

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年5月1日提出
【計算期間】	第26期(自 2019年2月5日至 2020年2月3日)
【ファンド名】	太陽財形株投 太陽一般財形 30
【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
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【電話番号】	03-6774-5100
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【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/資産複合に属し、主として国内外の公社債およびわが国の株式に実質的に投資し、安定した収益の確保と投資信託財産の成長をはかることを目的として、安定運用を行います。

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

(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。
資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式・債券・不動産投信（リート）・その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態
株式	<b>年1回</b>	グローバル	
一般			
大型株	年2回	<b>日本</b>	
中小型株	年4回	北米	
債券			
一般	年6回（隔月）	欧州	
公債			
社債	年12回	アジア	<b>ファミリーファンド</b>
その他債券	（毎月）		
クレジット属性		オセアニア	
（ ）	日々	中南米	
不動産投信	その他（ ）	アフリカ	
<b>その他資産</b>			
<b>（投資信託証券（資産複合（株式 一般、債券 一般））（資産配分固定型））</b>		中近東（中東）	
資産複合		エマージング	ファンド・オブ・ファンズ
（ ）			
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(資産複合 (株式一般、債券一 般)))(資産配分固定 型))	投資信託証券への投資を通じて、実質的に複数資産(株式一般、債券一般)に投資を行います。資産配分固定型とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。
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(資産複合)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

# 1 「太陽財形株投 太陽一般財形 30」は、財形貯蓄制度をご利用いただく勤労者のみなさまのためのファンドです。

- ご購入は毎月、給与からの天引きで行います。
- ご購入時、換金時とも手数料はかかりません。
- 財形貯蓄制度をご利用の方は、持ち家取得などについて財形融資を受けられる特典があります。

## ●財形貯蓄制度について

「財形貯蓄」とは、勤労者財産形成促進法に基づいて設けられた貯蓄制度です。この法律は、勤労者の計画的な財産形成を促進することにより、勤労者の生活の安定をはかり、もって国民経済の健全な発展に寄与することを目的としています。この法律において、いわゆる「財形資産形成のための措置」として、勤労者財産形成貯蓄（一般財形）、勤労者財産形成住宅貯蓄（住宅財形）、勤労者財産形成年金貯蓄（年金財形）の制度が設けられています。

# 2 太陽財形公社債 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し、安定した収益の確保と売買益の獲得をはかります。

- 当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。  
※詳しくは後述の「ファンドの仕組み」をご覧ください。
- 株式の実質組入比率は、投資信託財産の純資産総額の30%を限度とし、原則として常時相当程度の実質組入比率を維持します。

## マザーファンドの運用方針

- 太陽財形公社債 マザーファンドは、国内外の公社債を主要投資対象とし、安定した収益の確保を目的として安定運用を行います。
- ニュー トピックス インデックス マザーファンドは、東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とし、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。

## 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。

## ■ 分配方針

原則として、年1回(毎年2月1日。1日および2日のいずれかが休業日の場合は、1日以降の営業日で翌日が営業日である日のうち1日に最も近い日。)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。

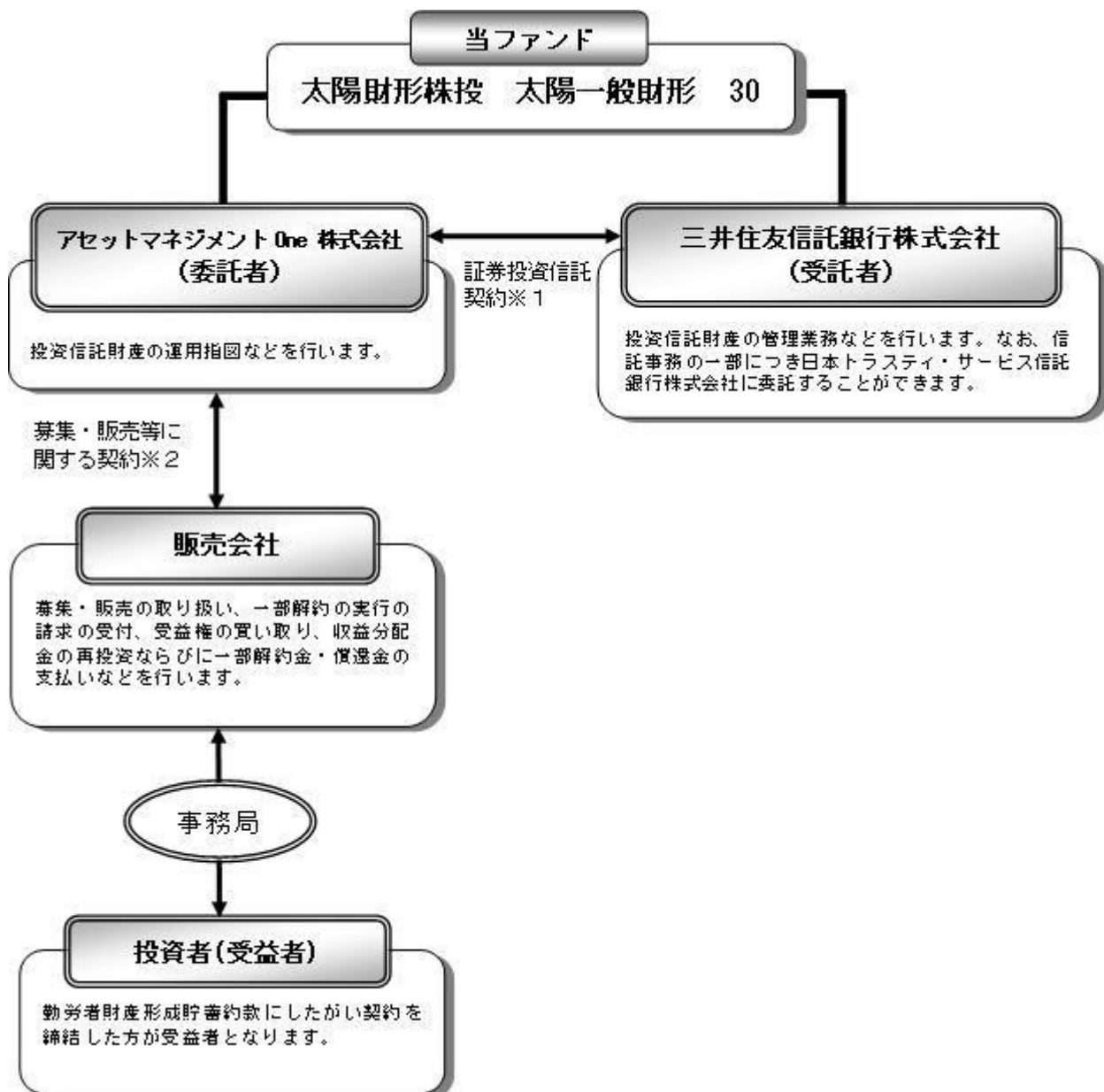
※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

### (2) 【ファンドの沿革】

1994年2月4日	投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
2014年9月24日	主要投資対象のうち、「太陽財形株式 マザーファンド受益証券」を「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」に変更する約款変更の届出
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。

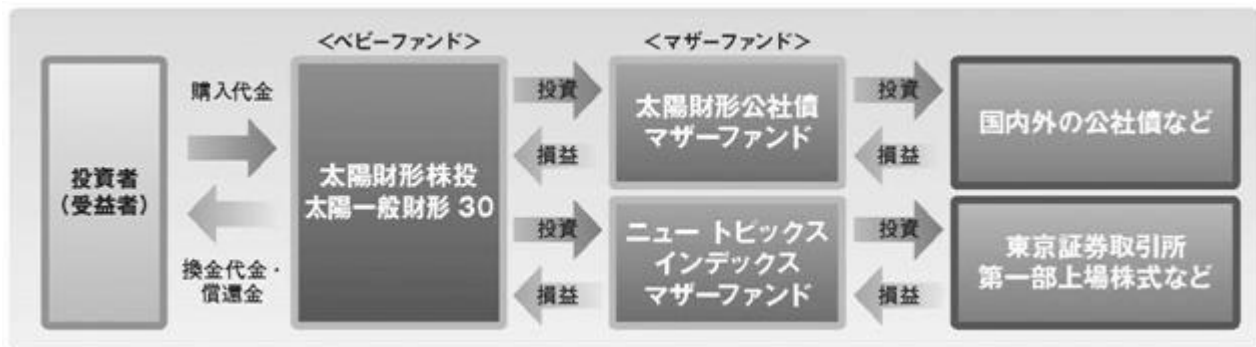
日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。（以下同じ）

## 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)で国内外の公社債およびわが国の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(2020年2月28日現在)

### 委託会社の沿革

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



## 大株主の状況

（2020年2月28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、安定した収益の確保と投資信託財産の成長をはかることを目的として、安定運用を行います。

## b. 運用の方法

## (イ) 主要投資対象

太陽財形公社債 マザーファンド受益証券およびニュー 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ます。

## (ロ) 投資態度

主として、太陽財形公社債 マザーファンド受益証券およびニュー トピックス インデックス マザーファンド受益証券への投資により、安定した収益の確保と売買益の獲得をはかります。

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およびわが国の株式への投資にあたっては、株式の実質投資割合の限度を投資信託財産の純資産総額の30%としたうえ、常時相当程度の組入比率を維持することを基本とします。

有価証券等の価格変動リスクおよび為替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、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる選択権取引、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有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨にかかる先物取引、通貨にかかる先物オプション取引、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および為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことができます。

## マザーファンドの運用方針

## 太陽財形公社債 マザーファンド

## 1. 基本方針

この投資信託は、公社債への投資により、安定した収益の確保をはかることを目的として、安定運用を行います。

## 2. 運用方法

## (1) 投資対象

内外の公社債を主要投資対象とします。

## (2) 投資態度

内外の公社債を中心に投資し、安定した収益の確保をめざします。

有価証券等の価格変動リスクおよび為替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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、スワップ取引を行うことができます。

## (3) 投資制限

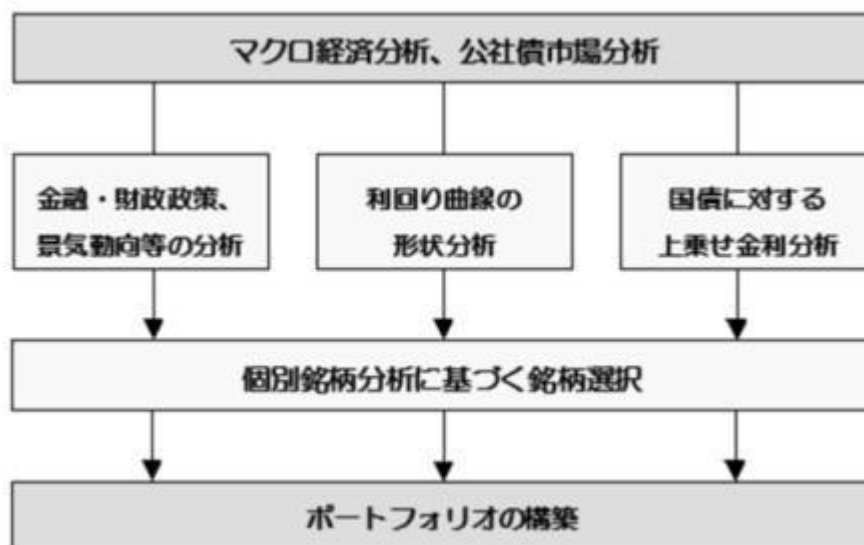
同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する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。

## 運用プロセス

太陽財形公社債 マザーファンドは、以下のプロセスによりわが国の公社債への投資を行います。



1. 当ファンドにおける運用は、マクロ経済分析、公社債市場分析、個別企業の信用リスク分析などを基に行われます。

2. 各種の分析を元にポートフォリオの残存期間、債券種別構成、投資銘柄の分散度合いをそれぞれ決定します。
3. 以上のプロセスにより、当ファンドに組入れる銘柄を決定し、ポートフォリオを構築します。個別銘柄の選択にあたっては、割高・割安の分析に加え、信用リスク・流動性リスクを十分に勘案します。

運用プロセスは2020年2月28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。

## 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。

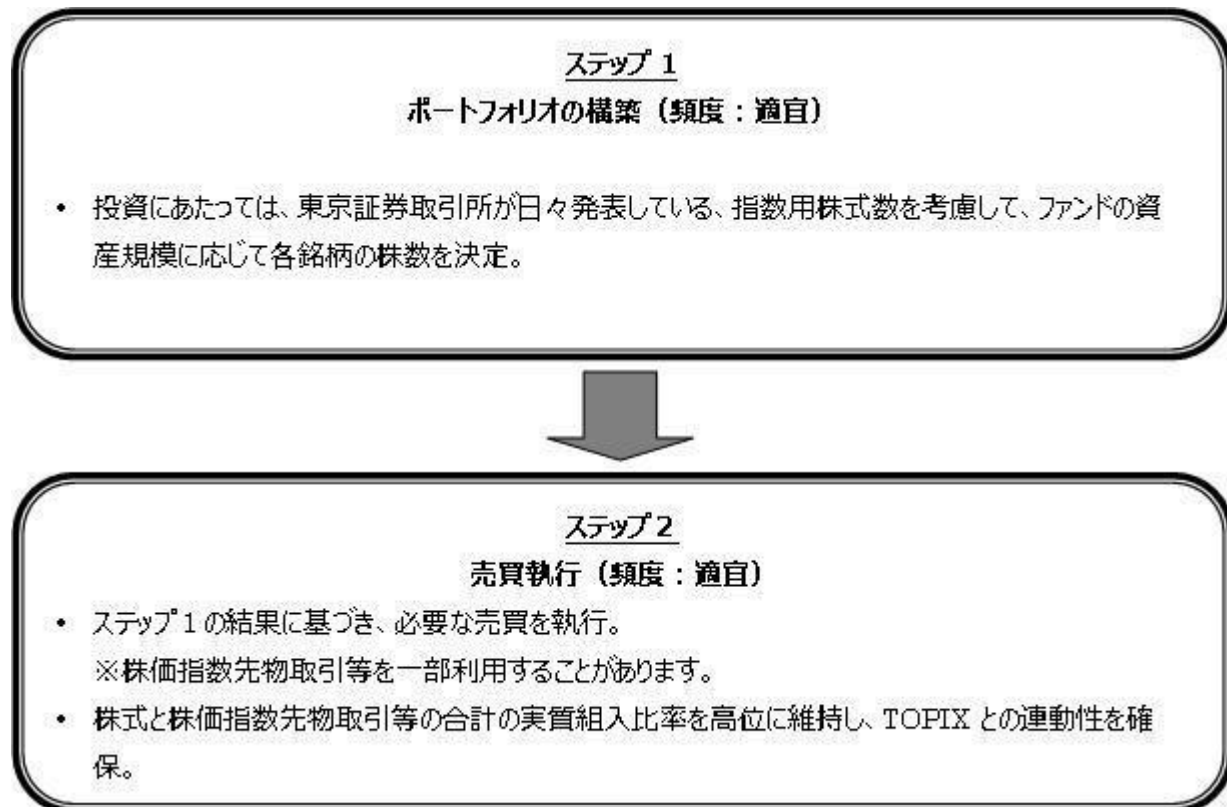
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

### 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「TOPIX(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。



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2020年2月28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、第1号から第2号までの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親投資信託(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券のほか、第3号から第15号までの有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)で市場性のあるものに投資することを指図します。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号で定めるものまたは外国の者に対する権利で同様の権利の性質を有するものにより運用することの指図ができます。

1. 太陽財形公社債 マザーファンド(以下「公社債ファンド」といいます。)受益証券
  2. ニュー トピックス インデックス マザーファンド(以下「株式ファンド」といいます。)受益証券
  3. 株券または新株引受権証書
  4. 国債証券
  5. 地方債証券
  6. 特別の法律により法人の発行する債券
  7. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)
  8. コマーシャル・ペーパー
  9. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第4号から第8号までの証券または証書の性質を有するもの
  10. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。)および新株予約権証券(外国または外国の者が発行する証券または証書で、かかる性質を有するものを含みます。以下同じ。)
  11. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  12. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  13. 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。)
  14. 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
  15. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第3号の証券または証書を以下「株式」といい、第4号から第7号までの証券および第9号の証券のうち第4号から第7号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」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、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとし(以下同じ。)、外国有価証券市場における現物オプション取引は公社債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）に投資信託財産が限月までに受け取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ投資信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに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、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為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引および先物オプション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。

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、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）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、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
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保有外貨建資産の時価総額の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。

(ハ) 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取引所におけ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、投資信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに余裕金の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建てで、投資信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に投資信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該余裕金等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に投資信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

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および為替変動リスクを回避するため、スワップ取引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。

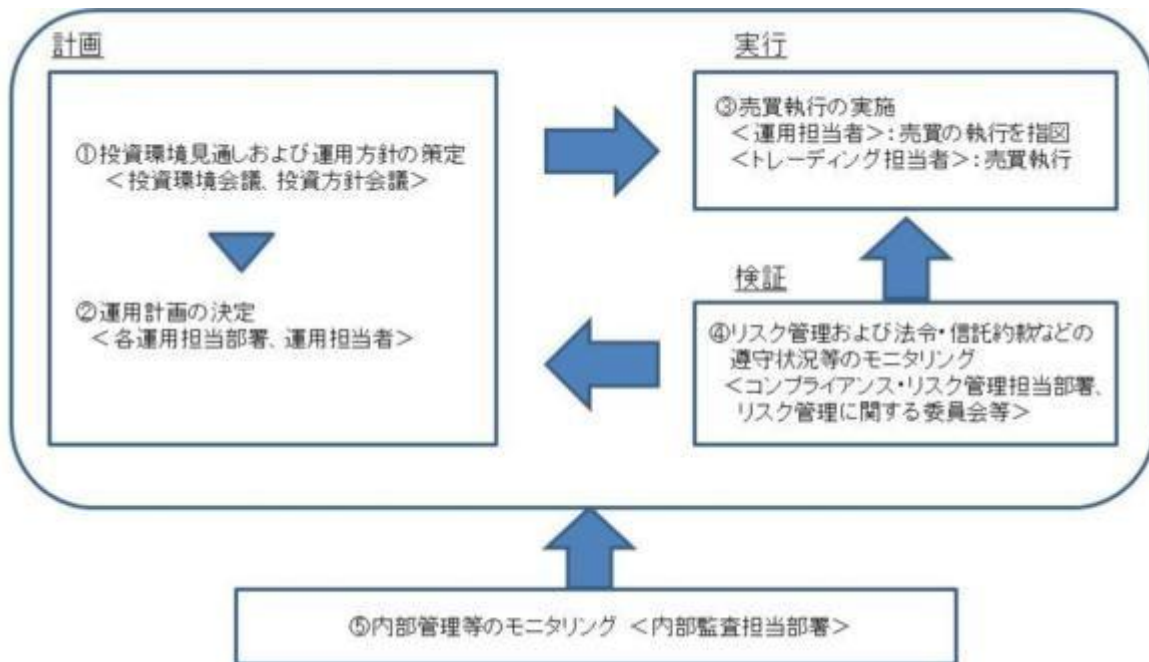
(ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額と株式ファンドおよび公社債ファンドの投資信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下同じ。)が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が投資信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

## (3) 【運用体制】

## a. ファンドの運用体制



## 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

## 運用計画の決定

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

## 売買執行の実施

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

## モニタリング

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

定期的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2020年2月28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1日(1日および2日のいずれかが休業日の場合は、1日以降の営業日で翌日が営業日である日のうち1日に最も近い日。)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. 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「利息等収益」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. 収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に再投資されます。

（５）【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

a．マザーファンドへの投資割合

委託者は、投資信託財産に属する株式ファンド受益証券の時価総額が投資信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしません。

b．株式等への投資割合

委託者は、投資信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券と株式ファンド受益証券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30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当該マザーファンド受益証券の時価総額に当該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。以下同じ。

c．新株引受権証券等への投資割合

委託者は、取得時において投資信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券と株式ファンドの投資信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額の合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

d．同一銘柄への投資割合

（イ）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株式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5を超えることとなる投資の指図をしません。

（ロ）委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と株式ファンドの投資信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券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5を超えることとなる投資の指図をしません。

（ハ）委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額と公社債ファンドの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。

e．外貨建資産への投資割合

委託者は、投資信託財産に属する外貨建資産の時価総額と公社債ファンドの投資信託財産に属する当該外貨建資産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30を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の30を超えたこととなった場合には、すみやかにこれを調整します。

f．投資する株式等の範囲

委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、わが国の取引所に上場（上場予定を含みます。）されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

g. 投資する公社債の範囲

委託者が投資することを指図する公社債のうち、外貨建公社債(外国通貨表示の公社債(利金および償還金が異なる通貨によって表示され支払われる複数通貨建公社債であって、利金および償還金のいずれかが外国通貨によって表示され支払われるものを含まず。))をいいます。以下同じ。)、外国または外国法人の発行する邦貨建公社債およびわが国またはわが国法人が外国において発行する邦貨建公社債については、取引所に上場(上場予定を含みます。))されている銘柄およびこれに準ずるものとします。ただし、社債権者割当または株主割当により取得する公社債については、この限りではありません。

h. 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。))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

i. 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および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けの指図をすることができます。

1. 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。
2. 公社債の貸し付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

(ロ) 上記(イ)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。

(ハ) 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。

j. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

k. 外国為替予約の指図

委託者は、投資信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジの為、外国為替の売買の予約を指図することができます。

1. 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。

m. 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。

n. 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。

o. 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(外貨建資産には為替変動リスクもあります。)に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。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下落するリスクをいいます。当ファンドは、株式を主要投資対象の一つとして、マザーファンドを通じてまたは直接組み入れているため、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。一般には、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公社債および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、公社債および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. 金利変動リスク

金利の上昇(公社債の価格の下落)は、基準価額の下落要因となります。

金利変動リスクとは、金利変動により債券価格が変動するリスクをいいます。一般に金利が上昇した場合には、債券価格は下落し、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

##### d. 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。

e．為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

外貨建資産は、為替変動の影響を受けます。たとえば、投資対象となる有価証券などが現地通貨建てで値上がりした場合でも、当該通貨に対して円高となった場合には、当該外貨建資産の円換算価格は下落することがあります。その場合、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

f．カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

一般に有価証券への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制などの要因によって影響を受けます。そのため、投資対象有価証券の発行国の政治、経済、社会情勢などの変化により、金融・証券市場が混乱し、資産価格や通貨価値が大きく変動することがあります。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。

g．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。

h．投資信託に関する一般的リスクおよびその他の留意点

- (イ) 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- (ロ) 有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- (ハ) 法令や税制が変更される場合に、投資信託を保有する受益者が不利益を被る可能性があります。
- (ニ) 投資信託財産の状況によっては、目指す運用が行われなことがある場合があります。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し込みがあった場合には、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。

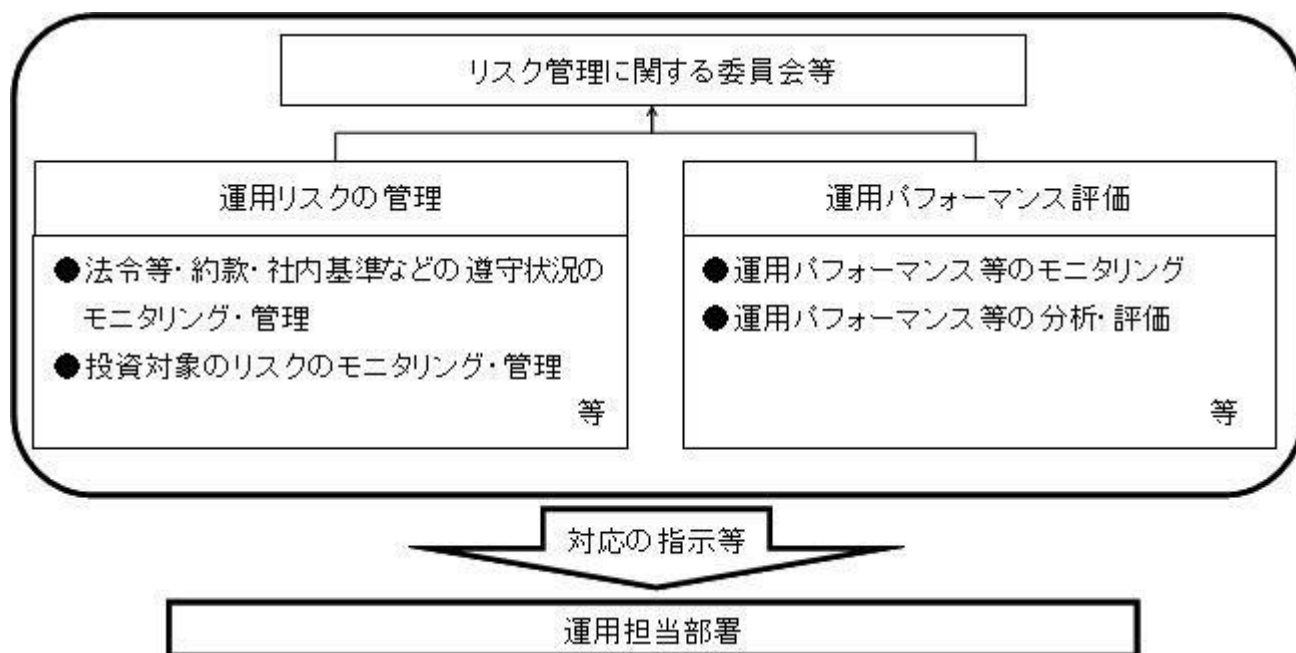
投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払い戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

(リ) 資金動向、市況動向等によっては、投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

## (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2020年2月28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>

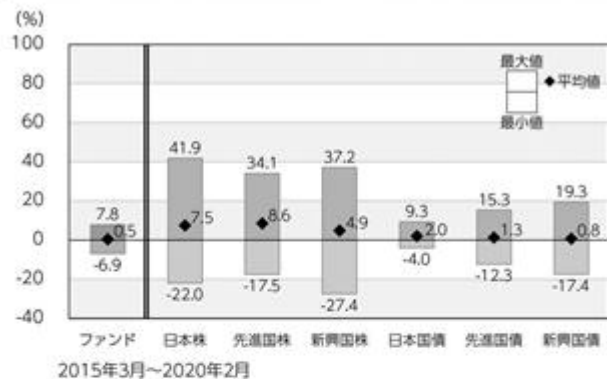
### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



2015年3月 2016年3月 2017年3月 2018年3月 2019年3月 2020年2月

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

### 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



2015年3月～2020年2月

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

### 各資産クラスの指数

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

(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】

申込手数料はありません。

(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1.595%（税抜1.45%）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。

2020年5月1日現在は、年率1.595%（税抜1.45%）になります。配分は以下の通りです。

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.32%	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1.05%	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0.08%	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および資産を外国で保管する場合の費用ならびに先物取引・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. 収益分配金・一部解約金・償還金の取り扱い

収益分配金のうち課税対象となる普通分配金および一部解約金・償還金の個別元本超過額については、配当所得として課税され、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%)の税率で源泉徴収されます。なお、元本払戻金(特別分配金)は課税されません。確定申告を行い、総合課税(配当控除の適用はありません。）・申告分離課税のいずれかを選択することもできます。

買取請求による換金については、各企業・団体の事務局にお問い合わせください。

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、2020年2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。

##### b. 個別元本について

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、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、下記の「c. 収益分配金の課税について」を参照。)

##### c. 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】

令和2年2月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	36,894,265	97.08
内 日本	36,894,265	97.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,108,511	2.92
純資産総額	38,002,776	100.00

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

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

(参考)

太陽財形公社債 マザーファンド

令和2年2月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
地方債証券	60,680,568	83.44
内 日本	60,680,568	83.44
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	12,042,740	16.56
純資産総額	72,723,308	100.00

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

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

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

令和2年2月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	2,282,044,520	95.86
内 日本	2,282,044,520	95.86
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	98,672,264	4.14
純資産総額	2,380,716,784	100.00

その他資産の投資状況

令和2年2月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	74,975,000	3.15
内 日本	74,975,000	3.15

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

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

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

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

令和2年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	太陽財形公社債 マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	23,186,360	1.1509 26,687,500	1.1510 26,687,500	- -	70.23
2	ニュー トピックス イン デックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	5,000,620	2.2433 11,218,074	2.0411 10,206,765	- -	26.86

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

令和2年2月28日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	97.08
合計	97.08

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

太陽財形公社債 マザーファンド

令和2年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	22年度2回 福井県公募 公債 日本	地方債 証券	22,000,000	101.71 22,377,080	101.62 22,357,940	1.4 2021/4/23	30.74
2	474回 名古屋市公募公 債 10年 日本	地方債 証券	15,000,000	101.53 15,230,850	101.39 15,208,800	1.31 2021/3/19	20.91
3	101回 共同発行市場公 募地方債 日本	地方債 証券	14,000,000	101.64 14,230,440	101.60 14,225,260	1.05 2021/8/25	19.56
4	27年度1回 とちぎ未来 債 日本	地方債 証券	8,900,000	99.87 8,888,568	99.87 8,888,568	0.12 2020/12/2	12.22

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

令和2年2月28日現在

種類	投資比率（％）
地方債証券	83.44
合計	83.44

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## ニュー トピックス インデックス マザーファンド

令和2年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	12,000	7,739.00 92,868,000	7,127.00 85,524,000	- -	3.59
2	ソニー 日本	株式 電気機器	6,800	8,036.00 54,644,800	6,611.00 44,954,800	- -	1.89
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	8,400	5,049.00 42,411,600	5,013.00 42,109,200	- -	1.77
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	72,700	579.00 42,093,300	531.90 38,669,130	- -	1.62
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	14,100	2,792.00 39,367,200	2,529.50 35,665,950	- -	1.50
6	キーエンス 日本	株式 電気機器	1,000	40,470.00 40,470,000	34,410.00 34,410,000	- -	1.45
7	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	9,000	4,408.00 39,672,000	3,763.00 33,867,000	- -	1.42
8	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	7,400	4,214.00 31,183,600	3,758.00 27,809,200	- -	1.17
9	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	7,300	3,998.00 29,185,400	3,484.00 25,433,200	- -	1.07
10	任天堂 日本	株式 その他製品	700	43,200.00 30,240,000	36,270.00 25,389,000	- -	1.07
11	KDDI 日本	株式 情報・通信業	7,900	3,283.00 25,935,700	3,058.00 24,158,200	- -	1.01
12	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	8,500	3,074.00 26,129,000	2,799.50 23,795,750	- -	1.00
13	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	7,800	3,110.00 24,258,000	2,927.50 22,834,500	- -	0.96

14	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	3,800	6,147.00 23,358,600	5,801.00 22,043,800	- -	0.93
15	信越化学工業 日本	株式 化学	1,800	12,365.00 22,257,000	12,145.00 21,861,000	- -	0.92
16	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	144,400	166.60 24,057,040	147.60 21,313,440	- -	0.90
17	HOYA 日本	株式 精密機器	2,200	10,730.00 23,606,000	9,609.00 21,139,800	- -	0.89
18	ダイキン工業 日本	株式 機械	1,400	15,580.00 21,812,000	14,725.00 20,615,000	- -	0.87
19	花王 日本	株式 化学	2,600	9,131.00 23,740,600	7,868.00 20,456,800	- -	0.86
20	第一三共 日本	株式 医薬品	3,100	7,200.00 22,320,000	6,590.00 20,429,000	- -	0.86
21	三菱商事 日本	株式 卸売業	7,400	2,907.00 21,511,800	2,690.00 19,906,000	- -	0.84
22	日立製作所 日本	株式 電気機器	5,200	4,587.00 23,852,400	3,637.00 18,912,400	- -	0.79
23	村田製作所 日本	株式 電気機器	3,200	6,870.00 21,984,000	5,721.00 18,307,200	- -	0.77
24	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	7,400	2,580.50 19,095,700	2,461.50 18,215,100	- -	0.77
25	ファナック 日本	株式 電気機器	1,000	20,915.00 20,915,000	17,970.00 17,970,000	- -	0.75
26	日本電産 日本	株式 電気機器	1,300	15,540.00 20,202,000	12,780.00 16,614,000	- -	0.70
27	三井物産 日本	株式 卸売業	9,300	1,972.50 18,344,250	1,783.50 16,586,550	- -	0.70
28	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	9,500	1,895.50 18,007,250	1,699.00 16,140,500	- -	0.68
29	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	900	21,945.00 19,750,500	17,780.00 16,002,000	- -	0.67
30	キヤノン 日本	株式 電気機器	5,800	3,079.00 17,858,200	2,733.50 15,854,300	- -	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。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

令和2年2月28日現在

種類	投資比率(%)
株式	95.86
合計	95.86

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

令和2年2月28日現在

業種	国内 / 外国	投資比率 (%)
電気機器	国内	13.94
情報・通信業		8.90
輸送用機器		7.54
化学		6.92
医薬品		5.90
銀行業		5.52
卸売業		4.90
サービス業		4.77
機械		4.70
小売業		4.15
陸運業		3.97
食料品		3.70
建設業		2.60
精密機器		2.43
保険業		2.31
不動産業		2.30
その他製品		2.18
電気・ガス業		1.50
その他金融業		1.19
証券、商品先物取引業		0.79
ガラス・土石製品		0.78
非鉄金属		0.68
鉄鋼		0.66
ゴム製品		0.64
繊維製品		0.54
金属製品		0.54
石油・石炭製品		0.47
空運業		0.43
鉱業		0.26
パルプ・紙		0.24
倉庫・運輸関連業		0.16
海運業		0.15
水産・農林業		0.10
合計	95.86	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

太陽財形公社債 マザーファンド

該当事項はありません。

ニュー トピックス インデックス マザーファンド  
該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

太陽財形公社債 マザーファンド

該当事項はありません。

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

令和2年2月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0203月	買建	5	81,216,650	74,975,000	3.15

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

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



## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日(令和2年2月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第17計算期間末 (平成23年2月1日)	41	41	0.8402	0.8407
第18計算期間末 (平成24年2月1日)	35	35	0.7968	0.7973
第19計算期間末 (平成25年2月4日)	39	40	0.8391	0.8396
第20計算期間末 (平成26年2月3日)	44	44	0.8791	0.8796
第21計算期間末 (平成27年2月2日)	38	38	0.9041	0.9046
第22計算期間末 (平成28年2月1日)	39	39	0.9106	0.9111
第23計算期間末 (平成29年2月1日)	42	42	0.9178	0.9183
第24計算期間末 (平成30年2月1日)	41	41	0.9599	0.9604
第25計算期間末 (平成31年2月4日)	38	38	0.9122	0.9127
第26計算期間末 (令和2年2月3日)	39	39	0.9185	0.9190
平成31年2月末日	39	-	0.9155	-
3月末日	39	-	0.9146	-
4月末日	39	-	0.9177	-
令和1年5月末日	38	-	0.8997	-
6月末日	39	-	0.9051	-
7月末日	40	-	0.9061	-
8月末日	39	-	0.8973	-
9月末日	40	-	0.9099	-
10月末日	39	-	0.9211	-
11月末日	39	-	0.9249	-
12月末日	40	-	0.9274	-
令和2年1月末日	39	-	0.9208	-
2月末日	38	-	0.8937	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金（円）
第17計算期間	0.0005
第18計算期間	0.0005
第19計算期間	0.0005
第20計算期間	0.0005
第21計算期間	0.0005
第22計算期間	0.0005
第23計算期間	0.0005
第24計算期間	0.0005
第25計算期間	0.0005
第26計算期間	0.0005

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第17計算期間	0.7
第18計算期間	5.1
第19計算期間	5.4
第20計算期間	4.8
第21計算期間	2.9
第22計算期間	0.8
第23計算期間	0.8
第24計算期間	4.6
第25計算期間	4.9
第26計算期間	0.7

（注）収益率は期間騰落率です。

## （４）【設定及び解約の実績】

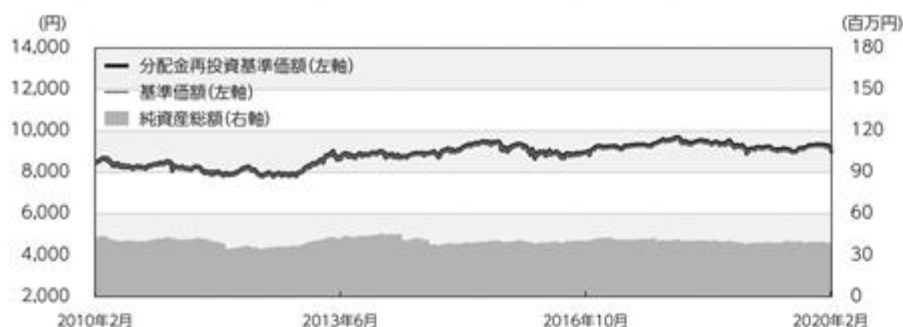
	設定口数	解約口数
第17計算期間	6,977,128	6,832,157
第18計算期間	7,166,380	12,235,967
第19計算期間	5,723,056	2,956,349
第20計算期間	5,522,083	2,249,182
第21計算期間	4,886,377	13,261,929
第22計算期間	4,402,640	3,089,454
第23計算期間	4,790,878	2,244,793
第24計算期間	4,254,344	7,461,417
第25計算期間	3,836,447	4,462,300
第26計算期間	3,941,211	3,700,314

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

## 参考情報

データの基準日:2020年2月28日

## 基準価額・純資産の推移 (2010年2月26日~2020年2月28日)



※基準価額は1万円当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日:1994年2月4日)

## 分配の推移(税引前)

2016年 2月	5円
2017年 2月	5円
2018年 2月	5円
2019年 2月	5円
2020年 2月	5円
直近10年間累計	50円

※分配金は1万円当たりです。

## 主要な資産の状況

## ■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	太陽財形公社債 マザーファンド	70.23
2	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	26.86

## ■太陽財形公社債 マザーファンド

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

## 資産の状況

資産の種類	比率(%)
地方債証券	83.44
内 日本	83.44
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	16.56
合計(純資産総額)	100.00

## 組入銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	22年度2回 福井県公債券	地方債証券	日本	1.4	2021/4/23	30.74
2	474回 名古屋市公債券 10年	地方債証券	日本	1.31	2021/3/19	20.91
3	101回 共同発行市場公募地方債	地方債証券	日本	1.05	2021/8/25	19.56
4	27年度1回 とちぎ未来債	地方債証券	日本	0.12	2020/12/2	12.22

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2020年2月28日

## ■ニュー トピックス インデックス マザーファンド

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

### 資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	95.86
内 日本	95.86
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4.14
合計(純資産総額)	100.00

### その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	3.15

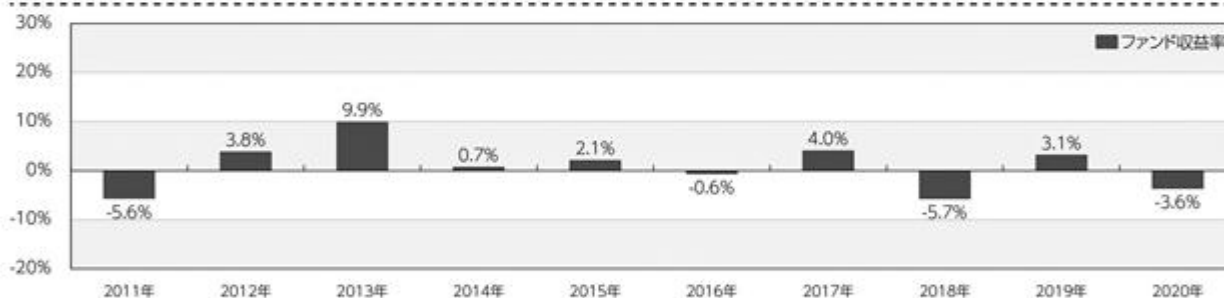
### 株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	13.94
2	情報・通信業	8.90
3	輸送用機器	7.54
4	化学	6.92
5	医薬品	5.90

### 組入上位10銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.59
2	ソニー	株式	日本	電気機器	1.89
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.77
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.62
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.50
6	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.45
7	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.42
8	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.17
9	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.07
10	任天堂	株式	日本	その他製品	1.07

## 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。

※2020年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込(販売)手続等】

(イ) 取得申込者は、事務局を通じて受益権を1,000円以上1円単位で、取得申込受付日の基準価額で購入することができます。

販売会社や申込形態によっては上記と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。

取得申込者は、事務局を通じて販売会社に取引口座を開設のうえ、申し込みを行います。

(ロ) 取得申込者は、販売会社との間で「勤労者財産形成貯蓄約款」(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) お買い付けは、原則として事務局を通じて給与天引きにより、一定の日(毎月10日、20日および月末(休日の場合はその直前の営業日)から5営業日目)に行います。

### 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、1口単位で、一部解約の実行を請求することができます。

(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、外国為替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、上記(ニ)の規定に準じ計算された価額とします。

#### 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、1口単位をもってその受益権を買い取りま  
す。
- (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、外国為替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せん。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
公社債等	計算日 における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

## (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2日から翌年2月1日までとします。ただし、2月1日および2月2日のいずれかが休業日のとき、2月1日以降の営業日で翌日が営業日である日のうち2月1日に最も近い日とします。

## (5) 【その他】

## a. 信託の終了（投資信託契約の解約）

(イ) 委託者は、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、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48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。

(ロ) 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。

(ハ) 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53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。

(ニ) 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

##### ・関係法人との契約の更改

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

#### 4【受益者の権利等】

##### a. 収益分配金請求権

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

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

##### 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ます。)に、原則として償還日(休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

##### c. 一部解約請求権

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

##### d. 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第26期計算期間(平成31年2月5日から令和2年2月3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】

## 【太陽財形株投 太陽一般財形 30】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第25期 平成31年2月4日現在	第26期 令和2年2月3日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,093,067	2,701,867
親投資信託受益証券	36,503,361	36,965,574
流動資産合計	39,596,428	39,667,441
資産合計	39,596,428	39,667,441
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	21,288	21,409
未払解約金	419,282	-
未払受託者報酬	17,486	17,375
未払委託者報酬	299,388	298,068
未払利息	6	-
その他未払費用	285	197
流動負債合計	757,735	337,049
負債合計	757,735	337,049
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	42,577,764	42,818,661
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,739,071	3,488,269
(分配準備積立金)	2,350,404	2,136,600
元本等合計	38,838,693	39,330,392
純資産合計	38,838,693	39,330,392
負債純資産合計	39,596,428	39,667,441

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第25期 自 平成30年2月2日 至 平成31年2月4日	第26期 自 平成31年2月5日 至 令和2年2月3日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	1,376,340	902,213
その他収益	143	-
営業収益合計	1,376,197	902,213
<b>営業費用</b>		
支払利息	1,805	1,407
受託者報酬	34,890	34,259
委託者報酬	597,381	587,153
その他費用	646	437
営業費用合計	634,722	623,256
営業利益又は営業損失( )	2,010,919	278,957
経常利益又は経常損失( )	2,010,919	278,957
当期純利益又は当期純損失( )	2,010,919	278,957
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	117,521	655
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,732,272	3,739,071
剰余金増加額又は欠損金減少額	183,752	324,961
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	183,752	324,961
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	275,865	332,362
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	275,865	332,362
分配金	21,288	21,409
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,739,071	3,488,269

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第26期	
	自 平成31年2月5日	至 令和2年2月3日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月1日を計算期間の末日としておりますが、該当日の翌日及び該当日が休業日のため、信託約款の規定により、前計算期間末日を平成31年2月4日、当計算期間末日を令和2年2月3日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第25期	第26期
	平成31年2月4日現在	令和2年2月3日現在
1. 期首元本額	43,203,617円	42,577,764円
期中追加設定元本額	3,836,447円	3,941,211円
期中一部解約元本額	4,462,300円	3,700,314円
2. 受益権の総数	42,577,764口	42,818,661口
3. 元本の欠損	元本の欠損 3,739,071円	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,488,269円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第25期	第26期
	自 平成30年2月2日 至 平成31年2月4日	自 平成31年2月5日 至 令和2年2月3日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金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(3,684,402円)及び分配準備積立金(2,371,692円)より分配対象収益は6,056,094円(1万口当たり1,422.35円)であり、うち21,288円(1万口当たり5円)を分配しております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(3,910,877円)及び分配準備積立金(2,158,009円)より分配対象収益は6,068,886円(1万口当たり1,417.34円)であり、うち21,409円(1万口当たり5円)を分配金額としております。

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	第25期 自 平成30年2月2日 至 平成31年2月4日	第26期 自 平成31年2月5日 至 令和2年2月3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。	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	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、金利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。	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3． 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	<p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第25期 平成31年2月4日現在	第26期 令和2年2月3日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価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。	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	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。	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
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。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第25期 平成31年2月4日現在	第26期 令和2年2月3日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,220,885	800,036
合計	1,220,885	800,036

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。



（1口当たり情報に関する注記）

	第25期 平成31年2月4日現在	第26期 令和2年2月3日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9122円 (9,122円)	0.9185円 (9,185円)

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## （1）株式

該当事項はありません。

## （2）株式以外の有価証券

令和2年2月3日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	太陽財形公社債 マザーファンド	23,186,360	26,687,500	
	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	4,556,490	10,278,074	
親投資信託受益証券	合計	27,742,850	36,965,574	
合計			36,965,574	

（注）親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

太陽財形公社債 マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

令和2年2月3日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,772,753
地方債証券	60,712,738
未収利息	155,860
前払費用	69,447
流動資産合計	72,710,798
資産合計	72,710,798
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	63,175,152
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	9,535,646
元本等合計	72,710,798
純資産合計	72,710,798
負債純資産合計	72,710,798

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成31年2月5日 至 令和2年2月3日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	地方債証券 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、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年2月3日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	64,825,377円
同期中追加設定元本額	4,370,116円
同期中一部解約元本額	6,020,341円
元本の内訳	
ファンド名	
太陽財形株投 太陽一般財形 30	23,186,360円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	26,211,493円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	13,777,299円
計	63,175,152円
2. 受益権の総数	63,175,152口

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成31年2月5日 至 令和2年2月3日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	令和2年2月3日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
地方債証券		13,200
合計		13,200

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（令和2年2月2日から令和2年2月3日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

令和2年2月3日現在	
1口当たり純資産額 （1000口当たり純資産額）	1.151円 (1,151円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

令和2年2月3日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
地方債証券	101回 共同発行市場公募地方債	14,000,000	14,228,620	
	27年度1回 とちぎ未来債	8,900,000	8,887,568	
	474回 名古屋市公募公債 10年	15,000,000	15,220,350	
	22年度2回 福井県公募公債	22,000,000	22,376,200	
地方債証券 合計		59,900,000	60,712,738	
合計			60,712,738	

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。

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2年2月3日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	101,480,737
株式	2,655,278,320
未収配当金	4,774,710
前払金	355,000
流動資産合計	2,761,888,767
資産合計	2,761,888,767
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	261,320
未払金	630,660
未払解約金	18,500,000
流動負債合計	19,391,980
負債合計	19,391,980
純資産の部	
元本等	
元本	1,215,809,567
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,526,687,220
元本等合計	2,742,496,787
純資産合計	2,742,496,787
負債純資産合計	2,761,888,767

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成31年2月5日 至 令和2年2月3日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年2月3日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	3,309,442,012円
同期中追加設定元本額	95,246,670円
同期中一部解約元本額	2,188,879,115円
元本の内訳	
ファンド名	
ニュー トピックス インデックス	232,314,092円
新光7資産バランスファンド	307,526,097円
ニュー トピックス インデックス(変額年金)	90,282,887円
世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	387,599,102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)	30,165,247円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	30,991,272円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	98,377,088円
グローバル・ナビ	18,213,394円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	4,556,490円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	13,023,137円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	2,760,761円
計	1,215,809,567円
2. 受益権の総数	1,215,809,567口
3. 差入代用有価証券	
株式	158,860,550円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成31年2月5日 至 令和2年2月3日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和2年2月3日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	107,675,710
合計	107,675,710

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(令和2年1月15日から令和2年2月3日まで)に対応する金額であります。



(デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	令和2年2月3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 先物取引 買建	66,960,000	-	66,700,000	260,000
合計	66,960,000	-	66,700,000	260,000

(注) 時価の算定方法

## 株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

令和2年2月3日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2557円 (22,557円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式

令和2年2月3日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	100	2,825.00	282,500	
日本水産	1,500	596.00	894,000	
マルハニチロ	200	2,648.00	529,600	
サカタのタネ	200	3,455.00	691,000	
ホクト	100	1,930.00	193,000	
ショーボンドホールディングス	200	4,450.00	890,000	
ミライト・ホールディングス	500	1,646.00	823,000	
タマホーム	100	1,305.00	130,500	
日本アクア	100	585.00	58,500	
TATERU	300	206.00	61,800	
スペースバリューホールディングス	200	545.00	109,000	
住石ホールディングス	300	135.00	40,500	
三井松島ホールディングス	100	1,141.00	114,100	
国際石油開発帝石	6,200	1,024.00	6,348,800	
石油資源開発	200	2,705.00	541,000	
K&Oエナジーグループ	100	1,600.00	160,000	
安藤・間	900	890.00	801,000	
東急建設	500	765.00	382,500	
コムシスホールディングス	500	3,135.00	1,567,500	

ビーアールホールディングス	200	478.00	95,600	
高松コンストラクショングループ	100	2,642.00	264,200	
ヤマウラ	100	939.00	93,900	
大成建設	1,200	4,360.00	5,232,000	
大林組	3,600	1,204.00	4,334,400	
清水建設	3,600	1,115.00	4,014,000	
飛鳥建設	100	1,389.00	138,900	
長谷工コーポレーション	1,400	1,419.00	1,986,600	
松井建設	100	768.00	76,800	
鹿島建設	2,800	1,399.00	3,917,200	
不動テトラ	100	1,663.00	166,300	
鉄建建設	100	2,775.00	277,500	
西松建設	300	2,445.00	733,500	
三井住友建設	900	612.00	550,800	
大豊建設	100	2,675.00	267,500	
前田建設工業	900	1,043.00	938,700	
佐田建設	100	429.00	42,900	
ナカノフドー建設	100	482.00	48,200	
奥村組	200	2,919.00	583,800	
東鉄工業	200	3,240.00	648,000	
富士ピー・エス	100	555.00	55,500	
戸田建設	1,500	709.00	1,063,500	
熊谷組	200	3,115.00	623,000	
矢作建設工業	200	820.00	164,000	
ピーエス三菱	100	717.00	71,700	
日本ハウスホールディングス	200	460.00	92,000	
大東建託	400	12,770.00	5,108,000	
新日本建設	200	906.00	181,200	
N I P P O	300	2,700.00	810,000	
前田道路	400	3,700.00	1,480,000	
東亜建設工業	100	1,576.00	157,600	
日本国土開発	300	596.00	178,800	
若築建設	100	1,641.00	164,100	
東洋建設	400	518.00	207,200	
五洋建設	1,400	654.00	915,600	
世紀東急工業	200	910.00	182,000	
住友林業	900	1,579.00	1,421,100	
日本基礎技術	100	385.00	38,500	
巴コーポレーション	200	419.00	83,800	
大和ハウス工業	3,500	3,447.00	12,064,500	
ライト工業	200	1,534.00	306,800	
積水ハウス	3,900	2,352.50	9,174,750	
日特建設	100	843.00	84,300	
北陸電気工事	100	1,121.00	112,100	
ユアテック	200	656.00	131,200	
中電工	100	2,550.00	255,000	
関電工	500	1,032.00	516,000	
きんでん	800	1,833.00	1,466,400	
東京エネシス	100	880.00	88,000	
住友電設	100	2,600.00	260,000	

日本電設工業	200	2,378.00	475,600
協和エクシオ	500	2,740.00	1,370,000
新日本空調	100	2,024.00	202,400
日本工営	100	3,565.00	356,500
九電工	200	3,095.00	619,000
三機工業	300	1,495.00	448,500
日揮ホールディングス	1,100	1,547.00	1,701,700
ヤマト	100	789.00	78,900
太平電業	100	2,302.00	230,200
高砂熱学工業	300	1,903.00	570,900
N E C ネットズエスアイ	100	4,170.00	417,000
明星工業	200	838.00	167,600
大気社	200	3,780.00	756,000
ダイダン	100	2,658.00	265,800
日比谷総合設備	100	1,914.00	191,400
日本製粉	300	1,646.00	493,800
日清製粉グループ本社	1,300	1,879.00	2,442,700
昭和産業	100	3,040.00	304,000
鳥越製粉	100	826.00	82,600
中部飼料	100	1,676.00	167,600
フィード・ワン	800	180.00	144,000
日本甜菜製糖	100	1,879.00	187,900
三井製糖	100	2,214.00	221,400
塩水港精糖	100	231.00	23,100
日新製糖	100	1,998.00	199,800
L I F U L L	400	561.00	224,400
ジェイエイシーリクルートメント	100	1,687.00	168,700
日本M&Aセンター	800	3,405.00	2,724,000
UTグループ	100	2,812.00	281,200
タケエイ	100	1,030.00	103,000
ビーネックスグループ	100	1,130.00	113,000
コシダカホールディングス	300	1,510.00	453,000
パソナグループ	100	1,386.00	138,600
リンクアンドモチベーション	200	524.00	104,800
G C A	100	917.00	91,700
エス・エム・エス	300	2,294.00	688,200
パーソルホールディングス	1,100	2,018.00	2,219,800
リニカル	100	1,050.00	105,000
クックパッド	400	326.00	130,400
アイ・ケイ・ケイ	100	721.00	72,100
森永製菓	300	5,330.00	1,599,000
江崎グリコ	300	4,660.00	1,398,000
名糖産業	100	1,395.00	139,500
不二家	100	2,177.00	217,700
山崎製パン	900	2,086.00	1,877,400
亀田製菓	100	4,965.00	496,500
寿スピリッツ	100	7,290.00	729,000
カルビー	500	3,605.00	1,802,500
森永乳業	200	4,190.00	838,000
六甲バター	100	1,597.00	159,700

ヤクルト本社	800	5,480.00	4,384,000	
明治ホールディングス	800	7,730.00	6,184,000	
雪印メグミルク	300	2,579.00	773,700	
プリマハム	200	2,435.00	487,000	
日本ハム	400	4,725.00	1,890,000	
丸大食品	100	2,131.00	213,100	
S Foods	100	2,599.00	259,900	
伊藤ハム米久ホールディングス	700	699.00	489,300	
スタジオアリス	100	1,912.00	191,200	
シミックホールディングス	100	1,796.00	179,600	
システナ	400	1,850.00	740,000	
デジタルアーツ	100	4,915.00	491,500	
日鉄ソリューションズ	200	3,230.00	646,000	
総合警備保障	400	5,770.00	2,308,000	
キューブシステム	100	762.00	76,200	
いちご	1,400	405.00	567,000	
日本駐車場開発	1,200	142.00	170,400	
カカクコム	800	2,815.00	2,252,000	
セントケア・ホールディング	100	473.00	47,300	
ルネサンス	100	1,718.00	171,800	
ディップ	200	3,465.00	693,000	
SBSホールディングス	100	1,823.00	182,300	
オプトホールディング	100	1,533.00	153,300	
新日本科学	100	610.00	61,000	
ツクイ	300	567.00	170,100	
ベネフィット・ワン	300	1,950.00	585,000	
エムスリー	2,400	3,175.00	7,620,000	
ツカダ・グローバルホールディング	100	575.00	57,500	
アウトソーシング	600	1,008.00	604,800	
ウェルネット	100	653.00	65,300	
ディー・エヌ・エー	500	1,768.00	884,000	
博報堂DYホールディングス	1,500	1,558.00	2,337,000	
ぐるなび	200	888.00	177,600	
タカミヤ	100	626.00	62,600	
ジャパンベストレスキューシステム	100	950.00	95,000	
ファンコミュニケーションズ	300	444.00	133,200	
エスプール	200	805.00	161,000	
ティア	100	595.00	59,500	
バリューコマース	100	2,529.00	252,900	
インフォマート	1,200	849.00	1,018,800	
サッポロホールディングス	400	2,657.00	1,062,800	
アサヒグループホールディングス	2,400	5,021.00	12,050,400	
麒麟ホールディングス	4,800	2,413.00	11,582,400	
宝ホールディングス	900	958.00	862,200	
オエノンホールディングス	300	380.00	114,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	800	2,912.00	2,329,600	
サントリー食品インターナショナル	800	4,670.00	3,736,000	
ダイドーグループホールディングス	100	4,070.00	407,000	
伊藤園	300	5,350.00	1,605,000	

キーコーヒー	100	2,267.00	226,700	
日清オイリオグループ	100	3,695.00	369,500	
不二製油グループ本社	300	2,835.00	850,500	
J-オイルミルズ	100	4,060.00	406,000	
ローソン	300	6,260.00	1,878,000	
サンエー	100	4,500.00	450,000	
カワチ薬品	100	2,157.00	215,700	
エービーシー・マート	200	6,990.00	1,398,000	
アスクル	100	3,540.00	354,000	
ゲオホールディングス	200	1,219.00	243,800	
アダストリア	200	2,113.00	422,600	
ジーフット	100	618.00	61,800	
くら寿司	100	5,470.00	547,000	
キャンドゥ	100	1,631.00	163,100	
エレマテック	100	1,076.00	107,600	
パルグループホールディングス	100	3,185.00	318,500	
エディオン	500	1,128.00	564,000	
あらた	100	4,475.00	447,500	
サーラコーポレーション	200	617.00	123,400	
J Pホールディングス	300	315.00	94,500	
フジオフードシステム	100	1,748.00	174,800	
ひらまつ	200	270.00	54,000	
フィールズ	100	555.00	55,500	
双日	6,200	343.00	2,126,600	
アルフレッサホールディングス	1,200	2,229.00	2,674,800	
ハニーズホールディングス	100	1,338.00	133,800	
キッコーマン	800	5,160.00	4,128,000	
味の素	2,500	1,915.00	4,787,500	
キューピー	600	2,258.00	1,354,800	
ハウス食品グループ本社	400	3,550.00	1,420,000	
カゴメ	400	2,687.00	1,074,800	
焼津水産化学工業	100	1,023.00	102,300	
アリアケジャパン	100	7,330.00	733,000	
ニチレイ	500	2,646.00	1,323,000	
横浜冷凍	300	960.00	288,000	
東洋水産	600	4,655.00	2,793,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	100	1,095.00	109,500	
日清食品ホールディングス	500	8,420.00	4,210,000	
永谷園ホールディングス	100	2,130.00	213,000	
フジッコ	100	1,949.00	194,900	
ロック・フィールド	100	1,436.00	143,600	
日本たばこ産業	6,600	2,290.50	15,117,300	
ケンコーマヨネーズ	100	2,425.00	242,500	
わらべや日洋ホールディングス	100	1,819.00	181,900	
なとり	100	1,686.00	168,600	
北の達人コーポレーション	400	619.00	247,600	
ユーグレナ	500	895.00	447,500	
スター・マイカ・ホールディングス	100	1,640.00	164,000	
片倉工業	200	1,236.00	247,200	
グンゼ	100	4,350.00	435,000	

ヒューリック	2,400	1,340.00	3,216,000
ラサ商事	100	920.00	92,000
アルペン	100	1,619.00	161,900
クオールホールディングス	200	1,353.00	270,600
アルコニックス	100	1,317.00	131,700
神戸物産	400	4,225.00	1,690,000
ジーンズホールディングス	100	7,630.00	763,000
ビックカメラ	700	1,164.00	814,800
DCMホールディングス	600	1,035.00	621,000
ペッパーフードサービス	100	955.00	95,500
MonotaRO	800	2,713.00	2,170,400
あいホールディングス	200	1,834.00	366,800
アークランドサービスホールディングス	100	1,959.00	195,900
J.フロントリテイリング	1,300	1,285.00	1,670,500
ドトール・日レスホールディングス	200	2,071.00	414,200
マツモトキヨシホールディングス	500	4,390.00	2,195,000
ブロンコビリー	100	2,596.00	259,600
ZOZO	800	1,582.00	1,265,600
ココカラファイン	100	5,850.00	585,000
三越伊勢丹ホールディングス	1,900	802.00	1,523,800
東洋紡	400	1,488.00	595,200
ユニチカ	300	391.00	117,300
富士紡ホールディングス	100	3,380.00	338,000
日清紡ホールディングス	800	946.00	756,800
倉敷紡績	100	2,307.00	230,700
ダイワボウホールディングス	100	5,990.00	599,000
シキボウ	100	1,350.00	135,000
日東紡績	200	4,615.00	923,000
トヨタ紡織	300	1,639.00	491,700
マクニカ・富士エレホールディングス	300	1,644.00	493,200
ウエルシアホールディングス	300	5,990.00	1,797,000
クリエイトSDホールディングス	200	2,813.00	562,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	200	1,037.00	207,400
八洲電機	100	892.00	89,200
メディアスホールディングス	100	830.00	83,000
レスターホールディングス	100	1,824.00	182,400
丸善CHIホールディングス	100	361.00	36,100
TOKAIホールディングス	600	1,022.00	613,200
三洋貿易	100	1,304.00	130,400
シュッピン	100	1,081.00	108,100
ウイン・パートナーズ	100	1,160.00	116,000
ネクステージ	200	1,041.00	208,200
ジョイフル本田	300	1,260.00	378,000
ホットランド	100	1,278.00	127,800
すかいらくホールディングス	1,300	1,985.00	2,580,500
日本毛織	400	1,044.00	417,600
ダイトウボウ	200	221.00	44,200
ダイドーリミテッド	100	272.00	27,200

ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	300	979.00	293,700	
野村不動産ホールディングス	700	2,629.00	1,840,300	
三重交通グループホールディングス	200	591.00	118,200	
サムティ	200	1,849.00	369,800	
ディア・ライフ	100	578.00	57,800	
エー・ディー・ワークス	2,100	29.00	60,900	
日本商業開発	100	1,695.00	169,500	
プレサンスコーポレーション	200	1,225.00	245,000	
ユニゾホールディングス	200	5,570.00	1,114,000	
THEグローバル社	100	449.00	44,900	
日本管理センター	100	1,351.00	135,100	
フージャースホールディングス	200	684.00	136,800	
オープンハウス	300	2,932.00	879,600	
東急不動産ホールディングス	3,000	771.00	2,313,000	
飯田グループホールディングス	900	1,850.00	1,665,000	
ムゲンエステート	100	685.00	68,500	
帝国繊維	100	2,439.00	243,900	
日本コークス工業	1,000	78.00	78,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	100	632.00	63,200	
あさひ	100	1,310.00	131,000	
シップヘルスケアホールディングス	200	4,865.00	973,000	
トーエル	100	784.00	78,400	
セブン&アイ・ホールディングス	4,400	4,256.00	18,726,400	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	300	2,281.00	684,300	
ツルハホールディングス	200	13,020.00	2,604,000	
サンマルクホールディングス	100	2,265.00	226,500	
トリドールホールディングス	100	2,502.00	250,200	
帝人	900	1,968.00	1,771,200	
東レ	8,000	718.70	5,749,600	
クラレ	1,700	1,315.00	2,235,500	
旭化成	7,400	1,125.00	8,325,000	
T O K Y O B A S E	100	504.00	50,400	
稲葉製作所	100	1,371.00	137,100	
トーカロ	300	1,114.00	334,200	
S U M C O	1,300	1,705.00	2,216,500	
ハウズドゥ	100	1,311.00	131,100	
日本フェルト	100	494.00	49,400	
エコナックホールディングス	200	140.00	28,000	
アツギ	100	774.00	77,400	
J Mホールディングス	100	2,268.00	226,800	
コメダホールディングス	200	2,184.00	436,800	
アレンザホールディングス	100	970.00	97,000	
パロックジャパンリミテッド	100	1,009.00	100,900	
クスリのアオキホールディングス	100	6,490.00	649,000	
共和レザー	100	781.00	78,100	
力の源ホールディングス	100	1,002.00	100,200	
スシローグローバルホールディングス	100	9,390.00	939,000	
L I X I L ビバ	100	2,110.00	211,000	

セーレン	300	1,402.00	420,600
小松マテーレ	200	749.00	149,800
ワコールホールディングス	300	2,932.00	879,600
ホギメディカル	100	3,610.00	361,000
レナウン	300	106.00	31,800
T S Iホールディングス	400	504.00	201,600
ワールド	200	2,324.00	464,800
T I S	400	6,620.00	2,648,000
グリー	700	464.00	324,800
コーエーテクモホールディングス	200	2,909.00	581,800
A G S	100	802.00	80,200
ファインデックス	100	1,108.00	110,800
K L a b	200	789.00	157,800
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	100	914.00	91,400
ネクソン	3,200	1,482.00	4,742,400
アイスタイル	300	454.00	136,200
エイチーム	100	914.00	91,400
エニグモ	100	869.00	86,900
テクノスジャパン	100	512.00	51,200
コロブラ	400	1,186.00	474,400
オルトプラス	100	884.00	88,400
ブロードリーフ	600	601.00	360,600
デジタルハーツホールディングス	100	901.00	90,100
システム情報	100	988.00	98,800
じげん	300	494.00	148,200
ブイキューブ	100	697.00	69,700
フィックスターズ	100	1,502.00	150,200
C A R T A H O L D I N G S	100	1,049.00	104,900
特種東海製紙	100	3,970.00	397,000
ティーガイア	100	2,696.00	269,600
日本アジアグループ	100	367.00	36,700
豆蔵ホールディングス	100	1,880.00	188,000
テクマトリックス	100	2,623.00	262,300
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	300	2,034.00	610,200
G M Oペイメントゲートウェイ	200	7,050.00	1,410,000
インターネットイニシアティブ	200	3,000.00	600,000
さくらインターネット	100	629.00	62,900
S R Aホールディングス	100	2,526.00	252,600
朝日ネット	100	717.00	71,700
e B A S E	100	1,693.00	169,300
アバント	100	1,087.00	108,700
フリービット	100	839.00	83,900
コムチュア	100	2,142.00	214,200
アステリア	100	552.00	55,200
王子ホールディングス	4,600	564.00	2,594,400
日本製紙	500	1,772.00	886,000
三菱製紙	100	453.00	45,300
北越コーポレーション	700	508.00	355,600



大王製紙	500	1,453.00	726,500
マークライNZ	100	1,963.00	196,300
メディカル・データ・ビジョン	100	811.00	81,100
g u m i	100	738.00	73,800
オープンドア	100	1,311.00	131,100
L I N E	300	5,360.00	1,608,000
カナミックネットワーク	100	761.00	76,100
レンゴー	1,000	767.00	767,000
トモク	100	1,852.00	185,200
ザ・パック	100	4,065.00	406,500
オークネット	100	1,184.00	118,400
A O I T Y O H O L D I N G S	100	684.00	68,400
マクロミル	200	993.00	198,600
昭和電工	800	2,652.00	2,121,600
住友化学	8,100	448.00	3,628,800
日産化学	600	4,535.00	2,721,000
クレハ	100	6,090.00	609,000
テイカ	100	1,852.00	185,200
石原産業	200	923.00	184,600
日本曹達	200	2,935.00	587,000
東ソー	1,700	1,631.00	2,772,700
トクヤマ	300	2,740.00	822,000
セントラル硝子	200	2,390.00	478,000
東亜合成	700	1,251.00	875,700
大阪ソーダ	100	2,929.00	292,900
関東電化工業	300	1,001.00	300,300
デンカ	400	2,952.00	1,180,800
イビデン	700	2,501.00	1,750,700
信越化学工業	1,900	12,745.00	24,215,500
堺化学工業	100	2,218.00	221,800
第一稀元素化学工業	100	915.00	91,500
エア・ウォーター	1,000	1,507.00	1,507,000
大陽日酸	1,100	2,388.00	2,626,800
日本パーカラizing	600	1,168.00	700,800
高压ガス工業	200	793.00	158,600
四国化成工業	200	1,280.00	256,000
ステラ ケミファ	100	3,020.00	302,000
日本触媒	200	6,410.00	1,282,000
大日精化工業	100	2,873.00	287,300
カネカ	300	3,380.00	1,014,000
協和キリン	1,100	2,621.00	2,883,100
三菱瓦斯化学	1,000	1,677.00	1,677,000
三井化学	1,000	2,426.00	2,426,000
J S R	1,000	1,984.00	1,984,000
東京応化工業	200	4,600.00	920,000
大阪有機化学工業	100	1,788.00	178,800
三菱ケミカルホールディングス	7,400	791.70	5,858,580
K H ネオケム	200	2,451.00	490,200
ダイセル	1,500	1,043.00	1,564,500
住友ベークライト	200	3,990.00	798,000

積水化学工業	2,400	1,825.00	4,380,000	
日本ゼオン	1,000	1,181.00	1,181,000	
アイカ工業	300	3,495.00	1,048,500	
宇部興産	600	2,208.00	1,324,800	
積水樹脂	200	2,475.00	495,000	
タキロンシーアイ	200	694.00	138,800	
旭有機材	100	1,651.00	165,100	
日立化成	500	4,595.00	2,297,500	
ニチパン	100	1,718.00	171,800	
リケンテクノス	300	465.00	139,500	
大倉工業	100	1,725.00	172,500	
積水化成品工業	100	732.00	73,200	
タイガースポリマー	100	567.00	56,700	
ダイキョーニシカワ	200	750.00	150,000	
森六ホールディングス	100	2,193.00	219,300	
日本化薬	700	1,251.00	875,700	
カーリットホールディングス	100	568.00	56,800	
E P Sホールディングス	200	1,352.00	270,400	
プレステージ・インターナショナル	400	949.00	379,600	
プロトコーポレーション	100	1,427.00	142,700	
アミューズ	100	2,778.00	277,800	
野村総合研究所	1,600	2,546.00	4,073,600	
サイバネットシステム	100	880.00	88,000	
クイック	100	1,481.00	148,100	
T A C	100	221.00	22,100	
C Eホールディングス	100	471.00	47,100	
ケネディクス	1,000	550.00	550,000	
電通グループ	1,100	3,630.00	3,993,000	
インテージホールディングス	100	883.00	88,300	
ソースネクスト	500	490.00	245,000	
シーティーエス	100	707.00	70,700	
インフォコム	100	3,105.00	310,500	
メディカルシステムネットワーク	100	527.00	52,700	
日本精化	100	1,361.00	136,100	
扶桑化学工業	100	3,380.00	338,000	
ラクスル	100	3,495.00	349,500	
F I G	100	295.00	29,500	
A D E K A	500	1,594.00	797,000	
日油	400	3,620.00	1,448,000	
新日本理化	200	208.00	41,600	
ハリマ化成グループ	100	1,136.00	113,600	
アルテリア・ネットワークス	100	1,908.00	190,800	
花王	2,700	8,701.00	23,492,700	
三洋化成工業	100	5,110.00	511,000	
武田薬品工業	9,400	4,189.00	39,376,600	代用有価証券 2,600株
アステラス製薬	10,000	1,859.00	18,590,000	
大日本住友製薬	800	1,823.00	1,458,400	
塩野義製薬	1,400	6,514.00	9,119,600	
わかもと製薬	100	260.00	26,000	

あすか製薬	100	1,216.00	121,600
日本新薬	300	9,700.00	2,910,000
中外製薬	1,200	11,570.00	13,884,000
科研製薬	200	5,930.00	1,186,000
エーザイ	1,400	8,680.00	12,152,000
理研ビタミン	100	3,935.00	393,500
ロート製薬	600	3,075.00	1,845,000
小野薬品工業	2,600	2,584.50	6,719,700
久光製薬	300	5,530.00	1,659,000
有機合成薬品工業	100	273.00	27,300
持田製薬	200	4,155.00	831,000
参天製薬	2,100	2,063.00	4,332,300
ツムラ	400	2,964.00	1,185,600
日医工	300	1,280.00	384,000
テルモ	3,200	3,890.00	12,448,000
みらかホールディングス	300	2,864.00	859,200
キッセイ薬品工業	200	2,978.00	595,600
生化学工業	200	1,165.00	233,000
栄研化学	200	2,249.00	449,800
鳥居薬品	100	3,725.00	372,500
JCRファーマ	100	9,430.00	943,000
東和薬品	100	2,497.00	249,700
富士製薬工業	100	1,356.00	135,600
沢井製薬	200	7,220.00	1,444,000
ゼリア新薬工業	200	1,915.00	383,000
第一三共	3,200	7,578.00	24,249,600
キョーリン製薬ホールディングス	200	2,021.00	404,200
ダイト	100	3,525.00	352,500
大塚ホールディングス	2,200	4,850.00	10,670,000
大正製薬ホールディングス	200	7,800.00	1,560,000
ペプチドリーム	600	5,220.00	3,132,000
大日本塗料	100	1,112.00	111,200
日本ペイントホールディングス	900	5,200.00	4,680,000
関西ペイント	1,200	2,580.00	3,096,000
神東塗料	100	203.00	20,300
中国塗料	300	968.00	290,400
日本特殊塗料	100	1,263.00	126,300
藤倉化成	100	549.00	54,900
太陽ホールディングス	100	4,595.00	459,500
DIC	500	2,886.00	1,443,000
サカタインクス	200	1,144.00	228,800
東洋インキSCホールディングス	200	2,449.00	489,800
T&K TOKA	100	965.00	96,500
アルプス技研	100	1,783.00	178,300
サニックス	200	333.00	66,600
日本空調サービス	100	755.00	75,500
オリエンタルランド	1,200	14,015.00	16,818,000
フォーカスシステムズ	100	963.00	96,300
ダスキン	300	3,025.00	907,500
パーク24	600	2,744.00	1,646,400

明光ネットワークジャパン	100	944.00	94,400	
ファルコホールディングス	100	2,076.00	207,600	
クレスコ	100	1,829.00	182,900	
フジ・メディア・ホールディングス	1,100	1,490.00	1,639,000	
ラウンドワン	300	1,005.00	301,500	
リゾートトラスト	500	1,726.00	863,000	
オービック	400	15,110.00	6,044,000	
ジャストシステム	200	5,850.00	1,170,000	
TDCソフト	100	966.00	96,600	
Zホールディングス	15,300	424.00	6,487,200	
ビー・エム・エル	100	3,095.00	309,500	
トレンドマイクロ	500	5,750.00	2,875,000	
りらいあコミュニケーションズ	200	1,433.00	286,600	
リソー教育	500	358.00	179,000	
日本オラクル	200	9,500.00	1,900,000	
フューチャー	100	1,900.00	190,000	
CAC Holdings	100	1,410.00	141,000	
ユー・エス・エス	1,200	1,966.00	2,359,200	
オービックビジネスコンサルタント	100	4,215.00	421,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	500	3,240.00	1,620,000	
アイティフォー	100	750.00	75,000	
サイバーエージェント	600	4,390.00	2,634,000	
楽天	5,000	847.00	4,235,000	
クリーク・アンド・リバー社	100	1,028.00	102,800	
テー・オー・ダブリュー	100	938.00	93,800	
大塚商会	600	4,350.00	2,610,000	
サイボウズ	100	1,979.00	197,900	
ソフトブレーン	100	564.00	56,400	
山田コンサルティンググループ	100	1,492.00	149,200	
電通国際情報サービス	100	4,585.00	458,500	
デジタルガレージ	200	4,015.00	803,000	
イーエムシステムズ	200	905.00	181,000	
C I J	100	852.00	85,200	
日本エンタープライズ	100	252.00	25,200	
WOWOW	100	2,665.00	266,500	
スカラ	100	727.00	72,700	
フルキャストホールディングス	100	2,384.00	238,400	
エン・ジャパン	200	4,410.00	882,000	
富士フイルムホールディングス	2,200	5,485.00	12,067,000	
コニカミノルタ	2,500	680.00	1,700,000	
資生堂	2,300	6,820.00	15,686,000	
ライオン	1,500	2,024.00	3,036,000	
高砂香料工業	100	2,371.00	237,100	
マンダム	300	2,510.00	753,000	
ミルボン	200	5,850.00	1,170,000	
ファンケル	500	2,830.00	1,415,000	
コーセー	200	14,120.00	2,824,000	
コタ	100	1,477.00	147,700	
ポーラ・オルビスホールディングス	500	2,342.00	1,171,000	
ノエビアホールディングス	100	5,040.00	504,000	

エステー	100	1,644.00	164,400
コニシ	200	1,533.00	306,600
長谷川香料	200	2,255.00	451,000
星光P M C	100	927.00	92,700
小林製薬	300	8,550.00	2,565,000
荒川化学工業	100	1,494.00	149,400
メック	100	1,523.00	152,300
タカラバイオ	300	2,049.00	614,700
J C U	100	3,100.00	310,000
新田ゼラチン	100	651.00	65,100
デクセリアルズ	300	926.00	277,800
アース製薬	100	5,850.00	585,000
北興化学工業	100	623.00	62,300
クミアイ化学工業	500	847.00	423,500
日本農薬	200	549.00	109,800
ニチレキ	100	1,336.00	133,600
ユシロ化学工業	100	1,366.00	136,600
富士石油	300	225.00	67,500
出光興産	1,300	2,748.00	3,572,400
J X T Gホールディングス	17,000	464.20	7,891,400
コスモエネルギーホールディングス	300	2,109.00	632,700
横浜ゴム	700	1,876.00	1,313,200
TOYO TIRE	700	1,387.00	970,900
ブリヂストン	3,500	3,898.00	13,643,000
住友ゴム工業	1,000	1,209.00	1,209,000
藤倉コンポジット	100	434.00	43,400
オカモト	100	3,820.00	382,000
アキレス	100	1,719.00	171,900
ニッタ	100	3,075.00	307,500
住友理工	200	856.00	171,200
三ツ星ベルト	100	1,855.00	185,500
バンドー化学	200	819.00	163,800
A G C	1,100	3,740.00	4,114,000
日本板硝子	500	571.00	285,500
有沢製作所	200	986.00	197,200
日本電気硝子	500	2,137.00	1,068,500
住友大阪セメント	200	4,445.00	889,000
太平洋セメント	700	2,950.00	2,065,000
日本ヒューム	100	796.00	79,600
日本コンクリート工業	200	276.00	55,200
三谷セキサン	100	3,795.00	379,500
アジアパイルホールディングス	200	554.00	110,800
東海カーボン	1,200	1,005.00	1,206,000
日本カーボン	100	3,750.00	375,000
東洋炭素	100	2,035.00	203,500
ノリタケカンパニーリミテド	100	4,275.00	427,500
T O T O	800	4,600.00	3,680,000
日本碍子	1,400	1,838.00	2,573,200
日本特殊陶業	900	1,915.00	1,723,500
ダントーホールディングス	100	113.00	11,300

ヨータイ	100	700.00	70,000	
イソライト工業	100	589.00	58,900	
東京窯業	100	311.00	31,100	
ニッカトー	100	713.00	71,300	
フジインコーポレーテッド	100	2,998.00	299,800	
ニチアス	300	2,641.00	792,300	
日本製鉄	5,000	1,513.00	7,565,000	
神戸製鋼所	2,000	491.00	982,000	
中山製鋼所	200	488.00	97,600	
合同製鐵	100	2,789.00	278,900	
ジェイ エフ イー ホールディングス	3,000	1,293.00	3,879,000	
東京製鐵	500	807.00	403,500	
共英製鋼	100	1,848.00	184,800	
大和工業	200	2,585.00	517,000	
大阪製鐵	100	1,563.00	156,300	
淀川製鋼所	200	1,956.00	391,200	
丸一鋼管	400	3,005.00	1,202,000	
大同特殊鋼	200	4,190.00	838,000	
日本冶金工業	100	2,073.00	207,300	
山陽特殊製鋼	100	1,424.00	142,400	
愛知製鋼	100	3,485.00	348,500	
日立金属	1,200	1,703.00	2,043,600	
大平洋金属	100	2,130.00	213,000	
新日本電工	700	159.00	111,300	
栗本鐵工所	100	2,102.00	210,200	
日本製鋼所	300	1,975.00	592,500	
三菱製鋼	100	993.00	99,300	
日亜鋼業	200	320.00	64,000	
大紀アルミニウム工業所	200	673.00	134,600	
日本軽金属ホールディングス	2,800	207.00	579,600	
三井金属鉱業	300	2,592.00	777,600	
東邦亜鉛	100	1,862.00	186,200	
三菱マテリアル	700	2,747.00	1,922,900	
住友金属鉱山	1,400	3,087.00	4,321,800	
DOWAホールディングス	300	3,880.00	1,164,000	
古河機械金属	200	1,324.00	264,800	
エス・サイエンス	500	45.00	22,500	
大阪チタニウムテクノロジーズ	100	1,292.00	129,200	
東邦チタニウム	200	797.00	159,400	
UACJ	200	2,226.00	445,200	
古河電気工業	300	2,571.00	771,300	
住友電気工業	4,200	1,458.00	6,123,600	
フジクラ	1,400	407.00	569,800	
昭和電線ホールディングス	100	1,373.00	137,300	
タツタ電線	200	572.00	114,400	
リョービ	100	1,757.00	175,700	
アーレスティ	100	518.00	51,800	
アサヒホールディングス	200	2,654.00	530,800	
東洋製罐グループホールディングス	700	1,858.00	1,300,600	

ホッカホールディングス	100	1,900.00	190,000
コロナ	100	1,000.00	100,000
横河ブリッジホールディングス	200	2,102.00	420,400
OSJBホールディングス	600	275.00	165,000
三和ホールディングス	1,100	1,161.00	1,277,100
文化シャッター	300	879.00	263,700
三協立山	100	1,460.00	146,000
アルインコ	100	1,194.00	119,400
LIXILグループ	1,700	1,904.00	3,236,800
日本フィルコン	100	528.00	52,800
ノーリツ	200	1,334.00	266,800
長府製作所	100	2,288.00	228,800
リンナイ	200	7,760.00	1,552,000
ユニプレス	200	1,412.00	282,400
ダイニチ工業	100	701.00	70,100
日東精工	200	571.00	114,200
岡部	200	849.00	169,800
ジーテクト	100	1,585.00	158,500
東プレ	200	1,684.00	336,800
高周波熱錬	200	868.00	173,600
東京製綱	100	1,079.00	107,900
サンコール	100	531.00	53,100
モリテックスチール	100	356.00	35,600
パイオラックス	200	1,944.00	388,800
エイチワン	100	726.00	72,600
日本発条	1,200	867.00	1,040,400
三浦工業	500	3,815.00	1,907,500
タクマ	400	1,187.00	474,800
テクノプロ・ホールディングス	200	7,470.00	1,494,000
Gunosy	100	1,221.00	122,100
イー・ガーディアン	100	1,802.00	180,200
リブセンス	100	287.00	28,700
ジャパンマテリアル	300	1,611.00	483,300
ベクトル	100	1,161.00	116,100
ウチヤマホールディングス	100	497.00	49,700
チャーム・ケア・コーポレーション	100	871.00	87,100
IBJ	100	1,247.00	124,700
N・フィールド	100	609.00	60,900
M&Aキャピタルパートナーズ	100	3,610.00	361,000
シグマクシス	100	1,980.00	198,000
ウィルグループ	100	1,063.00	106,300
エスクロー・エージェント・ジャパン	100	214.00	21,400
リクルートホールディングス	7,800	4,336.00	33,820,800
エラン	100	1,688.00	168,800
ツガミ	200	1,013.00	202,600
オークマ	100	5,090.00	509,000
東芝機械	100	3,405.00	340,500
アマダホールディングス	1,400	1,146.00	1,604,400
アイダエンジニアリング	300	877.00	263,100
FUJI	500	1,719.00	859,500

牧野フライス製作所	100	4,220.00	422,000	
オーエスジー	500	1,864.00	932,000	
旭ダイヤモンド工業	300	590.00	177,000	
D M G 森精機	700	1,581.00	1,106,700	
ソディック	300	854.00	256,200	
ディスコ	200	25,280.00	5,056,000	
日東工器	100	2,340.00	234,000	
パンチ工業	100	475.00	47,500	
日本郵政	8,900	996.70	8,870,630	
ベルシステム24ホールディングス	200	1,526.00	305,200	
鎌倉新書	100	1,569.00	156,900	
ソラスト	300	1,113.00	333,900	
インソース	100	3,315.00	331,500	
豊田自動織機	900	5,850.00	5,265,000	
豊和工業	100	823.00	82,300	
東洋機械金属	100	515.00	51,500	
島精機製作所	200	2,038.00	407,600	
オプトラン	100	2,876.00	287,600	
イワキ	100	1,156.00	115,600	
フリー	100	1,176.00	117,600	
ヤマシンフィルタ	200	756.00	151,200	
日阪製作所	100	898.00	89,800	
やまびこ	200	1,056.00	211,200	
平田機工	100	6,410.00	641,000	
ペガサスミシン製造	100	467.00	46,700	
タツモ	100	1,203.00	120,300	
ナブテスコ	700	3,185.00	2,229,500	
三井海洋開発	100	2,487.00	248,700	
レオン自動機	100	1,417.00	141,700	
S M C	400	47,820.00	19,128,000	
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	100	494.00	49,400	
オイレス工業	100	1,538.00	153,800	
サトーホールディングス	200	3,070.00	614,000	
技研製作所	100	4,810.00	481,000	
日精樹脂工業	100	943.00	94,300	
小松製作所	5,100	2,417.50	12,329,250	
住友重機械工業	600	2,847.00	1,708,200	
日立建機	500	2,966.00	1,483,000	
日工	200	800.00	160,000	
井関農機	100	1,426.00	142,600	
T O W A	100	988.00	98,800	
北川鉄工所	100	2,176.00	217,600	
シンニッタン	200	452.00	90,400	
クボタ	6,000	1,738.00	10,428,000	
東洋エンジニアリング	100	558.00	55,800	
月島機械	200	1,428.00	285,600	
帝国電機製作所	100	1,343.00	134,300	
新東工業	300	943.00	282,900	
澁谷工業	100	3,020.00	302,000	



アイチコーポレーション	200	724.00	144,800
小森コーポレーション	300	979.00	293,700
鶴見製作所	100	1,782.00	178,200
荏原製作所	500	3,030.00	1,515,000
西島製作所	100	875.00	87,500
北越工業	100	1,300.00	130,000
ダイキン工業	1,400	15,595.00	21,833,000
栗田工業	600	3,235.00	1,941,000
椿本チエイン	200	3,330.00	666,000
大同工業	100	815.00	81,500
日機装	300	1,332.00	399,600
木村化工機	100	613.00	61,300
レイズネクスト	200	1,302.00	260,400
アネスト岩田	200	1,000.00	200,000
ダイフク	600	6,670.00	4,002,000
加藤製作所	100	1,595.00	159,500
タダノ	500	1,032.00	516,000
フジテック	400	1,780.00	712,000
C K D	300	1,790.00	537,000
キトー	100	1,653.00	165,300
平和	300	2,258.00	677,400
理想科学工業	100	1,806.00	180,600
SANKYO	300	3,715.00	1,114,500
日本金銭機械	100	811.00	81,100
マースグループホールディングス	100	1,995.00	199,500
フクシマガリレイ	100	3,960.00	396,000
ダイコク電機	100	1,581.00	158,100
竹内製作所	200	1,865.00	373,000
アマノ	300	3,020.00	906,000
JUKI	200	759.00	151,800
サンデンホールディングス	100	651.00	65,100
蛇の目マシン工業	100	402.00	40,200
ブラザー工業	1,400	2,138.00	2,993,200
マックス	200	2,034.00	406,800
モリタホールディングス	200	1,754.00	350,800
グローリー	300	3,175.00	952,500
新晃工業	100	1,680.00	168,000
大和冷機工業	200	1,136.00	227,200
セガサミーホールディングス	1,100	1,479.00	1,626,900
リケン	100	3,505.00	350,500
T P R	200	1,773.00	354,600
ツバキ・ナカシマ	200	1,291.00	258,200
ホシザキ	300	10,190.00	3,057,000
大豊工業	100	715.00	71,500
日本精工	2,100	919.00	1,929,900
NTN	2,600	287.00	746,200
ジェイテクト	1,100	1,170.00	1,287,000
不二越	100	4,090.00	409,000
ミネベアミツミ	2,100	2,166.00	4,548,600
日本トムソン	300	459.00	137,700

THK	700	2,824.00	1,976,800
ユーシン精機	100	908.00	90,800
イーグル工業	100	980.00	98,000
前澤工業	100	387.00	38,700
日本ピラー工業	100	1,447.00	144,700
キッツ	500	754.00	377,000
日立製作所	5,400	4,100.00	22,140,000
三菱電機	11,300	1,584.00	17,899,200
富士電機	700	3,340.00	2,338,000
安川電機	1,200	3,845.00	4,614,000
シンフォニアテクノロジー	100	1,227.00	122,700
明電舎	200	2,087.00	417,400
山洋電気	100	5,320.00	532,000
デンヨー	100	2,068.00	206,800
ベйкаレント・コンサルティング	100	7,890.00	789,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	100	2,409.00	240,900
日総工産	100	1,008.00	100,800
RPAホールディングス	100	1,016.00	101,600
三櫻工業	100	1,031.00	103,100
マキタ	1,500	4,180.00	6,270,000
東芝テック	100	4,330.00	433,000
マブチモーター	300	3,950.00	1,185,000
日本電産	1,400	13,850.00	19,390,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	100	406.00	40,600
トレックス・セミコンダクター	100	1,469.00	146,900
東光高岳	100	1,169.00	116,900
ダブル・スコープ	200	885.00	177,000
ダイヘン	100	3,490.00	349,000
ヤーマン	200	649.00	129,800
JVCケンウッド	900	243.00	218,700
ミマキエンジニアリング	100	501.00	50,100
日新電機	300	1,242.00	372,600
大崎電気工業	200	629.00	125,800
オムロン	1,000	6,470.00	6,470,000
日東工業	200	2,250.00	450,000
IDEC	200	1,954.00	390,800
ジーエス・ユアサコーポレーション	400	2,165.00	866,000
日本電気	1,400	4,995.00	6,993,000
富士通	1,100	11,950.00	13,145,000
沖電気工業	500	1,355.00	677,500
電気興業	100	3,700.00	370,000
サンケン電気	100	2,724.00	272,400
アイホン	100	1,667.00	166,700
ルネサスエレクトロニクス	5,400	704.00	3,801,600
セイコーエプソン	1,400	1,665.00	2,331,000
ワコム	800	386.00	308,800
アルバック	200	3,980.00	796,000
EIZO	100	3,715.00	371,500
ジャパンディスプレイ	3,300	73.00	240,900

日本信号	300	1,386.00	415,800	
京三製作所	300	552.00	165,600	
能美防災	100	2,433.00	243,300	
ホーチキ	100	1,484.00	148,400	
星和電機	100	540.00	54,000	
エレコム	100	4,320.00	432,000	
パナソニック	12,900	1,075.50	13,873,950	代用有価証券 7,500株
シャープ	1,300	1,501.00	1,951,300	
アンリツ	700	2,173.00	1,521,100	
富士通ゼネラル	300	2,451.00	735,300	
ソニー	7,200	7,703.00	55,461,600	代用有価証券 3,700株
T D K	500	11,770.00	5,885,000	
タムラ製作所	400	643.00	257,200	
アルプスアルパイン	1,000	1,920.00	1,920,000	
日本電波工業	100	473.00	47,300	
鈴木	100	747.00	74,700	
ローランド ディー・ジー	100	1,982.00	198,200	
フォスター電機	100	1,603.00	160,300	
ヨコオ	100	2,888.00	288,800	
ティアック	100	191.00	19,100	
ホシデン	300	1,193.00	357,900	
ヒロセ電機	200	13,590.00	2,718,000	
日本航空電子工業	300	1,923.00	576,900	
T O A	100	1,112.00	111,200	
マクセルホールディングス	200	1,421.00	284,200	
古野電気	100	1,064.00	106,400	
スミダコーポレーション	100	1,046.00	104,600	
アイコム	100	2,536.00	253,600	
本多通信工業	100	516.00	51,600	
船井電機	100	658.00	65,800	
横河電機	1,000	1,917.00	1,917,000	
アズビル	700	2,965.00	2,075,500	
東亜ディーケーケー	100	960.00	96,000	
日本光電工業	500	3,155.00	1,577,500	
共和電業	100	427.00	42,700	
堀場製作所	200	6,980.00	1,396,000	
アドバンテスト	800	5,710.00	4,568,000	
エスペック	100	2,192.00	219,200	
キーエンス	1,000	37,120.00	37,120,000	
日置電機	100	3,925.00	392,500	
シスメックス	800	7,866.00	6,292,800	
日本マイクロニクス	200	1,262.00	252,400	
メガチップス	100	1,705.00	170,500	
O B A R A G R O U P	100	3,480.00	348,000	
I M A G I C A G R O U P	100	517.00	51,700	
デンソー	2,500	4,451.00	11,127,500	
原田工業	100	954.00	95,400	
コーセル	200	1,101.00	220,200	

イリソ電子工業	100	4,130.00	413,000	
オブテックスグループ	200	1,438.00	287,600	
千代田インテグレ	100	2,040.00	204,000	
レーザーテック	500	5,510.00	2,755,000	
スタンレー電気	800	2,898.00	2,318,400	
ウシオ電機	700	1,522.00	1,065,400	
岡谷電機産業	100	368.00	36,800	
ヘリオス テクノ ホールディング	100	429.00	42,900	
日本セラミック	100	2,424.00	242,400	
遠藤照明	100	687.00	68,700	
古河電池	100	731.00	73,100	
双信電機	100	434.00	43,400	
山一電機	100	1,626.00	162,600	
図研	100	2,502.00	250,200	
日本電子	200	3,560.00	712,000	
カシオ計算機	1,000	2,007.00	2,007,000	
ファナック	1,100	20,380.00	22,418,000	
日本シイエムケイ	300	515.00	154,500	
エンプラス	100	2,875.00	287,500	
ローム	500	7,920.00	3,960,000	
浜松ホトニクス	800	4,645.00	3,716,000	
三井ハイテック	100	1,669.00	166,900	
新光電気工業	400	1,285.00	514,000	
京セラ	1,600	7,093.00	11,348,800	
太陽誘電	500	3,205.00	1,602,500	
村田製作所	3,300	6,249.00	20,621,700	
双葉電子工業	200	1,261.00	252,200	
日東電工	800	6,100.00	4,880,000	
東海理化電機製作所	300	1,864.00	559,200	
ニチコン	400	986.00	394,400	
日本ケミコン	100	1,651.00	165,100	
K O A	200	1,150.00	230,000	
三井E & Sホールディングス	400	930.00	372,000	
日立造船	900	404.00	363,600	
三菱重工業	1,900	4,009.00	7,617,100	
川崎重工業	900	2,126.00	1,913,400	
I H I	800	2,582.00	2,065,600	
名村造船所	400	236.00	94,400	
サノヤスホールディングス	100	173.00	17,300	
三菱ロジスネクスト	100	1,695.00	169,500	
F P G	300	964.00	289,200	
じもとホールディングス	800	105.00	84,000	
全国保証	300	4,635.00	1,390,500	
めぶきフィナンシャルグループ	5,800	246.00	1,426,800	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	200	1,268.00	253,600	
九州フィナンシャルグループ	1,800	455.00	819,000	
かんぼ生命保険	400	1,861.00	744,400	
ゆうちょ銀行	3,200	1,016.00	3,251,200	
富山第一銀行	300	322.00	96,600	

コンコルディア・フィナンシャルグループ	6,600	419.00	2,765,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	800	731.00	584,800	
アルヒ	200	1,688.00	337,600	
プレミアグループ	100	2,008.00	200,800	
日産自動車	13,400	590.00	7,906,000	
いすゞ自動車	3,300	1,072.00	3,537,600	
トヨタ自動車	12,600	7,580.00	95,508,000	代用有価証券 9,000株
日野自動車	1,400	1,026.00	1,436,400	
三菱自動車工業	4,200	402.00	1,688,400	
エフテック	100	748.00	74,800	
武蔵精密工業	300	1,311.00	393,300	
日産車体	200	1,047.00	209,400	
新明和工業	300	1,349.00	404,700	
極東開発工業	200	1,404.00	280,800	
日信工業	200	2,234.00	446,800	
トピー工業	100	1,742.00	174,200	
曙ブレーキ工業	600	222.00	133,200	
タチエス	200	1,258.00	251,600	
N O K	600	1,500.00	900,000	
フタバ産業	300	654.00	196,200	
K Y B	100	2,967.00	296,700	
市光工業	200	677.00	135,400	
大同メタル工業	200	675.00	135,000	
プレス工業	600	362.00	217,200	
ミクニ	100	331.00	33,100	
太平洋工業	200	1,281.00	256,200	
ケーヒン	300	2,580.00	774,000	
河西工業	200	805.00	161,000	
アイシン精機	900	3,730.00	3,357,000	
マツダ	3,300	909.00	2,999,700	
今仙電機製作所	100	879.00	87,900	
本田技研工業	8,900	2,809.50	25,004,550	代用有価証券 6,000株
スズキ	2,200	5,025.00	11,055,000	
S U B A R U	3,500	2,746.00	9,611,000	
安永	100	1,123.00	112,300	
ヤマハ発動機	1,500	2,048.00	3,072,000	
ショーワ	300	2,282.00	684,600	
小糸製作所	700	4,820.00	3,374,000	
T B K	100	459.00	45,900	
エクセディ	200	2,296.00	459,200	
ミツバ	200	637.00	127,400	
豊田合成	400	2,319.00	927,600	
愛三工業	200	720.00	144,000	
日本プラスト	100	669.00	66,900	
ヨロズ	100	1,417.00	141,700	
エフ・シー・シー	200	2,269.00	453,800	

シマノ	400	16,800.00	6,720,000	
テイ・エス テック	300	3,050.00	915,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	700	617.00	431,900	
三十三フィナンシャルグループ	100	1,588.00	158,800	
第四北越フィナンシャルグループ	200	2,703.00	540,600	
ジャムコ	100	1,358.00	135,800	
小野建	100	1,350.00	135,000	
はるやまホールディングス	100	858.00	85,800	
ノジマ	200	2,159.00	431,800	
佐島電機	100	870.00	87,000	
カップ・クリエイト	200	1,460.00	292,000	
伯東	100	1,261.00	126,100	
コンドーテック	100	1,139.00	113,900	
中山福	100	514.00	51,400	
ライトオン	100	583.00	58,300	
ナガイレーベン	200	2,342.00	468,400	
三菱食品	100	3,165.00	316,500	
良品計画	1,500	1,807.00	2,710,500	
三城ホールディングス	100	333.00	33,300	
松田産業	100	1,561.00	156,100	
第一興商	200	5,270.00	1,054,000	
メディカルホールディングス	1,200	2,316.00	2,779,200	
アドヴァン	200	1,300.00	260,000	
アズワン	100	9,460.00	946,000	
シモジマ	100	1,120.00	112,000	
ドウシシャ	100	1,716.00	171,600	
コナカ	100	405.00	40,500	
高速	100	1,190.00	119,000	
G-7ホールディングス	100	2,335.00	233,500	
イオン北海道	100	798.00	79,800	
コジマ	200	519.00	103,800	
コーナン商事	200	2,384.00	476,800	
ネットワンシステムズ	400	1,841.00	736,400	
ワタミ	100	1,273.00	127,300	
システムソフト	300	98.00	29,400	
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	2,500	1,746.00	4,365,000	
丸文	100	598.00	59,800	
西松屋チェーン	200	932.00	186,400	
ゼンショーホールディングス	500	2,272.00	1,136,000	
ハビネット	100	1,326.00	132,600	
幸楽苑ホールディングス	100	1,847.00	184,700	
日本ライフライン	300	1,379.00	413,700	
サイゼリヤ	200	2,395.00	479,000	
タカショー	100	459.00	45,900	
VTホールディングス	500	446.00	223,000	
アルゴグラフィックス	100	3,515.00	351,500	
IDOM	300	581.00	174,300	
日本エム・ディ・エム	100	2,148.00	214,800	
ユナイテッドアローズ	100	2,858.00	285,800	

進和	100	2,194.00	219,400	
ハイデイ日高	200	1,967.00	393,400	
シークス	100	1,284.00	128,400	
京都きもの友禅	100	323.00	32,300	
コロワイド	400	2,198.00	879,200	
ピーシーデボコーポレーション	100	575.00	57,500	
オーハシテクニカ	100	1,535.00	153,500	
壱番屋	100	5,670.00	567,000	
スギホールディングス	200	5,400.00	1,080,000	
島津製作所	1,400	3,110.00	4,354,000	
JMS	100	927.00	92,700	
長野計器	100	886.00	88,600	
ブイ・テクノロジー	100	4,835.00	483,500	
スター精密	200	1,375.00	275,000	
東京計器	100	998.00	99,800	
インターアクション	100	2,640.00	264,000	
オーバル	100	240.00	24,000	
東京精密	200	3,860.00	772,000	
マニー	500	2,794.00	1,397,000	
ニコン	1,800	1,314.00	2,365,200	
トプコン	600	1,205.00	723,000	
オリンパス	6,300	1,785.50	11,248,650	
理研計器	100	2,125.00	212,500	
SCREENホールディングス	200	5,960.00	1,192,000	
キヤノン電子	100	2,014.00	201,400	
タムロン	100	2,324.00	232,400	
HOYA	2,300	10,590.00	24,357,000	
ノーリツ鋼機	100	1,550.00	155,000	
エー・アンド・デイ	100	898.00	89,800	
朝日インテック	1,000	2,998.00	2,998,000	
キヤノン	6,100	2,872.00	17,519,200	代用有価証券 4,100株
リコー	2,900	1,253.00	3,633,700	
シチズン時計	1,300	522.00	678,600	
大研医器	100	663.00	66,300	
メニコン	200	4,955.00	991,000	
スノーピーク	100	1,003.00	100,300	
パラマウントベッドホールディングス	100	4,540.00	454,000	
トランザクション	100	1,097.00	109,700	
ニホンフラッシュ	100	2,625.00	262,500	
前田工織	100	2,129.00	212,900	
永大産業	100	345.00	34,500	
アートネイチャー	100	763.00	76,300	
バンダイナムコホールディングス	1,200	6,332.00	7,598,400	
共立印刷	200	165.00	33,000	
SHOEI	100	5,310.00	531,000	
フランスベッドホールディングス	200	942.00	188,400	
マーベラス	200	696.00	139,200	
パイロットコーポレーション	200	4,335.00	867,000	
萩原工業	100	1,582.00	158,200	

エイベックス	200	1,207.00	241,400
トッパン・フォームズ	200	1,195.00	239,000
フジシールインターナショナル	300	2,311.00	693,300
タカラトミー	500	1,173.00	586,500
廣濟堂	100	1,045.00	104,500
アーク	400	93.00	37,200
レック	100	1,193.00	119,300
三光合成	100	353.00	35,300
プロネクサス	100	1,124.00	112,400
ホクシン	100	158.00	15,800
大建工業	100	1,844.00	184,400
きもと	200	172.00	34,400
凸版印刷	1,600	2,189.00	3,502,400
大日本印刷	1,500	3,055.00	4,582,500
N I S S H A	200	1,004.00	200,800
藤森工業	100	3,325.00	332,500
ヴィア・ホールディングス	100	660.00	66,000
TAKARA & COMPANY	100	1,723.00	172,300
前澤化成工業	100	1,131.00	113,100
未来工業	100	2,078.00	207,800
アシックス	900	1,588.00	1,429,200
J S P	100	1,848.00	184,800
ニチハ	200	2,715.00	543,000
エフピコ	100	6,480.00	648,000
ヤマハ	700	5,510.00	3,857,000
クリナップ	100	668.00	66,800
ビジョン	700	3,855.00	2,698,500
天馬	100	1,964.00	196,400
キングジム	100	881.00	88,100
象印マホービン	300	2,187.00	656,100
リンテック	300	2,395.00	718,500
信越ポリマー	200	957.00	191,400
東リ	300	294.00	88,200
イトーキ	200	469.00	93,800
任天堂	700	40,040.00	28,028,000
三菱鉛筆	200	1,593.00	318,600
松風	100	1,831.00	183,100
タカラスタANDARD	200	1,863.00	372,600
コクヨ	500	1,610.00	805,000
ナカバヤシ	100	613.00	61,300
ニフコ	400	2,846.00	1,138,400
グローブライト	100	2,327.00	232,700
オカムラ	400	1,042.00	416,800
バルカー	100	2,345.00	234,500
伊藤忠商事	7,800	2,530.00	19,734,000
丸紅	11,600	785.60	9,112,960
スクロール	200	352.00	70,400
ヨンドシーホールディングス	100	2,359.00	235,900
三陽商会	100	1,213.00	121,300
長瀬産業	600	1,509.00	905,400



蝶理	100	2,099.00	209,900	
豊田通商	1,200	3,605.00	4,326,000	
オンワードホールディングス	700	616.00	431,200	
三共生興	200	572.00	114,400	
兼松	400	1,400.00	560,000	
美津濃	100	2,663.00	266,300	
ファミリーマート	900	2,323.00	2,090,700	
三井物産	9,800	1,937.00	18,982,600	
日本紙パルプ商事	100	4,070.00	407,000	
東京エレクトロン	800	24,070.00	19,256,000	
日立ハイテクノロジーズ	400	8,100.00	3,240,000	
カメイ	100	1,120.00	112,000	
セイコーホールディングス	200	2,629.00	525,800	
山善	400	1,015.00	406,000	
住友商事	7,000	1,638.50	11,469,500	
日本ユニシス	300	3,325.00	997,500	
三菱商事	7,800	2,798.00	21,824,400	代用有価証券 5,200株
第一実業	100	3,490.00	349,000	
キヤノンマーケティングジャパン	300	2,632.00	789,600	
西華産業	100	1,270.00	127,000	
佐藤商事	100	943.00	94,300	
菱洋エレクトロ	100	1,826.00	182,600	
東京産業	100	608.00	60,800	
ユアサ商事	100	3,505.00	350,500	
小林産業	100	277.00	27,700	
阪和興業	200	2,663.00	532,600	
正栄食品工業	100	3,680.00	368,000	
カナデン	100	1,332.00	133,200	
菱電商事	100	1,647.00	164,700	
ニプロ	800	1,248.00	998,400	
フルサト工業	100	1,734.00	173,400	
岩谷産業	200	3,685.00	737,000	
イワキ	100	512.00	51,200	
兼松エレクトロニクス	100	3,480.00	348,000	
三愛石油	300	1,097.00	329,100	
稲畑産業	200	1,470.00	294,000	
明和産業	100	595.00	59,500	
キムラタン	600	28.00	16,800	
ゴールドウイン	200	6,540.00	1,308,000	
ユニ・チャーム	2,200	3,770.00	8,294,000	
デサント	200	1,779.00	355,800	
キング	100	563.00	56,300	
ワキタ	200	1,004.00	200,800	
ヤマトインターナショナル	100	409.00	40,900	
東邦ホールディングス	400	2,244.00	897,600	
サンゲツ	300	1,928.00	578,400	
ミツウロコグループホールディングス	200	1,139.00	227,800	
伊藤忠エネクス	200	927.00	185,400	
サンリオ	300	2,104.00	631,200	

サンワ テクノス	100	956.00	95,600
リョーサン	100	2,476.00	247,600
新光商事	200	830.00	166,000
トーホー	100	1,788.00	178,800
三信電気	100	1,704.00	170,400
東陽テクニカ	100	1,156.00	115,600
モスフードサービス	100	3,020.00	302,000
加賀電子	100	2,243.00	224,300
三益半導体工業	100	2,347.00	234,700
ソーダニッカ	100	595.00	59,500
立花エレテック	100	1,767.00	176,700
木曽路	100	2,926.00	292,600
S R Sホールディングス	100	1,040.00	104,000
千趣会	200	473.00	94,600
タカキュー	100	184.00	18,400
ケーヨー	200	540.00	108,000
上新電機	100	2,363.00	236,300
日本瓦斯	200	3,490.00	698,000
ロイヤルホールディングス	200	2,368.00	473,600
いなげや	100	1,471.00	147,100
島忠	200	3,100.00	620,000
チヨダ	100	1,469.00	146,900
ライフコーポレーション	100	2,648.00	264,800
リンガーハット	100	2,447.00	244,700
MrMaxHD	200	460.00	92,000
テンアライド	100	436.00	43,600
AOKIホールディングス	200	1,070.00	214,000
オークワ	200	1,483.00	296,600
コメリ	200	2,369.00	473,800
青山商事	200	1,406.00	281,200
しまむら	100	8,220.00	822,000
はせがわ	100	403.00	40,300
高島屋	800	1,150.00	920,000
松屋	200	743.00	148,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	500	990.00	495,000
パルコ	100	1,848.00	184,800
丸井グループ	1,000	2,480.00	2,480,000
クレディセゾン	800	1,721.00	1,376,800
アクシアル リテイリング	100	3,675.00	367,500
井筒屋	100	233.00	23,300
イオン	4,300	2,239.00	9,627,700
イズミ	200	3,395.00	679,000
平和堂	200	1,898.00	379,600
フジ	100	1,848.00	184,800
ヤオコー	100	5,650.00	565,000
ゼビオホールディングス	100	1,168.00	116,800
ケーズホールディングス	1,100	1,328.00	1,460,800
PALTAC	200	5,180.00	1,036,000
三谷産業	100	346.00	34,600
Olympicグループ	100	599.00	59,900

日産東京販売ホールディングス	200	277.00	55,400	
新生銀行	800	1,690.00	1,352,000	
あおぞら銀行	700	3,060.00	2,142,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	76,900	564.90	43,440,810	
りそなホールディングス	12,300	452.80	5,569,440	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,100	4,015.00	8,431,500	
三井住友フィナンシャルグループ	7,700	3,868.00	29,783,600	
千葉銀行	3,800	602.00	2,287,600	
群馬銀行	2,200	355.00	781,000	
武蔵野銀行	200	1,711.00	342,200	
千葉興業銀行	300	349.00	104,700	
筑波銀行	500	208.00	104,000	
七十七銀行	400	1,651.00	660,400	
青森銀行	100	2,677.00	267,700	
秋田銀行	100	1,996.00	199,600	
山形銀行	100	1,382.00	138,200	
岩手銀行	100	2,708.00	270,800	
東邦銀行	1,000	251.00	251,000	
東北銀行	100	1,040.00	104,000	
みちのく銀行	100	1,392.00	139,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	900	1,931.00	1,737,900	
静岡銀行	2,800	775.00	2,170,000	
十六銀行	100	2,270.00	227,000	
スルガ銀行	1,100	432.00	475,200	
八十二銀行	2,700	424.00	1,144,800	
山梨中央銀行	100	1,024.00	102,400	
大垣共立銀行	200	2,272.00	454,400	
福井銀行	100	1,631.00	163,100	
北國銀行	100	3,175.00	317,500	
滋賀銀行	200	2,637.00	527,400	
南都銀行	200	2,611.00	522,200	
百五銀行	1,000	329.00	329,000	
京都銀行	400	4,420.00	1,768,000	
紀陽銀行	400	1,578.00	631,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	700	1,062.00	743,400	
広島銀行	1,600	498.00	796,800	
山陰合同銀行	700	606.00	424,200	
中国銀行	1,000	1,035.00	1,035,000	
伊予銀行	1,600	564.00	902,400	
百十四銀行	100	1,975.00	197,500	
四国銀行	200	948.00	189,600	
阿波銀行	200	2,416.00	483,200	
大分銀行	100	2,533.00	253,300	
宮崎銀行	100	2,470.00	247,000	
佐賀銀行	100	1,545.00	154,500	
沖縄銀行	100	3,515.00	351,500	
琉球銀行	300	1,058.00	317,400	
セブン銀行	3,700	324.00	1,198,800	
みずほフィナンシャルグループ	151,800	162.30	24,637,140	
山口フィナンシャルグループ	1,400	660.00	924,000	

芙蓉総合リース	100	6,790.00	679,000	
みずほリース	200	3,240.00	648,000	
東京センチュリー	200	5,500.00	1,100,000	
SBIホールディングス	1,200	2,512.00	3,014,400	
日本証券金融	500	504.00	252,000	
アイフル	1,700	293.00	498,100	
日本アジア投資	100	272.00	27,200	
名古屋銀行	100	3,235.00	323,500	
北洋銀行	1,700	221.00	375,700	
愛媛銀行	200	1,133.00	226,600	
京葉銀行	500	572.00	286,000	
栃木銀行	500	205.00	102,500	
東和銀行	200	801.00	160,200	
福島銀行	100	232.00	23,200	
大東銀行	100	619.00	61,900	
リコーリース	100	4,070.00	407,000	
イオンフィナンシャルサービス	700	1,695.00	1,186,500	
アコム	2,200	502.00	1,104,400	
ジャックス	100	2,554.00	255,400	
オリエントコーポレーション	3,000	161.00	483,000	
日立キャピタル	300	2,960.00	888,000	
アプラスフィナンシャル	500	85.00	42,500	
オリックス	7,000	1,840.00	12,880,000	
三菱UFJリース	2,800	683.00	1,912,400	
ジャフコ	200	4,655.00	931,000	
九州リースサービス	100	596.00	59,600	
トモニホールディングス	900	367.00	330,300	
大和証券グループ本社	9,000	544.60	4,901,400	
野村ホールディングス	19,700	555.30	10,939,410	
岡三証券グループ	1,000	392.00	392,000	
丸三証券	300	522.00	156,600	
東洋証券	400	145.00	58,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,300	341.00	443,300	
水戸証券	300	224.00	67,200	
いちよし証券	200	605.00	121,000	
松井証券	600	881.00	528,600	
SOMPOホールディングス	2,100	4,093.00	8,595,300	
だいがく証券ビジネス	100	694.00	69,400	
日本取引所グループ	3,200	1,940.00	6,208,000	
マネックスグループ	800	252.00	201,600	
極東証券	100	748.00	74,800	
岩井コスモホールディングス	100	1,289.00	128,900	
藍澤證券	200	733.00	146,600	
フィデアホールディングス	1,100	123.00	135,300	
池田泉州ホールディングス	1,300	193.00	250,900	
アニコムホールディングス	100	3,980.00	398,000	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	2,900	3,651.00	10,587,900	

ソニーフィナンシャルホールディングス	900	2,525.00	2,272,500	
マネーパートナーズグループ	100	235.00	23,500	
スパークス・グループ	400	269.00	107,600	
第一生命ホールディングス	6,300	1,644.50	10,360,350	
東京海上ホールディングス	4,000	6,002.00	24,008,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	100	896.00	89,600	
イー・ギャランティ	100	1,308.00	130,800	
アサックス	100	713.00	71,300	
T&Dホールディングス	3,300	1,181.00	3,897,300	
三井不動産	5,500	2,936.50	16,150,750	
三菱地所	7,800	2,143.50	16,719,300	
平和不動産	200	3,275.00	655,000	
東京建物	1,200	1,767.00	2,120,400	
ダイビル	300	1,353.00	405,900	
京阪神ビルディング	200	1,448.00	289,600	
住友不動産	2,500	4,051.00	10,127,500	
テオーシー	200	875.00	175,000	
レオパレス21	1,500	313.00	469,500	
スターツコーポレーション	200	2,624.00	524,800	
フジ住宅	100	670.00	67,000	
空港施設	100	541.00	54,100	
明和地所	100	618.00	61,800	
ゴールドクレスト	100	1,884.00	188,400	
リログループ	600	2,910.00	1,746,000	
日神グループホールディングス	200	546.00	109,200	
日本エスコン	200	936.00	187,200	
タカラレーベン	500	482.00	241,000	
A V A N T I A	100	995.00	99,500	
イオンモール	600	1,791.00	1,074,600	
ランド	6,100	11.00	67,100	
カチタス	100	4,475.00	447,500	
東祥	100	2,162.00	216,200	
トーセイ	200	1,371.00	274,200	
サンフロンティア不動産	200	1,205.00	241,000	
エフ・ジェー・ネクスト	100	1,210.00	121,000	
グランディハウス	100	487.00	48,700	
東武鉄道	1,200	3,825.00	4,590,000	
相鉄ホールディングス	400	2,931.00	1,172,400	
東急	2,900	1,916.00	5,556,400	
京浜急行電鉄	1,500	2,026.00	3,039,000	
小田急電鉄	1,700	2,403.00	4,085,100	
京王電鉄	600	6,210.00	3,726,000	
京成電鉄	800	3,850.00	3,080,000	
富士急行	200	3,745.00	749,000	
東日本旅客鉄道	2,000	9,533.00	19,066,000	
西日本旅客鉄道	1,000	8,907.00	8,907,000	
東海旅客鉄道	900	21,605.00	19,444,500	
西武ホールディングス	1,500	1,700.00	2,550,000	
鴻池運輸	200	1,539.00	307,800	

西日本鉄道	300	2,545.00	763,500	
ハマキョウレックス	100	3,325.00	332,500	
サカイ引越センター	100	6,100.00	610,000	
近鉄グループホールディングス	1,100	5,720.00	6,292,000	
阪急阪神ホールディングス	1,400	4,430.00	6,202,000	
南海電気鉄道	500	2,738.00	1,369,000	
京阪ホールディングス	500	4,900.00	2,450,000	
名古屋鉄道	900	3,205.00	2,884,500	
山陽電気鉄道	100	2,101.00	210,100	
日本通運	400	5,770.00	2,308,000	
ヤマトホールディングス	1,900	1,849.00	3,513,100	
山九	300	5,420.00	1,626,000	
日新	100	1,634.00	163,400	
丸運	100	325.00	32,500	
丸全昭和運輸	100	2,924.00	292,400	
センコーグループホールディングス	600	873.00	523,800	
ニッコンホールディングス	400	2,549.00	1,019,600	
福山通運	100	3,605.00	360,500	
セイノーホールディングス	800	1,404.00	1,123,200	
日立物流	200	3,130.00	626,000	
丸和運輸機関	100	2,201.00	220,100	
C & F ロジホールディングス	100	1,276.00	127,600	
日本郵船	900	1,745.00	1,570,500	
商船三井	700	2,562.00	1,793,400	
川崎汽船	300	1,425.00	427,500	
N S ユナイテッド海運	100	1,971.00	197,100	
明治海運	100	364.00	36,400	
飯野海運	500	360.00	180,000	
九州旅客鉄道	1,000	3,555.00	3,555,000	
S G ホールディングス	1,100	2,392.00	2,631,200	
日本航空	1,900	3,037.00	5,770,300	
A N A ホールディングス	2,000	3,375.00	6,750,000	
国際紙パルプ商事	300	277.00	83,100	
総合メディカルホールディングス	100	2,005.00	200,500	
ブックオフグループホールディングス	100	962.00	96,200	
三菱倉庫	300	2,715.00	814,500	
三井倉庫ホールディングス	100	1,794.00	179,400	
住友倉庫	400	1,442.00	576,800	
澁澤倉庫	100	2,097.00	209,700	
ヤマタネ	100	1,512.00	151,200	
東陽倉庫	200	316.00	63,200	
乾汽船	100	1,131.00	113,100	
日本トランスシティ	200	475.00	95,000	
中央倉庫	100	1,114.00	111,400	
安田倉庫	100	1,104.00	110,400	
宇徳	100	541.00	54,100	
上組	600	2,355.00	1,413,000	
近鉄エクスプレス	200	1,746.00	349,200	
東海運	100	280.00	28,000	
エーアイティー	100	986.00	98,600	

東京放送ホールディングス	700	1,882.00	1,317,400
日本テレビホールディングス	900	1,488.00	1,339,200
朝日放送グループホールディングス	100	742.00	74,200
テレビ朝日ホールディングス	300	2,091.00	627,300
スカパーJ S A Tホールディングス	700	463.00	324,100
テレビ東京ホールディングス	100	2,336.00	233,600
ビジョン	100	1,454.00	145,400
ワイヤレスゲート	100	756.00	75,600
コネクシオ	100	1,579.00	157,900
日本通信	900	240.00	216,000
日本電信電話	14,900	2,786.50	41,518,850
K D D I	8,300	3,300.00	27,390,000
ソフトバンク	10,100	1,500.00	15,150,000
光通信	100	27,020.00	2,702,000
N T T ドコモ	8,200	3,084.00	25,288,800
エムティーアイ	100	682.00	68,200
G M O インターネット	400	2,100.00	840,000
K A D O K A W A	300	1,819.00	545,700
ゼンリン	200	1,475.00	295,000
昭文社	100	370.00	37,000
インプレスホールディングス	100	167.00	16,700
東京電力ホールディングス	9,000	449.00	4,041,000
中部電力	3,500	1,520.00	5,320,000
関西電力	4,300	1,255.50	5,398,650
中国電力	1,600	1,464.00	2,342,400
北陸電力	1,000	892.00	892,000
東北電力	2,800	1,036.00	2,900,800
四国電力	1,000	940.00	940,000
九州電力	2,300	905.00	2,081,500
北海道電力	1,100	498.00	547,800
沖縄電力	200	2,045.00	409,000
電源開発	900	2,479.00	2,231,100
エフオン	100	760.00	76,000
イーレックス	200	1,679.00	335,800
レノバ	200	1,321.00	264,200
東京瓦斯	2,200	2,431.50	5,349,300
大阪瓦斯	2,200	1,873.00	4,120,600
東邦瓦斯	600	4,235.00	2,541,000
北海道瓦斯	100	1,631.00	163,100
広島ガス	200	353.00	70,600
西部瓦斯	100	2,349.00	234,900
静岡ガス	300	886.00	265,800
メタウォーター	100	4,145.00	414,500
アイネット	100	1,461.00	146,100
松竹	100	14,620.00	1,462,000
東宝	700	4,005.00	2,803,500
エイチ・アイ・エス	200	2,504.00	500,800
エヌ・ティ・ティ・データ	3,000	1,549.00	4,647,000
共立メンテナンス	200	4,375.00	875,000
イチネンホールディングス	100	1,490.00	149,000

建設技術研究所	100	2,419.00	241,900	
スペース	100	1,214.00	121,400	
アインホールディングス	100	6,580.00	658,000	
東京都競馬	100	3,165.00	316,500	
カナモト	200	2,668.00	533,600	
東京ドーム	400	1,017.00	406,800	
D T S	200	2,548.00	509,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	500	5,410.00	2,705,000	
シーイーシー	100	2,046.00	204,600	
カプコン	500	3,120.00	1,560,000	
西尾レントオール	100	2,887.00	288,700	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	700	31.00	21,700	
日本空港ビルデング	400	5,190.00	2,076,000	
トランス・コスモス	100	2,823.00	282,300	
乃村工藝社	500	1,246.00	623,000	
ジャステック	100	1,065.00	106,500	
S C S K	300	5,670.00	1,701,000	
K N T - C Tホールディングス	100	1,284.00	128,400	
日本管財	100	1,935.00	193,500	
トーカイ	100	2,700.00	270,000	
セコム	1,100	9,610.00	10,571,000	
セントラル警備保障	100	5,990.00	599,000	
アイネス	100	1,608.00	160,800	
丹青社	200	1,225.00	245,000	
メイテック	100	6,260.00	626,000	
T K C	100	5,460.00	546,000	
富士ソフト	100	4,405.00	440,500	
応用地質	100	1,362.00	136,200	
船井総研ホールディングス	200	2,804.00	560,800	
N S D	400	1,782.00	712,800	
オオバ	100	806.00	80,600	
コナミホールディングス	400	4,130.00	1,652,000	
ベネッセホールディングス	400	3,025.00	1,210,000	
イオンディライト	100	3,845.00	384,500	
ナック	100	1,140.00	114,000	
ニチイ学館	200	1,494.00	298,800	
ダイセキ	200	2,992.00	598,400	
日鉄物産	100	4,880.00	488,000	
トラスコ中山	200	2,510.00	502,000	
ヤマダ電機	3,400	548.00	1,863,200	
オートバックスセブン	400	1,586.00	634,400	
モリト	100	798.00	79,800	
アークランドサカモト	200	1,209.00	241,800	
ニトリホールディングス	500	16,970.00	8,485,000	
グルメ杵屋	100	1,200.00	120,000	
愛眼	100	255.00	25,500	
ケーユーホールディングス	100	891.00	89,100	
吉野家ホールディングス	400	2,450.00	980,000	



加藤産業	200	3,410.00	682,000	
イノテック	100	1,099.00	109,900	
イエローハット	200	1,706.00	341,200	
松屋フーズホールディングス	100	4,755.00	475,500	
JBCホールディングス	100	1,893.00	189,300	
JKホールディングス	100	725.00	72,500	
サガミホールディングス	100	1,372.00	137,200	
日伝	100	2,058.00	205,800	
関西スーパーマーケット	100	1,015.00	101,500	
ミロク情報サービス	100	3,005.00	300,500	
北沢産業	100	268.00	26,800	
杉本商事	100	1,950.00	195,000	
因幡電機産業	300	2,696.00	808,800	
王将フードサービス	100	6,350.00	635,000	
ブレナス	100	1,978.00	197,800	
ミニストップ	100	1,534.00	153,400	
アークス	200	1,937.00	387,400	
パローホールディングス	200	1,901.00	380,200	
ミスミグループ本社	1,400	2,789.00	3,904,600	
アルテック	100	258.00	25,800	
ベルク	100	5,970.00	597,000	
大 庄	100	1,644.00	164,400	
ファーストリテイリング	100	57,600.00	5,760,000	
ソフトバンクグループ	8,800	4,502.00	39,617,600	
スズケン	500	4,200.00	2,100,000	
サンドラッグ	400	3,690.00	1,476,000	
サックスパー ホールディングス	100	837.00	83,700	
ジェコス	100	1,059.00	105,900	
グローセル	100	445.00	44,500	
ペルーナ	200	618.00	123,600	
合計	1,333,100		2,655,278,320	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

令和2年2月28日現在

資産総額	38,045,511円
負債総額	42,735円
純資産総額( - )	38,002,776円
発行済数量	42,521,187口
1口当たり純資産額( / )	0.8937円

(参考)

太陽財形公社債 マザーファンド

令和2年2月28日現在

資産総額	72,723,308円
負債総額	0円
純資産総額( - )	72,723,308円
発行済数量	63,175,152口
1口当たり純資産額( / )	1.151円

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

令和2年2月28日現在

資産総額	2,394,105,334円
負債総額	13,388,550円
純資産総額( - )	2,380,716,784円
発行済数量	1,166,386,536口
1口当たり純資産額( / )	2.0411円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

### (2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

### (5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6) 受益権の再分割

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

### (7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第二部【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(2020年2月28日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構(2020年2月28日現在)

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年2月28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	1,278,461,917,901
追加型株式投資信託	859	13,545,054,116,096
単位型公社債投資信託	38	103,552,799,629
単位型株式投資信託	180	1,323,787,336,372
合計	1,103	16,250,856,169,998

### 3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。  
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、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、第35期中間会計期間（自2019年4月1日至2019年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間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		
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		
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		
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	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）

「『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。

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。

## 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あります。

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第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 其他有価証券	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 其他有価証券	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す。

負 債

(1) 未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第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. その他有価証券

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	第34期
	(2018年3月31日現在)	(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IA種類株式15,510株を交付しました。

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

## (2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

- a. 発生したのれん  
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。

## (1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

	第35期中間会計期間末 (2019年9月30日現在)	
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		37,156,171
金銭の信託		18,742,684
有価証券		997
未収委託者報酬		11,945,046
未収運用受託報酬		3,120,602
未収投資助言報酬		332,118
未収収益		58,808
前払費用		781,218
その他		2,233,840
	流動資産計	74,371,488
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	1,051,855
器具備品	1	311,144
無形固定資産		
ソフトウェア		3,323,996
ソフトウェア仮勘定		213,219
電話加入権		3,931
電信電話専用施設利用権		6
投資その他の資産		
投資有価証券		958,309
関係会社株式		4,499,196
長期差入保証金		1,307,197
繰延税金資産		2,036,732
その他		95,551
	固定資産計	13,801,139
	資産合計	88,172,628

(単位:千円)

	第35期中間会計期間末 (2019年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	5,192,317
未払金	5,043,713
未払収益分配金	1,047
未払償還金	48,441
未払手数料	4,707,236
その他未払金	286,987
未払費用	6,512,990
未払法人税等	3,526,134
未払消費税等	516,610
前受収益	40,684
賞与引当金	1,281,617
役員賞与引当金	34,112
流動負債計	22,148,179
固定負債	
退職給付引当金	1,993,829
時効後支払損引当金	169,869
固定負債計	2,163,698
負債合計	24,311,878
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	19,552,957
資本準備金	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479
利益剰余金	41,866,681
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	41,743,387
別途積立金	31,680,000
繰越利益剰余金	10,063,387
株主資本計	63,419,638
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	441,111
評価・換算差額等計	441,111
純資産合計	63,860,750
負債・純資産合計	88,172,628

## (2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	42,425,693	
運用受託報酬	7,240,514	
投資助言報酬	601,626	
その他営業収益	57,443	
	営業収益計	50,325,278
営業費用		
支払手数料	17,730,384	
広告宣伝費	125,471	
公告費	125	
調査費	12,182,415	
調査費	4,742,559	
委託調査費	7,439,855	
委託計算費	421,559	
営業雑経費	538,430	
通信費	22,517	
印刷費	410,573	
協会費	34,596	
諸会費	16,711	
支払販売手数料	54,031	
	営業費用計	30,998,386
一般管理費		
給料	4,829,571	
役員報酬	87,372	
給料・手当	4,615,868	
賞与	126,330	
交際費	17,168	
寄付金	6,499	
旅費交通費	165,035	
租税公課	291,415	
不動産賃借料	749,406	
退職給付費用	254,598	
固定資産減価償却費	1 345,421	
福利厚生費	21,538	
修繕費	1,263	
賞与引当金繰入額	1,281,617	
役員賞与引当金繰入額	34,112	
機器リース料	138	
事務委託費	1,700,671	
事務用消耗品費	50,852	
器具備品費	490	
諸経費	100,495	
	一般管理費計	9,850,295
営業利益		9,476,595

(単位:千円)

	第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	1,075	
受取配当金	11,185	
時効成立分配金・償還金	608	
時効後支払損引当金戻入額	7,743	
投資信託償還益	2,466	
受取負担金	287,268	
雑収入	2,670	
	営業外収益計	313,018
営業外費用		
為替差損	9,702	
投資信託償還損	1	
金銭の信託運用損	18,907	
雑損失	104	
	営業外費用計	28,716
経常利益		9,760,897
特別利益		
投資有価証券売却益	634,060	
	特別利益計	634,060
特別損失		
固定資産除却損	7,444	
	特別損失計	7,444
税引前中間純利益		10,387,514
法人税、住民税及び事業税		3,299,452
法人税等調整額		109,246
法人税等合計		3,190,205
中間純利益		7,197,308

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

	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	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	14,146,079
当中間期変動額							
剰余金の配当							11,280,000
中間純利益							7,197,308
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	4,082,691
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	10,063,387

	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	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,280,000	11,280,000			11,280,000
中間純利益	7,197,308	7,197,308			7,197,308
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)			405,643	405,643	405,643
当中間期変動額 合計	4,082,691	4,082,691	405,643	405,643	4,488,335
当中間期末残高	41,866,681	63,419,638	441,111	441,111	63,860,750



## 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：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 器具備品 … 2～20年</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）に基づく定額法によっております。</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、中間決算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中間会計期間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中間会計期間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当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（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。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の日翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

項目	第35期中間会計期間末 （2019年9月30日現在）	
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	274,959千円
	器具備品	965,214千円

## （中間損益計算書関係）

項目	第35期中間会計期間 （自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）	
1.減価償却実施額	有形固定資産	97,348千円
	無形固定資産	248,073千円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第35期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

## 1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数（株）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 株式数（株）
普通株式	24,490	-	-	24,490
A種種類株式	15,510	-	-	15,510
合計	40,000	-	-	40,000

## 2.配当に関する事項

## （1）配当金支払額

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

（2）基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの  
該当事項はありません。

## (金融商品関係)

第35期中間会計期間末(2019年9月30日現在)

## 金融商品の時価等に関する事項

2019年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	37,156,171	37,156,171	-
(2) 金銭の信託	18,742,684	18,742,684	-
(3) 未収委託者報酬	11,945,046	11,945,046	-
(4) 未収運用受託報酬	3,120,602	3,120,602	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	699,937	699,937	-
資産計	71,664,441	71,664,441	-
(1) 未払手数料	4,707,236	4,707,236	-
負債計	4,707,236	4,707,236	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

## (5) 有価証券及び投資有価証券

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

## 負債

## (1) 未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	259,369
関係会社株式	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 その他有価証券」には含めておりません。

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

## (有価証券関係)

第35期中間会計期間末

(2019年9月30日現在)

## 1. 子会社株式

関係会社株式(中間貸借対照表計上額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. その他有価証券

区分	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	691,010	58,146	632,863
投資信託	5,937	3,000	2,937
小計	696,947	61,146	635,800
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	2,990	3,000	9
小計	2,990	3,000	9
合計	699,937	64,146	635,791

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額259,369千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## （企業結合等関係）

当社（以下「AMOne」という）は、2016年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社（以下「DIAM」という）、みずほ投信投資顧問株式会社（以下「MHAM」という）、みずほ信託銀行株式会社（以下「TB」という）及び新光投信株式会社（以下「新光投信」という）（以下総称して「統合4社」という）間の「統合契約書」に基づき、2016年10月1日付で統合いたしました。

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(\*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

「3. 企業結合の方法」の吸収合併において、DIAMは、MHAMの親会社であるMHFGに対して、その所有するMHAMの普通株式103万8,408株につき、DIAMの普通株式490株及び議決権を有しないIA種種類株式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) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2019年4月1日から2019年9月30日まで

## (2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

## (3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

b. 発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

## (4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451,657千円

うち現金・預金 11,605,537千円

うち金銭の信託 11,792,364千円

b. 負債の額 負債合計 9,256,209千円

うち未払手数料及び未払費用 4,539,592千円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030,000千円

## b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030,000千円

## c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	99,557,407千円
資産合計	99,557,407千円
流動負債	- 千円
固定負債	9,515,195千円
負債合計	9,515,195千円
純資産	90,042,211千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額64,791,112千円及び顧客関連資産の金額37,384,808千円が含まれております。

## (2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,477,219千円
経常利益	4,477,219千円
税引前中間純利益	4,551,164千円
中間純利益	3,763,741千円
1株当たり中間純利益	94,093円53銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,574,777千円が含まれております。

## (資産除去債務関係)

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

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

## (セグメント情報等)

第35期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

## 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

## (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。

## (1株当たり情報)

第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,596,518円75銭
1株当たり中間純利益金額	179,932円71銭

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



1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
中間純利益金額	7,197,308千円
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中間純利益金額	7,197,308千円
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
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の実取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 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

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
みずほ証券株式会社	125,167	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2019年3月末日現在

### 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および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益権の取得申込者に対する目論見書の交付
- (7) 受益者に対する運用報告書の交付
- (8) 所得税および地方税の源泉徴収
- (9) その他上記業務に付随する一切の業務

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

**第3【参考情報】**

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2019年 4月26日	有価証券届出書
2019年 4月26日	有価証券報告書
2019年11月 1日	有価証券届出書
2019年11月 1日	半期報告書

## 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

令和2年3月13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 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている太陽財形株投 太陽一般財形 30の平成31年2月5日から令和2年2月3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、太陽財形株投 太陽一般財形 30の令和2年2月3日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

(注1) 上記は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。

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年11月28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	山野 浩 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	長谷川 敬 印

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2019年4月1日から2020年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。