

【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】	平成30年7月20日提出
【計算期間】	第23特定期間(自 平成29年10月21日至 平成30年4月20日)
【ファンド名】	新光7資産バランスファンド
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	三木谷 正直
【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/内外/資産複合に属し、主として投資信託証券に投資し、安定した収益の確保と投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

委託者は、受託者と合意のうえ、金2,000億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	国内	株式
	海外	債券
追加型	内外	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。
内外	目論見書または投資信託約款において、国内および海外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。
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 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (含む日本)	ファミリーファンド
	年2回	日本	
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回	北米	ファンド・オブ・ファンズ
	年6回(隔月)	欧州	
	年12回(毎月)	アジア	為替ヘッジ
	日々	オセアニア	
不動産投信	その他()	中南米	あり()
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式一 般、債券一般、不動 産投信)) (資産配分 固定型))		アフリカ	
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東(中東)	なし
		エマージング	

(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、不動産投信)) (資産配分固定型))	投資信託証券への投資を通じて、実質的に株式一般、債券一般、不動産投信の複数の資産に投資を行います。 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12回(毎月)	目論見書または投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル(含む日本) エマージング	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世界(含む日本)・エマージング地域(複数の新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

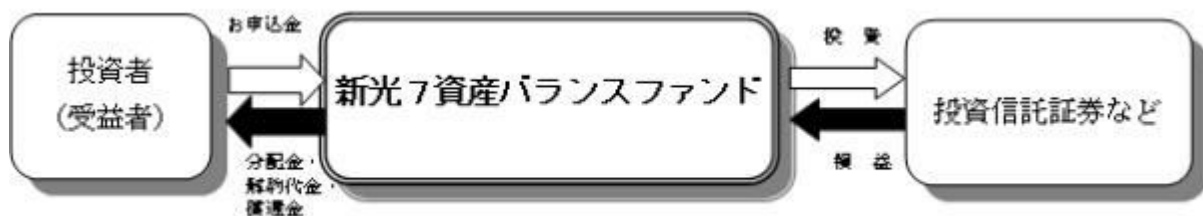
ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。
為替ヘッジなし ^(注)	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

(注)属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

当ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用します。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(<http://www.toushin.or.jp/>)をご参照ください。

当ファンドは、投資対象である投資信託証券へ投資を行います。その投資成果は収益分配金、解約代金、償還金として、受益者に支払われます。



b. ファンドの特色

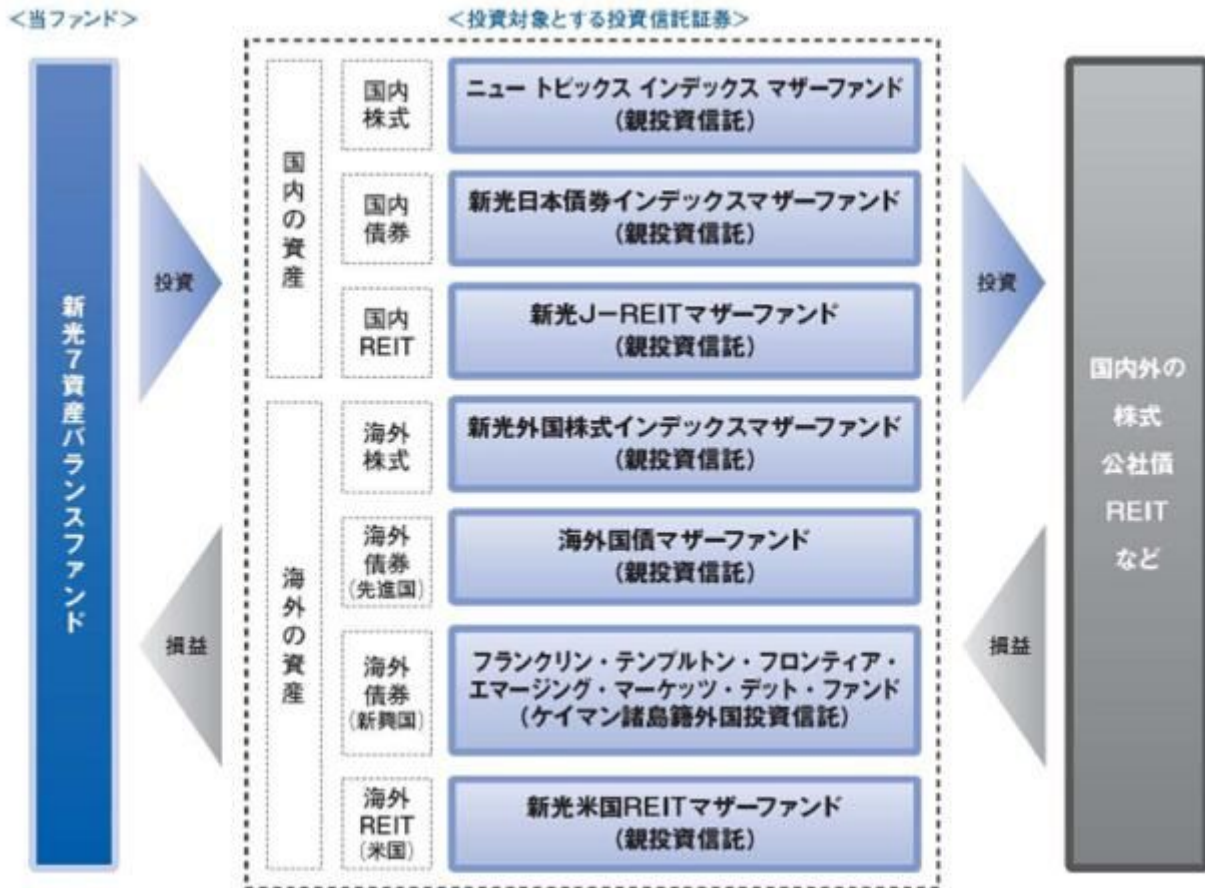
1. 7つの投資信託証券を通じて、国内外の各種資産(株式、公社債、不動産投資信託証券)にバランスよく分散投資します。

国内外の、株式、公社債および不動産投資信託証券(以下「REIT」といいます。)に実質的に投資することにより、リスク分散を図りながら、安定した収益の確保と投資信託財産の長期的な成長を目指すファンド・オブ・ファンズです。

投資信託証券の組入比率は、原則として、高位とすることを基本とします。

投資信託証券に含まれる外貨建資産については、原則として当ファンドにおいて為替ヘッジを行いません。

フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンドへの投資にあたっては、フランクリン テンプレトン インベストメント マネジメント リミテッドから投資助言および情報提供を受けます。



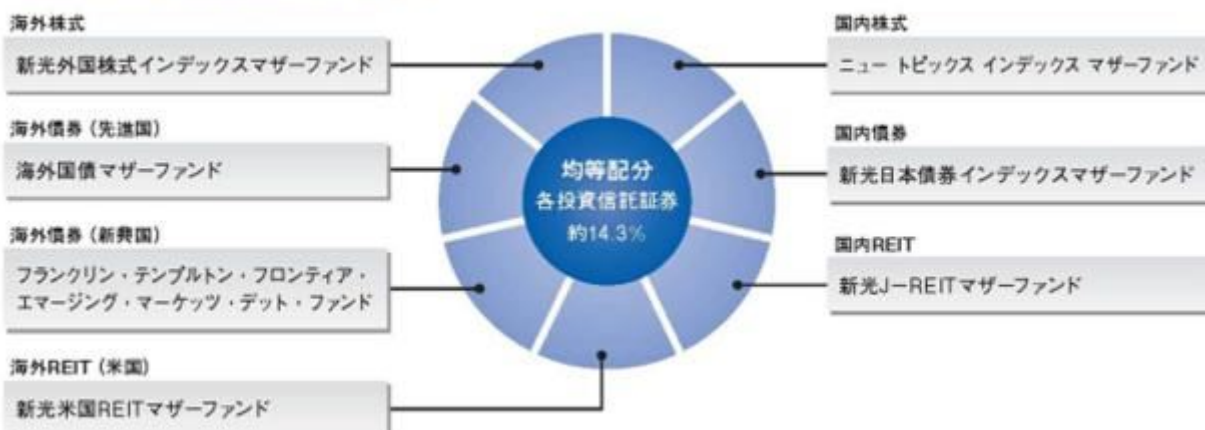
2. 基本投資配分比率に基づき、各投資信託証券に投資を行います。 基本投資配分比率は均等とします。

基本投資配分比率は、各投資信託証券につき純資産総額に対し約14.3%となります。

各投資信託証券の組入比率については、原則として、6ヵ月ごとにチェックを行い、基本投資配分比率に対し±5%の範囲を超過している場合には調整を行います。

実質的に投資している資産の値動きや余裕資金を保有することなどの影響により、各投資信託証券の組入比率は、基本投資配分比率からかい離します。

<基本投資配分比率のイメージ図>



当ファンドの資金動向、市場動向などによっては、上記のような運用ができない場合があります。

分配方針

原則として、毎月20日（休業日の場合は翌営業日。）の決算時に、収益の分配を行います。



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

分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を基礎として安定した分配を行うことを目標に決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

上記にかかる分配金のほか、分配対象額の範囲内で基準価額水準や市況動向などを勘案して委託会社が決定する額を付加して分配する場合があります。

留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。

運用状況により分配金額は変動します。

上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

【収益分配金に関する留意事項】

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。

投資信託から分配金が支払われるイメージ



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。

分配金額と基準価額の関係(イメージ)

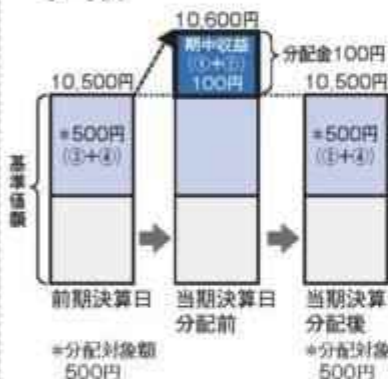
分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

①配当等収益(経費控除後)、②有価証券売買益・評価益(経費控除後)、③分配準備積立金、④収益調整金

計算期間中に発生した収益が中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

ケースA



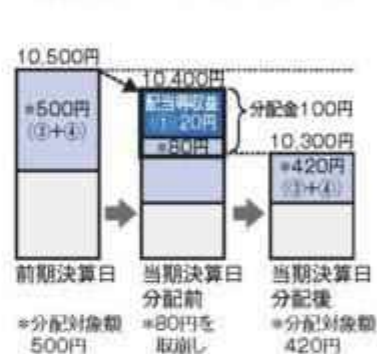
ケースB

<前期決算日から基準価額が上昇した場合>



ケースC

<前期決算日から基準価額が下落した場合>



上図のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

ケースA: 分配金受取額100円 + 当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円 = 100円

ケースB: 分配金受取額100円 + 当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円 = 50円

ケースC: 分配金受取額100円 + 当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円 = ▲100円

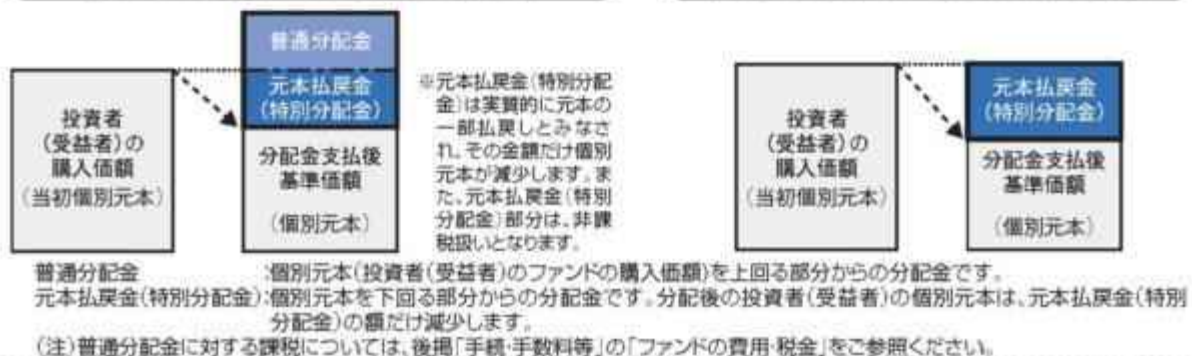
★A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではないのでご注意ください。

投資者(受益者)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かさった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



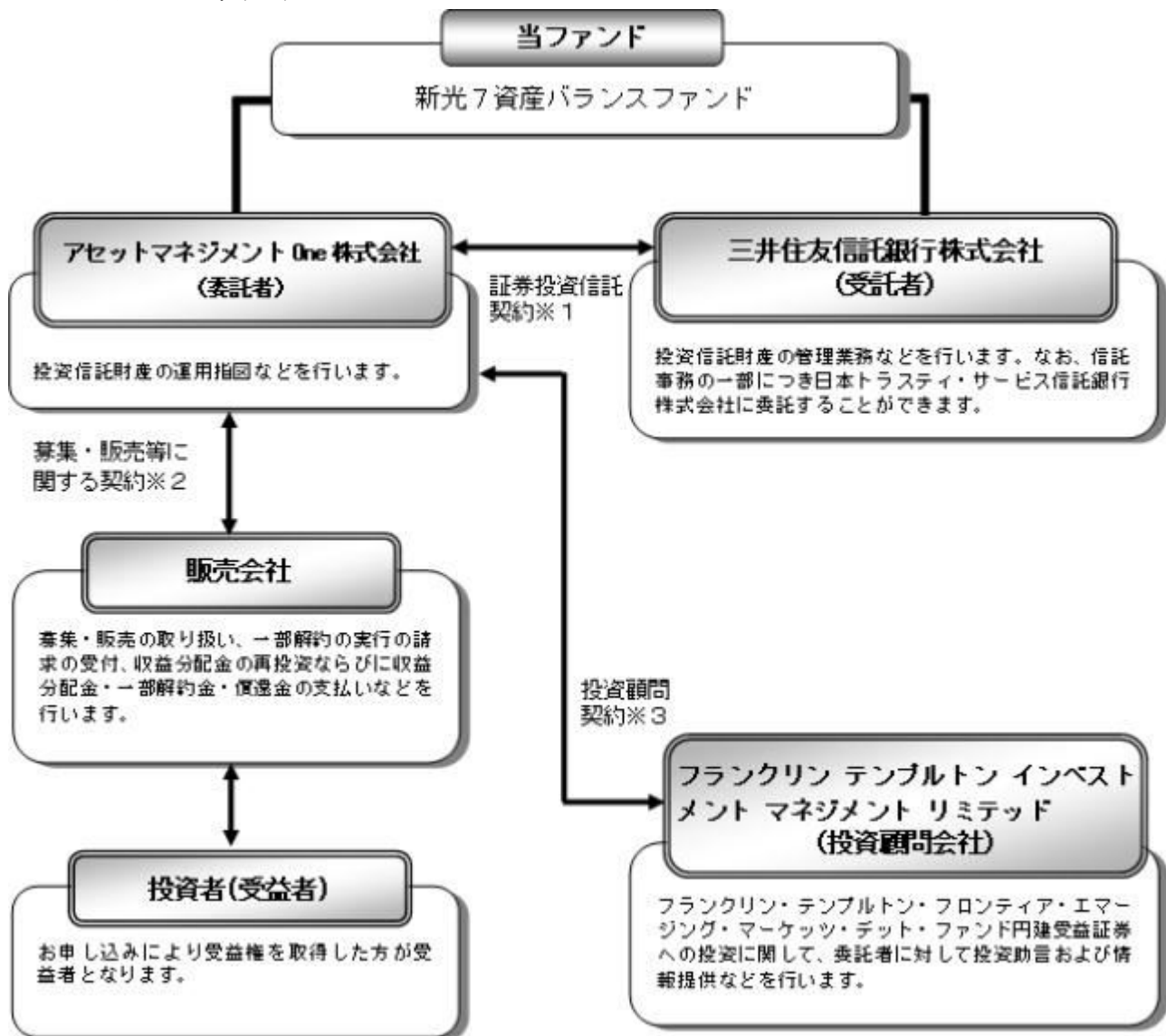
(2) 【ファンドの沿革】

平成18年10月31日
平成28年10月1日

投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始
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。

3 投資顧問契約

委託者と投資顧問会社との間において「投資顧問契約」を締結しており、投資顧問会社が提供する役務、委託者への報告、投資顧問会社に対する報酬、契約の期間等を規定しています。

当ファンドの運用は「ファンド・オブ・ファンズ方式」で行います。

ファンド・オブ・ファンズとは、投資信託証券への投資を目的とする投資信託のことで、一

般に投資対象に選んだ複数の投資信託証券を組み入れて運用する仕組みを「ファンド・オブ・ファンズ方式」といいます。



б．委託会社の概況

(イ) 資本金の額 20億円（平成30年 4月27日現在）

(ロ) 委託会社の沿革

昭和60年7月1日	会社設立
平成10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
平成10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
平成11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、商号を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする
平成20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
平成28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

(ハ) 大株主の状況

(平成30年 4月27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、投資信託証券を主要投資対象として、安定した収益の確保と投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

b. 運用の方法

(イ) 主要投資対象

投資信託証券を主要投資対象とします。

(ロ) 投資態度

以下の投資信託証券を通じて、実質的にわが国および海外の、株式、公社債および不動産投資信託証券に分散投資を行い、安定した収益の確保と投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

内国証券投資信託(親投資信託)	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
内国証券投資信託(親投資信託)	新光日本債券インデックスマザーファンド受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	新光J-REITマザーファンド受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	新光外国株式インデックスマザーファンド受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	海外国債マザーファンド受益証券
ケイマン諸島籍外国投資信託	フランクリン・テンプレトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド 円建受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	新光米国REITマザーファンド受益証券

投資信託証券の組入比率は、原則として、高位とすることを基本とし、基本投資配分比率に基づき各投資信託証券に投資を行います。基本投資配分比率は、純資産総額に対する各投資信託証券の構成比率が均等となる率とします。

各投資信託証券の構成比率については、原則として、6ヵ月ごとにチェックを行い、基本投資配分比率に対し一定の範囲を超過している場合には調整を行います。

投資信託証券に含まれる外貨建資産については、原則として当ファンドにおいて為替ヘッジを行いません。

フランクリン・テンプレトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド円建受益証券への投資にあたっては、フランクリン テンプレトン インベストメント マネジメント リミテッドから投資助言および情報提供を受けます。

当ファンドの資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

a. 投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)

- イ．有価証券
- ロ．金銭債権
- ハ．約束手形
- 2．次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形
- b．運用の指図範囲
 - (イ) 委託者は、信託金を、主として次の第1号に掲げる外国投資信託の受益証券および第2号から第7号に掲げる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であるマザーファンドの受益証券ならびに第8号から第12号に掲げる有価証券（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。）に投資することを指図します。
 - 1．ケイマン諸島籍外国投資信託 フランクリン・テンプルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンドの円建受益証券
 - 2．証券投資信託 ニュー トピックス インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券
 - 3．証券投資信託 新光日本債券インデックスマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券
 - 4．証券投資信託 新光外国株式インデックスマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券
 - 5．証券投資信託 海外国債マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券
 - 6．証券投資信託 新光J-REITマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券
 - 7．証券投資信託 新光米国REITマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券
 - 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、前号の証券の性質を有するもの
 - 10．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（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を除きます。）
 - 11．外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 12．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。）なお、第1号に掲げる外国投資信託の受益証券および第2号から第7号に掲げる証券投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）を以下「投資信託証券」といい、第5号の証券を以下「公社債」といいます。公社債にかかる運用の指図は短期社債等への投資ならびに買い現先取引（売り戻し条件付きの買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借り入れ）に限り行うことができます。
 - (ロ) 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（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含みません。）により運用することを指図することができます。
 - 1．預金
 - 2．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。）
 - 3．コール・ローン
 - 4．手形割引市場において売買される手形

（八）上記（イ）の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、上記（ロ）に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

当ファンドが投資する投資信託証券の概要

1. ニュー トピックス インデックス マザーファンドの概要

ファンド名	ニュー トピックス インデックス マザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> 東証株価指数に連動する投資成果を目指した運用を行います。 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。 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。 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などやむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 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。
信託期間	無期限
決算日	毎年1月14日
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。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成14年1月15日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

東証株価指数について

東証株価指数（TOPIX）とは、東京証券取引所第一部に上場しているすべての銘柄の時価総額を指数化することにより、市場全体の株価の変動を捉えようとする株価指数であり、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、公表を行っています。

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。

ニュー トピックス インデックス マザーファンドは、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、ニュー トピックス インデックス マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。

運用プロセス

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

ステップ 1

ポートフォリオの構築 (頻度：適宜)

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



ステップ 2

売買執行 (頻度：適宜)

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

なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは平成30年 4月27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. 新光日本債券インデックスマザーファンドの概要

ファンド名	新光日本債券インデックスマザーファンド
形態	親投資信託

運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA - B P I 総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ・公社債の組入比率については、原則として高位を保ちます。 ・ただし、ファンドの資金動向、市場動向などによっては、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・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、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り。）の行使により取得したものに限りません。 ・外貨建資産への投資は行いません。
信託期間	無期限
決算日	毎年11月10日（休業日の場合は翌営業日）
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。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成17年8月17日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

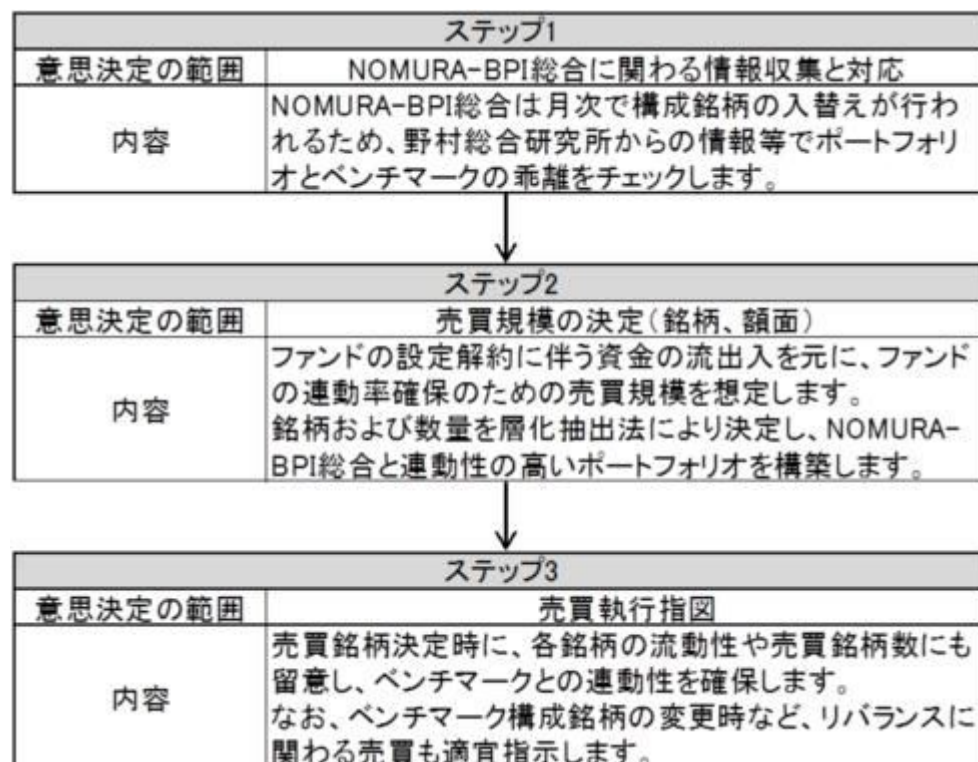
NOMURA - B P I 総合について

NOMURA - B P I 総合とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募利付債券市場全体の動向を表す投資収益指標で、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。

NOMURA - B P I 総合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。

運用プロセス

新光日本債券インデックスマザーファンドは、以下のプロセスにより「NOMURA - B P I 総合」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、市況動向等によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは平成30年 4月27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。

3. 新光J-REITマザーファンドの概要

ファンド名	新光J-REITマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として東証REIT指数の採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うことにより、東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果を目指した運用を行います。 ・不動産投資信託証券の組入比率は原則として高位を保ちます。 ・大量の追加設定・換金が発生した場合、市況動向に急激な変化が生じた場合ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合などやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・不動産投資信託証券、新投資口予約権証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外には投資を行いません。 ・不動産投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ・同一銘柄の不動産投資信託証券の投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証REIT指数における時価総額構成割合が30%を上回る銘柄については、当該構成割合以内の率を上限として組み入れることができるものとします。 ・外貨建資産への直接投資は行いません。
信託期間	無期限
決算日	毎年10月20日（休業日の場合は翌営業日）
収益配分方針	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。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成18年10月31日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

東証REIT指数（配当込み）について

東証REIT指数（配当込み）は、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。）に上場しているREIT全銘柄を対象とした時価総額加重平均の指数で、東京証券取引所上場のREIT全体の値動きを、配当金を反映させたうえで表す指数です。なお、2017年1月31日より、浮動株比率が考慮された指数となっています。

東証REIT指数（配当込み）の指数値および東証REIT指数の商標は、**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REIT指数（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数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REIT指数（配当込み）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数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REIT指数（配当込み）の指数値および東証REIT指数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REIT指数（配当込み）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REIT指数（配当込み）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REIT指数（配当込み）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。

新光J-REITマザーファンドおよび新光J-REIT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、新光J-REITマザーファンドおよび新光J-REIT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、新光J-REITマザーファンドおよび新光J-REIT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、委託会社または新光J-REITマザーファンドおよび新光J-REITマザー

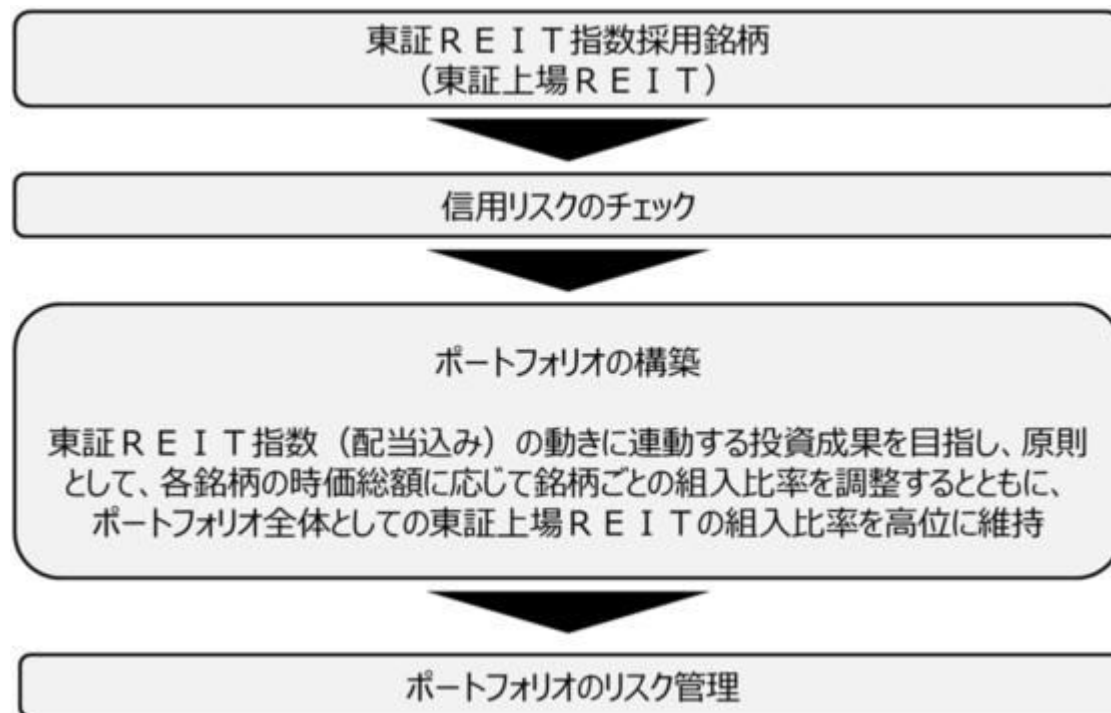
ファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数（配当込み）の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は新光J-REITマザーファンドおよび新光J-REIT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。

新光J-REITマザーファンドは、東証REIT指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、新光J-REITマザーファンドの基準価額と東証REIT指数の指数値の動向がかい離することがあります。

運用プロセス

新光J-REITマザーファンドは、以下のプロセスにより「東証REIT指数（配当込み）」に連動する投資成果をめざした運用を行います。



1. 原則として、東証REIT指数採用銘柄をすべてポートフォリオに組入れます。ただし、財務データ分析等に基づき信用リスクをチェックし、信用リスクが高いと判断される銘柄については、東証REIT指数（配当込み）に対する連動性を勘案しつつ、投資対象から除外する場合があります。
 2. 東証REIT指数採用銘柄に対して投資を行い、ポートフォリオを構築します。ポートフォリオの構築にあたっては、原則として、各銘柄の時価総額に応じて銘柄ごとの組入比率を調整するとともに、ポートフォリオ全体としての東証上場REIT指数の組入比率（各銘柄の組入比率の合計）を、でき得る限り100%に近づけるよう高位に維持し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指します。
 3. 東証REIT指数（配当込み）の動きと新光J-REITマザーファンドの基準価額の値動きの乖離（トラッキングエラー）を日々管理し、修正が必要な場合は速やかにポートフォリオの見直しを実施します。
- 運用プロセスは平成30年4月27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。

4. 新光外国株式インデックスマザーファンドの概要

ファンド名	新光外国株式インデックスマザーファンド
形態	親投資信託
運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として日本を除く世界主要先進国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ・株式の組入比率については、原則として高位を保ちます。 ・ただし、ファンドの資金動向、市場動向などによっては、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・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20%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
信託期間	無期限
決算日	毎年11月10日（休業日の場合は翌営業日）
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。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成17年8月17日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 （再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）について

MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）は、Morgan Stanley Capital International（以下「MSCI」といいます。）が開発した指数で、日本を除く世界の先進国の株式で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。

本ファンドは、MSCI、MSCIの関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者（以下、総称して「MSCI関係者」といいます。）によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。

MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、アセットマネジメントOne株式会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックするMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマークおよびトレードネーム、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会社、所有者、その他の者もしくは団体に関りなくMSCIが決定、編集、計算するMSCI指数のライセンス所有者です。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数の決定、編集または計算にあたり、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体の要望を考慮する義務を負いません。いかなるMSCI関係者も、本ファンドの発行時期、発行価格もしくは発行数量の決定、または、本ファンドを換金する方程式もしくは本ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与もしていません。また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。また、MSCI指数およびそれに含まれるデータの各々に関し、いかなるMSCI関係者も明示的または黙示的な保証を行うものではなく、かつMSCI関係者は、それらに関する特定目的に対する市場性および適合性に係る一切の保証を明示的に否認します。前記事項を制限することなく、直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、結果的損害その他あらゆる損害（逸失利益を含む。）については、その可能性について告知されていたとしても、MSCI関係者は、かかる損害について責任を負いません。

本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

運用プロセス

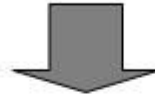
新光外国株式インデックスマザーファンドは、以下のプロセスにより「MSCIコクサイ・インデックス（円

ベース）」に連動する投資成果をめざした運用を行います。

ステップ 1

リスクモニタリング

- 計量モデル等を活用して、パフォーマンス分析やポートフォリオの属性分析を実施し、リバランスの必要性を判断。



ステップ 2

ポートフォリオの構築

- 計量モデル等を活用して、銘柄の選択を実施し、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）と連動性の高いポートフォリオを構築。
- 構築されたポートフォリオに対しステップ 1 と同様のリスクチェックを行い、必要に応じてポートフォリオを再構築。



ステップ 3

売買執行

- ステップ 2 で選択された銘柄について売買を執行。
- 加えて、株価指数先物取引等を一部利用することで、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）との連動性を確保。

なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは平成30年 4月27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。

5．海外国債マザーファンドの概要

ファンド名	海外国債マザーファンド
形態	親投資信託

運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・日本を除く世界主要先進国の公社債を主要投資対象として、長期的に安定した収益確保と投資信託財産の成長を目指します。 ・日本を除く、FTSE世界国債インデックスに含まれる国に所在する政府、政府関係機関、国際機関、法人およびその他事業体が発行する当該インデックスに含まれる通貨建ての国債、政府機関債、国際機関債、短期金融商品を主要投資対象とします。 ・FTSE世界国債インデックス(除く日本、7～10年、円ベース)をベンチマークとして、インデックスを上回る投資成果を目指す運用を行います。 ・債券ポートフォリオは、日本を除くG7構成国(アメリカ、イタリア、ドイツ、フランス、イギリス、カナダの6カ国)が発行する国債、政府機関債を中心に投資します。 ・運用にあたっては、主として以下の運用手法を用います。 <ul style="list-style-type: none"> ・通貨アロケーション ・イールドカーブ戦略 ・セクターアロケーション ・デュレーション調整 ・外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。したがって、基準価額は為替の変動によって大きく変動することが考えられます。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・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、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。)の行使により取得したものに限りません。 ・外貨建資産への投資割合には特に制限を設けません。
信託期間	無期限
決算日	毎年11月4日
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。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成13年11月5日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

FTSE世界国債インデックス(除く日本、7～10年、円ベース)について

FTSE世界国債インデックス(除く日本、7～10年、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。

FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

運用プロセス

海外国債マザーファンドは、以下のプロセスにより日本を除く世界主要先進国の公社債への投資を行います。



運用プロセスは平成30年 4月27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。

6. フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンドの概要

ファンド名	フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド (以下、当概要において「ファンド」といいます。)
形態	ケイマン諸島籍外国投資信託 / 円建受益証券
運用方針	ファンドは、高いインカム利回りと長期的な元本の成長を目的として、上場または非上場の新興諸国のソブリン債または準ソブリン債に主として投資を行います。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 単一国の証券への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。 ・ 単一発行体の証券への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。ただし、現地通貨建ての国債、政府保証債は除きます。 ・ クレジットリンク債への投資は、純資産総額の20%を超えないものとします。 ・ 発行体格付けにおいて、ムーディーズ・インベスターズ・サービス・インクまたはS & Pグローバル・レーティングのソブリン信用格付けがC a a 1またはC C C +以下の証券または無格付けの証券への投資は、純資産総額の10%を超えないものとします。 ・ ファンドにおける証券の平均信用格付けは、ムーディーズ・インベスターズ・サービス・インクまたはS & Pグローバル・レーティングの格付けにおいてB 1またはB +以上とします。 ・ ファンドにおける証券の平均デュレーションは、8年以下とします。
信託期間	150年
決算日	毎年5月31日
収益分配方針	<p>受託会社は毎月3日（休業日の場合は翌営業日）に受益者に分配金を支払います。当該月次分配にかかわらず、投資顧問会社および管理会社からの通知により受託会社は分配を行う場合があります。</p> <p>分配はネット・インカム収益とネット実現損益の合計の範囲内で行うことができますが、受益者の利益にかなうと判断される場合には純資産から分配を行うこともできます。</p>
信託報酬等	<p>運用報酬 : 純資産総額に対し0.40%</p> <p>その他報酬 : 純資産総額に対し0.15% (上限)</p> <p>その他報酬には、受託会社報酬、管理事務代行会社報酬、保管受託銀行報酬、監査報酬、法的費用が含まれます。</p>

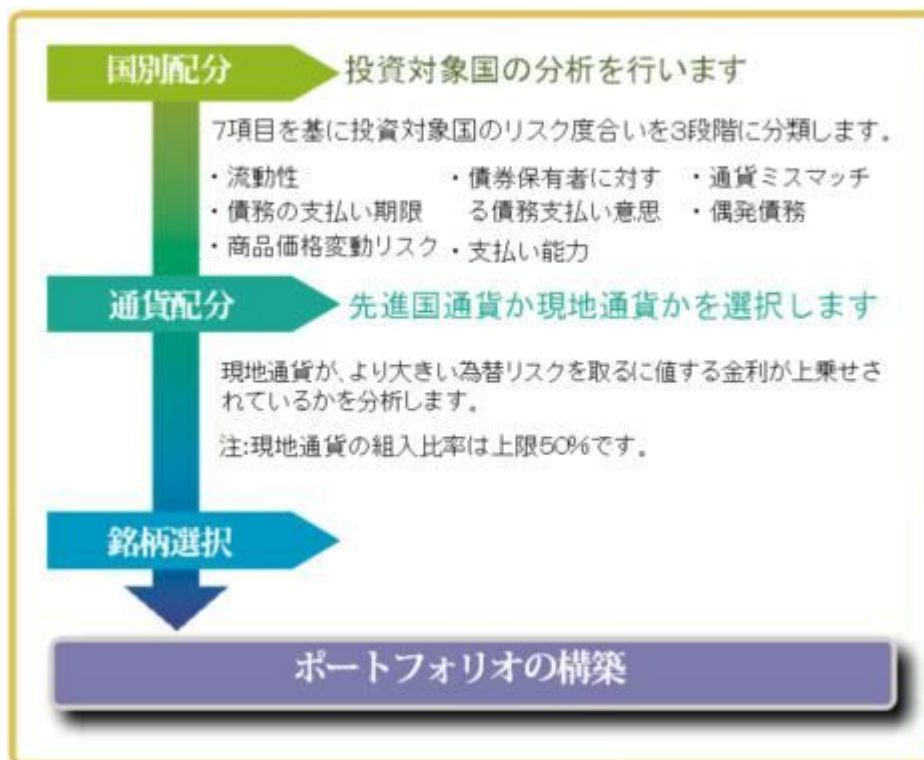
信託設定日	平成18年3月8日
関係法人	<p>受託会社兼管理事務代行会社：BNY メロン ファンド マネジメント(ケイマン) リミテッド</p> <p>副管理事務代行会社：ザ バンク オブ ニューヨーク メロン シンガポール支店</p> <p>保管受託銀行：ザ バンク オブ ニューヨーク メロン</p> <p>管理会社：フランクリン テンプルトン インターナショナル サービスーズ エス エー アール エル</p> <p>投資顧問会社：フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド</p>

フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド について

フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド (FTIML社) は、1985年に英国で設立された資産運用会社で、グローバルに資産運用業務を展開する米国独立系資産運用グループであるフランクリン テンプルトン インベストメンツ(設立：1947年、運用総資産：約78.4兆円)の一員です。FTIML社は、定性分析を重視したボトムアップ型の運用スタイルを採用し、また多様化するグローバル運用へのニーズに対応する運用体制を構築しています。

2018年3月末現在、1米ドル = 106.35円で換算

運用プロセス



出所：FTIML社資料を基にアセットマネジメントOne作成

運用プロセスは平成30年4月27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。

7. 新光米国REITマザーファンドの概要

ファンド名	新光米国REITマザーファンド
形態	親投資信託

運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として米国の取引所上場および店頭市場登録の不動産投資信託証券(以下「REIT」といいます。)に投資を行うことにより、円換算したFTSE NAREIT All Equity REITs インデックスの動きを概ね捉える投資成果を目指した運用を行います。 ・REITの組入比率は原則として高位を保ちます。 ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ・大量の追加設定・換金が発生した場合、市況動向に急激な変化が生じた場合ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となった場合などやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・REITおよび短期金融商品(短期運用の有価証券を含みます。)以外には投資を行いません。 ・REITへの投資割合には制限を設けません。 ・同一銘柄のREITへの投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスにおける時価総額構成割合が30%を上回る銘柄については、当該構成割合以内の率を上限として投資できるものとします。 ・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
信託期間	無期限
決算日	毎年10月20日(休業日の場合は翌営業日)
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。
信託報酬	報酬はかかりません。
信託設定日	平成18年10月31日
委託会社	アセットマネジメントOne株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

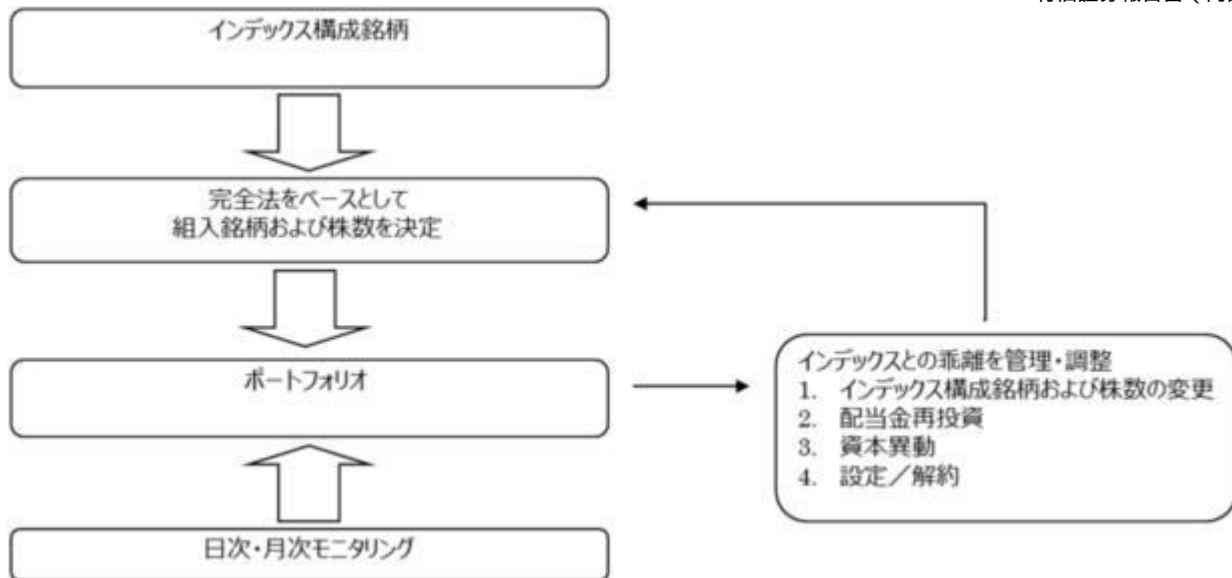
FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスについて

FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスとは、ニューヨーク証券取引所、アメリカン証券取引所、NASDAQ登録のすべてのEquity(エクイティ)型REITで構成される総合収益指数であり、FTSE International Limited(以下「FTSE」といいます。)が算出、公表しています。

“FTSE”及び“FTSE^(R)”は、London Stock Exchange Groupの商標であり、ライセンスに基づいてFTSEが使用しています。FTSE NAREIT All Equity REITs インデックス(以下「本指数」)は、FTSEの商標であり、本指数の算出、指数値の公表、利用など、本指数に関するあらゆる権利はFTSE又はその関連パートナー会社に与えられています。FTSEは、本指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性について、明示的、黙示的を問わず保証するものではありません。また、算出又は公表の誤謬、遅延または中断に対し、一切責任を負いません。

運用プロセス

新光米国REITマザーファンドは、以下のプロセスにより米国の取引所上場および店頭市場登録の不動産投資信託証券に投資を行います。



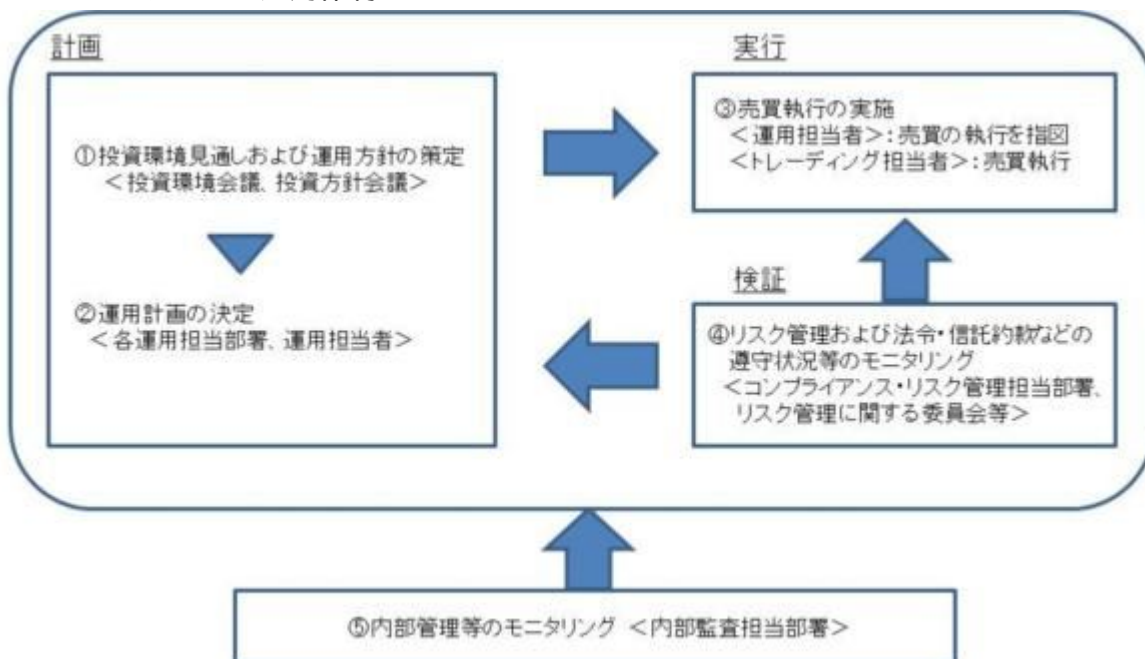
運用プロセスは平成30年 4月27日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

前述の各投資信託証券については、いずれも申込手数料はかかりません。

前述の各概要は、各投資信託証券の内容を要約したものであり、そのすべてではありません。また、各概要は平成30年 7月20日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

(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。

す。

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b．ファンドの関係法人に関する管理

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

c．運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は平成30年4月27日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（4）【配分方針】

a．収益分配は原則として、毎月20日（該当日が休業日の場合は翌営業日。）の決算時に以下の方針に基づき収益の分配を行います。

- 1．分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- 2．分配金額は、経費控除後の利子・配当等収益を基礎として安定した分配を行うことを目標に決定します。ただし、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。
- 3．上記2．にかかわらず、上記2．にかかる分配金のほか、分配対象額の範囲内で基準価額水準や市況動向等を勘案して委託者が決定する額を付加して分配する場合があります。
- 4．留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。

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. 分配金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額(以下「配当等収益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- c. 毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。
- d. 「分配金受取コース」の受益者の分配金は原則として、決算日から起算して5営業日までに、受益者に支払われます。
- 「分配金再投資コース」の受益者の分配金は、税金を差し引いた後、別に定める契約に基づき、全額再投資されます。

(5)【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

a. 投資信託証券への投資割合

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

b. 外貨建資産への投資割合

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

c. 公社債の借り入れ

(イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借り入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借り入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

(ロ) 借り入れの指図は、当該借り入れにかかる公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。

(ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借り入れにかかる公社債の時価総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借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

(ニ) 借り入れにかかる品借料は投資信託財産中から支払われます。

d. 同一銘柄の投資信託証券への投資制限

委託者は、原則として、投資信託財産に属する同一銘柄の投資信託証券の時価総額が投資信託財産の純資産総額の100分の50以上となる投資の指図をしません。ただし、当該投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、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. 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(外国通貨表示の有価証券をいいます。以下同じ。)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。

f. 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(外貨建有価証券、外国通貨表示の預金その他の資産をいいます。以下同じ。)について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

g．資金の借入れ

- (イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）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) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、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%を超えないこととします。
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は投資信託財産から収益分配金が支払われる日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は投資信託財産中より支払われます。

h．受託者の自己または利害関係人等との取引

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

i．デリバティブ取引等に係る投資制限

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

j．信用リスク集中回避のための投資制限

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

k．ファンドの投資制限

投資信託証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外には投資を行いません。

3【投資リスク】

(1) ファンドのもつリスク

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて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．資産配分リスク

当ファンドは基本投資配分比率に基づいて投資を行いますが、実質的に投資する資産の価格変動などの影響により投資信託証券の構成比率が基本投資配分からかい離することが想定されます。一時的に構成比率が大きくなった資産の収益率が低くなった場合や、一つあるいは複数またはすべての資産価値が下落する場合には、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

b．株価変動リスク

株価変動リスクとは、株式市場が国内外の政治、経済、社会情勢の変化、金利動向、発行企業の業績・経営状況の変化、市場の需給関係などの影響を受けて下落するリスクをいいます。当ファンドは、投資信託証券を通じて株式に実質的に投資を行いますので、株式市場の動きにより、当ファンドの基準価額は変動します。一般に株式市場が下落した場合には、その影響を受け当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

c．REITの価格変動リスク

当ファンドが投資信託証券を通じて実質的に投資するREITは、REITの保有不動産の評価の下落、REITの配当金の減少、企業体としてのREITに対する評価の悪化などの原因により価格が下落する場合があります。その影響を受け当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

d．為替変動リスク

当ファンドまたは当ファンドが組み入れる投資信託証券が投資する外貨建資産は、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。

また、当ファンドは新興国通貨建証券に実質的な投資を行うことから、為替変動リスクが相対的に高くなる可能性があります。

e．カントリーリスク

投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制などの要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。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。

一般に新興国市場は、先進国市場に比べて規模が小さく、流動性も低く、金融インフラが未発達であり、様々な地政学的問題を抱えていることから、カントリーリスクはより高くなる可能性があります。

f．金利変動リスク

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。

g．信用リスク

公社債や短期金融商品の信用力の変化や格付けの変更により、債券価格が変動したり、財政難、経営不振、その他の理由により、利息や元本があらかじめ決められた条件で支払われなくなること（債務不履行）があります。信用力の低下、格付けの引き下げ、債務不履行が生じた場合、通常、債券価格は下落し、その結果、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。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、当ファンドが実質的に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。

h. 流動性リスク

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。

当ファンドまたは当ファンドが組み入れる投資信託証券が、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。

i. 投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

- (イ) 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリングオフ)の適用はありません。
- (ロ) 有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴いません。
- (ハ) 法令や税制が変更される場合に、投資信託を保有する受益者が不利益を被る可能性があります。
- (ニ) 投資信託財産の状況によっては、目指す運用が行われなことがあります。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る有価証券を市場実勢より大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となり、損失を被ることがあります。
- (ト) 証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化もしくは政策の変更などの諸事情により閉鎖されることがあります。これにより当ファンドの運用が影響を被って基準価額の下落につながる可能性があります。
- (チ) 投資信託証券には、ファミリーファンド方式で運用をするものがあります。当該投資信託証券(ベビーファンド)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ベビーファンドにおいて、設定・解約や資産構成の変更などによりマザーファンドの組入る有価証券などに売買が生じた場合、その売買による組入る有価証券などの価格の変化や売買手数料などの負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。この影響を受け、当該投資信託証券(ベビーファンド)の価額が変動する可能性があります。

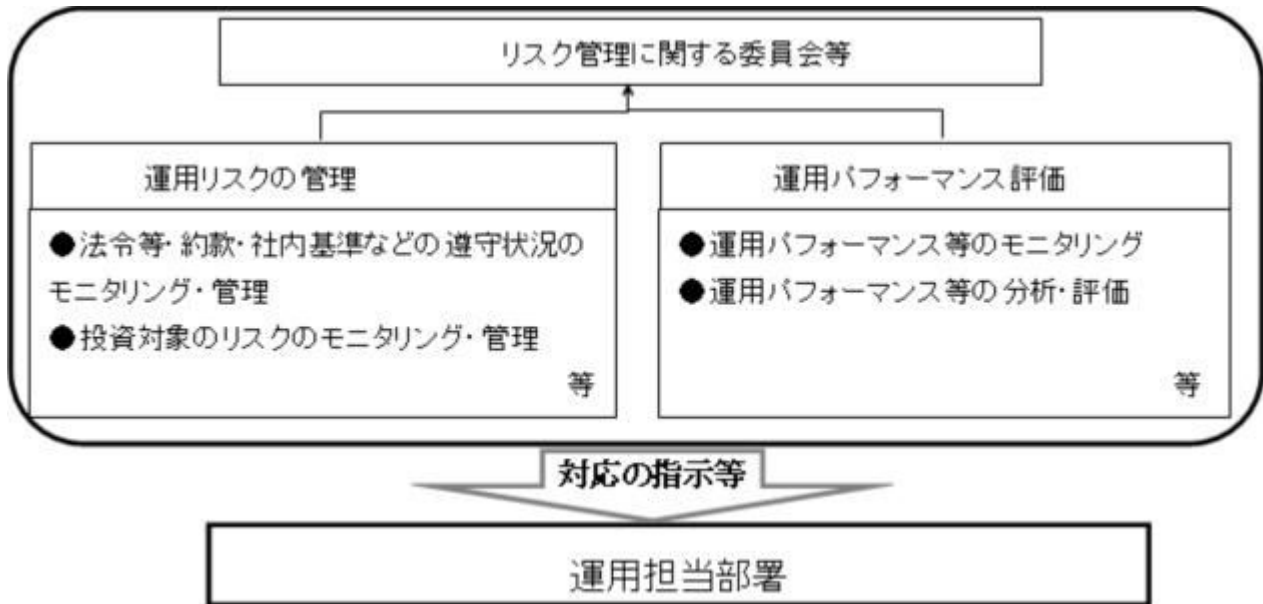
当ファンドが主要投資対象とする投資信託証券にはファミリーファンド方式を採用している場合があります。上記のような要因で、当ファンドの基準価額が変動する可能性があります。

(2) リスク管理体制

委託会社における当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。



リスク管理体制は平成30年 4月27日現在のものであり、今後変更になることがあります。

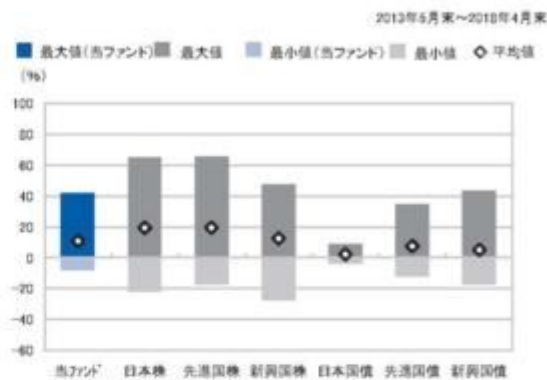
<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



* 分配金再投資基準価額は、2013年5月末の基準価額を10,000として指数化しております。
* 年間騰落率は、2013年5月から2018年4月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	42.1	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値	-8.0	-22.0	-17.5	-27.4	-4.0	-12.3	-17.4
平均値	11.0	19.6	19.7	12.7	2.2	7.8	5.2

*全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

*2013年5月から2018年4月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

*決算日に対応した数値とは異なります。

*当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

*各資産クラスの指数

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

●「東京証券指数(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(東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。

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

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

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

●「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.7%（税抜2.5%）を上限として販売会社がそれぞれ独自に定める手数料率を乗じて得た金額となります。商品および投資環境の説明・情報提供、購入の事務手続きなどの対価として販売会社にお支払いいただきます。当該手数料には消費税等（8%）が含まれます。

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社
コールセンター 0120-104-694
(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)
インターネットホームページ
<http://www.am-one.co.jp/>

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

ファンドの受益権の取得申込者が「償還乗り換え」¹または「償還前乗り換え」²によりファンドの受益権を取得する場合、申込手数料の優遇を受けることができる場合があります。

ただし、上記の申込手数料の優遇に関しては、優遇制度の取り扱い、優遇の内容、優遇を受けるための条件等は販売会社毎に異なりますので、詳しくは各販売会社でご確認ください。

- 1 「償還乗り換え」とは、取得申込受付日前の一定期間内に既に償還となった証券投資信託の償還金等をもって、その支払いを行った販売会社でファンドの受益権を取得する場合をいいます。
- 2 「償還前乗り換え」とは、償還することが決定している証券投資信託の償還日前の一定期間内において、当該証券投資信託の一部解約金をもって、その支払いを行った販売会社でファンドの受益権を取得する場合をいいます。

(2) 【換金（解約）手数料】

a. 解約時手数料

ご解約時の手数料はありません。

b. 信託財産留保額

ご解約時に、解約申込受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除します。

「信託財産留保額」とは、ご解約による組入有価証券などの売却等費用について受益者間の公平を期するため、投資信託を途中解約される投資家にご負担いただくものです。なお、これは運用資金の一部として投資信託財産に組み入れられます。

(3) 【信託報酬等】

ファンド	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.026%（税抜0.95%）</p> <p>信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率</p> <p>運用管理費用（信託報酬）は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。</p> <p>運用管理費用（信託報酬）の配分は、各販売会社の取扱純資産額に応じて、以下の通りとします。</p> <table border="1" data-bbox="403 344 1391 875"> <thead> <tr> <th colspan="4">運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）</th> </tr> <tr> <th>各販売会社の取扱純資産額</th> <th>委託会社</th> <th>販売会社</th> <th>受託会社</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>300億円未満の部分</td> <td>年率0.42%</td> <td>年率0.45%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>300億円以上 500億円未満の部分</td> <td>年率0.37%</td> <td>年率0.50%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>500億円以上の部分</td> <td>年率0.32%</td> <td>年率0.55%</td> <td>年率0.08%</td> </tr> <tr> <td>主な役務</td> <td>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</td> <td>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</td> <td>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</td> </tr> </tbody> </table> <p>委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社（フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド）に対する投資顧問報酬（投資対象とする外国投資信託の純資産総額のうちファンドにおける保有分に対し年率0.05%）が含まれます。</p>	運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）				各販売会社の取扱純資産額	委託会社	販売会社	受託会社	300億円未満の部分	年率0.42%	年率0.45%	年率0.08%	300億円以上 500億円未満の部分	年率0.37%	年率0.50%	年率0.08%	500億円以上の部分	年率0.32%	年率0.55%	年率0.08%	主な役務	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	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	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
運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）																									
各販売会社の取扱純資産額	委託会社	販売会社	受託会社																						
300億円未満の部分	年率0.42%	年率0.45%	年率0.08%																						
300億円以上 500億円未満の部分	年率0.37%	年率0.50%	年率0.08%																						
500億円以上の部分	年率0.32%	年率0.55%	年率0.08%																						
主な役務	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	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	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																						
投資対象とする外国投資信託	<p>フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンドの純資産総額に対して年率0.07865%</p> <p>当該外国投資信託の組入比率を14.3%として概算したものです。</p>																								
実質的な負担	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.10465%（税抜1.02865%）程度</p> <p>上記は概算の数値です。実際の運用管理費用（信託報酬）は、投資信託証券の組入状況に応じて変動します。</p>																								

（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（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支払われます。

投資信託財産にかかる監査報酬は、毎計算期末または信託終了のときに、当該監査報酬にかかる消費税等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についても投資信託財産が負担します。

c．「その他の手数料等」については、定率でないもの、定時に見直されるもの、売買条件などに応じて異なるものなどがあるため、当該費用および合計額などを表示することができません。

手数料などの合計額については、購入金額や保有期間などに応じて異なりますので、表示することができません。

（５）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

a. 個人の受益者に対する課税

(イ) 収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(ロ) 解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

(ハ) 損益通算について

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

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

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

b. 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成30年4月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

c．個別元本について

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

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

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

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

d．収益分配金の課税について

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

新光7資産バランスファンド

(平成30年 4月27日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	ケイマン諸島	663,120,000	12.32
親投資信託受益証券	日本	4,555,673,057	84.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		159,466,882	2.96
純資産総額		5,378,259,939	100.00

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

(参考) 海外国債マザーファンド

(平成30年 4月27日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	9,264,354,128	43.20
	カナダ	442,609,722	2.06
	ドイツ	2,253,322,812	10.50
	イタリア	3,881,939,580	18.10
	フランス	3,852,856,145	17.96
	イギリス	1,372,812,306	6.40
	小計	21,067,894,693	98.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		373,988,125	1.74
純資産総額		21,441,882,818	100.00

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

(参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(平成30年 4月27日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	8,979,644,700	95.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		374,774,784	4.00
純資産総額		9,354,419,484	100.00

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

(参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

(平成30年 4月27日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	3,740,015,721	58.55
	カナダ	225,944,016	3.53
	モーリシャス	473,135	0.00
	パナマ	3,888,861	0.06
	ドイツ	244,463,261	3.82
	イタリア	55,155,404	0.86
	フランス	249,943,326	3.91
	オランダ	125,179,317	1.95

	スペイン	80,950,203	1.26
	ベルギー	26,272,053	0.41
	オーストリア	7,155,569	0.11
	ルクセンブルグ	8,607,056	0.13
	フィンランド	27,306,567	0.42
	アイルランド	90,314,770	1.41
	ポルトガル	3,429,571	0.05
	イギリス	425,215,280	6.65
	スイス	205,793,423	3.22
	スウェーデン	63,830,195	0.99
	ノルウェー	19,220,973	0.30
	デンマーク	44,975,141	0.70
	ケイマン諸島	20,879,334	0.32
	リベリア	3,778,762	0.05
	オーストラリア	154,130,102	2.41
	バミューダ諸島	34,111,136	0.53
	ニュージーランド	4,507,594	0.07
	パプアニューギニア	1,976,236	0.03
	香港	56,445,546	0.88
	シンガポール	31,525,658	0.49
	イスラエル	13,982,362	0.21
	キュラソー	14,281,504	0.22
	ジャージー	29,236,139	0.45
	英ヴァージン諸島	2,718,249	0.04
	マン島	1,300,853	0.02
	小計	6,017,007,317	94.21
投資信託受益証券	シンガポール	433,026	0.00
投資証券	アメリカ	114,100,454	1.78
	カナダ	1,347,880	0.02
	フランス	7,663,918	0.11
	イギリス	3,535,113	0.05
	オーストラリア	9,449,388	0.14
	香港	563,541	0.00
	シンガポール	3,749,579	0.05
	小計	140,409,873	2.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		228,873,115	3.58
純資産総額		6,386,723,331	100.00

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

(参考)新光日本債券インデックスマザーファンド

(平成30年 4月27日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	10,101,647,500	79.55
地方債証券	日本	961,498,400	7.57
特殊債券	日本	951,829,000	7.49
社債券	日本	517,010,000	4.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		166,080,762	1.30
純資産総額		12,698,065,662	100.00

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

(参考)新光J-REITマザーファンド

(平成30年 4月27日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	2,440,636,820	98.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		45,393,699	1.82
純資産総額		2,486,030,519	100.00

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

(参考)新光米国REITマザーファンド

(平成30年 4月27日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	742,560,315	98.84
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,664,443	1.15
純資産総額		751,224,758	100.00

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

新光7資産バランスファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

(平成30年 4月27日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	新光日本債券インデックスマザー ファンド	628,025,669	1.2672	795,834,127	1.2674	795,959,732	14.79

2	日本	親投資信託 受益証券	新光J-R E I Tマザーファンド	462,104,698	1.6459	760,578,122	1.6659	769,820,216	14.31
3	日本	親投資信託 受益証券	ニュー トピックス インデック スマザーファンド	330,753,274	2.2751	752,496,773	2.3097	763,940,836	14.20
4	日本	親投資信託 受益証券	海外国債マザーファンド	341,575,843	2.2223	759,083,995	2.2331	762,773,015	14.18
5	日本	親投資信託 受益証券	新光米国R E I Tマザーファンド	496,954,036	1.4531	722,123,909	1.4867	738,821,565	13.73
6	日本	親投資信託 受益証券	新光外国株式インデックスマザー ファンド	316,216,743	2.2736	718,950,386	2.2907	724,357,693	13.46
7	ケイマン 諸島	投資信託受 益証券	フランクリン・テンブルトン・フ ロンティア・エマージング・マー ケッツ・デット・ファンド	180,000	3.659	658,620,000	3.684	663,120,000	12.32

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

ロ.種類別投資比率

(平成30年 4月27日現在)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	12.32
親投資信託受益証券	84.70
合計	97.03

(参考) 海外国債マザーファンド

イ.評価額上位銘柄明細

(平成30年 4月27日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000,000	10,887.15	1,088,715,937	10,405.3359	1,040,533,594	2.2500	2025.11.15	4.85
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000,000	10,707.75	1,070,775,701	10,248.9996	1,024,899,964	2.0000	2025.08.15	4.77
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000,000	10,358.34	1,035,834,964	9,914.9695	991,496,952	1.6250	2026.02.15	4.62
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000,000	10,331.86	1,033,186,640	9,878.2348	987,823,481	1.6250	2026.05.15	4.60
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000,000	10,203.72	1,020,372,188	9,745.8187	974,581,875	1.5000	2026.08.15	4.54
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	10,782.56	862,604,912	10,566.7981	845,343,848	3.0000	2047.05.15	3.94
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	10,587.30	846,984,607	10,405.3359	832,426,875	2.3750	2027.05.15	3.88
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	10,390.78	831,262,981	10,261.8140	820,945,125	2.2500	2027.11.15	3.82
9	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,500,000	19,291.87	675,215,479	18,729.2133	655,522,466	6.0000	2025.10.25	3.05
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	10,820.43	649,225,986	10,360.9125	621,654,750	2.1250	2025.05.15	2.89
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	10,573.64	634,418,458	10,278.9000	616,734,000	2.2500	2027.08.15	2.87
12	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000	18,727.58	561,827,415	18,899.9964	566,999,892	6.5000	2027.11.01	2.64
13	イギリス	国債証券	TSY	3,000,000	19,288.30	578,649,251	18,869.0800	566,072,400	4.2500	2027.12.07	2.64
14	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,200,000	16,683.78	533,881,209	16,366.0517	523,713,657	3.5000	2026.04.25	2.44
15	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,700,000	13,491.86	499,199,002	13,338.2925	493,516,823	0.5000	2025.05.25	2.30
16	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000	16,225.18	486,755,665	16,326.3348	489,790,044	4.5000	2026.03.01	2.28

17	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,000,000	16,017.55	480,526,716	15,719.9886	471,599,658	2.7500	2027.10.25	2.19
18	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,400,000	13,941.99	474,027,689	13,761.9404	467,905,976	1.0000	2025.11.25	2.18
19	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000	13,643.58	463,881,851	13,397.8680	455,527,512	0.5000	2026.02.15	2.12
20	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,500,000	12,764.43	446,755,351	12,976.8678	454,190,373	1.2500	2026.12.01	2.11
21	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,500,000	12,884.93	450,972,766	12,798.4060	447,944,213	0.0000	2026.08.15	2.08
22	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,300,000	12,922.58	426,445,401	12,839.1822	423,693,013	0.2500	2026.11.25	1.97
23	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000	13,698.96	410,969,010	13,886.3871	416,591,613	2.2000	2027.06.01	1.94
24	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000	13,711.19	411,335,730	13,867.8525	416,035,575	2.0000	2025.12.01	1.94
25	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000	13,473.63	404,209,176	13,693.0977	410,792,931	2.0500	2027.08.01	1.91
26	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,100,000	13,318.43	412,871,454	13,191.3396	408,931,528	0.5000	2026.05.25	1.90
27	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,000,000	13,736.96	412,108,888	13,599.1008	407,973,024	1.0000	2027.05.25	1.90
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,297.01	411,880,443	10,120.0007	404,800,031	2.0000	2026.11.15	1.88
29	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000	13,336.92	400,107,734	13,491.8649	404,755,947	1.5000	2025.06.01	1.88
30	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000	13,095.22	392,856,734	13,204.5786	396,137,358	0.5000	2027.08.15	1.84

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成30年4月27日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

ロ.種類別投資比率

(平成30年4月27日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	98.25
合計	98.25

(参考)ニュー トピックス インデックス マザーファンド

イ.評価額上位銘柄明細

(平成30年4月27日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	43,200	7,568.76	326,970,432	7,181.00	310,219,200	3.31
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	245,500	870.45	213,695,475	733.20	180,000,600	1.92
3	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	15,800	8,932.03	141,126,074	8,501.00	134,315,800	1.43

4	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	25,000	5,215.23	130,380,750	5,205.00	130,125,000	1.39
5	日本	株式	ソニー	電気機器	23,800	5,517.33	131,312,454	5,400.00	128,520,000	1.37
6	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	26,500	5,179.72	137,262,580	4,550.00	120,575,000	1.28
7	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	32,000	3,963.16	126,821,120	3,767.00	120,544,000	1.28
8	日本	株式	キーエンス	電気機器	1,700	66,050.00	112,285,000	66,970.00	113,849,000	1.21
9	日本	株式	任天堂	その他製品	2,200	44,620.00	98,164,000	46,170.00	101,574,000	1.08
10	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	476,500	216.57	103,195,605	198.40	94,537,600	1.01
11	日本	株式	KDDI	情報・通信業	31,400	2,759.81	86,658,034	2,937.00	92,221,800	0.98
12	日本	株式	ファナック	電気機器	3,400	31,524.48	107,183,232	23,560.00	80,104,000	0.85
13	日本	株式	三菱商事	卸売業	24,600	3,265.17	80,323,182	3,027.00	74,464,200	0.79
14	日本	株式	日本電産	電気機器	4,300	16,825.60	72,350,080	17,140.00	73,702,000	0.78
15	日本	株式	キャノン	電気機器	19,100	4,273.65	81,626,715	3,790.00	72,389,000	0.77
16	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	25,100	2,656.18	66,670,118	2,835.00	71,158,500	0.76
17	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	14,700	4,581.91	67,354,077	4,805.00	70,633,500	0.75
18	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	3,200	20,844.08	66,701,056	21,970.00	70,304,000	0.75
19	日本	株式	花王	化学	8,700	7,531.96	65,528,052	7,855.00	68,338,500	0.73
20	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	13,200	5,372.36	70,915,152	5,172.00	68,270,400	0.72
21	日本	株式	信越化学工業	化学	6,200	11,924.09	73,929,358	11,005.00	68,231,000	0.72
22	日本	株式	日立製作所	電気機器	85,000	904.33	76,868,050	801.60	68,136,000	0.72
23	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	6,400	11,444.33	73,243,712	10,490.00	67,136,000	0.71
24	日本	株式	パナソニック	電気機器	40,600	1,704.85	69,216,910	1,632.00	66,259,200	0.70
25	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	26,200	2,746.65	71,962,230	2,527.00	66,207,400	0.70
26	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	22,100	3,590.75	79,355,575	2,936.50	64,896,650	0.69
27	日本	株式	小松製作所	機械	17,200	4,423.10	76,077,320	3,750.00	64,500,000	0.68
28	日本	株式	ダイキン工業	機械	4,900	13,628.65	66,780,385	12,805.00	62,744,500	0.67
29	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	13,100	6,431.49	84,252,519	4,621.00	60,535,100	0.64
30	日本	株式	三菱電機	電気機器	35,600	2,001.19	71,242,364	1,680.50	59,825,800	0.63

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

(平成30年 4月27日現在)

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.32
		建設業	3.09
		食料品	4.19
		繊維製品	0.65
		パルプ・紙	0.27
		化学	6.93

医薬品	4.37
石油・石炭製品	0.67
ゴム製品	0.82
ガラス・土石製品	0.93
鉄鋼	1.02
非鉄金属	0.86
金属製品	0.64
機械	5.15
電気機器	13.08
輸送用機器	8.47
精密機器	1.59
その他製品	2.14
電気・ガス業	1.65
陸運業	4.01
海運業	0.20
空運業	0.58
倉庫・運輸関連業	0.17
情報・通信業	7.02
卸売業	4.63
小売業	4.73
銀行業	6.87
証券、商品先物取引業	0.94
保険業	2.21
その他金融業	1.19
不動産業	2.35
サービス業	4.00
合計	95.99

(参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

(平成30年 4月27日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	7,869	19,220.44	151,245,717	17,957.4569	141,307,229	2.21
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェ ア・サービ ス	11,183	9,240.07	103,331,759	10,307.3310	115,266,883	1.80
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	627	125,212.31	78,508,119	165,988.9266	104,075,057	1.62
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェ ア・サービ ス	3,612	19,588.95	70,755,320	19,044.3959	68,788,358	1.07
5	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	5,432	10,710.83	58,181,242	12,039.4350	65,398,211	1.02

6	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,079	15,243.39	62,177,788	13,997.8936	57,097,408	0.89
7	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	6,409	9,127.44	58,497,792	8,842.0410	56,668,641	0.88
8	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	482	113,312.84	54,616,791	113,728.3734	54,817,076	0.85
9	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	449	114,568.18	51,441,114	114,085.9487	51,224,591	0.80
10	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORPORATION	銀行	15,140	2,896.68	43,855,758	3,288.1544	49,782,659	0.77
11	スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	4,940	9,241.14	45,651,251	8,449.6775	41,741,407	0.65
12	アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	7,228	5,904.90	42,680,618	5,734.3140	41,447,622	0.64
13	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	1,913	20,262.55	38,762,268	21,545.2305	41,216,026	0.64
14	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	7,097	5,062.90	35,931,437	5,801.0174	41,169,821	0.64
15	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	3,007	12,820.19	38,550,323	13,583.4569	40,845,455	0.63
16	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	2,881	12,265.78	35,337,739	13,896.1978	40,034,946	0.62
17	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	1,531	23,303.57	35,677,779	25,919.2305	39,682,342	0.62
18	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9,473	3,849.11	36,462,713	4,029.5474	38,171,903	0.59
19	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7,492	3,723.36	27,895,469	4,834.3634	36,219,051	0.56
20	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	1,774	17,853.57	31,672,241	20,308.4819	36,027,247	0.56
21	アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	9,759	3,717.89	36,282,986	3,619.4849	35,322,554	0.55
22	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	6,475	4,928.40	31,911,420	5,441.2560	35,232,133	0.55
23	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC(UK)	銀行	31,826	1,129.55	35,949,309	1,080.2548	34,380,190	0.53
24	アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	856	28,726.24	24,589,666	37,484.0864	32,086,378	0.50
25	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	3,840	9,534.22	36,611,430	7,955.2125	30,548,016	0.47
26	アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	6,457	5,049.78	32,606,449	4,674.7125	30,184,619	0.47
27	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	3,974	7,920.22	31,474,956	7,564.8329	30,062,646	0.47
28	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3,531	9,042.17	31,927,909	8,412.0940	29,703,104	0.46
29	アメリカ	株式	MASTERCARD INCORPORATED	ソフトウェア・サービス	1,426	16,324.86	23,279,252	19,481.7959	27,781,041	0.43
30	フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	3,851	6,403.87	24,661,339	6,872.3648	26,465,477	0.41

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成30年4月27日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

ロ.種類別及び業種別の投資比率

(平成30年 4月27日現在)

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.86
		素材	4.82
		資本財	7.11
		商業・専門サービス	0.90
		運輸	1.98
		自動車・自動車部品	1.44
		耐久消費財・アパレル	1.90
		消費者サービス	1.85
		メディア	2.13
		小売	4.41
		食品・生活必需品小売り	1.60
		食品・飲料・タバコ	4.68
		家庭用品・パーソナル用品	1.78
		ヘルスケア機器・サービス	4.22
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.54
		銀行	9.14
		各種金融	4.45
		保険	3.98
		不動産	0.63
		ソフトウェア・サービス	10.47
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.93		
電気通信サービス	2.36		
公益事業	2.99		
半導体・半導体製造装置	2.91		
投資信託受益証券			0.00
投資証券			2.19
合計			96.41

(参考) 新光日本債券インデックスマザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

(平成30年 4月27日現在)

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第123回利付 国債(5年)	160,000,000	100.61	160,979,200	100.42	160,678,400	0.1000	2020.03.20	1.26
2	日本	国債証券	第306回利付 国債(10年)	150,000,000	103.68	155,526,000	102.88	154,329,000	1.4000	2020.03.20	1.21
3	日本	国債証券	第124回利付 国債(5年)	150,000,000	100.66	150,996,000	100.48	150,721,500	0.1000	2020.06.20	1.18

4	日本	国債証券	第312回利付 国債(10年)	140,000,000	104.15	145,815,600	103.49	144,886,000	1.2000	2020.12.20	1.14
5	日本	国債証券	第308回利付 国債(10年)	140,000,000	103.80	145,329,800	103.04	144,268,600	1.3000	2020.06.20	1.13
6	日本	国債証券	第126回利付 国債(5年)	140,000,000	100.74	141,044,400	100.58	140,813,400	0.1000	2020.12.20	1.10
7	日本	国債証券	第342回利付 国債(10年)	130,000,000	101.00	131,303,900	100.90	131,179,100	0.1000	2026.03.20	1.03
8	日本	国債証券	第332回利付 国債(10年)	120,000,000	104.16	125,000,400	103.82	124,584,000	0.6000	2023.12.20	0.98
9	日本	国債証券	第335回利付 国債(10年)	120,000,000	103.88	124,664,400	103.52	124,227,600	0.5000	2024.09.20	0.97
10	日本	国債証券	第338回利付 国債(10年)	120,000,000	103.39	124,069,500	103.03	123,643,200	0.4000	2025.03.20	0.97
11	日本	国債証券	第303回利付 国債(10年)	120,000,000	102.94	123,529,200	102.13	122,566,800	1.4000	2019.09.20	0.96
12	日本	特殊債券	第97回政府保 証日本高速道路 保有・債務返済 機構債券	100,000,000	122.24	122,240,000	121.54	121,540,000	2.1000	2029.12.28	0.95
13	日本	地方債証券	第18回東京都 公募債(20 年)	100,000,000	122.12	122,120,000	121.33	121,330,000	2.2200	2029.03.19	0.95
14	日本	国債証券	第345回利付 国債(10年)	120,000,000	100.81	120,981,600	100.73	120,879,600	0.1000	2026.12.20	0.95
15	日本	国債証券	第128回利付 国債(5年)	120,000,000	100.83	120,997,200	100.70	120,848,400	0.1000	2021.06.20	0.95
16	日本	国債証券	第127回利付 国債(5年)	120,000,000	100.78	120,946,800	100.63	120,763,200	0.1000	2021.03.20	0.95
17	日本	国債証券	第125回利付 国債(5年)	120,000,000	100.71	120,858,000	100.52	120,631,200	0.1000	2020.09.20	0.94
18	日本	国債証券	第340回利付 国債(10年)	110,000,000	103.46	113,810,000	103.14	113,458,400	0.4000	2025.09.20	0.89
19	日本	国債証券	第310回利付 国債(10年)	110,000,000	103.29	113,619,000	102.68	112,948,000	1.0000	2020.09.20	0.88
20	日本	社債券	第36回東日本 旅客鉄道社債	100,000,000	113.95	113,950,000	112.85	112,850,000	2.1100	2024.12.20	0.88
21	日本	国債証券	第132回利付 国債(5年)	110,000,000	101.01	111,118,700	100.87	110,959,200	0.1000	2022.06.20	0.87
22	日本	国債証券	第343回利付 国債(10年)	110,000,000	100.94	111,039,400	100.85	110,939,400	0.1000	2026.06.20	0.87
23	日本	国債証券	第344回利付 国債(10年)	110,000,000	100.88	110,972,400	100.79	110,875,600	0.1000	2026.09.20	0.87
24	日本	国債証券	第346回利付 国債(10年)	110,000,000	100.74	110,820,600	100.70	110,779,900	0.1000	2027.03.20	0.87
25	日本	国債証券	第120回利付 国債(5年)	110,000,000	100.71	110,785,400	100.46	110,511,500	0.2000	2019.09.20	0.87
26	日本	特殊債券	第49回政府保 証地方公共団体 金融機構債券	100,000,000	104.83	104,830,000	104.42	104,420,000	0.8820	2023.06.16	0.82
27	日本	国債証券	第313回利付 国債(10年)	100,000,000	104.80	104,804,000	104.10	104,106,000	1.3000	2021.03.20	0.81
28	日本	国債証券	第334回利付 国債(10年)	100,000,000	104.44	104,440,000	104.06	104,063,000	0.6000	2024.06.20	0.81
29	日本	国債証券	第325回利付 国債(10年)	100,000,000	104.38	104,385,000	103.98	103,987,000	0.8000	2022.09.20	0.81
30	日本	特殊債券	第58回政府保 証地方公共団体 金融機構債券	100,000,000	103.93	103,930,000	103.60	103,600,000	0.6450	2024.03.15	0.81

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

ロ.種類別投資比率

(平成30年 4月27日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	79.55
地方債証券	7.57
特殊債券	7.49
社債券	4.07
合計	98.69

(参考)新光J-REITマザーファンド

イ.評価額上位銘柄明細

(平成30年 4月27日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	293	555,504.89	162,762,935	615,000	180,195,000	7.24
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	301	539,310.23	162,332,381	568,000	170,968,000	6.87
3	日本	投資証券	野村不動産マスタ-ファンド投資法人	895	142,703.67	127,719,785	152,700	136,666,500	5.49
4	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	571	204,864.96	116,977,896	205,000	117,055,000	4.70
5	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	667	164,421.92	109,669,421	167,800	111,922,600	4.50
6	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	600	158,554.04	95,132,424	166,700	100,020,000	4.02
7	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	403	240,179.5	96,792,342	230,300	92,810,900	3.73
8	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	352	263,263.48	92,668,745	261,000	91,872,000	3.69
9	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	280	266,307.91	74,566,215	281,900	78,932,000	3.17
10	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	191	376,414.04	71,895,082	397,000	75,827,000	3.05
11	日本	投資証券	GLP投資法人	628	116,741.82	73,313,867	117,500	73,790,000	2.96
12	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	873	76,267.4	66,581,447	82,800	72,284,400	2.90
13	日本	投資証券	アクティブア・プロパティーズ投資法人	137	450,436.21	61,709,761	485,000	66,445,000	2.67
14	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	88	624,702.4	54,973,812	672,000	59,136,000	2.37
15	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	101	434,245.06	43,858,752	489,500	49,439,500	1.98
16	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	103	446,105.72	45,948,890	451,000	46,453,000	1.86
17	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	325	134,711.84	43,781,349	140,500	45,662,500	1.83
18	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	202	207,991.82	42,014,349	221,700	44,783,400	1.80
19	日本	投資証券	産業ファンド投資法人	351	116,992.96	41,064,529	121,100	42,506,100	1.70
20	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	65	572,638.84	37,221,525	647,000	42,055,000	1.69
21	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	830	46,762.67	38,813,021	48,900	40,587,000	1.63
22	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	271	135,626.83	36,754,872	142,200	38,536,200	1.55
23	日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	216	163,430.49	35,300,987	163,300	35,272,800	1.41
24	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	206	160,538.28	33,070,887	168,900	34,793,400	1.39
25	日本	投資証券	イオンリート投資法人	287	116,782.84	33,516,677	113,500	32,574,500	1.31
26	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	203	136,285.76	27,666,010	147,200	29,881,600	1.20
27	日本	投資証券	プレミアム投資法人	273	103,804.54	28,338,642	107,100	29,238,300	1.17
28	日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	340	79,609.96	27,067,389	85,200	28,968,000	1.16

29	日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	115	233,307.6	26,830,375	250,900	28,853,500	1.16
30	日本	投資証券	MCUBS MidCity投資法人	338	75,722.5	25,594,207	82,500	27,885,000	1.12

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

ロ.種類別投資比率

(平成30年 4月27日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	98.17
合計	98.17

(参考)新光米国REITマザーファンド

イ.評価額上位銘柄明細

(平成30年 4月27日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	投資証券	AMERICAN TOWER CORPORATION	3,082	15,133.03	46,640,000	14,963.4539	46,117,365	6.13
2	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	2,268	18,082.83	41,011,864	16,419.9960	37,240,551	4.95
3	アメリカ	投資証券	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	2,933	11,305.90	33,160,211	11,492.6849	33,708,045	4.48
4	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	3,845	7,053.89	27,122,226	7,202.8845	27,695,091	3.68
5	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	567	51,363.70	29,123,221	45,498.3474	25,797,563	3.43
6	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	1,079	23,474.18	25,328,645	21,850.3169	23,576,492	3.13
7	アメリカ	投資証券	WEYERHAEUSER COMPANY	5,443	3,847.87	20,943,987	4,007.6775	21,813,789	2.90
8	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,004	19,710.74	19,789,584	17,668.7729	17,739,448	2.36
9	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	2,600	7,205.18	18,733,484	6,684.5653	17,379,870	2.31
10	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	1,489	13,481.15	20,073,436	11,317.7253	16,852,093	2.24
11	アメリカ	投資証券	SBA COMMUNICATIONS CORP	848	16,240.66	13,772,081	18,066.8066	15,320,652	2.03
12	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	1,123	13,515.22	15,177,594	13,184.3294	14,806,002	1.97
13	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	2,705	7,409.30	20,042,174	5,468.5933	14,792,545	1.96
14	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	2,587	6,868.25	17,768,187	5,190.8446	13,428,715	1.78
15	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	476	28,341.39	13,490,503	26,001.2436	12,376,592	1.64
16	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS	5,323	2,168.68	11,543,914	2,143.2600	11,408,573	1.51
17	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	2,055	6,137.84	12,613,273	5,510.1464	11,323,351	1.50
18	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE	729	13,548.01	9,876,501	13,483.9478	9,829,798	1.30
19	アメリカ	投資証券	GGP INC	4,493	2,329.79	10,467,781	2,155.2884	9,683,711	1.28
20	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	1,254	8,173.84	10,249,998	7,220.3803	9,054,357	1.20
21	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	872	8,945.70	7,800,655	9,674.1949	8,435,898	1.12
22	アメリカ	投資証券	HCP INC	3,364	2,883.41	9,699,804	2,447.2529	8,232,559	1.09
23	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	812	11,487.63	9,327,959	9,916.9519	8,052,565	1.07
24	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	2,054	4,423.09	9,085,039	3,753.9853	7,710,686	1.02
25	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	2,547	3,155.90	8,038,092	2,926.2061	7,453,047	0.99
26	アメリカ	投資証券	JDR INC	1,901	4,213.87	8,010,580	3,913.6365	7,439,823	0.99

27	アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORPORATION	659	10,788.47	7,109,602	10,680.2139	7,038,261	0.93
28	アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORPORATION	1,068	7,051.50	7,531,006	6,259.1938	6,684,819	0.88
29	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT	531	13,890.85	7,376,046	12,450.5913	6,611,264	0.88
30	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	662	10,082.09	6,674,349	9,300.2175	6,156,744	0.81

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

外貨建資産の単価及び金額は、平成30年4月27日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

□.種類別投資比率

(平成30年4月27日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	98.84
合計	98.84

【投資不動産物件】

新光7資産バランスファンド

該当事項はありません。

(参考) 海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光J-REITマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光米国REIT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】

新光7資産バランスファンド

該当事項はありません。

(参考) 海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(平成30年 4月27日現在)

資産の種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	17	日本円	292,015,508	302,515,000	3.23

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

(参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

(平成30年 4月27日現在)

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P500 EMINI	買建	10	米ドル	1,341,615	146,705,600	1,337,300	146,233,755	2.28
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 601X	買建	1	カナダドル	183,477.5	15,582,744	184,500	15,669,585	0.24
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO ST50	買建	5	ユーロ	168,063.75	22,249,960	172,100	22,784,319	0.35
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200	買建	1	オーストラリアドル	149,705.5	12,367,171	147,350	12,172,583	0.19
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100 IDX	買建	1	英ポンド	71,882.25	10,938,322	73,720	11,217,972	0.17

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

外貨建先物取引については、平成30年 4月27日現在のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

(参考) 新光日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光J - R E I Tマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新光米国REITマザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

新光7資産バランスファンド

期別	純資産総額(円)		1口当たり純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第4特定期間末 (平成20年10月20日)	31,463,032,178	31,656,566,896	0.6503	0.6543
第5特定期間末 (平成21年4月20日)	21,963,360,031	22,110,320,662	0.5978	0.6018
第6特定期間末 (平成21年10月20日)	19,553,950,956	19,673,764,141	0.6526	0.6566
第7特定期間末 (平成22年4月20日)	16,678,962,105	16,777,904,047	0.6743	0.6783
第8特定期間末 (平成22年10月20日)	13,023,510,796	13,108,669,225	0.6117	0.6157
第9特定期間末 (平成23年4月20日)	12,014,371,674	12,090,851,540	0.6284	0.6324
第10特定期間末 (平成23年10月20日)	9,331,021,288	9,365,284,964	0.5447	0.5467
第11特定期間末 (平成24年4月20日)	8,395,549,774	8,423,613,455	0.5983	0.6003
第12特定期間末 (平成24年10月22日)	7,563,587,311	7,588,930,007	0.5969	0.5989
第13特定期間末 (平成25年4月22日)	9,376,624,758	9,400,502,707	0.7854	0.7874
第14特定期間末 (平成25年10月21日)	8,609,105,823	8,631,386,804	0.7728	0.7748
第15特定期間末 (平成26年4月21日)	8,104,673,028	8,125,011,741	0.7970	0.7990
第16特定期間末 (平成26年10月20日)	7,644,769,179	7,663,292,344	0.8254	0.8274
第17特定期間末 (平成27年4月20日)	7,692,606,511	7,709,179,240	0.9283	0.9303
第18特定期間末 (平成27年10月20日)	6,937,097,365	6,952,525,025	0.8993	0.9013
第19特定期間末 (平成28年4月20日)	6,329,734,429	6,344,342,644	0.8666	0.8686
第20特定期間末 (平成28年10月20日)	5,699,976,862	5,713,662,835	0.8330	0.8350
第21特定期間末 (平成29年4月20日)	5,622,268,303	5,635,216,149	0.8684	0.8704
第22特定期間末 (平成29年10月20日)	5,597,326,160	5,609,576,923	0.9138	0.9158
第23特定期間末 (平成30年4月20日)	5,336,378,402	5,348,390,205	0.8885	0.8905
平成29年4月末日	5,710,454,445		0.8831	
5月末日	5,703,746,671		0.8882	
6月末日	5,683,920,672		0.8948	
7月末日	5,614,813,221		0.8949	
8月末日	5,585,663,915		0.8943	
9月末日	5,606,812,306		0.9061	
10月末日	5,592,739,275		0.9137	
11月末日	5,609,727,449		0.9203	
12月末日	5,616,749,418		0.9286	

平成30年 1月末日	5,505,255,968		0.9172
2月末日	5,348,633,498		0.8884
3月末日	5,290,095,850		0.8808
4月末日	5,378,259,939		0.8969

(注)表中の(分配付)の数値は支払外国税を控除している場合があります。

【分配の推移】

新光7資産バランスファンド

期	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第4特定期間	平成20年 4月22日～平成20年10月20日	0.0240
第5特定期間	平成20年10月21日～平成21年 4月20日	0.0240
第6特定期間	平成21年 4月21日～平成21年10月20日	0.0240
第7特定期間	平成21年10月21日～平成22年 4月20日	0.0240
第8特定期間	平成22年 4月21日～平成22年10月20日	0.0240
第9特定期間	平成22年10月21日～平成23年 4月20日	0.0240
第10特定期間	平成23年 4月21日～平成23年10月20日	0.0220
第11特定期間	平成23年10月21日～平成24年 4月20日	0.0120
第12特定期間	平成24年 4月21日～平成24年10月22日	0.0120
第13特定期間	平成24年10月23日～平成25年 4月22日	0.0120
第14特定期間	平成25年 4月23日～平成25年10月21日	0.0120
第15特定期間	平成25年10月22日～平成26年 4月21日	0.0120
第16特定期間	平成26年 4月22日～平成26年10月20日	0.0120
第17特定期間	平成26年10月21日～平成27年 4月20日	0.0120
第18特定期間	平成27年 4月21日～平成27年10月20日	0.0120
第19特定期間	平成27年10月21日～平成28年 4月20日	0.0120
第20特定期間	平成28年 4月21日～平成28年10月20日	0.0120
第21特定期間	平成28年10月21日～平成29年 4月20日	0.0120
第22特定期間	平成29年 4月21日～平成29年10月20日	0.0120
第23特定期間	平成29年10月21日～平成30年 4月20日	0.0120

(注)各特定期間中の分配金の合計額を表示しています。

【収益率の推移】

新光7資産バランスファンド

期	計算期間	収益率(%)
第4特定期間	平成20年 4月22日～平成20年10月20日	25.3
第5特定期間	平成20年10月21日～平成21年 4月20日	4.4
第6特定期間	平成21年 4月21日～平成21年10月20日	13.2

第7特定期間	平成21年10月21日～平成22年 4月20日	7.0
第8特定期間	平成22年 4月21日～平成22年10月20日	5.7
第9特定期間	平成22年10月21日～平成23年 4月20日	6.7
第10特定期間	平成23年 4月21日～平成23年10月20日	9.8
第11特定期間	平成23年10月21日～平成24年 4月20日	12.0
第12特定期間	平成24年 4月21日～平成24年10月22日	1.8
第13特定期間	平成24年10月23日～平成25年 4月22日	33.6
第14特定期間	平成25年 4月23日～平成25年10月21日	0.1
第15特定期間	平成25年10月22日～平成26年 4月21日	4.7
第16特定期間	平成26年 4月22日～平成26年10月20日	5.1
第17特定期間	平成26年10月21日～平成27年 4月20日	13.9
第18特定期間	平成27年 4月21日～平成27年10月20日	1.8
第19特定期間	平成27年10月21日～平成28年 4月20日	2.3
第20特定期間	平成28年 4月21日～平成28年10月20日	2.5
第21特定期間	平成28年10月21日～平成29年 4月20日	5.7
第22特定期間	平成29年 4月21日～平成29年10月20日	6.6
第23特定期間	平成29年10月21日～平成30年 4月20日	1.5

(注)収益率は各特定期間における騰落率を表示しており、当該特定期間中の分配金合計額を加算して計算しています。

(4)【設定及び解約の実績】

新光7資産バランスファンド

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第4特定期間	平成20年 4月22日～平成20年10月20日	995,245,882	19,708,278,668
第5特定期間	平成20年10月21日～平成21年 4月20日	176,344,143	11,818,197,061
第6特定期間	平成21年 4月21日～平成21年10月20日	262,138,325	7,040,526,124
第7特定期間	平成21年10月21日～平成22年 4月20日	65,470,071	5,293,476,712
第8特定期間	平成22年 4月21日～平成22年10月20日	64,807,629	3,510,685,871
第9特定期間	平成22年10月21日～平成23年 4月20日	93,294,151	2,262,935,013
第10特定期間	平成23年 4月21日～平成23年10月20日	55,270,668	2,043,398,766
第11特定期間	平成23年10月21日～平成24年 4月20日	24,129,070	3,124,126,893
第12特定期間	平成24年 4月21日～平成24年10月22日	19,313,591	1,379,805,960
第13特定期間	平成24年10月23日～平成25年 4月22日	36,256,481	768,629,921
第14特定期間	平成25年 4月23日～平成25年10月21日	22,407,208	820,891,392
第15特定期間	平成25年10月22日～平成26年 4月21日	25,208,228	996,341,985
第16特定期間	平成26年 4月22日～平成26年10月20日	8,899,172	916,673,106
第17特定期間	平成26年10月21日～平成27年 4月20日	13,815,643	989,033,927
第18特定期間	平成27年 4月21日～平成27年10月20日	10,689,548	583,223,930
第19特定期間	平成27年10月21日～平成28年 4月20日	7,316,627	417,039,060
第20特定期間	平成28年 4月21日～平成28年10月20日	6,935,970	468,057,013
第21特定期間	平成28年10月21日～平成29年 4月20日	5,348,676	374,412,075

第22特定期間	平成29年 4月21日 ~ 平成29年10月20日	9,877,379	358,418,763
第23特定期間	平成29年10月21日 ~ 平成30年 4月20日	45,095,213	164,575,560

参考情報

運用実績

<基準価額・純資産の推移>

(2008年5月1日～2018年4月27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、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:2006年10月31日)

※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

データの基準日:2018年4月27日

<分配の推移(税引前)>

2018年4月	20円
2018年3月	20円
2018年2月	20円
2018年1月	20円
2017年12月	20円
直近1年累計	240円
設定来累計	3,800円

※分配金は1万口当たりです。

<主要な資産の状況>

組入状況

ファンド名	純資産比率
新光日本債券インデックスマザーファンド	14.79%
新光J-REITマザーファンド	14.31%
ニュー トピックス インデックス マザーファンド	14.20%
海外国債マザーファンド	14.18%
新光米国REITマザーファンド	13.73%
新光外国株式インデックスマザーファンド	13.46%
フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド	12.32%
合計	97.03%

国内株式の組入上位5銘柄(ニュー トピックス インデックス マザーファンド)

銘柄名	業種	純資産比率
トヨタ自動車	輸送用機器	3.31%
三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.92%
ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.43%
日本電信電話	情報・通信業	1.39%
ソニー	電気機器	1.37%

※東証33業種分類にしたがって記載しています。

※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

国内債券の組入上位5銘柄(新光日本債券インデックスマザーファンド)

銘柄名	償還日	利率	純資産比率
第123回利付国債(5年)	2020/03/20	0.100%	1.26%
第306回利付国債(10年)	2020/03/20	1.400%	1.21%
第124回利付国債(5年)	2020/06/20	0.100%	1.18%
第312回利付国債(10年)	2020/12/20	1.200%	1.14%
第308回利付国債(10年)	2020/06/20	1.300%	1.13%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

国内REITの組入上位5銘柄(新光J-REITマザーファンド)

銘柄名	純資産比率
日本ビルファンド投資法人	7.24%
ジャパソリアルエステイト投資法人	6.87%
野村不動産マスターファンド投資法人	5.49%
日本リテールファンド投資法人	4.70%
ユナイテッド・アーバン投資法人	4.50%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

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

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

-委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日：2018年4月27日

外国株式等の組入上位5銘柄(新光外国株式インデックスマザーファンド)

銘柄名	国・地域	業種	純資産比率
APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.21%
MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.80%
AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	1.62%
FACEBOOK INC-A	アメリカ	ソフトウェア・サービス	1.07%
JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	1.02%

※世界産業分類基準(GICS)にしたがって記載しています。
 ※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

外国債券の組入上位5銘柄(海外国債マザーファンド)

銘柄名	償還日	利率	通貨	純資産比率
US TREASURY N/B	2025/11/15	2.250%	米ドル	4.85%
US TREASURY N/B	2025/08/15	2.000%	米ドル	4.77%
US TREASURY N/B	2026/02/15	1.625%	米ドル	4.62%
US TREASURY N/B	2026/05/15	1.625%	米ドル	4.60%
US TREASURY N/B	2026/08/15	1.500%	米ドル	4.54%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

フランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンドの状況(現地2018年4月13日現在)

①組入公社債の上位5通貨

通貨	比率
米ドル	62.4%
南アフリカランド	4.3%
メキシコペソ	3.4%
ウルグアイペソ	3.3%
コロンビアペソ	3.2%

②組入公社債の上位5カ国

国・地域	比率
南アフリカ	6.2%
コロンビア	5.1%
トルコ	4.6%
メキシコ	4.5%
アルゼンチン	4.3%

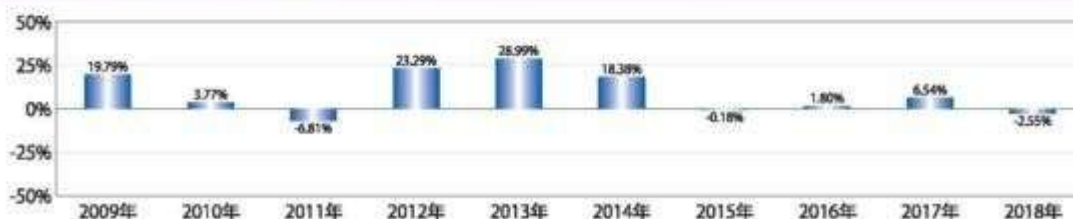
※フランクリン・テンブルトン・インベストメント・マネジメント・リミテッドからの情報を基に作成しております。
 ※比率はフランクリン・テンブルトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンドの純資産総額に対する割合で、小数第2位を四捨五入しています。

米国REITの組入上位5銘柄(新光米国REITマザーファンド)

銘柄名	純資産比率
AMERICAN TOWER CORPORATION	6.13%
SIMON PROPERTY GROUP	4.95%
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	4.48%
PROLOGIS INC	3.68%
EQUINIX INC	3.43%

※純資産比率は、マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

<年間収益率の推移(暦年ベース)>



※年間収益率は、分配金再投資基準額をもとに計算したものです。
 ※2018年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
 ※当ファンドにはベンチマークはありません。

掲載データ等はいくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
 表中の純資産比率は小数第3位を切り捨てて求めたものであり、各比率の合計と合計欄の数値が一致しない場合があります。
 ※委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(イ) 取得申込者は、「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」について、販売会社ごとに定める申込単位で、取得申込受付日の翌営業日の基準価額で購入することができます。ただし、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は1口単位となります。

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込金額に手数料および当該手数料にかかる消費税等を加算した金額を販売会社が指定する期日までに支払うものとします。

(ロ) 「分配金再投資コース」での取得申込者は販売会社との間で「新光7資産バランスファンド自動継続投資約款」(別の名称で同様の権利義務を規定する約款を含みます。)にしたがって契約(以下「別に定める契約」といいます。)を締結します。

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

なお、以下のいずれかに該当する日には、取得申し込みの受付は行いません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

また、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託者の判断により、取得申し込みの受付を中止すること、または既に受け付けた取得申し込みの受付を取り消すことができます。ただし、別に定める契約に基づく収益分配金の再投資にかかる追加信託金の申し込みに限ってこれを受け付けるものとします。

2【換金(解約)手続等】

一部解約(解約請求によるご解約)

(イ) 受益者は、「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」の両コースとも、販売会社が定める単位で、一部解約の実行を請求することができます。

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

また、投資信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

(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翌営業日の基準価額から当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。

一部解約に関して課税対象者にかかる所得税および地方税(法人の受益者の場合は所得税のみ)に相当する金額が控除されます。

なお、一部解約の価額は、毎営業日に算出されますので、販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

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

（ホ）一部解約金は、受益者の一部解約の実行の請求受付日から起算して、原則として、5営業日目から販売会社において受益者に支払われます。ただし、投資を行った投資信託証券の換金停止、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託者の判断により、一部解約金の支払いを延期する場合があります。

（ヘ）受益者は、以下のいずれかに該当する日には、上記（イ）による一部解約の実行の請求を行えないものとします。

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

（ト）委託者は、投資を行った投資信託証券の換金停止、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能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およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。

（チ）上記（ト）により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合、またはすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受付が取り消された場合には、受益者は当該受付中止または取消以前に行った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、当該受付中止または取り消しを解除した後の最初の基準価額の計算日（この日が一部解約の実行の請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の実行の請求を受け付けることができる日とします。）に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記（二）の規定に準じて計算された価額とします。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入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
外国投資信託証券	計算日に入手し得る直近の純資産価格(基準価額)
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

(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、投資信託契約締結日から平成33年10月20日までです。

委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託者と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

(4) 【計算期間】

当ファンドの計算期間は、原則として毎月21日から翌月20日までとします。

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

(5) 【その他】

a. 信託の終了(投資信託契約の解約)

(イ) 委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより、受益権の総口数が30億口を下回ることとなった場合、または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、もしく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。

(ロ) 委託者は、上記(イ)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。

(ハ) 上記(ロ)の投資信託契約の解約にかかる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。

(ニ) 上記(ハ)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。

(ホ) 委託者は、上記(ニ)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。

(ヘ)上記(ハ)から(ホ)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、上記(ホ)の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。

(ト)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。

(チ)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。

(リ)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、毎年4月、10月の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の処理の一部について日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

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

h. 信託業務の委託等

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

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

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

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

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

i. 関係法人との契約の更改

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

また、委託者と投資顧問会社との間において締結している「投資顧問契約」の有効期間は

契約の締結日から投資信託約款に基づくファンドの信託終了日までとし、途中での更新は行いません。なお、委託者、投資顧問会社は、法律による解除権の行使以外に、相手方に対する90日前の書面による解約申し入れによりこの契約を解約できるものとします。

4【受益者の権利等】

a．収益分配金請求権

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

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

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

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

b．償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として扱います。)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)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。

(3) 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23期特定期間(平成29年10月21日から平成30年4月20日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【新光7資産バランスファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第22期特定期間末 平成29年10月20日現在	第23期特定期間末 平成30年4月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	162,001,226	185,334,321
投資信託受益証券	691,185,000	658,620,000
親投資信託受益証券	4,771,243,750	4,509,067,312
流動資産合計	5,624,429,976	5,353,021,633
資産合計	5,624,429,976	5,353,021,633
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	12,250,763	12,011,803
未払解約金	10,102,880	-
未払受託者報酬	398,191	388,346
未払委託者報酬	4,330,322	4,223,256
未払利息	266	420
その他未払費用	21,394	19,406
流動負債合計	27,103,816	16,643,231
負債合計	27,103,816	16,643,231
純資産の部		
元本等		
元本	6,125,381,994	6,005,901,647
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	528,055,834	669,523,245
(分配準備積立金)	330,794,242	375,532,653
元本等合計	5,597,326,160	5,336,378,402
純資産合計	5,597,326,160	5,336,378,402
負債純資産合計	5,624,429,976	5,353,021,633

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第22期特定期間		第23期特定期間	
	自	平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	自	平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
営業収益				
受取配当金		84,150,000		87,975,000
有価証券売買等損益		307,596,648		138,346,438
その他収益		-		44,093
営業収益合計		391,746,648		50,327,345
営業費用				
支払利息		49,751		51,247
受託者報酬		2,448,307		2,363,591
委託者報酬		26,625,233		25,703,981
その他費用		221,656		118,116
営業費用合計		29,344,947		28,236,935
営業利益		362,401,701		78,564,280
経常利益		362,401,701		78,564,280
当期純利益		362,401,701		78,564,280
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		1,955,783		290,139
期首剰余金又は期首欠損金()		851,655,075		528,055,834
剰余金増加額又は欠損金減少額		39,617,540		14,465,397
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		39,617,540		14,465,397
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,061,671		4,646,990
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,061,671		4,646,990
分配金		75,402,546		72,431,399
期末剰余金又は期末欠損金()		528,055,834		669,523,245

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第23期特定期間	
	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券	移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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。
	親投資信託受益証券	移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金	原則として、投資信託受益証券の収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

第22期特定期間末 平成29年10月20日現在		第23期特定期間末 平成30年 4月20日現在	
1. 特定期間末日における受益権の総数	6,125,381,994口	1. 特定期間末日における受益権の総数	6,005,901,647口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額	元本の欠損 528,055,834円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額	元本の欠損 669,523,245円
3. 特定期間末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.9138円 (1万口当たり純資産額) (9,138円)	3. 特定期間末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 0.8885円 (1万口当たり純資産額) (8,885円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第22期特定期間 自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	第23期特定期間 自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
分配金の計算過程	<p>第125期(自 平成29年 4月21日 至 平成29年 5月22日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(21,862,924円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に定める収益調整金(3,569,627円)及び分配準備積立金(293,799,079円)より分配対象収益は319,231,630円(1万口当たり496.86円)であり、うち12,849,322円(1万口当たり20円)を分配しております。</p> <p>第126期(自 平成29年 5月23日 至 平成29年 6月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(21,093,395円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に定める収益調整金(3,595,497円)及び分配準備積立金(301,705,195円)より分配対象収益は326,394,087円(1万口当たり509.91円)であり、うち12,801,445円(1万口当たり20円)を分配しております。</p> <p>第127期(自 平成29年 6月21日 至 平成29年 7月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(18,274,342円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に定める収益調整金(3,744,200円)及び分配準備積立金(304,893,492円)より分配対象収益は326,912,034円(1万口当たり519.40円)であり、うち12,587,567円(1万口当たり20円)を分配しております。</p> <p>第128期(自 平成29年 7月21日 至 平成29年 8月21日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(16,810,561円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に定める収益調整金(3,772,069円)及び分配準備積立金(308,988,820円)より分配対象収益は329,571,450円(1万口当たり526.39円)であり、うち12,521,440円(1万口当たり20円)を分配しております。</p>	<p>第131期(自 平成29年10月21日 至 平成29年11月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(16,943,866円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に定める収益調整金(3,937,701円)及び分配準備積立金(329,531,303円)より分配対象収益は350,412,870円(1万口当たり574.15円)であり、うち12,205,835円(1万口当たり20円)を分配しております。</p> <p>第132期(自 平成29年11月21日 至 平成29年12月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(20,427,290円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に定める収益調整金(3,957,745円)及び分配準備積立金(332,043,092円)より分配対象収益は356,428,127円(1万口当たり588.02円)であり、うち12,122,684円(1万口当たり20円)を分配しております。</p> <p>第133期(自 平成29年12月21日 至 平成30年 1月22日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(21,354,434円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に定める収益調整金(3,985,131円)及び分配準備積立金(338,670,869円)より分配対象収益は364,010,434円(1万口当たり603.56円)であり、うち12,061,733円(1万口当たり20円)を分配しております。</p> <p>第134期(自 平成30年 1月23日 至 平成30年 2月20日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(17,863,166円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、信託約款に定める収益調整金(4,164,403円)及び分配準備積立金(345,933,758円)より分配対象収益は367,961,327円(1万口当たり613.51円)であり、うち11,994,851円(1万口当たり20円)を分配しております。</p>

区分	第22期特定期間 自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	第23期特定期間 自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
	<p>第129期（自 平成29年 8月22日 至 平成29年 9月20日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（22,953,942円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、信託約款に定める収益調整金（3,839,502円）及び分配準備積立金（310,082,404円）より分配対象収益は336,875,848円（1万口当たり543.67円）であり、うち12,392,009円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第130期（自 平成29年 9月21日 至 平成29年10月20日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（25,927,649円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、信託約款に定める収益調整金（3,842,458円）及び分配準備積立金（317,117,356円）より分配対象収益は346,887,463円（1万口当たり566.29円）であり、うち12,250,763円（1万口当たり20円）を分配しております。</p>	<p>第135期（自 平成30年 2月21日 至 平成30年 3月20日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（21,357,641円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、信託約款に定める収益調整金（6,369,629円）及び分配準備積立金（350,850,943円）より分配対象収益は378,578,213円（1万口当たり629.13円）であり、うち12,034,493円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第136期（自 平成30年 3月21日 至 平成30年 4月20日）</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（28,088,952円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、信託約款に定める収益調整金（6,431,286円）及び分配準備積立金（359,455,504円）より分配対象収益は393,975,742円（1万口当たり655.95円）であり、うち12,011,803円（1万口当たり20円）を分配しております。</p>

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	第22期特定期間 自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	第23期特定期間 自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2.金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、投資信託受益証券、親投資信託受益証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p>	同左

区分	第22期特定期間 自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	第23期特定期間 自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
3.金融商品に係るリスクの管理体制	<p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	同左
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

第22期特定期間末 平成29年10月20日現在	第23期特定期間末 平成30年 4月20日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

第22期特定期間末 平成29年10月20日現在	第23期特定期間末 平成30年 4月20日現在
投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 親投資信託受益証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

	第22期特定期間 自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	第23期特定期間 自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	第22期特定期間末 平成29年10月20日現在	第23期特定期間末 平成30年 4月20日現在
期首元本額	6,473,923,378円	6,125,381,994円
期中追加設定元本額	9,877,379円	45,095,213円
期中一部解約元本額	358,418,763円	164,575,560円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第22期特定期間末 平成29年10月20日現在	第23期特定期間末 平成30年 4月20日現在
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）
投資信託受益証券	2,310,000	1,620,000
親投資信託受益証券	59,896,721	60,904,040
合計	57,586,721	59,284,040

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド	180,000	658,620,000	
投資信託受益証券 小計		180,000	658,620,000	
親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	341,575,843	759,083,995	
	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	330,753,274	752,496,773	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	316,216,743	718,950,386	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	628,025,669	795,834,127	
	新光J - R E I Tマザーファンド	462,104,698	760,578,122	
	新光米国 R E I Tマザーファンド	496,954,036	722,123,909	
親投資信託受益証券 小計		2,575,630,263	4,509,067,312	
合計		2,575,810,263	5,167,687,312	

(注1) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド」、「海外国債マザーファンド」、「ニュー トピックス インデックス マザーファンド」、「新光外国株式インデックスマザーファンド」、「新光日本債券インデックスマザーファンド」、「新光J - R E I Tマザーファンド」及び「新光米国 R E I Tマザーファンド」各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「投資信託受益証券」は、すべて「フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド」の受益証券であり、「親投資信託受益証券」は、「海外国債マザーファンド」、「ニュー トピックス インデックス マザーファンド」、「新光外国株式インデックスマザーファンド」、「新光日本債券インデックスマザーファンド」、「新光J - R E I Tマザーファンド」及び「新光米国 R E I Tマザーファンド」の受益証券であります。

各ファンドの状況は次の通りであります。

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

「フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド」の状況

「フランクリン・templton・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンド」は、ケイ

マン諸島で設立された円建外国証券投資信託であります。同ファンドの平成29年5月31日現在の「財政状態計算書」は、国際財務報告基準に従い作成されており、独立監査人の監査を受けております。同ファンドの平成29年11月30日現在の「投資ポートフォリオ」は、国際財務報告基準に従い作成されておりますが、独立監査人の監査を受けておりません。

同ファンドの「財政状態計算書」及び「投資ポートフォリオ」は、同ファンドの副管理事務代行会社であるザバンクオブニューヨークメロンシンガポール支店から入手した財務書類の原文の一部を翻訳・抜粋したものであります。あくまで参考和訳であり、正確性を保証するものではありません。

財政状態計算書

2017年5月31日現在

	2017年 (日本円)	2016年 (日本円)
資産		
流動資産		
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産	19,374,319,731	22,038,032,952
ブローカーに対する債権	-	294,594,577
発行に係る未収入金	136,471,941	67,756,680
現金および現金同等物	2,474,572,696	1,122,999,402
その他の債権	5,478,574	11,174,748
資産合計	21,990,842,942	23,534,558,359
負債		
流動負債		
償還に係る未払金	2,892,780	356,648,726
ブローカーに対する債務	-	6,118,096
未払費用	25,447,393	39,959,092
負債合計	28,340,173	402,725,914
受益証券保有者に帰属する純資産	21,962,502,769	23,131,832,445

投資ポートフォリオ

2017年11月30日現在

(無監査)

	公正価値 2017年11月30日 現在 (日本円)	公正価値 2017年5月31日 現在 (日本円)
債券		
アンゴラ		
Angolan Government International Bond 9.50% due 12/11/2025 REGS	977,106,419	640,103,230
Republic of Angola (Northern Lights III BV) 7.00% due 17/08/2019 REGS	-	135,149,639
アンゴラ合計	977,106,419	775,252,869
アルゼンチン		
Provincia De Tierra Del Fuego Argentina 8.95% due 17/04/2027 REGS	543,579,073	107,736,737
Provincia Del Chubut Argentina 7.75% due 26/07/2026 REGS	454,141,999	434,794,545
アルゼンチン合計	997,721,072	542,531,282
アルメニア		
Republic of Armenia 7.15% due 26/03/2025 REGS	729,399,036	586,980,870
アルメニア合計	729,399,036	586,980,870

アゼルバイジャン

International Bank of Azerbaijan Ojsc 5.625% due 11/06/2019 REGS	557,020,367	565,124,044
Southern Gas Corridor 6.875% due 24/03/2026 REGS	322,164,156	-
アゼルバイジャン合計	879,184,523	565,124,044
ボスニア・ヘルツェゴビナ		
Bosnia and Herzegovina FRN due 20/12/2021	747,407,289	747,901,086
ボスニア・ヘルツェゴビナ合計	747,407,289	747,901,086
ブラジル		
Brazil Republic of 2.625% due 05/01/2023	470,859,354	-
Caixa Economica Federal 4.25% due 13/05/2019 REGS	441,262,968	433,430,059
ブラジル合計	912,122,322	433,430,059
カメルーン		
Republic of Cameroon International Bond 9.50% due 19/11/2025 REGS	473,355,275	462,575,128
カメルーン合計	473,355,275	462,575,128
	公正価値 2017年11月30日 現在 (日本円)	公正価値 2017年5月31日 現在 (日本円)
債券(続き)		
コロンビア		
Bogota Distrito Capital 9.75% due 26/07/2028 REGS	376,087,622	242,478,847
Ecopetrol SA 4.125% due 16/01/2025	330,752,890	315,008,411
Empresa De Telecomunicaciones De Bogota SA 7.00% due 17/01/2023 REGS	407,564,942	382,545,517
Republic of Colombia 4.375% due 12/07/2021	241,677,138	-
コロンビア合計	1,356,082,592	940,032,775
ドミニカ共和国		
Mestenio Ltd 8.50% due 02/01/2020 REGS	123,997,600	153,014,112
ドミニカ共和国合計	123,997,600	153,014,112
エジプト		
Arab Republic Egypt 7.50% due 31/01/2027 REGS	63,867,917	60,183,760
Egypt Government Bond 18.15% due 13/06/2020	189,349,154	-
Egypt Government Bond 16.40% due 05/09/2020	59,699,307	-
Egypt Treasury Bill due 27/02/2018	119,319,360	-
エジプト合計	432,235,738	60,183,760
エルサルバドル		
Republic of El Salvador 7.65% due 15/06/2035	355,777,822	312,442,961
エルサルバドル合計	355,777,822	312,442,961
エチオピア		
Federal Democratic Republic of Ethiopia 6.625% due 11/12/2024 REGS	554,398,980	379,945,795
エチオピア合計	554,398,980	379,945,795

ガボン

Republic of Gabon 6.95% due 16/06/2025 REGS	515,193,387	331,531,851
ガボン合計	515,193,387	331,531,851

ジョージア

Georgian Oil & Gas Corp 6.75% due 26/04/2021 REGS	328,576,511	317,445,869
Georgian Railway LLC 7.75% due 11/07/2022	155,306,883	151,133,799
ジョージア合計	483,883,394	468,579,668

ガーナ

Ghana Govt 23.00% due 21/08/2017	-	898,297,307
Ghana Govt 18.25% due 25/07/2022	697,482,258	-
Saderea Dac 12.50% due 30/11/2026 REGS	105,550,635	-
ガーナ合計	803,032,893	898,297,307

公正価値 2017年11月30日 現在 (日本円)	公正価値 2017年5月31日 現在 (日本円)
------------------------------------	-----------------------------------

債券(続き)

イラク

Oilflow SPV 1 DAC (Krg) 12.00% due 13/01/2022 REGS	190,337,320	82,793,793
Republic of Iraq 5.80% due 15/01/2028 REGS	193,121,491	799,335,707
イラク合計	383,458,811	882,129,500

ジャマイカ

Government of Jamaica 7.875% due 28/07/2045	353,580,019	202,121,428
ジャマイカ合計	353,580,019	202,121,428

ヨルダン

Jordan Kingdom 6.125% due 29/01/2026 REGS	272,257,407	93,428,459
ヨルダン合計	272,257,407	93,428,459

カザフスタン

Astana Finance JSC 0% due 22/12/2024 REGS	3,407,459	3,353,870
Kazakhstan Government International Bond 4.875% due 14/10/2044 REGS	384,603,338	233,188,518
Kazakhstan Temir Zholy Finance Bv 6.375% due 06/10/2020 REGS	-	146,139,519
Kazakhstan Temir Zholy Finance Bv 6.95% due 10/07/2042 REGS	262,676,007	248,209,289
Kazakhstan Temir Zholy National Co JSC 4.85% due 17/11/2027 REGS	241,176,531	-
カザフスタン合計	891,863,335	630,891,196

ケニア

Kenya Government International Bond 6.875% due 24/06/2024 REGS	183,793,064	176,528,294
Kenya Infrastructure Bond 11.00% due 15/09/2025	309,837,265	414,125,215
Kenya Infrastructure Bond 12.50% due 05/12/2025	154,592,080	-
ケニア合計	648,222,409	590,653,509

メキシコ

Mexican Fixed Rate Bonds 5.00% due 11/12/2019	953,560,978	590,635,795
Mexican Udibonos 4.50% due 04/12/2025 Index Linked To Mxudi	99,392,771	96,457,707
Mexican Udibonos 4.00% due 15/11/2040 Index Linked	-	207,238,627
Mexico City Airport Trust 4.25% due 31/10/2026 REGS	164,096,277	45,737,500
Mexico City Airport Trust 5.50% due 31/07/2047 REGS	131,645,978	-
メキシコ合計	1,348,696,004	940,069,629

公正価値 2017年11月30日 現在 (日本円)	公正価値 2017年5月31日 現在 (日本円)
------------------------------------	-----------------------------------

債券(続き)

モザンビーク

Mozambique International Bond 10.50% due 18/01/2023 REGS	343,670,226	313,154,834
モザンビーク合計	343,670,226	313,154,834

ペルー

Lima Metro Line 2 Finance Ltd 5.875% due 05/07/2034 REGS	626,133,053	597,596,017
Peruvian Government International Bond 6.35% due 12/08/2028 REGS	448,890,631	65,476,624
ペルー合計	1,075,023,684	663,072,641

ロシア

Russia Govt Bond - Ofz 7.50% due 15/03/2018	751,493,495	472,615,238
RZD Capital Ltd 5.70% due 05/04/2022 REGS	456,803,102	446,661,045
ロシア合計	1,208,296,597	919,276,283

南アフリカ

South Africa Republic of 4.30% due 12/10/2028	522,573,547	-
South Africa Republic of 7.00% due 28/02/2031	1,154,884,930	1,205,645,819
南アフリカ合計	1,677,458,477	1,205,645,819

スリランカ

National Savings Bank 8.875% due 18/09/2018 REGS	262,231,615	204,379,676
スリランカ合計	262,231,615	204,379,676

国際機関

Banque Ouest Africaine De Developpement 5.00% due 27/07/2027 REGS	262,336,997	-
International Finance Corp 10.25% due 05/12/2018	89,868,515	86,739,579
国際機関合計	352,205,512	86,739,579

スリナム

Suriname, Republic of 9.25% due 26/10/2026 REGS	123,100,378	114,795,997
スリナム合計	123,100,378	114,795,997

トリニダード・トバゴ

Petro Co Trin/Tobago Ltd 9.75% due 14/08/2019 REGS	841,089,043	829,555,691
トリニダード・トバゴ合計	841,089,043	829,555,691

チュニジア

Banque Centrale De Tunisie International Bond 5.75% due
30/01/2025 REGS

741,534,942 -

チュニジア合計

741,534,942 -

	公正価値 2017年11月30日 現在 (日本円)	公正価値 2017年5月31日 現在 (日本円)
--	------------------------------------	-----------------------------------

債券(続き)

トルコ

Turkey Government Bond 8.70% due 11/07/2018

765,147,861 796,033,386

Turkey Republic of 4.875% due 16/04/2043

457,247,410 -

トルコ合計

1,222,395,271 796,033,386

ウガンダ

Republic of Uganda Government Bonds 10.75% due
22/02/2018

96,161,659 93,876,161

Republic of Uganda Government Bonds 16.125% due
22/03/2018

142,600,799 141,721,143

Republic of Uganda Government Bonds 14.625% due
01/11/2018

6,240,606 5,941,222

Republic of Uganda Government Bonds 13.75% due
13/06/2019

240,071,715 225,183,780

ウガンダ合計

485,074,779 466,722,306

ウクライナ

City of Kyiv (CSFB) 8.00% due 06/11/2015

465,086,331 402,394,752

Ukraine Government 7.375% due 25/09/2032 REGS

315,356,445 -

ウクライナ合計

780,442,776 402,394,752

ウルグアイ

Uruguay Republic of 3.70% due 26/06/2037 Index Linked

1,101,460,152 924,840,605

ウルグアイ合計

1,101,460,152 924,840,605

債券合計

24,452,959,779 17,923,728,857

原油ワラント

ナイジェリア

Nigeria Central Bank of WRD Exp 15/11/2020

1,126,645,662 1,138,498,173

ナイジェリア合計

1,126,645,662 1,138,498,173

ベネズエラ

Venezuela Republic of WRD Exp 15/04/2020

120,792,168 312,092,701

ベネズエラ合計

120,792,168 312,092,701

原油ワラント合計

1,247,437,830 1,450,590,874

投資ポートフォリオ

25,700,397,609 19,374,319,731

(FRN)変動利付債です。

(Index Linked)インフレ連動債です。

(REGS)Regulation Sの略。米国外での証券の募集に関して1990年に米証券取引委員会より定められた規制です。米国企業が米国外で募集した証券については当局での登録義務が免除されており、米国証券を購入する海外投資家の負担を軽減しています。

はアセットマネジメントOneにて追記

海外国債マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	200,244,284	183,002,707
国債証券	23,845,540,620	21,071,774,161
未収利息	135,480,459	117,157,946
前払費用	47,814,975	55,306,725
流動資産合計	24,229,080,338	21,427,241,539
資産合計	24,229,080,338	21,427,241,539
負債の部		
流動負債		
未払解約金	60,000,000	-
未払利息	329	415
流動負債合計	60,000,329	415
負債合計	60,000,329	415
純資産の部		
元本等		
元本	10,478,644,216	9,642,136,028
剰余金		
剰余金又は欠損金()	13,690,435,793	11,785,105,096
元本等合計	24,169,080,009	21,427,241,124
純資産合計	24,169,080,009	21,427,241,124
負債純資産合計	24,229,080,338	21,427,241,539

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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(ただし、売気配は使用いたしません。)、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)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	為替予約取引 原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。

(貸借対照表に関する注記)

平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 10,478,644,216口	1. 計算日における受益権の総数 9,642,136,028口
2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 2.3065円 (1万口当たり純資産額) (23,065円)	2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 2.2223円 (1万口当たり純資産額) (22,223円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 また、当ファンドは、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、国債証券であり、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引は為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左

区分	自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	<p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

金融商品の時価等に関する事項

平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p>

平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
国債証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

区分	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	12,075,774,784円	10,478,644,216円
期中追加設定元本額	33,413,066円	32,599,920円
期中一部解約元本額	1,630,543,634円	869,108,108円
同期末における元本の内訳		
海外国債ファンド	7,647,781,823円	7,029,474,252円
海外国債ファンド(3ヵ月決算型)	1,209,817,879円	1,154,979,912円
新光7資産バランスファンド	341,575,843円	341,575,843円
海外国債ファンド(1年決算型)	30,496,279円	29,110,123円
海外国債ファンド(変額年金)	1,235,146,275円	1,070,465,822円
グローバル・ナビ	13,826,117円	16,530,076円
合計	10,478,644,216円	9,642,136,028円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	344,646,306	346,244,104
合計	344,646,306	346,244,104

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

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

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

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	10,000,000.00	9,517,968.78	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	10,000,000.00	9,416,406.28	
		US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	10,000,000.00	9,564,843.78	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	10,000,000.00	9,114,062.49	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	10,000,000.00	9,084,375.00	
		US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	10,000,000.00	8,963,281.30	
		US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	1,000,000.00	931,015.63	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	1,000,000.00	948,515.63	
		US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	8,000,000.00	7,658,125.04	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	6,000,000.00	5,674,218.78	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	8,000,000.00	7,554,375.04	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	5,000,000.00	4,895,703.15	
米ドル建小計			89,000,000.00	83,322,890.90 (8,955,544,313)	
カナダドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	2,000,000.00	1,995,660.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	2,000,000.00	1,881,400.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	1,500,000.00	1,337,700.00	
カナダドル建小計			5,500,000.00	5,214,760.00 (442,315,943)	
ユーロ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	3,400,000.00	3,439,780.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-26/08/15	3,500,000.00	3,382,540.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	3,000,000.00	2,943,300.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	1,000,000.00	1,542,770.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15	3,000,000.00	2,990,880.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	1,500,000.00	2,221,845.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-28/02/15	500,000.00	495,570.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-25/06/01	3,000,000.00	3,050,100.00	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-25/12/01	3,000,000.00	3,139,200.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-26/03/01	3,000,000.00	3,693,600.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%-26/06/01	2,000,000.00	2,020,000.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	2,000,000.00	2,919,200.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%-26/12/01	3,500,000.00	3,423,350.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%-27/06/01	3,000,000.00	3,140,400.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%-27/08/01	3,000,000.00	3,096,000.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	3,000,000.00	4,274,400.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-28/02/01	500,000.00	510,250.00	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	3,700,000.00	3,728,120.00	
		FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	3,500,000.00	4,955,650.00	
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	3,400,000.00	3,537,700.00	
		FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	3,200,000.00	3,938,560.00	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	3,100,000.00	3,095,040.00	
		FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	3,300,000.00	3,203,640.00	
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	3,000,000.00	3,085,200.00	
		FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,000,000.00	3,562,800.00	
ユーロ建小計			68,100,000.00	75,389,895.00 (10,002,731,268)	
英ポンド	国債証券	TSY-2.0%-25/09/07	1,800,000.00	1,878,480.00	
		TSY-1.5%-26/07/22	3,200,000.00	3,206,400.00	
		TSY-1.25%-27/07/22	2,300,000.00	2,234,910.00	
		TSY-4.25%-27/12/07	3,000,000.00	3,725,700.00	
英ポンド建小計			10,300,000.00	11,045,490.00 (1,671,182,637)	
合計				21,071,774,161 (21,071,774,161)	

有価証券明細表注記

- 小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。
- 合計欄の記載は、邦貨金額であります。（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	債券 12銘柄	41.8%	42.5%
カナダドル	債券 3銘柄	2.1%	2.1%

ユーロ	債券	25銘柄	46.7%	47.5%
英ポンド	債券	4銘柄	7.8%	7.9%

(注1) 組入債券時価比率は、純資産総額に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

(注2) 有価証券の合計額に対する比率は、邦貨建有価証券評価額及び外貨建有価証券の邦貨換算評価額の合計に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

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。

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	268,811,452	235,107,884
株式	11,189,861,700	9,042,592,480
派生商品評価勘定	24,938,844	8,460,140
未収入金	-	624,352
未収配当金	88,577,574	87,574,231
流動資産合計	11,572,189,570	9,374,359,087
資産合計	11,572,189,570	9,374,359,087
負債の部		
流動負債		
前受金	25,515,000	9,080,000
未払解約金	9,310,000	41,210,000
未払利息	441	533
流動負債合計	34,825,441	50,290,533
負債合計	34,825,441	50,290,533
純資産の部		
元本等		
元本	5,186,122,788	4,098,246,220
剰余金		
剰余金又は欠損金()	6,351,241,341	5,225,822,334
元本等合計	11,537,364,129	9,324,068,554
純資産合計	11,537,364,129	9,324,068,554
負債純資産合計	11,572,189,570	9,374,359,087

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

区分	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。
3.収益及び費用の計上基準	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。 受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
1. 担保資産 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り差入を行っております。 株式 157,892,200円	1. 担保資産 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り差入を行っております。 株式 160,403,750円
2. 計算日における受益権の総数 5,186,122,788口	2. 計算日における受益権の総数 4,098,246,220口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 2.2247円 (1万口当たり純資産額) (22,247円)	3. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 2.2751円 (1万口当たり純資産額) (22,751円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため、デリバティブ取引を行っております。	同左

区分	自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、株式であり、株価変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。株価指数先物取引は株価の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	<p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

金融商品の時価等に関する事項

平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>株式 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載して おります。</p> <p>派生商品評価勘定 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載して おります。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に 近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりま す。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

区分	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首にお ける当該親投資信託の元本額	5,760,289,946円	5,186,122,788円
期中追加設定元本額	98,220,772円	175,144,985円
期中一部解約元本額	672,387,930円	1,263,021,553円
同期末における元本の内訳		
ニュー トピックス インデックス	283,603,879円	269,586,137円
新光7資産バランスファンド	352,965,055円	330,753,274円
ニュー トピックス インデックス(変額年 金)	153,131,615円	130,456,477円
新光世界バランスファンド35VA(適格機関 投資家私募)	1,390,094,344円	804,445,787円
新光ワールドバランスファンドVA(適格機関 投資家私募)	1,157,882,945円	841,698,741円
新光世界バランス35VAT(適格機関投資家 私募)	41,174,592円	36,384,531円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関 投資家私募)	1,308,023,974円	1,205,482,988円

区分	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	457,246,496円	431,936,520円
グローバル・ナビ	14,595,545円	21,951,511円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	5,029,285円	5,064,967円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	18,982,580円	17,271,049円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	3,392,478円	3,214,238円
合計	5,186,122,788円	4,098,246,220円

2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	1,200,153,302	627,982,573
合計	1,200,153,302	627,982,573

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

3 デリバティブ取引等関係 取引の時価等に関する事項 (株式関連)

種類	平成29年10月20日現在				平成30年 4月20日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超				うち1年超		
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	303,856,156	-	328,795,000	24,938,844	254,114,860	-	262,575,000	8,460,140
東証株価指数先物	303,856,156	-	328,795,000	24,938,844	254,114,860	-	262,575,000	8,460,140
合計	303,856,156	-	328,795,000	24,938,844	254,114,860	-	262,575,000	8,460,140

時価の算定方法

先物取引

原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
 先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。
 契約額等には手数料相当額を含んでおります。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表 (1) 株式

(単位:円)

		評価額
--	--	-----

銘柄	株式数	単価	金額	備考
極洋	200	3,755.00	751,000	
日本水産	4,600	589.00	2,709,400	
マルハニチロ	800	3,780.00	3,024,000	
カネコ種苗	100	1,601.00	160,100	
サカタのタネ	600	3,990.00	2,394,000	
ホクト	400	1,994.00	797,600	
ホクリヨウ	100	1,280.00	128,000	
日鉄鉱業	100	6,890.00	689,000	
三井松島産業	200	1,536.00	307,200	
国際石油開発帝石	19,800	1,419.00	28,096,200	
石油資源開発	600	2,760.00	1,656,000	
K&Oエナジーグループ	200	1,707.00	341,400	
ショーボンドホールディングス	400	8,180.00	3,272,000	
ミライト・ホールディングス	1,300	1,706.00	2,217,800	
TATERU	400	2,045.00	818,000	
ダイセキ環境ソリューション	100	1,094.00	109,400	
安藤・間	3,200	865.00	2,768,000	
東急建設	1,600	1,152.00	1,843,200	
コムシスホールディングス	1,400	2,947.00	4,125,800	
ミサワホーム	300	938.00	281,400	
高松コンストラクショングループ	300	2,960.00	888,000	
東建コーポレーション	200	10,920.00	2,184,000	
ソネック	100	779.00	77,900	
ヤマウラ	200	882.00	176,400	
大成建設	4,100	5,640.00	23,124,000	
大林組	12,200	1,186.00	14,469,200	
清水建設	12,500	999.00	12,487,500	
飛鳥建設	3,700	172.00	636,400	
長谷工コーポレーション	4,700	1,670.00	7,849,000	
松井建設	400	841.00	336,400	
銭高組	100	5,250.00	525,000	
鹿島建設	18,000	1,017.00	18,306,000	
不動テトラ	3,100	185.00	573,500	
鉄建建設	200	3,095.00	619,000	
西松建設	900	2,888.00	2,599,200	
三井住友建設	2,900	645.00	1,870,500	
大豊建設	1,000	632.00	632,000	
前田建設工業	2,900	1,330.00	3,857,000	
佐田建設	300	473.00	141,900	
ナカノフドー建設	300	614.00	184,200	
奥村組	700	4,465.00	3,125,500	

東鉄工業	500	3,210.00	1,605,000
イチケン	100	2,437.00	243,700
浅沼組	1,000	394.00	394,000
戸田建設	5,000	877.00	4,385,000
熊谷組	600	3,505.00	2,103,000
青木あすなろ建設	300	1,057.00	317,100
北野建設	1,000	386.00	386,000
植木組	100	2,616.00	261,600
三井ホーム	1,000	727.00	727,000
矢作建設工業	600	819.00	491,400
ピーエス三菱	500	697.00	348,500
日本ハウスホールディングス	800	593.00	474,400
大東建託	1,500	18,600.00	27,900,000
新日本建設	500	1,181.00	590,500
NIPPO	900	2,427.00	2,184,300
東亜道路工業	100	3,880.00	388,000
前田道路	1,300	2,289.00	2,975,700
日本道路	100	5,310.00	531,000
東亜建設工業	300	2,636.00	790,800
若築建設	200	1,675.00	335,000
東洋建設	1,300	518.00	673,400
五洋建設	4,800	832.00	3,993,600
世紀東急工業	500	703.00	351,500
福田組	100	6,930.00	693,000
住友林業	2,600	1,766.00	4,591,600
日本基礎技術	500	394.00	197,000
日成ビルド工業	600	1,328.00	796,800
巴コーポレーション	500	567.00	283,500
大和ハウス工業	12,000	4,024.00	48,288,000
ライト工業	800	1,130.00	904,000
積水ハウス	13,200	1,945.50	25,680,600
日特建設	300	616.00	184,800
北陸電気工事	200	1,212.00	242,400
ユアテック	600	912.00	547,200
西部電気工業	100	2,820.00	282,000
四電工	100	2,543.00	254,300
中電工	500	3,030.00	1,515,000
関電工	1,600	1,243.00	1,988,800
きんでん	2,700	1,888.00	5,097,600
東京エネシス	500	1,268.00	634,000
トーエネック	100	3,170.00	317,000
住友電設	300	2,255.00	676,500

日本電設工業	600	2,319.00	1,391,400
協和エクシオ	1,500	2,789.00	4,183,500
新日本空調	300	1,621.00	486,300
N D S	100	4,420.00	442,000
九電工	800	5,330.00	4,264,000
三機工業	900	1,218.00	1,096,200
日揮	3,500	2,553.00	8,935,500
中外炉工業	100	2,990.00	299,000
ヤマト	300	787.00	236,100
太平電業	300	2,836.00	850,800
高砂熱学工業	1,100	2,019.00	2,220,900
朝日工業社	100	3,530.00	353,000
明星工業	700	742.00	519,400
大気社	500	3,655.00	1,827,500
ダイダン	300	2,588.00	776,400
日比谷総合設備	500	2,120.00	1,060,000
東芝プラントシステム	900	2,269.00	2,042,100
O S J Bホールディングス	1,800	302.00	543,600
東洋エンジニアリング	500	1,170.00	585,000
千代田化工建設	2,600	1,102.00	2,865,200
新興プランテック	800	998.00	798,400
日本製粉	1,200	1,754.00	2,104,800
日清製粉グループ本社	4,500	2,302.00	10,359,000
昭和産業	300	2,842.00	852,600
鳥越製粉	300	960.00	288,000
中部飼料	400	2,220.00	888,000
フィード・ワン	2,400	235.00	564,000
日本甜菜製糖	200	2,403.00	480,600
三井製糖	300	4,210.00	1,263,000
塩水港精糖	400	265.00	106,000
日新製糖	200	2,073.00	414,600
森永製菓	900	5,310.00	4,779,000
中村屋	100	4,775.00	477,500
江崎グリコ	1,000	5,780.00	5,780,000
名糖産業	200	1,766.00	353,200
不二家	200	2,614.00	522,800
山崎製パン	3,000	2,339.00	7,017,000
モロゾフ	100	6,640.00	664,000
亀田製菓	200	5,340.00	1,068,000
寿スピリッツ	400	5,130.00	2,052,000
カルビー	1,700	3,715.00	6,315,500
森永乳業	700	4,740.00	3,318,000

六甲バター	200	2,842.00	568,400
ヤクルト本社	2,200	7,740.00	17,028,000
明治ホールディングス	2,400	8,590.00	20,616,000
雪印メグミルク	900	3,170.00	2,853,000
プリマハム	3,000	617.00	1,851,000
日本ハム	1,600	4,750.00	7,600,000
丸大食品	2,000	515.00	1,030,000
S Foods	300	4,505.00	1,351,500
伊藤ハム米久ホールディングス	2,300	994.00	2,286,200
サッポロホールディングス	1,300	3,065.00	3,984,500
アサヒグループホールディングス	7,600	5,480.00	41,648,000
キリンホールディングス	17,500	3,124.00	54,670,000
宝ホールディングス	2,700	1,287.00	3,474,900
オエノンホールディングス	1,000	452.00	452,000
養命酒製造	100	2,401.00	240,100
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	2,600	4,620.00	12,012,000
サントリー食品インターナショナル	2,800	5,400.00	15,120,000
ダイドーグループホールディングス	200	6,640.00	1,328,000
伊藤園	1,200	4,365.00	5,238,000
キーコーヒー	400	2,166.00	866,400
ユニカフェ	100	1,101.00	110,100
ジャパンフーズ	100	1,504.00	150,400
日清オイリオグループ	400	3,160.00	1,264,000
不二製油グループ本社	1,000	3,465.00	3,465,000
J - オイルミルズ	200	3,730.00	746,000
キッコーマン	2,800	4,510.00	12,628,000
味の素	8,400	1,973.50	16,577,400
キューピー	2,000	2,503.00	5,006,000
ハウス食品グループ本社	1,400	3,745.00	5,243,000
カゴメ	1,500	3,845.00	5,767,500
焼津水産化学工業	200	1,242.00	248,400
アリアケジャパン	300	9,130.00	2,739,000
エバラ食品工業	100	2,100.00	210,000
ニチレイ	1,700	3,180.00	5,406,000
東洋水産	2,000	4,230.00	8,460,000
日清食品ホールディングス	1,600	7,720.00	12,352,000
一正蒲鉾	100	1,313.00	131,300
フジッコ	400	2,470.00	988,000
ロック・フィールド	400	2,168.00	867,200
日本たばこ産業	22,600	2,892.00	65,359,200
ケンコーマヨネーズ	200	3,780.00	756,000
わらべや日洋ホールディングス	200	2,705.00	541,000

なとり	200	1,930.00	386,000
ユーグレナ	1,400	1,024.00	1,433,600
ミヨシ油脂	100	1,427.00	142,700
理研ビタミン	100	4,205.00	420,500
片倉工業	400	1,385.00	554,000
グンゼ	300	6,610.00	1,983,000
東洋紡	1,400	2,146.00	3,004,400
ユニチカ	1,100	721.00	793,100
富士紡ホールディングス	200	4,125.00	825,000
倉敷紡績	4,000	356.00	1,424,000
シキボウ	200	1,364.00	272,800
日本毛織	1,100	1,100.00	1,210,000
帝国繊維	400	2,144.00	857,600
帝人	3,100	2,058.00	6,379,800
東レ	27,600	1,022.50	28,221,000
サカイオーベックス	100	2,380.00	238,000
住江織物	100	2,846.00	284,600
日本フェルト	200	518.00	103,600
アツギ	300	1,221.00	366,300
セーレン	900	2,038.00	1,834,200
ソトー	100	1,002.00	100,200
小松精練	600	1,059.00	635,400
ワコールホールディングス	1,100	3,230.00	3,553,000
ホギメディカル	500	4,480.00	2,240,000
T S Iホールディングス	1,300	869.00	1,129,700
三陽商会	200	2,750.00	550,000
オンワードホールディングス	2,300	855.00	1,966,500
ルックホールディングス	1,000	341.00	341,000
ゴールドウイン	200	6,870.00	1,374,000
デサント	900	1,864.00	1,677,600
キング	200	588.00	117,600
ヤマトインターナショナル	300	603.00	180,900
特種東海製紙	200	4,170.00	834,000
王子ホールディングス	16,000	745.00	11,920,000
日本製紙	1,700	2,056.00	3,495,200
北越紀州製紙	2,100	692.00	1,453,200
中越パルプ工業	200	1,957.00	391,400
大王製紙	1,500	1,540.00	2,310,000
レンゴー	3,700	956.00	3,537,200
トモク	200	2,084.00	416,800
ザ・パック	300	4,060.00	1,218,000
クラレ	6,400	1,806.00	11,558,400

旭化成	23,700	1,506.00	35,692,200
共和レザー	200	965.00	193,000
昭和電工	2,500	3,810.00	9,525,000
住友化学	28,000	639.00	17,892,000
住友精化	200	5,190.00	1,038,000
日産化学工業	2,200	4,900.00	10,780,000
クレハ	300	7,270.00	2,181,000
多木化学	100	4,500.00	450,000
テイカ	300	2,844.00	853,200
石原産業	700	1,271.00	889,700
片倉コープアグリ	100	1,242.00	124,200
日東エフシー	200	735.00	147,000
日本曹達	3,000	626.00	1,878,000
東ソー	5,500	2,013.00	11,071,500
トクヤマ	1,100	3,465.00	3,811,500
セントラル硝子	800	2,645.00	2,116,000
東亜合成	2,200	1,289.00	2,835,800
大阪ソーダ	300	3,010.00	903,000
関東電化工業	900	1,061.00	954,900
デンカ	1,400	4,060.00	5,684,000
信越化学工業	6,300	10,670.00	67,221,000
堺化学工業	300	2,849.00	854,700
エア・ウォーター	3,100	2,104.00	6,522,400
大陽日酸	2,900	1,665.00	4,828,500
日本化学工業	100	3,490.00	349,000
東邦アセチレン	100	1,349.00	134,900
日本パーカライズン	1,900	1,710.00	3,249,000
高压ガス工業	600	965.00	579,000
四国化成工業	500	1,608.00	804,000
ステラ ケミファ	200	3,585.00	717,000
保土谷化学工業	100	4,855.00	485,500
日本触媒	600	7,190.00	4,314,000
大日精化工業	300	4,605.00	1,381,500
カネカ	5,000	1,078.00	5,390,000
三菱瓦斯化学	3,100	2,635.00	8,168,500
三井化学	3,500	3,390.00	11,865,000
J S R	3,800	2,333.00	8,865,400
東京応化工業	700	3,845.00	2,691,500
大阪有機化学工業	200	1,542.00	308,400
三菱ケミカルホールディングス	25,500	1,056.00	26,928,000
K Hネオケム	600	3,375.00	2,025,000
ダイセル	5,100	1,249.00	6,369,900

住友ベークライト	3,000	997.00	2,991,000
積水化学工業	7,900	1,909.00	15,081,100
日本ゼオン	3,200	1,574.00	5,036,800
アイカ工業	1,100	4,020.00	4,422,000
宇部興産	1,900	3,380.00	6,422,000
積水樹脂	600	2,326.00	1,395,600
タキロンシーアイ	800	691.00	552,800
旭有機材	200	1,778.00	355,600
日立化成	1,900	2,587.00	4,915,300
ニチバン	200	3,315.00	663,000
リケンテクノス	800	525.00	420,000
大倉工業	1,000	602.00	602,000
積水化成成品工業	500	1,254.00	627,000
群栄化学工業	100	3,520.00	352,000
タイガースポリマー	200	850.00	170,000
ミライアル	100	1,547.00	154,700
ダイキョーニシカワ	800	1,931.00	1,544,800
日本化薬	2,500	1,352.00	3,380,000
カーリットホールディングス	400	1,039.00	415,600
日本精化	300	1,265.00	379,500
扶桑化学工業	300	2,770.00	831,000
ADEKA	1,600	1,987.00	3,179,200
日油	1,500	3,230.00	4,845,000
ハリマ化成グループ	300	839.00	251,700
花王	8,900	7,853.00	69,891,700
第一工業製薬	1,000	854.00	854,000
日華化学	100	1,232.00	123,200
ニイタカ	100	1,793.00	179,300
三洋化成工業	200	5,180.00	1,036,000
大日本塗料	400	1,541.00	616,400
日本ペイントホールディングス	2,900	4,300.00	12,470,000
関西ペイント	4,000	2,481.00	9,924,000
神東塗料	300	249.00	74,700
中国塗料	1,100	1,087.00	1,195,700
日本特殊塗料	200	2,207.00	441,400
藤倉化成	500	662.00	331,000
太陽ホールディングス	300	4,680.00	1,404,000
DIC	1,500	3,745.00	5,617,500
サカタインクス	800	1,688.00	1,350,400
東洋インキSCホールディングス	4,000	681.00	2,724,000
T&K TOKA	300	1,342.00	402,600
富士フイルムホールディングス	7,500	4,357.00	32,677,500

資生堂	6,800	6,925.00	47,090,000
ライオン	5,100	2,335.00	11,908,500
高砂香料工業	200	3,385.00	677,000
マンダム	700	3,890.00	2,723,000
ミルボン	500	4,775.00	2,387,500
ファンケル	900	4,120.00	3,708,000
コーセー	600	20,560.00	12,336,000
コタ	200	1,678.00	335,600
シーズ・ホールディングス	500	5,170.00	2,585,000
ポーラ・オルビスホールディングス	1,600	4,710.00	7,536,000
ノエビアホールディングス	200	7,770.00	1,554,000
アジュバンコスメジャパン	100	1,060.00	106,000
エステー	300	2,389.00	716,700
アグロ カネショウ	100	2,719.00	271,900
コニシ	600	1,780.00	1,068,000
長谷川香料	500	2,171.00	1,085,500
星光PMC	200	1,190.00	238,000
小林製薬	1,000	9,030.00	9,030,000
荒川化学工業	300	1,961.00	588,300
メック	200	1,815.00	363,000
日本高純度化学	100	2,583.00	258,300
タカラバイオ	1,000	2,025.00	2,025,000
JCU	400	2,515.00	1,006,000
新田ゼラチン	200	839.00	167,800
デクセリアルズ	900	1,202.00	1,081,800
アース製薬	300	5,710.00	1,713,000
北興化学工業	400	699.00	279,600
大成ラミック	100	3,130.00	313,000
クミアイ化学工業	1,700	669.00	1,137,300
日本農薬	900	678.00	610,200
アキレス	300	2,277.00	683,100
有沢製作所	600	1,030.00	618,000
日東電工	2,700	8,401.00	22,682,700
レック	200	3,725.00	745,000
きもと	600	315.00	189,000
藤森工業	300	3,780.00	1,134,000
前澤化成工業	200	1,189.00	237,800
JSP	200	3,450.00	690,000
エフピコ	300	6,640.00	1,992,000
天馬	300	2,049.00	614,700
信越ポリマー	700	1,110.00	777,000
東リ	900	376.00	338,400

ニフコ	1,300	3,745.00	4,868,500	
日本バルカー工業	300	3,025.00	907,500	
ユニ・チャーム	7,700	3,031.00	23,338,700	
協和発酵キリン	4,600	2,373.00	10,915,800	
武田薬品工業	13,400	4,857.00	65,083,800	代用有価証券 2,600株
アステラス製薬	37,300	1,582.00	59,008,600	
大日本住友製薬	2,700	2,016.00	5,443,200	
塩野義製薬	5,200	5,497.00	28,584,400	
田辺三菱製薬	4,400	2,092.00	9,204,800	
わかもと製薬	400	290.00	116,000	
あすか製薬	400	1,693.00	677,200	
日本新薬	1,000	8,480.00	8,480,000	
ビオフェルミン製薬	100	2,809.00	280,900	
中外製薬	3,800	5,830.00	22,154,000	
科研製薬	700	6,390.00	4,473,000	
エーザイ	4,300	7,074.00	30,418,200	
ロート製薬	2,000	3,095.00	6,190,000	
小野薬品工業	8,600	2,482.50	21,349,500	
久光製薬	1,100	7,930.00	8,723,000	
持田製薬	300	7,420.00	2,226,000	
参天製薬	6,900	1,764.00	12,171,600	
扶桑薬品工業	100	2,881.00	288,100	
ツムラ	1,300	3,845.00	4,998,500	
日医工	1,000	1,702.00	1,702,000	
キッセイ薬品工業	700	3,015.00	2,110,500	
生化学工業	700	1,859.00	1,301,300	
栄研化学	600	2,534.00	1,520,400	
日水製薬	200	1,396.00	279,200	
鳥居薬品	200	2,739.00	547,800	
JCRファーマ	300	5,600.00	1,680,000	
東和薬品	200	7,010.00	1,402,000	
富士製薬工業	100	4,565.00	456,500	
沢井製薬	700	4,780.00	3,346,000	
ゼリア新薬工業	800	2,192.00	1,753,600	
第一三共	10,400	3,758.00	39,083,200	
キョーリン製薬ホールディングス	1,000	2,084.00	2,084,000	
大幸薬品	200	2,015.00	403,000	
ダイト	200	3,820.00	764,000	
大塚ホールディングス	7,600	5,302.00	40,295,200	
大正製薬ホールディングス	800	10,390.00	8,312,000	
ペプチドリーム	1,700	4,640.00	7,888,000	
昭和シェル石油	3,400	1,488.00	5,059,200	

ニチレキ	500	1,207.00	603,500
ユシロ化学工業	200	1,779.00	355,800
ビーピー・カストロール	200	1,711.00	342,200
MORESCO	100	1,918.00	191,800
出光興産	3,000	4,075.00	12,225,000
JXTGホールディングス	58,000	713.00	41,354,000
コスモエネルギーホールディングス	1,100	3,800.00	4,180,000
横浜ゴム	2,100	2,525.00	5,302,500
東洋ゴム工業	2,200	1,854.00	4,078,800
ブリヂストン	12,000	4,572.00	54,864,000
住友ゴム工業	3,700	1,941.00	7,181,700
藤倉ゴム工業	300	757.00	227,100
オカモト	1,000	1,068.00	1,068,000
フコク	200	991.00	198,200
ニッタ	400	4,070.00	1,628,000
住友理工	700	1,148.00	803,600
三ツ星ベルト	1,000	1,210.00	1,210,000
バンドー化学	700	1,293.00	905,100
日東紡績	500	2,400.00	1,200,000
旭硝子	3,700	4,465.00	16,520,500
日本板硝子	1,800	884.00	1,591,200
日本山村硝子	2,000	187.00	374,000
日本電気硝子	1,600	3,155.00	5,048,000
オハラ	100	2,338.00	233,800
住友大阪セメント	7,000	486.00	3,402,000
太平洋セメント	2,300	3,965.00	9,119,500
日本ヒューム	400	831.00	332,400
日本コンクリート工業	800	445.00	356,000
三谷セキサン	200	2,462.00	492,400
アジアパイルホールディングス	500	642.00	321,000
東海カーボン	3,300	1,401.00	4,623,300
日本カーボン	200	4,895.00	979,000
東洋炭素	200	3,005.00	601,000
ノリタケカンパニーリミテド	200	4,505.00	901,000
TOTO	2,800	6,070.00	16,996,000
日本碍子	4,400	1,920.00	8,448,000
日本特殊陶業	3,100	2,621.00	8,125,100
MARUWA	100	8,260.00	826,000
品川リフラクトリーズ	100	2,986.00	298,600
黒崎播磨	100	4,915.00	491,500
ヨータイ	200	782.00	156,400
東京窯業	500	409.00	204,500

ニッカトー	100	1,091.00	109,100
フジインコーポレーテッド	300	2,306.00	691,800
ニチアス	2,000	1,355.00	2,710,000
ニチハ	500	4,375.00	2,187,500
新日鐵住金	16,100	2,422.50	39,002,250
神戸製鋼所	6,600	1,158.00	7,642,800
中山製鋼所	500	744.00	372,000
合同製鐵	200	2,256.00	451,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	9,700	2,273.00	22,048,100
日新製鋼	1,000	1,360.00	1,360,000
東京製鐵	1,900	871.00	1,654,900
共英製鋼	400	2,078.00	831,200
大和工業	800	3,180.00	2,544,000
東京鐵鋼	100	1,640.00	164,000
大阪製鐵	200	2,303.00	460,600
淀川製鋼所	500	3,015.00	1,507,500
丸一鋼管	1,300	3,480.00	4,524,000
モリ工業	100	3,105.00	310,500
大同特殊鋼	600	5,590.00	3,354,000
日本冶金工業	3,000	304.00	912,000
山陽特殊製鋼	400	2,787.00	1,114,800
愛知製鋼	200	4,705.00	941,000
日立金属	3,900	1,363.00	5,315,700
大平洋金属	200	3,855.00	771,000
新日本電工	2,200	363.00	798,600
栗本鐵工所	200	2,062.00	412,400
三菱製鋼	300	2,670.00	801,000
日亜鋼業	500	354.00	177,000
日本精線	100	4,780.00	478,000
シンニッタン	600	471.00	282,600
新家工業	100	2,063.00	206,300
大紀アルミニウム工業所	600	776.00	465,600
日本輕金属ホールディングス	10,500	287.00	3,013,500
三井金属鉱業	1,000	5,080.00	5,080,000
東邦亜鉛	200	5,270.00	1,054,000
三菱マテリアル	2,400	3,365.00	8,076,000
住友金属鉱山	4,600	4,882.00	22,457,200
D O W A ホールディングス	900	4,120.00	3,708,000
古河機械金属	600	2,168.00	1,300,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	400	2,230.00	892,000
東邦チタニウム	600	1,425.00	855,000
U A C J	500	2,869.00	1,434,500

古河電気工業	1,200	5,180.00	6,216,000
住友電気工業	13,400	1,657.50	22,210,500
フジクラ	4,300	740.00	3,182,000
タツタ電線	700	670.00	469,000
カナレ電気	100	2,331.00	233,100
平河ヒューテック	200	1,409.00	281,800
リョービ	400	2,813.00	1,125,200
アーレスティ	400	987.00	394,800
アサヒホールディングス	600	2,004.00	1,202,400
稲葉製作所	200	1,392.00	278,400
宮地エンジニアリンググループ	100	2,036.00	203,600
トーカロ	1,000	1,284.00	1,284,000
アルファC o	100	1,776.00	177,600
SUMCO	3,300	2,653.00	8,754,900
川田テクノロジーズ	100	6,140.00	614,000
東洋製罐グループホールディングス	2,500	1,655.00	4,137,500
ホッカンホールディングス	1,000	385.00	385,000
コロナ	200	1,267.00	253,400
横河ブリッジホールディングス	700	2,273.00	1,591,100
駒井ハルテック	100	2,496.00	249,600
三和ホールディングス	3,400	1,387.00	4,715,800
文化シャッター	1,100	1,050.00	1,155,000
三協立山	500	1,560.00	780,000
アルインコ	300	1,093.00	327,900
LIXILグループ	5,300	2,425.00	12,852,500
日本フィルコン	300	626.00	187,800
ノーリツ	800	1,974.00	1,579,200
長府製作所	400	2,578.00	1,031,200
リンナイ	600	10,480.00	6,288,000
ダイニチ工業	200	831.00	166,200
日東精工	500	783.00	391,500
岡部	700	1,055.00	738,500
ジーテクト	400	2,066.00	826,400
東プレ	700	3,190.00	2,233,000
高周波熱錬	700	1,087.00	760,900
東京製綱	300	2,340.00	702,000
サンコール	200	719.00	143,800
モリテック スチール	200	728.00	145,600
パイオラックス	500	3,015.00	1,507,500
日本発條	3,600	1,189.00	4,280,400
アドバネクス	100	2,555.00	255,500
立川ブラインド工業	200	1,523.00	304,600

三益半導体工業	300	1,932.00	579,600
日本製鋼所	1,200	3,580.00	4,296,000
三浦工業	1,600	3,330.00	5,328,000
タクマ	1,200	1,225.00	1,470,000
ツガミ	1,000	1,361.00	1,361,000
オークマ	400	6,190.00	2,476,000
東芝機械	2,000	727.00	1,454,000
アマダホールディングス	5,500	1,313.00	7,221,500
アイダエンジニアリング	900	1,285.00	1,156,500
滝澤鉄工所	100	1,936.00	193,600
F U J I	1,100	2,050.00	2,255,000
牧野フライス製作所	2,000	1,004.00	2,008,000
オーエスジー	1,700	2,415.00	4,105,500
旭ダイヤモンド工業	1,100	1,113.00	1,224,300
D M G 森精機	2,000	1,951.00	3,902,000
ソディック	800	1,372.00	1,097,600
ディスコ	500	21,910.00	10,955,000
日東工器	200	2,885.00	577,000
日進工具	100	3,150.00	315,000
パンチ工業	300	1,185.00	355,500
富士ダイス	100	1,032.00	103,200
東洋機械金属	300	830.00	249,000
島精機製作所	500	6,930.00	3,465,000
フリー	300	930.00	279,000
ヤマシンフィルタ	500	1,268.00	634,000
日阪製作所	500	1,150.00	575,000
やまびこ	700	1,476.00	1,033,200
平田機工	100	9,970.00	997,000
ペガサスミシン製造	300	776.00	232,800
ナブテスコ	2,000	3,975.00	7,950,000
三井海洋開発	400	2,826.00	1,130,400
レオン自動機	300	2,028.00	608,400
S M C	1,100	42,360.00	46,596,000
新川	300	964.00	289,200
ホソカワミクロン	100	7,120.00	712,000
ユニオンツール	200	3,675.00	735,000
オイレス工業	500	2,355.00	1,177,500
日精エー・エス・ビー機械	100	6,640.00	664,000
サトーホールディングス	500	3,080.00	1,540,000
技研製作所	200	2,574.00	514,800
日本エアーテック	100	852.00	85,200
日精樹脂工業	300	1,451.00	435,300

オカダアイヨン	100	1,447.00	144,700
小松製作所	17,500	3,708.00	64,890,000
住友重機械工業	2,100	4,140.00	8,694,000
日立建機	1,700	4,220.00	7,174,000
日工	100	2,357.00	235,700
巴工業	200	2,147.00	429,400
井関農機	400	2,115.00	846,000
TOWA	300	1,424.00	427,200
北川鉄工所	200	2,727.00	545,400
ローツェ	200	2,220.00	444,000
クボタ	19,500	1,829.00	35,665,500
荏原実業	100	2,342.00	234,200
三菱化工機	100	2,240.00	224,000
月島機械	700	1,512.00	1,058,400
帝国電機製作所	300	1,657.00	497,100
新東工業	900	1,151.00	1,035,900
澁谷工業	300	3,765.00	1,129,500
アイチ コーポレーション	600	718.00	430,800
小森コーポレーション	900	1,383.00	1,244,700
鶴見製作所	300	2,085.00	625,500
住友精密工業	1,000	387.00	387,000
酒井重工業	100	4,685.00	468,500
荏原製作所	1,500	4,210.00	6,315,000
石井鐵工所	100	2,002.00	200,200
西島製作所	400	1,017.00	406,800
北越工業	400	1,186.00	474,400
ダイキン工業	5,000	12,855.00	64,275,000
オルガノ	100	3,160.00	316,000
トーヨーカネツ	200	3,325.00	665,000
栗田工業	2,000	3,475.00	6,950,000
椿本チエイン	2,000	914.00	1,828,000
大同工業	100	1,489.00	148,900
アネスト岩田	600	1,181.00	708,600
ダイフク	1,800	6,070.00	10,926,000
加藤製作所	200	2,507.00	501,400
油研工業	100	2,902.00	290,200
タダノ	1,800	1,691.00	3,043,800
フジテック	1,200	1,515.00	1,818,000
C K D	1,000	2,256.00	2,256,000
キトー	300	2,039.00	611,700
平和	1,100	2,161.00	2,377,100
理想科学工業	400	2,163.00	865,200

SANKYO	900	3,780.00	3,402,000
日本金銭機械	300	1,212.00	363,600
マースエンジニアリング	200	2,388.00	477,600
福島工業	200	4,725.00	945,000
オーイズミ	200	583.00	116,600
ダイコク電機	200	1,744.00	348,800
竹内製作所	600	2,462.00	1,477,200
アマノ	1,100	2,870.00	3,157,000
JUKI	500	1,521.00	760,500
サンデンホールディングス	400	1,582.00	632,800
蛇の目ミシン工業	300	730.00	219,000
マックス	600	1,402.00	841,200
グローリー	1,100	3,840.00	4,224,000
新晃工業	400	1,769.00	707,600
大和冷機工業	600	1,271.00	762,600
セガサミーホールディングス	3,600	1,691.00	6,087,600
日本ピストンリング	100	2,262.00	226,200
リケン	200	6,190.00	1,238,000
T P R	400	3,250.00	1,300,000
ツバキ・ナカシマ	400	2,570.00	1,028,000
ホシザキ	1,100	9,840.00	10,824,000
大豊工業	300	1,587.00	476,100
日本精工	7,500	1,419.00	10,642,500
NTN	8,400	468.00	3,931,200
ジェイテクト	3,900	1,640.00	6,396,000
不二越	3,000	562.00	1,686,000
日本トムソン	1,200	803.00	963,600
THK	2,300	3,925.00	9,027,500
ユーシン精機	300	1,584.00	475,200
前澤給装工業	100	1,920.00	192,000
イーグル工業	400	1,893.00	757,200
前澤工業	300	483.00	144,900
日本ピラー工業	400	1,526.00	610,400
キッツ	1,600	888.00	1,420,800
マキタ	4,700	4,945.00	23,241,500
日立造船	2,900	575.00	1,667,500
三菱重工業	6,100	4,186.00	25,534,600
I H I	2,800	3,675.00	10,290,000
スター精密	600	1,954.00	1,172,400
日清紡ホールディングス	2,200	1,510.00	3,322,000
イビデン	2,200	1,710.00	3,762,000
コニカミノルタ	8,500	948.00	8,058,000

ブラザー工業	4,400	2,464.00	10,841,600
ミネベアミツミ	6,700	2,202.00	14,753,400
日立製作所	87,000	790.00	68,730,000
三菱電機	36,300	1,714.00	62,218,200
富士電機	11,000	726.00	7,986,000
安川電機	4,200	4,820.00	20,244,000
シンフォニアテクノロジー	2,000	368.00	736,000
明電舎	3,000	410.00	1,230,000
山洋電気	200	8,200.00	1,640,000
デンヨー	300	1,921.00	576,300
東芝テック	3,000	630.00	1,890,000
マブチモーター	1,000	5,480.00	5,480,000
日本電産	4,400	16,785.00	73,854,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	100	2,667.00	266,700
東光高岳	200	1,731.00	346,200
ダブル・スコープ	500	1,588.00	794,000
ダイヘン	2,000	835.00	1,670,000
ヤーマン	500	2,733.00	1,366,500
JVCケンウッド	2,700	383.00	1,034,100
ミマキエンジニアリング	300	822.00	246,600
第一精工	200	2,085.00	417,000
日新電機	900	1,057.00	951,300
大崎電気工業	800	769.00	615,200
オムロン	3,900	6,080.00	23,712,000
日東工業	600	1,769.00	1,061,400
I D E C	400	2,481.00	992,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	7,000	585.00	4,095,000
サクサホールディングス	100	2,136.00	213,600
メルコホールディングス	200	3,615.00	723,000
テクノメディカ	100	2,084.00	208,400
日本電気	4,700	2,935.00	13,794,500
富士通	37,000	661.80	24,486,600
沖電気工業	1,500	1,449.00	2,173,500
岩崎通信機	200	807.00	161,400
電気興業	200	3,230.00	646,000
サンケン電気	2,000	717.00	1,434,000
ナカヨ	100	1,908.00	190,800
アイホン	200	1,795.00	359,000
ルネサスエレクトロニクス	1,900	1,107.00	2,103,300
セイコーエプソン	5,400	2,056.00	11,102,400
ワコム	2,800	537.00	1,503,600
アルバック	800	5,940.00	4,752,000

E I Z O	300	5,150.00	1,545,000	
ジャパンディスプレイ	7,500	152.00	1,140,000	
日本信号	1,000	1,005.00	1,005,000	
京三製作所	900	674.00	606,600	
能美防災	500	2,339.00	1,169,500	
ホーチキ	300	2,141.00	642,300	
エレコム	300	2,351.00	705,300	
パナソニック	41,500	1,581.50	65,632,250	代用有価証券 7,500株
シャープ	2,500	3,545.00	8,862,500	
アンリツ	2,600	1,325.00	3,445,000	
富士通ゼネラル	1,100	1,951.00	2,146,100	
ソニー	24,300	5,385.00	130,855,500	代用有価証券 3,700株
T D K	1,900	9,680.00	18,392,000	
帝国通信工業	200	1,272.00	254,400	
タムラ製作所	1,400	801.00	1,121,400	
アルプス電気	3,100	2,637.00	8,174,700	
パイオニア	6,100	182.00	1,110,200	
日本電波工業	300	689.00	206,700	
鈴木	200	1,038.00	207,600	
日本トリム	100	5,240.00	524,000	
ローランド ディー . ジー .	200	2,498.00	499,600	
フォスター電機	400	2,553.00	1,021,200	
クラリオン	2,000	342.00	684,000	
S M K	1,000	463.00	463,000	
ヨコオ	200	2,115.00	423,000	
ホシデン	900	1,334.00	1,200,600	
ヒロセ電機	600	15,160.00	9,096,000	
日本航空電子工業	1,000	1,658.00	1,658,000	
T O A	400	1,270.00	508,000	
マクセルホールディングス	700	2,180.00	1,526,000	
古野電気	400	828.00	331,200	
アルパイン	900	2,088.00	1,879,200	
スミダコーポレーション	400	1,508.00	603,200	
アイコム	200	2,760.00	552,000	
リオン	200	2,561.00	512,200	
本多通信工業	300	1,069.00	320,700	
船井電機	400	793.00	317,200	
横河電機	3,600	2,369.00	8,528,400	
新電元工業	100	6,810.00	681,000	
アズビル	1,100	4,925.00	5,417,500	
東亜ディーケーケー	200	1,251.00	250,200	

日本光電工業	1,500	3,010.00	4,515,000
チノー	100	1,540.00	154,000
共和電業	400	438.00	175,200
日本電子材料	100	785.00	78,500
堀場製作所	700	7,690.00	5,383,000
アドバンテスト	2,000	2,299.00	4,598,000
エスベック	300	2,544.00	763,200
キーエンス	1,800	63,490.00	114,282,000
日置電機	200	4,345.00	869,000
シスメックス	2,800	9,510.00	26,628,000
日本マイクロニクス	600	1,143.00	685,800
メガチップス	300	3,590.00	1,077,000
O B A R A G R O U P	200	6,460.00	1,292,000
コーセル	500	1,423.00	711,500
イリソ電子工業	300	6,540.00	1,962,000
オブテックスグループ	600	3,165.00	1,899,000
千代田インテグレ	200	2,516.00	503,200
アイ・オー・データ機器	200	1,131.00	226,200
レーザーテック	700	4,140.00	2,898,000
スタンレー電気	2,800	4,010.00	11,228,000
岩崎電気	100	1,696.00	169,600
ウシオ電機	2,200	1,519.00	3,341,800
岡谷電機産業	200	649.00	129,800
ヘリオス テクノ ホールディング	300	938.00	281,400
日本セラミック	400	2,831.00	1,132,400
古河電池	300	962.00	288,600
山一電機	300	1,892.00	567,600
図研	200	1,519.00	303,800
日本電子	1,000	922.00	922,000
カシオ計算機	2,900	1,758.00	5,098,200
ファナック	3,500	26,250.00	91,875,000
日本シイエムケイ	600	829.00	497,400
エンブラス	200	3,580.00	716,000
ローム	1,600	9,930.00	15,888,000
浜松ホトニクス	2,600	4,045.00	10,517,000
三井ハイテック	500	1,643.00	821,500
新光電気工業	1,400	807.00	1,129,800
京セラ	6,000	6,228.00	37,368,000
太陽誘電	1,600	1,922.00	3,075,200
村田製作所	3,800	14,215.00	54,017,000
双葉電子工業	600	2,237.00	1,342,200
ニチコン	1,100	1,228.00	1,350,800

日本ケミコン	300	2,569.00	770,700	
K O A	500	2,184.00	1,092,000	
市光工業	500	1,146.00	573,000	
小糸製作所	2,200	7,500.00	16,500,000	
ミツバ	700	1,565.00	1,095,500	
S C R E E Nホールディングス	700	8,770.00	6,139,000	
キャノン電子	300	2,483.00	744,900	
キャノン	19,600	3,882.00	76,087,200	代用有価証券 4,100株
リコー	10,900	1,105.00	12,044,500	
東京エレクトロン	2,400	19,610.00	47,064,000	
トヨタ紡織	1,100	2,360.00	2,596,000	
ユニプレス	700	2,577.00	1,803,900	
豊田自動織機	2,900	6,360.00	18,444,000	
モリタホールディングス	600	2,124.00	1,274,400	
三櫻工業	500	785.00	392,500	
デンソー	8,100	5,919.00	47,943,900	
東海理化電機製作所	1,000	2,186.00	2,186,000	
三井E & Sホールディングス	1,300	1,753.00	2,278,900	
川崎重工業	2,800	3,535.00	9,898,000	
名村造船所	1,100	679.00	746,900	
三菱ロジスネクスト	400	923.00	369,200	
日産自動車	42,800	1,135.00	48,578,000	
いすゞ自動車	10,500	1,652.50	17,351,250	
トヨタ自動車	44,200	6,957.00	307,499,400	代用有価証券 9,000株
日野自動車	5,200	1,380.00	7,176,000	
三菱自動車工業	13,400	762.00	10,210,800	
エフテック	200	1,372.00	274,400	
ファルテック	100	1,312.00	131,200	
武蔵精密工業	400	3,850.00	1,540,000	
日産車体	1,400	1,194.00	1,671,600	
新明和工業	1,600	1,117.00	1,787,200	
極東開発工業	700	1,673.00	1,171,100	
日信工業	700	1,886.00	1,320,200	
トピー工業	300	3,230.00	969,000	
ティラド	100	3,880.00	388,000	
曙ブレーキ工業	1,700	282.00	479,400	
タチエス	600	1,947.00	1,168,200	
N O K	2,000	2,224.00	4,448,000	
フタバ産業	1,100	894.00	983,400	
K Y B	400	5,240.00	2,096,000	
大同メタル工業	500	1,337.00	668,500	

プレス工業	1,900	642.00	1,219,800	
ミクニ	500	636.00	318,000	
太平洋工業	800	1,448.00	1,158,400	
ケーヒン	800	2,200.00	1,760,000	
河西工業	400	1,515.00	606,000	
アイシン精機	3,000	5,840.00	17,520,000	
マツダ	11,400	1,472.00	16,780,800	
今仙電機製作所	300	1,192.00	357,600	
本田技研工業	32,700	3,682.00	120,401,400	代用有価証券 6,000株
スズキ	7,200	5,747.00	41,378,400	
S U B A R U	11,300	3,514.00	39,708,200	
安永	200	2,383.00	476,600	
ヤマハ発動機	5,100	3,435.00	17,518,500	
ショーワ	900	1,675.00	1,507,500	
T B K	400	525.00	210,000	
エクセディ	400	3,565.00	1,426,000	
豊田合成	1,300	2,580.00	3,354,000	
愛三工業	600	1,168.00	700,800	
盟和産業	100	1,317.00	131,700	
ヨロズ	400	1,838.00	735,200	
エフ・シー・シー	600	3,105.00	1,863,000	
シマノ	1,500	14,240.00	21,360,000	
テイ・エス テック	800	4,415.00	3,532,000	
ジャムコ	200	2,445.00	489,000	
テルモ	5,600	6,190.00	34,664,000	
クリエートメディック	100	1,188.00	118,800	
日機装	1,300	1,153.00	1,498,900	
島津製作所	4,300	3,000.00	12,900,000	
J M S	300	622.00	186,600	
長野計器	300	1,265.00	379,500	
ブイ・テクノロジー	100	28,700.00	2,870,000	
東京計器	200	1,189.00	237,800	
オーバル	400	303.00	121,200	
東京精密	700	4,210.00	2,947,000	
マニー	400	4,375.00	1,750,000	
ニコン	6,300	1,930.00	12,159,000	
トプコン	2,000	2,139.00	4,278,000	
オリンパス	5,400	4,000.00	21,600,000	
理研計器	300	2,416.00	724,800	
タムロン	300	2,264.00	679,200	
H O Y A	7,300	5,772.00	42,135,600	
ノーリツ鋼機	400	2,820.00	1,128,000	

シチズン時計	4,300	813.00	3,495,900
リズム時計工業	100	2,330.00	233,000
大研医器	300	736.00	220,800
メニコン	500	2,870.00	1,435,000
松風	200	1,450.00	290,000
セイコーホールディングス	600	2,893.00	1,735,800
ニプロ	2,500	1,567.00	3,917,500
中本パックス	100	2,007.00	200,700
パラマウントベッドホールディングス	400	5,370.00	2,148,000
トランザクション	200	1,009.00	201,800
ニホンフラッシュ	200	2,633.00	526,600
前田工織	400	1,672.00	668,800
永大産業	500	557.00	278,500
アートネイチャー	400	711.00	284,400
バンダイナムコホールディングス	3,800	3,675.00	13,965,000
共立印刷	600	368.00	220,800
SHOEI	200	4,195.00	839,000
フランスベッドホールディングス	400	978.00	391,200
パイロットコーポレーション	600	5,920.00	3,552,000
萩原工業	200	1,868.00	373,600
トッパン・フォームズ	800	1,203.00	962,400
フジシールインターナショナル	800	4,120.00	3,296,000
タカラトミー	1,500	1,085.00	1,627,500
廣濟堂	300	526.00	157,800
As-meエステール	100	905.00	90,500
タカノ	200	965.00	193,000
プロネクサス	300	1,353.00	405,900
ウッドワン	100	1,436.00	143,600
大建工業	300	2,720.00	816,000
凸版印刷	10,000	898.00	8,980,000
大日本印刷	4,800	2,315.00	11,112,000
図書印刷	200	1,029.00	205,800
共同印刷	100	3,325.00	332,500
NISSHA	700	2,886.00	2,020,200
宝印刷	200	1,960.00	392,000
アシックス	3,600	2,070.00	7,452,000
ツツミ	100	2,044.00	204,400
小松ウオール工業	100	2,377.00	237,700
ヤマハ	2,400	4,930.00	11,832,000
河合楽器製作所	100	3,610.00	361,000
クリナップ	300	870.00	261,000
ピジョン	2,200	4,980.00	10,956,000

キングジム	300	1,086.00	325,800
リンテック	900	3,185.00	2,866,500
イトーキ	800	740.00	592,000
任天堂	2,200	45,900.00	100,980,000
三菱鉛筆	600	2,433.00	1,459,800
タカスタンダード	800	1,834.00	1,467,200
コクヨ	1,700	2,112.00	3,590,400
ナカバヤシ	400	614.00	245,600
グロープライド	200	2,958.00	591,600
オカムラ	1,300	1,517.00	1,972,100
美津濃	400	3,425.00	1,370,000
東京電力ホールディングス	29,000	456.00	13,224,000
中部電力	11,100	1,674.00	18,581,400
関西電力	14,800	1,484.00	21,963,200
中国電力	5,000	1,328.00	6,640,000
北陸電力	3,600	1,011.00	3,639,600
東北電力	8,500	1,469.00	12,486,500
四国電力	3,300	1,362.00	4,494,600
九州電力	8,000	1,279.00	10,232,000
北海道電力	3,600	695.00	2,502,000
沖縄電力	600	3,190.00	1,914,000
電源開発	2,900	2,874.00	8,334,600
エフオン	200	1,460.00	292,000
イーレックス	600	844.00	506,400
東京瓦斯	7,700	2,846.50	21,918,050
大阪瓦斯	7,000	2,273.50	15,914,500
東邦瓦斯	1,800	3,400.00	6,120,000
北海道瓦斯	1,000	299.00	299,000
広島ガス	700	374.00	261,800
西部瓦斯	400	2,741.00	1,096,400
静岡ガス	1,000	953.00	953,000
メタウォーター	200	3,260.00	652,000
SBSホールディングス	400	1,358.00	543,200
東武鉄道	3,900	3,330.00	12,987,000
相鉄ホールディングス	1,200	3,005.00	3,606,000
東京急行電鉄	9,900	1,769.00	17,513,100
京浜急行電鉄	5,000	1,917.00	9,585,000
小田急電鉄	5,400	2,291.00	12,371,400
京王電鉄	2,000	4,845.00	9,690,000
京成電鉄	2,500	3,430.00	8,575,000
富士急行	500	2,919.00	1,459,500
新京成電鉄	100	2,216.00	221,600

東日本旅客鉄道	6,500	10,190.00	66,235,000
西日本旅客鉄道	3,300	7,588.00	25,040,400
東海旅客鉄道	3,300	20,795.00	68,623,500
西武ホールディングス	4,600	1,808.00	8,316,800
鴻池運輸	500	1,845.00	922,500
西日本鉄道	1,000	2,946.00	2,946,000
ハマキョウレックス	300	3,720.00	1,116,000
サカイ引越センター	200	5,950.00	1,190,000
近鉄グループホールディングス	3,400	4,340.00	14,756,000
阪急阪神ホールディングス	4,600	4,130.00	18,998,000
南海電気鉄道	1,600	2,808.00	4,492,800
京阪ホールディングス	1,500	3,420.00	5,130,000
名古屋鉄道	2,700	2,765.00	7,465,500
山陽電気鉄道	300	2,774.00	832,200
日本通運	1,400	7,720.00	10,808,000
ヤマトホールディングス	6,000	2,895.50	17,373,000
山九	900	5,230.00	4,707,000
丸運	200	330.00	66,000
丸全昭和運輸	1,000	519.00	519,000
センコーグループホールディングス	2,100	831.00	1,745,100
トナミホールディングス	100	6,300.00	630,000
ニッコンホールディングス	1,300	2,914.00	3,788,200
福山通運	500	4,720.00	2,360,000
セイノーホールディングス	2,600	1,949.00	5,067,400
神奈川中央交通	100	3,820.00	382,000
日立物流	800	2,969.00	2,375,200
丸和運輸機関	200	3,085.00	617,000
C & F ロジホールディングス	400	1,488.00	595,200
九州旅客鉄道	2,900	3,420.00	9,918,000
S Gホールディングス	2,400	2,407.00	5,776,800
日本郵船	2,900	2,308.00	6,693,200
商船三井	2,200	3,330.00	7,326,000
川崎汽船	1,600	2,563.00	4,100,800
N S ユナイテッド海運	200	2,293.00	458,600
飯野海運	1,800	544.00	979,200
日本航空	6,400	4,222.00	27,020,800
A N A ホールディングス	6,700	4,229.00	28,334,300
トランコム	100	7,840.00	784,000
日新	300	2,731.00	819,300
三菱倉庫	1,200	2,452.00	2,942,400
三井倉庫ホールディングス	2,000	343.00	686,000
住友倉庫	2,000	754.00	1,508,000

澁澤倉庫	200	1,812.00	362,400
東陽倉庫	600	371.00	222,600
日本トランスシティ	800	497.00	397,600
中央倉庫	200	1,098.00	219,600
川西倉庫	100	1,812.00	181,200
安田倉庫	300	1,020.00	306,000
宇徳	300	452.00	135,600
上組	2,100	2,376.00	4,989,600
キムラユニティー	100	1,113.00	111,300
キューソー流通システム	100	2,815.00	281,500
近鉄エクスプレス	600	2,016.00	1,209,600
東海運	200	387.00	77,400
エーアイティー	200	1,228.00	245,600
内外トランスライン	100	1,831.00	183,100
日本コンセプト	100	1,430.00	143,000
NEC ネットエスアイ	400	2,860.00	1,144,000
システナ	300	4,165.00	1,249,500
デジタルアーツ	200	4,340.00	868,000
新日鉄住金ソリューションズ	500	3,160.00	1,580,000
キューブシステム	200	809.00	161,800
コア	200	1,323.00	264,600
ソフトクリエイティブホールディングス	200	1,601.00	320,200
T I S	1,200	4,265.00	5,118,000
電算システム	100	2,093.00	209,300
グリー	1,900	613.00	1,164,700
コーエーテクモホールディングス	600	2,135.00	1,281,000
三菱総合研究所	200	3,215.00	643,000
A G S	200	871.00	174,200
ヒト・コミュニケーションズ	100	1,921.00	192,100
K L a b	700	1,911.00	1,337,700
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	300	1,821.00	546,300
ネクソン	8,000	1,600.00	12,800,000
アイスタイル	900	1,405.00	1,264,500
エイチーム	200	2,271.00	454,200
テクノスジャパン	300	947.00	284,100
コロプラ	1,200	834.00	1,000,800
ブロードリーフ	1,800	521.00	937,800
ハーツユナイテッドグループ	200	1,841.00	368,200
ティーガイア	400	3,050.00	1,220,000
豆蔵ホールディングス	300	1,294.00	388,200
テクマトリックス	200	1,549.00	309,800
プロシップ	100	2,747.00	274,700

ガンホー・オンライン・エンターテイメント	9,700	368.00	3,569,600
GMOペイメントゲートウェイ	300	10,550.00	3,165,000
インターネットイニシアティブ	600	2,062.00	1,237,200
GMOクラウド	100	2,345.00	234,500
SRAホールディングス	200	3,105.00	621,000
Minorityソリューションズ	100	1,565.00	156,500
朝日ネット	300	510.00	153,000
コムチュア	200	3,690.00	738,000
gumi	400	1,021.00	408,400
オープンドア	100	2,142.00	214,200
アカツキ	100	4,795.00	479,500
LINE	1,100	4,030.00	4,433,000
オークネット	100	1,518.00	151,800
AOI TYO Holdings	300	1,684.00	505,200
マクロミル	300	2,928.00	878,400
フェイス	100	1,155.00	115,500
野村総合研究所	2,300	5,110.00	11,753,000
サイバネットシステム	300	866.00	259,800
インテージホールディングス	400	1,206.00	482,400
東邦システムサイエンス	100	866.00	86,600
クレスコ	100	3,765.00	376,500
フジ・メディア・ホールディングス	3,700	1,856.00	6,867,200
オービック	1,100	8,970.00	9,867,000
ジャストシステム	600	2,561.00	1,536,600
TDCソフト	200	1,286.00	257,200
ヤフー	25,700	449.00	11,539,300
トレンドマイクロ	1,700	6,540.00	11,118,000
インフォメーション・ディベロプメント	100	1,514.00	151,400
日本オラクル	600	8,840.00	5,304,000
アルファシステムズ	100	2,336.00	233,600
フューチャー	500	1,236.00	618,000
CAC Holdings	300	1,072.00	321,600
ソフトバンク・テクノロジー	100	1,872.00	187,200
トーセ	100	1,209.00	120,900
オービックビジネスコンサルタント	200	6,880.00	1,376,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,600	2,189.00	3,502,400
アイティフォー	400	876.00	350,400
東計電算	100	3,200.00	320,000
大塚商会	2,100	5,030.00	10,563,000
サイボウズ	500	532.00	266,000
電通国際情報サービス	200	2,822.00	564,400
デジタルガレージ	600	3,475.00	2,085,000

EMシステムズ	200	1,279.00	255,800
ウェザーニューズ	100	3,355.00	335,500
C I J	300	708.00	212,400
WOWOW	200	3,370.00	674,000
イマジカ・ロボットホールディングス	300	1,274.00	382,200
ネットワンシステムズ	1,500	1,565.00	2,347,500
アルゴグラフィックス	200	3,540.00	708,000
マーベラス	600	926.00	555,600
エイベックス	700	1,565.00	1,095,500
日本ユニシス	1,000	2,276.00	2,276,000
兼松エレクトロニクス	200	3,305.00	661,000
東京放送ホールディングス	2,000	2,360.00	4,720,000
日本テレビホールディングス	3,300	1,874.00	6,184,200
朝日放送グループホールディングス	400	881.00	352,400
テレビ朝日ホールディングス	1,000	2,537.00	2,537,000
スカパーJ S A Tホールディングス	2,700	496.00	1,339,200
テレビ東京ホールディングス	300	2,899.00	869,700
日本BS放送	100	1,373.00	137,300
ビジョン	100	2,992.00	299,200
コネクシオ	300	2,380.00	714,000
日本通信	3,200	118.00	377,600
日本電信電話	25,600	5,169.00	132,326,400
K D D I	32,100	2,845.00	91,324,500
光通信	400	17,540.00	7,016,000
N T T ドコモ	26,400	2,761.50	72,903,600
エムティーアイ	500	661.00	330,500
G M O インターネット	1,300	1,878.00	2,441,400
カドカワ	1,000	1,190.00	1,190,000
学研ホールディングス	100	4,835.00	483,500
ゼンリン	600	2,199.00	1,319,400
アイネット	200	1,635.00	327,000
松竹	200	16,410.00	3,282,000
東宝	2,300	3,625.00	8,337,500
東映	100	11,890.00	1,189,000
エヌ・ティ・ティ・データ	11,100	1,170.00	12,987,000
ピー・シー・エー	100	1,733.00	173,300
ビジネスブレイン太田昭和	100	2,411.00	241,100
D T S	400	3,835.00	1,534,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1,700	4,565.00	7,760,500
シーイーシー	200	3,360.00	672,000
カプコン	1,500	2,147.00	3,220,500
ジャステック	200	1,222.00	244,400

SCSK	800	4,665.00	3,732,000
日本システムウエア	100	2,805.00	280,500
アイネス	500	1,147.00	573,500
TKC	300	4,105.00	1,231,500
富士ソフト	500	4,215.00	2,107,500
NSD	600	2,233.00	1,339,800
コナミホールディングス	1,500	5,310.00	7,965,000
福井コンピュータホールディングス	100	2,266.00	226,600
JBCCHホールディングス	300	1,102.00	330,600
ミロク情報サービス	300	3,195.00	958,500
ソフトバンクグループ	16,100	8,277.00	133,259,700
高千穂交易	100	1,237.00	123,700
伊藤忠食品	100	6,130.00	613,000
エレマテック	200	2,541.00	508,200
JALUX	100	3,105.00	310,500
あらた	200	6,220.00	1,244,000
トーメンデバイス	100	2,766.00	276,600
東京エレクトロン デバイス	100	2,038.00	203,800
フィールズ	300	1,185.00	355,500
双日	21,200	353.00	7,483,600
アルフレッサ ホールディングス	4,000	2,327.00	9,308,000
横浜冷凍	900	1,102.00	991,800
ラサ商事	200	905.00	181,000
アルコニックス	400	2,082.00	832,800
神戸物産	200	5,070.00	1,014,000
ペッパーフードサービス	200	5,730.00	1,146,000
あい ホールディングス	600	2,884.00	1,730,400
ディーブイエックス	100	1,307.00	130,700
ダイワボウホールディングス	300	4,890.00	1,467,000
マクニカ・富士エレホールディングス	700	1,857.00	1,299,900
バイタルケーエスケー・ホールディングス	700	1,071.00	749,700
八洲電機	300	908.00	272,400
UKCホールディングス	200	2,250.00	450,000
OCHIホールディングス	100	1,451.00	145,100
TOKAIホールディングス	1,900	1,112.00	2,112,800
三洋貿易	200	2,081.00	416,200
ウイン・パートナーズ	300	1,435.00	430,500
シップヘルスケアホールディングス	700	3,775.00	2,642,500
明治電機工業	100	1,761.00	176,100
デリカフーズホールディングス	100	1,597.00	159,700
コメダホールディングス	700	2,223.00	1,556,100
富士興産	100	610.00	61,000

小野建	300	1,869.00	560,700
佐島電機	300	1,052.00	315,600
伯東	200	1,631.00	326,200
コンドーテック	300	913.00	273,900
中山福	200	754.00	150,800
ナガイレーベン	500	3,120.00	1,560,000
三菱食品	400	3,150.00	1,260,000
松田産業	300	1,813.00	543,900
第一興商	500	5,610.00	2,805,000
メディバルホールディングス	3,600	2,256.00	8,121,600
S P K	100	2,848.00	284,800
萩原電気ホールディングス	100	3,015.00	301,500
アズワン	300	7,150.00	2,145,000
スズデン	100	1,630.00	163,000
尾家産業	100	1,302.00	130,200
シモジマ	200	1,171.00	234,200
ドウシシャ	400	2,589.00	1,035,600
小津産業	100	2,333.00	233,300
高速	200	1,385.00	277,000
たけびし	100	1,643.00	164,300
リックス	100	2,114.00	211,400
丸文	300	973.00	291,900
ハピネット	200	1,565.00	313,000
橋本総業ホールディングス	100	1,858.00	185,800
日本ライフライン	1,000	3,180.00	3,180,000
エクセル	100	2,876.00	287,600
マルカキカイ	100	2,082.00	208,200
I D O M	1,100	821.00	903,100
日本エム・ディ・エム	200	1,002.00	200,400
進和	200	2,437.00	487,400
ダイトロン	200	2,033.00	406,600
シークス	500	2,202.00	1,101,000
田中商事	100	686.00	68,600
オーハシテクニカ	200	1,758.00	351,600
白銅	100	2,235.00	223,500
伊藤忠商事	26,300	2,139.50	56,268,850
丸紅	29,400	801.30	23,558,220
長瀬産業	2,200	1,887.00	4,151,400
蝶理	200	2,082.00	416,400
豊田通商	4,000	3,795.00	15,180,000
三共生興	600	498.00	298,800
兼松	1,500	1,629.00	2,443,500

三井物産	30,400	1,917.00	58,276,800	
日本紙パルプ商事	200	4,415.00	883,000	
日立ハイテクノロジーズ	1,200	4,740.00	5,688,000	
カメイ	500	1,486.00	743,000	
東都水産	100	1,961.00	196,100	
OUGホールディングス	100	2,672.00	267,200	
スターゼン	100	5,660.00	566,000	
山善	1,400	1,098.00	1,537,200	
椿本興業	100	3,290.00	329,000	
住友商事	22,600	1,914.00	43,256,400	
内田洋行	200	2,939.00	587,800	
三菱商事	25,100	2,955.50	74,183,050	代用有価証券 5,200株
第一実業	200	3,215.00	643,000	
キャノンマーケティングジャパン	1,000	2,840.00	2,840,000	
西華産業	200	2,746.00	549,200	
佐藤商事	300	1,166.00	349,800	
菱洋エレクトロ	300	1,784.00	535,200	
東京産業	400	555.00	222,000	
ユアサ商事	300	3,460.00	1,038,000	
小林産業	200	362.00	72,400	
阪和興業	700	4,565.00	3,195,500	
正栄食品工業	200	4,150.00	830,000	
カナデン	300	1,364.00	409,200	
菱電商事	300	1,763.00	528,900	
フルサト工業	200	1,816.00	363,200	
岩谷産業	800	4,075.00	3,260,000	
極東貿易	1,000	517.00	517,000	
イワキ	500	392.00	196,000	
三愛石油	1,000	1,695.00	1,695,000	
稲畑産業	900	1,642.00	1,477,800	
明和産業	300	517.00	155,100	
ワキタ	800	1,137.00	909,600	
東邦ホールディングス	1,100	2,595.00	2,854,500	
サンゲツ	1,200	2,245.00	2,694,000	
ミツウロコグループホールディングス	500	860.00	430,000	
シナネンホールディングス	100	2,782.00	278,200	
伊藤忠エネクス	800	1,079.00	863,200	
サンリオ	1,000	2,021.00	2,021,000	
サンワテクノス	200	1,609.00	321,800	
リョーサン	500	3,900.00	1,950,000	
新光商事	400	1,896.00	758,400	
トーヨー	200	2,587.00	517,400	

三信電気	300	2,154.00	646,200
東陽テクニカ	400	965.00	386,000
モスフードサービス	500	3,300.00	1,650,000
加賀電子	300	2,759.00	827,700
ソーダニッカ	400	744.00	297,600
立花エレテック	200	2,061.00	412,200
フォーバル	200	859.00	171,800
PALTAC	500	5,430.00	2,715,000
三谷産業	400	438.00	175,200
ヤマタネ	200	1,939.00	387,800
日鉄住金物産	300	6,040.00	1,812,000
トラスコ中山	700	2,760.00	1,932,000
オートバックスセブン	1,400	2,030.00	2,842,000
モリト	300	999.00	299,700
加藤産業	600	3,945.00	2,367,000
イノテック	300	1,298.00	389,400
イエローハット	300	3,240.00	972,000
J Kホールディングス	400	936.00	374,400
日伝	300	2,156.00	646,800
杉本商事	200	1,887.00	377,400
因幡電機産業	500	4,770.00	2,385,000
バイテックホールディングス	200	2,500.00	500,000
ミスミグループ本社	4,200	3,050.00	12,810,000
タキヒヨー	100	2,413.00	241,300
蔵王産業	100	1,700.00	170,000
スズケン	1,600	4,540.00	7,264,000
ジェコス	200	1,191.00	238,200
ルネサスイーストン	300	670.00	201,000
ローソン	900	7,160.00	6,444,000
サンエー	300	6,000.00	1,800,000
カワチ薬品	300	2,706.00	811,800
エービーシー・マート	700	7,090.00	4,963,000
ハードオフコーポレーション	200	1,109.00	221,800
アスクル	300	3,425.00	1,027,500
ゲオホールディングス	700	1,747.00	1,222,900
アダストリア	600	1,987.00	1,192,200
ジーフット	200	777.00	155,400
くらコーポレーション	200	7,560.00	1,512,000
キャンドウ	200	1,781.00	356,200
パルグループホールディングス	200	2,954.00	590,800
エディオン	1,400	1,258.00	1,761,200
サーラコーポレーション	600	676.00	405,600

ワッツ	100	1,095.00	109,500
ハローズ	100	2,685.00	268,500
あみやき亭	100	5,320.00	532,000
ひらまつ	500	502.00	251,000
大黒天物産	100	5,540.00	554,000
ハニーズホールディングス	300	1,036.00	310,800
アルペン	300	2,318.00	695,400
クオール	400	2,350.00	940,000
ジinz	200	5,880.00	1,176,000
ビックカメラ	2,100	1,726.00	3,624,600
D C Mホールディングス	1,900	1,056.00	2,006,400
Monotaro	1,300	3,940.00	5,122,000
アークランドサービスホールディングス	300	2,341.00	702,300
J.フロントリテイリング	4,300	1,721.00	7,400,300
ドトール・日レスホールディングス	600	2,271.00	1,362,600
マツモトキヨシホールディングス	1,500	4,620.00	6,930,000
ブロンコビリー	200	4,245.00	849,000
スタートトゥデイ	3,500	3,010.00	10,535,000
トレジャー・ファクトリー	100	779.00	77,900
物語コーポレーション	100	11,320.00	1,132,000
ココカラファイン	400	7,730.00	3,092,000
三越伊勢丹ホールディングス	6,700	1,194.00	7,999,800
ウエルシアホールディングス	900	5,440.00	4,896,000
クリエイティブSDホールディングス	500	2,998.00	1,499,000
丸善CH Iホールディングス	400	352.00	140,800
チムニー	100	2,862.00	286,200
シュッピン	200	1,217.00	243,400
ネクステージ	400	1,028.00	411,200
ジョイフル本田	500	3,710.00	1,855,000
鳥貴族	100	2,967.00	296,700
すかいらーく	2,200	1,567.00	3,447,400
綿半ホールディングス	100	3,865.00	386,500
ヨシックス	100	3,405.00	340,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,200	1,351.00	1,621,200
ブックオフコーポレーション	200	830.00	166,000
あさひ	300	1,291.00	387,300
日本調剤	100	3,510.00	351,000
コスモス薬品	200	23,320.00	4,664,000
トーエル	200	1,111.00	222,200
オンリー	100	1,021.00	102,100
セブン&アイ・ホールディングス	15,000	4,760.00	71,400,000
薬王堂	200	3,660.00	732,000

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	1,000	1,242.00	1,242,000
ツルハホールディングス	800	15,250.00	12,200,000
サンマルクホールディングス	300	3,125.00	937,500
フェリシモ	100	1,367.00	136,700
トリドールホールディングス	400	3,715.00	1,486,000
TOKYO BASE	200	1,101.00	220,200
クスリのアオキホールディングス	300	7,620.00	2,286,000
スシローグローバルホールディングス	300	5,220.00	1,566,000
LIXILピバ	300	2,011.00	603,300
総合メディカル	300	2,990.00	897,000
はるやまホールディングス	200	1,055.00	211,000
ノジマ	600	2,490.00	1,494,000
カッパ・クリエイト	400	1,307.00	522,800
ライトオン	300	1,009.00	302,700
良品計画	500	37,250.00	18,625,000
三城ホールディングス	400	502.00	200,800
アドヴァン	400	992.00	396,800
アルビス	100	3,545.00	354,500
コナカ	500	585.00	292,500
G-7ホールディングス	100	2,438.00	243,800
イオン北海道	400	800.00	320,000
ヒマラヤ	100	1,135.00	113,500
コーナン商事	500	2,750.00	1,375,000
エコス	100	1,811.00	181,100
ワタミ	400	1,462.00	584,800
ドンキホーテホールディングス	2,300	5,670.00	13,041,000
西松屋チェーン	800	1,287.00	1,029,600
ゼンショーホールディングス	1,900	2,528.00	4,803,200
ハークスレイ	100	1,060.00	106,000
サイゼリヤ	500	2,530.00	1,265,000
V Tホールディングス	1,200	514.00	616,800
魚力	100	1,409.00	140,900
フジ・コーポレーション	100	2,627.00	262,700
ユナイテッドアローズ	400	4,095.00	1,638,000
ハイデイ日高	500	2,831.00	1,415,500
京都きもの友禅	200	757.00	151,400
コロワイド	1,200	2,785.00	3,342,000
ピーシーデポコーポレーション	500	720.00	360,000
壱番屋	300	4,545.00	1,363,500
PLANT	100	1,342.00	134,200
スギホールディングス	800	6,430.00	5,144,000
スクロール	500	428.00	214,000

ヨンドシーホールディングス	400	2,732.00	1,092,800
ユニー・ファミリーマートホールディングス	1,100	10,000.00	11,000,000
木曽路	400	2,816.00	1,126,400
ケーヨー	700	563.00	394,100
上新電機	400	4,290.00	1,716,000
日本瓦斯	700	5,290.00	3,703,000
ロイヤルホールディングス	600	2,925.00	1,755,000
いなげや	400	1,778.00	711,200
島忠	900	3,480.00	3,132,000
チヨダ	400	2,543.00	1,017,200
ライフコーポレーション	300	2,750.00	825,000
リンガーハット	400	2,633.00	1,053,200
MrMaxHD	400	742.00	296,800
AOKIホールディングス	700	1,610.00	1,127,000
オークワ	1,000	1,192.00	1,192,000
コメリ	600	2,886.00	1,731,600
青山商事	700	4,100.00	2,870,000
しまむら	400	13,700.00	5,480,000
はせがわ	200	485.00	97,000
高島屋	6,000	929.00	5,574,000
松屋	700	1,435.00	1,004,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,700	2,054.00	3,491,800
近鉄百貨店	100	3,920.00	392,000
パルコ	300	1,344.00	403,200
丸井グループ	3,400	2,258.00	7,677,200
アクシアル リテイリング	300	4,290.00	1,287,000
イオン	13,800	2,077.00	28,662,600
イズミ	600	6,890.00	4,134,000
平和堂	700	2,587.00	1,810,900
フジ	400	2,365.00	946,000
ヤオコー	400	6,000.00	2,400,000
ゼビオホールディングス	500	2,055.00	1,027,500
ケーズホールディングス	3,000	1,544.00	4,632,000
日産東京販売ホールディングス	500	394.00	197,000
Genky DrugStores	100	4,030.00	403,000
アインホールディングス	500	7,920.00	3,960,000
元気寿司	100	2,819.00	281,900
ヤマダ電機	12,000	570.00	6,840,000
アーランドサカモト	600	1,675.00	1,005,000
ニトリホールディングス	1,400	18,510.00	25,914,000
ケーヨーホールディングス	200	1,119.00	223,800
吉野家ホールディングス	1,200	2,040.00	2,448,000

松屋フーズ	200	3,770.00	754,000
サガミチェーン	500	1,393.00	696,500
関西スーパーマーケット	300	1,207.00	362,100
王将フードサービス	300	5,420.00	1,626,000
プレナス	400	1,846.00	738,400
ミニストップ	300	2,176.00	652,800
アークス	700	2,821.00	1,974,700
パローホールディングス	800	2,982.00	2,385,600
ベルク	200	5,880.00	1,176,000
大庄	200	1,702.00	340,400
ファーストリテイリング	600	47,510.00	28,506,000
サンドラッグ	1,500	5,450.00	8,175,000
サックスパー ホールディングス	300	1,146.00	343,800
ヤマザワ	100	1,779.00	177,900
やまや	100	3,185.00	318,500
ベルーナ	900	1,240.00	1,116,000
じもとホールディングス	2,400	188.00	451,200
めぶきフィナンシャルグループ	18,600	418.00	7,774,800
東京ＴＹフィナンシャルグループ	500	2,862.00	1,431,000
九州フィナンシャルグループ	5,900	533.00	3,144,700
ゆうちょ銀行	10,200	1,463.00	14,922,600
富山第一銀行	900	494.00	444,600
コンコルディア・フィナンシャルグループ	21,800	616.00	13,428,800
西日本フィナンシャルホールディングス	2,400	1,249.00	2,997,600
関西みらいフィナンシャルグループ	1,600	840.00	1,344,000
三十三フィナンシャルグループ	300	2,233.00	669,900
新生銀行	3,100	1,653.00	5,124,300
あおぞら銀行	2,100	4,280.00	8,988,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	250,800	716.30	179,648,040
りそなホールディングス	39,300	587.50	23,088,750
三井住友トラスト・ホールディングス	7,000	4,497.00	31,479,000
三井住友フィナンシャルグループ	27,100	4,522.00	122,546,200
第四銀行	400	4,840.00	1,936,000
北越銀行	400	2,384.00	953,600
千葉銀行	12,700	838.00	10,642,600
群馬銀行	7,300	615.00	4,489,500
武蔵野銀行	600	3,485.00	2,091,000
千葉興業銀行	1,000	501.00	501,000
筑波銀行	1,500	377.00	565,500
七十七銀行	1,100	2,613.00	2,874,300
青森銀行	300	3,335.00	1,000,500
秋田銀行	200	2,936.00	587,200

山形銀行	400	2,385.00	954,000
岩手銀行	300	4,330.00	1,299,000
東邦銀行	3,200	418.00	1,337,600
東北銀行	200	1,449.00	289,800
みちのく銀行	200	1,782.00	356,400
ふくおかフィナンシャルグループ	15,000	575.00	8,625,000
静岡銀行	9,500	1,061.00	10,079,500
十六銀行	500	2,827.00	1,413,500
スルガ銀行	3,700	1,321.00	4,887,700
八十二銀行	6,500	566.00	3,679,000
山梨中央銀行	2,000	452.00	904,000
大垣共立銀行	600	2,720.00	1,632,000
福井銀行	300	2,442.00	732,600
北國銀行	400	4,290.00	1,716,000
清水銀行	100	2,993.00	299,300
富山銀行	100	3,835.00	383,500
滋賀銀行	3,000	543.00	1,629,000
南都銀行	400	2,970.00	1,188,000
百五銀行	3,400	500.00	1,700,000
京都銀行	1,400	6,220.00	8,708,000
紀陽銀行	1,300	1,744.00	2,267,200
ほくほくフィナンシャルグループ	2,400	1,566.00	3,758,400
広島銀行	5,300	804.00	4,261,200
山陰合同銀行	2,100	992.00	2,083,200
中国銀行	2,500	1,243.00	3,107,500
鳥取銀行	100	1,712.00	171,200
伊予銀行	5,100	832.00	4,243,200
百十四銀行	4,000	362.00	1,448,000
四国銀行	500	1,561.00	780,500
阿波銀行	3,000	723.00	2,169,000
大分銀行	200	3,945.00	789,000
宮崎銀行	200	3,480.00	696,000
佐賀銀行	200	2,375.00	475,000
十八銀行	2,000	284.00	568,000
沖縄銀行	300	4,525.00	1,357,500
琉球銀行	700	1,642.00	1,149,400
セブン銀行	13,400	359.00	4,810,600
みずほフィナンシャルグループ	486,800	195.30	95,072,040
高知銀行	100	1,286.00	128,600
山口フィナンシャルグループ	3,000	1,380.00	4,140,000
長野銀行	100	1,828.00	182,800
名古屋銀行	300	3,995.00	1,198,500

北洋銀行	5,400	357.00	1,927,800
愛知銀行	100	5,140.00	514,000
中京銀行	100	2,311.00	231,100
大光銀行	100	2,319.00	231,900
愛媛銀行	500	1,315.00	657,500
トマト銀行	100	1,519.00	151,900
京葉銀行	3,000	484.00	1,452,000
栃木銀行	1,900	407.00	773,300
北日本銀行	100	2,825.00	282,500
東和銀行	600	1,453.00	871,800
福島銀行	300	804.00	241,200
大東銀行	200	1,280.00	256,000
トモニホールディングス	3,000	471.00	1,413,000
フィデアホールディングス	3,500	192.00	672,000
池田泉州ホールディングス	3,800	421.00	1,599,800
F P G	1,300	1,319.00	1,714,700
S B Iホールディングス	4,100	2,812.00	11,529,200
ジャフコ	500	4,950.00	2,475,000
大和証券グループ本社	31,000	672.00	20,832,000
野村ホールディングス	61,600	636.90	39,233,040
岡三証券グループ	3,000	626.00	1,878,000
丸三証券	1,100	1,038.00	1,141,800
東洋証券	1,000	291.00	291,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	4,000	771.00	3,084,000
光世証券	100	1,418.00	141,800
水戸証券	1,000	419.00	419,000
いちよし証券	800	1,295.00	1,036,000
松井証券	1,800	1,019.00	1,834,200
マネックスグループ	3,800	553.00	2,101,400
カブドットコム証券	2,300	399.00	917,700
極東証券	500	1,622.00	811,000
岩井コスモホールディングス	400	1,438.00	575,200
藍澤証券	700	784.00	548,800
かんぽ生命保険	1,400	2,592.00	3,628,800
S O M P Oホールディングス	7,000	4,419.00	30,933,000
アニコムホールディングス	200	3,585.00	717,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	9,400	3,600.00	33,840,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	2,900	1,955.00	5,669,500
第一生命ホールディングス	20,300	2,067.50	41,970,250
東京海上ホールディングス	13,500	4,968.00	67,068,000
T & Dホールディングス	11,100	1,738.00	19,291,800
全国保証	1,000	4,440.00	4,440,000

クレディセゾン	2,700	1,903.00	5,138,100
芙蓉総合リース	400	6,980.00	2,792,000
興銀リース	700	2,955.00	2,068,500
東京センチュリー	700	6,420.00	4,494,000
日本証券金融	1,500	672.00	1,008,000
アイフル	6,000	356.00	2,136,000
リコーリース	300	3,610.00	1,083,000
イオンフィナンシャルサービス	2,500	2,531.00	6,327,500
アコム	7,200	509.00	3,664,800
ジャックス	400	2,430.00	972,000
オリエントコーポレーション	7,800	170.00	1,326,000
日立キャピタル	1,000	2,834.00	2,834,000
オリックス	23,900	1,894.00	45,266,600
三菱UFJリース	9,100	666.00	6,060,600
日本取引所グループ	10,300	1,966.00	20,249,800
イー・ギャランティ	200	2,114.00	422,800
NECキャピタルソリューション	100	2,073.00	207,300
いちご	5,100	435.00	2,218,500
日本駐車場開発	4,300	175.00	752,500
ヒューリック	7,500	1,172.00	8,790,000
三栄建築設計	100	1,915.00	191,500
スター・マイカ	100	2,459.00	245,900
野村不動産ホールディングス	2,400	2,626.00	6,302,400
三重交通グループホールディングス	700	518.00	362,600
サムティ	300	2,087.00	626,100
日本商業開発	200	1,732.00	346,400
プレサンスコーポレーション	500	1,666.00	833,000
ユニゾホールディングス	400	2,581.00	1,032,400
日本管理センター	200	1,587.00	317,400
サンセイランディック	100	1,231.00	123,100
フージャースホールディングス	900	765.00	688,500
オープンハウス	600	5,980.00	3,588,000
東急不動産ホールディングス	8,700	819.00	7,125,300
飯田グループホールディングス	3,000	2,091.00	6,273,000
ムゲンエステート	200	1,327.00	265,400
ファーストブラザーズ	100	1,390.00	139,000
シーアールイー	100	1,798.00	179,800
ケイアイスター不動産	100	2,822.00	282,200
パーク24	2,000	3,085.00	6,170,000
パラカ	100	2,332.00	233,200
三井不動産	17,900	2,704.00	48,401,600
三菱地所	26,700	1,892.00	50,516,400

平和不動産	600	2,444.00	1,466,400
東京建物	3,900	1,588.00	6,193,200
ダイビル	900	1,262.00	1,135,800
京阪神ビルディング	600	885.00	531,000
住友不動産	9,000	4,050.00	36,450,000
大京	600	2,314.00	1,388,400
テオオーシー	1,200	953.00	1,143,600
東京楽天地	100	5,320.00	532,000
レオパレス21	4,300	968.00	4,162,400
スターツコーポレーション	500	2,874.00	1,437,000
フジ住宅	500	920.00	460,000
空港施設	400	627.00	250,800
明和地所	200	753.00	150,600
ゴールドクレスト	300	2,280.00	684,000
日本エスリード	100	2,035.00	203,500
日神不動産	500	791.00	395,500
日本エスコン	600	932.00	559,200
タカラレーベン	1,700	434.00	737,800
サンヨーハウジング名古屋	200	1,205.00	241,000
イオンモール	2,300	2,152.00	4,949,600
ファースト住建	100	1,658.00	165,800
トーセイ	400	1,381.00	552,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	2,200	1,260.00	2,772,000
サンフロンティア不動産	400	1,262.00	504,800
エフ・ジェー・ネクスト	300	838.00	251,400
グランディハウス	300	440.00	132,000
日本空港ビルデング	1,000	4,395.00	4,395,000
日本工営	200	3,250.00	650,000
LIFULL	1,200	919.00	1,102,800
ジェイエイシーリクルートメント	300	2,223.00	666,900
日本M&Aセンター	2,400	3,325.00	7,980,000
タケエイ	400	1,318.00	527,200
トラスト・テック	200	3,500.00	700,000
コシダカホールディングス	200	6,440.00	1,288,000
パソナグループ	300	1,803.00	540,900
リンクアンドモチベーション	600	1,126.00	675,600
GCA	400	929.00	371,600
エス・エム・エス	700	4,320.00	3,024,000
パーソルホールディングス	3,200	2,784.00	8,908,800
リニカル	200	1,757.00	351,400
クックパッド	1,100	663.00	729,300
アイ・ケイ・ケイ	200	835.00	167,000

学情	200	1,374.00	274,800
スタジオアリス	200	2,416.00	483,200
シミックホールディングス	200	2,578.00	515,600
N J S	100	1,590.00	159,000
総合警備保障	1,400	5,300.00	7,420,000
カカクコム	2,600	2,065.00	5,369,000
セントケア・ホールディング	100	789.00	78,900
ルネサンス	200	1,824.00	364,800
ディップ	500	2,538.00	1,269,000
ツクイ	800	853.00	682,400
エムスリー	3,700	4,555.00	16,853,500
ツカダ・グローバルホールディング	300	644.00	193,200
アウトソーシング	1,000	1,842.00	1,842,000
ウェルネット	400	1,164.00	465,600
ワールドホールディングス	100	4,310.00	431,000
ディー・エヌ・エー	1,900	2,091.00	3,972,900
博報堂D Yホールディングス	4,800	1,474.00	7,075,200
ぐるなび	500	1,519.00	759,500
エスアールジータカミヤ	400	663.00	265,200
ファンコミュニケーションズ	1,000	691.00	691,000
ライク	100	1,979.00	197,900
W D Bホールディングス	200	3,540.00	708,000
ティア	200	1,034.00	206,800
バリューコマース	300	1,352.00	405,600
インフォマート	1,800	1,053.00	1,895,400
J Pホールディングス	1,100	320.00	352,000
E P Sホールディングス	500	2,228.00	1,114,000
レッグス	100	963.00	96,300
プレステージ・インターナショナル	700	1,327.00	928,900
アミューズ	200	3,280.00	656,000
クイック	200	1,769.00	353,800
ケネディクス	4,600	623.00	2,865,800
電通	4,200	5,130.00	21,546,000
ぴあ	100	5,960.00	596,000
イオンファンタジー	100	5,810.00	581,000
シーティーエス	300	766.00	229,800
ネクシィーズグループ	100	1,636.00	163,600
みらかホールディングス	1,000	4,310.00	4,310,000
アルプス技研	300	2,508.00	752,400
ダイオーズ	100	1,333.00	133,300
日本空調サービス	400	771.00	308,400
オリエンタルランド	4,100	10,785.00	44,218,500

ダスキン	900	2,730.00	2,457,000
明光ネットワークジャパン	400	1,227.00	490,800
ファルコホールディングス	200	1,793.00	358,600
ラウンドワン	1,100	1,605.00	1,765,500
リゾートトラスト	1,500	2,244.00	3,366,000
ビー・エム・エル	400	2,751.00	1,100,400
りらいあコミュニケーションズ	500	1,366.00	683,000
リソー教育	600	844.00	506,400
ユー・エス・エス	4,200	2,249.00	9,445,800
東京個別指導学院	100	1,126.00	112,600
サイバーエージェント	2,300	5,600.00	12,880,000
楽天	17,800	779.30	13,871,540
クリーク・アンド・リバー社	200	1,200.00	240,000
テー・オー・ダブリュー	300	986.00	295,800
セントラルスポーツ	100	3,730.00	373,000
フルキャストホールディングス	300	2,421.00	726,300
テクノプロ・ホールディングス	700	6,350.00	4,445,000
ジャパンマテリアル	900	1,325.00	1,192,500
ベクトル	400	1,940.00	776,000
ウチヤマホールディングス	200	632.00	126,400
I B J	300	966.00	289,800
アサンテ	100	1,951.00	195,100
M & A キャピタルパートナーズ	100	8,290.00	829,000
日本ビューホテル	100	1,560.00	156,000
リクルートホールディングス	26,800	2,572.00	68,929,600
日本郵政	19,700	1,326.00	26,122,200
ベルシステム24ホールディングス	600	1,697.00	1,018,200
ソラスト	200	2,948.00	589,600
リログループ	1,900	2,501.00	4,751,900
東祥	200	3,950.00	790,000
エイチ・アイ・エス	500	3,845.00	1,922,500
共立メンテナンス	600	5,030.00	3,018,000
イチネンホールディングス	400	1,471.00	588,400
建設技術研究所	200	1,456.00	291,200
スペース	200	1,490.00	298,000
燦ホールディングス	100	2,885.00	288,500
タナベ経営	100	2,033.00	203,300
ナガワ	100	4,655.00	465,500
よみうりランド	100	4,700.00	470,000
東京都競馬	300	4,025.00	1,207,500
常磐興産	100	1,911.00	191,100
カナモト	500	3,625.00	1,812,500

東京ドーム	1,400	1,056.00	1,478,400
西尾レントオール	300	3,245.00	973,500
トランス・コスモス	400	2,939.00	1,175,600
乃村工藝社	800	2,297.00	1,837,600
藤田観光	100	3,260.00	326,000
KNT-CTホールディングス	200	1,731.00	346,200
日本管財	400	2,085.00	834,000
トーカイ	300	2,235.00	670,500
セコム	3,700	8,165.00	30,210,500
セントラル警備保障	200	3,900.00	780,000
丹青社	700	1,310.00	917,000
メイテック	400	6,110.00	2,444,000
応用地質	400	1,554.00	621,600
船井総研ホールディングス	700	2,507.00	1,754,900
進学会ホールディングス	200	616.00	123,200
いであ	100	1,038.00	103,800
ベネッセホールディングス	1,300	3,980.00	5,174,000
イオンディライト	400	3,865.00	1,546,000
ナック	200	941.00	188,200
ニチイ学館	700	1,242.00	869,400
ダイセキ	600	3,235.00	1,941,000
ステップ	100	1,711.00	171,100
合 計	4,329,100		9,042,592,480

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

新光外国株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	351,703,629	208,853,046
コール・ローン	16,652,366	26,312,022

	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
株式	7,014,497,467	5,975,147,722
投資信託受益証券	608,958	432,069
投資証券	201,308,646	137,541,724
派生商品評価勘定	2,911,102	2,892,010
未収入金	69,577	58,684
未収配当金	6,387,787	8,136,772
差入委託証拠金	73,773,195	63,243,517
流動資産合計	7,667,912,727	6,422,617,566
資産合計	7,667,912,727	6,422,617,566
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	140,495	3,021,158
未払解約金	15,900,000	20,068,000
未払利息	27	59
流動負債合計	16,040,522	23,089,217
負債合計	16,040,522	23,089,217
純資産の部		
元本等		
元本	3,364,583,423	2,814,681,019
剰余金		
剰余金又は欠損金()	4,287,288,782	3,584,847,330
元本等合計	7,651,872,205	6,399,528,349
純資産合計	7,651,872,205	6,399,528,349
負債純資産合計	7,667,912,727	6,422,617,566

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p> <p>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、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 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、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>

3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>(1) 株式及び投資証券 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 原則として、投資信託受益証券の収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 3,364,583,423口	1. 計算日における受益権の総数 2,814,681,019口
2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 2.2742円 (1万口当たり純資産額) (22,742円)	2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 2.2736円 (1万口当たり純資産額) (22,736円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため及び為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。</p>	同左

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

平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>投資証券</p> <p>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

	自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,054,284,644円	3,364,583,423円
期中追加設定元本額	1,939,105円	92,883,764円
期中一部解約元本額	691,640,326円	642,786,168円
同期末における元本の内訳		
新光7資産バランスファンド	360,501,597円	316,216,743円
新光外国株式インデックスVA	698,801,033円	551,653,419円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	541,273,019円	325,591,338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）	371,674,355円	279,336,775円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	100,592,798円	89,805,424円

ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	841,400,977円	804,269,269円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	443,319,268円	431,157,671円
グローバル・ナビ	7,020,376円	16,650,380円
合計	3,364,583,423円	2,814,681,019円

2 有価証券関係
 売買目的有価証券

種類	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	1,010,948,202	137,953,997
投資信託受益証券	27,065	116,078
投資証券	14,729,355	15,503,616
合計	1,025,704,622	122,334,303

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

3 デリバティブ取引等関係
 取引の時価等に関する事項
 (株式関連)

種類	平成29年10月20日現在				平成30年 4月20日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
	うち1年超				うち1年超			
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	424,617,960	-	427,386,065	2,768,105	283,104,967	-	282,967,075	137,892
S&P500 EMINI	343,623,159	-	346,497,102	2,873,943	189,160,232	-	188,145,352	1,014,880
S&P/TSE 601X	16,823,329	-	16,835,473	12,144	15,562,561	-	15,393,133	169,428
DJ EURO ST50	28,905,736	-	28,799,332	106,404	44,293,559	-	45,270,416	976,857
FTSE 100 IDX	22,239,718	-	22,210,876	28,842	21,663,058	-	22,011,124	348,066
SPI 200	13,026,018	-	13,043,282	17,264	12,425,557	-	12,147,050	278,507
合計	424,617,960	-	427,386,065	2,768,105	283,104,967	-	282,967,075	137,892

時価の算定方法

先物取引

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

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

契約額等及び時価の邦貨換算額は計算日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

種類	平成29年10月20日現在				平成30年 4月20日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超				うち1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	9,343,180	-	9,351,300	8,120	-	-	-	-
ユーロ	9,343,180	-	9,351,300	8,120	-	-	-	-
合計	9,343,180	-	9,351,300	8,120	-	-	-	-

時価の算定方法

為替予約取引

1) 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該仲値で評価しております。

計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物売買相場のうち受渡日に最も近い前後二つの先物売買相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、発表されているもので為替予約の受渡日に最も近い先物売買相場の仲値で評価しております。

2) 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	923	66.08	60,991.84	

ANDEAVOR	143	116.48	16,656.64
ANTERO RESOURCES CORPORATION	453	20.33	9,209.49
BAKER HUGHES A GE CO LLC	861	33.71	29,024.31
CABOT OIL & GAS CORPORATION	1,029	23.56	24,243.24
CHENIERE ENERGY INC	442	58.61	25,905.62
CHEVRON CORP	3,007	123.71	371,995.97
CONCHO RESOURCES INC	236	157.45	37,158.20
CONOCOPHILLIPS	2,037	66.31	135,073.47
CONTINENTAL RESOURCES INC	189	64.04	12,103.56
DEVON ENERGY CORPORATION	535	35.69	19,094.15
DIAMONDBACK ENERGY INC	190	128.88	24,487.20
EOG RESOURCES INC	950	114.04	108,338.00
EQT CORPORATION	382	48.22	18,420.04
EXXON MOBIL CORP	6,409	79.42	509,002.78
HALLIBURTON CO	1,378	52.01	71,669.78
HELMERICH & PAYNE INC	236	73.00	17,228.00
HESS CORPORATION	235	58.20	13,677.00
HOLLYFRONTIER CORPORATION	378	58.24	22,014.72
KINDER MORGAN INC	2,486	16.54	41,118.44
MARATHON OIL CORP	1,874	17.99	33,713.26
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	653	79.40	51,848.20
NATIONAL OILWELL VARCO INC	810	38.58	31,249.80
NEWFIELD EXPLORATION CO	440	28.11	12,368.40
NOBLE ENERGY INC	392	33.83	13,261.36
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,259	75.99	95,671.41
ONEOK INC	411	59.74	24,553.14
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	480	30.38	14,582.40
PHILLIPS 66	522	110.64	57,754.08
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	270	195.47	52,776.90
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	317	24.50	7,766.50
RANGE RESOURCES CORP	508	14.24	7,233.92
SCHLUMBERGER LIMITED	1,880	70.28	132,126.40
TARGA RESOURCES CORPORATION	442	47.17	20,849.14
TECHNIPFMC PLC	262	33.33	8,732.46
VALERO ENERGY CORP	586	108.20	63,405.20
WILLIAMS COS INC	1,470	25.55	37,558.50
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	267	166.80	44,535.60
ALBEMARLE CORPORATION	241	98.59	23,760.19
AVERY DENNISON CORPORATION	197	107.69	21,214.93
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	479	31.47	15,074.13
BALL CORPORATION	190	40.92	7,774.80
CELANESE CORP-SERIES A	82	111.19	9,117.58

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	516	39.64	20,454.24
CROWN HOLDINGS INC	308	51.20	15,769.60
DOWDUPONT INC	3,453	66.53	229,728.09
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	301	107.47	32,348.47
ECOLAB INC	312	148.98	46,481.76
FMC CORPORATION	296	82.12	24,307.52
FREEMPORT-MCMORAN INC	1,575	19.57	30,822.75
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	45	141.63	6,373.35
INTERNATIONAL PAPER CO	301	53.59	16,130.59
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV-CLASS A	433	107.60	46,590.80
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	129	198.17	25,563.93
MONSANTO CO	722	124.60	89,961.20
NEWMONT MINING CORP	846	41.94	35,481.24
NUCOR CORP	394	65.13	25,661.22
PACKAGING CORPORATION OF AMERICA	208	116.19	24,167.52
PPG INDUSTRIES INC	456	109.64	49,995.84
PRAXAIR INC	454	151.56	68,808.24
SEALED AIR CORPORATION	428	44.35	18,981.80
STEEL DYNAMICS INC	498	47.15	23,480.70
THE MOSAIC COMPANY	736	25.85	19,025.60
THE SHERWIN-WILLIAMS COMPANY	138	396.19	54,674.22
VULCAN MATERIALS CO	156	115.33	17,991.48
WESTROCK COMPANY	389	66.61	25,911.29
WR GRACE & CO	161	69.48	11,186.28
3M CO	899	218.85	196,746.15
A.O. SMITH CORPORATION	327	65.28	21,346.56
ACUITY BRANDS INC	98	128.79	12,621.42
AGCO CORPORATION	132	66.95	8,837.40
ALLEGION PUBLIC LIMITED COMPANY	196	85.39	16,736.44
AMETEK INC	369	76.53	28,239.57
ARCONIC INC	810	23.53	19,059.30
BOEING CO	856	340.64	291,587.84
CATERPILLAR INC	935	155.70	145,579.50
CUMMINS INC	263	169.52	44,583.76
DEERE & CO	481	148.10	71,236.10
DOVER CORP	249	96.00	23,904.00
EATON CORPORATION PLC	554	79.15	43,849.10
EMERSON ELECTRIC CO	1,023	70.67	72,295.41
FASTENAL CO	249	50.58	12,594.42
FLOWSERVE CORPORATION	289	47.64	13,767.96
FLUOR CORP	308	59.15	18,218.20
FORTIVE CORPORATION	555	76.77	42,607.35

GENERAL DYNAMICS CORP	422	224.98	94,941.56
GENERAL ELECTRIC CO(US)	12,766	13.99	178,596.34
HARRIS CORPORATION	85	168.86	14,353.10
HD SUPPLY HOLDINGS INC	414	39.25	16,249.50
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,027	148.13	152,129.51
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	100	265.59	26,559.00
IDEX CORPORATION	157	145.18	22,793.26
ILLINOIS TOOL WORKS	494	159.09	78,590.46
INGERSOLL-RAND PLC	406	84.49	34,302.94
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	259	60.50	15,669.50
JARDINE MATHESON HLDGS LIMITED	400	61.57	24,628.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	500	38.41	19,205.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	1,489	34.01	50,640.89
L3 TECHNOLOGIES INC	42	216.06	9,074.52
LENNOX INTERNATIONAL INC	79	202.84	16,024.36
LOCKHEED MARTIN CORP	429	353.38	151,600.02
NORTHROP GRUMMAN CORP	263	358.02	94,159.26
PACCAR INC	558	69.64	38,859.12
PARKER HANNIFIN CORP	211	176.18	37,173.98
PENTAIR PLC	354	71.14	25,183.56
RAYTHEON COMPANY	479	228.06	109,240.74
ROCKWELL AUTOMATION INC	229	174.50	39,960.50
ROCKWELL COLLINS INC.	267	133.36	35,607.12
ROPER TECHNOLOGIES INC	162	279.98	45,356.76
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	378	53.99	20,408.22
SNAP-ON INC	10	152.59	1,525.90
STANLEY BLACK & DECKER INC	252	154.57	38,951.64
TEXTRON INC	394	65.48	25,799.12
THE MIDDLEBY CORPORATION	127	126.21	16,028.67
TRANSDIGM GROUP INC	55	329.06	18,098.30
UNITED RENTALS INC	85	168.22	14,298.70
UNITED TECHNOLOGIES CORP	1,099	123.85	136,111.15
WABCO HOLDINGS INC	116	134.97	15,656.52
WABTEC CORPORATION	191	83.79	16,003.89
WW GRAINGER INC	48	299.88	14,394.24
XYLEM INC	313	78.75	24,648.75
CINTAS CORPORATION	186	174.16	32,393.76
COSTAR GROUP INC	72	377.55	27,183.60
EQUIFAX INC	257	118.78	30,526.46
IHS MARKIT LIMITED	769	49.50	38,065.50
MANPOWER GROUP	148	118.66	17,561.68
NIELSEN HOLDINGS PLC	291	34.70	10,097.70

REPUBLIC SERVICES INC	210	65.89	13,836.90
ROBERT HALF INTL INC	285	60.55	17,256.75
ROLLINS INC	201	52.84	10,620.84
STERICYCLE INC	188	60.85	11,439.80
VERISK ANALYTICS INC	110	107.57	11,832.70
WASTE CONNECTIONS INC	297	73.91	21,951.27
WASTE MANAGEMENT INC	504	82.62	41,640.48
AMERCO	16	344.65	5,514.40
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	278	46.88	13,032.64
C H ROBINSON WORLDWIDE INC	95	94.29	8,957.55
CSX CORP	1,193	61.19	72,999.67
DELTA AIR LINES INC	375	55.07	20,651.25
EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON	24	64.37	1,544.88
FEDEX CORP	418	251.59	105,164.62
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	199	121.27	24,132.73
KANSAS CITY SOUTHERN	219	110.29	24,153.51
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORPORATION	172	39.21	6,744.12
NORFOLK SOUTHERN CORP	383	138.86	53,183.38
SOUTHWEST AIRLINES COMPANY	340	54.80	18,632.00
SWIFT TRANSPORTATION COMPANY	237	44.27	10,491.99
UNION PACIFIC CORP	1,191	137.99	164,346.09
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	175	70.23	12,290.25
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	982	109.68	107,705.76
APTIV PLC	441	86.02	37,934.82
AUTOLIV INC	195	151.39	29,521.05
BORGWARNER INC	471	52.67	24,807.57
FORD MOTOR CO	5,898	10.96	64,642.08
GENERAL MOTORS CO	1,648	37.77	62,244.96
HARLEY-DAVIDSON INC	391	40.96	16,015.36
TESLA INC	189	300.08	56,715.12
THE GOODYEAR TIRE & RUBBER COMPANY	517	26.95	13,933.15
DR HORTON INC	358	43.76	15,666.08
GARMIN LIMITED	262	59.23	15,518.26
HANESBRANDS INC	836	17.62	14,730.32
HASBRO INC	230	83.99	19,317.70
LEGGETT & PLATT INC	296	43.58	12,899.68
LENNAR CORPORATION-CLASS A	408	55.62	22,692.96
LULULEMON ATHLETICA INC	234	95.29	22,297.86
MATTEL INC	757	13.45	10,181.65
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	363	65.71	23,852.73
MOHAWK INDUSTRIES INC	41	240.98	9,880.18
NEWELL BRANDS INC	990	26.68	26,413.20

NIKE INC -CL B	1,913	65.73	125,741.49
NVR INC	7	3,052.23	21,365.61
POLARIS INDUSTRIES INC	135	121.15	16,355.25
PVH CORPORATION	61	160.36	9,781.96
RALPH LAUREN CORPORATION	125	110.09	13,761.25
TAPESTRY INC	576	53.29	30,695.04
TOLL BROTHERS INC	357	41.68	14,879.76
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	421	16.08	6,769.68
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	429	14.01	6,010.29
VF CORP	540	77.78	42,001.20
WHIRLPOOL CORP	53	152.01	8,056.53
ARAMARK	514	37.50	19,275.00
CARNIVAL CORP(US)	553	65.06	35,978.18
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	53	338.46	17,938.38
DARDEN RESTAURANTS INC	259	89.76	23,247.84
DOMINO'S PIZZA INC	32	240.69	7,702.08
H&R BLOCK INC	425	26.33	11,190.25
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	96	81.98	7,870.08
LAS VEGAS SANDS CORP	629	73.84	46,445.36
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	436	137.62	60,002.32
MCDONALD'S CORP	1,206	159.53	192,393.18
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LTD-ADR	436	31.37	13,677.32
MGM RESORTS INTERNATIONAL	480	35.56	17,068.80
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	352	54.96	19,345.92
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	306	117.98	36,101.88
STARBUCKS CORP	2,299	59.22	136,146.78
VAIL RESORTS INC	82	231.62	18,992.84
WYNDHAM WORLDWIDE CORPORATION	215	114.10	24,531.50
WYNN RESORTS LTD	180	191.65	34,497.00
YUM! BRANDS INC	589	86.44	50,913.16
CBS CORP-CLASS B	308	50.95	15,692.60
CHARTER COMMUNICATIONS INC-CL A	292	315.55	92,140.60
COMCAST CORP-CL A	7,125	33.48	238,545.00
DISCOVERY INC-A	348	23.38	8,136.24
DISCOVERY INC-C	682	21.63	14,751.66
DISH NETWORK CORPORATION-A	486	38.52	18,720.72
INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC	878	24.65	21,642.70
LIBERTY BROADBAND-C	237	83.76	19,851.12
LIBERTY GLOBAL PLC-A	540	32.22	17,398.80
LIBERTY GLOBAL PLC-C	224	30.87	6,914.88
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	211	41.64	8,786.04
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	366	41.47	15,178.02

NEWS CORPRATION-CLASS A	845	16.19	13,680.55
OMNICOM GROUP	86	75.03	6,452.58
SIRIUS XM HOLDINGS INC	3,387	6.34	21,473.58
THE WALT DISNEY CO.	2,308	100.89	232,854.12
TIME WARNER INC	1,277	96.58	123,332.66
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS A	1,872	37.20	69,638.40
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS B	47	36.68	1,723.96
VIACOM INC-CLASS B	713	30.76	21,931.88
ADVANCE AUTO PARTS INC	163	105.18	17,144.34
AMAZON.COM INC	627	1,556.91	976,182.57
AUTONATION INC	156	46.45	7,246.20
AUTOZONE INC	12	603.82	7,245.84
BEST BUY CO INC	351	73.34	25,742.34
BOOKING HOLDINGS INC	72	2,158.95	155,444.40
CARMAX INC	384	62.57	24,026.88
DOLLAR GENERAL CORPORATION	435	99.00	43,065.00
DOLLAR TREE INC	376	98.90	37,186.40
EXPEDIA GROUP INC	265	111.37	29,513.05
GAP INC/THE	529	29.55	15,631.95
GENUINE PARTS CO	111	88.14	9,783.54
HOME DEPOT INC	1,774	177.08	314,139.92
KOHL'S CORP	397	60.12	23,867.64
L BRANDS INC	521	35.95	18,729.95
LKQ CORPORATION	82	38.63	3,167.66
LOWE'S COS INC	1,354	84.88	114,927.52
MACY'S INC	676	29.41	19,881.16
NETFLIX INC	710	332.70	236,217.00
NORDSTROM INC	288	46.72	13,455.36
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	79	222.95	17,613.05
QURATE RETAIL GROUP INC QVC GROUP-A	920	25.41	23,377.20
ROSS STORES INC	622	78.75	48,982.50
TARGET CORP	687	70.98	48,763.26
TIFFANY & CO	275	98.03	26,958.25
TJX COMPANIES INC	1,059	82.64	87,515.76
TRACTOR SUPPLY COMPANY	290	59.88	17,365.20
TRIPADVISOR INC	274	41.64	11,409.36
ULTA BEAUTY INC	121	234.16	28,333.36
COSTCO WHOLESALE CORP	722	195.07	140,840.54
CVS HEALTH CORPORATION	1,617	65.86	106,495.62
KROGER CO	936	24.18	22,632.48
SYSCO CORP	905	61.58	55,729.90
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,171	65.28	76,442.88

WALMART INC	2,294	87.89	201,619.66
ALTRIA GROUP INC	2,873	57.78	166,001.94
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	902	45.79	41,302.58
BROWN-FORMAN CORPORATION-CLASS B	526	55.46	29,171.96
BUNGE LIMITED	286	75.70	21,650.20
CAMPBELL SOUP COMPANY	378	41.27	15,600.06
COCA-COLA CO/THE	6,457	44.31	286,109.67
CONAGRA BRANDS INC	189	36.66	6,928.74
CONSTELLATION BRANDS INC-A	305	229.62	70,034.10
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC(US)	142	120.44	17,102.48
GENERAL MILLS INC	710	44.03	31,261.30
HERSHEY CO/THE	149	93.56	13,940.44
HORMEL FOODS CORPORATION	644	35.40	22,797.60
INGREDION INCORPORATED	160	129.47	20,715.20
KELLOGG COMPANY	126	62.20	7,837.20
KRAFT HEINZ CO/THE	966	59.73	57,699.18
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	233	106.45	24,802.85
MOLSON COORS BREWING CO-B	66	73.06	4,821.96
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	2,102	41.01	86,203.02
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	631	57.31	36,162.61
PEPSICO INC	2,159	105.57	227,925.63
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	2,329	85.64	199,455.56
THE JM SMUCKER COMPANY	187	117.04	21,886.48
TYSON FOODS INC-CL A	589	70.38	41,453.82
CHURCH & DWIGHT CO INC	169	48.72	8,233.68
CLOROX COMPANY	137	119.16	16,324.92
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,332	69.77	92,933.64
COTY INC-CL A	1,073	17.17	18,423.41
ESTEE LAUDER COMPANIES INC-CL A	355	151.83	53,899.65
KIMBERLY-CLARK CORP	563	103.34	58,180.42
PROCTER & GAMBLE CO	3,840	74.95	287,808.00
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	59	99.28	5,857.52
ABBOTT LABORATORIES	2,857	59.88	171,077.16
AETNA INC	527	176.43	92,978.61
ALIGN TECHNOLOGY INC	98	252.78	24,772.44
AMERISOURCEBERGEN CORP	334	91.69	30,624.46
ANTHEM INC	421	227.67	95,849.07
BAXTER INTERNATIONAL INC.	871	66.98	58,339.58
BECTON DICKINSON & CO	366	235.24	86,097.84
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,755	28.89	50,701.95
CARDINAL HEALTH INC	179	62.31	11,153.49
CENTENE CORPORATION	366	111.37	40,761.42

CERNER CORPORATION	354	58.92	20,857.68
CIGNA CORP	421	171.73	72,298.33
DANAHER CORP	1,028	101.50	104,342.00
DAVITA INC	320	64.12	20,518.40
DENTSPLY SIRONA INC	149	49.74	7,411.26
EDWARDS LIFESCIENCES CORPORATION	333	138.56	46,140.48
ENVISION HEALTHCARE CORPORATION	260	37.98	9,874.80
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	768	73.76	56,647.68
HCA HEALTHCARE INC	466	98.41	45,859.06
HENRY SCHEIN INC	326	69.75	22,738.50
HOLOGIC INC	554	38.61	21,389.94
HUMANA INC	194	295.00	57,230.00
IDEXX LABORATORIES INC	181	197.82	35,805.42
INTUITIVE SURGICAL INC	182	462.71	84,213.22
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	75	168.26	12,619.50
MCKESSON CORP	375	147.10	55,162.50
MEDTRONIC PLC	1,984	80.00	158,720.00
QUEST DIAGNOSTICS	46	101.49	4,668.54
RESMED INC	133	100.37	13,349.21
STRYKER CORP	534	163.55	87,335.70
TELEFLEX INC	97	269.64	26,155.08
THE COOPER COS INC	108	225.22	24,323.76
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,531	235.76	360,948.56
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	198	121.51	24,058.98
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	207	126.79	26,245.53
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	219	74.57	16,330.83
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	214	110.74	23,698.36
ABBVIE INC	2,410	93.01	224,154.10
AGILENT TECHNOLOGIES INC	322	67.97	21,886.34
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	400	111.74	44,696.00
ALKERMES PLC	336	46.15	15,506.40
ALLERGAN PLC	553	158.59	87,700.27
AMGEN INC	1,068	172.93	184,689.24
BIOGEN INC	339	266.02	90,180.78
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	122	83.62	10,201.64
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,422	51.61	124,999.42
CELGENE CORP	1,286	89.62	115,251.32
ELI LILLY & CO	1,635	79.75	130,391.25
GILEAD SCIENCES INC	1,884	74.44	140,244.96
ILLUMINA INC	260	245.84	63,918.40
INCYTE CORP	350	69.05	24,167.50
IQIVA HOLDINGS INC	291	98.07	28,538.37

JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	133	158.72	21,109.76
JOHNSON & JOHNSON	4,079	127.55	520,276.45
MERCK & CO. INC.	4,059	58.64	238,019.76
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	24	577.37	13,856.88
MYLAN NV	570	40.81	23,261.70
PERRIGO CO PLC	265	82.73	21,923.45
PFIZER INC	9,473	36.53	346,048.69
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	139	315.83	43,900.37
SEATTLE GENETICS INC	219	49.57	10,855.83
TESARO INC	77	52.21	4,020.17
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	1,874	17.71	33,188.54
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	644	216.99	139,741.56
UNITED THERAPEUTICS CORPORATION	94	112.99	10,621.06
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	354	159.55	56,480.70
WATERS CORP	70	207.39	14,517.30
ZOETIS INC	638	85.41	54,491.58
BANK OF AMERICA CORPORATION	15,140	30.18	456,925.20
BB&T CORPORATION	1,112	52.36	58,224.32
CIT GROUP INC	297	52.99	15,738.03
CITIGROUP INC	3,974	70.28	279,292.72
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	589	41.86	24,655.54
COMERICA INC	198	95.04	18,817.92
EAST WEST BANCORP INC	296	65.07	19,260.72
FIFTH THIRD BANCORP	602	31.36	18,878.72
FIRST REPUBLIC BANK/CA	331	92.47	30,607.57
HUNTINGTON BANCSHARES INC	459	14.68	6,738.12
JPMORGAN CHASE & CO	5,432	111.72	606,863.04
KEYCORP	1,329	19.55	25,981.95
M & T BANK CORP	167	180.24	30,100.08
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	1,078	12.59	13,572.02
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	689	18.07	12,450.23
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	768	144.26	110,791.68
REGIONS FINANCIAL CORP	1,490	18.15	27,043.50
SIGNATURE BANK	119	130.93	15,580.67
SUNTRUST BANKS INC	860	67.03	57,645.80
SVB FINANCIAL GROUP	107	249.14	26,657.98
US BANCORP	2,775	50.70	140,692.50
WELLS FARGO & COMPANY	7,228	51.54	372,531.12
ZIONS BANCORPORATION	415	53.21	22,082.15
ALLY FINANCIAL INC	939	27.62	25,935.18
AMERICAN EXPRESS CO	1,251	102.37	128,064.87
AMERIPRISE FINANCIAL INC	242	145.58	35,230.36

BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	1,712	55.24	94,570.88
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,913	200.38	383,326.94
BLACKROCK INC	200	525.06	105,012.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	767	98.35	75,434.45
CBOE GLOBAL MARKETS INC	207	109.88	22,745.16
CME GROUP INC	539	164.47	88,649.33
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	626	73.29	45,879.54
E*TRADE FINANCIAL CORP	270	58.83	15,884.10
EATON VANCE CORPORATION	260	55.44	14,414.40
FRANKLIN RESOURCES INC	237	34.17	8,098.29
GOLDMAN SACHS GROUP INC	583	254.17	148,181.11
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	940	74.62	70,142.80
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	717	24.11	17,286.87
MOODY'S CORP	273	165.72	45,241.56
MORGAN STANLEY	2,202	54.70	120,449.40
MSCI INC	198	150.00	29,700.00
NASDAQ INC	247	86.94	21,474.18
NORTHERN TRUST CORP	346	108.15	37,419.90
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	283	88.01	24,906.83
S&P GLOBAL INC	409	193.94	79,321.46
SEI INVESTMENTS COMPANY	297	70.88	21,051.36
STATE STREET CORP	490	104.18	51,048.20
SYNCHRONY FINANCIAL	1,287	35.35	45,495.45
T ROWE PRICE GROUP INC	429	108.83	46,688.07
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	241	60.61	14,607.01
THE CHARLES SCHWAB CORPORATION	1,981	53.68	106,340.08
VOYA FINANCIAL INC	431	52.99	22,838.69
AFLAC INC	1,412	45.23	63,864.76
ALLEGHANY CORPORATION	3	590.19	1,770.57
ALLSTATE CORP	449	97.98	43,993.02
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	153	113.71	17,397.63
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,464	55.18	80,783.52
AON PLC	326	144.82	47,211.32
ARCH CAPITAL GROUP LTD	252	80.58	20,306.16
ARTHUR J GALLAGHER & CO	394	70.10	27,619.40
ASSURANT INC	126	92.60	11,667.60
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	156	49.35	7,698.60
AXIS CAPITAL HOLDINGS LIMITED	196	55.73	10,923.08
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	173	51.96	8,989.08
CHUBB LIMITED	769	137.62	105,829.78
CINCINNATI FINANCIAL CORPORATION	93	75.04	6,978.72
EVEREST RE GROUP LTD	90	242.35	21,811.50

FNF GROUP	541	37.84	20,471.44
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	392	52.03	20,395.76
LINCOLN NATIONAL CORP	319	71.62	22,846.78
LOEWS CORPORATION	231	51.52	11,901.12
MARKEL CORPORATION	12	1,155.17	13,862.04
MARSH & MCLENNAN COS	818	83.35	68,180.30
METLIFE INC	1,238	47.44	58,730.72
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	457	61.00	27,877.00
PROGRESSIVE CORP	1,034	61.13	63,208.42
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	681	107.07	72,914.67
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	142	152.77	21,693.34
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	94	136.73	12,852.62
TORCHMARK CORPORATION	55	87.22	4,797.10
TRAVELERS COS INC/THE	497	136.59	67,885.23
UNUM GROUP	471	48.73	22,951.83
WILLIS TOWERS WATSON PLC	147	152.69	22,445.43
WR BERKLEY CORP	215	74.16	15,944.40
XL GROUP LIMITED	544	55.61	30,251.84
CBRE GROUP INC	542	47.55	25,772.10
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	2,643	7.07	18,686.01
JONES LANG LASALLE INCORPORATED	104	175.97	18,300.88
ACCENTURE PLC	1,021	154.59	157,836.39
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,136	67.68	76,884.48
ADOBE SYSTEMS INC	722	227.62	164,341.64
AKAMAI TECHNOLOGIES	383	72.46	27,752.18
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	103	211.66	21,800.98
ALPHABET INC-CL A	449	1,089.45	489,163.05
ALPHABET INC-CL C	482	1,087.70	524,271.40
ANSYS INC	175	165.48	28,959.00
AUTODESK INC	315	132.33	41,683.95
AUTOMATIC DATA PROCESSING	737	117.75	86,781.75
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	263	110.96	29,182.48
CA INC	140	34.84	4,877.60
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	572	37.38	21,381.36
CDK GLOBAL INC	281	65.31	18,352.11
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	105	103.10	10,825.50
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP-A	970	82.37	79,898.90
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	444	73.90	32,811.60
DXC TECHNOLOGY CO	466	104.06	48,491.96
EBAY INC	1,632	42.11	68,723.52
ELECTRONIC ARTS INC	418	123.11	51,459.98
FACEBOOK INC-A	3,612	168.10	607,177.20

FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	588	97.06	57,071.28
FIRST DATA CORP- CLASS A	711	15.22	10,821.42
FISERV INC	756	71.75	54,243.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	102	209.69	21,388.38
FORTINET INC	325	57.41	18,658.25
GARTNER INC	194	118.88	23,062.72
GLOBAL PAYMENTS INC	138	112.34	15,502.92
INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION	1,316	147.70	194,373.20
INTUIT INC	433	179.41	77,684.53
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	159	122.28	19,442.52
LEIDOS HOLDINGS INC	293	66.78	19,566.54
MASTERCARD INCORPORATED	1,426	179.01	255,268.26
MERCADOLIBRE INC	88	330.00	29,040.00
MICROSOFT CORP	11,183	96.11	1,074,798.13
ORACLE CORPORATION	4,629	46.82	216,729.78
PAYCHEX INC	331	60.93	20,167.83
PAYPAL HOLDINGS INC	1,879	79.68	149,718.72
RED HAT INC	293	160.14	46,921.02
SABRE CORPORATION	465	20.59	9,574.35
SALESFORCE COM INC	1,074	124.06	133,240.44
SERVICENOW INC	270	172.99	46,707.30
SPLUNK INC	298	105.91	31,561.18
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	356	50.62	18,020.72
SYMANTEC CORPORATION	1,270	27.85	35,369.50
SYNOPSYS INC	309	84.14	25,999.26
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	194	100.77	19,549.38
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	141	88.02	12,410.82
TWITTER INC	1,265	31.54	39,898.10
VISA INC-CLASS A SHARES	2,881	123.96	357,128.76
VMWARE INC-CLASS A	142	135.59	19,253.78
WORKDAY INC-CLASS A	270	131.97	35,631.90
WORLDPAY INC-CLASS A	325	82.67	26,867.75
ZILLOW GROUP INC-C	254	46.96	11,927.84
AMPHENOL CORPORATION-CL A	503	86.20	43,358.60
APPLE INC	7,869	172.80	1,359,763.20
ARISTA NETWORKS INC	95	256.37	24,355.15
ARROW ELECTRONICS INC	201	78.35	15,748.35
AVNET INC	282	41.91	11,818.62
CDW CORPORATION	320	72.53	23,209.60
CISCO SYSTEMS INC	7,492	44.56	333,843.52
COMMSCOPE HOLDING COMPANY INC	400	40.68	16,272.00
CORNING INC	1,637	27.62	45,213.94

F5 NETWORKS INC	145	157.76	22,875.20
FLEX LTD	1,195	17.17	20,518.15
FLIR SYSTEMS INC	301	52.71	15,865.71
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE COMPANY	2,613	17.41	45,492.33
HP INC	2,995	21.66	64,871.70
JUNIPER NETWORKS INC	757	24.44	18,501.08
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1	110.71	110.71
NETAPP INC	565	69.01	38,990.65
PALO ALTO NETWORKS INC	111	192.02	21,314.22
SEAGATE TECHNOLOGY	606	59.90	36,299.40
TE CONNECTIVITY LIMITED	397	101.05	40,116.85
TRIMBLE INC	554	36.76	20,365.04
WESTERN DIGITAL CORPORATION	462	89.51	41,353.62
XEROX CORPORATION	476	30.33	14,437.08
AT&T INC	9,759	34.82	339,808.38
CENTURYLINK INC	1,073	17.32	18,584.36
SPRINT CORPORATION	1,762	5.96	10,501.52
T-MOBILE US INC	335	63.25	21,188.75
VERIZON COMMUNICATIONS INC	6,475	48.43	313,584.25
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	350	36.80	12,880.00
AES CORP	1,458	11.75	17,131.50
ALLIANT ENERGY CORP	503	41.53	20,889.59
AMEREN CORPORATION	520	56.85	29,562.00
AMERICAN ELECTRIC POWER COMPANY INC	875	68.52	59,955.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	145	83.66	12,130.70
ATMOS ENERGY CORPORATION	230	84.23	19,372.90
CENTERPOINT ENERGY INC	840	26.98	22,663.20
CMS ENERGY CORPORATION	575	45.37	26,087.75
CONSOLIDATED EDISON INC	485	78.11	37,883.35
DOMINION ENERGY INC	998	66.06	65,927.88
DTE ENERGY COMPANY	156	103.74	16,183.44
DUKE ENERGY CORPORATION	1,111	78.52	87,235.72
EDISON INTERNATIONAL	517	64.62	33,408.54
ENERGY CORP	94	80.02	7,521.88
EVERSOURCE ENERGY	285	59.86	17,060.10
EXELON CORP	1,648	38.96	64,206.08
FIRSTENERGY CORP	421	34.87	14,680.27
NEXTERA ENERGY INC	771	162.54	125,318.34
NISOURCE INC	714	24.00	17,136.00
OGE ENERGY CORPORATION	442	32.76	14,479.92
P G & E CORPORATION	909	46.50	42,268.50
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	246	78.69	19,357.74

	PPL CORPORATION	1,084	28.28	30,655.52	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	803	50.03	40,174.09	
	SCANA CORPORATION	300	35.99	10,797.00	
	SEMPRA ENERGY	424	110.37	46,796.88	
	SOUTHERN CO	1,637	45.60	74,647.20	
	UGI CORPORATION	383	45.78	17,533.74	
	WEC ENERGY GROUP INC	317	62.54	19,825.18	
	WESTAR ENERGY INC	314	52.13	16,368.82	
	XCEL ENERGY INC	806	45.39	36,584.34	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	1,743	10.11	17,621.73	
	ANALOG DEVICES INC	604	89.85	54,269.40	
	APPLIED MATERIALS INC	1,769	51.19	90,555.11	
	BROADCOM INC	661	242.86	160,530.46	
	INTEL CORP	7,097	52.22	370,605.34	
	KLA-TENCOR CORPORATION	135	102.29	13,809.15	
	LAM RESEARCH CORP	287	190.39	54,641.93	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	834	21.04	17,547.36	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC	463	56.15	25,997.45	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	189	85.14	16,091.46	
	MICRON TECHNOLOGY INC	1,870	51.42	96,155.40	
	NVIDIA CORP	980	229.04	224,459.20	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	441	107.17	47,261.97	
	QORVO INC	260	70.63	18,363.80	
	QUALCOMM INC	2,432	52.57	127,850.24	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	188	93.88	17,649.44	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	1,428	101.29	144,642.12	
	XILINX INC	222	64.90	14,407.80	
	米ドル 建小計	474,017		36,244,199.74 (3,895,526,588)	
カナダドル	ALTAGAS LIMITED	279	25.41	7,089.39	
	ARC RESOURCES LIMITED	819	14.51	11,883.69	
	CAMECO CORP (CA)	772	13.42	10,360.24	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,245	45.61	56,784.45	
	CENOVUS ENERGY INC	2,196	12.70	27,889.20	
	CRESCENT POINT ENERGY CORPORATION	1,193	10.73	12,800.89	
	ENBRIDGE INC	2,685	40.49	108,715.65	
	ENCANA CORP	2,096	16.07	33,682.72	
	HUSKY ENERGY INC	825	19.52	16,104.00	
	IMPERIAL OIL LTD	597	37.61	22,453.17	
	INTER PIPELINE LIMITED	790	23.92	18,896.80	
	KEYERA CORP	410	35.86	14,702.60	
	PEMBINA PIPELINE CORPORATION	767	41.53	31,853.51	

PRAIRIESKY ROYALTY LTD	351	30.52	10,712.52
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	500	17.60	8,800.00
SUNCOR ENERGY INC	2,727	48.57	132,450.39
TOURMALINE OIL CORPORATION	500	23.73	11,865.00
TRANSCANADA CORPORATION	1,462	55.24	80,760.88
VERMILION ENERGY INC	154	46.00	7,084.00
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	431	56.23	24,235.13
BARRICK GOLD CORP	763	16.89	12,887.07
CCL INDUSTRIES INC - CL B	300	62.59	18,777.00
FRANCO-NEVADA CORPORATION	321	90.71	29,117.91
GOLDCORP INC	22	18.24	401.28
KINROSS GOLD CORP	2,930	4.88	14,298.40
METHANEX CORPORATION	234	85.41	19,985.94
NUTRIEN LTD	557	60.26	33,564.82
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	1,197	33.73	40,374.81
TURQUOISE HILL RESOURCES LIMITED	2,200	3.86	8,492.00
WEST FRASER TIMBER CO LIMITED	100	92.19	9,219.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	909	27.46	24,961.14
CAE INC	604	24.62	14,870.48
FINNING INTERNATIONAL INC	337	31.67	10,672.79
SNC-LAVALIN GROUP INC	341	56.03	19,106.23
CANADIAN NATL RAILWAY CO	928	96.48	89,533.44
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	241	223.48	53,858.68
LINAMAR CORPORATION	100	72.25	7,225.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	542	37.04	20,075.68
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	400	69.38	27,752.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	891	26.29	23,424.39
CANADIAN TIRE CORP -CL A	126	167.85	21,149.10
DOLLARAMA INC	200	147.53	29,506.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	442	52.76	23,319.92
EMPIRE COMPANY LIMITED A	450	23.78	10,701.00
GEORGE WESTON LIMITED	100	104.47	10,447.00
JEAN COUTU GROUP INC A	200	24.60	4,920.00
LOBLAW COMPANIES LTD	413	65.32	26,977.16
METRO INC	513	42.28	21,689.64
SAPUTO INC	400	41.03	16,412.00
BANK OF MONTREAL	1,007	95.01	95,675.07
BANK OF NOVA SCOTIA	1,893	76.39	144,606.27
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	550	110.50	60,775.00
NATIONAL BANK OF CANADA	619	59.22	36,657.18
ROYAL BANK OF CANADA	2,179	96.63	210,556.77
TORONTO-DOMINION BANK(CA)	2,962	69.50	205,859.00

	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	1,465	49.14	71,990.10
	CI FINANCIAL CORPORATION	483	26.84	12,963.72
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	800	5.20	4,160.00
	IGM FINANCIAL INC	193	37.27	7,193.11
	ONEX CORPORATION	100	92.03	9,203.00
	THOMSON REUTERS CORP(CA)	4	50.39	201.56
	GREAT-WEST LIFECO INC	600	33.35	20,010.00
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL	242	52.05	12,596.10
	INTACT FINANCIAL CORPORATION	200	96.60	19,320.00
	MANULIFE FINANCIAL CORP	3,460	23.77	82,244.20
	POWER CORP OF CANADA	729	29.48	21,490.92
	POWER FINANCIAL CORP	473	32.47	15,358.31
	SUN LIFE FINANCIAL INC	1,150	51.58	59,317.00
	FIRST CAPITAL REALTY INC	300	20.23	6,069.00
	BLACKBERRY LIMITED	1,100	13.44	14,784.00
	CGI GROUP INC -CL A	377	73.32	27,641.64
	OPEN TEXT CORPORATION	478	44.83	21,428.74
	SHOPIFY INC - CLASS A	100	160.27	16,027.00
	BCE INC	336	53.08	17,834.88
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	683	57.95	39,579.85
	TELUS CORPORATION	44	44.75	1,969.00
	ATCO LIMITED	194	41.39	8,029.66
	CANADIAN UTILITIES LTD A	328	35.00	11,480.00
	EMERA INC	100	40.57	4,057.00
	FORTIS INC	800	42.53	34,024.00
	HYDRO ONE LIMITED	600	20.79	12,474.00
	カナダドル 建小計	62,109		2,598,420.19 (220,398,000)
ユーロ	ENAGAS SA	502	23.07	11,581.14
	ENI SPA	4,038	16.00	64,608.00
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,109	16.11	17,865.99
	KONINKLIJKE VOPAK NV	161	41.34	6,655.74
	NESTE OYJ	284	55.38	15,727.92
	OMV AG	326	50.34	16,410.84
	SNAM SPA	4,670	3.82	17,853.41
	TENARIS SA	1,045	15.24	15,931.02
	TOTAL SA	3,851	50.30	193,705.30
	AIR LIQUIDE SA	705	103.65	73,073.25
	AKZO NOBEL	400	78.26	31,304.00
	ARCELORMITTAL	525	28.20	14,807.62
	ARKEMA	150	109.95	16,492.50
	BASF SE	1,512	86.07	130,137.84

COVESTRO AG	195	81.84	15,958.80
CRH PLC(IE)	1,488	27.97	41,619.36
EVONIK INDUSTRIES AG	361	29.91	10,797.51
FUCHS PETROLUB SE-PREF	159	43.96	6,989.64
IMERYS SA	82	80.25	6,580.50
K+S AG	439	23.42	10,281.38
KONINKLIJKE DSM NV	372	86.64	32,230.08
LANXESS AG	202	62.00	12,524.00
LINDE AG - TENDER	329	175.80	57,838.20
STORA ENSO OYJ-R SHS(FI)	1,219	16.59	20,229.30
THYSSENKRUPP AG	814	22.79	18,551.06
UMICORE	408	43.65	17,809.20
UPM-KYMMENE OYJ	572	30.15	17,245.80
VOESTALPINE AG	261	44.90	11,718.90
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS	506	34.23	17,320.38
AIRBUS SE	956	94.24	90,093.44
ALSTOM	339	37.68	12,773.52
ANDRITZ AG	167	46.22	7,718.74
BOSKALIS WESTMINSTER NV	209	24.00	5,016.00
BOUYGUES SA	461	42.86	19,758.46
BRENTAG AG	28	48.42	1,355.76
CNH INDUSTRIAL NV	2,096	10.35	21,704.08
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	889	43.67	38,827.07
DASSAULT AVIATION SA	5	1,640.00	8,200.00
EIFFAGE SA	151	96.36	14,550.36
FERROVIAL SA	993	17.60	17,481.76
GEA GROUP AG	405	34.54	13,988.70
HOCHTIEF AG	43	149.00	6,407.00
KION GROUP AG	126	77.04	9,707.04
KONE OYJ-B	354	40.58	14,365.32
LEGRAND SA	422	64.84	27,362.48
LEONARDO SPA	895	9.91	8,874.82
MAN SE	81	96.20	7,792.20
METSO OYJ	259	27.16	7,034.44
OSRAM LICHT AG	172	57.86	9,951.92
PRYSMIAN SPA	432	24.74	10,687.68
REXEL SA	670	14.04	9,406.80
SAFRAN SA	557	90.18	50,230.26
SCHNEIDER ELECTRIC SE	893	74.18	66,242.74
SIEMENS AG-REG	1,091	107.62	117,413.42
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	489	13.56	6,633.28
THALES SA	25	103.00	2,575.00

VINCI SA	799	83.74	66,908.26
WARTSILA OYJ-B SHARES	111	18.68	2,073.48
BUREAU VERITAS SA	569	21.44	12,199.36
EDENRED	483	28.92	13,968.36
RANDSTAD NV	263	56.22	14,785.86
RELX NV	1,201	17.46	20,975.46
SOCIETE BIC SA	66	80.90	5,339.40
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	1,424	18.29	26,052.08
AENA SME SA	139	166.90	23,199.10
AEROPORTS DE PARIS(ADP)	68	182.70	12,423.60
ATLANTIA SPA	913	27.00	24,651.00
BOLLORE	2,000	4.50	9,000.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	538	26.61	14,316.18
DEUTSCHE POST AG-REG	1,171	37.69	44,134.99
FRAPORT AG	95	80.98	7,693.10
GETLINK	1,034	11.56	11,953.04
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	1,306	7.04	9,202.07
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	589	90.88	53,528.32
BMW-PFD	126	79.55	10,023.30
CONTINENTAL AG	181	222.20	40,218.20
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	1,585	65.20	103,342.00
FERRARI NV	116	100.10	11,611.60
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	1,300	19.42	25,248.60
MICHELIN (CGDE)-B	272	118.30	32,177.60
NOKIAN RENKAAT OYJ	265	33.33	8,832.45
PEUGEOT SA	1,075	20.57	22,112.75
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING-PFD	339	72.18	24,469.02
RENAULT SA	364	94.50	34,398.00
SCHAEFFLER AG	367	13.30	4,881.10
VOLKSWAGEN AG	74	171.10	12,661.40
VOLKSWAGEN AG-PFD	330	173.28	57,182.40
ADIDAS AG	299	210.50	62,939.50
HERMES INTERNATIONAL	43	516.00	22,188.00
HUGO BOSS AG-ORD	153	76.60	11,719.80
KERING	96	429.00	41,184.00
LUXOTTICA GROUP SPA	62	52.14	3,232.68
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	396	277.20	109,771.20
SEB SA	50	161.50	8,075.00
ACCOR SA	378	45.00	17,010.00
PADDY POWER BETFAIR PLC	176	84.80	14,924.80
SODEXO	22	80.78	1,777.16
ALTICE SA-A	818	8.15	6,668.33

AXEL SPRINGER SE	99	67.70	6,702.30
EUTELSAT COMMUNICATIONS	400	18.20	7,282.00
JC DECAUX SA	170	29.58	5,028.60
LAGARDERE S.C.A.	271	23.54	6,379.34
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	515	29.62	15,254.30
PUBLICIS GROUPE	412	60.28	24,835.36
RTL GROUP SA	89	70.95	6,314.55
SES	806	12.94	10,429.64
TELENET GROUP HOLDING NV	121	52.70	6,376.70
VIVENDI	1,635	21.61	35,332.35
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	1,731	24.62	42,617.22
ZALANDO SE	198	42.92	8,498.16
CARREFOUR SA	462	16.41	7,581.42
CASINO GUICHARD PERRACHON SA	127	42.28	5,369.56
COLRUYT SA	154	45.54	7,013.16
JERONIMO MARTINS SGPS SA	577	14.19	8,187.63
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	2,034	19.44	39,553.16
METRO AG	394	14.60	5,752.40
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,046	85.20	89,119.20
DANONE	937	66.46	62,273.02
HEINEKEN HOLDING NV	223	85.25	19,010.75
HEINEKEN NV	473	88.54	41,879.42
KERRY GROUP PLC-A	153	86.80	13,280.40
PERNOD-RICARD SA	378	138.70	52,428.60
REMY COINTREAU SA	51	114.00	5,814.00
BEIERSDORF AG	223	92.44	20,614.12
HENKEL AG & CO KGAA	213	97.75	20,820.75
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	283	104.90	29,686.70
L'OREAL	414	190.10	78,701.40
UNILEVER NV-CVA	2,245	45.34	101,799.52
ESSILOR INTERNATIONAL SA	329	113.35	37,292.15
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	351	85.04	29,849.04
FRESENIUS SE & CO KGAA	739	65.96	48,744.44
KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,654	32.96	54,515.84
BAYER AG	1,200	99.60	119,520.00
EUROFINS SCIENTIFIC SE	24	434.40	10,425.60
GRIFOLS SA	660	23.38	15,430.80
IPSEN SA	77	128.00	9,856.00
MERCK KGAA	64	82.00	5,248.00
ORION OYJ-CLASS B	221	25.95	5,734.95
QIAGEN NV	485	26.60	12,901.00
RECORDATI SPA	215	29.98	6,445.70

SANOFI	1,603	65.60	105,156.80
UCB SA	280	65.62	18,373.60
ABN AMRO GROUP NV-CVA	624	25.19	15,718.56
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	10,978	6.51	71,554.60
BANCO DE SABADELL SA	4,349	1.72	7,519.42
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,632	0.00	0.00
BANCO SANTANDER SA	25,641	5.50	141,153.70
BANK OF IRELAND GROUP PLC	2,028	7.41	15,037.62
BANKIA SA	2,068	3.66	7,587.49
BANKINTER SA	1,491	8.69	12,956.79
BNP PARIBAS	1,848	62.59	115,666.32
CAIXABANK	3,872	4.01	15,561.56
COMMERZBANK AG	1,326	10.84	14,376.49
CREDIT AGRICOLE SA	1,242	13.50	16,767.00
ERSTE GROUP BANK AG	264	40.75	10,758.00
ING GROEP NV-CVA	6,396	14.19	90,759.24
INTESA SANPAOLO	17,850	3.11	55,540.27
INTESA SANPAOLO-RSP	2,139	3.24	6,945.33
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION LI(IE)	9,000	0.00	0.00
KBC GROEP NV	446	73.20	32,647.20
MEDIOBANCA SPA	1,301	10.13	13,179.13
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	269	28.50	7,666.50
SOCIETE GENERALE	1,218	45.26	55,132.77
UNICREDIT SPA	3,564	17.86	63,681.55
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	2,921	11.68	34,134.80
DEUTSCHE BOERSE AG	237	111.70	26,472.90
EURAZEO	95	74.20	7,049.00
EXOR NV	240	61.02	14,644.80
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	178	94.20	16,767.60
NATIXIS SA	2,082	6.66	13,866.12
WENDEL	62	124.60	7,725.20
AEGON NV	3,901	5.97	23,288.97
AGEAS	36	43.73	1,574.28
ALLIANZ SE-REG	642	192.66	123,687.72
ASSICURAZIONI GENERALI	1,691	16.54	27,977.59
AXA	3,196	23.45	74,962.18
CNP ASSURANCES	394	21.24	8,368.56
HANNOVER RUECK SE	133	116.70	15,521.10
MAPFRE SA	2,472	2.80	6,921.60
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	191	194.85	37,216.35
NN GROUP NV	619	38.52	23,843.88
POSTE ITALIANE SPA	1,156	7.75	8,968.24

	SAMPO OYJ-A SHS	710	46.66	33,128.60
	SCOR SE	361	35.25	12,725.25
	UNIPOLSAI SPA	2,504	2.11	5,303.47
	DEUTSCHE WOHNEN SE	227	38.13	8,655.51
	VONOVIA SE	748	40.45	30,256.60
	AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	781	62.02	48,437.62
	ATOS SE	197	110.05	21,679.85
	DASSAULT SYSTEMES SA	264	109.20	28,828.80
	SAP SE	1,618	87.71	141,914.78
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	272	53.68	14,600.96
	WIRECARD AG	189	110.40	20,865.60
	INGENICO GROUP	122	70.64	8,618.08
	NOKIA OYJ	10,385	4.74	49,307.98
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	5,197	13.95	72,524.13
	ELISA OYJ	315	35.56	11,201.40
	ILIAD SA	58	173.45	10,060.10
	KONINKLIJKE KPN NV	7,012	2.47	17,340.67
	ORANGE	2,214	14.51	32,125.14
	PROXIMUS	337	25.31	8,529.47
	TELECOM ITALIA-RSP	13,336	0.75	10,026.00
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,645	3.77	6,201.65
	TELEFONICA SA	7,197	8.18	58,914.64
	E.ON SE	3,917	9.03	35,394.01
	ELECTRICITE DE FRANCE	1,126	11.96	13,466.96
	ENDESA SA	703	18.60	13,079.31
	ENEL SPA	13,390	5.19	69,520.88
	ENGIE	2,148	14.09	30,265.32
	FORTUM OYJ	983	18.23	17,925.00
	GAS NATURAL SDG SA	775	20.32	15,748.00
	IBERDROLA SA	6,721	6.25	42,019.69
	INNOGY SE	307	37.90	11,635.30
	RWE AG	1,083	21.87	23,685.21
	SUEZ	726	11.87	8,621.25
	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	2,888	4.83	13,966.36
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	203	19.42	3,942.26
	ASML HOLDING NV	615	160.75	98,861.25
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,869	21.42	40,033.98
	STMICROELECTRONICS NV	1,410	17.83	25,140.30
	ユーロ 建小計	306,630		6,210,234.98 (823,973,977)
英債券	BP PLC	28,699	5.16	148,230.33
	JOHN WOOD GROUP PLC	1,202	5.57	6,695.14

ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	6,416	24.84	159,373.44
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	5,997	25.35	152,023.95
ANGLO AMERICAN PLC	2,118	17.83	37,772.41
ANTOFAGASTA PLC	904	9.62	8,698.28
BHP BILLITON PLC(UK)	2,607	15.20	39,642.04
CRODA INTERNATIONAL PLC	290	45.70	13,253.00
FRESNILLO PLC	507	13.01	6,598.60
GLENCORE PLC	20,144	3.78	76,144.32
JOHNSON MATTHEY PLC	428	32.63	13,965.64
MONDI PLC	812	20.06	16,288.72
RANDGOLD RESOURCES LIMITED	208	57.60	11,980.80
RIO TINTO PLC(UK)	2,032	39.52	80,304.64
ASHTREAD GROUP PLC	487	20.69	10,076.03
BAE SYSTEMS PLC	5,054	5.92	29,939.89
COBHAM PLC	5,128	1.16	5,948.48
DCC PUBLIC LIMITED COMPANY	196	68.80	13,484.80
FERGUSON PLC	282	55.58	15,673.56
IMI PLC	624	10.78	6,726.72
MEGGITT PLC	1,716	4.54	7,797.50
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,766	8.76	15,484.28
SMITHS GROUP PLC	875	15.72	13,755.00
THE WEIR GROUP PLC	482	22.50	10,845.00
TRAVIS PERKINS PLC	553	13.11	7,249.83
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	580	7.40	4,292.00
CAPITA PLC	1,476	1.51	2,230.97
EXPERIAN PLC	430	15.75	6,772.50
G4S PLC	3,433	2.60	8,936.09
INTERTEK GROUP PLC	357	49.06	17,514.42
RELX PLC	1,701	15.25	25,948.75
EASYJET PLC	372	16.08	5,981.76
ROYAL MAIL PLC	1,991	5.63	11,209.33
GKN PLC	3,793	4.77	18,115.36
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,227	5.53	12,315.31
BERKELEY GROUP HOLDINGS PLC	303	39.50	11,968.50
BURBERRY GROUP PLC	184	17.14	3,154.68
PERSIMMON PLC	682	27.02	18,427.64
TAYLOR WIMPEY PLC	7,223	1.93	13,976.50
CARNIVAL PLC(UK)	110	46.12	5,073.20
COMPASS GROUP PLC	1,807	14.90	26,924.30
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	1,573	3.50	5,516.51
TUI AG	904	16.08	14,540.84
WHITBREAD PLC	30	41.86	1,255.80

ITV PLC	8,015	1.45	11,645.79
PEARSON PLC	1,819	7.75	14,108.16
SKY PLC	2,212	13.19	29,176.28
WPP PLC	1,621	11.56	18,738.76
KINGFISHER PLC	1,322	3.05	4,034.74
MARKS & SPENCER GROUP PLC	3,595	2.80	10,087.57
NEXT PLC	309	52.26	16,148.34
SAINSBURY (J) PLC	3,629	2.64	9,602.33
TESCO PLC	10,467	2.39	25,089.39
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	4,908	2.33	11,435.64
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	764	26.44	20,200.16
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC(UK)	3,404	36.50	124,246.00
COCA-COLA HBC AG-CDI	402	25.02	10,058.04
DIAGEO PLC	4,145	24.64	102,132.80
IMPERIAL BRANDS PLC	1,522	23.55	35,843.10
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,099	57.86	63,588.14
UNILEVER PLC	1,689	38.61	65,212.29
CONVATEC GROUP PLC	2,403	2.14	5,142.42
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	845	6.74	5,700.37
SMITH & NEPHEW PLC	250	13.41	3,352.50
ASTRAZENECA PLC	2,084	49.55	103,272.62
GLAXOSMITHKLINE PLC	6,906	14.07	97,195.04
SHIRE PLC	1,441	39.75	57,279.75
BARCLAYS PLC	27,035	2.14	57,908.97
HSBC HOLDINGS PLC(UK)	31,826	6.90	219,822.18
LLOYDS BANKING GROUP PLC	113,905	0.66	75,279.81
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	7,280	2.72	19,816.16
STANDARD CHARTERED PLC(UK)	5,855	7.45	43,637.31
3I GROUP PLC	608	9.17	5,575.36
HARGREAVES LANSDOWN PLC	598	17.36	10,381.28
INVESTEC PLC	1,506	5.82	8,767.93
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	330	42.50	14,025.00
SCHRODERS PLC	255	32.57	8,305.35
ST JAMES'S PLACE PLC	1,167	11.07	12,918.69
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	360	3.67	1,321.20
ADMIRAL GROUP PLC	409	19.74	8,075.70
AVIVA PLC	7,235	5.25	37,998.22
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	3,042	3.68	11,221.93
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	10,597	2.73	28,982.79
OLD MUTUAL PLC	4,649	2.42	11,273.82
PRUDENTIAL PLC	4,104	18.54	76,088.16
RSA INSURANCE GROUP PLC	2,255	6.46	14,580.83

	AUTO TRADER GROUP PLC	2,260	3.42	7,745.02
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC(UK)	468	12.86	6,020.82
	SAGE GROUP PLC (THE)	2,389	6.30	15,050.70
	BT GROUP PLC	15,065	2.40	36,201.19
	VODAFONE GROUP PLC	43,833	2.06	90,580.89
	CENTRICA PLC	11,768	1.45	17,145.97
	NATIONAL GRID PLC	5,456	8.10	44,204.51
	SEVERN TRENT PLC	521	18.71	9,747.91
	SSE PLC	1,359	13.23	17,986.36
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,509	7.12	10,744.08
	英ポンド 建小計	491,198		2,886,805.23 (436,773,631)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	18	613.50	11,043.00
	GIVAUDAN-REG	8	2,199.00	17,592.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	810	55.08	44,614.80
	SIKA AG-BR	4	7,425.00	29,700.00
	ABB LIMITED-REG	2,332	23.60	55,035.20
	GEBERIT AG-REG	48	429.30	20,606.40
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	46	198.90	9,149.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	90	207.20	18,648.00
	SGS SA-REG	8	2,426.00	19,408.00
	KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL AG-REG	119	152.10	18,099.90
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	829	93.46	77,478.34
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	114	85.35	9,729.90
	THE SWATCH GROUP AG-B	63	460.40	29,005.20
	DUFREY AG	75	134.20	10,065.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	5	1,803.00	9,015.00
	LINDT&SPRUENGLI AG-PC	2	6,195.00	12,390.00
	NESTLE SA-REGISTERED	4,940	75.40	372,476.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	116	159.15	18,461.40
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	20	632.50	12,650.00
	LONZA GROUP AG-REG	118	245.30	28,945.40
	NOVARTIS AG-REG SHS	3,531	77.28	272,875.68
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,028	216.50	222,562.00
	VIFOR PHARMA AG	100	147.00	14,700.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	3,237	16.11	52,164.25
	PARGESA HOLDING SA-BR	80	91.10	7,288.00
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	38	719.50	27,341.00
	UBS GROUP AG	5,808	17.12	99,432.96
	BALOISE HOLDING AG-REG	111	154.60	17,160.60
	SWISS RE AG	357	97.06	34,650.42
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	240	312.80	75,072.00

	SWISS PRIME SITE AG-REG	158	92.65	14,638.70	
	SWISSCOM AG-REG	53	456.30	24,183.90	
	スイスフラン 建小計	24,506		1,686,182.45 (186,542,364)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	414	239.70	99,235.80	
	BOLIDEN AB	605	308.50	186,642.50	
	ALFA LAVAL AB	650	207.90	135,135.00	
	ASSA ABLOY AB-B	1,113	178.55	198,726.15	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	1,106	364.20	402,805.20	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	801	328.00	262,728.00	
	SANDVIK AB	1,099	161.20	177,158.80	
	SKANSKA AB-B SHS	752	160.40	120,620.80	
	SKF AB-B SHARES	774	183.05	141,680.70	
	VOLVO AB-B SHS	2,559	161.15	412,382.85	
	SECURITAS AB-B SHS	693	140.10	97,089.30	
	ELECTROLUX AB-SER B	532	256.00	136,192.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	955	82.18	78,481.90	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	1,507	136.42	205,584.94	
	ICA GRUPPEN AB	185	296.00	54,760.00	
	SWEDISH MATCH AB	418	373.80	156,248.40	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,249	223.90	279,651.10	
	GETINGE AB-B SHS	459	95.12	43,660.08	
	NORDEA BANK AB	3,492	88.60	309,391.20	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	2,181	85.34	186,126.54	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,604	100.00	160,400.00	
	SWEDBANK AB-A SHARES	1,020	185.20	188,904.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	377	187.10	70,536.70	
	INVESTOR AB-B SHS	377	375.80	141,676.60	
	KINNEVIK AB-B	518	312.30	161,771.40	
	L E LUNDBERGFÖRETAGEN AB-B SHS	84	591.00	49,644.00	
ERICSSON LM-B SHS	3,262	55.56	181,236.72		
HEXAGON AB-B SHS	174	515.20	89,644.80		
MILLICOM INTL CELLULAR -SDR	152	566.50	86,108.00		
TELE2 AB-B SHS	828	104.40	86,443.20		
TELIA CO AB	5,333	38.02	202,760.66		
	スウェーデンクローナ 建小計	35,273		5,103,427.34 (65,221,801)	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	1,882	200.70	377,717.40	
	NORSK HYDRO ASA	2,975	53.52	159,222.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	393	336.70	132,323.10	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	197	203.00	39,991.00	
	MARINE HARVEST	846	172.60	146,019.60	

	ORKLA ASA	1,803	82.00	147,846.00	
	DNB ASA	1,551	149.75	232,262.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	459	134.40	61,689.60	
	TELENOR ASA	635	173.50	110,172.50	
	ノルウェークローネ 建小計	10,741		1,407,243.45	(19,391,814)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	219	565.40	123,822.60	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	383	416.20	159,404.60	
	ISS A/S	370	215.00	79,550.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	8	8,700.00	69,600.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-B	13	9,234.00	120,042.00	
	DSV A/S	42	488.00	20,496.00	
	PANDORA A/S	246	694.40	170,822.40	
	CARLSBERG AS-B	220	682.80	150,216.00	
	COLOPLAST A/S	263	522.80	137,496.40	
	WILLIAM DEMANT HOLDING A/S	275	234.80	64,570.00	
	GENMAB A/S	118	1,277.50	150,745.00	
	H LUNDBECK A/S	142	347.90	49,401.80	
	NOVO NORDISK A/S-B	2,736	287.55	786,736.80	
	DANSKE BANK A/S	1,190	223.80	266,322.00	
	TRYG A/S	259	142.00	36,778.00	
ORSTED A/S	337	386.80	130,351.60		
	デンマーククローネ 建小計	6,821		2,516,355.20	(44,841,449)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	577	31.83	18,365.91	
	OIL SEARCH LIMITED	3,032	7.77	23,558.64	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	1,276	9.52	12,147.52	
	SANTOS LTD	4,195	6.00	25,170.00	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	1,349	31.06	41,899.94	
	ALUMINA LIMITED	5,614	2.87	16,112.18	
	BHP BILLITON LIMITED(AU)	5,115	30.92	158,155.80	
	BLUESCOPE STEEL LTD	1,175	16.66	19,575.50	
	BORAL LIMITED	2,577	7.63	19,662.51	
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	3,444	4.71	16,221.24	
	INCITEC PIVOT LIMITED	3,870	3.68	14,241.60	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	975	23.98	23,380.50	
	NEWCREST MINING LIMITED	1,574	20.11	31,653.14	
	ORICA LTD	829	18.93	15,692.97	
	RIO TINTO LIMITED(AU)	755	81.42	61,472.10	
	SOUTH32 LIMITED	5,656	3.88	21,945.28	
	CIMIC GROUP LIMITED	223	43.88	9,785.24	
BRAMBLES LTD	3,261	9.71	31,664.31		

SEEK LIMITED	758	19.20	14,553.60	
AURIZON HOLDINGS LIMITED	4,539	4.47	20,289.33	
SYDNEY AIRPORT CO LIMITED	2,439	6.53	15,926.67	
TRANSURBAN GROUP	3,948	11.23	44,336.04	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,198	25.17	30,153.66	
CROWN RESORTS LIMITED	835	12.87	10,746.45	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	138	39.21	5,410.98	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LIMITED	123	55.67	6,847.41	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	20	4.35	87.00	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	1,276	3.51	4,478.76	
WESFARMERS LIMITED	1,618	41.32	66,855.76	
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,703	26.51	45,146.53	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	1,314	8.93	11,734.02	
TREASURY WINE ESTATES LIMITED	1,633	17.66	28,838.78	
COCHLEAR LIMITED	127	185.83	23,600.41	
HEALTHSCOPE LTD	3,707	2.06	7,636.42	
RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	313	63.55	19,891.15	
SONIC HEALTHCARE LTD	874	23.25	20,320.50	
CSL LIMITED	699	159.80	111,700.20	
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	4,624	26.71	123,507.04	
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	888	10.51	9,332.88	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	1,084	10.02	10,861.68	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	2,488	72.40	180,131.20	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	4,261	28.33	120,714.13	
WESTPAC BANKING CORPORATION	5,526	28.59	157,988.34	
ASX LTD	428	56.47	24,169.16	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	1,311	10.78	14,132.58	
MACQUARIE GROUP LIMITED	375	104.45	39,168.75	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	4,859	7.56	36,734.04	
MEDIBANK PRIVATE LIMITED	6,093	2.82	17,182.26	
LENDLEASE GROUP	1,225	17.97	22,013.25	
COMPUTERSHARE LIMITED	1,027	17.23	17,695.21	
REA GROUP LIMITED	121	78.66	9,517.86	
TELSTRA CORPORATION	2,169	3.11	6,745.59	
TPG TELECOM LIMITED	751	5.26	3,950.26	
AGL ENERGY LIMITED	1,443	20.68	29,841.24	
APA GROUP	2,465	7.97	19,646.05	
AUSNET SERVICES	4,089	1.63	6,665.07	
オーストラリアドル 建小計	117,986		1,899,254.64 (157,638,135)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LIMITED	1,535	6.27	9,624.45
	AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LIMITED	2,108	6.27	13,217.16

	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	860	10.63	9,141.80
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	4,053	3.40	13,780.20
	MERCURY NZ LTD	1,606	3.15	5,058.90
	MERIDIAN ENERGY LTD	2,939	2.87	8,434.93
	ニュージーランドドル 建小計	13,101		59,257.44 (4,617,932)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED	4,534	93.70	424,835.80
	NWS HOLDINGS LIMITED	2,500	14.52	36,300.00
	MTR CORPORATION	2,903	43.45	126,135.35
	LI & FUNG LIMITED	14,000	3.92	54,880.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LIMITED	2,773	44.95	124,646.35
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS LIMITED	1,338	23.05	30,840.90
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	4,537	70.65	320,539.05
	MGM CHINA HOLDINGS LIMITED	2,155	22.15	47,733.25
	SANDS CHINA LIMITED	4,974	44.65	222,089.10
	SHANGRI-LA ASIA LIMITED	1,813	15.26	27,666.38
	SJM HOLDINGS LIMITED	4,000	7.42	29,680.00
	WYNN MACAU LIMITED	3,499	30.55	106,894.45
	WH GROUP LTD	18,000	8.46	152,280.00
	BANK OF EAST ASIA	2,667	33.50	89,344.50
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,684	39.15	144,228.60
	HANG SENG BANK LTD	600	194.10	116,460.00
	FIRST PACIFIC COMPANY LIMITED	4,000	4.14	16,560.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	2,066	260.40	537,986.40
	AIA GROUP LIMITED	17,751	68.70	1,219,493.70
	CK ASSET HOLDINGS LTD	4,534	67.75	307,178.50
	HANG LUNG GROUP LTD	2,000	24.75	49,500.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	3,864	18.36	70,943.04
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,725	50.40	86,940.00
	HYSAN DEVELOPMENT COMPANY LIMITED	1,000	43.40	43,400.00
	KERRY PROPERTIES LIMITED	1,452	37.10	53,869.20
	NEW WORLD DEVELOPMENT	11,562	11.38	131,575.56
	SINO LAND CO	6,576	13.34	87,723.84
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	2,000	124.80	249,600.00
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	1,000	78.80	78,800.00
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	2,632	27.45	72,248.40
	WHARF HOLDINGS LTD	2,000	25.60	51,200.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	2,000	53.30	106,600.00
	WHEELLOCK AND COMPANY LTD	2,000	56.30	112,600.00
	HKT TRUST AND HKT LIMITED	8,080	10.30	83,224.00
	PCCW LIMITED	8,884	4.80	42,643.20
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	1,000	62.20	62,200.00

	CLP HOLDINGS LTD	235	81.20	19,082.00
	HK ELECTRIC INVESTMENTS AND HK ELECTRIC	6,000	7.32	43,920.00
	HONG KONG & CHINA GAS COMPANY LIMITED	2,062	16.22	33,445.64
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	2,567	59.25	152,094.75
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY LIMITED	500	107.00	53,500.00
	香港ドル 建小計	171,467		5,820,881.96 (79,746,082)
シンガポールドル	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	2,300	3.16	7,268.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	3,600	3.68	13,248.00
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	4,369	1.24	5,417.56
	COMFORTDELGRO CORPORATION LIMITED	4,900	2.24	10,976.00
	SATS LTD	1,500	5.49	8,235.00
	SINGAPORE AIRLINES LTD	1,200	10.88	13,056.00
	GENTING SINGAPORE PLC	13,400	1.19	15,946.00
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	3,500	2.75	9,625.00
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LIMITED	200	35.62	7,124.00
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LIMITED	16,200	0.34	5,508.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	3,300	3.21	10,593.00
	DBS GROUP HOLDINGS LIMITED	1,900	29.91	56,829.00
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	3,300	13.74	45,342.00
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	2,300	29.78	68,494.00
	SINGAPORE EXCHANGE LIMITED	1,800	7.59	13,662.00
	CAPITALAND LTD	5,700	3.77	21,489.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	900	12.85	11,565.00
	UOL GROUP LIMITED	1,100	8.88	9,768.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	13,000	3.43	44,590.00
STARHUB LIMITED	1,300	2.32	3,016.00	
	シンガポールドル 建小計	85,769		381,751.56 (31,231,095)
イスラエルシュケル	FRUTAROM	85	370.00	31,450.00
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	1,130	15.74	17,786.20
	ELBIT SYSTEMS LIMITED	52	442.70	23,020.40
	BANK HAPOLIM BM	2,357	24.50	57,746.50
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	3,201	21.55	68,981.55
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LIMITED	319	67.04	21,385.76
	AZRIELI GROUP	94	170.20	15,998.80
	NICE LIMITED	137	334.80	45,867.60
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORPORATION LTD	4,757	4.36	20,773.81
	イスラエルシュケル 建小計	12,132		303,010.62 (9,244,854)
	合 計	1,811,750		5,975,147,722 (5,975,147,722)

(注)外貨建株式の評価額の単価は、小数点第3位以下を切り捨てて表示しております。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資信託受益証券	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	12,000	4,020.00	
	投資信託受益証券 小計		12,000	4,020.00 (432,069)	
	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	732	13,695.72	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE	176	21,482.56	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	675	92,758.50	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	2,091	21,432.75	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	219	35,596.26	
		BOSTON PROPERTIES INC	244	29,118.96	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	673	9,603.71	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	194	16,476.42	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	1,164	6,623.16	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	639	65,586.96	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	341	35,180.97	
		DUKE REALTY CORP	785	20,574.85	
		EQUINIX INC	139	56,902.43	
		EQUITY RESIDENTIAL	583	35,388.10	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	62	14,894.88	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	56	4,894.40	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT	159	18,068.76	
		GGP INC	1,235	24,576.50	
		HCP INC	1,003	22,427.08	
		HOST HOTELS & RESORTS	641	12,473.86	
		INVITATION HOMES INC	494	11,119.94	
		IRON MOUNTAIN INC	554	18,703.04	
		KIMCO REALTY CORPORATION	940	12,784.00	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	325	12,824.50	
		MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	233	21,049.22	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	325	12,346.75	
		PROLOGIS INC	944	61,577.12	
		PUBLIC STORAGE	185	35,851.15	
		REALTY INCOME CORP	555	27,844.35	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	54	3,083.40	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	80	13,248.80		
	SIMON PROPERTY GROUP	514	77,243.92		
	SL GREEN REALTY CORPORATION	206	19,992.30		
	THE MACERICH COMPANY	270	15,538.50		

		UDR INC	591	20,909.58
		VENTAS INC	563	26,911.40
		VEREIT INC	2,155	14,330.75
		WELLTOWER INC	581	30,165.52
		WEYERHAEUSER COMPANY	1,194	43,736.22
	投資証券	小計	22,574	1,037,017.29 (111,458,618)
米ドル建小計			34,574	1,041,037.29 (111,890,687)
カナダドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	300	6,156.00
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	297	6,908.22
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	100	2,851.00
カナダドル建小計			697	15,915.22 (1,349,928)
ユーロ	投資証券	FONCIERE DES REGIONS	76	6,710.80
		GECINA SA	93	13,020.00
		ICADE	85	6,740.50
		UNIBAIL-RODAMCO SE	158	30,304.40
ユーロ建小計			412	56,775.70 (7,532,999)
英ポンド	投資証券	HAMMERSON PLC	1,755	9,115.47
		SEGRO PLC	2,136	13,379.90
英ポンド建小計			3,891	22,495.37 (3,403,549)
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS	2,141	19,825.66
		GOODMAN GROUP	310	2,706.30
		GPT GROUP	3,978	18,497.70
		MIRVAC GROUP	8,197	17,869.46
		SCENTRE GROUP	9,474	36,759.12
		VICINITY CENTRES	7,444	17,642.28
オーストラリアドル建小計			31,544	113,300.52 (9,403,943)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	607	42,125.80
香港ドル建小計			607	42,125.80 (577,123)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,500	15,015.00
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	4,769	8,870.34
		CAPITALAND MALL TRUST	5,700	12,084.00
		SUNTEC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,500	10,670.00
シンガポールドル建小計			21,469	46,639.34 (3,815,564)
				137,973,793

合計		(137,973,793)
----	--	---------------

(注1) 投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、口数及び証券数を表示しております。

有価証券明細表注記

1. 小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄の記載は、邦貨金額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	株式 574銘柄	60.9%			63.7%
	投資信託受 益証券 1銘柄		0.0%		0.0%
	投資証券 39銘柄			1.7%	1.8%
カナダドル	株式 81銘柄	3.4%			3.6%
	投資証券 3銘柄			0.0%	0.0%
ユーロ	株式 220銘柄	12.9%			13.5%
	投資証券 4銘柄			0.1%	0.1%
英ポンド	株式 96銘柄	6.8%			7.1%
	投資証券 2銘柄			0.1%	0.1%
スイスフラン	株式 32銘柄	2.9%			3.1%
スウェーデンクロー ナ	株式 31銘柄	1.0%			1.1%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	0.3%			0.3%
デンマーククローネ	株式 16銘柄	0.7%			0.7%
オーストラリアドル	株式 56銘柄	2.5%			2.6%
	投資証券 6銘柄			0.1%	0.2%
ニュージーランドド ル	株式 6銘柄	0.1%			0.1%
香港ドル	株式 41銘柄	1.2%			1.3%
	投資証券 1銘柄			0.0%	0.0%
シンガポールドル	株式 20銘柄	0.5%			0.5%
	投資証券 4銘柄			0.1%	0.1%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	0.1%			0.2%

(注1) 組入株式時価比率、組入投資信託受益証券時価比率及び組入投資証券時価比率は、純資産総額に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

(注2) 有価証券の合計額に対する比率は、邦貨建有価証券評価額及び外貨建有価証券の邦貨換算評価額の合計に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

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

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

新光日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

	(単位：円)	
	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	87,358,201	193,765,584
国債証券	11,908,332,500	10,053,096,900
地方債証券	963,465,600	961,230,400
特殊債券	1,005,418,000	951,479,000
社債券	420,410,000	516,900,000
未収利息	26,415,074	21,742,872
前払費用	716,683	155,338
流動資産合計	14,412,116,058	12,698,370,094
資産合計		
14,412,116,058		
12,698,370,094		
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,100	20,293,000
未払利息	143	439
流動負債合計	6,243	20,293,439
負債合計		
6,243		
20,293,439		
純資産の部		
元本等		
元本	11,455,970,078	10,004,472,192
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,956,139,737	2,673,604,463
元本等合計	14,412,109,815	12,678,076,655
純資産合計		
14,412,109,815		
12,678,076,655		
負債純資産合計		
14,412,116,058		
12,698,370,094		

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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（ただし、売気配は使用いたしません。）、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）に基づいて評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
1. 計算日における受益権の総数	1. 計算日における受益権の総数
11,455,970,078口	10,004,472,192口
2. 計算日における1単位当たりの純資産の額	2. 計算日における1単位当たりの純資産の額

平成29年10月20日現在		平成30年 4月20日現在	
1口当たり純資産額	1.2580円	1口当たり純資産額	1.2672円
(1万口当たり純資産額)	(12,580円)	(1万口当たり純資産額)	(12,672円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券であり、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。 リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。 市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。 信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。 流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>国債証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>地方債証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>特殊債券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>社債券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

区分	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	11,543,736,572円	11,455,970,078円
期中追加設定元本額	743,810,317円	525,791,328円
期中一部解約元本額	831,576,811円	1,977,289,214円
同期末における元本の内訳		
新光日本債券インデックスファンド(DC年金)	122,433,459円	117,344,683円
新光7資産バランスファンド	628,025,669円	628,025,669円
日本債券ファンド	2,260,602,991円	2,362,872,180円
新光日本債券インデックスVA	123,028,459円	46,237,428円

区分	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
新光世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	1,937,009,933円	1,129,713,335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)	2,005,894,371円	1,492,803,356円
新光世界バランス35VAT(適格機関投資家私募)	138,329,218円	122,900,694円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	2,924,109,101円	2,821,466,745円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	1,297,727,013円	1,254,303,009円
グローバル・ナビ	18,809,864円	28,805,093円
合計	11,455,970,078円	10,004,472,192円

2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	277,557,100	534,800
地方債証券	9,963,650	3,716,300
特殊債券	10,314,200	3,751,000
社債券	5,442,000	1,776,000
合計	303,276,950	9,778,100

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

3 デリバティブ取引等関係 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表 (1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第118回利付国債(5年)	100,000,000	100,382,000	
	第120回利付国債(5年)	110,000,000	110,511,500	
	第122回利付国債(5年)	70,000,000	70,261,100	

第123回利付国債(5年)	160,000,000	160,670,400	
第124回利付国債(5年)	150,000,000	150,696,000	
第125回利付国債(5年)	120,000,000	120,622,800	
第126回利付国債(5年)	140,000,000	140,802,200	
第127回利付国債(5年)	120,000,000	120,733,200	
第128回利付国債(5年)	120,000,000	120,798,000	
第129回利付国債(5年)	60,000,000	60,430,800	
第130回利付国債(5年)	80,000,000	80,601,600	
第131回利付国債(5年)	60,000,000	60,469,800	
第132回利付国債(5年)	110,000,000	110,917,400	
第133回利付国債(5年)	50,000,000	50,431,500	
第1回利付国債(40年)	10,000,000	14,453,900	
第2回利付国債(40年)	20,000,000	27,977,600	
第3回利付国債(40年)	20,000,000	28,117,200	
第4回利付国債(40年)	30,000,000	42,374,700	
第5回利付国債(40年)	30,000,000	40,742,100	
第6回利付国債(40年)	30,000,000	39,930,000	
第7回利付国債(40年)	30,000,000	38,223,900	
第8回利付国債(40年)	30,000,000	35,380,500	
第9回利付国債(40年)	40,000,000	34,250,400	
第10回利付国債(40年)	40,000,000	40,525,200	
第302回利付国債(10年)	70,000,000	71,239,700	
第303回利付国債(10年)	120,000,000	122,598,000	
第305回利付国債(10年)	60,000,000	61,425,000	
第306回利付国債(10年)	150,000,000	154,365,000	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	144,296,600	
第309回利付国債(10年)	20,000,000	20,527,400	
第310回利付国債(10年)	110,000,000	112,961,200	
第311回利付国債(10年)	50,000,000	51,104,500	
第312回利付国債(10年)	140,000,000	144,907,000	
第313回利付国債(10年)	100,000,000	104,107,000	
第315回利付国債(10年)	80,000,000	83,318,400	
第317回利付国債(10年)	50,000,000	52,069,500	
第318回利付国債(10年)	80,000,000	83,037,600	
第319回利付国債(10年)	30,000,000	31,327,200	
第320回利付国債(10年)	50,000,000	52,028,500	
第321回利付国債(10年)	50,000,000	52,155,500	
第322回利付国債(10年)	20,000,000	20,783,800	
第323回利付国債(10年)	40,000,000	41,660,400	
第325回利付国債(10年)	100,000,000	103,938,000	
第326回利付国債(10年)	60,000,000	62,216,400	
第327回利付国債(10年)	50,000,000	52,081,000	

第328回利付国債(10年)	50,000,000	51,699,000	
第329回利付国債(10年)	70,000,000	73,189,200	
第330回利付国債(10年)	40,000,000	41,889,200	
第332回利付国債(10年)	120,000,000	124,531,200	
第333回利付国債(10年)	80,000,000	83,128,000	
第334回利付国債(10年)	100,000,000	104,013,000	
第335回利付国債(10年)	120,000,000	124,202,400	
第336回利付国債(10年)	30,000,000	31,081,200	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,680,700	
第338回利付国債(10年)	120,000,000	123,612,000	
第339回利付国債(10年)	90,000,000	92,774,700	
第340回利付国債(10年)	110,000,000	113,427,600	
第341回利付国債(10年)	100,000,000	102,454,000	
第342回利付国債(10年)	130,000,000	131,131,000	
第343回利付国債(10年)	110,000,000	110,896,500	
第344回利付国債(10年)	110,000,000	110,831,600	
第345回利付国債(10年)	120,000,000	120,880,800	
第346回利付国債(10年)	110,000,000	110,732,600	
第347回利付国債(10年)	80,000,000	80,511,200	
第348回利付国債(10年)	50,000,000	50,304,500	
第349回利付国債(10年)	50,000,000	50,264,000	
第5回利付国債(30年)	20,000,000	25,175,400	
第7回利付国債(30年)	20,000,000	25,660,200	
第10回利付国債(30年)	20,000,000	22,378,200	
第11回利付国債(30年)	20,000,000	24,146,600	
第12回利付国債(30年)	10,000,000	12,678,900	
第13回利付国債(30年)	30,000,000	37,626,900	
第15回利付国債(30年)	20,000,000	26,738,800	
第17回利付国債(30年)	20,000,000	26,536,800	
第19回利付国債(30年)	20,000,000	26,290,600	
第20回利付国債(30年)	10,000,000	13,494,600	
第21回利付国債(30年)	10,000,000	13,177,000	
第22回利付国債(30年)	10,000,000	13,542,500	
第23回利付国債(30年)	10,000,000	13,566,100	
第24回利付国債(30年)	20,000,000	27,177,800	
第26回利付国債(30年)	30,000,000	40,367,700	
第27回利付国債(30年)	30,000,000	41,013,900	
第28回利付国債(30年)	30,000,000	41,121,900	
第29回利付国債(30年)	40,000,000	54,274,800	
第30回利付国債(30年)	40,000,000	53,677,200	
第31回利付国債(30年)	30,000,000	39,785,400	
第32回利付国債(30年)	40,000,000	54,000,800	

第33回利付国債(30年)	50,000,000	64,592,000	
第34回利付国債(30年)	30,000,000	40,150,500	
第35回利付国債(30年)	50,000,000	64,967,500	
第36回利付国債(30年)	50,000,000	65,179,000	
第37回利付国債(30年)	50,000,000	64,249,000	
第38回利付国債(30年)	30,000,000	37,964,400	
第39回利付国債(30年)	30,000,000	38,693,400	
第40回利付国債(30年)	20,000,000	25,347,000	
第41回利付国債(30年)	30,000,000	37,337,400	
第42回利付国債(30年)	30,000,000	37,356,300	
第43回利付国債(30年)	30,000,000	37,376,100	
第44回利付国債(30年)	30,000,000	37,394,700	
第45回利付国債(30年)	20,000,000	23,971,400	
第46回利付国債(30年)	40,000,000	48,005,600	
第47回利付国債(30年)	20,000,000	24,498,600	
第48回利付国債(30年)	40,000,000	47,088,400	
第49回利付国債(30年)	40,000,000	47,088,000	
第50回利付国債(30年)	40,000,000	41,029,200	
第51回利付国債(30年)	30,000,000	26,924,100	
第52回利付国債(30年)	30,000,000	28,409,700	
第53回利付国債(30年)	30,000,000	29,144,700	
第54回利付国債(30年)	40,000,000	40,912,400	
第55回利付国債(30年)	40,000,000	40,869,600	
第56回利付国債(30年)	30,000,000	30,619,500	
第57回利付国債(30年)	30,000,000	30,586,500	
第45回利付国債(20年)	30,000,000	31,445,700	
第47回利付国債(20年)	50,000,000	52,798,000	
第48回利付国債(20年)	30,000,000	32,093,100	
第50回利付国債(20年)	30,000,000	31,760,100	
第51回利付国債(20年)	10,000,000	10,667,100	
第52回利付国債(20年)	20,000,000	21,509,600	
第53回利付国債(20年)	10,000,000	10,805,600	
第55回利付国債(20年)	10,000,000	10,821,500	
第57回利付国債(20年)	30,000,000	32,490,300	
第58回利付国債(20年)	20,000,000	21,761,400	
第59回利付国債(20年)	10,000,000	10,837,200	
第63回利付国債(20年)	20,000,000	21,946,600	
第64回利付国債(20年)	10,000,000	11,069,400	
第69回利付国債(20年)	30,000,000	33,829,200	
第70回利付国債(20年)	20,000,000	23,025,800	
第72回利付国債(20年)	20,000,000	22,757,000	
第76回利付国債(20年)	30,000,000	34,017,300	

第78回利付国債(20年)	20,000,000	22,768,200	
第81回利付国債(20年)	10,000,000	11,498,600	
第84回利付国債(20年)	40,000,000	46,178,800	
第85回利付国債(20年)	40,000,000	46,676,000	
第88回利付国債(20年)	30,000,000	35,627,700	
第90回利付国債(20年)	40,000,000	47,359,200	
第92回利付国債(20年)	50,000,000	58,988,000	
第94回利付国債(20年)	30,000,000	35,514,600	
第95回利付国債(20年)	20,000,000	24,134,400	
第97回利付国債(20年)	40,000,000	48,098,000	
第99回利付国債(20年)	40,000,000	47,904,000	
第100回利付国債(20年)	50,000,000	60,564,500	
第103回利付国債(20年)	30,000,000	36,765,000	
第105回利付国債(20年)	30,000,000	36,273,900	
第108回利付国債(20年)	40,000,000	47,667,600	
第111回利付国債(20年)	30,000,000	36,930,300	
第113回利付国債(20年)	50,000,000	61,176,000	
第114回利付国債(20年)	10,000,000	12,269,200	
第116回利付国債(20年)	60,000,000	74,515,800	
第117回利付国債(20年)	40,000,000	49,208,400	
第118回利付国債(20年)	40,000,000	48,863,600	
第121回利付国債(20年)	50,000,000	60,621,500	
第123回利付国債(20年)	70,000,000	86,793,700	
第125回利付国債(20年)	30,000,000	37,642,200	
第128回利付国債(20年)	50,000,000	60,974,000	
第130回利付国債(20年)	50,000,000	60,446,000	
第132回利付国債(20年)	40,000,000	47,912,800	
第133回利付国債(20年)	20,000,000	24,222,000	
第134回利付国債(20年)	40,000,000	48,526,400	
第137回利付国債(20年)	30,000,000	36,021,300	
第140回利付国債(20年)	60,000,000	72,149,400	
第141回利付国債(20年)	40,000,000	48,132,800	
第142回利付国債(20年)	20,000,000	24,365,800	
第143回利付国債(20年)	40,000,000	47,622,000	
第145回利付国債(20年)	60,000,000	72,387,000	
第146回利付国債(20年)	50,000,000	60,398,000	
第147回利付国債(20年)	60,000,000	71,611,200	
第148回利付国債(20年)	60,000,000	70,768,200	
第149回利付国債(20年)	60,000,000	70,821,600	
第150回利付国債(20年)	60,000,000	69,883,800	
第151回利付国債(20年)	70,000,000	79,302,300	
第152回利付国債(20年)	60,000,000	67,922,400	

	第153回利付国債(20年)	50,000,000	57,408,500	
	第154回利付国債(20年)	60,000,000	67,867,200	
	第155回利付国債(20年)	70,000,000	76,799,800	
	第156回利付国債(20年)	50,000,000	49,668,000	
	第157回利付国債(20年)	60,000,000	57,433,800	
	第158回利付国債(20年)	60,000,000	60,458,400	
	第159回利付国債(20年)	60,000,000	61,390,200	
	第160回利付国債(20年)	50,000,000	51,951,000	
	第161回利付国債(20年)	50,000,000	50,963,000	
	第162回利付国債(20年)	50,000,000	50,839,500	
	第163回利付国債(20年)	20,000,000	20,303,400	
国債証券 小計		9,180,000,000	10,053,096,900	
地方債証券	第18回東京都公募公債(20年)	100,000,000	121,260,000	
	第678回東京都公募公債	80,000,000	81,816,000	
	第164回神奈川県公募公債	100,000,000	101,750,000	
	第200回神奈川県公募公債	35,000,000	36,414,000	
	第110回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,210,000	
	第412回大阪府公募公債(10年)	50,000,000	49,485,000	
	平成24年度第3回広島県公募公債	66,000,000	68,237,400	
	平成24年度第7回広島県公募公債	100,000,000	103,000,000	
	平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	10,000,000	12,962,000	
	第105回共同発行市場公募地方債	50,000,000	51,900,000	
	第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,210,000	
	第485回名古屋市公募公債(10年)	30,000,000	30,996,000	
	平成24年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,990,000	
地方債証券 小計		921,000,000	961,230,400	
特殊債券	第97回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,450,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,040,000	
	第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,000,000	
	第327回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,240,000	
	第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,420,000	
	第49回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,370,000	
	第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,560,000	
	い第782号農林債	10,000,000	10,049,000	
	第317回信金中金債(5年)	100,000,000	99,960,000	
	第13回中日本高速道路社債(財投機関債)	100,000,000	102,390,000	
特殊債券 小計		910,000,000	951,479,000	
社債券	第4回第一三共社債	100,000,000	103,440,000	
	第11回ブリヂストン社債	100,000,000	99,960,000	
	第44回ホンダファイナンス社債	100,000,000	99,680,000	

	第47回野村ホールディングス社債	100,000,000	100,900,000	
	第36回東日本旅客鉄道社債	100,000,000	112,920,000	
社債券 小計		500,000,000	516,900,000	
	合計	11,511,000,000	12,482,706,300	

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。

新光J-REITマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	23,341,547	37,314,268
投資証券	2,414,905,100	2,311,780,890
未収入金	-	53,840
未収配当金	21,023,567	18,638,399
流動資産合計	2,459,270,214	2,367,787,397
資産合計	2,459,270,214	2,367,787,397
負債の部		
流動負債		
未払金	-	11,587,380
未払利息	38	84
流動負債合計	38	11,587,464
負債合計	38	11,587,464
純資産の部		
元本等		
元本	1,584,079,714	1,431,530,602
剰余金		
剰余金又は欠損金()	875,190,462	924,669,331
元本等合計	2,459,270,176	2,356,199,933
純資産合計	2,459,270,176	2,356,199,933
負債純資産合計	2,459,270,214	2,367,787,397

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

2. 収益及び費用の計上基準	<p>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。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p> <p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

平成29年10月20日現在		平成30年 4月20日現在	
1. 計算日における受益権の総数	1,584,079,714口	1. 計算日における受益権の総数	1,431,530,602口
2. 計算日における1単位当たりの純資産の額		2. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.5525円	1口当たり純資産額	1.6459円
(1万口当たり純資産額)	(15,525円)	(1万口当たり純資産額)	(16,459円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、投資証券であり、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。	同左

3.金融商品に係るリスクの管理体制	<p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	同左
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。	同左

金融商品の時価等に関する事項

平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>投資証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
--	--------------------------------	--------------------------------

該当事項はありません。	同左
-------------	----

(その他の注記)

1 元本の移動

区分	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,657,457,590円	1,584,079,714円
期中追加設定元本額	107,861,436円	46,835,847円
期中一部解約元本額	181,239,312円	199,384,959円
同期末における元本の内訳		
新光7資産バランスファンド	498,351,904円	462,104,698円
グローバル・ナビ	5,083,588円	7,493,159円
新光J-REITオープン(年2回決算型)	1,080,644,222円	961,932,745円
合計	1,584,079,714円	1,431,530,602円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資証券	193,086,617	84,122,557
合計	193,086,617	84,122,557

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

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	------	-----	----

投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	96	45,792,000	
	MCUBS MidCity投資法人	323	25,872,300	
	森ヒルズリート投資法人	311	42,762,500	
	産業ファンド投資法人	336	40,454,400	
	アドバンス・レジデンス投資法人	268	74,423,600	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	147	23,255,400	
	アクティブア・プロパティーズ投資法人	131	63,338,500	
	GLP投資法人	601	69,836,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	110	27,192,000	
	日本プロロジスリート投資法人	386	89,359,000	
	星野リゾート・リート投資法人	44	24,200,000	
	Oneリート投資法人	32	7,865,600	
	イオンリート投資法人	275	31,047,500	
	ヒューリックリート投資法人	197	32,465,600	
	日本リート投資法人	78	24,960,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1,283	18,128,790	
	日本ヘルスケア投資法人	14	2,472,400	
	積水ハウス・リート投資法人	182	25,935,000	
	ト・セイ・リート投資法人	47	5,376,800	
	ケネディクス商業リート投資法人	105	24,318,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	36	3,798,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	50	4,710,000	
	野村不動産マスタ・ファンド投資法人	857	129,921,200	
	いちごホテルリート投資法人	45	5,607,000	
	ラサ・ルロジポ・リート投資法人	218	24,394,200	
	スタ・アジア不動産投資法人	68	7,092,400	
	マリモ地方創生リート投資法人	23	2,631,200	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	55	19,442,500	
	大江戸温泉リート投資法人	49	4,326,700	
	さくら総合リート投資法人	70	6,531,000	
	投資法人みらい	37	6,915,300	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	63	8,889,300	
	三菱地所物流リート投資法人	27	7,119,900	
	CREロジスティクスファンド投資法人	29	3,271,200	
	ザイマックス・リート投資法人	27	3,040,200	
	日本ビルファンド投資法人	280	172,200,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	288	162,432,000	
	日本リートールファンド投資法人	547	112,353,800	
	オリックス不動産投資法人	574	94,767,400	
	日本プライムリアルティ投資法人	183	69,906,000	
	プレミアム投資法人	261	28,422,900	
	東急リアル・エステート投資法人	194	28,091,200	

グローバル・ワン不動産投資法人	186	19,585,800	
ユナイテッド・アーバン投資法人	638	105,844,200	
森トラスト総合リート投資法人	207	33,161,400	
インヴィンシブル投資法人	794	38,350,200	
フロンティア不動産投資法人	98	43,610,000	
平和不動産リート投資法人	180	18,054,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	193	42,826,700	
福岡リート投資法人	150	25,005,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	85	57,205,000	
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	219	25,688,700	
いちごオフィスリート投資法人	224	18,233,600	
大和証券オフィス投資法人	62	38,688,000	
阪急リート投資法人	126	17,186,400	
スタートアップリート投資法人	46	7,636,000	
大和ハウスリート投資法人	337	87,148,200	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	835	64,963,000	
日本賃貸住宅投資法人	326	27,286,200	
ジャパンエクセレント投資法人	259	36,389,500	
合計	13,912	2,311,780,890	

(注1) 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。

新光米国REITマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	平成29年10月20日現在	平成30年4月20日現在
資産の部		
流動資産		
預金	10,328,646	5,106,373
コール・ローン	2,113,747	2,826,437
投資証券	809,721,822	725,699,828
未収配当金	417,060	639,624
流動資産合計	822,581,275	734,272,262
資産合計	822,581,275	734,272,262
負債の部		
流動負債		
未払利息	3	6
流動負債合計	3	6
負債合計	3	6
純資産の部		

	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
元本等		
元本	501,859,495	505,327,422
剰余金		
剰余金又は欠損金()	320,721,777	228,944,834
元本等合計	822,581,272	734,272,256
純資産合計	822,581,272	734,272,256
負債純資産合計	822,581,275	734,272,262

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 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、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場 (最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。

(貸借対照表に関する注記)

平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
1. 計算日における受益権の総数 501,859,495口	1. 計算日における受益権の総数 505,327,422口
2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.6391円 (1万口当たり純資産額) (16,391円)	2. 計算日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.4531円 (1万口当たり純資産額) (14,531円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日

1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>また、当ファンドは、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。</p>	同左
2.金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、投資証券であり、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引は為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3.金融商品に係るリスクの管理体制	<p>運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。</p> <p>リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。</p> <p>信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。</p> <p>流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。</p>	同左

4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
---------------------------	---	----

金融商品の時価等に関する事項

平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>投資証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成29年 4月21日 至 平成29年10月20日	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日
	該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

区分	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	533,436,463円	501,859,495円
期中追加設定元本額	303,667円	4,170,992円
期中一部解約元本額	31,880,635円	703,065円
同期末における元本の内訳		
新光7資産バランスファンド	496,954,036円	496,954,036円
グローバル・ナビ	4,905,459円	8,373,386円
合計	501,859,495円	505,327,422円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成29年10月20日現在	平成30年 4月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	22,929,084	68,905,487
合計	22,929,084	68,905,487

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

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

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

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	624	14,489.28	
		AGREE REALTY CORPORATION	200	9,786.00	
		ALEXANDER'S INC	16	6,317.44	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE	729	88,981.74	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	300	9,981.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	975	37,742.25	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	1,760	34,865.60	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	3,082	423,528.44	
		AMERICOLD REALTY TRUST	331	6,527.32	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	1,137	45,354.93	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	1,475	26,358.25	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	300	4,089.00	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	200	2,098.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	547	3,801.65	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,004	163,190.16	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	200	1,752.00	

BOSTON PROPERTIES INC	1,123	134,018.82
BRANDYWINE REALTY	1,214	18,707.74
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	2,146	30,623.42
CAMDEN PROPERTY TRUST	662	56,223.66
CARETRUST REIT INC	500	6,605.00
CATCHMARK TIMBER TRUST INC	300	3,945.00
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	1,314	5,453.10
CEDAR REALTY TRUST INC	700	2,597.00
CHATHAM LODGING TRUST	300	5,793.00
CHESAPEAKE LODGING TRUST	421	12,377.40
CITY OFFICE REIT INC	210	2,381.40
CLIPPER REALTY INC	111	886.89
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	3,805	21,650.45
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	860	17,638.60
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	100	2,573.00
CORECIVIC INC	869	17,675.46
COREENERGY INFRASTRUCTURE TRUST INC	100	3,836.00
CORESITE REALTY CORPORATION	238	25,161.36
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	736	19,879.36
COUSINS PROPERTIES INC	2,976	25,296.00
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	2,933	301,043.12
CUBESMART	1,265	35,331.45
CYRUSONE INC	646	33,301.30
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	668	38,096.04
DDR CORPORATION	2,173	15,145.81
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	1,424	15,777.92
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,489	153,620.13
DOUGLAS EMMETT INC	1,139	40,787.59
DUKE REALTY CORP	2,547	66,756.87
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	272	5,499.84
EASTGROUP PROPERTIES	232	19,562.24
EDUCATION REALTY TRUST INC	514	16,674.16
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	944	15,736.48
EPR PROPERTIES	441	23,963.94
EQUINIX INC	567	232,112.79
EQUITY COMMONWEALTH	862	26,256.52
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	593	51,804.48
EQUITY RESIDENTIAL	2,600	157,820.00
ESSEX PROPERTY TRUST INC	476	114,354.24
EXTRA SPACE STORAGE INC	872	76,212.80
FARMLAND PARTNERS INC	229	1,854.90
FEDERAL REALTY INVESTMENT	531	60,342.84

FIRST INDUSTRIAL REALTY	847	24,986.50	
FOREST CITY REALTY TRUST- A	1,707	34,481.40	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	460	10,423.60	
FRANKLIN STREET PROPERTIES	800	6,136.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	347	3,327.73	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	1,438	49,567.86	
GETTY REALTY CORP	201	5,035.05	
GGP INC	4,493	89,410.70	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	200	3,442.00	
GLADSTONE LAND CORPORATION	54	676.62	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	100	776.00	
GLOBAL NET LEASE INC	436	7,699.76	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	661	8,123.69	
GRAMERCY PROPERTY TRUST	1,139	25,502.21	
HCP INC	3,364	75,219.04	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	865	23,502.05	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	1,451	36,275.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	275	5,296.50	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	728	30,889.04	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	1,141	28,559.23	
HOST HOTELS & RESORTS	5,323	103,585.58	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	1,098	34,433.28	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	500	4,715.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	146	3,066.00	
INFREIT INC	300	6,171.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,000	5,300.00	
INVITATION HOMES INC	2,100	47,271.00	
IRON MOUNTAIN INC	2,054	69,343.04	
JBG SMITH PROPERTIES	605	20,721.25	
KILROY REALTY CORP	703	48,689.78	
KIMCO REALTY CORPORATION	3,010	40,936.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	635	9,321.80	
LAMAR ADVERTISING COMPANY	604	38,408.36	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	795	24,557.55	
LEXINGTON REALTY TRUST	1,644	12,691.68	
LIBERTY PROPERTY TRUST	1,072	42,301.12	
LIFE STORAGE INC	322	27,778.94	
LTC PROPERTIES INC	300	10,887.00	
MACK-CALI REALTY CORP	633	10,729.35	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	200	2,034.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	2,544	31,876.32	
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	812	73,356.08	

MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT COR- CL A	500	7,640.00
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	284	18,908.72
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	1,085	41,219.15
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	325	8,271.25
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	600	4,992.00
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	127	3,314.70
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	433	6,005.71
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	1,367	35,432.64
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	100	2,324.00
OUTFRONT MEDIA INC	973	18,263.21
PARAMOUNT GROUP INC	1,483	20,880.64
PARK HOTELS & RESORTS INC	1,300	37,050.00
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	481	17,200.56
PENN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	500	4,695.00
PHYSICIANS REALTY TRUST	1,259	18,784.28
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC-A	1,018	17,621.58
POTLATCHDELTIC CORP	436	23,042.60
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	259	3,732.19
PROLOGIS INC	3,845	250,809.35
PS BUSINESS PARKS INC/CA	138	15,983.16
PUBLIC STORAGE	1,079	209,099.41
QTS REALTY TRUST INC-CL A	352	12,439.68
QUALITY CARE PROPERTIES INC	719	15,041.48
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	600	7,098.00
RAYONIER INC	921	33,966.48
REALTY INCOME CORP	2,055	103,099.35
REGENCY CENTERS CORPORATION	1,068	60,982.80
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	771	13,029.90
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	1,665	18,764.55
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	550	16,093.00
RLJ LODGING TRUST	1,208	24,522.40
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	329	26,208.14
SABRA HEALTH CARE REIT INC	1,263	22,153.02
SAFETY INCOME & GROWTH INC	73	1,270.20
SAUL CENTERS INC	81	4,011.12
SBA COMMUNICATIONS CORP	848	140,437.28
SELECT INCOME REIT	442	8,309.60
SENIOR HOUSING PROPERTIES	1,654	25,240.04
SIMON PROPERTY GROUP	2,268	340,835.04
SL GREEN REALTY CORPORATION	659	63,955.95
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	3,263	26,006.11
STAG INDUSTRIAL INC	674	16,263.62

	STORE CAPITAL CORPORATION	1,201	29,604.65
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	796	11,677.32
	SUN COMMUNITIES INC	544	49,824.96
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS	1,635	25,898.40
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	657	14,513.13
	TAUBMAN CENTERS INC	415	23,202.65
	TERRENO REALTY CORP	364	12,852.84
	THE GEO GROUP INC	910	20,092.80
	THE MACERICH COMPANY	980	56,399.00
	TIER REIT INC	367	6,914.28
	UDR INC	1,901	67,257.38
	UMH PROPERTIES INC	200	2,650.00
	UNITI GROUP INC	1,163	19,712.85
	UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	100	6,025.00
	URBAN EDGE PROPERTIES	700	14,322.00
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES INC	229	4,511.30
	VENTAS INC	2,587	123,658.60
	VEREIT INC	7,120	47,348.00
	VORNADO REALTY TRUST	1,254	83,014.80
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	1,423	8,993.36
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	577	15,982.90
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	844	22,762.68
	WELLTOWER INC	2,705	140,443.60
	WEYERHAEUSER COMPANY	5,443	199,377.09
	WHITESTONE REIT	283	3,028.10
	WINTHROP REALTY LIQUIDATING TRUST	300	1,899.00
	WP CAREY INC	769	47,485.75
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	766	15,756.62
米ドル建小計		177,377	6,751,952.26 (725,699,828)
	合計		725,699,828 (725,699,828)

(注1) 券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

有価証券明細表注記

- 小計欄の()内は、邦貨換算額であります。
- 合計欄の記載は、邦貨金額であります。()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 170銘柄	98.8%	100.0%

(注1) 組入投資証券時価比率は、純資産総額に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

(注2) 有価証券の合計額に対する比率は、邦貨建有価証券評価額及び外貨建有価証券の邦貨換算評価額の合計に対する各通貨毎の評価額小計の割合であります。

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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

新光7資産バランスファンド

(平成30年 4月27日現在)

資産総額	5,383,677,494円
負債総額	5,417,555円
純資産総額(-)	5,378,259,939円
発行済口数	5,996,703,872口
1口当たり純資産額(/)	0.8969円
(1万口当たり純資産額)	(8,969円)

(参考) 海外国債マザーファンド

(平成30年 4月27日現在)

資産総額	21,816,732,170円
負債総額	374,849,352円
純資産総額(-)	21,441,882,818円
発行済口数	9,601,885,391口
1口当たり純資産額(/)	2.2331円
(1万口当たり純資産額)	(22,331円)

(参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(平成30年 4月27日現在)

資産総額	9,367,012,425円
負債総額	12,592,941円
純資産総額(-)	9,354,419,484円
発行済口数	4,050,138,740口
1口当たり純資産額(/)	2.3097円
(1万口当たり純資産額)	(23,097円)

(参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

(平成30年 4月27日現在)

資産総額	6,409,614,037円
負債総額	22,890,706円

純資産総額(-)	6,386,723,331円
発行済口数	2,788,097,469口
1口当たり純資産額(/)	2.2907円
(1万口当たり純資産額)	(22,907円)

(参考) 新光日本債券インデックスマザーファンド

(平成30年 4月27日現在)

資産総額	12,754,508,550円
負債総額	56,442,888円
純資産総額(-)	12,698,065,662円
発行済口数	10,019,143,109口
1口当たり純資産額(/)	1.2674円
(1万口当たり純資産額)	(12,674円)

(参考) 新光J-REITマザーファンド

(平成30年 4月27日現在)

資産総額	2,493,030,590円
負債総額	7,000,071円
純資産総額(-)	2,486,030,519円
発行済口数	1,492,319,945口
1口当たり純資産額(/)	1.6659円
(1万口当たり純資産額)	(16,659円)

(参考) 新光米国REITマザーファンド

(平成30年 4月27日現在)

資産総額	751,224,764円
負債総額	6円
純資産総額(-)	751,224,758円
発行済口数	505,293,012口
1口当たり純資産額(/)	1.4867円
(1万口当たり純資産額)	(14,867円)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【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】

a．資本金の額（平成30年 4月27日現在）

資本金の額	20億円	
会社が発行する株式総数	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カ年における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

b．会社の機構（平成30年 4月27日現在）

（イ）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。

（ロ）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。

平成30年4月27日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	1,176,800,622,980
追加型株式投資信託	846	12,687,192,173,919
単位型公社債投資信託	53	203,165,104,513
単位型株式投資信託	143	896,110,306,509
合計	1,080	14,963,268,207,921

3【委託会社等の経理状況】

- 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第33期事業年度（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：千円）

	第32期 （平成29年3月31日現在）	第33期 （平成30年3月31日現在）
（資産の部）		
流動資産		
現金・預金	27,972,477	49,071,217
金銭の信託	12,366,219	12,083,824
有価証券	297,560	-
未収委託者報酬	10,164,041	11,769,015
未収運用受託報酬	7,250,239	4,574,225
未収投資助言報酬	316,414	341,689

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

(単位：千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,169,128	1,003,550
未払金	4,745,195	5,081,728
未払収益分配金	1,027	1,031
未払償還金	57,332	57,275
未払手数料	4,062,695	4,629,133
その他未払金	624,140	394,288
未払費用	7,030,589	7,711,038
未払法人税等	1,915,556	5,153,972
未払消費税等	891,476	1,660,259
賞与引当金	1,432,264	1,393,911

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	56,355,754		84,705,447	
運用受託報酬	12,834,241		19,124,427	
投資助言報酬	1,002,482		1,217,672	
その他営業収益	378,715		117,586	
営業収益計		70,571,194		105,165,133
営業費用				
支払手数料	24,957,038		37,242,284	
広告宣伝費	838,356		379,873	

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

(単位：千円)

	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		537		1,430
受取配当金		51,036		74,278
時効成立分配金・償還金		103		256
為替差益		7,025		8,530
投資信託解約益		2		236,398
投資信託償還益		-		93,177
雑収入	1	18,213	1	10,306
時効後支払損引当金戻入額		-		17,429
営業外収益計		76,918		441,807
営業外費用				
投資信託解約損		31,945		4,138
投資信託償還損		47,201		17,065

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		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	-	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047
当期変動額									
剰余金の配当									2,544,000
別途積立金の 積立						2,550,000			2,550,000
当期純利益									6,443,302
合併による 増加			17,124,479	17,124,479					
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									

当期変動額合計	-	-	17,124,479	17,124,479	-	2,550,000	-	-	1,349,302
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350

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

第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

(単位:千円)

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

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465
当期変動額					

剰余金の配当	3,200,000	3,200,000			3,200,000
当期純利益	15,650,211	15,650,211			15,650,211
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)		-	277,137	277,137	277,137
当期変動額合計	12,450,211	12,450,211	277,137	277,137	12,727,349
当期末残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815

重要な会計方針

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

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

会計上の見積りの変更

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

追加情報

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

(損益計算書関係)

1. 関係会社に対する事項

(千円)

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

2. 固定資産売却益の内訳

(千円)

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

3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

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

5. 本社移転費用の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

平成30年6月20日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
平成30年6月20日 定時株主総会	普通株式 A種種類株式	利益 剰余金	12,520,000	313,000	平成30年3月31日	平成30年6月21日

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第32期（平成29年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）

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

第33期（平成30年3月31日現在）

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第32期(平成29年3月31日現在)

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

第33期(平成30年3月31日現在)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第32期の貸借対照表計上額3,306,296千円、第33期の貸借対照表計上額3,229,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. 其他有価証券

第32期(平成29年3月31日現在)

(千円)

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

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

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

第33期(平成30年3月31日現在)

(千円)

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

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

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

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

第33期において、該当事項はありません。

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

退職一時金制度を改定しました。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

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

(3) 退職給付費用

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

4. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成30年3月31日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 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	114,270,495千円
資産合計	114,270,495千円

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

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

(2) 損益計算書項目

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	1,349,261円64銭	1,667,445円37銭
1株当たり当期純利益金額	201,491円22銭	391,255円29銭

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
当期純利益金額	6,443,302千円	15,650,211千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	6,443,302千円	15,650,211千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	31,978株	40,000株
(うち普通株式)	(24,244株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(7,734株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

（４）委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

（５）上記（３）（４）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

a．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

平成30年6月20日付で、総則の「目的」に関する事項の定款の変更を行いました。

b．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

平成29年3月末日現在、342,037百万円

b．事業の内容

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

（２）フランクリン テンプルトン インベストメント マネジメント リミテッド（「投資顧問会社」）

a．資本金の額

平成29年3月末日現在、300万ポンド

b．事業の内容

英国籍の法人であり、内外の有価証券等にかかる投資顧問業務を営んでいます。

（３）販売会社

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

販売会社一覧表

（資本金の額は平成29年3月末日現在）

名 称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
みずほ証券株式会社	125,167	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
大山日ノ丸証券株式会社	215	同上
岡安証券株式会社	650	同上
岡三にいがた証券株式会社	852	同上

三豊証券株式会社	300	同上
永和証券株式会社	500	同上
西村証券株式会社	500	同上
いちよし証券株式会社 ^(注)	14,577	同上
あかつき証券株式会社	3,067	同上
楽天証券株式会社	7,495	同上
株式会社SBI証券	48,323	同上
SMBC日興証券株式会社	10,000	同上
立花証券株式会社	6,695	同上
高木証券株式会社	11,069	同上

(注) いちよし証券株式会社におきましては、募集・販売の取り扱いは行っておりません。

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

「投資顧問会社」は以下の業務を行います。

委託者に対する助言および情報提供等

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

(持株比率5%以上を記載します。)

<再信託受託会社の概要>

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

第3【参考情報】

ファンドについては、当特定期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成29年10月31日	臨時報告書
平成30年 1月19日	有価証券届出書
平成30年 1月19日	有価証券報告書
平成30年 1月31日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

平成30年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成30年6月8日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている新光7資産バランスファンドの平成29年10月21日から平成30年4月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、新光7資産バランスファンドの平成30年4月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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