,101	1,145,870
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,995	4,000	4
小計	3,995	4,000	4
合計	1,448,968	303,101	1,145,866

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

### 第34期(2019年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	1,326,372	111,223	1,215,148
投資信託	158,321	153,000	5,321
小計	1,484,694	264,223	1,220,470
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,990	4,000	9
小計	3,990	4,000	9
合計	1,488,684	268,223	1,220,460

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額276,674千円)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33期(自2017年4月1日至2018年3月31日)

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

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

#### 第34期(自2018年4月1日至2019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	394,222	353,644	-
投資信託	-	-	-

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

なお、当社は2017年10月1日付で、確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行するとともに、退職一時金制度を改定しました。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,718,372	2,154,607
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
数理計算上の差異の発生額	61,792	10,147
退職給付の支払額	111,758	158,018
確定拠出制度への移行に伴う減少額	1,316,796	-
退職一時金制度改定に伴う増加額	526,345	-
その他	-	438
退職給付債務の期末残高	2,154,607	2,289,044

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
年金資産の期首残高	1,363,437	-
期待運用収益	17,042	-
事業主からの拠出額	36,672	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	1,417,152	-
年金資産の期末残高	-	-

## (3) 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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,154,607	2,289,044
未積立退職給付債務	2,154,607	2,289,044
未認識数理計算上の差異	204,636	150,568
未認識過去勤務費用	312,836	243,317
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,637,133	1,895,158
退職給付引当金	1,637,133	1,895,158
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,637,133	1,895,158

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
期待運用収益	17,042	-
数理計算上の差異の費用処理額	88,417	43,920
過去勤務費用の費用処理額	39,611	69,519
退職一時金制度改定に伴う費用処理額	70,560	-
その他	1,620	3,640
確定給付制度に係る退職給付費用	456,577	411,963
制度移行に伴う損失(注)	690,899	-

(注) 特別損失に計上しております。

## (5) 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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019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% ~ 4.42%

## 3. 簡便法を適用した確定給付制度

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

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	300,927	-
退職給付費用	53,156	-
制度への拠出額	35,640	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	391,600	-
退職一時金制度改定に伴う振替額	108,189	-
退職給付引当金の期末残高	-	-

## (2) 退職給付費用

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

## 4. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度86,141千円、当事業年度104,720千円であります。

## (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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	290,493	173,805
未払事業所税	11,683	10,915
賞与引当金	426,815	411,675
未払法定福利費	81,186	80,253

未払給与	9,186	7,961
受取負担金	-	138,994
運用受託報酬	-	102,490
資産除去債務	90,524	10,152
減価償却超過額(一括償却資産)	11,331	4,569
減価償却超過額	176,791	125,839
繰延資産償却超過額(税法上)	34,977	135,542
退職給付引当金	501,290	580,297
時効後支払損引当金	60,941	54,458
ゴルフ会員権評価損	13,173	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
本社移転費用引当金	47,947	-
その他	29,193	29,494
繰延税金資産小計	1,981,254	2,069,527
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,981,254	2,069,527
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	281,720	321,067
繰延税金負債合計	281,720	321,067
繰延税金資産の純額	1,699,533	1,748,459

## 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A種種類株式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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	114,270,495千円	104,326,078千円
資産合計	114,270,495千円	104,326,078千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	13,059,836千円	10,571,428千円
負債合計	13,059,836千円	10,571,428千円
純資産	101,210,659千円	93,754,650千円

(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	70,507,975千円	66,696,733千円
顧客関連資産	45,200,838千円	39,959,586千円

### (2) 損益計算書項目

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	9,012,128千円	9,043,138千円
経常利益	9,012,128千円	9,043,138千円
税引前当期純利益	9,012,128千円	9,091,728千円
当期純利益	7,419,617千円	7,489,721千円
1株当たり当期純利益	185,490円43銭	187,243円04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	5,233,360千円	5,241,252千円

### (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33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)及び第34期(自 2018年4月1日 至 2019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33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019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33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019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	6,048,352	未払手数料	915,980
								子会社株式の取得	1,270,000	-	-
	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	10,215,017	未払手数料	1,670,194

## 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) 子会社株式の取得は、独立した第三者機関により算定された価格を基礎として協議の上、合理的に決定しております。

(注3) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

## 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33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	1,667,445円37銭	1,708,727円13銭
1株当たり当期純利益金額	391,255円29銭	352,987円92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33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
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	15,650,211千円	14,119,516千円
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  
2018年6月20日付で、総則の「目的」に関する事項の定款の変更を行いました。  
委託会社は、株式会社みずほ銀行から、みずほグローバルオルタナティブインベストメンツ株式会社(以下「MGAI」といいます。 )の発行済株式の全てについて2018年11月1日付で譲り受け、MGAIを100%子会社(新商号:アセットマネジメントOneオルタナティブインベストメンツ株式会社)としました。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項  
委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

#### 第2【その他の関係法人の概況】

##### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

- (1) 三井住友信託銀行株式会社(「受託者」)

## a．資本金の額

2019年3月末日現在、342,037百万円

## b．事業の内容

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

## (2) 販売会社

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

## 販売会社一覧表

（資本金の額は2019年3月末日現在）

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

## 2【関係業務の概要】

「受託者」は以下の業務を行います。

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

「販売会社」は以下の業務を行います。

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

## 3【資本関係】

該当事項はありません。

（持株比率5%以上を記載します。）

## &lt;再信託受託会社の概要&gt;

- 名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- 業務の概要：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
- 再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（投資信託財産の管理）を原信託受託者から再信託受託者（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原投資信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

### 第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載する場合があります。また、以下の内容を記載することがあります。
- ・ 金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
  - ・ 委託会社の金融商品取引業者登録番号
  - ・ 詳細情報の入手方法  
委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など  
請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
  - ・ 目論見書の使用開始日
  - ・ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。  
届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法  
届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
  - ・ ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
  - ・ 投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
  - ・ 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
  - ・ 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載
- (2) 有価証券届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」に記載の内容について、投資家の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関する箇所に記載することがあります。また、第二部「ファンド情報」第1「ファンドの状況」5「運用状況」について、有価証券届出書提出後の随時入手可能な直近の情報および同情報についての表での表示に加えて、グラフで表示した情報を目論見書に記載することがあります。
- (3) 投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。
- (4) 目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (5) 目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用する場合があります。
- (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

2019年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

### EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 湯原 尚 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 山野 浩 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第34期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

平成31年4月5日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニュー トピックス インデックスの平成30年2月23日から平成31年2月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ニュー トピックス インデックスの平成31年2月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の中間監査報告書

令和1年10月11日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているニュー トピックス インデックスの平成31年2月23日から令和1年8月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ニュー トピックス インデックスの令和1年8月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(平成31年2月23日から令和1年8月22日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

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