

【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】	2021年4月30日提出
【計算期間】	第27期(自 2020年2月4日至 2021年2月1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 追加型	国内 海外 内外	株式 債券 不動産投信 その他資産 () 資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類の定義

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の投資信託財産とともに運用されるファンドをいう。
国内	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
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	年1回	グローバル	
一般			
大型株	年2回	日本	
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	ファミリーファンド
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	
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））		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。

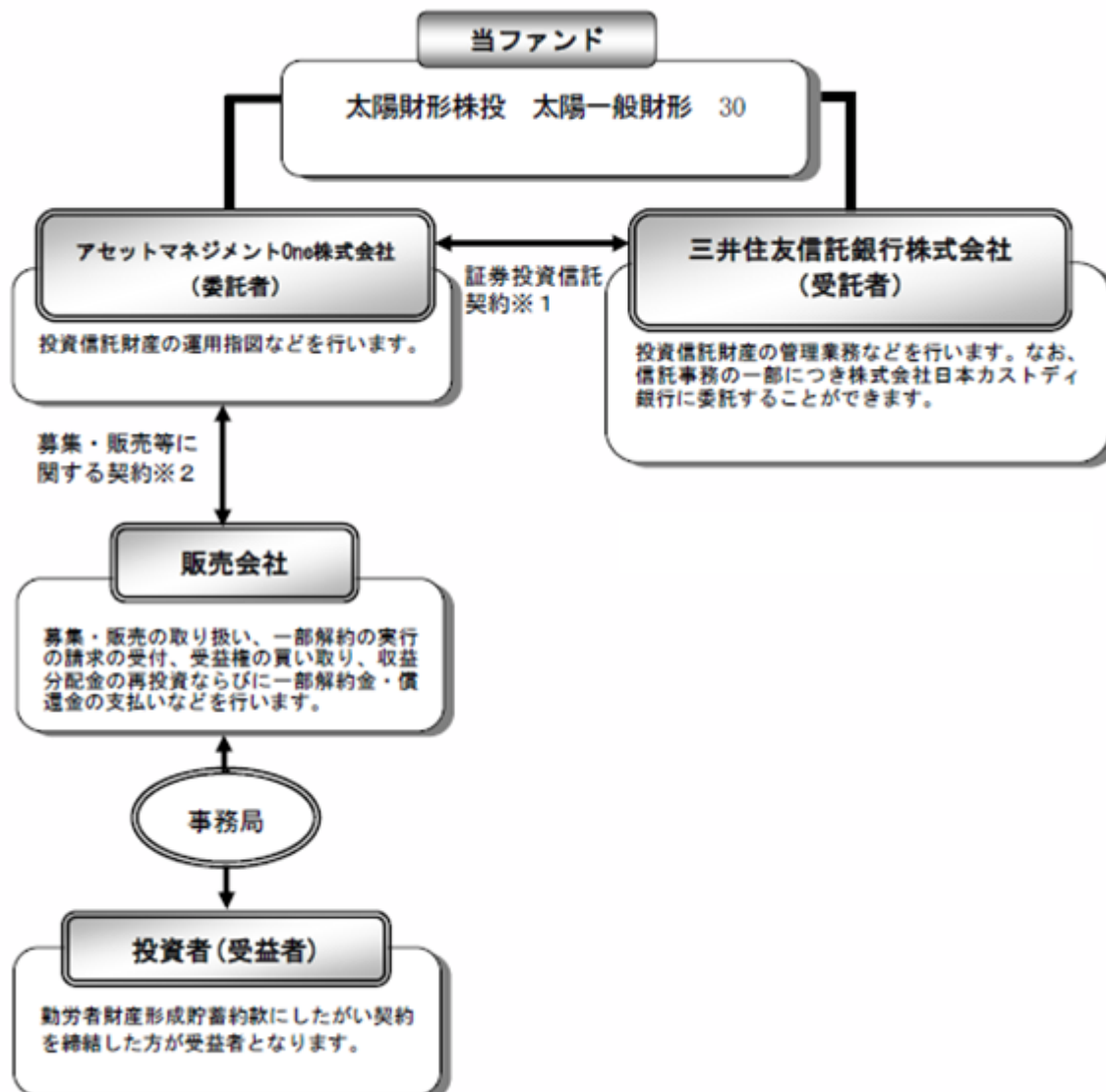
※運用状況により分配金額は変動します。また、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

(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

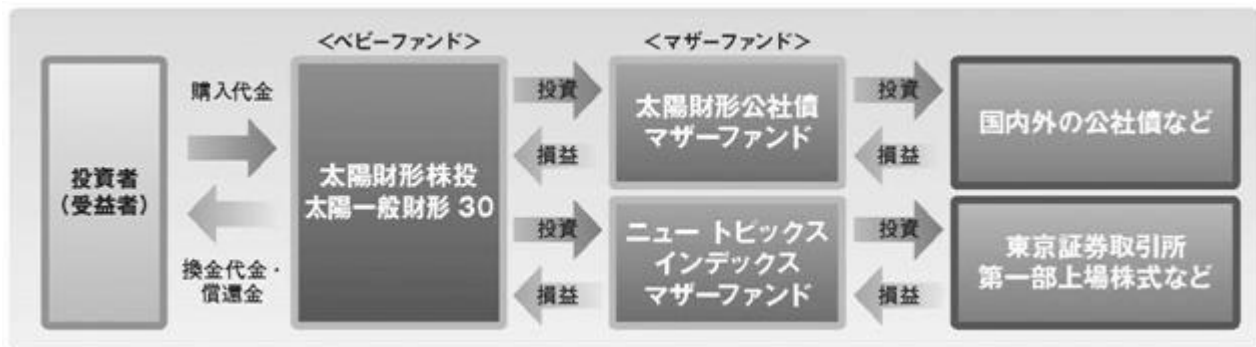
委託者と受託者との間において「証券投資信託契約（投資信託約款）」を締結しており、委託者および受託者の業務、受益者の権利、受益権、投資信託財産の運用・評価・管理、収益の分配、信託の期間・償還等を規定しています。

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（2021年2月26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

（2021年2月26日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

a. 基本方針

当ファンドは、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

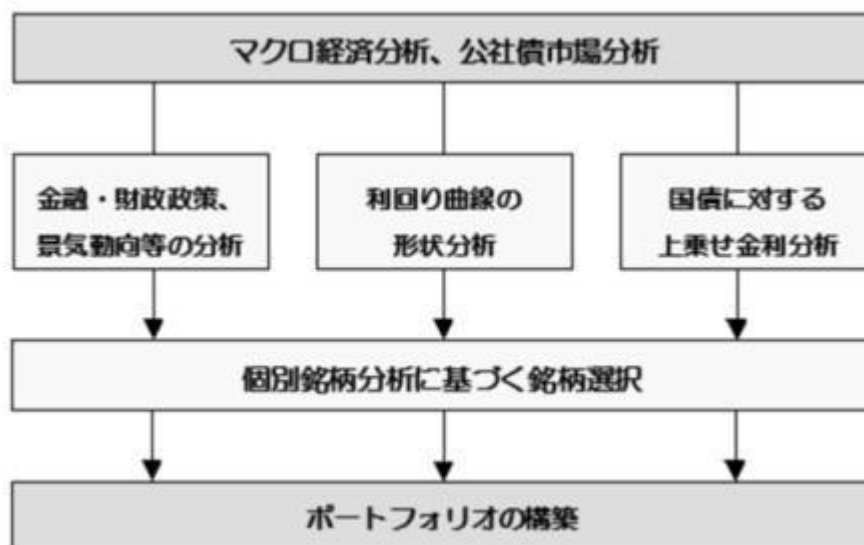
同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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2021年2月26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。

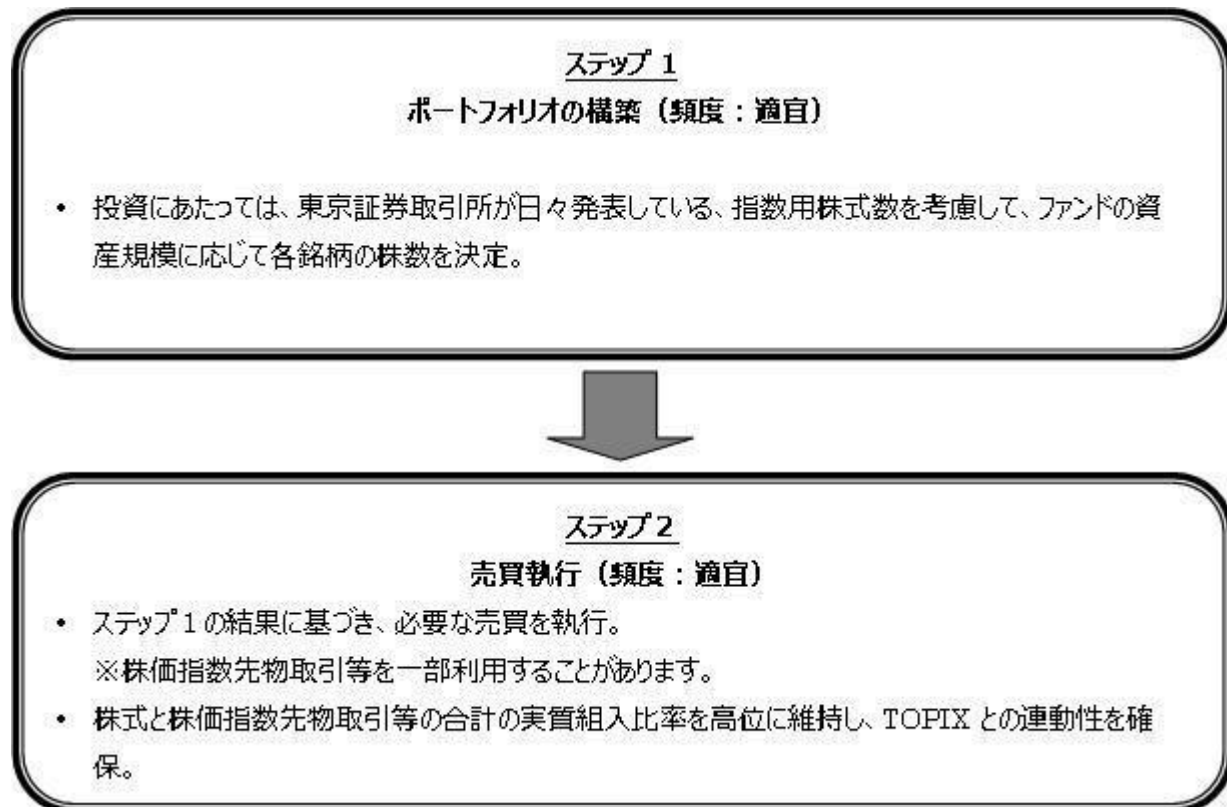
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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2021年2月26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。

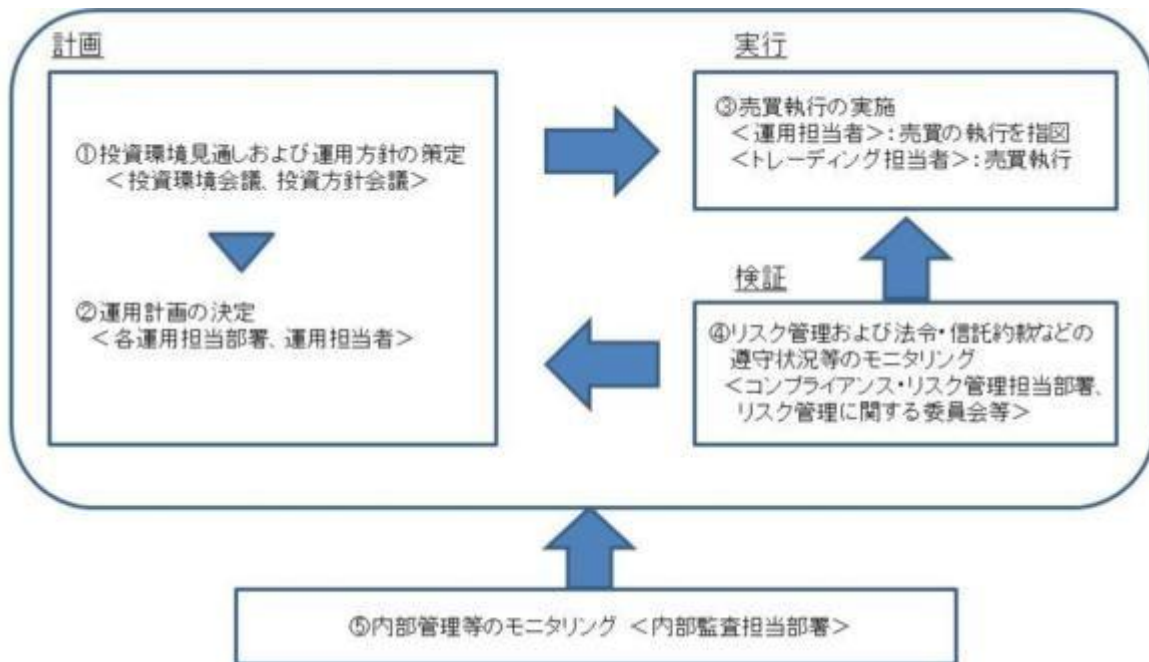
2. 先物取引の買い建ておよびプット・オプションの売り付けの指図は、建玉の合計額が、投資信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに余裕金の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建てで、投資信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に投資信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該余裕金等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に投資信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にか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



投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

定期的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2021年2月26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みます。）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。

l. 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ことがあります。また、投資信託財産の減少の状況によっては、委託者が目的とする運用が困難と判断した場合、安定運用に切り替えることがあります。
- (ホ) 投資した資産の流動性が低下し、当該資産の売却・換金が困難になる場合などがあります。その結果、投資者の換金請求に伴う資金の手当てに支障が生じる場合などには、換金のお申し込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた換金のお申し込みを取り消す場合があります。
- (ヘ) 短期間に相当金額の解約申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。

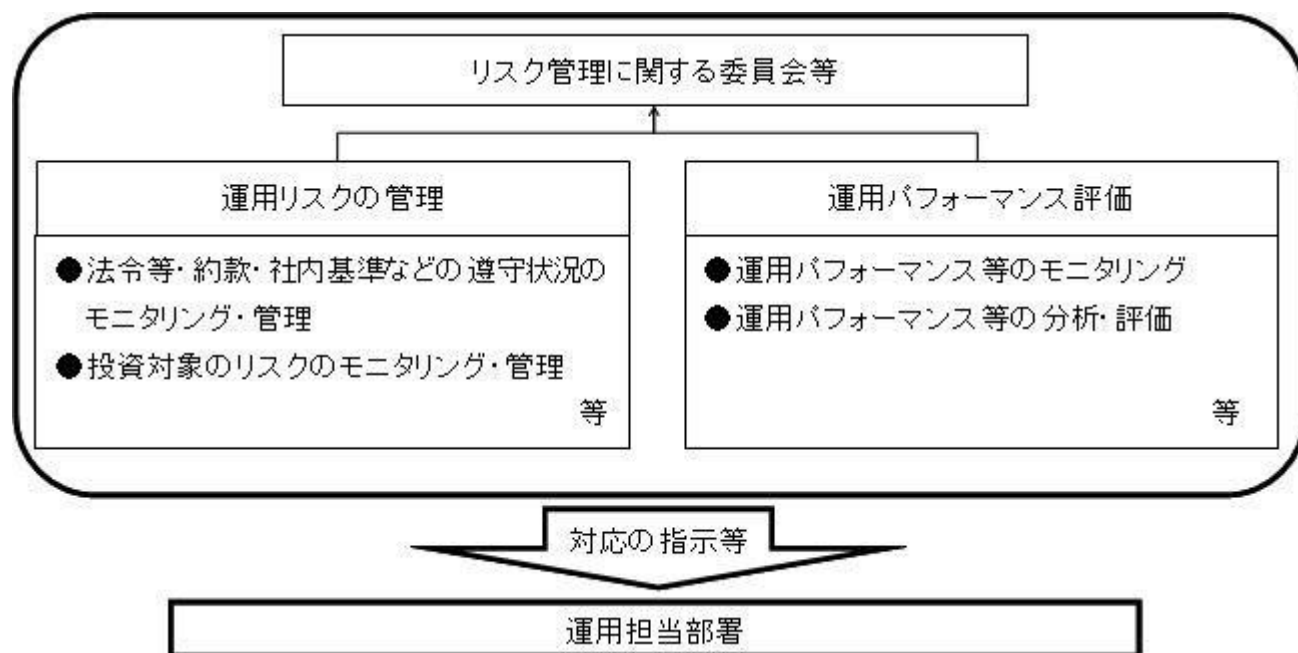
投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払い戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

(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。

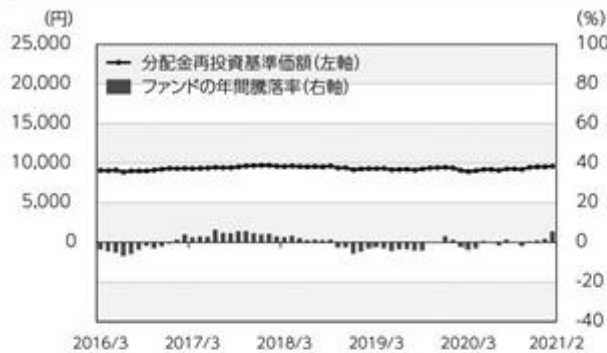
- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



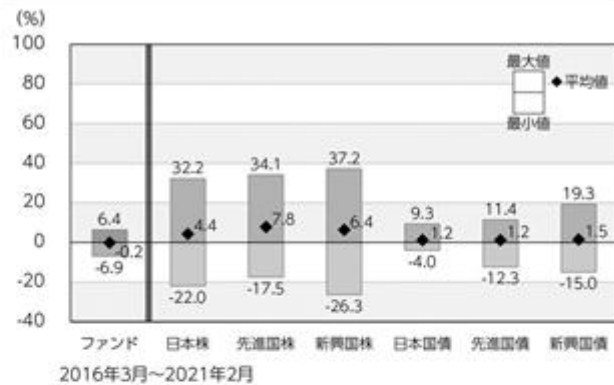
リスク管理体制は2021年2月26日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (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、株式会社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。

2021年4月30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、2021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】

2021年2月26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	40,522,516	97.35
内 日本	40,522,516	97.35
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,103,775	2.65
純資産総額	41,626,291	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

2021年2月26日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
地方債証券	61,236,028	85.50
内 日本	61,236,028	85.50
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,388,170	14.50
純資産総額	71,624,198	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

2021年2月26日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	2,406,724,540	98.27
内 日本	2,406,724,540	98.27
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	42,447,166	1.73
純資産総額	2,449,171,706	100.00

その他資産の投資状況

2021年2月26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)	37,510,000	1.53
内 日本	37,510,000	1.53

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

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

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

2021年2月26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	25,289,365	1.1509 29,108,058	1.1510 29,108,059	- -	69.93

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	4,427,984	2.5280 11,194,386	2.5778 11,414,457	- -	27.42
---	------------------------------------	-------------------	-----------	----------------------	----------------------	--------	-------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年2月26日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.35
合計	97.35

(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

2021年2月26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	100.21 22,046,428	100.21 22,046,428	1.4 2021/4/23	30.78
2	474回 名古屋市公募公 債 10年 日本	地方債 証券	15,000,000	100.07 15,011,560	100.07 15,011,560	1.31 2021/3/19	20.96
3	101回 共同発行市場公 募地方債 日本	地方債 証券	14,000,000	100.50 14,070,840	100.50 14,070,840	1.05 2021/8/25	19.65
4	23年度9回 福岡市公募 公債 10年 日本	地方債 証券	10,000,000	101.15 10,115,000	101.07 10,107,200	1.01 2022/3/28	14.11

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年2月26日現在

種類	投資比率(%)
地方債証券	85.50
合計	85.50

(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

2021年2月26日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
----	-----------------	----------	----	---------------------	---------------------	------------------	-----------------

1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	9,600	7,863.00 75,484,800	7,873.00 75,580,800	- -	3.09
2	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	7,400	8,565.22 63,382,678	9,895.00 73,223,000	- -	2.99
3	ソニー 日本	株式 電気機器	5,900	10,738.10 63,354,790	11,120.00 65,608,000	- -	2.68
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	900	57,700.00 51,930,000	50,560.00 45,504,000	- -	1.86
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	64,100	500.76 32,099,058	558.00 35,767,800	- -	1.46
6	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	6,500	4,568.37 29,694,463	5,281.00 34,326,500	- -	1.40
7	任天堂 日本	株式 その他製品	500	65,810.00 32,905,000	64,750.00 32,375,000	- -	1.32
8	日本電産 日本	株式 電気機器	2,300	14,050.00 32,315,000	13,520.00 31,096,000	- -	1.27
9	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	10,900	2,765.00 30,138,500	2,758.00 30,062,200	- -	1.23
10	信越化学工業 日本	株式 化学	1,700	19,061.94 32,405,300	17,350.00 29,495,000	- -	1.20
11	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	7,900	3,690.36 29,153,864	3,582.00 28,297,800	- -	1.16
12	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	600	42,250.00 25,350,000	43,550.00 26,130,000	- -	1.07
13	村田製作所 日本	株式 電気機器	2,800	10,255.00 28,714,000	9,081.00 25,426,800	- -	1.04
14	ダイキン工業 日本	株式 機械	1,200	23,795.00 28,554,000	20,720.00 24,864,000	- -	1.02
15	第一三共 日本	株式 医薬品	8,200	3,642.63 29,869,637	3,010.00 24,682,000	- -	1.01
16	KDDI 日本	株式 情報・通信業	7,500	3,234.00 24,255,000	3,290.00 24,675,000	- -	1.01
17	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	6,500	3,540.11 23,010,724	3,742.00 24,323,000	- -	0.99
18	HOYA 日本	株式 精密機器	1,900	13,920.00 26,448,000	12,100.00 22,990,000	- -	0.94
19	日立製作所 日本	株式 電気機器	4,600	4,341.19 19,969,500	4,876.00 22,429,600	- -	0.92
20	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	7,500	2,917.34 21,880,066	2,911.50 21,836,250	- -	0.89

21	ファナック 日本	株式 電気機器	800	27,675.00 22,140,000	26,340.00 21,072,000	- -	0.86
22	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	6,500	3,136.06 20,384,394	3,168.00 20,592,000	- -	0.84
23	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	12,700	1,436.91 18,248,868	1,559.00 19,799,300	- -	0.81
24	S M C 日本	株式 機械	300	69,180.00 20,754,000	62,900.00 18,870,000	- -	0.77
25	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	1,000	16,470.00 16,470,000	17,840.00 17,840,000	- -	0.73
26	三井物産 日本	株式 卸売業	7,600	2,000.00 15,200,000	2,263.50 17,202,600	- -	0.70
27	三菱商事 日本	株式 卸売業	5,700	2,691.00 15,338,700	3,003.00 17,117,100	- -	0.70
28	花王 日本	株式 化学	2,300	7,873.00 18,107,900	7,144.00 16,431,200	- -	0.67
29	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	3,100	5,643.00 17,493,300	5,253.00 16,284,300	- -	0.66
30	資生堂 日本	株式 化学	1,900	6,688.00 12,707,200	7,913.00 15,034,700	- -	0.61

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年2月26日現在

種類	投資比率（％）
株式	98.27
合計	98.27

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2021年2月26日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
電気機器	国内	17.44
情報・通信業		9.36
化学		7.29
輸送用機器		6.97
サービス業		5.59
医薬品		5.44
機械		5.41
銀行業		5.00
卸売業		4.54
小売業		4.53
陸運業		3.56
食料品		3.30
精密機器		2.52
その他製品		2.37
建設業		2.20
不動産業		1.96
保険業		1.89

電気・ガス業	1.29
その他金融業	1.04
証券、商品先物取引業	0.79
非鉄金属	0.78
ガラス・土石製品	0.77
鉄鋼	0.69
金属製品	0.61
ゴム製品	0.59
繊維製品	0.49
空運業	0.48
石油・石炭製品	0.45
パルプ・紙	0.26
海運業	0.20
鉱業	0.18
倉庫・運輸関連業	0.16
水産・農林業	0.09
合計	98.27

(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

2021年2月26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 0303月	買建	2	37,510,000	37,510,000	1.53

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(2021年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18計算期間末 (2012年 2月 1日)	35	35	0.7968	0.7973
第19計算期間末 (2013年 2月 4日)	39	40	0.8391	0.8396
第20計算期間末 (2014年 2月 3日)	44	44	0.8791	0.8796
第21計算期間末 (2015年 2月 2日)	38	38	0.9041	0.9046
第22計算期間末 (2016年 2月 1日)	39	39	0.9106	0.9111
第23計算期間末 (2017年 2月 1日)	42	42	0.9178	0.9183
第24計算期間末 (2018年 2月 1日)	41	41	0.9599	0.9604
第25計算期間末 (2019年 2月 4日)	38	38	0.9122	0.9127
第26計算期間末 (2020年2月3日)	39	39	0.9185	0.9190
第27計算期間末 (2021年2月1日)	41	41	0.9380	0.9385
2020年2月末日	38	-	0.8937	-
3月末日	36	-	0.8790	-
4月末日	37	-	0.8886	-
5月末日	37	-	0.9043	-
6月末日	38	-	0.9026	-
7月末日	38	-	0.8915	-
8月末日	39	-	0.9094	-
9月末日	39	-	0.9114	-
10月末日	38	-	0.9029	-
11月末日	40	-	0.9293	-
12月末日	41	-	0.9359	-
2021年1月末日	41	-	0.9357	-
2月末日	41	-	0.9420	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
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

第27計算期間	0.0005
---------	--------

【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第27計算期間	2.2

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

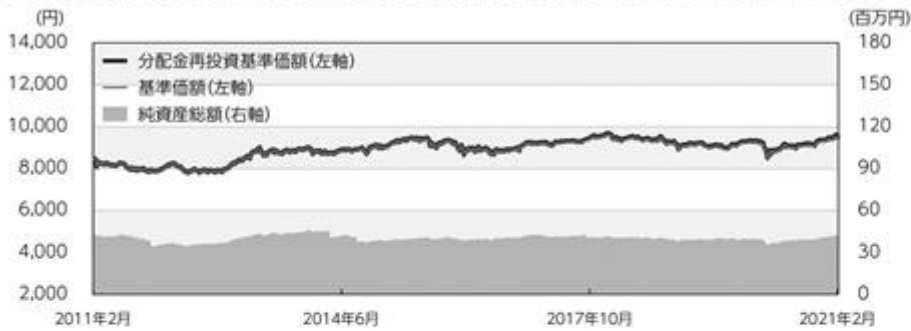
	設定口数	解約口数
第18計算期間	7,166,380	12,235,967
第19計算期間	5,723,056	2,956,349
第20計算期間	5,522,083	2,249,182
第21計算期間	4,886,377	13,261,929
第22計算期間	4,402,640	3,089,454
第23計算期間	4,790,878	2,244,793
第24計算期間	4,254,344	7,461,417
第25計算期間	3,836,447	4,462,300
第26計算期間	3,941,211	3,700,314
第27計算期間	3,787,524	2,668,773

(注) 本邦外における設定及び解約はありません。

参考情報

データの基準日:2021年2月26日

基準価額・純資産の推移（2011年2月28日～2021年2月26日）



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

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

分配の推移(税引前)

2017年 2月	5円
2018年 2月	5円
2019年 2月	5円
2020年 2月	5円
2021年 2月	5円
直近10年間累計	50円

※分配金は1万口当たりです。

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	69.93
2	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	27.42

■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	85.50
内 日本	85.50
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	14.50
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 福井県公募公債	地方債証券	日本	1.4	2021/4/23	30.78
2	474回 名古屋市公募公債 10年	地方債証券	日本	1.31	2021/3/19	20.96
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	19.65
4	23年度9回 福岡市公募公債 10年	地方債証券	日本	1.01	2022/3/28	14.11

○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。

■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割合比率です。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	98.27
内 日本	98.27
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.73
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)	1.53

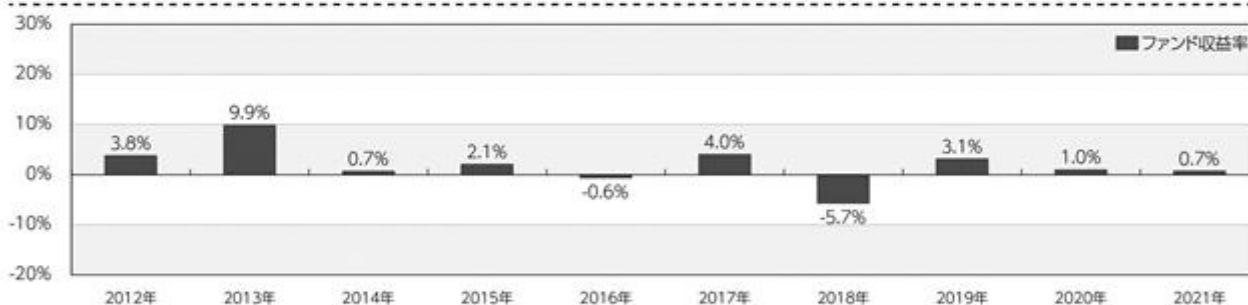
株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	電気機器	17.44
2	情報・通信業	9.36
3	化学	7.29
4	輸送用機器	6.97
5	サービス業	5.59

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	3.09
2	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.99
3	ソニー	株式	日本	電気機器	2.68
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.86
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.46
6	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.40
7	任天堂	株式	日本	その他製品	1.32
8	日本電産	株式	日本	電気機器	1.27
9	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.23
10	信越化学工業	株式	日本	化学	1.20

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2021年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※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。

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

投資対象	評価方法
マザーファンド受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における取引所の最終相場
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株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

(ロ) 上記(イ)における株式会社日本カストディ銀行に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行うものとします。

h. 信託業務の委託等

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

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

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

(ハ) 上記(イ)および(ロ)にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務(裁量性のないものに限ります。)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27期計算期間(2020年2月4日から2021年2月1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26期 2020年2月3日現在	第27期 2021年2月1日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,701,867	1,941,310
親投資信託受益証券	36,965,574	39,612,444
流動資産合計	39,667,441	41,553,754
資産合計	39,667,441	41,553,754
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	21,409	21,968
未払受託者報酬	17,375	17,403
未払委託者報酬	298,068	298,775
その他未払費用	197	182
流動負債合計	337,049	338,328
負債合計	337,049	338,328
純資産の部		
元本等		
元本	42,818,661	43,937,412
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	3,488,269	2,721,986
(分配準備積立金)	2,136,600	1,984,259
元本等合計	39,330,392	41,215,426
純資産合計	39,330,392	41,215,426
負債純資産合計	39,667,441	41,553,754

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第26期 自 2019年2月5日 至 2020年2月3日	第27期 自 2020年2月4日 至 2021年2月1日
営業収益		
有価証券売買等損益	902,213	1,486,870
営業収益合計	902,213	1,486,870
営業費用		
支払利息	1,407	425
受託者報酬	34,259	33,850
委託者報酬	587,153	581,190
その他費用	437	364
営業費用合計	623,256	615,829
営業利益又は営業損失()	278,957	871,041
経常利益又は経常損失()	278,957	871,041
当期純利益又は当期純損失()	278,957	871,041
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()	655	35,194
期首剰余金又は期首欠損金()	3,739,071	3,488,269
剰余金増加額又は欠損金減少額	324,961	217,994
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	324,961	217,994
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	332,362	335,978
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	332,362	335,978
分配金	21,409	21,968
期末剰余金又は期末欠損金()	3,488,269	2,721,986

(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27期	
	自 2020年2月4日	至 2021年2月1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、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2020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26期	第27期
	2020年2月3日現在	2021年2月1日現在
1. 期首元本額	42,577,764円	42,818,661円
期中追加設定元本額	3,941,211円	3,787,524円
期中一部解約元本額	3,700,314円	2,668,773円
2. 受益権の総数	42,818,661口	43,937,412口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,488,269円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,721,986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26期	第27期
	自 2019年2月5日 至 2020年2月3日	自 2020年2月4日 至 2021年2月1日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(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。	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(4,199,242円)及び分配準備積立金(2,006,227円)より分配対象収益は6,205,469円(1万口当たり1,412.34円)であり、うち21,968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26期	第27期
	自 2019年2月5日 至 2020年2月3日	自 2020年2月4日 至 2021年2月1日

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第26期 2020年2月3日現在	第27期 2021年2月1日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第26期 2020年2月3日現在	第27期 2021年2月1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	800,036	1,508,661
合計	800,036	1,508,661

（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26期 2020年2月3日現在	第27期 2021年2月1日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9185円 (9,185円)	0.9380円 (9,380円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2021年2月1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	24,689,886	28,418,058	
	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	4,427,984	11,194,386	
親投資信託受益証券	合計	29,117,870	39,612,444	
合計			39,612,444	

（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)

2021年2月1日現在

資産の部		
流動資産		
コール・ローン		8,192,518
地方債証券		61,287,703
未収利息		231,185
前払費用		23,520
流動資産合計		69,734,926
資産合計		69,734,926
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		60,577,802
剰余金		
剰余金又は欠損金()		9,157,124
元本等合計		69,734,926
純資産合計		69,734,926
負債純資産合計		69,734,926

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2020年2月4日 至 2021年2月1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	2021年2月1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	63,175,152円
同期中追加設定元本額	9,784,460円
同期中一部解約元本額	12,381,810円
元本の内訳	
ファンド名	
太陽財形株投 太陽一般財形 30	24,689,886円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	28,704,912円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	7,183,004円
計	60,577,802円
2. 受益権の総数	60,577,802口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年2月4日 至 2021年2月1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	2021年2月1日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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	2021年2月1日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
地方債証券		11,200
合計		11,200

(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(2020年2月2日から2021年2月1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)

2021年2月1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

2021年2月1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	14,080,640	
	474回 名古屋市公募公債 10年	15,000,000	15,024,935	
	23年度9回 福岡市公募公債 10年	10,000,000	10,115,000	
	22年度2回 福井県公募公債	22,000,000	22,067,128	

地方債証券 合計	61,000,000	61,287,703	
合計		61,287,703	

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)

2021年2月1日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	91,957,731
株式	2,380,284,570
派生商品評価勘定	3,848,350
未収配当金	3,290,005
流動資産合計	2,479,380,656
資産合計	2,479,380,656
負債の部	
流動負債	
前受金	2,350,000
未払解約金	73,000
流動負債合計	2,423,000
負債合計	2,423,000
純資産の部	
元本等	
元本	979,773,842
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,497,183,814
元本等合計	2,476,957,656
純資産合計	2,476,957,656
負債純資産合計	2,479,380,656

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年2月4日 至 2021年2月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年2月1日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,215,809,567円
同期中追加設定元本額	158,297,320円
同期中一部解約元本額	394,333,045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	206,332,311円
新光7資産バランスファンド	239,469,774円
ニュー トピックス インデックス(変額年金)	68,639,493円
世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	373,281,964円
新光ワールドバランスファンドVA(適格機関投資家私募)	17,489,718円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	28,817,719円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	10,860,860円
グローバル・ナビ	16,423,631円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	4,427,984円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	12,745,329円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	1,285,059円
計	979,773,842円
2. 受益権の総数	979,773,842口
3. 差入代用有価証券	
株式	163,038,050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 2020年2月4日 至 2021年2月1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	2021年2月1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 「(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)は短時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。また、デリバティブ取引に関する契約額は、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	2021年2月1日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)
株式	55,409,539
合計	55,409,539

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2021年2月1日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	87,850,000	-	91,700,000	3,850,000
合計	87,850,000	-	91,700,000	3,850,000

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2021年2月1日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5281円 (25,281円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年2月1日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
日本水産	1,200	443.00	531,600	
マルハニチロ	200	2,337.00	467,400	
雪国まいたけ	100	1,794.00	179,400	
サカタのタネ	200	3,645.00	729,000	
ホクト	100	2,156.00	215,600	
ショーボンドホールディングス	200	4,520.00	904,000	
ミライト・ホールディングス	500	1,707.00	853,500	
タマホーム	100	1,916.00	191,600	
日本アクア	100	585.00	58,500	
TATERU	200	170.00	34,000	
スペースバリューホールディングス	200	663.00	132,600	
住石ホールディングス	200	110.00	22,000	
三井松島ホールディングス	100	775.00	77,500	
国際石油開発帝石	4,800	601.00	2,884,800	
石油資源開発	200	2,003.00	400,600	
K&Oエナジーグループ	100	1,428.00	142,800	
安藤・間	800	738.00	590,400	
東急建設	400	524.00	209,600	

コムシスホールディングス	500	3,150.00	1,575,000	
ビーアールホールディングス	200	663.00	132,600	
高松コンストラクショングループ	100	2,057.00	205,700	
ヤマウラ	100	920.00	92,000	
大成建設	900	3,440.00	3,096,000	
大林組	3,000	887.00	2,661,000	
清水建設	2,800	737.00	2,063,600	
飛島建設	100	1,061.00	106,100	
長谷工コーポレーション	1,000	1,246.00	1,246,000	
松井建設	100	704.00	70,400	
鹿島建設	2,200	1,417.00	3,117,400	
不動テトラ	100	1,714.00	171,400	
鉄建建設	100	1,857.00	185,700	
西松建設	200	2,464.00	492,800	
三井住友建設	700	439.00	307,300	
大豊建設	100	3,725.00	372,500	
前田建設工業	800	877.00	701,600	
佐田建設	100	439.00	43,900	
ナカノフドー建設	100	397.00	39,700	
奥村組	200	2,648.00	529,600	
東鉄工業	100	2,661.00	266,100	
戸田建設	1,300	735.00	955,500	
熊谷組	100	2,642.00	264,200	
矢作建設工業	100	843.00	84,300	
ピーエス三菱	100	608.00	60,800	
日本ハウスホールディングス	200	324.00	64,800	
大東建託	300	10,740.00	3,222,000	
新日本建設	100	832.00	83,200	
N I P P O	200	2,606.00	521,200	
前田道路	200	1,773.00	354,600	
東亜建設工業	100	2,004.00	200,400	
日本国土開発	300	551.00	165,300	
若築建設	100	1,215.00	121,500	
東洋建設	300	510.00	153,000	
五洋建設	1,300	873.00	1,134,900	
世紀東急工業	100	806.00	80,600	
住友林業	700	2,121.00	1,484,700	
日本基礎技術	100	474.00	47,400	
巴コーポレーション	100	384.00	38,400	
大和ハウス工業	2,800	2,987.00	8,363,600	
ライト工業	200	1,726.00	345,200	
積水ハウス	3,300	2,050.00	6,765,000	
日特建設	100	761.00	76,100	
北陸電気工事	100	1,186.00	118,600	
ユアテック	200	831.00	166,200	
日本リーテック	100	2,247.00	224,700	
中電工	100	2,169.00	216,900	
関電工	500	890.00	445,000	
きんでん	700	1,715.00	1,200,500	
東京エネシス	100	941.00	94,100	

住友電設	100	2,529.00	252,900
日本電設工業	200	1,931.00	386,200
協和エクシオ	500	2,765.00	1,382,500
新日本空調	100	2,106.00	210,600
日本工営	100	2,702.00	270,200
九電工	200	3,315.00	663,000
三機工業	200	1,246.00	249,200
日揮ホールディングス	1,000	1,205.00	1,205,000
ヤマト	100	692.00	69,200
太平電業	100	2,471.00	247,100
高砂熱学工業	300	1,602.00	480,600
NEC ネットズエスアイ	300	1,950.00	585,000
明星工業	200	775.00	155,000
大気社	100	2,830.00	283,000
ダイダン	100	2,883.00	288,300
日比谷総合設備	100	1,860.00	186,000
ニッポン	300	1,620.00	486,000
日清製粉グループ本社	1,100	1,765.00	1,941,500
昭和産業	100	3,040.00	304,000
鳥越製粉	100	842.00	84,200
中部飼料	100	1,391.00	139,100
フィード・ワン	100	864.00	86,400
日本甜菜製糖	100	1,622.00	162,200
三井製糖	100	1,889.00	188,900
塩水港精糖	100	223.00	22,300
L I F U L L	300	410.00	123,000
ミクシィ	200	2,504.00	500,800
ジェイエシーリクルートメント	100	1,871.00	187,100
日本M&Aセンター	800	6,090.00	4,872,000
UTグループ	100	3,220.00	322,000
タケエイ	100	1,303.00	130,300
ビーネックスグループ	100	1,189.00	118,900
コシダカホールディングス	200	411.00	82,200
パソナグループ	100	1,931.00	193,100
リンクアンドモチベーション	200	586.00	117,200
G C A	100	708.00	70,800
エス・エム・エス	300	4,080.00	1,224,000
パーソルホールディングス	900	1,980.00	1,782,000
リニカル	100	757.00	75,700
クックパッド	300	305.00	91,500
森永製菓	200	4,080.00	816,000
江崎グリコ	300	4,560.00	1,368,000
井村屋グループ	100	2,525.00	252,500
不二家	100	2,292.00	229,200
山崎製パン	700	1,920.00	1,344,000
亀田製菓	100	4,840.00	484,000
寿スピリッツ	100	5,780.00	578,000
カルビー	400	3,000.00	1,200,000
森永乳業	200	5,030.00	1,006,000
六甲バター	100	1,809.00	180,900

ヤクルト本社	700	5,280.00	3,696,000	
明治ホールディングス	600	7,110.00	4,266,000	
雪印メグミルク	200	2,236.00	447,200	
プリマハム	100	3,230.00	323,000	
日本ハム	400	4,490.00	1,796,000	
丸大食品	100	1,687.00	168,700	
S Foods	100	3,380.00	338,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	600	714.00	428,400	
システナ	300	2,010.00	603,000	
デジタルアーツ	100	9,510.00	951,000	
日鉄ソリューションズ	100	3,460.00	346,000	
総合警備保障	400	4,990.00	1,996,000	
キューブシステム	100	1,184.00	118,400	
いちご	1,100	292.00	321,200	
日本駐車場開発	900	140.00	126,000	
カカクコム	700	3,045.00	2,131,500	
セントケア・ホールディング	100	941.00	94,100	
ルネサンス	100	915.00	91,500	
ディップ	100	3,010.00	301,000	
SBSホールディングス	100	2,455.00	245,500	
デジタルホールディングス	100	1,875.00	187,500	
新日本科学	100	712.00	71,200	
ツクイホールディングス	200	581.00	116,200	
ベネフィット・ワン	300	2,936.00	880,800	
エムスリー	1,600	9,280.00	14,848,000	
ツカダ・グローバルホールディング	100	280.00	28,000	
アウトソーシング	500	1,357.00	678,500	
ウェルネット	100	472.00	47,200	
ディー・エヌ・エー	400	2,022.00	808,800	
博報堂DYホールディングス	1,300	1,565.00	2,034,500	
ぐるなび	200	529.00	105,800	
タカミヤ	100	527.00	52,700	
ジャパンベストレスキューシステム	100	848.00	84,800	
ファンコミュニケーションズ	300	408.00	122,400	
エスプール	200	1,019.00	203,800	
ティア	100	412.00	41,200	
パリュウ・コマース	100	3,020.00	302,000	
インフォマート	900	915.00	823,500	
サッポロホールディングス	300	2,020.00	606,000	
アサヒグループホールディングス	2,100	4,203.00	8,826,300	
麒麟ホールディングス	4,100	2,245.50	9,206,550	
宝ホールディングス	700	1,255.00	878,500	
オエノンホールディングス	300	381.00	114,300	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	700	1,581.00	1,106,700	
サントリー食品インターナショナル	600	3,650.00	2,190,000	
ダイドーグループホールディングス	100	5,210.00	521,000	
伊藤園	300	6,440.00	1,932,000	
キーコーヒー	100	2,140.00	214,000	
日清オイリオグループ	100	3,035.00	303,500	

不二製油グループ本社	200	3,110.00	622,000	
ローソン	200	5,100.00	1,020,000	
サンエー	100	4,025.00	402,500	
カワチ薬品	100	2,947.00	294,700	
エービーシー・マート	100	5,910.00	591,000	
アスクル	100	3,920.00	392,000	
ゲオホールディングス	100	1,216.00	121,600	
アダストリア	100	1,955.00	195,500	
ジーフット	100	418.00	41,800	
くら寿司	100	6,440.00	644,000	
エレマテック	100	1,009.00	100,900	
パルグループホールディングス	100	1,509.00	150,900	
エディオン	400	1,031.00	412,400	
あらた	100	4,560.00	456,000	
サーラコーポレーション	200	568.00	113,600	
J Pホールディングス	300	281.00	84,300	
フジオフードグループ本社	100	1,261.00	126,100	
ひらまつ	200	140.00	28,000	
フィールズ	100	514.00	51,400	
双日	5,200	246.00	1,279,200	
アルフレッサ ホールディングス	1,000	2,096.00	2,096,000	
ハニーズホールディングス	100	972.00	97,200	
キッコーマン	700	7,270.00	5,089,000	
味の素	2,300	2,342.50	5,387,750	
キューピー	500	2,446.00	1,223,000	
ハウス食品グループ本社	400	3,830.00	1,532,000	
カゴメ	400	3,390.00	1,356,000	
アリアケジャパン	100	6,780.00	678,000	
ニチレイ	500	2,940.00	1,470,000	
横浜冷凍	200	875.00	175,000	
東洋水産	500	4,855.00	2,427,500	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	100	852.00	85,200	
日清食品ホールディングス	400	8,800.00	3,520,000	
フジッコ	100	2,028.00	202,800	
ロック・フィールド	100	1,532.00	153,200	
日本たばこ産業	5,200	2,088.00	10,857,600	
ケンコーマヨネーズ	100	1,860.00	186,000	
わらべや日洋ホールディングス	100	1,635.00	163,500	
なとり	100	1,927.00	192,700	
北の達人コーポレーション	300	575.00	172,500	
ユーグレナ	400	855.00	342,000	
A Dワークスグループ	200	156.00	31,200	
片倉工業	100	1,359.00	135,900	
グンゼ	100	3,315.00	331,500	
ヒューリック	2,000	1,163.00	2,326,000	
ラサ商事	100	903.00	90,300	
アルペン	100	2,330.00	233,000	
ラクーンホールディングス	100	2,009.00	200,900	
クオールホールディングス	100	1,163.00	116,300	
アルコニックス	100	1,589.00	158,900	

神戸物産	700	2,948.00	2,063,600
ジーンズホールディングス	100	6,650.00	665,000
ビックカメラ	600	1,127.00	676,200
DCMホールディングス	600	1,057.00	634,200
ペッパーフードサービス	100	256.00	25,600
MonotaRO	700	5,400.00	3,780,000
あいホールディングス	100	1,977.00	197,700
アークランドサービスホールディングス	100	2,083.00	208,300
J.フロントリテイリング	1,100	871.00	958,100
ドトール・日レスホールディングス	100	1,559.00	155,900
マツモトキヨシホールディングス	400	4,165.00	1,666,000
ZOZO	600	3,435.00	2,061,000
ココカラファイン	100	6,910.00	691,000
三越伊勢丹ホールディングス	1,700	649.00	1,103,300
東洋紡	400	1,325.00	530,000
ユニチカ	300	381.00	114,300
日清紡ホールディングス	600	800.00	480,000
倉敷紡績	100	1,791.00	179,100
ダイワボウホールディングス	100	8,800.00	880,000
シキボウ	100	1,011.00	101,100
日東紡績	100	4,985.00	498,500
トヨタ紡織	300	1,769.00	530,700
マクニカ・富士エレホールディングス	200	2,265.00	453,000
ウエルシアホールディングス	500	3,555.00	1,777,500
クリエイトSDホールディングス	100	3,400.00	340,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	200	815.00	163,000
八洲電機	100	958.00	95,800
メディアスホールディングス	100	790.00	79,000
レスターホールディングス	100	2,087.00	208,700
丸善CHIホールディングス	100	371.00	37,100
TOKAIホールディングス	500	980.00	490,000
三洋貿易	100	972.00	97,200
シュッピン	100	950.00	95,000
オイシックス・ラ・大地	100	3,090.00	309,000
ウイン・パートナーズ	100	1,096.00	109,600
ネクステージ	200	1,533.00	306,600
ジョイフル本田	300	1,387.00	416,100
ホットランド	100	1,230.00	123,000
すかいらーくホールディングス	1,100	1,692.00	1,861,200
綿半ホールディングス	100	1,293.00	129,300
日本毛織	300	952.00	285,600
ダイトウボウ	200	106.00	21,200
ダイドーリミテッド	100	187.00	18,700
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	300	1,125.00	337,500
野村不動産ホールディングス	600	2,333.00	1,399,800
三重交通グループホールディングス	200	476.00	95,200
サムティ	100	1,640.00	164,000

ディア・ライフ	100	436.00	43,600	
日本商業開発	100	1,680.00	168,000	
プレサンスコーポレーション	200	1,471.00	294,200	
THEグローバル社	100	244.00	24,400	
日本管理センター	100	1,155.00	115,500	
フージャースホールディングス	200	665.00	133,000	
オープンハウス	300	4,305.00	1,291,500	
東急不動産ホールディングス	2,600	598.00	1,554,800	
飯田グループホールディングス	800	2,377.00	1,901,600	
ムゲンエステート	100	458.00	45,800	
帝国繊維	100	2,272.00	227,200	
日本コークス工業	800	94.00	75,200	
あさひ	100	1,616.00	161,600	
日本調剤	100	1,585.00	158,500	
コスモス薬品	100	16,000.00	1,600,000	
シップヘルスケアホールディングス	200	6,130.00	1,226,000	
セブン&アイ・ホールディングス	3,700	3,978.00	14,718,600	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	500	796.00	398,000	
ツルハホールディングス	200	13,980.00	2,796,000	
サンマルクホールディングス	100	1,442.00	144,200	
トリドールホールディングス	200	1,534.00	306,800	
帝人	900	1,961.00	1,764,900	
東レ	6,800	689.10	4,685,880	
クラレ	1,500	1,129.00	1,693,500	
旭化成	6,200	1,175.50	7,288,100	
TOKYO BASE	100	510.00	51,000	
稲葉製作所	100	1,404.00	140,400	
トーカロ	200	1,460.00	292,000	
SUMCO	1,200	2,292.00	2,750,400	
信和	100	697.00	69,700	
日本フェルト	100	438.00	43,800	
エコナックホールディングス	200	91.00	18,200	
アツギ	100	471.00	47,100	
JMホールディングス	100	2,027.00	202,700	
コメダホールディングス	200	1,901.00	380,200	
アレンザホールディングス	100	1,353.00	135,300	
バロックジャパンリミテッド	100	754.00	75,400	
クスリのアオキホールディングス	100	8,400.00	840,000	
共和レザー	100	640.00	64,000	
スシログローバルホールディングス	500	3,690.00	1,845,000	
セーレン	200	1,584.00	316,800	
小松マテーレ	200	994.00	198,800	
ワコールホールディングス	200	2,234.00	446,800	
ホギメディカル	100	3,135.00	313,500	
TSIホールディングス	300	255.00	76,500	
ワールド	100	1,217.00	121,700	
TIS	900	2,421.00	2,178,900	
グリー	600	583.00	349,800	
コーエーテクモホールディングス	200	5,940.00	1,188,000	

ファインデックス	100	1,070.00	107,000
K L a b	200	914.00	182,800
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	100	1,127.00	112,700
ネクソン	2,400	3,295.00	7,908,000
アイスタイル	300	416.00	124,800
エイチーム	100	1,146.00	114,600
エニグモ	100	1,256.00	125,600
テクノスジャパン	100	661.00	66,100
コロブラ	300	911.00	273,300
オルトプラス	100	404.00	40,400
ブロードリーフ	500	627.00	313,500
システム情報	100	1,133.00	113,300
じげん	200	374.00	74,800
ブイキューブ	100	3,030.00	303,000
ディー・エル・イー	100	312.00	31,200
フィックスターズ	100	941.00	94,100
オブティム	100	3,130.00	313,000
特種東海製紙	100	4,540.00	454,000
ティーガイア	100	1,907.00	190,700
日本アジアグループ	100	1,212.00	121,200
テクマトリックス	100	2,049.00	204,900
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	200	2,620.00	524,000
GMOペイメントゲートウェイ	200	15,360.00	3,072,000
インターネットイニシアティブ	300	2,124.00	637,200
さくらインターネット	100	672.00	67,200
S R Aホールディングス	100	2,504.00	250,400
朝日ネット	100	867.00	86,700
e B A S E	100	1,072.00	107,200
アバント	100	1,416.00	141,600
フリービット	100	942.00	94,200
コムチュア	100	2,974.00	297,400
アステリア	100	991.00	99,100
アイル	100	1,524.00	152,400
王子ホールディングス	4,200	643.00	2,700,600
日本製紙	400	1,296.00	518,400
三菱製紙	100	333.00	33,300
北越コーポレーション	700	437.00	305,900
大王製紙	500	1,868.00	934,000
メディカル・データ・ビジョン	100	2,695.00	269,500
g u m i	100	865.00	86,500
オーブンドア	100	1,754.00	175,400
カナミックネットワーク	100	710.00	71,000
レンゴー	1,000	882.00	882,000
トモク	100	1,834.00	183,400
ザ・バック	100	2,560.00	256,000
チェンジ	100	3,550.00	355,000
シンクロ・フード	100	327.00	32,700
A O I T Y O H O L D I N G S	100	445.00	44,500

マクロミル	200	780.00	156,000	
昭和電工	700	2,558.00	1,790,600	
住友化学	7,400	509.00	3,766,600	
日産化学	500	6,040.00	3,020,000	
クレハ	100	6,600.00	660,000	
テイカ	100	1,465.00	146,500	
石原産業	200	755.00	151,000	
日本曹達	100	3,025.00	302,500	
東ソー	1,500	1,860.00	2,790,000	
トクヤマ	300	2,675.00	802,500	
セントラル硝子	200	2,166.00	433,200	
東亜合成	600	1,149.00	689,400	
大阪ソーダ	100	2,540.00	254,000	
関東電化工業	200	833.00	166,600	
デンカ	300	4,050.00	1,215,000	
イビデン	500	4,960.00	2,480,000	
信越化学工業	1,700	18,270.00	31,059,000	
堺化学工業	100	2,031.00	203,100	
第一稀元素化学工業	100	933.00	93,300	
エア・ウォーター	1,000	1,720.00	1,720,000	
日本酸素ホールディングス	800	2,030.00	1,624,000	
日本パーカライズン	500	1,022.00	511,000	
高圧ガス工業	100	730.00	73,000	
四国化成工業	100	1,212.00	121,200	
ステラ ケミファ	100	3,555.00	355,500	
日本触媒	200	5,900.00	1,180,000	
大日精化工業	100	2,241.00	224,100	
カネカ	200	3,765.00	753,000	
協和キリン	1,000	3,185.00	3,185,000	
三菱瓦斯化学	900	2,438.00	2,194,200	
三井化学	800	3,165.00	2,532,000	
J S R	900	3,210.00	2,889,000	
東京応化工業	200	7,060.00	1,412,000	
大阪有機化学工業	100	3,605.00	360,500	
三菱ケミカルホールディングス	6,300	726.00	4,573,800	
K Hネオケム	200	2,367.00	473,400	
ダイセル	1,300	794.00	1,032,200	
住友ベークライト	100	3,760.00	376,000	
積水化学工業	2,000	1,919.00	3,838,000	
日本ゼオン	800	1,719.00	1,375,200	
アイカ工業	300	3,675.00	1,102,500	
宇部興産	500	2,056.00	1,028,000	
積水樹脂	200	2,107.00	421,400	
タキロンシーアイ	200	647.00	129,400	
旭有機材	100	1,497.00	149,700	
リケンテクノス	200	476.00	95,200	
積水化成成品工業	100	540.00	54,000	
ダイキョーニシカワ	200	798.00	159,600	
森六ホールディングス	100	2,015.00	201,500	
日本化薬	600	1,000.00	600,000	

カーリットホールディングス	100	726.00	72,600	
E P Sホールディングス	100	1,020.00	102,000	
プレステージ・インターナショナル	300	883.00	264,900	
プロトコーポレーション	100	1,051.00	105,100	
アミューズ	100	2,534.00	253,400	
野村総合研究所	1,700	3,530.00	6,001,000	
サイバネットシステム	100	962.00	96,200	
クイック	100	1,145.00	114,500	
電通グループ	1,000	3,370.00	3,370,000	
インテージホールディングス	100	1,162.00	116,200	
ソースネクスト	400	291.00	116,400	
シーティーエス	100	913.00	91,300	
インフォコム	100	3,110.00	311,000	
メディカルシステムネットワーク	100	588.00	58,800	
日本精化	100	1,374.00	137,400	
扶桑化学工業	100	3,605.00	360,500	
トリケミカル研究所	100	4,265.00	426,500	
ラクスル	100	4,115.00	411,500	
F I G	100	257.00	25,700	
A D E K A	400	1,771.00	708,400	
日油	400	5,120.00	2,048,000	
新日本理化	200	258.00	51,600	
ハリマ化成グループ	100	904.00	90,400	
イーソル	100	1,198.00	119,800	
アルテリア・ネットワークス	100	1,557.00	155,700	
花王	2,300	7,594.00	17,466,200	
三洋化成工業	100	5,230.00	523,000	
武田薬品工業	8,000	3,723.00	29,784,000	代用有価証券 2,600株
アステラス製薬	8,300	1,734.00	14,392,200	
大日本住友製薬	700	1,752.00	1,226,400	
塩野義製薬	1,200	5,715.00	6,858,000	
わかもと製薬	100	244.00	24,400	
あすか製薬	100	1,561.00	156,100	
日本新薬	300	7,710.00	2,313,000	
中外製薬	3,000	5,459.00	16,377,000	
科研製薬	200	4,100.00	820,000	
エーザイ	1,100	7,793.00	8,572,300	
理研ビタミン	100	1,367.00	136,700	
ロート製薬	500	3,100.00	1,550,000	
小野薬品工業	2,200	3,159.00	6,949,800	
久光製薬	300	6,330.00	1,899,000	
有機合成薬品工業	100	290.00	29,000	
持田製薬	100	3,970.00	397,000	
参天製薬	1,700	1,745.00	2,966,500	
ツムラ	300	3,410.00	1,023,000	
日医工	300	1,008.00	302,400	
テルモ	2,900	4,104.00	11,901,600	
H . U . グループホールディングス	300	3,090.00	927,000	
キッセイ薬品工業	200	2,309.00	461,800	

生化学工業	200	1,037.00	207,400
栄研化学	200	2,381.00	476,200
鳥居薬品	100	3,255.00	325,500
J C Rファーマ	300	3,210.00	963,000
東和薬品	100	2,083.00	208,300
富士製薬工業	100	1,225.00	122,500
沢井製薬	200	4,730.00	946,000
ゼリア新薬工業	200	1,993.00	398,600
第一三共	8,300	3,368.00	27,954,400
キョーリン製薬ホールディングス	200	1,965.00	393,000
大幸薬品	100	1,580.00	158,000
ダイト	100	3,645.00	364,500
大塚ホールディングス	2,000	4,520.00	9,040,000
大正製薬ホールディングス	200	6,880.00	1,376,000
ペプチドリーム	500	6,340.00	3,170,000
大日本塗料	100	917.00	91,700
日本ペイントホールディングス	800	9,500.00	7,600,000
関西ペイント	1,100	3,085.00	3,393,500
神東塗料	100	201.00	20,100
中国塗料	200	910.00	182,000
日本特殊塗料	100	1,060.00	106,000
藤倉化成	100	484.00	48,400
太陽ホールディングス	100	6,220.00	622,000
D I C	400	2,604.00	1,041,600
サカタインクス	200	1,055.00	211,000
東洋インキS Cホールディングス	200	1,844.00	368,800
T & K T O K A	100	820.00	82,000
アルプス技研	100	2,068.00	206,800
サニックス	100	330.00	33,000
日本空調サービス	100	715.00	71,500
オリエンタルランド	1,000	16,290.00	16,290,000
フォーカスシステムズ	100	950.00	95,000
ダスキン	200	2,770.00	554,000
パーク24	500	2,042.00	1,021,000
明光ネットワークジャパン	100	580.00	58,000
クレスコ	100	1,282.00	128,200
フジ・メディア・ホールディングス	1,000	1,235.00	1,235,000
ラウンドワン	300	887.00	266,100
リゾートトラスト	400	1,480.00	592,000
オービック	300	19,620.00	5,886,000
ジャストシステム	100	7,640.00	764,000
T D Cソフト	100	952.00	95,200
Zホールディングス	13,000	675.80	8,785,400
ビー・エム・エル	100	3,680.00	368,000
トレンドマイクロ	500	5,770.00	2,885,000
りらいあコミュニケーションズ	100	1,465.00	146,500
リソー教育	500	331.00	165,500
日本オラクル	200	12,420.00	2,484,000
フューチャー	100	1,767.00	176,700
C A C Holdings	100	1,366.00	136,600

ユー・エス・エス	1,000	2,086.00	2,086,000	
オービックビジネスコンサルタント	100	6,490.00	649,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	400	3,780.00	1,512,000	
アイティフォー	100	921.00	92,100	
東京個別指導学院	100	663.00	66,300	
サイバーエージェント	600	6,710.00	4,026,000	
楽天	4,300	1,013.00	4,355,900	
モーニングスター	100	477.00	47,700	
テー・オー・ダブリュー	200	270.00	54,000	
大塚商会	500	5,430.00	2,715,000	
サイボウズ	100	2,665.00	266,500	
山田コンサルティンググループ	100	953.00	95,300	
電通国際情報サービス	100	3,905.00	390,500	
A C C E S S	100	745.00	74,500	
デジタルガレージ	200	3,665.00	733,000	
イーエムシステムズ	200	962.00	192,400	
C I J	100	882.00	88,200	
日本エンタープライズ	100	234.00	23,400	
スカラ	100	820.00	82,000	
インテリジェント ウェイブ	100	728.00	72,800	
フルキャストホールディングス	100	1,690.00	169,000	
エン・ジャパン	200	3,040.00	608,000	
富士フイルムホールディングス	1,700	6,063.00	10,307,100	
コニカミノルタ	1,900	464.00	881,600	
資生堂	1,900	6,871.00	13,054,900	
ライオン	1,200	2,366.00	2,839,200	
高砂香料工業	100	2,559.00	255,900	
マンダム	200	1,627.00	325,400	
ミルボン	100	6,980.00	698,000	
ファンケル	400	3,965.00	1,586,000	
コーセー	200	17,210.00	3,442,000	
コタ	100	1,431.00	143,100	
ポーラ・オルビスホールディングス	400	1,997.00	798,800	
ノエビアホールディングス	100	4,880.00	488,000	
エステー	100	1,998.00	199,800	
コニシ	200	1,541.00	308,200	
長谷川香料	200	2,007.00	401,400	
星光P M C	100	740.00	74,000	
小林製薬	300	11,810.00	3,543,000	
荒川化学工業	100	1,229.00	122,900	
メック	100	2,211.00	221,100	
タカラバイオ	300	2,914.00	874,200	
J C U	100	3,810.00	381,000	
新田ゼラチン	100	671.00	67,100	
デクセリアルズ	300	1,411.00	423,300	
アース製薬	100	5,930.00	593,000	
北興化学工業	100	1,181.00	118,100	
クミアイ化学工業	400	853.00	341,200	
日本農薬	200	484.00	96,800	
ニチレキ	100	1,487.00	148,700	

ユシロ化学工業	100	1,101.00	110,100
富士石油	200	211.00	42,200
出光興産	1,100	2,439.00	2,682,900
E N E O Sホールディングス	14,500	421.40	6,110,300
コスモエネルギーホールディングス	300	2,237.00	671,100
横浜ゴム	600	1,692.00	1,015,200
TOYO TIRE	500	1,609.00	804,500
ブリヂストン	2,600	3,906.00	10,155,600
住友ゴム工業	900	980.00	882,000
藤倉コンポジット	100	413.00	41,300
オカモト	100	3,890.00	389,000
アキレス	100	1,435.00	143,500
ニッタ	100	2,212.00	221,200
住友理工	200	597.00	119,400
三ツ星ベルト	100	1,697.00	169,700
バンドー化学	200	659.00	131,800
A G C	900	3,665.00	3,298,500
日本板硝子	500	485.00	242,500
有沢製作所	100	971.00	97,100
日本電気硝子	400	2,367.00	946,800
住友大阪セメント	200	3,180.00	636,000
太平洋セメント	600	2,632.00	1,579,200
日本ヒューム	100	757.00	75,700
日本コンクリート工業	200	330.00	66,000
アジアパイルホールディングス	100	479.00	47,900
東海カーボン	900	1,511.00	1,359,900
日本カーボン	100	4,045.00	404,500
東洋炭素	100	1,926.00	192,600
ノリタケカンパニーリミテド	100	3,290.00	329,000
T O T O	700	6,510.00	4,557,000
日本碍子	1,100	1,890.00	2,079,000
日本特殊陶業	700	1,948.00	1,363,600
ダントーホールディングス	100	403.00	40,300
ヨータイ	100	866.00	86,600
東京窯業	100	322.00	32,200
フジインコーポレーテッド	100	4,220.00	422,000
ニチアス	200	2,406.00	481,200
日本製鉄	4,500	1,222.00	5,499,000
神戸製鋼所	1,700	503.00	855,100
中山製鋼所	100	368.00	36,800
合同製鉄	100	1,931.00	193,100
ジェイ エフ イー ホールディングス	2,700	934.00	2,521,800
東京製鉄	400	747.00	298,800
共英製鋼	100	1,345.00	134,500
大和工業	200	2,695.00	539,000
大阪製鉄	100	1,217.00	121,700
淀川製鋼所	100	2,044.00	204,400
丸一鋼管	300	2,275.00	682,500
大同特殊鋼	200	4,605.00	921,000

日本冶金工業		100	1,756.00	175,600	
山陽特殊製鋼		100	1,616.00	161,600	
愛知製鋼		100	3,135.00	313,500	
日立金属		900	1,685.00	1,516,500	
大平洋金属		100	2,209.00	220,900	
新日本電工		600	268.00	160,800	
日本製鋼所		300	3,075.00	922,500	
三菱製鋼		100	641.00	64,100	
日亜鋼業		100	292.00	29,200	
大紀アルミニウム工業所		100	817.00	81,700	
日本軽金属ホールディングス		300	1,927.00	578,100	
三井金属鉱業		300	3,765.00	1,129,500	
東邦亜鉛		100	2,236.00	223,600	
三菱マテリアル		600	2,284.00	1,370,400	
住友金属鉱山		1,200	4,705.00	5,646,000	
DOWAホールディングス		200	3,905.00	781,000	
古河機械金属		200	1,236.00	247,200	
エス・サイエンス		400	40.00	16,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ		100	763.00	76,300	
東邦チタニウム		200	859.00	171,800	
UACJ		100	1,869.00	186,900	
古河電気工業		300	2,916.00	874,800	
住友電気工業		3,300	1,420.50	4,687,650	
フジクラ		1,100	509.00	559,900	
昭和電線ホールディングス		100	1,634.00	163,400	
タツタ電線		200	687.00	137,400	
平河ヒューテック		100	1,215.00	121,500	
リョービ		100	1,203.00	120,300	
アーレスティ		100	355.00	35,500	
アサヒホールディングス		200	4,440.00	888,000	
東洋製罐グループホールディングス		600	1,122.00	673,200	
コロナ		100	930.00	93,000	
横河ブリッジホールディングス		200	1,975.00	395,000	
OSJBホールディングス		400	264.00	105,600	
三和ホールディングス		900	1,235.00	1,111,500	
文化シャッター		300	935.00	280,500	
三協立山		100	815.00	81,500	
アルインコ		100	938.00	93,800	
LIXIL		1,300	2,526.00	3,283,800	
日本フィルコン		100	501.00	50,100	
ノーリツ		200	1,518.00	303,600	
長府製作所		100	2,025.00	202,500	
リンナイ		200	11,430.00	2,286,000	
ユニプレス		200	982.00	196,400	
日東精工		100	450.00	45,000	
岡部		200	773.00	154,600	
ジーテクト		100	1,487.00	148,700	
東プレ		200	1,492.00	298,400	
高周波熱錬		200	482.00	96,400	
東京製鋼		100	1,252.00	125,200	

サンコール	100	473.00	47,300
モリテックスチール	100	418.00	41,800
パイオラックス	100	1,529.00	152,900
エイチワン	100	767.00	76,700
日本発条	900	737.00	663,300
三浦工業	400	6,050.00	2,420,000
タクマ	300	2,221.00	666,300
テクノプロ・ホールディングス	200	8,420.00	1,684,000
Keeper 技研	100	2,127.00	212,700
Gunosy	100	767.00	76,700
リブセンス	100	239.00	23,900
ジャパンマテリアル	300	1,486.00	445,800
ベクトル	100	1,251.00	125,100
チャーム・ケア・コーポレーション	100	1,328.00	132,800
I B J	100	882.00	88,200
N・フィールド	100	854.00	85,400
M&Aキャピタルパートナーズ	100	5,230.00	523,000
シグマクシス	100	1,651.00	165,100
ウィルグループ	100	1,010.00	101,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	100	284.00	28,400
リクルートホールディングス	6,600	4,655.00	30,723,000
エラン	100	1,483.00	148,300
ツガミ	200	1,743.00	348,600
オークマ	100	6,150.00	615,000
芝浦機械	100	2,762.00	276,200
アマダ	1,400	1,221.00	1,709,400
アイダエンジニアリング	200	1,003.00	200,600
F U J I	400	2,797.00	1,118,800
牧野フライス製作所	100	4,035.00	403,500
オーエスジー	500	1,855.00	927,500
旭ダイヤモンド工業	200	458.00	91,600
D M G 森精機	600	1,638.00	982,800
ソディック	200	956.00	191,200
ディスコ	100	34,900.00	3,490,000
パンチ工業	100	417.00	41,700
日本郵政	6,900	838.30	5,784,270
ベルシステム24ホールディングス	200	1,891.00	378,200
鎌倉新書	100	885.00	88,500
ソラスト	200	1,591.00	318,200
インソース	100	2,390.00	239,000
豊田自動織機	800	8,390.00	6,712,000
豊和工業	100	849.00	84,900
東洋機械金属	100	421.00	42,100
島精機製作所	100	2,182.00	218,200
オプトラン	100	2,568.00	256,800
イワキ	100	804.00	80,400
フリーー	100	1,080.00	108,000
ヤマシンフィルタ	200	1,011.00	202,200
日阪製作所	100	809.00	80,900
やまびこ	200	1,288.00	257,600

ペガサスミシン製造	100	380.00	38,000	
ナブテスコ	600	4,925.00	2,955,000	
三井海洋開発	100	1,982.00	198,200	
レオン自動機	100	1,151.00	115,100	
S M C	300	64,510.00	19,353,000	
オイレス工業	100	1,628.00	162,800	
サトーホールディングス	100	2,237.00	223,700	
技研製作所	100	5,000.00	500,000	
日精樹脂工業	100	903.00	90,300	
小松製作所	4,400	2,973.00	13,081,200	
住友重機械工業	600	3,035.00	1,821,000	
日立建機	400	2,903.00	1,161,200	
日工	100	710.00	71,000	
井関農機	100	1,351.00	135,100	
T O W A	100	1,965.00	196,500	
シンニッタン	100	206.00	20,600	
クボタ	5,000	2,378.50	11,892,500	
東洋エンジニアリング	100	452.00	45,200	
月島機械	200	1,348.00	269,600	
帝国電機製作所	100	1,231.00	123,100	
新東工業	200	741.00	148,200	
澁谷工業	100	3,465.00	346,500	
アイチコーポレーション	200	913.00	182,600	
小森コーポレーション	200	685.00	137,000	
鶴見製作所	100	1,829.00	182,900	
荏原製作所	400	3,665.00	1,466,000	
西島製作所	100	891.00	89,100	
北越工業	100	1,024.00	102,400	
ダイキン工業	1,200	22,255.00	26,706,000	
栗田工業	500	4,505.00	2,252,500	
椿本チエイン	100	2,727.00	272,700	
日機装	300	1,022.00	306,600	
木村化工機	100	578.00	57,800	
レイズネクスト	200	1,143.00	228,600	
アネスト岩田	200	1,126.00	225,200	
ダイフク	500	12,400.00	6,200,000	
加藤製作所	100	936.00	93,600	
タダノ	500	950.00	475,000	
フジテック	300	2,382.00	714,600	
C K D	200	2,415.00	483,000	
キトー	100	1,523.00	152,300	
平和	300	1,465.00	439,500	
理想科学工業	100	1,390.00	139,000	
S A N K Y O	200	2,986.00	597,200	
日本金銭機械	100	511.00	51,100	
マースグループホールディングス	100	1,522.00	152,200	
フクシマガリレイ	100	4,260.00	426,000	
竹内製作所	200	2,426.00	485,200	
アマノ	300	2,504.00	751,200	
J U K I	100	636.00	63,600	

サンデンホールディングス	100	428.00	42,800
蛇の目マシン工業	100	825.00	82,500
ブラザー工業	1,200	2,358.00	2,829,600
マックス	100	1,601.00	160,100
モリタホールディングス	200	1,732.00	346,400
グローリー	200	2,059.00	411,800
新晃工業	100	1,840.00	184,000
大和冷機工業	200	1,015.00	203,000
セガサミーホールディングス	900	1,689.00	1,520,100
T P R	100	1,404.00	140,400
ツバキ・ナカシマ	200	1,197.00	239,400
ホシザキ	300	9,410.00	2,823,000
大豊工業	100	788.00	78,800
日本精工	2,000	985.00	1,970,000
N T N	2,200	291.00	640,200
ジェイテクト	900	950.00	855,000
不二越	100	4,180.00	418,000
ミネベアミツミ	1,700	2,358.00	4,008,600
日本トムソン	300	484.00	145,200
T H K	600	3,420.00	2,052,000
ユーシン精機	100	971.00	97,100
イーグル工業	100	1,156.00	115,600
前澤工業	100	564.00	56,400
日本ピラー工業	100	1,726.00	172,600
キッツ	300	595.00	178,500
日立製作所	4,600	4,475.00	20,585,000
三菱電機	9,600	1,622.00	15,571,200
富士電機	600	4,345.00	2,607,000
安川電機	1,000	5,520.00	5,520,000
シンフォニア テクノロジー	100	1,449.00	144,900
明電舎	200	2,410.00	482,000
デンヨー	100	2,024.00	202,400
ベイカレント・コンサルティング	100	16,100.00	1,610,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	300	2,495.00	748,500
日総工産	100	801.00	80,100
R P Aホールディングス	100	639.00	63,900
三櫻工業	100	889.00	88,900
マキタ	1,300	4,780.00	6,214,000
東芝テック	100	3,970.00	397,000
マブチモーター	300	4,500.00	1,350,000
日本電産	2,300	14,195.00	32,648,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	100	479.00	47,900
トレックス・セミコンダクター	100	1,455.00	145,500
ダブル・スコープ	200	1,041.00	208,200
ダイヘン	100	4,955.00	495,500
ヤーマン	200	1,818.00	363,600
J V Cケンウッド	800	201.00	160,800
ミマキエンジニアリング	100	485.00	48,500
日新電機	200	1,329.00	265,800

大崎電気工業	200	586.00	117,200	
オムロン	800	9,520.00	7,616,000	
日東工業	100	2,051.00	205,100	
I D E C	100	1,914.00	191,400	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	300	3,270.00	981,000	
日本電気	1,200	6,430.00	7,716,000	
富士通	900	15,980.00	14,382,000	
沖電気工業	400	1,095.00	438,000	
サンケン電気	100	4,475.00	447,500	
アイホン	100	1,679.00	167,900	
ルネサスエレクトロニクス	4,100	1,211.00	4,965,100	
セイコーエプソン	1,200	1,800.00	2,160,000	
ワコム	700	941.00	658,700	
アルバック	200	4,765.00	953,000	
E I Z O	100	3,800.00	380,000	
ジャパンディスプレイ	3,300	48.00	158,400	
日本信号	200	930.00	186,000	
京三製作所	200	411.00	82,200	
能美防災	100	2,218.00	221,800	
ホーチキ	100	1,277.00	127,700	
エレコム	100	4,960.00	496,000	
パナソニック	10,200	1,339.50	13,662,900	代用有価証券 7,500株
シャープ	1,100	2,247.00	2,471,700	
アンリツ	600	2,559.00	1,535,400	
富士通ゼネラル	300	2,742.00	822,600	
ソニー	6,000	10,155.00	60,930,000	代用有価証券 3,700株
T D K	500	16,090.00	8,045,000	
タムラ製作所	300	571.00	171,300	
アルプスアルパイン	800	1,340.00	1,072,000	
日本電波工業	100	735.00	73,500	
ローランド ディー・ジー・	100	1,723.00	172,300	
フォスター電機	100	1,579.00	157,900	
ヨコオ	100	3,330.00	333,000	
ティアック	100	104.00	10,400	
ホシデン	300	966.00	289,800	
ヒロセ電機	100	16,340.00	1,634,000	
日本航空電子工業	200	1,667.00	333,400	
T O A	100	857.00	85,700	
マクセルホールディングス	200	1,467.00	293,400	
古野電気	100	1,157.00	115,700	
スミダコーポレーション	100	1,009.00	100,900	
本多通信工業	100	476.00	47,600	
船井電機	100	430.00	43,000	
横河電機	1,000	2,324.00	2,324,000	
アズビル	600	5,410.00	3,246,000	
日本光電工業	400	3,150.00	1,260,000	
共和電業	100	387.00	38,700	
堀場製作所	200	6,920.00	1,384,000	

アドバンテスト	700	8,450.00	5,915,000	
エスベック	100	1,961.00	196,100	
キーエンス	900	57,680.00	51,912,000	
シスメックス	700	12,700.00	8,890,000	
日本マイクロニクス	200	1,617.00	323,400	
メガチップス	100	3,255.00	325,500	
OBARA GROUP	100	4,155.00	415,500	
IMAGICA GROUP	100	362.00	36,200	
デンソー	2,100	5,925.00	12,442,500	
コーセル	100	1,180.00	118,000	
イリソ電子工業	100	4,745.00	474,500	
オブテックスグループ	200	1,946.00	389,200	
レーザーテック	400	14,290.00	5,716,000	
スタンレー電気	700	3,450.00	2,415,000	
ウシオ電機	500	1,417.00	708,500	
岡谷電機産業	100	360.00	36,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	100	319.00	31,900	
日本セラミック	100	2,813.00	281,300	
古河電池	100	1,559.00	155,900	
山一電機	100	1,715.00	171,500	
図研	100	2,702.00	270,200	
日本電子	200	4,355.00	871,000	
カシオ計算機	800	1,951.00	1,560,800	
ファナック	800	27,655.00	22,124,000	
日本シイエムケイ	200	436.00	87,200	
ローム	400	10,830.00	4,332,000	
浜松ホトニクス	700	6,130.00	4,291,000	
三井ハイテック	100	4,180.00	418,000	
新光電気工業	300	2,684.00	805,200	
京セラ	1,500	6,760.00	10,140,000	
太陽誘電	400	5,990.00	2,396,000	
村田製作所	2,800	9,721.00	27,218,800	
双葉電子工業	200	971.00	194,200	
日東電工	600	9,670.00	5,802,000	
東海理化電機製作所	300	1,775.00	532,500	
ニチコン	300	1,437.00	431,100	
日本ケミコン	100	1,991.00	199,100	
KOA	100	1,693.00	169,300	
三井E&Sホールディングス	400	408.00	163,200	
日立造船	800	615.00	492,000	
三菱重工業	1,500	3,045.00	4,567,500	
川崎重工業	700	2,273.00	1,591,100	
IHI	600	1,895.00	1,137,000	
名村造船所	300	170.00	51,000	
サノヤスホールディングス	100	152.00	15,200	
カーブスホールディングス	300	861.00	258,300	
三菱ロジスネクスト	100	1,197.00	119,700	
FPG	300	524.00	157,200	
じもとホールディングス	100	803.00	80,300	
全国保証	200	4,725.00	945,000	

めぶきフィナンシャルグループ	4,900	209.00	1,024,100	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	100	1,097.00	109,700	
九州フィナンシャルグループ	1,900	421.00	799,900	
かんぼ生命保険	1,200	2,129.00	2,554,800	
ゆうちょ銀行	2,700	921.00	2,486,700	
富山第一銀行	200	287.00	57,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	5,800	385.00	2,233,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	600	648.00	388,800	
アルヒ	100	1,810.00	181,000	
日産自動車	11,300	540.40	6,106,520	
いすゞ自動車	2,800	1,027.00	2,875,600	
トヨタ自動車	9,700	7,294.00	70,751,800	代用有価証券 9,000株
日野自動車	1,200	950.00	1,140,000	
三菱自動車工業	3,600	242.00	871,200	
エフテック	100	639.00	63,900	
武蔵精密工業	200	1,551.00	310,200	
日産車体	100	836.00	83,600	
新明和工業	300	907.00	272,100	
極東開発工業	200	1,489.00	297,800	
トビー工業	100	1,267.00	126,700	
曙ブレーキ工業	500	156.00	78,000	
タチエス	100	1,102.00	110,200	
N O K	500	1,399.00	699,500	
フタバ産業	200	519.00	103,800	
K Y B	100	2,389.00	238,900	
市光工業	100	691.00	69,100	
大同メタル工業	200	508.00	101,600	
プレス工業	500	314.00	157,000	
ミクニ	100	270.00	27,000	
太平洋工業	200	1,125.00	225,000	
河西工業	100	387.00	38,700	
アイシン精機	700	3,355.00	2,348,500	
マツダ	3,000	761.00	2,283,000	
今仙電機製作所	100	717.00	71,700	
本田技研工業	7,600	2,774.00	21,082,400	代用有価証券 6,000株
スズキ	1,900	4,864.00	9,241,600	
S U B A R U	2,800	2,025.00	5,670,000	
ヤマハ発動機	1,400	2,382.00	3,334,800	
小糸製作所	600	7,180.00	4,308,000	
T B K	100	436.00	43,600	
エクセディ	100	1,597.00	159,700	
ミツバ	200	429.00	85,800	
豊田合成	300	2,861.00	858,300	
愛三工業	200	537.00	107,400	
日本プラスト	100	507.00	50,700	
ヨロズ	100	1,244.00	124,400	

エフ・シー・シー	200	1,726.00	345,200
シマノ	400	25,230.00	10,092,000
テイ・エス テック	200	3,090.00	618,000
関西みらいフィナンシャルグループ	400	517.00	206,800
三十三フィナンシャルグループ	100	1,257.00	125,700
第四北越フィナンシャルグループ	200	2,193.00	438,600
ひろぎんホールディングス	1,400	612.00	856,800
ジャムコ	100	651.00	65,100
小野建	100	1,201.00	120,100
ノジマ	200	2,663.00	532,600
佐鳥電機	100	751.00	75,100
カップ・クリエイト	100	1,520.00	152,000
伯東	100	1,296.00	129,600
コンドーテック	100	1,050.00	105,000
中山福	100	531.00	53,100
ライトオン	100	628.00	62,800
ナガイレーベン	100	3,040.00	304,000
三菱食品	100	2,817.00	281,700
良品計画	1,300	2,545.00	3,308,500
三城ホールディングス	100	305.00	30,500
松田産業	100	1,828.00	182,800
第一興商	100	3,615.00	361,500
メディカルホールディングス	900	2,158.00	1,942,200
アドヴァン	100	1,089.00	108,900
アズワン	100	15,990.00	1,599,000
シモジマ	100	1,356.00	135,600
ドウシシャ	100	1,825.00	182,500
コナカ	100	302.00	30,200
高速	100	1,500.00	150,000
G - 7ホールディングス	100	2,403.00	240,300
イオン北海道	100	988.00	98,800
コジマ	200	623.00	124,600
コーナン商事	100	2,858.00	285,800
ネットワンシステムズ	400	3,535.00	1,414,000
ワタミ	100	956.00	95,600
システムソフト	200	93.00	18,600
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	1,900	2,390.00	4,541,000
丸文	100	539.00	53,900
西松屋チェーン	200	1,433.00	286,600
ゼンショーホールディングス	500	2,895.00	1,447,500
ハビネット	100	1,559.00	155,900
幸楽苑ホールディングス	100	1,718.00	171,800
日本ライフライン	300	1,423.00	426,900
サイゼリヤ	100	2,146.00	214,600
タカショー	100	753.00	75,300
V Tホールディングス	400	420.00	168,000
アルゴグラフィックス	100	3,020.00	302,000
I D O M	300	619.00	185,700
日本エム・ディ・エム	100	2,090.00	209,000

ユナイテッドアローズ	100	1,628.00	162,800	
進和	100	2,146.00	214,600	
ハイデイ日高	100	1,751.00	175,100	
シークス	100	1,528.00	152,800	
京都きもの友禅	100	216.00	21,600	
コロワイド	300	1,864.00	559,200	
ピーシーデポコーポレーション	100	562.00	56,200	
壱番屋	100	5,080.00	508,000	
スギホールディングス	200	6,890.00	1,378,000	
島津製作所	1,200	4,015.00	4,818,000	
JMS	100	1,020.00	102,000	
長野計器	100	941.00	94,100	
スター精密	100	1,608.00	160,800	
東京計器	100	930.00	93,000	
オーバル	100	333.00	33,300	
東京精密	200	4,970.00	994,000	
マニー	400	2,775.00	1,110,000	
ニコン	1,500	822.00	1,233,000	
トプコン	500	1,281.00	640,500	
オリンパス	5,300	1,952.00	10,345,600	
理研計器	100	3,005.00	300,500	
SCREENホールディングス	200	8,470.00	1,694,000	
キヤノン電子	100	1,737.00	173,700	
タムロン	100	2,034.00	203,400	
HOYA	1,900	13,245.00	25,165,500	
ノーリツ鋼機	100	2,155.00	215,500	
エー・アンド・デイ	100	1,201.00	120,100	
朝日インテック	1,000	3,420.00	3,420,000	
キヤノン	4,800	2,355.00	11,304,000	代用有価証券 4,100株
リコー	2,400	817.00	1,960,800	
シチズン時計	1,200	325.00	390,000	
大研医器	100	545.00	54,500	
メニコン	100	6,300.00	630,000	
スノーピーク	100	1,841.00	184,100	
パラマウントベッドホールディングス	100	4,530.00	453,000	
トランザクション	100	1,073.00	107,300	
ニホンフラッシュ	100	1,194.00	119,400	
前田工織	100	2,686.00	268,600	
永大産業	100	295.00	29,500	
アートネイチャー	100	649.00	64,900	
バンダイナムコホールディングス	800	9,140.00	7,312,000	
共立印刷	200	124.00	24,800	
SHOEI	100	4,065.00	406,500	
フランスベッドホールディングス	100	923.00	92,300	
マーベラス	100	886.00	88,600	
パイロットコーポレーション	200	2,966.00	593,200	
萩原工業	100	1,427.00	142,700	
エイベックス	200	1,337.00	267,400	
トッパン・フォームズ	200	1,163.00	232,600	

フジシールインターナショナル	200	1,949.00	389,800
タカラトミー	400	904.00	361,600
廣濟堂	100	825.00	82,500
レック	100	1,352.00	135,200
三光合成	100	435.00	43,500
プロネクサス	100	1,134.00	113,400
ホクシン	100	115.00	11,500
大建工業	100	1,760.00	176,000
きもと	100	190.00	19,000
凸版印刷	1,500	1,522.00	2,283,000
大日本印刷	1,200	1,823.00	2,187,600
N I S S H A	200	1,359.00	271,800
藤森工業	100	4,585.00	458,500
ヴィア・ホールディングス	100	252.00	25,200
前澤化成工業	100	945.00	94,500
アシックス	800	1,860.00	1,488,000
J S P	100	1,738.00	173,800
ニチハ	100	3,400.00	340,000
エフピコ	200	4,165.00	833,000
ヤマハ	600	6,150.00	3,690,000
クリナップ	100	456.00	45,600
ピジョン	600	4,800.00	2,880,000
天馬	100	2,144.00	214,400
キングジム	100	885.00	88,500
象印マホービン	300	1,774.00	532,200
リンテック	200	2,384.00	476,800
信越ポリマー	100	1,032.00	103,200
東リ	200	241.00	48,200
イトーキ	200	327.00	65,400
任天堂	500	62,640.00	31,320,000
三菱鉛筆	200	1,324.00	264,800
タカラスタンダード	200	1,455.00	291,000
コクヨ	500	1,375.00	687,500
ナカバヤシ	100	611.00	61,100
ニフコ	400	3,775.00	1,510,000
オカムラ	400	923.00	369,200
バルカー	100	2,041.00	204,100
伊藤忠商事	6,600	2,980.50	19,671,300
丸紅	9,300	703.20	6,539,760
スクロール	100	975.00	97,500
ヨンドシーホールディングス	100	1,925.00	192,500
長瀬産業	500	1,507.00	753,500
蝶理	100	1,535.00	153,500
豊田通商	1,000	4,125.00	4,125,000
オンワードホールディングス	600	255.00	153,000
三共生興	100	465.00	46,500
兼松	400	1,328.00	531,200
美津濃	100	2,066.00	206,600
三井物産	7,700	1,931.00	14,868,700
東京エレクトロン	600	40,290.00	24,174,000

カメイ	100	1,210.00	121,000	
セイコーホールディングス	100	1,430.00	143,000	
山善	400	982.00	392,800	
住友商事	6,000	1,411.00	8,466,000	
日本ユニシス	300	4,040.00	1,212,000	
三菱商事	5,800	2,652.50	15,384,500	代用有価証券 5,200株
キヤノンマーケティングジャパン	200	2,400.00	480,000	
佐藤商事	100	913.00	91,300	
菱洋エレクトロ	100	2,902.00	290,200	
東京産業	100	604.00	60,400	
ユアサ商事	100	3,210.00	321,000	
トルク	100	250.00	25,000	
阪和興業	200	2,703.00	540,600	
正栄食品工業	100	3,705.00	370,500	
カナデン	100	1,209.00	120,900	
菱電商事	100	1,592.00	159,200	
ニプロ	700	1,242.00	869,400	
岩谷産業	200	6,560.00	1,312,000	
イワキ	100	633.00	63,300	
兼松エレクトロニクス	100	3,750.00	375,000	
三愛石油	200	1,080.00	216,000	
稲畑産業	200	1,473.00	294,600	
明和産業	100	447.00	44,700	
キムラタン	500	24.00	12,000	
ヤマエ久野	100	1,059.00	105,900	
ゴールドウイン	200	6,310.00	1,262,000	
ユニ・チャーム	2,000	4,663.00	9,326,000	
デザート	200	1,697.00	339,400	
ワキタ	200	1,005.00	201,000	
ヤマトインターナショナル	100	335.00	33,500	
東邦ホールディングス	300	1,998.00	599,400	
サンゲツ	300	1,563.00	468,900	
ミツウロコグループホールディングス	100	1,344.00	134,400	
伊藤忠エネクス	200	1,012.00	202,400	
サンリオ	300	1,555.00	466,500	
サンワテクノス	100	1,037.00	103,700	
リョーサン	100	2,306.00	230,600	
新光商事	100	752.00	75,200	
三信電気	100	1,884.00	188,400	
東陽テクニカ	100	1,131.00	113,100	
モスフードサービス	100	3,060.00	306,000	
加賀電子	100	2,473.00	247,300	
三益半導体工業	100	2,715.00	271,500	
ソーダニッカ	100	522.00	52,200	
立花エレテック	100	1,577.00	157,700	
木曽路	100	2,339.00	233,900	
SRSホールディングス	100	821.00	82,100	
千趣会	200	316.00	63,200	
タカキュー	100	148.00	14,800	

リテールパートナーズ	100	1,328.00	132,800
ケーヨー	200	738.00	147,600
上新電機	100	2,726.00	272,600
日本瓦斯	200	5,060.00	1,012,000
ロイヤルホールディングス	200	1,843.00	368,600
いなげや	100	1,680.00	168,000
チヨダ	100	919.00	91,900
ライフコーポレーション	100	3,205.00	320,500
リンガーハット	100	2,389.00	238,900
MrMaxHD	100	742.00	74,200
テナアライド	100	333.00	33,300
AOKIホールディングス	200	543.00	108,600
オークワ	100	1,251.00	125,100
コメリ	100	2,742.00	274,200
青山商事	200	608.00	121,600
しまむら	100	11,810.00	1,181,000
はせがわ	100	288.00	28,800
高島屋	700	990.00	693,000
松屋	200	883.00	176,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	400	769.00	307,600
丸井グループ	800	1,877.00	1,501,600
クレディセゾン	600	1,204.00	722,400
アクシアル リテイリング	100	4,930.00	493,000
イオン	3,600	3,308.00	11,908,800
イズミ	200	3,810.00	762,000
平和堂	200	2,145.00	429,000
フジ	100	1,958.00	195,800
ヤオコー	100	6,790.00	679,000
ゼビオホールディングス	100	874.00	87,400
ケーズホールディングス	800	1,402.00	1,121,600
PALTAC	200	5,390.00	1,078,000
三谷産業	100	425.00	42,500
日産東京販売ホールディングス	100	260.00	26,000
新生銀行	800	1,283.00	1,026,400
あおぞら銀行	600	1,969.00	1,181,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	64,800	475.30	30,799,440
りそなホールディングス	10,300	372.80	3,839,840
三井住友トラスト・ホールディングス	1,800	3,160.00	5,688,000
三井住友フィナンシャルグループ	6,600	3,315.00	21,879,000
千葉銀行	3,200	581.00	1,859,200
群馬銀行	2,000	328.00	656,000
武蔵野銀行	100	1,503.00	150,300
千葉興業銀行	200	237.00	47,400
筑波銀行	400	176.00	70,400
七十七銀行	300	1,328.00	398,400
青森銀行	100	2,324.00	232,400
秋田銀行	100	1,369.00	136,900
山形銀行	100	1,013.00	101,300
岩手銀行	100	1,951.00	195,100
東邦銀行	800	205.00	164,000

みちのく銀行	100	1,001.00	100,100	
ふくおかフィナンシャルグループ	900	1,912.00	1,720,800	
静岡銀行	2,300	762.00	1,752,600	
十六銀行	100	1,879.00	187,900	
スルガ銀行	800	309.00	247,200	
八十二銀行	2,100	344.00	722,400	
山梨中央銀行	100	800.00	80,000	
大垣共立銀行	200	1,981.00	396,200	
福井銀行	100	1,878.00	187,800	
北國銀行	100	2,534.00	253,400	
滋賀銀行	200	1,919.00	383,800	
南都銀行	100	1,692.00	169,200	
百五銀行	900	295.00	265,500	
京都銀行	300	5,500.00	1,650,000	
紀陽銀行	300	1,350.00	405,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	600	939.00	563,400	
山陰合同銀行	600	476.00	285,600	
中国銀行	800	815.00	652,000	
伊予銀行	1,300	606.00	787,800	
百十四銀行	100	1,492.00	149,200	
四国銀行	100	664.00	66,400	
阿波銀行	100	2,151.00	215,100	
大分銀行	100	2,020.00	202,000	
宮崎銀行	100	2,145.00	214,500	
佐賀銀行	100	1,298.00	129,800	
沖縄銀行	100	2,690.00	269,000	
琉球銀行	200	736.00	147,200	
セブン銀行	3,200	230.00	736,000	
みずほフィナンシャルグループ	12,900	1,400.00	18,060,000	
山口フィナンシャルグループ	1,200	600.00	720,000	
芙蓉総合リース	100	7,410.00	741,000	
みずほリース	100	3,285.00	328,500	
東京センチュリー	200	8,880.00	1,776,000	
SBIホールディングス	1,200	2,641.00	3,169,200	
日本証券金融	400	520.00	208,000	
アイフル	1,600	271.00	433,600	
日本アジア投資	100	231.00	23,100	
名古屋銀行	100	2,603.00	260,300	
北洋銀行	1,400	215.00	301,000	
愛媛銀行	100	954.00	95,400	
京葉銀行	400	403.00	161,200	
栃木銀行	500	170.00	85,000	
東和銀行	200	668.00	133,600	
福島銀行	100	208.00	20,800	
リコーリース	100	3,120.00	312,000	
イオンフィナンシャルサービス	600	1,267.00	760,200	
アコム	1,900	454.00	862,600	
ジャックス	100	1,922.00	192,200	
オリエントコーポレーション	2,600	122.00	317,200	
日立キャピタル	200	2,661.00	532,200	

オリックス	5,900	1,715.50	10,121,450
三菱UFJリース	2,100	526.00	1,104,600
ジャフコグループ	100	5,830.00	583,000
トモニホールディングス	700	304.00	212,800
大和証券グループ本社	7,100	489.10	3,472,610
野村ホールディングス	14,500	549.10	7,961,950
岡三証券グループ	800	372.00	297,600
丸三証券	300	513.00	153,900
東洋証券	300	135.00	40,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,000	310.00	310,000
水戸証券	300	248.00	74,400
いちよし証券	200	500.00	100,000
松井証券	500	819.00	409,500
SOMPOホールディングス	1,700	4,144.00	7,044,800
日本取引所グループ	2,600	2,462.50	6,402,500
マネックスグループ	900	570.00	513,000
極東証券	100	760.00	76,000
岩井コスモホールディングス	100	1,415.00	141,500
藍澤證券	200	825.00	165,000
フィデアホールディングス	900	108.00	97,200
池田泉州ホールディングス	1,100	149.00	163,900
アニコムホールディングス	300	1,152.00	345,600
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	2,300	3,015.00	6,934,500
マネーパートナーズグループ	100	206.00	20,600
スパークス・グループ	400	290.00	116,000
第一生命ホールディングス	5,000	1,606.00	8,030,000
東京海上ホールディングス	3,100	5,147.00	15,955,700
イー・ギャランティ	100	2,231.00	223,100
T&Dホールディングス	2,800	1,230.00	3,444,000
三井不動産	4,300	2,120.00	9,116,000
三菱地所	6,200	1,663.50	10,313,700
平和不動産	200	3,660.00	732,000
東京建物	900	1,412.00	1,270,800
ダイビル	200	1,200.00	240,000
京阪神ビルディング	200	1,598.00	319,600
住友不動産	2,100	3,144.00	6,602,400
テーオーシー	200	729.00	145,800
レオパレス21	800	159.00	127,200
スターツコーポレーション	100	2,721.00	272,100
フジ住宅	100	633.00	63,300
空港施設	100	488.00	48,800
ゴールドクレスト	100	1,759.00	175,900
リログループ	500	2,605.00	1,302,500
日神グループホールディングス	100	411.00	41,100
日本エスコン	200	725.00	145,000
タカラレーベン	400	334.00	133,600
AVANTIA	100	849.00	84,900
イオンモール	500	1,733.00	866,500

ランド	5,200	9.00	46,800	
カチタス	200	3,165.00	633,000	
東祥	100	1,524.00	152,400	
トーセイ	100	1,036.00	103,600	
サンフロンティア不動産	100	883.00	88,300	
エフ・ジェー・ネクスト	100	1,016.00	101,600	
グランディハウス	100	408.00	40,800	
東武鉄道	1,000	2,920.00	2,920,000	
相鉄ホールディングス	300	2,472.00	741,600	
東急	2,400	1,217.00	2,920,800	
京浜急行電鉄	1,200	1,645.00	1,974,000	
小田急電鉄	1,500	3,040.00	4,560,000	
京王電鉄	500	7,940.00	3,970,000	
京成電鉄	700	3,515.00	2,460,500	
富士急行	100	5,010.00	501,000	
東日本旅客鉄道	1,700	6,561.00	11,153,700	
西日本旅客鉄道	900	5,408.00	4,867,200	
東海旅客鉄道	800	14,515.00	11,612,000	
西武ホールディングス	1,200	959.00	1,150,800	
鴻池運輸	200	1,018.00	203,600	
西日本鉄道	300	2,810.00	843,000	
ハマキョウレックス	100	3,190.00	319,000	
近鉄グループホールディングス	900	4,360.00	3,924,000	
阪急阪神ホールディングス	1,200	3,345.00	4,014,000	
南海電気鉄道	400	2,555.00	1,022,000	
京阪ホールディングス	400	4,735.00	1,894,000	
名古屋鉄道	700	2,637.00	1,845,900	
山陽電気鉄道	100	2,006.00	200,600	
日本通運	300	7,750.00	2,325,000	
ヤマトホールディングス	1,300	2,857.00	3,714,100	
山九	200	3,885.00	777,000	
日新	100	1,245.00	124,500	
丸運	100	252.00	25,200	
丸全昭和運輸	100	3,310.00	331,000	
センコーグループホールディングス	500	968.00	484,000	
ニッコンホールディングス	300	2,132.00	639,600	
福山通運	100	4,145.00	414,500	
セイノーホールディングス	700	1,414.00	989,800	
日立物流	200	3,295.00	659,000	
丸和運輸機関	200	2,304.00	460,800	
C & F ロジホールディングス	100	1,920.00	192,000	
日本郵船	800	2,484.00	1,987,200	
商船三井	500	2,928.00	1,464,000	
川崎汽船	300	1,854.00	556,200	
明治海運	100	372.00	37,200	
飯野海運	400	407.00	162,800	
九州旅客鉄道	700	2,183.00	1,528,100	
S Gホールディングス	1,700	2,602.00	4,423,400	
日本航空	2,200	1,864.00	4,100,800	
A N Aホールディングス	2,500	2,221.00	5,552,500	

国際紙パルプ商事	200	243.00	48,600	
ブックオフグループホールディングス	100	854.00	85,400	
三菱倉庫	300	3,070.00	921,000	
三井倉庫ホールディングス	100	2,318.00	231,800	
住友倉庫	300	1,284.00	385,200	
東陽倉庫	200	309.00	61,800	
日本トランスシティ	200	536.00	107,200	
中央倉庫	100	1,134.00	113,400	
安田倉庫	100	931.00	93,100	
宇徳	100	466.00	46,600	
上組	500	1,864.00	932,000	
近鉄エクスプレス	200	2,652.00	530,400	
東海運	100	310.00	31,000	
エーアイティー	100	995.00	99,500	
TBSホールディングス	600	1,989.00	1,193,400	
日本テレビホールディングス	800	1,218.00	974,400	
朝日放送グループホールディングス	100	698.00	69,800	
テレビ朝日ホールディングス	300	1,958.00	587,400	
スカパーJ S A Tホールディングス	600	465.00	279,000	
テレビ東京ホールディングス	100	2,393.00	239,300	
ビジョン	100	878.00	87,800	
コネクシオ	100	1,378.00	137,800	
日本通信	800	182.00	145,600	
日本電信電話	11,000	2,636.00	28,996,000	
KDDI	7,600	3,101.00	23,567,600	
ソフトバンク	8,600	1,361.00	11,704,600	
光通信	100	21,500.00	2,150,000	
エムティーアイ	100	800.00	80,000	
GMOインターネット	300	2,962.00	888,600	
KADOKAWA	300	3,435.00	1,030,500	
学研ホールディングス	100	1,709.00	170,900	
ゼンリン	200	1,268.00	253,600	
インプレスホールディングス	100	177.00	17,700	
東京電力ホールディングス	8,200	397.00	3,255,400	
中部電力	2,900	1,301.00	3,772,900	
関西電力	3,600	1,030.50	3,709,800	
中国電力	1,400	1,271.00	1,779,400	
北陸電力	900	677.00	609,300	
東北電力	2,300	911.00	2,095,300	
四国電力	800	727.00	581,600	
九州電力	2,100	923.00	1,938,300	
北海道電力	900	438.00	394,200	
沖縄電力	200	1,396.00	279,200	
電源開発	800	1,664.00	1,331,200	
エフオン	100	1,083.00	108,300	
イーレックス	100	1,818.00	181,800	
レノバ	200	3,785.00	757,000	
東京瓦斯	1,800	2,260.00	4,068,000	
大阪瓦斯	1,700	1,940.00	3,298,000	
東邦瓦斯	500	6,160.00	3,080,000	

北海道瓦斯	100	1,563.00	156,300	
広島ガス	200	379.00	75,800	
西部瓦斯	100	2,849.00	284,900	
静岡ガス	300	952.00	285,600	
メタウォーター	100	2,386.00	238,600	
松竹	100	14,340.00	1,434,000	
東宝	600	4,035.00	2,421,000	
エイチ・アイ・エス	100	1,754.00	175,400	
エヌ・ティ・ティ・データ	2,500	1,546.00	3,865,000	
共立メンテナンス	200	3,425.00	685,000	
イチネンホールディングス	100	1,220.00	122,000	
建設技術研究所	100	2,484.00	248,400	
スペース	100	785.00	78,500	
アインホールディングス	100	6,550.00	655,000	
東京都競馬	100	4,395.00	439,500	
カナモト	200	2,255.00	451,000	
D T S	200	2,286.00	457,200	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	400	6,270.00	2,508,000	
シーイーシー	100	1,412.00	141,200	
カブコン	400	6,690.00	2,676,000	
西尾レントオール	100	2,197.00	219,700	
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	500	24.00	12,000	
日本空港ビルデング	300	5,490.00	1,647,000	
トランス・コスモス	100	2,763.00	276,300	
乃村工藝社	400	767.00	306,800	
ジャステック	100	1,208.00	120,800	
S C S K	200	6,630.00	1,326,000	
日本管財	100	2,030.00	203,000	
トーカイ	100	2,013.00	201,300	
セコム	900	9,423.00	8,480,700	
アイネス	100	1,421.00	142,100	
丹青社	200	755.00	151,000	
メイテック	100	5,470.00	547,000	
T K C	100	6,850.00	685,000	
富士ソフト	100	5,510.00	551,000	
応用地質	100	1,281.00	128,100	
船井総研ホールディングス	200	2,393.00	478,600	
N S D	300	1,980.00	594,000	
オオバ	100	731.00	73,100	
コナミホールディングス	300	6,580.00	1,974,000	
ベネッセホールディングス	300	2,024.00	607,200	
イオンディライト	100	2,749.00	274,900	
ダイセキ	200	3,365.00	673,000	
日鉄物産	100	3,620.00	362,000	
トラスコ中山	200	2,731.00	546,200	
ヤマダホールディングス	3,200	535.00	1,712,000	
オートバックスセブン	400	1,421.00	568,400	
モリト	100	600.00	60,000	

アーランドサカモト	100	1,464.00	146,400	
ニトリホールディングス	400	20,810.00	8,324,000	
グルメ杵屋	100	973.00	97,300	
愛眼	100	222.00	22,200	
吉野家ホールディングス	300	2,172.00	651,600	
加藤産業	100	3,405.00	340,500	
イノテック	100	1,244.00	124,400	
イエローハット	200	1,751.00	350,200	
JBC Cホールディングス	100	1,484.00	148,400	
J Kホールディングス	100	797.00	79,700	
サガミホールディングス	100	1,168.00	116,800	
日伝	100	2,190.00	219,000	
関西スーパーマーケット	100	1,130.00	113,000	
ミロク情報サービス	100	2,139.00	213,900	
北沢産業	100	261.00	26,100	
因幡電機産業	300	2,448.00	734,400	
王将フードサービス	100	5,760.00	576,000	
プレナス	100	2,016.00	201,600	
ミニストップ	100	1,408.00	140,800	
アークス	200	2,336.00	467,200	
バローホールディングス	200	2,508.00	501,600	
ミスミグループ本社	1,200	3,510.00	4,212,000	
アルテック	100	275.00	27,500	
大 庄	100	988.00	98,800	
ファーストリテイリング	100	91,520.00	9,152,000	
ソフトバンクグループ	7,500	8,458.00	63,435,000	
スズケン	400	4,055.00	1,622,000	
サンドラッグ	400	4,245.00	1,698,000	
サックスパー ホールディングス	100	532.00	53,200	
ジェコス	100	941.00	94,100	
グローセル	100	504.00	50,400	
ベルーナ	200	1,124.00	224,800	
合計	998,400		2,380,284,570	

(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】

2021年2月26日現在

資産総額	41,672,109円
負債総額	45,818円
純資産総額(-)	41,626,291円
発行済数量	44,188,475口
1口当たり純資産額(/)	0.9420円

(参考)

太陽財形公社債 マザーファンド

2021年2月26日現在

資産総額	71,624,198円
負債総額	0円
純資産総額(-)	71,624,198円
発行済数量	62,219,853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

2021年2月26日現在

資産総額	2,458,520,415円
負債総額	9,348,709円
純資産総額(-)	2,449,171,706円
発行済数量	950,098,020口
1口当たり純資産額(/)	2.5778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た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(2021年2月26日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2021年2月26日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年2月26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	1,570,560,416,431
追加型株式投資信託	851	15,220,981,170,031
単位型公社債投資信託	32	72,197,313,686
単位型株式投資信託	204	1,266,892,227,814
合計	1,113	18,130,631,127,962

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35期事業年度（自2019年4月1日至2020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36期中間会計期間（自2020年4月1日至2020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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	41,087,475	32,932,013
金銭の信託	18,773,228	28,548,165
有価証券	153,518	996
未収委託者報酬	12,438,085	11,487,393
未収運用受託報酬	3,295,109	4,674,225
未収投資助言報酬	327,064	331,543
未収収益	56,925	11,674
前払費用	573,874	480,129
その他	491,914	2,815,351
流動資産計	77,197,195	81,281,494
固定資産		
有形固定資産		
建物	1,461,316	1,278,455
1 建物	1,096,916	1,006,793
器具備品	1 364,399	1 270,768
建設仮勘定	-	894
無形固定資産		
ソフトウェア	2,411,540	3,524,781
ソフトウェア仮勘定	885,545	3,299,065
1,522,040	221,784	
電話加入権	3,931	3,931
電信電話専用施設利用権	23	-
投資その他の資産		
投資有価証券	9,269,808	9,482,127
関係会社株式	1,611,931	261,361
4,499,196	5,299,196	
長期差入保証金	1,312,328	1,302,402
繰延税金資産	1,748,459	2,508,004
その他	97,892	111,162
固定資産計	13,142,665	14,285,364
資産合計	90,339,861	95,566,859

(単位:千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	2,183,889	3,702,906
未払金	5,697,942	4,803,140
未払収益分配金	1,053	966
未払償還金	48,968	9,999
未払手数料	4,883,723	4,582,140
その他未払金	764,196	210,034
未払費用	6,724,986	6,673,320
未払法人税等	3,341,238	4,090,268
未払消費税等	576,632	1,338,183
賞与引当金	1,344,466	1,373,328
役員賞与引当金	48,609	65,290
流動負債計	19,917,766	22,046,438
固定負債		
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
時効後支払損引当金	177,851	174,139
固定負債計	2,073,009	2,293,087
負債合計	21,990,776	24,339,526
(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	45,949,372	49,674,383
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	45,826,079	49,551,090
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	14,146,079	17,871,090
株主資本計	67,502,329	71,227,341
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	846,755	7
評価・換算差額等計	846,755	7
純資産合計	68,349,085	71,227,333
負債・純資産合計	90,339,861	95,566,859

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	84,812,585		84,426,075	
運用受託報酬	16,483,356		16,912,305	
投資助言報酬	1,235,553		1,208,954	
その他営業収益	113,622		68,156	
営業収益計		102,645,117		102,615,492
営業費用				
支払手数料	36,100,556		34,980,736	
広告宣伝費	387,028		340,791	
公告費	375		375	
調査費	24,389,003		25,132,268	
調査費	9,956,757		10,586,542	
委託調査費	14,432,246		14,545,725	
委託計算費	936,075		698,723	
営業雑経費	1,254,114		990,002	
通信費	47,007		44,209	
印刷費	978,185		738,330	
協会費	63,558		71,386	
諸会費	22,877		22,790	
支払販売手数料	142,485		113,286	
営業費用計		63,067,153		62,142,897
一般管理費				
給料	10,859,354		10,817,861	
役員報酬	189,198		174,795	
給料・手当	9,098,957		9,087,800	
賞与	1,571,197		1,555,264	
交際費	60,115		40,436	
寄付金	7,255		8,906	
旅費交通費	361,479		320,037	
租税公課	588,172		651,265	
不動産賃借料	1,511,876		1,479,503	
退職給付費用	521,184		505,189	
固定資産減価償却費	590,667		882,526	
福利厚生費	45,292		44,352	
修繕費	16,247		1,843	
賞与引当金繰入額	1,344,466		1,373,328	
役員賞与引当金繰入額	48,609		65,290	
機器リース料	130		233	
事務委託費	3,302,806		3,625,424	
事務用消耗品費	131,074		104,627	
器具備品費	8,112		1,620	
諸経費	188,367		197,094	
一般管理費計		19,585,212		20,119,543
営業利益		19,992,752		20,353,050

(単位:千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	1,749		4,440	
受取配当金	73,517		11,185	
時効成立分配金・償還金	8,582		49,164	
投資信託償還益	-		5,528	
受取負担金	177,066		297,886	
雑収入	24,919		7,394	
時効後支払損引当金戻入額	19,797		3,473	
営業外収益計		305,633		379,073
営業外費用				
為替差損	17,542		19,750	
投資信託償還損	-		1	
金銭の信託運用損	175,164		169,505	
システム解約料	-		31,680	
雑損失	5,659		104	
営業外費用計		198,365		221,042
経常利益		20,100,019		20,511,082
特別利益				
投資有価証券売却益	353,644		1,169,758	
特別利益計		353,644		1,169,758
特別損失				
固定資産除却損	1 19,121		1 16,085	
特別損失計		19,121		16,085
税引前当期純利益		20,434,543		21,664,754
法人税、住民税及び事業税		6,386,793		7,045,579
法人税等調整額		71,767		385,835
法人税等合計		6,315,026		6,659,743
当期純利益		14,119,516		15,005,011

(3)【株主資本等変動計算書】

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
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

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		別途 積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	14,146,079	45,949,372	67,502,329
当期変動額									
剰余金の配当							11,280,000	11,280,000	11,280,000
当期純利益							15,005,011	15,005,011	15,005,011
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,725,011	3,725,011	3,725,011
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
建物	229,897	320,020
器具備品	927,688	949,984

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)	第35期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)
建物	1,550	-
器具備品	439	9,609
ソフトウエア	17,130	6,475

(株主資本等変動計算書関係)

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

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					

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2020年6月17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
2020年6月17日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種 類株式					

（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	-

第35期(2020年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	32,932,013	32,932,013	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	28,548,165	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	11,487,393	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	4,674,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	2,988	2,988	-
資産計	77,644,787	77,644,787	-
(1) 未払手数料	4,582,140	4,582,140	-
負債計	4,582,140	4,582,140	-

(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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非上場株式	276,764	259,369
関係会社株式	4,499,196	5,299,196

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第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 その他有価証券(投資信託)	153,518	1,995	996	-

第35期(2020年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	32,932,013	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	996	994	997	-

(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34期の貸借対照表計上額4,499,196千円、第35期の貸借対照表計上額5,299,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

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276,764千円)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35期(2020年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計			
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	2,988	3,000	11
小計	2,988	3,000	11
合計	2,988	3,000	11

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

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	-	-	-

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	1,298,377	1,169,758	-
投資信託	159,526	5,528	1

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,154,607	2,289,044
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の発生額	10,147	18,448
退職給付の支払額	158,018	187,749
その他	438	1,476
退職給付債務の期末残高	2,289,044	2,422,901

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

(千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未積立退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未認識数理計算上の差異	150,568	130,155
未認識過去勤務費用	243,317	173,798
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の費用処理額	43,920	38,861
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,519
その他	3,640	11,303
確定給付制度に係る退職給付費用	411,963	401,711

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020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. 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104,720千円、当事業年度103,477千円であります。

(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34期	第35期
	(2019年3月31日現在)	(2020年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	173,805	221,053
未払事業所税	10,915	10,778
賞与引当金	411,675	420,513
未払法定福利費	80,253	78,439
未払給与	7,961	10,410
受取負担金	138,994	47,781
運用受託報酬	102,490	331,395
資産除去債務	10,152	14,116
減価償却超過額(一括償却資産)	4,569	50,942
減価償却超過額	125,839	82,684
繰延資産償却超過額(税法上)	135,542	323,132
退職給付引当金	580,297	648,821
時効後支払損引当金	54,458	53,321
ゴルフ会員権評価損	7,360	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
その他	29,494	11,532
その他有価証券評価差額金	-	3
繰延税金資産小計	2,069,527	2,508,004
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,069,527	2,508,004
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	321,067	-
繰延税金負債合計	321,067	-
繰延税金資産の純額	1,748,459	2,508,004

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳
 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	104,326,078千円	94,605,736千円
資産合計	104,326,078千円	94,605,736千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	10,571,428千円	8,278,713千円
負債合計	10,571,428千円	8,278,713千円
純資産	93,754,650千円	86,327,023千円

(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	66,696,733千円	62,885,491千円
顧客関連資産	39,959,586千円	34,810,031千円

(2) 損益計算書項目

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	9,043,138千円	8,954,439千円
経常利益	9,043,138千円	8,954,439千円
税引前当期純利益	9,091,728千円	9,111,312千円
当期純利益	7,489,721千円	7,536,465千円
1株当たり当期純利益	187,243円04銭	188,411円64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	5,241,252千円	5,149,555千円

(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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)及び第35期(自 2019年4月1日 至 2020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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

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。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

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

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業 上 の関 係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	5,793,912	未払 手数料	1,112,061
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	10,294,840	未払 手数料	1,231,431

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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	1,708,727円13銭	1,780,683円32銭
1株当たり当期純利益金額	352,987円92銭	375,125円27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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
当期純利益金額	14,119,516千円	15,005,011千円
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	14,119,516千円	15,005,011千円
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36期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		27,281,363
金銭の信託		25,870,423
有価証券		996
未収委託者報酬		13,747,204
未収運用受託報酬		3,023,356
未収投資助言報酬		304,673
未収収益		24,940
前払費用		757,672
その他		2,912,168
	流動資産計	73,922,799
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	961,771
器具備品	1	237,569
無形固定資産		
ソフトウェア		3,099,921
ソフトウェア仮勘定		556,224
電話加入権		3,931
投資その他の資産		
投資有価証券		261,361
関係会社株式		5,299,196
長期差入保証金		1,295,930
繰延税金資産		2,294,343
その他		793,037
	固定資産計	14,803,286
資産合計		88,726,085

(単位:千円)

	第36期中間会計期間末 (2020年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,297,202
未払金	5,820,782
未払収益分配金	899
未払償還金	19,850
未払手数料	5,549,722
その他未払金	250,310
未払費用	7,902,650
未払法人税等	2,901,506
未払消費税等	824,900
前受収益	20,779
賞与引当金	1,126,713
役員賞与引当金	34,112
流動負債計	19,928,648
固定負債	
退職給付引当金	2,207,043
時効後支払損引当金	156,886
固定負債計	2,363,929
負債合計	22,292,578
(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	44,880,558
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	44,757,265
別途積立金	31,680,000
繰越利益剰余金	13,077,265
株主資本計	66,433,515
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	8
評価・換算差額等計	8
純資産合計	66,433,506
負債・純資産合計	88,726,085

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	40,520,928	
運用受託報酬	6,813,891	
投資助言報酬	548,146	
その他営業収益	773,786	
	営業収益計	48,656,752
営業費用		
支払手数料	16,685,574	
広告宣伝費	116,359	
調査費	12,452,140	
調査費	4,305,114	
委託調査費	8,147,025	
委託計算費	269,176	
営業雑経費	450,999	
通信費	24,247	
印刷費	314,201	
協会費	20,394	
諸会費	32,852	
支払販売手数料	59,302	
	営業費用計	29,974,250
一般管理費		
給料	4,693,004	
役員報酬	75,939	
給料・手当	4,496,351	
賞与	120,714	
交際費	5,108	
寄付金	6,331	
旅費交通費	20,383	
租税公課	277,754	
不動産賃借料	734,008	
退職給付費用	267,068	
固定資産減価償却費	1 534,020	
福利厚生費	17,379	
修繕費	511	
賞与引当金繰入額	1,126,713	
役員賞与引当金繰入額	34,112	
機器リース料	139	
事務委託費	1,899,643	
事務用消耗品費	35,787	
器具備品費	265	
諸経費	66,792	
	一般管理費計	9,719,026
営業利益		8,963,474

(単位:千円)

	第36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	17,653	
受取配当金	2,356	
時効成立分配金・償還金	176	
時効後支払損引当金戻入額	16,343	
為替差益	8,484	
金銭の信託運用損益	1,367,091	
雑収入	1,361	
営業外収益計		1,413,467
経常利益		10,376,942
特別損失		
固定資産除却損	0	
特別損失計		0
税引前中間純利益		10,376,942
法人税、住民税及び事業税		2,957,106
法人税等調整額		213,661
法人税等合計		3,170,767
中間純利益		7,206,174

(3) 中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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	17,871,090
当中間期変動額							
剰余金の配当							12,000,000
中間純利益							7,206,174
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	-	-	-	-	-	-	4,793,825
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	13,077,265

	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	49,674,383	71,227,341	7	7	71,227,333
当中間期変動額					
剰余金の配当	12,000,000	12,000,000			12,000,000
中間純利益	7,206,174	7,206,174			7,206,174
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額 合計	4,793,825	4,793,825	0	0	4,793,826
当中間期末残高	44,800,558	66,433,515	8	8	66,433,506

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36期中間会計期間末 （2020年9月30日現在）	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	建物	365,042千円
	器具備品	980,577千円

（中間損益計算書関係）

項目	第36期中間会計期間 （自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）	
1. 減価償却実施額	有形固定資産	79,115千円
	無形固定資産	454,905千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第36期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種類 株式				

（2）基準日が当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36期中間会計期間末(2020年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

2020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	27,281,363	27,281,363	-
(2) 金銭の信託	25,870,423	25,870,423	-
(3) 未収委託者報酬	13,747,204	13,747,204	-
(4) 未収運用受託報酬	3,023,356	3,023,356	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	2,987	2,987	-
資産計	69,925,335	69,925,335	-
(1) 未払手数料	5,549,722	5,549,722	-
負債計	5,549,722	5,549,722	-

(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、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	5,299,196

非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 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36期中間会計期間末

(2020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5,299,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

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 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	2,987	3,000	12
小計	2,987	3,000	12
合計	2,987	3,000	12

(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

2020年4月1日から2020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	90,405,440千円
資産合計	90,405,440千円
流動負債	- 千円
固定負債	7,722,834千円
負債合計	7,722,834千円
純資産	82,682,605千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額60,979,870千円及び顧客関連資産の金額32,301,694千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	4,411,813千円
経常利益	4,411,813千円
税引前中間純利益	4,411,813千円
中間純利益	3,644,417千円
1株当たり中間純利益	91,110円42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2,508,336千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36期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020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36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,660,837円67銭
1株当たり中間純利益金額	180,154円36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いません。

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36期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
中間純利益金額	7,206,174千円
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	7,206,174千円
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) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
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

2020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2020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を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2020年5月1日	有価証券報告書
2020年5月1日	有価証券届出書
2020年11月2日	半期報告書
2020年11月2日	有価証券届出書

独立監査人の監査報告書

2020年5月27日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第35期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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

2021年3月12日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬 印
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている太陽財形株投 太陽一般財形 30の2020年2月4日から2021年2月1日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、太陽財形株投 太陽一般財形 30の2021年2月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、アセットマネジメントOne株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年11月26日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	丘本 正彦 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	長谷川 敬 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間(2020年4月1日から2020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。

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2020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(2020年4月1日から2020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。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。