

**【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】	2019年1月22日提出
【計算期間】	第24特定期間(自 2018年4月21日至 2018年10月22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
<b>追加型</b>	<b>内外</b>	不動産投信
		その他資産 ( )
		<b>資産複合</b>

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類の定義

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の投資信託財産とともに運用されるファンドをいう。
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	<b>グローバル</b> <b>(含む日本)</b>	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	<b>ファンド・オブ・ファンズ</b>
	年6回(隔月)	欧州	
	<b>年12回(毎月)</b>	アジア	為替ヘッジ
不動産投信	日々	オセアニア	
	その他( )	中南米	あり( )
<b>その他資産</b> <b>(投資信託証券</b> <b>(資産複合(株式一</b> <b>般、債券一般、不動</b> <b>産投信)) (資産配分</b> <b>固定型))</b>		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)	<b>なし</b>
		<b>エマージング</b>	

(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。

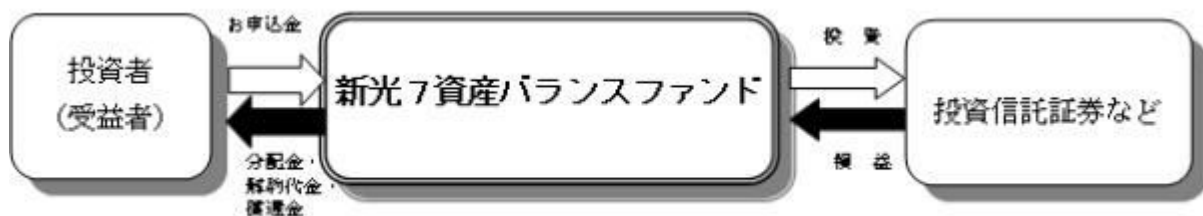
ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。
為替ヘッジなし <sup>(注)</sup>	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

(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

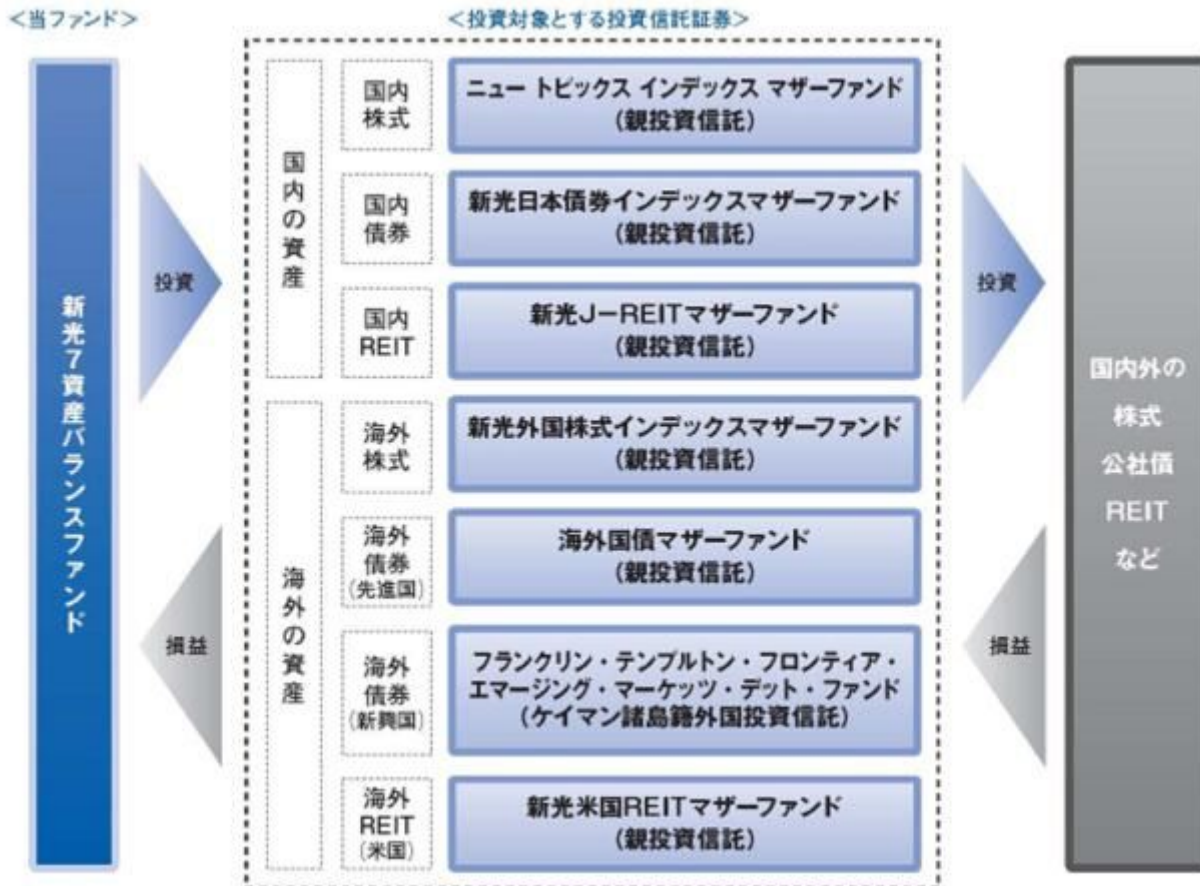
### 1. 7つの投資信託証券を通じて、国内外の各種資産(株式、公社債、不動産投資信託証券)にバランスよく分散投資します。

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。



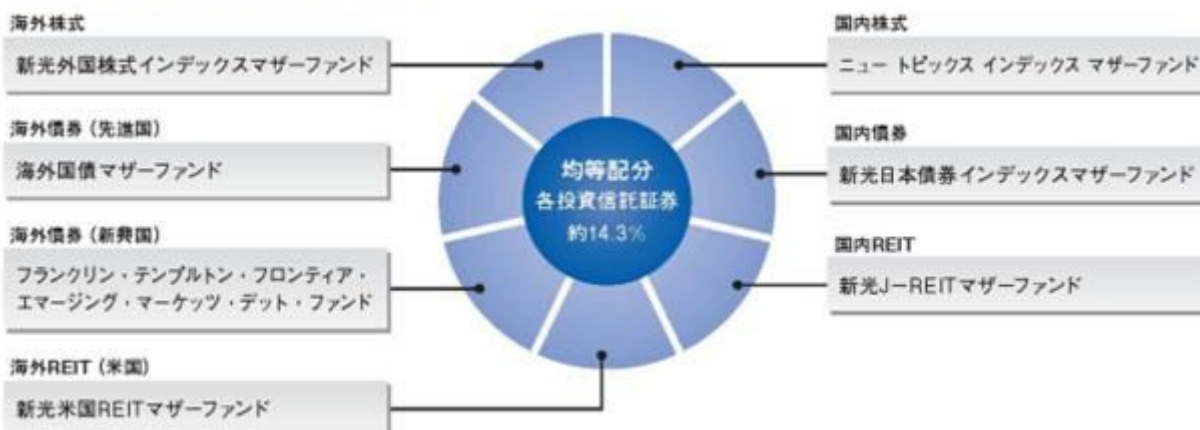
## 2. 基本投資配分比率に基づき、各投資信託証券に投資を行います。 基本投資配分比率は均等とします。

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)

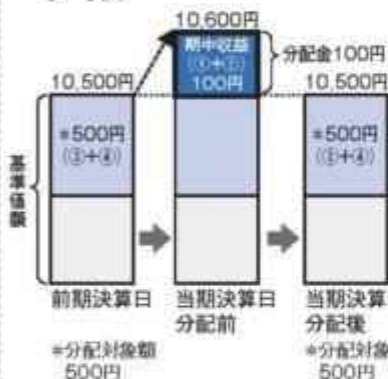
分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

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



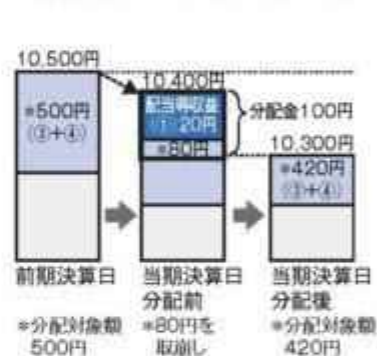
ケースB

<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

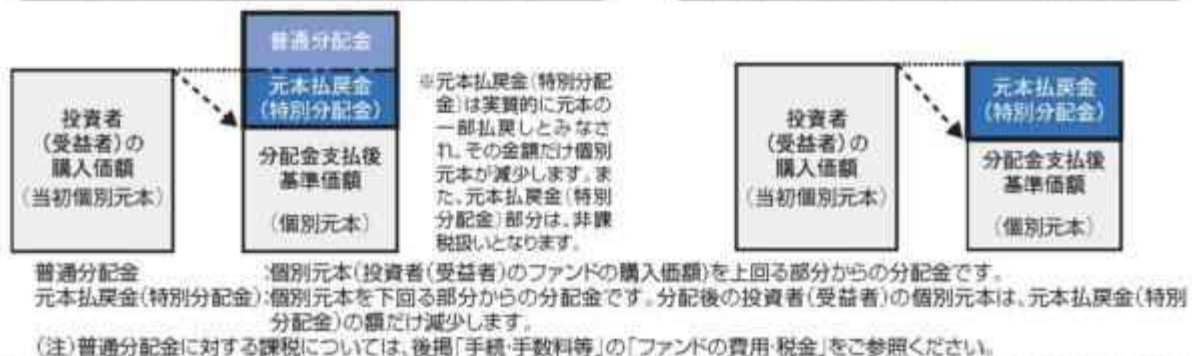
★A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。

※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】

2006年10月31日

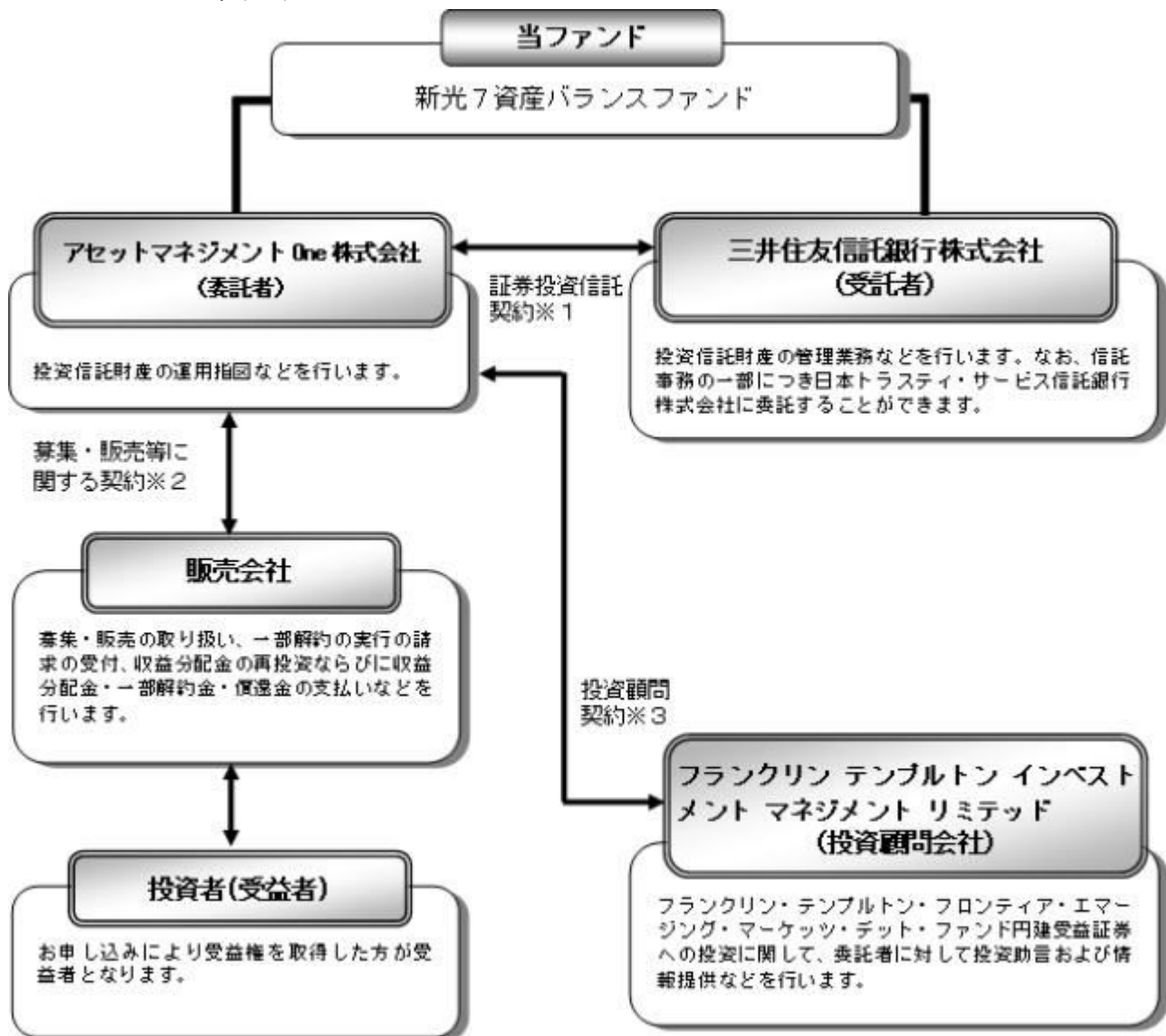
投資信託契約締結、ファンドの設定・運用開始

2016年10月1日

ファンドの委託会社としての業務を新光投信株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継

## (3) 【ファンドの仕組み】

## a. ファンドの仕組み



## 1 証券投資信託契約

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

## 2 募集・販売等に関する契約

委託者と販売会社との間において「証券投資信託に関する基本契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取り扱い、収益分配金および償還金の支払い、解約の取り扱い等を規定しています。

## 3 投資顧問契約

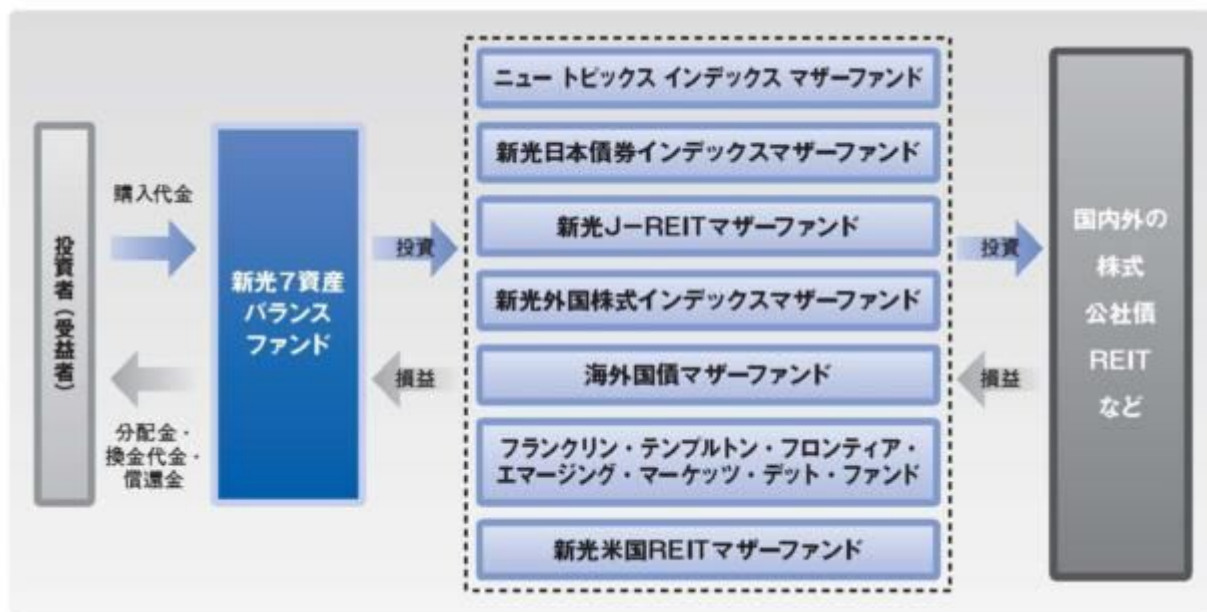
委託者と投資顧問会社との間において「投資顧問契約」を締結しており、投資顧問会社が提供する役務、委託者への報告、投資顧問会社に対する報酬、契約の期間等を規定しています。

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。



## b. 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

### 資本金の額

20億円（2018年10月31日現在）

### 委託会社の沿革

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

### 大株主の状況

（2018年10月31日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 <sup>1</sup>	70.0% <sup>2</sup>

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### a．基本方針

当ファンドは、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 - R E I T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 円建受益証券
内国証券投資信託（親投資信託）	新光米国R E I T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 テンプルトン 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。

１．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１０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るものとします。

（ロ）委託者は、信託金を、上記（イ）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

ます。)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"> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 株式の組入比率は、高位を保ちます。</li> <li>・ 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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 株式への投資割合には制限を設けません。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 外貨建資産への投資は行いません。</li> </ul>
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	2002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の指数値の動向がかい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実質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2018年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

## 2. 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"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への投資は行いません。</li> </ul>
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	2005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)

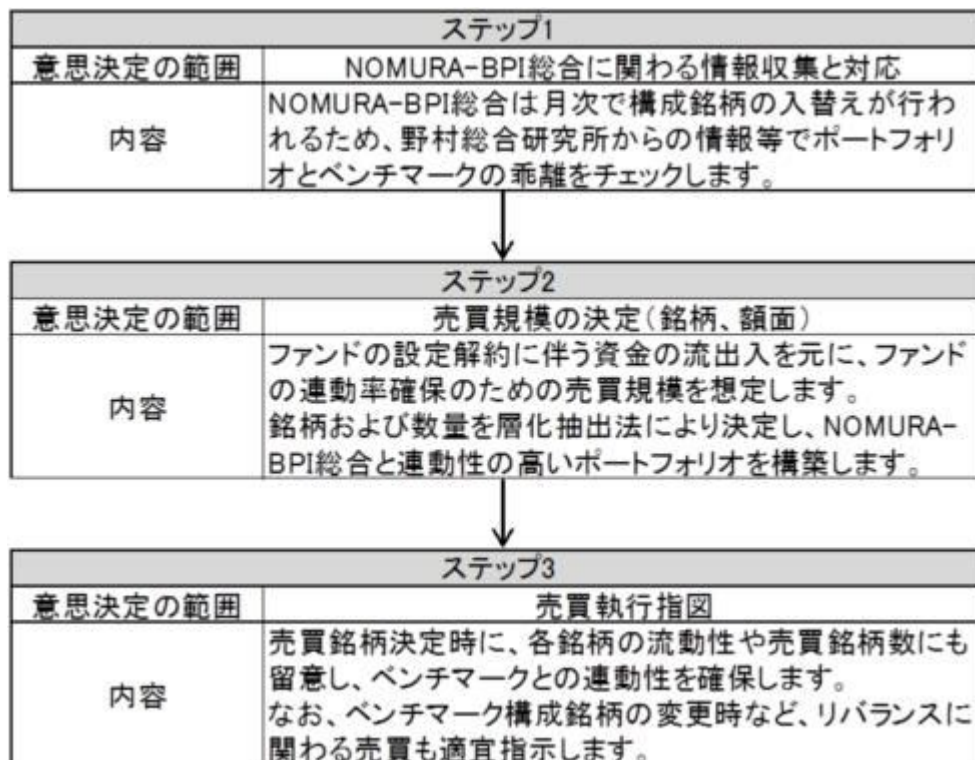
## NOMURA - B P I 総合について

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2018年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

### 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"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への直接投資は行いません。</li> </ul>
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	2006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。



東証REIT指数採用銘柄  
(東証上場REIT)

信用リスクのチェック

ポートフォリオの構築

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、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の組入比率を高位に維持

ポートフォリオのリスク管理

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2018年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

#### 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"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・株式の組入比率については、原則として高位を保ちます。</li> <li>・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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式への投資割合には制限を設けません。</li> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> </ul>
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	2005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。

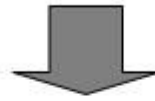
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

## 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2018年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

#### 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"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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"> <li>・通貨アロケーション</li> <li>・イールドカーブ戦略</li> <li>・セクターアロケーション</li> <li>・デュレーション調整</li> </ul> </li> <li>・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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には特に制限を設けません。</li> </ul>
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	2001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2018年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

#### 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"> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 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。</li> <li>・ 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 &amp; 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。</li> <li>・ 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 &amp; 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。</li> <li>・ 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。</li> </ul>
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>

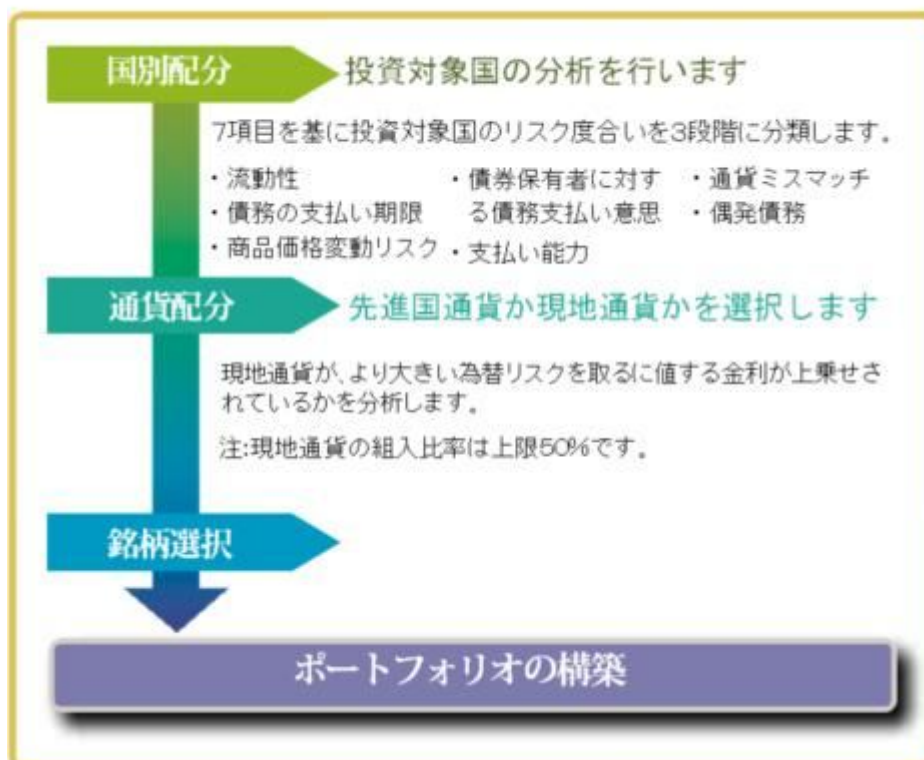
信託報酬等	運用報酬 : 純資産総額に対し0.40% その他報酬 : 純資産総額に対し0.15% (上限) その他報酬には、受託会社報酬、管理事務代行会社報酬、保管受託銀行報酬、監査報酬、法的費用が含まれます。
信託設定日	2006年3月8日
関係法人	受託会社兼管理事務代行会社: BNY メロン ファンド マネジメント(ケイマン) リミテッド 副管理事務代行会社: ザ バンク オブ ニューヨーク メロン シンガポール支店 保管受託銀行: ザ バンク オブ ニューヨーク メロン 管理会社: フランクリン テンプルトン インターナショナル サービスーズ エス エー アール エル 投資顧問会社: 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

### 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81.5兆円) 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9月末現在、1米ドル = 113.585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2018年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

### 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"> <li>・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。</li> <li>・REITの組入比率は原則として高位を保ちます。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・REITへの投資割合には制限を設けません。</li> <li>・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。</li> <li>・外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> </ul>
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	2006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)

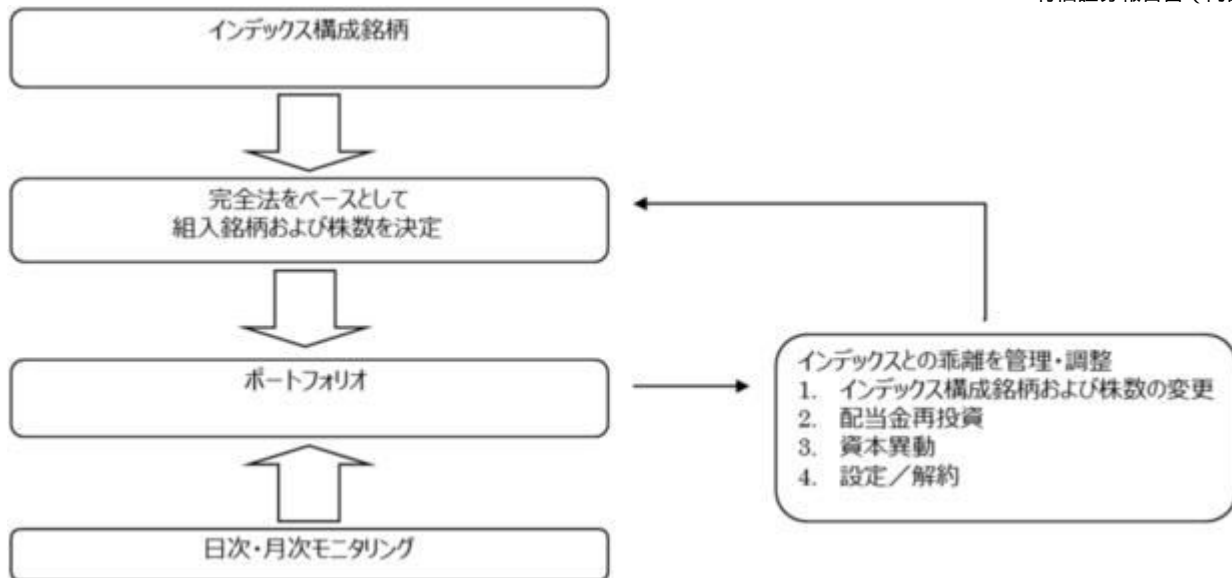
#### FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスについて

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<sup>(R)</sup>”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。



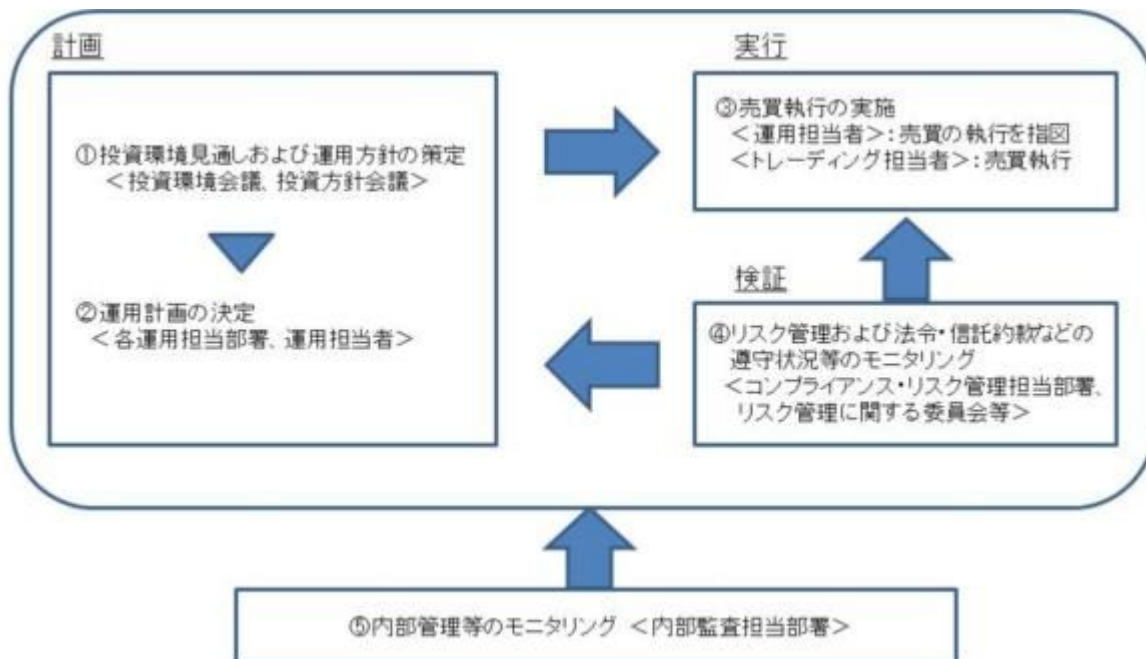
運用プロセスは2018年10月31日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

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2019年1月22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2018年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

### （4）【分配方針】

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

外貨建資産への実質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有価証券などに売買が生じた場合、その売買による組入有価証券などの価格の変化や売買手数料などの負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。この影響を受け、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。

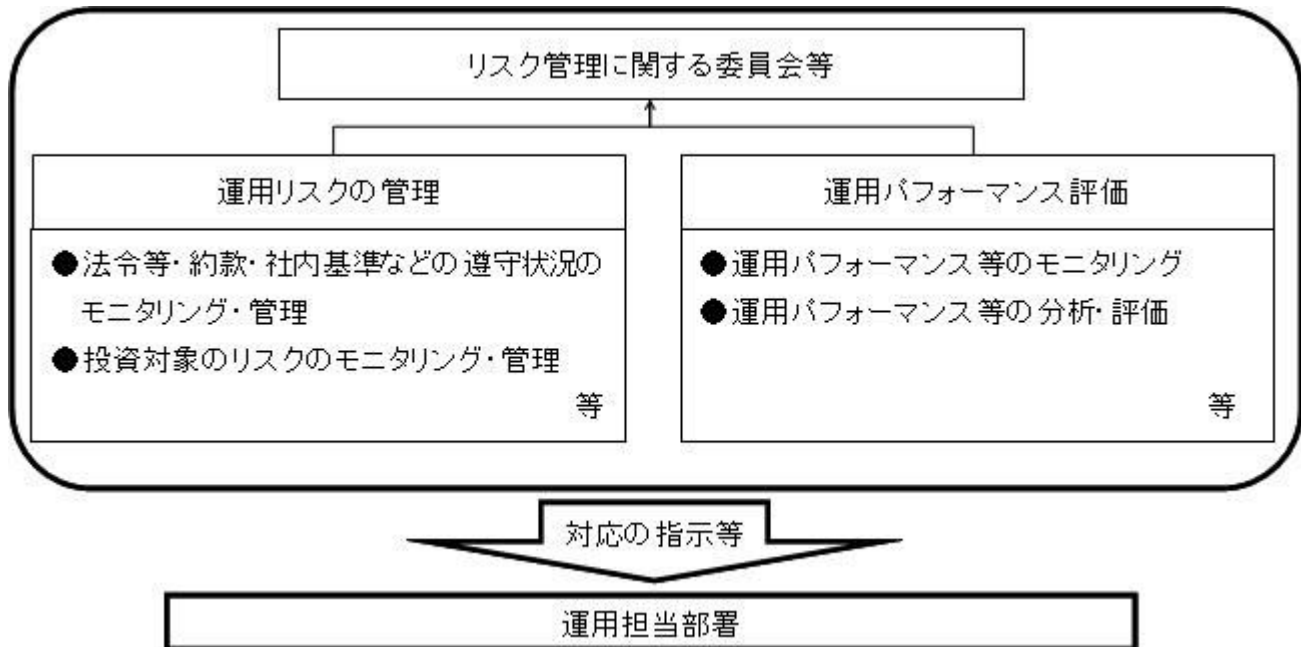
当ファンドが主要投資対象とする投資信託証券にはファミリーファンド方式を採用している場合があり、上記のような要因で、当ファンドの基準価額が変動する可能性があります。

#### (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2018年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## ＜参考情報＞

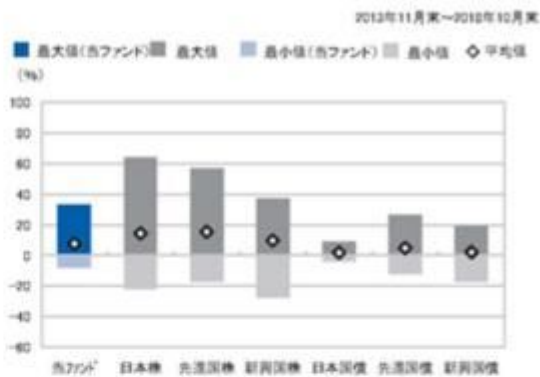
## ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



- 2013年11月 2014年10月 2015年10月 2016年10月 2017年10月 2018年10月
- 分配金再投資基準価額は、2013年11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11月から2018年10月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

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

## ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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	33.2	64.2	57.1	37.2	9.3	26.6
最小値	-18.0	-22.0	-17.5	-27.4	-4.0	-12.3
平均値	7.9	14.5	15.4	9.7	2.1	4.8

- 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11月から2018年10月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- 決算日に対応した数値とは異なります。
- 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

- 各資産クラスの指数
  - 日本株・・・東証株価指数(TOPX)(配当込み)
  - 先進国株・・・MSCIコクサイ・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-SP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・ディバースファイド(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。

- 「東証株価指数(TOPX)」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(関東証券取引所)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、関東証券取引所が有しています。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「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-SP国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切の責任を負いません。
- 「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・ディバースファイド」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、信頼性、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懸念について、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」<sup>1</sup>または「償還前乗り換え」<sup>2</sup>によりファンドの受益権を取得する場合、申込手数料の優遇を受けることができる場合があります。

ただし、上記の申込手数料の優遇に関しては、優遇制度の取り扱い、優遇の内容、優遇を受けるための条件等は販売会社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はいいます。
- 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はいいます。

## (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、2018年10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10月31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	644,800,000	12.75
親投資信託受益証券	日本	4,291,745,638	84.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		120,217,949	2.37
純資産総額		5,056,763,587	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10月31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	9,318,785,075	47.03
	カナダ	363,050,943	1.83
	ドイツ	2,741,785,286	13.83
	イタリア	2,380,045,496	12.01
	フランス	4,018,873,941	20.28
	イギリス	671,228,025	3.38
	小計		19,493,768,766
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		320,779,720	1.61
純資産総額		19,814,548,486	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10月31日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	7,193,256,460	95.96
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		302,160,672	4.03
純資産総額		7,495,417,132	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10月31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	3,219,503,756	60.15
	カナダ	185,772,015	3.47
	モーリシャス	331,128	0.00
	パナマ	3,390,939	0.06
	ドイツ	172,050,487	3.21
	イタリア	35,914,320	0.67
	フランス	190,970,913	3.56
	オランダ	89,892,732	1.67

	スペイン	56,168,919	1.04
	ベルギー	18,232,461	0.34
	オーストリア	4,541,339	0.08
	ルクセンブルグ	7,988,887	0.14
	フィンランド	25,880,688	0.48
	アイルランド	81,171,866	1.51
	ポルトガル	2,986,892	0.05
	イギリス	316,290,668	5.90
	スイス	175,453,438	3.27
	スウェーデン	47,637,626	0.89
	ノルウェー	15,871,657	0.29
	デンマーク	30,486,925	0.56
	ケイマン諸島	11,329,414	0.21
	リベリア	2,144,766	0.04
	オーストラリア	119,961,255	2.24
	バミューダ諸島	25,356,458	0.47
	ニュージーランド	4,372,671	0.08
	パプアニューギニア	1,875,748	0.03
	香港	44,782,790	0.83
	シンガポール	23,112,710	0.43
	イスラエル	11,513,394	0.21
	キュラソー	11,140,435	0.20
	ジャージー	25,442,003	0.47
	英ヴァージン諸島	1,107,949	0.02
	小計	4,962,677,249	92.72
投資証券	アメリカ	94,700,322	1.76
	カナダ	1,395,470	0.02
	フランス	3,221,011	0.06
	イギリス	3,021,088	0.05
	オーストラリア	6,730,623	0.12
	香港	2,714,210	0.05
	シンガポール	3,592,262	0.06
	小計	115,374,986	2.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		273,871,455	5.11
	純資産総額	5,351,923,690	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10月31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	10,027,553,800	79.78
地方債証券	日本	961,619,700	7.65
特殊債券	日本	948,410,000	7.54
社債券	日本	515,590,000	4.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		115,074,992	0.91
純資産総額		12,568,248,492	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10月31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	2,249,037,450	98.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		38,997,538	1.70
純資産総額		2,288,034,988	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10月31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	718,569,996	99.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,949,207	0.95
純資産総額		725,519,203	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10月31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J-REITマザーファンド	426,161,221	1.7311	737,727,689	1.7163	731,420,503	14.46
2	日本	親投資信託 受益証券	海外国債マザーファンド	328,992,704	2.2031	724,803,826	2.2186	729,903,213	14.43
3	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	577,583,847	1.2570	726,022,895	1.2610	728,333,231	14.40
4	日本	親投資信託 受益証券	新光米国REITマザーファンド	429,551,750	1.6264	698,622,966	1.6625	714,129,784	14.12
5	日本	親投資信託 受益証券	ニュー トビックス インデック ス マザーファンド	325,349,085	2.2255	724,064,388	2.1615	703,242,047	13.90
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	297,858,387	2.3542	701,218,214	2.2988	684,716,860	13.54
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	200,000	3,225	645,000,000	3,224	644,800,000	12.75

(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10月31日現在)

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	12.75
親投資信託受益証券	84.87
合計	97.62

#### (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10月31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	8,000,000	11,186.47	894,917,697	11,002.1471	880,171,775	2.7500	2028.02.15	4.44
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	10,893.58	871,486,856	10,728.7305	858,298,441	2.3750	2027.05.15	4.33
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	10,688.63	855,090,880	10,641.1309	851,290,475	2.2500	2027.02.15	4.29
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	10,734.15	858,732,189	10,591.5797	847,326,376	2.2500	2027.08.15	4.27
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	10,693.91	855,512,950	10,569.4586	845,556,692	2.2500	2027.11.15	4.26
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	10,448.02	835,841,811	10,465.0470	837,203,767	2.0000	2026.11.15	4.22
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	10,728.38	858,270,938	10,275.6905	822,055,241	1.6250	2026.02.15	4.14
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	10,701.10	856,088,662	10,242.0664	819,365,315	1.6250	2026.05.15	4.13
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	10,568.57	845,485,900	10,105.8005	808,464,042	1.5000	2026.08.15	4.08
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	11,325.54	792,788,146	11,109.2133	777,644,934	2.8750	2028.05.15	3.92
11	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4,000,000	15,475.52	619,021,041	15,293.4444	611,737,776	2.7500	2027.10.25	3.08
12	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4,400,000	13,491.16	593,611,166	13,442.7680	591,481,796	1.0000	2025.11.25	2.98
13	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4,300,000	12,526.01	538,618,724	12,614.3946	542,418,968	0.2500	2026.11.25	2.73
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,276.23	563,811,678	10,760.5848	538,029,244	2.2500	2025.11.15	2.71

15	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4,000,000	13,301.84	532,073,931	13,322.0439	532,881,756	1.0000	2027.05.25	2.68
16	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,200,000	16,184.74	517,911,955	15,751.9395	504,062,064	3.5000	2026.04.25	2.54
17	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000	13,262.43	450,922,867	13,232.1429	449,892,859	0.5000	2026.02.15	2.27
18	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,500,000	18,714.81	467,870,490	17,918.5536	447,963,840	6.0000	2025.10.25	2.26
19	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,500,000	12,499.52	437,483,438	12,695.3054	444,335,692	0.0000	2026.08.15	2.24
20	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,100,000	12,920.05	400,521,797	12,931.6166	400,880,117	0.5000	2026.05.25	2.02
21	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,000,000	13,048.74	391,462,346	12,914.9208	387,447,624	0.7500	2028.05.25	1.95
22	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000	12,502.91	375,087,521	12,887.9505	386,638,515	0.2500	2027.02.15	1.95
23	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000	18,013.20	360,264,130	16,435.1871	328,703,742	7.2500	2026.11.01	1.65
24	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,500,000	12,929.40	323,235,192	13,121.6930	328,042,327	0.5000	2027.08.15	1.65
25	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,500,000	12,918.15	322,953,931	13,045.9194	326,147,985	0.5000	2028.02.15	1.64
26	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000	17,985.33	359,706,744	15,918.8985	318,377,970	6.5000	2027.11.01	1.60
27	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,500,000	12,360.82	309,020,561	11,205.5175	280,137,938	1.2500	2026.12.01	1.41
28	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000	15,681.17	313,623,492	13,991.1642	279,823,284	4.5000	2026.03.01	1.41
29	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000	12,688.49	253,769,974	12,674.7567	253,495,134	0.2500	2028.08.15	1.27
30	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000	13,370.07	267,401,534	11,977.3818	239,547,636	2.0000	2025.12.01	1.20

(注)投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。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10月31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10月31日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	98.38
合計	98.38

(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10月31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	34,600	7,543.44	261,003,140	6,615.00	228,879,000	3.05



2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	213,000	859.71	183,120,000	684.80	145,862,400	1.94
3	日本	株式	ソニー	電気機器	20,800	5,541.51	115,263,512	6,140.00	127,712,000	1.70
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	12,700	8,935.97	113,486,925	9,048.00	114,909,600	1.53
5	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	20,800	5,204.46	108,252,960	4,750.00	98,800,000	1.31
6	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	21,600	5,151.70	111,276,798	4,414.00	95,342,400	1.27
7	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	26,200	3,935.85	103,119,309	3,241.00	84,914,200	1.13
8	日本	株式	キーエンス	電気機器	1,500	65,648.70	98,473,050	55,300.00	82,950,000	1.10
9	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	415,600	215.23	89,452,380	194.00	80,626,400	1.07
10	日本	株式	KDDI	情報・通信業	26,800	2,765.75	74,122,165	2,814.50	75,428,600	1.00
11	日本	株式	三菱商事	卸売業	21,400	3,262.53	69,818,215	3,180.00	68,052,000	0.90
12	日本	株式	任天堂	その他製品	1,900	44,128.73	83,844,600	35,160.00	66,804,000	0.89
13	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	21,200	2,756.86	58,445,456	3,037.00	64,384,400	0.85
14	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	12,800	4,592.48	58,783,779	4,893.00	62,630,400	0.83
15	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	21,900	2,665.96	58,384,566	2,844.50	62,294,550	0.83
16	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	2,800	20,872.97	58,444,316	21,650.00	60,620,000	0.80
17	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	11,100	5,372.71	59,637,189	5,346.00	59,340,600	0.79
18	日本	株式	ファナック	電気機器	2,900	31,076.73	90,122,544	19,735.00	57,231,500	0.76
19	日本	株式	村田製作所	電気機器	3,300	15,478.57	51,079,312	17,165.00	56,644,500	0.75
20	日本	株式	花王	化学	7,500	7,546.37	56,597,848	7,531.00	56,482,500	0.75
21	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	12,200	6,213.12	75,800,064	4,570.00	55,754,000	0.74
22	日本	株式	ダイキン工業	機械	4,200	13,593.94	57,094,584	13,125.00	55,125,000	0.73
23	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	5,500	11,384.89	62,616,949	9,875.00	54,312,500	0.72
24	日本	株式	キャノン	電気機器	16,700	4,223.97	70,540,380	3,222.00	53,807,400	0.71
25	日本	株式	日本電産	電気機器	3,700	16,750.17	61,975,660	14,490.00	53,613,000	0.71
26	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	18,000	3,555.75	64,003,604	2,906.50	52,317,000	0.69
27	日本	株式	信越化学工業	化学	5,400	11,751.17	63,456,322	9,469.00	51,132,600	0.68
28	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	28,600	1,452.46	41,540,382	1,747.00	49,964,200	0.66
29	日本	株式	日立製作所	電気機器	14,000	4,483.50	62,769,019	3,462.00	48,468,000	0.64
30	日本	株式	三井物産	卸売業	25,200	1,948.69	49,107,116	1,885.50	47,514,600	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10月31日現在)

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.32
		建設業	2.81
		食料品	4.12
		繊維製品	0.61

	パルプ・紙	0.29
	化学	6.81
	医薬品	4.87
	石油・石炭製品	0.85
	ゴム製品	0.77
	ガラス・土石製品	0.84
	鉄鋼	0.98
	非鉄金属	0.78
	金属製品	0.57
	機械	4.78
	電気機器	12.56
	輸送用機器	7.81
	精密機器	1.75
	その他製品	1.98
	電気・ガス業	1.78
	陸運業	4.29
	海運業	0.16
	空運業	0.56
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	7.34
	卸売業	4.92
	小売業	4.96
	銀行業	6.77
	証券、商品先物取引業	0.94
	保険業	2.39
	その他金融業	1.17
	不動産業	2.20
	サービス業	4.52
	合計	95.96

（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10月31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	6,339	19,907.71	126,194,975	24,158.3579	153,139,831	2.86

2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	9,389	9,570.47	89,857,143	11,748.4597	110,306,289	2.06
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	526	129,689.49	68,216,674	173,335.3688	91,174,404	1.70
4	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	3,403	15,788.44	53,728,075	15,941.3449	54,248,397	1.01
5	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	4,379	11,093.81	48,579,825	12,084.8419	52,919,523	0.98
6	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	3,068	20,289.39	62,247,868	16,560.8771	50,808,771	0.94
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	405	117,364.54	47,532,640	117,361.1456	47,531,264	0.88
8	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	5,317	9,453.81	50,265,919	8,922.6227	47,441,585	0.88
9	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	381	118,664.76	45,211,276	118,867.5013	45,288,518	0.84
10	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORPORATION	銀行	12,361	3,000.25	37,086,182	3,033.1028	37,492,184	0.70
11	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	1,624	20,987.07	34,083,015	23,031.4211	37,403,028	0.69
12	スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	3,923	9,415.86	36,938,450	9,496.9615	37,256,580	0.69
13	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	7,499	3,986.75	29,896,653	4,857.7214	36,428,053	0.68
14	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	1,236	24,136.83	29,833,133	29,252.7928	36,156,452	0.67
15	アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	5,911	6,116.04	36,151,913	5,967.6694	35,274,894	0.65
16	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	2,326	12,704.37	29,550,375	15,036.3976	34,974,661	0.65
17	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	5,285	5,104.62	26,977,960	6,589.4667	34,825,332	0.65
18	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	5,933	5,243.93	31,112,284	5,409.2976	32,093,363	0.59
19	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	3,163	9,875.13	31,235,066	10,101.6595	31,951,549	0.59

20	アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信 サービス	9,190	3,667.35	33,703,027	3,451.0322	31,714,986	0.59
21	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	6,110	3,856.50	23,563,233	5,049.1307	30,850,189	0.57
22	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	2,406	13,278.60	31,948,318	12,554.8711	30,207,020	0.56
23	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	1,465	18,491.96	27,090,722	19,960.9426	29,242,781	0.54
24	アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	716	29,753.40	21,303,436	39,630.8072	28,375,658	0.53
25	アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3,405	6,366.34	21,677,403	8,253.2560	28,102,337	0.52
26	アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	5,055	5,230.34	26,439,404	5,394.5738	27,269,571	0.50
27	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	2,759	9,213.13	25,419,037	9,796.5574	27,028,702	0.50
28	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	6,176	4,140.78	25,573,492	4,271.0346	26,377,910	0.49
29	アメリカ	株式	MASTERCARD INCORPORATED	ソフトウェア・サービス	1,219	16,908.58	20,611,565	21,262.2994	25,918,743	0.48
30	スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	930	25,670.62	23,873,685	27,053.7258	25,159,965	0.47

(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10月31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10月31日現在)

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.43
		素材	4.14

	資本財	6.56
	商業・専門サービス	0.99
	運輸	1.96
	自動車・自動車部品	1.14
	耐久消費財・アパレル	1.79
	消費者サービス	1.71
	メディア・娯楽	5.49
	小売	4.27
	食品・生活必需品小売り	1.61
	食品・飲料・タバコ	4.80
	家庭用品・パーソナル用品	1.84
	ヘルスケア機器・サービス	4.71
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.13
	銀行	8.20
	各種金融	4.05
	保険	3.61
	不動産	0.67
	ソフトウェア・サービス	7.78
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.53
	電気通信サービス	2.33
	公益事業	3.19
	半導体・半導体製造装置	2.69
投資証券		2.15
合計		94.88

(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10月31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	100.33	160,531,200	0.1000	2020.03.20	1.27
2	日本	国債証券	第306回利付 国債(10年)	150,000,000	103.68	155,526,000	102.12	153,184,500	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	100.38	150,576,000	0.1000	2020.06.20	1.19
4	日本	国債証券	第312回利付 国債(10年)	140,000,000	104.15	145,815,600	102.83	143,969,000	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	102.34	143,287,200	1.3000	2020.06.20	1.14
6	日本	国債証券	第126回利付 国債(5年)	140,000,000	100.74	141,044,400	100.51	140,718,200	0.1000	2020.12.20	1.11
7	日本	国債証券	第332回利付 国債(10年)	120,000,000	104.16	125,000,400	103.50	124,206,000	0.6000	2023.12.20	0.98
8	日本	国債証券	第128回利付 国債(5年)	120,000,000	100.83	120,997,200	100.59	120,712,800	0.1000	2021.06.20	0.96
9	日本	国債証券	第345回利付 国債(10年)	120,000,000	100.81	120,981,600	100.56	120,681,600	0.1000	2026.12.20	0.96
10	日本	国債証券	第127回利付 国債(5年)	120,000,000	100.78	120,946,800	100.54	120,658,800	0.1000	2021.03.20	0.96
11	日本	国債証券	第125回利付 国債(5年)	120,000,000	100.71	120,858,000	100.44	120,532,800	0.1000	2020.09.20	0.95
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	120.12	120,120,000	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	119.96	119,960,000	2.2200	2029.03.19	0.95
14	日本	国債証券	第340回利付 国債(10年)	110,000,000	103.46	113,810,000	102.93	113,224,100	0.4000	2025.09.20	0.90
15	日本	国債証券	第310回利付 国債(10年)	110,000,000	103.29	113,619,000	102.14	112,358,400	1.0000	2020.09.20	0.89
16	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	111.90	111,900,000	2.1100	2024.12.20	0.89
17	日本	国債証券	第132回利付 国債(5年)	110,000,000	101.01	111,118,700	100.78	110,862,400	0.1000	2022.06.20	0.88
18	日本	国債証券	第343回利付 国債(10年)	110,000,000	100.94	111,039,400	100.72	110,796,400	0.1000	2026.06.20	0.88
19	日本	国債証券	第344回利付 国債(10年)	110,000,000	100.88	110,972,400	100.62	110,691,900	0.1000	2026.09.20	0.88
20	日本	国債証券	第346回利付 国債(10年)	110,000,000	100.74	110,820,600	100.50	110,551,100	0.1000	2027.03.20	0.87
21	日本	地方債証券	第12回兵庫県 公募債(15 年)	100,000,000	104.82	104,829,000	104.74	104,740,000	0.7810	2030.12.06	0.83
22	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	104.11	104,110,000	0.8820	2023.06.16	0.82
23	日本	国債証券	第334回利付 国債(10年)	100,000,000	104.44	104,440,000	103.73	103,730,000	0.6000	2024.06.20	0.82
24	日本	国債証券	第325回利付 国債(10年)	100,000,000	104.38	104,385,000	103.53	103,530,000	0.8000	2022.09.20	0.82
25	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	103.42	103,420,000	0.6450	2024.03.15	0.82
26	日本	国債証券	第313回利付 国債(10年)	100,000,000	104.80	104,804,000	103.40	103,402,000	1.3000	2021.03.20	0.82
27	日本	社債券	第4回第一三共 社債	100,000,000	103.80	103,800,000	103.23	103,230,000	0.8460	2023.09.15	0.82
28	日本	特殊債券	第34回政府保 証地方公共団体 金融機構債券	100,000,000	103.90	103,900,000	103.10	103,100,000	0.9000	2022.03.14	0.82
29	日本	特殊債券	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	103.28	103,280,000	102.94	102,940,000	0.4840	2025.06.30	0.81
30	日本	特殊債券	第104回日本 高速道路保有・ 債務返済機構債 券	100,000,000	103.47	103,470,000	102.86	102,860,000	0.7150	2023.03.20	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。

#### □.種類別投資比率

(平成30年10月31日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	79.78
地方債証券	7.65
特殊債券	7.54
社債券	4.10
合計	99.08

(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10月31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	256	650,996.49	166,655,101	645,000	165,120,000	7.21
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	265	589,969.76	156,341,989	582,000	154,230,000	6.74
3	日本	投資証券	野村不動産マスタ-ファンド投資法人	785	150,272.45	117,963,881	146,300	114,845,500	5.01
4	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	500	208,195.1	104,097,550	208,400	104,200,000	4.55
5	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	584	174,671.86	102,008,366	171,900	100,389,600	4.38
6	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	527	175,189.89	92,325,072	172,600	90,960,200	3.97
7	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	331	253,958.03	84,060,107	247,000	81,757,000	3.57
8	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	355	232,276.71	82,458,232	227,600	80,798,000	3.53
9	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	258	288,792.38	74,508,436	288,200	74,355,600	3.24
10	日本	投資証券	GLP投資法人	656	112,601.15	73,866,354	111,700	73,275,200	3.20
11	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	168	401,006.47	67,369,088	403,000	67,704,000	2.95
12	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	767	81,786.91	62,730,562	80,300	61,590,100	2.69
13	日本	投資証券	アクティブア・プロパティーズ投資法人	127	480,468.7	61,019,526	468,000	59,436,000	2.59
14	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	82	708,987.97	58,137,014	699,000	57,318,000	2.50
15	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	683	73,097	49,925,251	70,500	48,151,500	2.10
16	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	88	521,000	45,848,000	517,000	45,496,000	1.98
17	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	926	46,698.72	43,243,014	46,700	43,244,200	1.89
18	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	304	140,294.56	42,649,549	139,600	42,438,400	1.85
19	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	61	679,000	41,419,000	689,000	42,029,000	1.83
20	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	175	224,983.34	39,372,085	225,200	39,410,000	1.72
21	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	90	437,500	39,375,000	432,500	38,925,000	1.70
22	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	214	160,105.12	34,262,496	164,100	35,117,400	1.53
23	日本	投資証券	産業ファンド投資法人	308	114,596.55	35,295,737	113,300	34,896,400	1.52
24	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	237	148,092.87	35,098,012	146,400	34,696,800	1.51
25	日本	投資証券	イオンリート投資法人	272	125,592.05	34,161,039	124,500	33,864,000	1.48
26	日本	投資証券	日本リート投資法人	85	366,474.51	31,150,333	367,000	31,195,000	1.36
27	日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	189	161,496.42	30,522,825	160,000	30,240,000	1.32
28	日本	投資証券	プレミアム投資法人	252	117,498.83	29,609,707	116,700	29,408,400	1.28

29	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	177	157,198.73	27,824,175	158,900	28,125,300	1.22
30	日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	101	268,616.26	27,130,243	270,100	27,280,100	1.19

(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10月31日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	98.29
合計	98.29

#### (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10月31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	2,780	17,005.98	47,276,650	18,229.1971	50,677,168	6.98
2	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	1,953	19,794.45	38,658,561	21,264.5647	41,529,695	5.72
3	アメリカ	投資証券	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	2,624	12,110.89	31,778,980	12,404.2351	32,548,713	4.48
4	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	3,967	7,202.20	28,571,141	7,432.1212	29,483,225	4.06
5	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	940	22,647.47	21,288,622	23,525.2351	22,113,721	3.04
6	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	502	46,924.75	23,556,225	42,675.2350	21,422,968	2.95
7	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	2,358	7,301.87	17,217,814	7,870.4372	18,558,491	2.55
8	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	874	20,156.88	17,617,115	20,229.3684	17,680,468	2.43
9	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	2,245	7,347.17	16,494,410	7,450.2427	16,725,795	2.30
10	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	1,286	12,750.81	16,397,543	11,775.6423	15,143,476	2.08
11	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	2,255	6,335.76	14,287,149	6,678.9423	15,061,015	2.07
12	アメリカ	投資証券	WEYERHAEUSER COMPANY	4,737	3,232.44	15,312,070	2,970.8097	14,072,726	1.93
13	アメリカ	投資証券	SBA COMMUNICATIONS CORP	721	17,485.07	12,606,742	18,373.0374	13,246,960	1.82
14	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	978	13,245.75	12,954,350	13,249.1543	12,957,673	1.78
15	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	1,837	6,625.70	12,171,429	6,954.1638	12,774,799	1.76
16	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	416	27,821.18	11,573,613	28,953.7860	12,044,775	1.66
17	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS	4,637	2,163.26	10,031,064	2,148.5421	9,962,790	1.37
18	アメリカ	投資証券	HCP INC	2,978	2,990.06	8,904,410	3,097.6608	9,224,834	1.27
19	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE	649	13,865.28	8,998,573	14,038.5778	9,111,037	1.25
20	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	1,092	7,737.92	8,449,812	7,698.2820	8,406,524	1.15
21	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	718	11,259.17	8,084,089	11,326.0000	8,132,068	1.12
22	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	752	9,874.00	7,425,253	10,303.2619	7,748,053	1.06
23	アメリカ	投資証券	UDR INC	1,636	4,461.31	7,298,705	4,568.9083	7,474,734	1.03
24	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	2,209	3,140.69	6,937,806	3,169.0149	7,000,354	0.96
25	アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORPORATION	941	7,186.34	6,762,352	7,349.4410	6,915,824	0.95
26	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT	452	13,919.65	6,291,684	14,373.8274	6,496,970	0.89
27	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	1,759	3,644.70	6,411,039	3,580.1483	6,297,481	0.86



28	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	568	10,535.44	5,984,133	10,508.2623	5,968,693	0.82
29	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	516	11,296.55	5,829,021	11,517.4089	5,942,983	0.81
30	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	541	10,688.34	5,782,395	10,937.5175	5,917,197	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10月31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10月31日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	99.04
合計	99.04

### 【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10月31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	18	日本円	301,990,832	295,380,000	3.94

(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10月31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	13	米ドル	1,854,385	210,027,644	1,745,445	197,689,100	3.69
	カナダ	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60IX	買建	1	カナダ ドル	188,976	16,333,195	177,320	15,325,767	0.28
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EURO ST50	買建	9	ユーロ	294,090	37,769,979	282,870	36,328,994	0.67
	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	154,200	12,373,008	144,300	11,578,632	0.21
	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	2	英ポンド	142,760	20,543,164	140,420	20,206,438	0.37

(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10月31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R E I T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
第24特定期間末（平成30年10月22日）	5,115,450,505	5,126,901,072	0.8935	0.8955
平成29年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	
5月末日	5,312,512,732		0.8930	
6月末日	5,318,377,880		0.9015	
7月末日	5,322,068,321		0.9090	
8月末日	5,277,437,930		0.9083	
9月末日	5,307,890,986		0.9223	

10月末日	5,056,763,587	0.8897
-------	---------------	--------

(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
第24特定期間	平成30年 4月21日～平成30年10月22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
第24特定期間	平成30年 4月21日～平成30年10月22日	1.9

(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
第24特定期間	平成30年 4月21日～平成30年10月22日	4,817,074	285,434,876

## 参考情報

## 運用実績

## &lt;基準価額・純資産の推移&gt; (2008年11月4日～2018年10月31日)



※基準価額は1万円当たり・信託報酬控除後の価額です。  
 ※分配金再投資基準価額は、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10月31日

## &lt;分配の推移(税引前)&gt;

2018年10月	20円
2018年9月	20円
2018年8月	20円
2018年7月	20円
2018年6月	20円
直近1年累計	240円
設定来累計	3,920円

※分配金は1万円当たりです。

## &lt;主要な資産の状況&gt;

## 組入状況

ファンド名	純資産比率
新光J-REITマザーファンド	14.46%
海外国債マザーファンド	14.43%
新光日本債券インデックスマザーファンド	14.40%
新光米国REITマザーファンド	14.12%
ニュー トピックス インデックス マザーファンド	13.90%
新光外国株式インデックスマザーファンド	13.54%
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	12.75%
合計	97.62%

## 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	3.05%
三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.94%
ソニー	電気機器	1.70%
ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.53%
日本電信電話	情報・通信業	1.31%

※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%	1.27%
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%	1.19%
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%	1.14%

※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	7.21%
ジャパリアルエステイト投資法人	6.74%
野村不動産マスターファンド投資法人	5.01%
日本リテールファンド投資法人	4.55%
ユナイテッド・アーバン投資法人	4.38%

※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。

データの基準日:2018年10月31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	2.86%
MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	2.06%
AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	1.70%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.01%
JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	0.98%

※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	2028/02/15	2.750%	米ドル	4.44%
US TREASURY N/B	2027/05/15	2.375%	米ドル	4.33%
US TREASURY N/B	2027/02/15	2.250%	米ドル	4.29%
US TREASURY N/B	2027/08/15	2.250%	米ドル	4.27%
US TREASURY N/B	2027/11/15	2.250%	米ドル	4.26%

※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・ファンドの状況(現地2018年10月12日現在)

## ①組入公社債の上位5通貨

通貨	比率
米ドル	67.4%
南アフリカランド	3.8%
メキシコペソ	3.6%
ウルグアイペソ	3.3%
コロンビアペソ	3.0%

## ②組入公社債の上位5カ国

国・地域	比率
アルゼンチン	6.4%
南アフリカ	5.6%
その他	5.2%
コロンビア	5.0%
メキシコ	4.7%

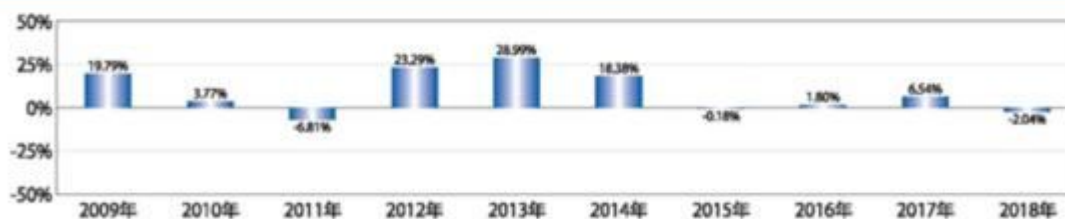
※フランクリン・テンプレトン・インベストメント・マネジメント・リミテッドからの情報を基に作成しております。  
 ※比率はフランクリン・テンプレトン・フロンティア・エマージング・マーケット・デット・ファンドの純資産総額に対する割合で、小数第2位を四捨五入しています。

## 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	6.98%
SIMON PROPERTY GROUP	5.72%
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	4.48%
PROLOGIS INC	4.06%
PUBLIC STORAGE	3.04%

※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。

## &lt;年間収益率の推移(暦年ベース)&gt;



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。  
 ※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。

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

(イ) 取得申込者は、「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」について、販売会社ごとに定める申込単位で、取得申込受付日の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。

## &lt; 主な投資対象の時価評価方法の原則 &gt;

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
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2021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30億口を下回るようになった場合、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24期特定期間(平成30年4月21日から平成30年10月22日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【新光7資産バランスファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第23期特定期間末 平成30年4月20日現在	第24期特定期間末 平成30年10月22日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	185,334,321	174,160,983
投資信託受益証券	658,620,000	645,000,000
親投資信託受益証券	4,509,067,312	4,312,459,978
流動資産合計	5,353,021,633	5,131,620,961
資産合計	5,353,021,633	5,131,620,961
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	12,011,803	11,450,567
未払受託者報酬	388,346	395,828
未払委託者報酬	4,223,256	4,304,616
未払利息	420	402
その他未払費用	19,406	19,043
流動負債合計	16,643,231	16,170,456
負債合計	16,643,231	16,170,456
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,005,901,647	5,725,283,845
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	669,523,245	609,833,340
(分配準備積立金)	375,532,653	410,358,465
元本等合計	5,336,378,402	5,115,450,505
純資産合計	5,336,378,402	5,115,450,505
負債純資産合計	5,353,021,633	5,131,620,961

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第23期特定期間		第24期特定期間	
	自	平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日	自	平成30年 4月21日 至 平成30年10月22日
営業収益				
受取配当金		87,975,000		84,900,000
有価証券売買等損益		138,346,438		45,392,666
その他収益		44,093		369
営業収益合計		50,327,345		130,293,035
営業費用				
支払利息		51,247		65,879
受託者報酬		2,363,591		2,326,660
委託者報酬		25,703,981		25,302,271
その他費用		118,116		115,535
営業費用合計		28,236,935		27,810,345
営業利益		78,564,280		102,482,690
経常利益		78,564,280		102,482,690
当期純利益		78,564,280		102,482,690
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		290,139		621,045
期首剰余金又は期首欠損金( )		528,055,834		669,523,245
剰余金増加額又は欠損金減少額		14,465,397		28,506,462
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		14,465,397		28,506,462
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,646,990		464,592
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,646,990		464,592
分配金		72,431,399		70,213,610
期末剰余金又は期末欠損金( )		669,523,245		609,833,340



## (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24期特定期間 自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22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。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間に関する事項 当特定期間終了日に該当する日が休業日のため、当特定期間は平成30年 4月21日から平成30年10月22日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第23期特定期間末 平成30年 4月20日現在	第24期特定期間末 平成30年10月22日現在
1. 特定期間末日における受益権の総数 6,005,901,647口	1. 特定期間末日における受益権の総数 5,725,283,845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 669,523,245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 609,833,340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)	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 0.8935円 (1万口当たり純資産額) (8,935円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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	第24期特定期間 自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22日
分配金の計算過程	<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>	<p>第137期(自 平成30年 4月21日 至 平成30年 5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(22,678,194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(6,452,117円)及び分配準備積立金(373,650,216円)より分配対象収益は402,780,527円(1万口当たり674.04円)であり、うち11,950,990円(1万口当たり20円)を分配しております。</p> <p>第138期(自 平成30年 5月22日 至 平成30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(18,644,625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(6,430,621円)及び分配準備積立金(380,103,533円)より分配対象収益は405,178,779円(1万口当たり685.90円)であり、うち11,814,187円(1万口当たり20円)を分配しております。</p> <p>第139期(自 平成30年 6月21日 至 平成30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(23,751,035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(6,435,204円)及び分配準備積立金(384,453,975円)より分配対象収益は414,640,214円(1万口当たり706.52円)であり、うち11,737,196円(1万口当たり20円)を分配しております。</p> <p>第140期(自 平成30年 7月21日 至 平成30年 8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(15,642,301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(6,465,153円)及び分配準備積立金(395,210,666円)より分配対象収益は417,318,120円(1万口当たり713.34円)であり、うち11,699,921円(1万口当たり20円)を分配しております。</p>

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	第24期特定期間 自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22日
	<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>	<p>第141期（自 平成30年 8月21日 至 平成30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（20,978,830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（6,435,556円）及び分配準備積立金（394,538,884円）より分配対象収益は421,953,270円（1万口当たり729.96円）であり、うち11,560,749円（1万口当たり20円）を分配しております。</p> <p>第142期（自 平成30年 9月21日 至 平成30年10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（21,633,037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（6,446,427円）及び分配準備積立金（400,175,995円）より分配対象収益は428,255,459円（1万口当たり747.99円）であり、うち11,450,567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23期特定期間 自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日	第24期特定期間 自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2.金融商品の内容及びリスク	<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23期特定期間 自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日	第24期特定期間 自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22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23期特定期間末 平成30年 4月20日現在	第24期特定期間末 平成30年10月22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>

第23期特定期間末 平成30年 4月20日現在	第24期特定期間末 平成30年10月22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23期特定期間 自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日	第24期特定期間 自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22日
	該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

区分	第23期特定期間末 平成30年 4月20日現在	第24期特定期間末 平成30年10月22日現在
期首元本額	6,125,381,994円	6,005,901,647円
期中追加設定元本額	45,095,213円	4,817,074円
期中一部解約元本額	164,575,560円	285,434,876円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第23期特定期間末 平成30年 4月20日現在	第24期特定期間末 平成30年10月22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	1,620,000	4,800,000
親投資信託受益証券	60,904,040	101,585,705
合計	59,284,040	106,385,705

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	200,000	645,000,000	
投資信託受益証券 小計		200,000	645,000,000	
親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	328,992,704	724,803,826	
	ニュー トピックス インデックス マザーファンド	325,349,085	724,064,388	
	新光外国株式インデックスマザーファンド	297,858,387	701,218,214	
	新光日本債券インデックスマザーファンド	577,583,847	726,022,895	
	新光J - R E I Tマザーファンド	426,161,221	737,727,689	
	新光米国 R E I Tマザーファンド	429,551,750	698,622,966	
親投資信託受益証券 小計		2,385,496,994	4,312,459,978	
合計		2,385,696,994	4,957,459,978	

（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30年5月31日現在の財務書類は、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「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

2018年5月31日現在

	2018年 (日本円)	2017年 (日本円)
<b>資産</b>		
<b>流動資産</b>		
純損益を通じて公正価値で測定する金融資産	29,518,931,969	19,374,319,731
発行に係る未収入金	-	136,471,941
現金および現金同等物	2,293,049,447	2,474,572,696
その他の債権	2,828,809	5,478,574
<b>資産合計</b>	<b>31,814,810,225</b>	<b>21,990,842,942</b>
<b>負債</b>		
<b>流動負債</b>		
償還に係る未払金	-	2,892,780
ブローカーに対する債務	430,952,768	-
未払費用	36,512,893	25,447,393
<b>負債合計</b>	<b>467,465,661</b>	<b>28,340,173</b>
受益証券保有者に帰属する純資産	31,347,344,564	21,962,502,769

#### 投資ポートフォリオ(無監査)

2018年5月31日終了会計年度

	公正価値 2018年 (日本円)	公正価値 2017年 (日本円)
<b>債券</b>		
<b>アンゴラ</b>		
Angolan Government International Bond 9.50% due 12/11/2025 REGS	1,101,270,519	640,103,230
Republic of Angola (Northern Lights III BV) 7.00% due 17/08/2019 REGS	-	135,149,639
<b>アンゴラ合計</b>	<b>1,101,270,519</b>	<b>775,252,869</b>
<b>アルゼンチン</b>		
Provincia De Tierra Del Fuego Argentina 8.95% due 17/04/2027 REGS	558,060,753	107,736,737
Provincia Del Chubut Argentina 7.75% due 26/07/2026 REGS	371,043,510	434,794,545
Republic of Argentina 5.875% due 11/01/2028	362,411,306	-
<b>アルゼンチン合計</b>	<b>1,291,515,569</b>	<b>542,531,282</b>
<b>アルメニア</b>		
Republic of Armenia International Bond 7.15% due 26/03/2025 REGS	785,937,974	586,980,870
<b>アルメニア合計</b>	<b>785,937,974</b>	<b>586,980,870</b>
<b>アゼルバイジャン</b>		
International Bank of Azerbaijan Ojsc 5.625% due 11/06/2019 REGS	535,248,042	565,124,044

Southern Gas Corridor 6.875% due 24/03/2026 REGS	383,427,376	-
アゼルバイジャン合計	918,675,418	565,124,044
ベラルーシ		
Republic of Belarus International Bond 6.20% due 28/02/2030 REGS	118,592,053	-
ベラルーシ合計	118,592,053	-
ボスニア・ヘルツェゴビナ		
Bosnia and Herzegovina due 20/12/2021 REGS	634,645,076	747,901,086
ボスニア・ヘルツェゴビナ合計	634,645,076	747,901,086
ブラジル		
Brazil Republic of 2.625% due 05/01/2023	436,523,834	-
Caixa Economica Federal 4.25% due 13/05/2019 REGS	420,522,193	433,430,059
Rio Oil Finance Trust Series 2018-1 8.20% due 06/04/2028 REGS	169,438,098	-
ブラジル合計	1,026,484,125	433,430,059
カメルーン		
Republic of Cameroon International Bond 9.50% due 19/11/2025 REGS	573,665,713	462,575,128
カメルーン合計	573,665,713	462,575,128
	公正価値 2018年 (日本円)	公正価値 2017年 (日本円)
債券(続き)		
中国		
CNAC HK Finbridge Co Ltd 4.875% due 14/03/2025 REGS	584,116,899	-
中国合計	584,116,899	-
コロンビア		
Bogota Distrito Capital 9.75% due 26/07/2028 REGS	581,061,038	242,478,847
Ecopetrol SA 4.125% due 16/01/2025	303,221,382	315,008,411
Empresa De Telecomunicaciones De Bogota SA 7.00% due 17/01/2023 REGS	400,986,440	382,545,517
Republic of Colombia 4.375% due 12/07/2021	292,794,837	-
コロンビア合計	1,578,063,697	940,032,775
ドミニカ共和国		
Dominican Republic 8.90% due 15/02/2023 REGS	302,965,804	-
Mestenio Ltd 8.50% due 02/01/2020 REGS	91,087,662	153,014,112
ドミニカ共和国合計	394,053,466	153,014,112
エジプト		
Arab Republic Egypt 7.50% due 31/01/2027 REGS	-	60,183,760
Egypt Government Bond 16.40% due 05/09/2020	55,955,249	-
Egypt Government Bond 18.15% due 13/06/2020	177,436,457	-
エジプト合計	233,391,706	60,183,760
エルサルバドル		



Republic of El Salvador 7.65% due 15/06/2035	482,184,563	312,442,961
エルサルバドル合計	482,184,563	312,442,961
<b>エチオピア</b>		
Federal Democratic Republic of Ethiopia 6.625% due 11/12/2024 REGS	536,752,709	379,945,795
エチオピア合計	536,752,709	379,945,795
<b>ガボン</b>		
Republic of Gabon 6.95% due 16/06/2025 REGS	476,208,190	331,531,851
ガボン合計	476,208,190	331,531,851
<b>ジョージア</b>		
Georgian Oil & Gas Corp 6.75% due 26/04/2021 REGS	299,914,572	317,445,869
Georgian Railway LLC 7.75% due 11/07/2022	140,404,816	151,133,799
ジョージア合計	440,319,388	468,579,668
<b>ガーナ</b>		
Ghana Government International Bond 8.125% due 18/01/2026 REGS	236,748,990	-
Ghana Govt 18.25% due 25/07/2022	719,041,623	-
Ghana Govt 23.00% due 21/08/2017	-	898,297,307
Ghana Govt 24.75% due 19/07/2021	118,378,187	-
Saderea DAC 12.50% due 30/11/2026 REGS	100,738,921	-
ガーナ合計	1,174,907,721	898,297,307
	公正価値 2018年 (日本円)	公正価値 2017年 (日本円)
<b>債券(続き)</b>		
<b>インドネシア</b>		
Indonesia Republic of 3.375% due 15/04/2023 REGS	691,171,970	-
インドネシア合計	691,171,970	-
<b>イラク</b>		
Oilflow SPV 1 DAC (Krg) 12.00% due 13/01/2022 REGS	196,824,873	82,793,793
Republic of Iraq 5.80% due 15/01/2028 REGS	311,279,273	799,335,707
イラク合計	508,104,146	882,129,500
<b>ジャマイカ</b>		
Government of Jamaica 7.875% due 28/07/2045	402,317,233	202,121,428
ジャマイカ合計	402,317,233	202,121,428
<b>ヨルダン</b>		
Jordan Kingdom 6.125% due 29/01/2026 REGS	438,051,760	93,428,459
ヨルダン合計	438,051,760	93,428,459
<b>カザフスタン</b>		
Astana Finance JSC 0% due 22/12/2024 REGS	856,543	3,353,870
Development Bank of Kazakhstan JSC 9.50% due 14/12/2020 REGS	183,162,974	-

Kazakhstan Government International Bond 4.875% due 14/10/2044 REGS	454,509,535	233,188,518
Kazakhstan Temir Zholy National Co JSC 4.85% due 17/11/2027 REGS	224,127,049	-
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	216,984,171	248,209,289
カザフスタン合計	1,079,640,272	630,891,196
<b>ケニア</b>		
Kenya Government International Bond 6.875% due 24/06/2024 REGS	261,403,467	176,528,294
Kenya Infrastructure Bond 11.00% due 15/09/2025	313,963,370	414,125,215
Kenya Infrastructure Bond 12.50% due 12/05/2025	302,899,692	-
Kenya Infrastructure Bond 12.50% due 10/01/2033	17,354,804	-
ケニア合計	895,621,333	590,653,509
<b>メキシコ</b>		
Mexican Fixed Rate Bonds 5.00% due 11/12/2019	914,250,451	590,635,795
Mexican Udibonos 4.00% due 15/11/2040 Index Linked	-	207,238,627
Mexican Udibonos 4.50% due 04/12/2025 Index Linked To Mxudi	88,927,571	96,457,707
Mexico City Airport Trust 4.25% due 31/10/2026 REGS	202,656,597	45,737,500
Mexico City Airport Trust 5.50% due 31/07/2047 REGS	112,095,738	-
メキシコ合計	1,317,930,357	940,069,629
	公正価値 2018年 (日本円)	公正価値 2017年 (日本円)
<b>債券(続き)</b>		
<b>モザンビーク</b>		
Mozambique International Bond 10.50% due 18/01/2023 REGS	339,121,321	313,154,834
モザンビーク合計	339,121,321	313,154,834
<b>ペルー</b>		
Iirsa Norte Finance Ltd 8.75% due 30/05/2024 REGS	188,240,445	-
Lima Metro Line 2 Finance Ltd 5.875% due 05/07/2034 REGS	553,959,361	597,596,017
Peruvian Government International Bond 6.35% due 12/08/2028 REGS	414,818,481	65,476,624
ペルー合計	1,157,018,287	663,072,641
<b>ロシア</b>		
Russia Govt Bond - Ofz 7.00% due 16/08/2023	297,832,008	-
Russia Govt Bond - Ofz 7.50% due 15/03/2018	-	472,615,238
Rzd Capital PLC (Russian Railways) 5.70% due 05/04/2022 REGS	423,568,556	446,661,045
ロシア合計	721,400,564	919,276,283
<b>南アフリカ</b>		
South Africa Republic of 4.30% due 12/10/2028	581,270,029	-

South Africa Republic of 7.00% due 28/02/2031	1,286,763,778	1,205,645,819
南アフリカ合計	1,868,033,807	1,205,645,819
スリランカ		
National Savings Bank 8.875% due 18/09/2018 REGS	245,883,634	204,379,676
スリランカ合計	245,883,634	204,379,676
国際機関		
Banque Ouest Africaine De Developpement 5.00% due 27/07/2027 REGS	321,874,094	-
European Bank For Reconstruction & Development Frn due 21/02/2019	132,440,333	-
International Finance Corp 10.25% due 05/12/2018	82,486,770	86,739,579
国際機関合計	536,801,197	86,739,579
スリナム		
Republic of Suriname 9.00% due 28/06/2019	162,840,460	-
Suriname, Republic of 9.25% due 26/10/2026 REGS	219,450,148	114,795,997
スリナム合計	382,290,608	114,795,997
トリニダード・トバゴ		
Petro Co Trin/Tobago Ltd 9.75% due 14/08/2019 REGS	790,432,803	829,555,691
トリニダード・トバゴ合計	790,432,803	829,555,691
チュニジア		
Banque Cent de Tunisie International Bond 5.75% due 30/01/2025 REGS	723,654,978	-
チュニジア合計	723,654,978	-
	公正価値 2018年 (日本円)	公正価値 2017年 (日本円)
債券(続き)		
トルコ		
Export Credit Bank of Turkey 6.125% due 03/05/2024 REGS	323,744,915	-
Turkey Government Bond 8.70% due 11/07/2018	782,542,486	796,033,386
Turkey Republic of 4.875% due 16/04/2043	583,625,571	-
トルコ合計	1,689,912,972	796,033,386
ウガンダ		
Republic of Uganda Government Bonds 10.75% due 22/02/2018	-	93,876,161
Republic of Uganda Government Bonds 13.75% due 13/06/2019	221,263,595	225,183,780
Republic of Uganda Government Bonds 14.625% due 01/11/2018	5,685,024	5,941,222
Republic of Uganda Government Bonds 16.125% due 22/03/2018	-	141,721,143
ウガンダ合計	226,948,619	466,722,306
ウクライナ		
City of Kyiv (CSFB) 8.00% due 06/11/2015	502,009,597	402,394,752

Ukraine Government 7.375% due 25/09/2032 REGS	608,797,135	-
ウクライナ合計	1,110,806,732	402,394,752
ウルグアイ		
Uruguay Republic of 3.70% due 26/06/2037 Index Linked	989,454,764	924,840,605
ウルグアイ合計	989,454,764	924,840,605
債券合計	28,465,382,143	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 REGS	936,765,666	1,138,498,173
ナイジェリア合計	936,765,666	1,138,498,173
ベネズエラ		
Venezuela Republic of WRD Exp 15/04/2020	116,784,160	312,092,701
ベネズエラ合計	116,784,160	312,092,701
原油ワラント合計	1,053,549,826	1,450,590,874
投資ポートフォリオ	29,518,931,969	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30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	183,002,707	227,140,008
国債証券	21,071,774,161	19,337,517,372
未収利息	117,157,946	145,693,651
前払費用	55,306,725	20,748,729
流動資産合計	21,427,241,539	19,731,099,760
資産合計	21,427,241,539	19,731,099,760
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払利息	415	524
流動負債合計	415	524
負債合計	415	524
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	9,642,136,028	8,955,905,478
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	11,785,105,096	10,775,193,758

	平成30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
元本等合計	21,427,241,124	19,731,099,236
純資産合計	21,427,241,124	19,731,099,236
負債純資産合計	21,427,241,539	19,731,099,760

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22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30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
1. 計算日における受益権の総数 9,642,136,028口	1. 計算日における受益権の総数 8,955,905,478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 2.2223円 (1万口当たり純資産額) (22,223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 2.2031円 (1万口当たり純資産額) (22,031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10月21日 至 平成30年 4月20日	自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 また、当ファンドは、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

区分	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日	自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22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、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。</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	<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30年 4月20日現在	平成30年10月22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</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10月21日 至 平成30年 4月20日	自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22日
	該当事項はありません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	10,478,644,216円	9,642,136,028円
期中追加設定元本額	32,599,920円	26,241,436円
期中一部解約元本額	869,108,108円	712,471,986円
同期末における元本の内訳		
海外国債ファンド	7,029,474,252円	6,501,857,583円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	1,154,979,912円	1,090,903,565円
新光7資産バランスファンド	341,575,843円	328,992,704円
海外国債ファンド（1年決算型）	29,110,123円	25,561,050円
海外国債ファンド（変額年金）	1,070,465,822円	993,302,594円
グローバル・ナビ	16,530,076円	15,287,982円
合計	9,642,136,028円	8,955,905,478円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成30年 4月20日現在	平成30年10月22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	346,244,104	608,705,024
合計	346,244,104	608,705,024

(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-2.25%-25/11/15	5,000,000.00	4,716,015.64	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	8,000,000.00	7,201,875.02	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	8,000,000.00	7,175,625.03	
		US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	8,000,000.00	7,081,250.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	8,000,000.00	7,333,125.04	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	8,000,000.00	7,456,875.04	
		US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	8,000,000.00	7,519,375.04	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	8,000,000.00	7,421,875.04	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	8,000,000.00	7,406,250.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	8,000,000.00	7,711,250.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	7,000,000.00	6,813,515.66	
		US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	2,000,000.00	1,945,312.50	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	2,000,000.00	1,855,937.50	
米ドル建小計			88,000,000.00	81,638,281.51 (9,183,490,287)	
カナダドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	1,000,000.00	932,770.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	1,500,000.00	1,328,340.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	2,000,000.00	1,916,200.00	
カナダドル建小計			4,500,000.00	4,177,310.00 (358,413,198)	
ユーロ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	3,400,000.00	3,489,522.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-26/08/15	3,500,000.00	3,444,350.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	3,000,000.00	2,996,700.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	1,000,000.00	1,536,850.00	



		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15	2,500,000.00	2,539,125.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	1,000,000.00	1,480,800.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-28/02/15	2,500,000.00	2,527,050.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-28/08/15	2,000,000.00	1,963,480.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%-48/08/15	1,000,000.00	1,048,980.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-25/12/01	2,000,000.00	1,848,600.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-26/03/01	2,000,000.00	2,157,400.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%-26/06/01	2,000,000.00	1,786,200.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	2,000,000.00	2,541,000.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%-26/12/01	2,500,000.00	2,159,000.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%-27/06/01	2,000,000.00	1,831,800.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%-27/08/01	2,000,000.00	1,802,000.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	2,000,000.00	2,458,000.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-28/02/01	2,000,000.00	1,784,200.00	
		FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,500,000.00	3,477,000.00	
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	4,400,000.00	4,583,920.00	
		FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	3,200,000.00	3,918,720.00	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	3,100,000.00	3,104,960.00	
		FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	4,300,000.00	4,197,230.00	
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	4,000,000.00	4,123,600.00	
		FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	4,000,000.00	4,718,400.00	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	3,000,000.00	2,984,400.00	
ユーロ建小計			66,900,000.00	70,503,287.00	(9,118,895,140)
英債券	国債証券	TSY-1.5%-26/07/22	1,200,000.00	1,213,260.00	
		TSY-1.25%-27/07/22	1,300,000.00	1,278,355.00	
		TSY-4.25%-27/12/07	1,300,000.00	1,613,755.00	
		TSY-1.625%-28/10/22	500,000.00	503,175.00	
英債券建小計			4,300,000.00	4,608,545.00	(676,718,747)
合計				19,337,517,372	(19,337,517,372)

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 13銘柄	46.5%	47.5%
カナダドル	債券 3銘柄	1.8%	1.9%
ユーロ	債券 26銘柄	46.2%	47.2%
英ポンド	債券 4銘柄	3.4%	3.5%

（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30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	235,107,884	278,512,898
株式	9,042,592,480	7,176,270,630
派生商品評価勘定	8,460,140	898,056
未収入金	624,352	-
未収配当金	87,574,231	64,228,195
前払金	-	7,915,000
流動資産合計	9,374,359,087	7,527,824,779
資産合計	9,374,359,087	7,527,824,779
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	8,053,564
前受金	9,080,000	-
未払金	-	44,876,395
未払解約金	41,210,000	3,500,000
未払利息	533	643
流動負債合計	50,290,533	56,430,602
負債合計	50,290,533	56,430,602
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	4,098,246,220	3,357,158,939
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,225,822,334	4,114,235,238

	平成30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
元本等合計	9,324,068,554	7,471,394,177
純資産合計	9,324,068,554	7,471,394,177
負債純資産合計	9,374,359,087	7,527,824,779

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

平成30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
1. 担保資産 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の通り差入を行っております。 株式 160,403,750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 154,124,550円
2. 計算日における受益権の総数 4,098,246,220口	2. 計算日における受益権の総数 3,357,158,939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 2.2751円 (1万口当たり純資産額) (22,751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 2.2255円 (1万口当たり純資産額) (22,255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10月21日 至 平成30年 4月20日	自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22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、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

区分	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日	自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22日
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30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。 2.時価の算定方法 株式 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載して おります。 派生商品評価勘定 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載して おります。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に 近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりま す。	1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2.時価の算定方法 同左

## (関連当事者との取引に関する注記)

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

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

区分	平成30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首にお ける当該親投資信託の元本額	5,186,122,788円	4,098,246,220円
期中追加設定元本額	175,144,985円	145,227,410円
期中一部解約元本額	1,263,021,553円	886,314,691円

区分	平成30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
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	269,586,137円	258,907,293円
新光7資産バランスファンド	330,753,274円	325,349,085円
ニュー トピックス インデックス(変額年金)	130,456,477円	112,857,450円
新光世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	804,445,787円	564,195,780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)	841,698,741円	460,255,379円
新光世界バランス35VAT(適格機関投資家私募)	36,384,531円	28,347,460円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	1,205,482,988円	1,156,525,727円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	431,936,520円	409,018,053円
グローバル・ナビ	21,951,511円	19,692,577円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	5,064,967円	4,777,923円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	17,271,049円	14,528,908円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	3,214,238円	2,703,304円
合計	4,098,246,220円	3,357,158,939円

## 2 有価証券関係

### 売買目的有価証券

種類	平成30年 4月20日現在	平成30年10月22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	627,982,573	736,698,825
合計	627,982,573	736,698,825

(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30年 4月20日現在				平成30年10月22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	254,114,860	-	262,575,000	8,460,140	295,390,508	-	288,235,000	7,155,508
東証株価指数先物	254,114,860	-	262,575,000	8,460,140	295,390,508	-	288,235,000	7,155,508
合計	254,114,860	-	262,575,000	8,460,140	295,390,508	-	288,235,000	7,155,508

### 時価の算定方法

## 先物取引

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

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

(単位:円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	100	3,110.00	311,000	
日本水産	3,800	738.00	2,804,400	
マルハニチロ	600	4,030.00	2,418,000	
カネコ種苗	100	1,451.00	145,100	
サカタのタネ	500	3,695.00	1,847,500	
ホクト	300	1,941.00	582,300	
ホクリヨウ	100	788.00	78,800	
日鉄鉱業	100	4,920.00	492,000	
三井松島ホールディングス	200	1,869.00	373,800	
国際石油開発帝石	16,300	1,424.00	23,211,200	
石油資源開発	500	2,505.00	1,252,500	
K&Oエナジーグループ	200	1,589.00	317,800	
ショーボンドホールディングス	300	8,510.00	2,553,000	
ミライト・ホールディングス	1,100	1,889.00	2,077,900	
TATERU	500	529.00	264,500	
スペースバリューホールディングス	500	1,037.00	518,500	
ダイセキ環境ソリューション	100	911.00	91,100	
安藤・間	2,700	800.00	2,160,000	
東急建設	1,300	1,040.00	1,352,000	
コムシスホールディングス	1,300	3,140.00	4,082,000	
ミサワホーム	300	853.00	255,900	
高松コンストラクショングループ	200	3,050.00	610,000	
東建コーポレーション	100	7,310.00	731,000	
ヤマウラ	200	893.00	178,600	
大成建設	3,300	5,010.00	16,533,000	
大林組	10,000	1,050.00	10,500,000	
清水建設	10,200	991.00	10,108,200	
飛島建設	300	1,750.00	525,000	
長谷工コーポレーション	3,900	1,457.00	5,682,300	
松井建設	400	847.00	338,800	

鹿島建設	7,400	1,547.00	11,447,800
不動テトラ	300	1,891.00	567,300
鉄建建設	200	2,754.00	550,800
西松建設	800	2,766.00	2,212,800
三井住友建設	2,400	748.00	1,795,200
大豊建設	200	3,215.00	643,000
前田建設工業	2,400	1,404.00	3,369,600
佐田建設	200	409.00	81,800
ナカノフドー建設	300	657.00	197,100
奥村組	600	3,570.00	2,142,000
東鉄工業	400	2,813.00	1,125,200
イチケン	100	2,188.00	218,800
浅沼組	100	3,235.00	323,500
戸田建設	3,900	800.00	3,120,000
熊谷組	500	3,060.00	1,530,000
青木あすなろ建設	200	948.00	189,600
北野建設	100	4,000.00	400,000
矢作建設工業	500	803.00	401,500
ピーエス三菱	400	611.00	244,400
日本ハウスホールディングス	600	628.00	376,800
大東建託	1,200	15,100.00	18,120,000
新日本建設	400	1,100.00	440,000
N I P O	800	1,897.00	1,517,600
東亜道路工業	100	3,555.00	355,500
前田道路	1,000	2,141.00	2,141,000
日本道路	100	6,410.00	641,000
東亜建設工業	300	2,291.00	687,300
若築建設	200	1,524.00	304,800
東洋建設	1,100	458.00	503,800
五洋建設	4,000	725.00	2,900,000
世紀東急工業	500	671.00	335,500
福田組	100	4,875.00	487,500
住友林業	2,100	1,757.00	3,689,700
日本基礎技術	400	376.00	150,400
巴コーポレーション	400	452.00	180,800
大和ハウス工業	9,900	3,472.00	34,372,800
ライト工業	600	1,522.00	913,200
積水ハウス	10,900	1,679.50	18,306,550
日特建設	300	724.00	217,200
北陸電気工事	200	986.00	197,200
ユアテック	500	871.00	435,500
四電工	100	2,550.00	255,000



中電工	400	2,440.00	976,000
関電工	1,300	1,104.00	1,435,200
きんでん	2,200	1,784.00	3,924,800
東京エネシス	400	1,003.00	401,200
トーエネック	100	3,040.00	304,000
住友電設	300	1,751.00	525,300
日本電設工業	500	2,285.00	1,142,500
協和エクシオ	1,300	3,120.00	4,056,000
新日本空調	300	1,818.00	545,400
九電工	700	4,185.00	2,929,500
三機工業	700	1,125.00	787,500
日揮	2,900	2,393.00	6,939,700
中外炉工業	100	2,508.00	250,800
ヤマト	300	693.00	207,900
太平電業	200	2,693.00	538,600
高砂熱学工業	900	1,938.00	1,744,200
朝日工業社	100	3,295.00	329,500
明星工業	600	852.00	511,200
大気社	400	3,365.00	1,346,000
ダイダン	200	2,649.00	529,800
日比谷総合設備	400	1,877.00	750,800
東芝プラントシステム	700	2,263.00	1,584,100
OSJBホールディングス	1,500	303.00	454,500
東洋エンジニアリング	400	854.00	341,600
千代田化工建設	2,200	789.00	1,735,800
新興プランテック	600	1,056.00	633,600
日本製粉	1,000	1,879.00	1,879,000
日清製粉グループ本社	3,700	2,401.00	8,883,700
昭和産業	300	2,872.00	861,600
鳥越製粉	300	989.00	296,700
中部飼料	400	1,471.00	588,400
フィード・ワン	2,000	198.00	396,000
日本甜菜製糖	200	1,932.00	386,400
三井製糖	200	3,090.00	618,000
塩水港精糖	400	256.00	102,400
日新製糖	100	2,190.00	219,000
森永製菓	700	4,465.00	3,125,500
中村屋	100	4,600.00	460,000
江崎グリコ	800	5,780.00	4,624,000
名糖産業	100	1,502.00	150,200
不二家	200	2,502.00	500,400
山崎製パン	2,500	2,121.00	5,302,500

モロゾフ	100	5,540.00	554,000
亀田製菓	200	5,030.00	1,006,000
寿スピリッツ	300	4,650.00	1,395,000
カルビー	1,400	3,750.00	5,250,000
森永乳業	600	3,020.00	1,812,000
六甲バター	200	2,406.00	481,200
ヤクルト本社	1,700	8,910.00	15,147,000
明治ホールディングス	2,000	7,620.00	15,240,000
雪印メグミルク	700	2,701.00	1,890,700
プリマハム	400	2,328.00	931,200
日本ハム	1,300	4,140.00	5,382,000
丸大食品	300	1,991.00	597,300
S Foods	200	4,765.00	953,000
伊藤ハム米久ホールディングス	1,900	731.00	1,388,900
サッポロホールディングス	1,100	2,246.00	2,470,600
アサヒグループホールディングス	6,300	4,844.00	30,517,200
キリンホールディングス	13,600	2,681.50	36,468,400
宝ホールディングス	2,200	1,673.00	3,680,600
オエノンホールディングス	900	407.00	366,300
養命酒製造	100	2,312.00	231,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	2,300	2,915.00	6,704,500
サントリー食品インターナショナル	2,000	4,480.00	8,960,000
ダイトーグループホールディングス	200	5,860.00	1,172,000
伊藤園	1,000	5,100.00	5,100,000
キーコーヒー	300	2,073.00	621,900
ユニカフェ	100	1,230.00	123,000
日清オイリオグループ	400	3,435.00	1,374,000
不二製油グループ本社	800	3,565.00	2,852,000
J - オイルミルズ	200	3,835.00	767,000
キッコーマン	2,200	6,770.00	14,894,000
味の素	6,900	1,871.50	12,913,350
キューピー	1,700	2,602.00	4,423,400
ハウス食品グループ本社	1,100	3,310.00	3,641,000
カゴメ	1,200	3,100.00	3,720,000
焼津水産化学工業	100	1,026.00	102,600
アリアケジャパン	300	9,960.00	2,988,000
エバラ食品工業	100	2,183.00	218,300
ニチレイ	1,400	2,828.00	3,959,200
東洋水産	1,600	4,225.00	6,760,000
日清食品ホールディングス	1,200	7,400.00	8,880,000
永谷園ホールディングス	200	2,875.00	575,000
一正蒲鉾	100	969.00	96,900

フジッコ	300	2,282.00	684,600
ロック・フィールド	300	1,742.00	522,600
日本たばこ産業	17,300	2,955.00	51,121,500
ケンコーマヨネーズ	200	2,477.00	495,400
わらべや日洋ホールディングス	200	1,892.00	378,400
なとり	200	1,785.00	357,000
ユーグレナ	1,200	675.00	810,000
ミヨシ油脂	100	1,265.00	126,500
理研ビタミン	100	3,805.00	380,500
片倉工業	400	1,239.00	495,600
ゲンゼ	200	5,140.00	1,028,000
東洋紡	1,200	1,695.00	2,034,000
ユニチカ	900	608.00	547,200
富士紡ホールディングス	200	3,375.00	675,000
倉敷紡績	300	2,580.00	774,000
シキボウ	200	1,222.00	244,400
日本毛織	1,000	906.00	906,000
帝国繊維	300	2,547.00	764,100
帝人	2,600	2,028.00	5,272,800
東レ	22,700	830.80	18,859,160
サカイオーベックス	100	2,172.00	217,200
住江織物	100	2,668.00	266,800
日本フェルト	200	492.00	98,400
アツギ	200	1,117.00	223,400
セーレン	700	1,707.00	1,194,900
ソトー	100	994.00	99,400
小松マテーレ	500	974.00	487,000
ワコールホールディングス	900	3,130.00	2,817,000
ホギメディカル	400	3,315.00	1,326,000
T S Iホールディングス	1,100	762.00	838,200
三陽商会	200	2,036.00	407,200
オンワードホールディングス	1,800	675.00	1,215,000
ルックホールディングス	100	1,221.00	122,100
ゴールドウイン	200	8,420.00	1,684,000
デサント	700	2,687.00	1,880,900
キング	200	453.00	90,600
ヤマトインターナショナル	200	458.00	91,600
特種東海製紙	200	4,415.00	883,000
王子ホールディングス	13,200	781.00	10,309,200
日本製紙	1,400	1,957.00	2,739,800
北越コーポレーション	1,700	539.00	916,300
中越パルプ工業	100	1,526.00	152,600

大王製紙	1,300	1,522.00	1,978,600
レンゴー	3,000	979.00	2,937,000
トーモク	200	1,933.00	386,600
ザ・パック	200	3,300.00	660,000
クラレ	4,900	1,612.00	7,898,800
旭化成	19,500	1,448.00	28,236,000
共和レザー	200	901.00	180,200
昭和電工	1,900	5,620.00	10,678,000
住友化学	23,000	594.00	13,662,000
住友精化	100	5,890.00	589,000
日産化学	1,800	5,970.00	10,746,000
クレハ	300	8,060.00	2,418,000
テイカ	200	2,458.00	491,600
石原産業	600	1,479.00	887,400
片倉コープアグリ	100	1,201.00	120,100
日東エフシー	200	775.00	155,000
日本曹達	400	3,170.00	1,268,000
東ソー	4,500	1,608.00	7,236,000
トクヤマ	900	2,827.00	2,544,300
セントラル硝子	600	2,707.00	1,624,200
東亜合成	1,800	1,190.00	2,142,000
大阪ソーダ	300	2,685.00	805,500
関東電化工業	700	1,117.00	781,900
デンカ	1,200	3,860.00	4,632,000
信越化学工業	5,200	8,926.00	46,415,200
堺化学工業	200	2,726.00	545,200
エア・ウォーター	2,600	1,907.00	4,958,200
大陽日酸	2,400	1,725.00	4,140,000
日本化学工業	100	3,295.00	329,500
日本パーカライズン	1,600	1,363.00	2,180,800
高压ガス工業	500	817.00	408,500
四国化成工業	500	1,429.00	714,500
ステラ ケミファ	200	3,810.00	762,000
保土谷化学工業	100	2,978.00	297,800
日本触媒	500	7,830.00	3,915,000
大日精化工業	200	3,335.00	667,000
カネカ	800	5,040.00	4,032,000
三菱瓦斯化学	2,600	1,993.00	5,181,800
三井化学	2,800	2,679.00	7,501,200
J S R	3,100	1,871.00	5,800,100
東京応化工業	500	3,095.00	1,547,500
大阪有機化学工業	300	1,455.00	436,500

三菱ケミカルホールディングス	21,000	928.20	19,492,200
KHネオケム	400	3,815.00	1,526,000
ダイセル	4,200	1,241.00	5,212,200
住友ベークライト	500	4,305.00	2,152,500
積水化学工業	6,400	1,810.00	11,584,000
日本ゼオン	2,600	1,159.00	3,013,400
アイカ工業	900	4,145.00	3,730,500
宇部興産	1,600	2,621.00	4,193,600
積水樹脂	500	2,018.00	1,009,000
タキロンシーアイ	600	589.00	353,400
旭有機材	200	2,424.00	484,800
日立化成	1,500	1,947.00	2,920,500
ニチバン	200	2,366.00	473,200
リケンテクノス	700	541.00	378,700
大倉工業	100	1,973.00	197,300
積水化成成品工業	400	930.00	372,000
群栄化学工業	100	2,950.00	295,000
タイガースポリマー	200	711.00	142,200
ミライアル	100	1,032.00	103,200
ダイキョーニシカワ	600	1,118.00	670,800
竹本容器	100	2,820.00	282,000
日本化薬	2,000	1,299.00	2,598,000
カーリットホールディングス	300	886.00	265,800
日本精化	300	1,151.00	345,300
扶桑化学工業	300	2,375.00	712,500
ADEKA	1,300	1,830.00	2,379,000
日油	1,200	3,420.00	4,104,000
ハリマ化成グループ	200	923.00	184,600
花王	7,400	8,206.00	60,724,400
第一工業製薬	100	3,195.00	319,500
日華化学	100	1,178.00	117,800
三洋化成工業	200	5,340.00	1,068,000
大日本塗料	400	1,193.00	477,200
日本ペイントホールディングス	2,400	3,720.00	8,928,000
関西ペイント	3,300	1,768.00	5,834,400
神東塗料	200	207.00	41,400
中国塗料	900	972.00	874,800
日本特殊塗料	200	2,335.00	467,000
藤倉化成	400	632.00	252,800
太陽ホールディングス	200	4,250.00	850,000
DIC	1,300	3,365.00	4,374,500
サカタインクス	600	1,187.00	712,200

東洋インキＳＣホールディングス	600	2,718.00	1,630,800
T&K TOKA	200	1,081.00	216,200
富士フイルムホールディングス	6,200	5,001.00	31,006,200
資生堂	5,900	7,228.00	42,645,200
ライオン	4,200	2,110.00	8,862,000
高砂香料工業	200	3,785.00	757,000
マンダム	600	3,265.00	1,959,000
ミルボン	400	4,580.00	1,832,000
ファンケル	700	4,645.00	3,251,500
コーセー	500	18,190.00	9,095,000
コタ	100	1,456.00	145,600
シーズ・ホールディングス	400	3,865.00	1,546,000
ポーラ・オルビスホールディングス	1,300	3,415.00	4,439,500
ノエビアホールディングス	200	5,010.00	1,002,000
アジュバンコスメジャパン	100	1,004.00	100,400
エステー	200	1,942.00	388,400
アグロ カネショウ	100	2,277.00	227,700
コニシ	500	1,638.00	819,000
長谷川香料	400	2,153.00	861,200
星光PMC	200	999.00	199,800
小林製薬	800	7,440.00	5,952,000
荒川化学工業	300	1,662.00	498,600
メック	200	1,670.00	334,000
日本高純度化学	100	2,376.00	237,600
タカラバイオ	800	2,992.00	2,393,600
JCU	400	2,615.00	1,046,000
新田ゼラチン	200	800.00	160,000
デクセリアルズ	800	1,048.00	838,400
アース製薬	200	5,120.00	1,024,000
北興化学工業	300	583.00	174,900
大成ラミック	100	3,145.00	314,500
クミアイ化学工業	1,200	765.00	918,000
日本農薬	700	627.00	438,900
アキレス	200	2,232.00	446,400
有沢製作所	500	921.00	460,500
日東電工	2,300	7,895.00	18,158,500
レック	400	2,406.00	962,400
きもと	500	280.00	140,000
藤森工業	300	3,495.00	1,048,500
前澤化成工業	200	1,118.00	223,600
JSP	200	2,563.00	512,600
エフピコ	200	6,010.00	1,202,000

天馬	200	1,885.00	377,000	
信越ポリマー	600	843.00	505,800	
東リ	700	334.00	233,800	
ニフコ	1,100	2,709.00	2,979,900	
バルカー	200	2,885.00	577,000	
ユニ・チャーム	6,300	3,238.00	20,399,400	
協和発酵キリン	3,700	2,053.00	7,596,100	
武田薬品工業	11,000	4,602.00	50,622,000	代用有価証券 2,600株
アステラス製薬	29,400	1,860.50	54,698,700	
大日本住友製薬	2,200	2,676.00	5,887,200	
塩野義製薬	4,200	7,369.00	30,949,800	
田辺三菱製薬	3,600	1,777.00	6,397,200	
わかもと製薬	400	274.00	109,600	
あすか製薬	300	1,565.00	469,500	
日本新薬	800	6,950.00	5,560,000	
ビオフェルミン製薬	100	2,752.00	275,200	
中外製薬	3,100	6,830.00	21,173,000	
科研製薬	500	5,940.00	2,970,000	
エーザイ	3,600	10,585.00	38,106,000	
ロート製薬	1,600	3,720.00	5,952,000	
小野薬品工業	7,100	2,808.50	19,940,350	
久光製薬	900	6,650.00	5,985,000	
持田製薬	200	8,930.00	1,786,000	
参天製薬	5,700	1,764.00	10,054,800	
扶桑薬品工業	100	2,767.00	276,700	
ツムラ	1,100	3,635.00	3,998,500	
日医工	800	1,625.00	1,300,000	
キッセイ薬品工業	500	3,350.00	1,675,000	
生化学工業	600	1,687.00	1,012,200	
栄研化学	500	2,562.00	1,281,000	
日水製薬	100	1,290.00	129,000	
鳥居薬品	200	2,568.00	513,600	
JCRファーマ	200	5,810.00	1,162,000	
東和薬品	100	8,760.00	876,000	
富士製薬工業	200	1,845.00	369,000	
沢井製薬	600	6,080.00	3,648,000	
ゼリア新薬工業	600	2,281.00	1,368,600	
第一三共	8,600	4,549.00	39,121,400	
キョーリン製薬ホールディングス	800	2,550.00	2,040,000	
大幸薬品	200	1,895.00	379,000	
ダイト	200	3,345.00	669,000	
大塚ホールディングス	5,700	5,452.00	31,076,400	

大正製薬ホールディングス	700	12,730.00	8,911,000
ペプチドリーム	1,400	4,515.00	6,321,000
昭和シェル石油	2,800	2,127.00	5,955,600
ニチレキ	400	1,107.00	442,800
ユシロ化学工業	200	1,403.00	280,600
ビーピー・カストロール	100	1,541.00	154,100
MORESCO	100	1,663.00	166,300
出光興産	2,500	5,060.00	12,650,000
JXTGホールディングス	47,700	777.40	37,081,980
コスモエネルギーホールディングス	900	4,280.00	3,852,000
横浜ゴム	1,700	2,215.00	3,765,500
東洋ゴム工業	1,500	1,848.00	2,772,000
ブリヂストン	9,200	4,282.00	39,394,400
住友ゴム工業	2,700	1,607.00	4,338,900
藤倉ゴム工業	300	544.00	163,200
オカモト	200	5,220.00	1,044,000
フコク	100	915.00	91,500
ニッタ	300	4,165.00	1,249,500
住友理工	600	1,019.00	611,400
三ツ星ベルト	400	2,910.00	1,164,000
バンドー化学	600	1,338.00	802,800
日東紡績	400	2,456.00	982,400
AGC	3,000	4,385.00	13,155,000
日本板硝子	1,500	1,156.00	1,734,000
日本山村硝子	100	1,750.00	175,000
日本電気硝子	1,300	3,225.00	4,192,500
オハラ	100	2,895.00	289,500
住友大阪セメント	600	4,385.00	2,631,000
太平洋セメント	1,900	3,435.00	6,526,500
日本ヒューム	300	945.00	283,500
日本コンクリート工業	600	319.00	191,400
三谷セキサン	200	2,649.00	529,800
アジアパイルホールディングス	400	673.00	269,200
東海カーボン	2,700	2,040.00	5,508,000
日本カーボン	100	7,580.00	758,000
東洋炭素	200	3,070.00	614,000
ノリタケカンパニーリミテド	200	5,960.00	1,192,000
TOTO	2,300	4,595.00	10,568,500
日本碍子	3,600	1,673.00	6,022,800
日本特殊陶業	2,500	2,814.00	7,035,000
MARUWA	100	6,470.00	647,000
品川リフラクトリーズ	100	4,805.00	480,500



黒崎播磨	100	7,930.00	793,000
ヨータイ	200	822.00	164,400
東京窯業	400	466.00	186,400
ニッカトー	100	1,107.00	110,700
フジインコーポレーテッド	300	2,672.00	801,600
ニチアス	800	2,727.00	2,181,600
ニチハ	500	2,632.00	1,316,000
新日鐵住金	13,200	2,210.50	29,178,600
神戸製鋼所	5,400	1,020.00	5,508,000
中山製鋼所	400	635.00	254,000
合同製鐵	200	2,069.00	413,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	8,000	2,431.50	19,452,000
日新製鋼	800	1,560.00	1,248,000
東京製鐵	1,600	792.00	1,267,200
共英製鋼	300	2,028.00	608,400
大和工業	600	2,986.00	1,791,600
東京鐵鋼	100	1,701.00	170,100
大阪製鐵	200	2,005.00	401,000
淀川製鋼所	400	2,463.00	985,200
丸一鋼管	1,000	3,295.00	3,295,000
モリ工業	100	2,639.00	263,900
大同特殊鋼	500	4,775.00	2,387,500
日本冶金工業	2,400	323.00	775,200
山陽特殊製鋼	300	2,737.00	821,100
愛知製鋼	200	4,015.00	803,000
日立金属	3,200	1,351.00	4,323,200
大平洋金属	200	3,630.00	726,000
新日本電工	1,800	283.00	509,400
栗本鐵工所	100	1,733.00	173,300
三菱製鋼	200	2,010.00	402,000
日亜鋼業	400	333.00	133,200
シンニッタン	500	405.00	202,500
新家工業	100	1,864.00	186,400
大紀アルミニウム工業所	500	695.00	347,500
日本軽金属ホールディングス	8,600	237.00	2,038,200
三井金属鉱業	800	3,250.00	2,600,000
東邦亜鉛	200	4,430.00	886,000
三菱マテリアル	2,000	3,275.00	6,550,000
住友金属鉱山	3,800	3,745.00	14,231,000
D O W Aホールディングス	700	3,430.00	2,401,000
古河機械金属	500	1,505.00	752,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	300	1,924.00	577,200

東邦チタニウム	500	1,248.00	624,000
U A C J	400	2,576.00	1,030,400
古河電気工業	1,000	3,095.00	3,095,000
住友電気工業	11,100	1,571.00	17,438,100
フジクラ	3,600	491.00	1,767,600
タツタ電線	600	568.00	340,800
平河ヒューテック	100	1,672.00	167,200
リヨービ	400	3,505.00	1,402,000
アーレスティ	400	705.00	282,000
アサヒホールディングス	500	2,006.00	1,003,000
稲葉製作所	200	1,361.00	272,200
宮地エンジニアリンググループ	100	2,885.00	288,500
トーカロ	800	1,028.00	822,400
アルファC o	100	1,404.00	140,400
S U M C O	3,300	1,634.00	5,392,200
川田テクノロジーズ	100	7,100.00	710,000
東洋製罐グループホールディングス	1,900	2,370.00	4,503,000
ホッカンホールディングス	200	2,171.00	434,200
コロナ	200	1,190.00	238,000
横河ブリッジホールディングス	500	2,064.00	1,032,000
駒井ハルテック	100	2,218.00	221,800
三和ホールディングス	2,800	1,335.00	3,738,000
文化シャッター	900	824.00	741,600
三協立山	400	1,347.00	538,800
アルインコ	200	1,038.00	207,600
L I X I L グループ	4,400	2,062.00	9,072,800
日本フィルコン	200	609.00	121,800
ノーリツ	700	1,673.00	1,171,100
長府製作所	300	2,360.00	708,000
リンナイ	500	8,400.00	4,200,000
ダイニチ工業	200	749.00	149,800
日東精工	400	666.00	266,400
岡部	600	1,022.00	613,200
ジーテクト	300	1,650.00	495,000
東プレ	600	2,372.00	1,423,200
高周波熱錬	600	1,044.00	626,400
東京製綱	200	1,341.00	268,200
サンコール	200	809.00	161,800
モリテック スチール	200	513.00	102,600
パイオラックス	400	2,461.00	984,400
日本発條	2,900	1,062.00	3,079,800
立川ブラインド工業	100	1,129.00	112,900

三益半導体工業	200	1,541.00	308,200
日本ドライケミカル	100	1,226.00	122,600
日本製鋼所	1,000	2,509.00	2,509,000
三浦工業	1,300	3,020.00	3,926,000
タクマ	1,000	1,473.00	1,473,000
ツガミ	800	1,024.00	819,200
オークマ	300	5,860.00	1,758,000
東芝機械	300	2,147.00	644,100
アマダホールディングス	4,600	1,098.00	5,050,800
アイダエンジニアリング	800	935.00	748,000
滝澤鉄工所	100	1,667.00	166,700
F U J I	900	1,646.00	1,481,400
牧野フライス製作所	300	4,435.00	1,330,500
オーエスジー	1,500	2,336.00	3,504,000
旭ダイヤモンド工業	900	744.00	669,600
D M G 森精機	1,900	1,722.00	3,271,800
ソディック	600	891.00	534,600
ディスコ	400	18,980.00	7,592,000
日東工器	200	2,451.00	490,200
日進工具	100	2,816.00	281,600
パンチ工業	200	692.00	138,400
富士ダイス	100	821.00	82,100
東洋機械金属	200	691.00	138,200
島精機製作所	400	4,565.00	1,826,000
フリーー	200	920.00	184,000
ヤマシンフィルタ	400	755.00	302,000
日阪製作所	400	1,086.00	434,400
やまびこ	600	1,270.00	762,000
平田機工	100	8,500.00	850,000
ペガサスミシン製造	300	914.00	274,200
ナブテスコ	1,600	2,685.00	4,296,000
三井海洋開発	300	3,500.00	1,050,000
レオン自動機	300	2,069.00	620,700
S M C	900	33,990.00	30,591,000
新川	200	519.00	103,800
ホソカワミクロン	100	5,810.00	581,000
ユニオンツール	100	4,005.00	400,500
オイレス工業	400	2,210.00	884,000
日精エー・エス・ビー機械	100	3,870.00	387,000
サトーホールディングス	400	3,435.00	1,374,000
技研製作所	200	3,765.00	753,000
日本エアーテック	100	751.00	75,100

日精樹脂工業	200	1,093.00	218,600
オカダアイヨン	100	1,704.00	170,400
小松製作所	14,400	3,068.00	44,179,200
住友重機械工業	1,700	3,640.00	6,188,000
日立建機	1,400	3,405.00	4,767,000
日工	100	2,475.00	247,500
巴工業	100	2,253.00	225,300
井関農機	300	1,958.00	587,400
TOWA	200	1,027.00	205,400
北川鉄工所	100	2,834.00	283,400
ローツェ	100	1,894.00	189,400
クボタ	16,000	1,888.50	30,216,000
荏原実業	100	1,923.00	192,300
三菱化工機	100	1,781.00	178,100
月島機械	600	1,363.00	817,800
帝国電機製作所	200	1,566.00	313,200
新東工業	700	992.00	694,400
澁谷工業	300	3,935.00	1,180,500
アイチ コーポレーション	500	609.00	304,500
小森コーポレーション	800	1,300.00	1,040,000
鶴見製作所	300	1,813.00	543,900
酒井重工業	100	3,420.00	342,000
荏原製作所	1,300	3,385.00	4,400,500
西島製作所	300	958.00	287,400
北越工業	300	1,177.00	353,100
ダイキン工業	4,100	13,560.00	55,596,000
オルガノ	100	2,992.00	299,200
トーヨーカネツ	100	2,663.00	266,300
栗田工業	1,600	2,814.00	4,502,400
椿本チエイン	400	4,585.00	1,834,000
大同工業	100	1,121.00	112,100
アネスト岩田	500	1,032.00	516,000
ダイフク	1,500	5,090.00	7,635,000
加藤製作所	100	3,350.00	335,000
油研工業	100	2,193.00	219,300
タダノ	1,400	1,183.00	1,656,200
フジテック	900	1,295.00	1,165,500
C K D	800	1,295.00	1,036,000
キトー	200	1,885.00	377,000
平和	900	2,624.00	2,361,600
理想科学工業	300	2,465.00	739,500
SANKYO	700	4,410.00	3,087,000

日本金銭機械	300	1,139.00	341,700
マースグループホールディングス	200	2,335.00	467,000
福島工業	200	5,340.00	1,068,000
オーイズミ	100	541.00	54,100
ダイコク電機	100	1,639.00	163,900
竹内製作所	500	2,503.00	1,251,500
アマノ	900	2,234.00	2,010,600
JUKI	400	1,414.00	565,600
サンデンホールディングス	400	1,322.00	528,800
蛇の目マシン工業	300	618.00	185,400
マックス	500	1,553.00	776,500
グローリー	900	2,673.00	2,405,700
新晃工業	300	1,651.00	495,300
大和冷機工業	400	1,216.00	486,400
セガサミーホールディングス	3,000	1,526.00	4,578,000
日本ピストンリング	100	2,231.00	223,100
リケン	100	5,620.00	562,000
T P R	300	2,752.00	825,600
ツバキ・ナカシマ	500	2,148.00	1,074,000
ホシザキ	900	11,140.00	10,026,000
大豊工業	200	1,133.00	226,600
日本精工	6,100	1,185.00	7,228,500
N T N	6,900	433.00	2,987,700
ジェイテクト	3,200	1,532.00	4,902,400
不二越	300	4,830.00	1,449,000
日本トムソン	1,000	669.00	669,000
T H K	1,900	2,558.00	4,860,200
ユーシン精機	300	1,097.00	329,100
前澤給装工業	100	1,836.00	183,600
イーグル工業	400	1,332.00	532,800
前澤工業	200	406.00	81,200
日本ピラー工業	300	1,437.00	431,100
キッツ	1,200	877.00	1,052,400
マキタ	3,900	4,785.00	18,661,500
日立造船	2,400	443.00	1,063,200
三菱重工業	5,000	4,224.00	21,120,000
I H I	2,300	4,380.00	10,074,000
スター精密	500	1,724.00	862,000
日清紡ホールディングス	1,900	1,312.00	2,492,800
イビデン	1,800	1,433.00	2,579,400
コニカミノルタ	7,000	1,178.00	8,246,000
ブラザー工業	3,700	2,111.00	7,810,700

ミネベアミツミ	5,500	1,843.00	10,136,500
日立製作所	14,400	3,408.00	49,075,200
三菱電機	29,900	1,404.00	41,979,600
富士電機	1,800	3,945.00	7,101,000
安川電機	3,500	3,310.00	11,585,000
シンフォニアテクノロジー	400	1,483.00	593,200
明電舎	500	1,763.00	881,500
山洋電気	100	4,680.00	468,000
デンヨー	300	1,721.00	516,300
東芝テック	400	3,435.00	1,374,000
マブチモーター	800	4,010.00	3,208,000
日本電産	3,600	14,450.00	52,020,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	100	2,146.00	214,600
東光高岳	200	1,650.00	330,000
ダブル・スコープ	400	990.00	396,000
ダイヘン	300	2,580.00	774,000
ヤーマン	400	1,886.00	754,400
JVCケンウッド	2,500	293.00	732,500
ミマキエンジニアリング	300	1,128.00	338,400
第一精工	100	1,444.00	144,400
日新電機	700	926.00	648,200
大崎電気工業	600	819.00	491,400
オムロン	3,200	4,585.00	14,672,000
日東工業	500	1,926.00	963,000
I D E C	400	2,217.00	886,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,100	2,435.00	2,678,500
サクサホールディングス	100	2,057.00	205,700
メルコホールディングス	100	4,100.00	410,000
テクノメディカ	100	2,076.00	207,600
日本電気	3,900	3,140.00	12,246,000
富士通	3,100	7,428.00	23,026,800
沖電気工業	1,200	1,448.00	1,737,600
岩崎通信機	100	782.00	78,200
電気興業	200	3,060.00	612,000
サンケン電気	300	2,491.00	747,300
ナカヨ	100	1,547.00	154,700
アイホン	200	1,566.00	313,200
ルネサスエレクトロニクス	3,100	640.00	1,984,000
セイコーエプソン	4,500	1,940.00	8,730,000
ワコム	2,300	508.00	1,168,400
アルバック	700	3,895.00	2,726,500
E I Z O	300	4,635.00	1,390,500

ジャパンディスプレイ	6,100	112.00	683,200	
日本信号	800	1,024.00	819,200	
京三製作所	700	537.00	375,900	
能美防災	400	2,426.00	970,400	
ホーチキ	200	1,517.00	303,400	
エレコム	300	2,712.00	813,600	
パナソニック	34,200	1,228.50	42,014,700	代用有価証券 7,500株
シャープ	3,000	1,921.00	5,763,000	
アンリツ	2,200	1,834.00	4,034,800	
富士通ゼネラル	900	1,709.00	1,538,100	
ソニー	20,000	6,309.00	126,180,000	代用有価証券 3,700株
T D K	1,600	10,340.00	16,544,000	
帝国通信工業	100	1,237.00	123,700	
タムラ製作所	1,200	619.00	742,800	
アルプス電気	2,600	2,788.00	7,248,800	
パイオニア	5,000	109.00	545,000	
日本電波工業	300	477.00	143,100	
鈴木	100	755.00	75,500	
日本トリム	100	5,430.00	543,000	
ローランド ディー . ジー .	200	2,553.00	510,600	
フォスター電機	300	1,392.00	417,600	
クラリオン	300	2,056.00	616,800	
S M K	100	2,702.00	270,200	
ヨコオ	200	1,417.00	283,400	
ホシデン	800	1,058.00	846,400	
ヒロセ電機	500	10,640.00	5,320,000	
日本航空電子工業	800	1,784.00	1,427,200	
T O A	300	1,218.00	365,400	
マクセルホールディングス	600	1,596.00	957,600	
古野電気	400	1,325.00	530,000	
アルパイン	700	2,047.00	1,432,900	
スミダコーポレーション	300	1,302.00	390,600	
アイコム	200	2,454.00	490,800	
リオン	100	2,598.00	259,800	
本多通信工業	200	784.00	156,800	
船井電機	300	625.00	187,500	
横河電機	3,000	2,354.00	7,062,000	
新電元工業	100	5,140.00	514,000	
アズビル	1,800	2,175.00	3,915,000	
東亜ディーケーケー	100	1,242.00	124,200	
日本光電工業	1,200	3,545.00	4,254,000	

チノー	100	1,422.00	142,200
共和電業	300	415.00	124,500
日本電子材料	100	791.00	79,100
堀場製作所	600	5,290.00	3,174,000
アドバンテスト	1,700	2,198.00	3,736,600
エスベック	300	1,855.00	556,500
キーエンス	1,500	56,330.00	84,495,000
日置電機	200	4,145.00	829,000
シスメックス	2,300	8,540.00	19,642,000
日本マイクロニクス	500	735.00	367,500
メガチップス	200	2,190.00	438,000
OBARA GROUP	200	5,040.00	1,008,000
コーセル	400	1,153.00	461,200
イリソ電子工業	300	5,270.00	1,581,000
オブテックスグループ	500	2,084.00	1,042,000
千代田インテグレ	100	2,316.00	231,600
アイ・オー・データ機器	100	1,334.00	133,400
レーザーテック	600	3,240.00	1,944,000
スタンレー電気	2,300	3,670.00	8,441,000
岩崎電気	100	1,505.00	150,500
ウシオ電機	1,800	1,404.00	2,527,200
岡谷電機産業	200	484.00	96,800
ハリオス テクノ ホールディング	300	801.00	240,300
日本セラミック	300	2,926.00	877,800
古河電池	200	834.00	166,800
山一電機	200	1,364.00	272,800
図研	200	1,772.00	354,400
日本電子	500	2,055.00	1,027,500
カシオ計算機	2,400	1,665.00	3,996,000
ファナック	2,800	19,265.00	53,942,000
日本シイエムケイ	500	796.00	398,000
エンプラス	100	2,991.00	299,100
ローム	1,300	7,430.00	9,659,000
浜松ホトニクス	2,100	4,110.00	8,631,000
三井ハイテック	400	1,305.00	522,000
新光電気工業	1,100	863.00	949,300
京セラ	4,900	6,259.00	30,669,100
太陽誘電	1,500	2,459.00	3,688,500
村田製作所	3,100	16,565.00	51,351,500
双葉電子工業	500	1,815.00	907,500
ニチコン	900	1,004.00	903,600
日本ケミコン	200	2,677.00	535,400



K O A	400	1,663.00	665,200	
市光工業	400	771.00	308,400	
小糸製作所	1,800	6,110.00	10,998,000	
ミツバ	500	912.00	456,000	
S C R E E Nホールディングス	600	6,600.00	3,960,000	
キャノン電子	300	2,222.00	666,600	
キャノン	16,100	3,569.00	57,460,900	代用有価証券 4,100株
リコー	9,000	1,257.00	11,313,000	
東京エレクトロン	2,000	15,310.00	30,620,000	
トヨタ紡織	900	1,994.00	1,794,600	
ユニプレス	600	2,107.00	1,264,200	
豊田自動織機	2,400	5,810.00	13,944,000	
モリタホールディングス	500	2,229.00	1,114,500	
三櫻工業	400	679.00	271,600	
デンソー	6,600	5,170.00	34,122,000	
東海理化電機製作所	800	2,199.00	1,759,200	
三井E & Sホールディングス	1,100	2,046.00	2,250,600	
川崎重工業	2,300	2,835.00	6,520,500	
名村造船所	900	541.00	486,900	
三菱ロジスネクスト	400	1,282.00	512,800	
日産自動車	35,300	1,003.50	35,423,550	
いすゞ自動車	8,700	1,516.50	13,193,550	
トヨタ自動車	36,300	6,549.00	237,728,700	代用有価証券 9,000株
日野自動車	4,300	1,135.00	4,880,500	
三菱自動車工業	11,100	709.00	7,869,900	
エフテック	200	1,164.00	232,800	
ファルテック	100	1,008.00	100,800	
武蔵精密工業	600	1,669.00	1,001,400	
日産車体	1,200	930.00	1,116,000	
新明和工業	1,300	1,444.00	1,877,200	
極東開発工業	600	1,634.00	980,400	
日信工業	600	1,738.00	1,042,800	
トピー工業	200	3,235.00	647,000	
ティラド	100	2,831.00	283,100	
曙ブレーキ工業	1,400	230.00	322,000	
タチエス	500	1,626.00	813,000	
N O K	1,600	1,626.00	2,601,600	
フタバ産業	900	707.00	636,300	
K Y B	300	2,691.00	807,300	
大同メタル工業	400	901.00	360,400	
プレス工業	1,600	519.00	830,400	

ミクニ	400	652.00	260,800	
太平洋工業	600	1,705.00	1,023,000	
ケーヒン	700	2,213.00	1,549,100	
河西工業	400	1,052.00	420,800	
アイシン精機	2,500	4,625.00	11,562,500	
マツダ	9,400	1,266.00	11,900,400	
今仙電機製作所	300	1,061.00	318,300	
本田技研工業	26,900	3,078.00	82,798,200	代用有価証券 6,000株
スズキ	5,900	5,682.00	33,523,800	
S U B A R U	9,300	3,295.00	30,643,500	
安永	100	1,866.00	186,600	
ヤマハ発動機	4,200	2,726.00	11,449,200	
ショーワ	800	1,560.00	1,248,000	
T B K	400	470.00	188,000	
エクセディ	400	3,245.00	1,298,000	
豊田合成	1,100	2,558.00	2,813,800	
愛三工業	500	854.00	427,000	
ヨロズ	300	1,619.00	485,700	
エフ・シー・シー	500	2,863.00	1,431,500	
シマノ	1,200	15,660.00	18,792,000	
テイ・エス テック	700	3,255.00	2,278,500	
ジャムコ	100	2,919.00	291,900	
テルモ	4,600	6,560.00	30,176,000	
クリエートメディック	100	1,181.00	118,100	
日機装	1,000	1,381.00	1,381,000	
島津製作所	3,600	3,195.00	11,502,000	
J M S	300	592.00	177,600	
長野計器	200	989.00	197,800	
ブイ・テクノロジー	100	14,720.00	1,472,000	
東京計器	200	1,086.00	217,200	
オーバル	300	286.00	85,800	
東京精密	500	2,868.00	1,434,000	
マニー	400	5,170.00	2,068,000	
ニコン	5,200	2,063.00	10,727,600	
トプコン	1,600	1,850.00	2,960,000	
オリンパス	4,500	4,015.00	18,067,500	
理研計器	300	2,285.00	685,500	
タムロン	300	2,191.00	657,300	
H O Y A	6,000	6,264.00	37,584,000	
ノーリツ鋼機	300	2,616.00	784,800	
シチズン時計	3,600	671.00	2,415,600	
リズム時計工業	100	2,028.00	202,800	

大研医器	300	845.00	253,500
メニコン	400	2,562.00	1,024,800
松風	100	1,309.00	130,900
セイコーホールディングス	500	2,884.00	1,442,000
ニプロ	2,100	1,461.00	3,068,100
中本パックス	100	1,844.00	184,400
パラマウントベッドホールディングス	300	4,935.00	1,480,500
トランザクション	200	794.00	158,800
ニホンフラッシュ	100	1,971.00	197,100
前田工織	300	2,292.00	687,600
永大産業	400	475.00	190,000
アートネイチャー	300	685.00	205,500
バンダイナムコホールディングス	3,100	4,180.00	12,958,000
共立印刷	500	322.00	161,000
SHOEI	100	4,370.00	437,000
フランスベッドホールディングス	300	978.00	293,400
パイロットコーポレーション	500	6,520.00	3,260,000
萩原工業	200	1,769.00	353,800
トッパン・フォームズ	600	1,020.00	612,000
フジシールインターナショナル	700	3,335.00	2,334,500
タカラトミー	1,300	1,200.00	1,560,000
廣済堂	300	479.00	143,700
エステールホールディングス	100	730.00	73,000
タカノ	100	913.00	91,300
プロネクサス	300	1,128.00	338,400
ウッドワン	100	1,226.00	122,600
大建工業	200	2,063.00	412,600
凸版印刷	4,200	1,638.00	6,879,600
大日本印刷	3,900	2,612.00	10,186,800
図書印刷	200	857.00	171,400
共同印刷	100	2,764.00	276,400
NISSHA	600	1,971.00	1,182,600
宝印刷	200	1,854.00	370,800
アシックス	3,000	1,711.00	5,133,000
ツツミ	100	2,130.00	213,000
小松ウオール工業	100	2,057.00	205,700
ヤマハ	2,000	5,330.00	10,660,000
河合楽器製作所	100	4,450.00	445,000
クリナップ	300	707.00	212,100
ピジョン	1,800	5,230.00	9,414,000
キングジム	200	919.00	183,800
リンテック	700	2,748.00	1,923,600

イトーキ	600	618.00	370,800
任天堂	1,800	38,050.00	68,490,000
三菱鉛筆	500	1,841.00	920,500
タカスタンダード	600	1,815.00	1,089,000
コクヨ	1,400	1,823.00	2,552,200
ナカバヤシ	300	626.00	187,800
グロープライド	100	2,845.00	284,500
オカムラ	1,000	1,514.00	1,514,000
美津濃	300	2,676.00	802,800
東京電力ホールディングス	23,900	587.00	14,029,300
中部電力	9,100	1,693.50	15,410,850
関西電力	12,200	1,735.00	21,167,000
中国電力	4,100	1,459.00	5,981,900
北陸電力	2,900	1,128.00	3,271,200
東北電力	7,000	1,509.00	10,563,000
四国電力	2,700	1,444.00	3,898,800
九州電力	6,600	1,350.00	8,910,000
北海道電力	3,000	714.00	2,142,000
沖縄電力	600	2,282.00	1,369,200
電源開発	2,400	3,130.00	7,512,000
エフオン	200	1,150.00	230,000
イーレックス	500	937.00	468,500
東京瓦斯	6,300	2,808.50	17,693,550
大阪瓦斯	5,800	2,174.00	12,609,200
東邦瓦斯	1,500	4,265.00	6,397,500
北海道瓦斯	200	1,482.00	296,400
広島ガス	600	367.00	220,200
西部瓦斯	400	2,628.00	1,051,200
静岡ガス	900	980.00	882,000
メタウォーター	200	2,960.00	592,000
SBSホールディングス	300	1,497.00	449,100
東武鉄道	3,200	3,175.00	10,160,000
相鉄ホールディングス	1,000	3,495.00	3,495,000
東京急行電鉄	8,100	1,891.00	15,317,100
京浜急行電鉄	4,100	1,728.00	7,084,800
小田急電鉄	4,400	2,536.00	11,158,400
京王電鉄	1,700	6,140.00	10,438,000
京成電鉄	2,100	3,605.00	7,570,500
富士急行	400	3,345.00	1,338,000
新京成電鉄	100	2,153.00	215,300
東日本旅客鉄道	5,300	9,848.00	52,194,400
西日本旅客鉄道	2,700	7,615.00	20,560,500

東海旅客鉄道	2,700	22,025.00	59,467,500
西武ホールディングス	3,800	2,092.00	7,949,600
鴻池運輸	400	1,757.00	702,800
西日本鉄道	800	2,881.00	2,304,800
ハマキョウレックス	200	3,780.00	756,000
サカイ引越センター	200	6,160.00	1,232,000
近鉄グループホールディングス	2,800	4,330.00	12,124,000
阪急阪神ホールディングス	3,800	3,835.00	14,573,000
南海電気鉄道	1,300	2,828.00	3,676,400
京阪ホールディングス	1,300	4,280.00	5,564,000
名古屋鉄道	2,300	2,747.00	6,318,100
山陽電気鉄道	200	2,482.00	496,400
日本通運	1,100	6,860.00	7,546,000
ヤマトホールディングス	5,000	3,284.00	16,420,000
山九	700	5,890.00	4,123,000
丸運	200	327.00	65,400
丸全昭和運輸	200	3,000.00	600,000
センコーグループホールディングス	1,700	884.00	1,502,800
トナミホールディングス	100	5,990.00	599,000
ニッコンホールディングス	1,100	2,770.00	3,047,000
福山通運	400	4,410.00	1,764,000
セイノーホールディングス	2,100	1,550.00	3,255,000
神奈川中央交通	100	3,660.00	366,000
日立物流	600	2,856.00	1,713,600
丸和運輸機関	100	3,710.00	371,000
C & F ロジホールディングス	300	1,268.00	380,400
九州旅客鉄道	2,400	3,400.00	8,160,000
S Gホールディングス	2,700	2,846.00	7,684,200
日本郵船	2,400	1,911.00	4,586,400
商船三井	1,800	2,820.00	5,076,000
川崎汽船	1,300	1,771.00	2,302,300
N S ユナイテッド海運	100	2,579.00	257,900
飯野海運	1,400	531.00	743,400
日本航空	5,200	3,915.00	20,358,000
A N A ホールディングス	5,500	3,683.00	20,256,500
トランコム	100	7,560.00	756,000
日新	200	2,260.00	452,000
三菱倉庫	1,000	2,786.00	2,786,000
三井倉庫ホールディングス	300	1,871.00	561,300
住友倉庫	1,000	1,357.00	1,357,000
澁澤倉庫	200	1,625.00	325,000
東陽倉庫	500	330.00	165,000

日本トランスシティ	700	436.00	305,200
中央倉庫	200	1,092.00	218,400
川西倉庫	100	1,624.00	162,400
安田倉庫	300	861.00	258,300
宇徳	200	541.00	108,200
上組	1,700	2,349.00	3,993,300
キムラユニティー	100	1,174.00	117,400
キューソー流通システム	100	2,575.00	257,500
近鉄エクスプレス	500	1,858.00	929,000
東海運	200	323.00	64,600
エーアイティー	200	1,107.00	221,400
内外トランスライン	100	1,681.00	168,100
日本コンセプト	100	1,129.00	112,900
NEC ネットエスアイ	300	2,371.00	711,300
システナ	900	1,537.00	1,383,300
デジタルアーツ	100	5,370.00	537,000
新日鉄住金ソリューションズ	400	3,505.00	1,402,000
キューブシステム	200	922.00	184,400
コア	100	1,307.00	130,700
ソフトクリエイトホールディングス	100	1,695.00	169,500
T I S	1,000	5,350.00	5,350,000
電算システム	100	2,255.00	225,500
グリー	1,600	487.00	779,200
コーエーテクモホールディングス	600	1,918.00	1,150,800
三菱総合研究所	100	4,070.00	407,000
A G S	200	751.00	150,200
ヒト・コミュニケーションズ	100	2,122.00	212,200
K L a b	500	1,062.00	531,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	200	2,503.00	500,600
ネクソン	7,500	1,374.00	10,305,000
アイスタイル	700	1,148.00	803,600
エイチーム	200	1,955.00	391,000
テクノスジャパン	300	977.00	293,100
コロプラ	800	720.00	576,000
ブロードリーフ	1,500	721.00	1,081,500
デジタルハーツホールディングス	200	1,503.00	300,600
ティーガイア	300	2,716.00	814,800
豆蔵ホールディングス	200	880.00	176,000
テクマトリックス	100	2,325.00	232,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	7,100	218.00	1,547,800
GMOペイメントゲートウェイ	500	6,290.00	3,145,000
インターネットイニシアティブ	500	2,167.00	1,083,500

GMOクラウド	100	3,440.00	344,000
SRAホールディングス	200	3,300.00	660,000
Minorisソリューションズ	100	1,390.00	139,000
朝日ネット	300	504.00	151,200
コムチュア	100	4,415.00	441,500
gumi	300	704.00	211,200
オープンドア	100	2,911.00	291,100
アカツキ	100	4,410.00	441,000
LINE	900	4,050.00	3,645,000
オークネット	200	1,223.00	244,600
AOI TYO Holdings	300	1,321.00	396,300
マクロミル	400	2,271.00	908,400
フェイス	100	1,231.00	123,100
野村総合研究所	1,900	5,350.00	10,165,000
サイバネットシステム	200	678.00	135,600
インテージホールディングス	300	979.00	293,700
東邦システムサイエンス	100	870.00	87,000
クレスコ	100	3,530.00	353,000
フジ・メディア・ホールディングス	3,000	1,947.00	5,841,000
オービック	900	10,050.00	9,045,000
ジャストシステム	500	2,505.00	1,252,500
TDCソフト	300	1,176.00	352,800
ヤフー	21,200	374.00	7,928,800
トレンドマイクロ	1,600	6,780.00	10,848,000
インフォメーション・ディベロプメント	100	1,623.00	162,300
日本オラクル	500	8,200.00	4,100,000
アルファシステムズ	100	2,842.00	284,200
フューチャー	400	1,640.00	656,000
CAC Holdings	200	1,056.00	211,200
ソフトバンク・テクノロジー	100	2,737.00	273,700
トーセ	100	980.00	98,000
オービックビジネスコンサルタント	100	9,730.00	973,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,300	2,321.00	3,017,300
アイティフォー	400	1,061.00	424,400
大塚商会	1,600	3,940.00	6,304,000
サイボウズ	300	695.00	208,500
電通国際情報サービス	200	4,090.00	818,000
デジタルガレージ	500	3,370.00	1,685,000
EMシステムズ	200	1,217.00	243,400
ウェザーニューズ	100	3,350.00	335,000
CIJ	200	761.00	152,200
WOWOW	100	3,405.00	340,500

IMAGICA GROUP	200	620.00	124,000
ネットワンシステムズ	1,200	2,450.00	2,940,000
アルゴグラフィックス	100	4,705.00	470,500
マーベラス	500	875.00	437,500
エイベックス	500	1,625.00	812,500
日本ユニシス	800	2,770.00	2,216,000
兼松エレクトロニクス	200	3,675.00	735,000
東京放送ホールディングス	1,600	2,222.00	3,555,200
日本テレビホールディングス	2,700	1,881.00	5,078,700
朝日放送グループホールディングス	300	778.00	233,400
テレビ朝日ホールディングス	800	2,159.00	1,727,200
スカパーJ S A Tホールディングス	2,200	523.00	1,150,600
テレビ東京ホールディングス	200	2,718.00	543,600
日本BS放送	100	1,290.00	129,000
ビジョン	100	4,370.00	437,000
コネクシオ	200	1,913.00	382,600
日本通信	2,600	152.00	395,200
日本電信電話	21,100	4,974.00	104,951,400
K D D I	25,900	2,968.00	76,871,200
光通信	300	20,400.00	6,120,000
N T T ドコモ	21,100	2,886.50	60,905,150
エムティーアイ	300	602.00	180,600
G M O インターネット	1,100	1,662.00	1,828,200
カドカワ	900	1,175.00	1,057,500
学研ホールディングス	100	5,740.00	574,000
ゼンリン	500	3,390.00	1,695,000
アイネット	200	1,718.00	343,600
松竹	200	11,660.00	2,332,000
東宝	1,900	3,625.00	6,887,500
東映	100	12,840.00	1,284,000
エヌ・ティ・ティ・データ	9,100	1,536.00	13,977,600
ビジネスブレイン太田昭和	100	2,220.00	222,000
D T S	300	4,115.00	1,234,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1,400	4,175.00	5,845,000
シーイーシー	300	2,485.00	745,500
カブコン	1,300	2,619.00	3,404,700
ジャステック	200	1,165.00	233,000
S C S K	700	4,930.00	3,451,000
日本システムウエア	100	1,958.00	195,800
アイネス	400	1,250.00	500,000
T K C	200	4,510.00	902,000
富士ソフト	400	5,360.00	2,144,000



N S D	500	2,469.00	1,234,500
コナミホールディングス	1,200	4,505.00	5,406,000
福井コンピュータホールディングス	100	1,955.00	195,500
J B C Cホールディングス	200	1,481.00	296,200
ミロク情報サービス	300	2,307.00	692,100
ソフトバンクグループ	13,300	9,433.00	125,458,900
高千穂交易	100	1,075.00	107,500
伊藤忠食品	100	5,550.00	555,000
エレマテック	100	2,429.00	242,900
J A L U X	100	2,891.00	289,100
あらた	100	4,765.00	476,500
東京エレクトロン デバイス	100	1,914.00	191,400
フィールズ	200	936.00	187,200
双日	17,400	397.00	6,907,800
アルフレッサ ホールディングス	3,300	3,030.00	9,999,000
横浜冷凍	800	894.00	715,200
ラサ商事	100	973.00	97,300
アルコニックス	300	1,443.00	432,900
神戸物産	200	6,060.00	1,212,000
あい ホールディングス	500	2,340.00	1,170,000
ディーブイエックス	100	1,362.00	136,200
ダイワボウホールディングス	300	6,680.00	2,004,000
マクニカ・富士エレホールディングス	600	1,850.00	1,110,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	600	1,195.00	717,000
八洲電機	200	847.00	169,400
U K Cホールディングス	200	2,359.00	471,800
O C H Iホールディングス	100	1,315.00	131,500
T O K A Iホールディングス	1,600	1,024.00	1,638,400
三洋貿易	100	1,923.00	192,300
ウイン・パートナーズ	200	1,164.00	232,800
シップヘルスケアホールディングス	600	4,310.00	2,586,000
明治電機工業	100	1,879.00	187,900
デリカフーズホールディングス	100	1,522.00	152,200
コメダホールディングス	500	2,317.00	1,158,500
富士興産	100	641.00	64,100
小野建	300	1,715.00	514,500
佐島電機	200	1,067.00	213,400
伯東	200	1,508.00	301,600
コンドーテック	200	1,046.00	209,200
中山福	200	674.00	134,800
ナガイレーベン	400	2,623.00	1,049,200
三菱食品	300	2,846.00	853,800

松田産業	200	1,468.00	293,600
第一興商	400	5,410.00	2,164,000
メディパルホールディングス	3,000	2,385.00	7,155,000
S P K	100	2,352.00	235,200
萩原電気ホールディングス	100	3,050.00	305,000
アズワン	200	8,740.00	1,748,000
スズデン	100	1,318.00	131,800
尾家産業	100	1,431.00	143,100
シモジマ	200	996.00	199,200
ドウシシャ	300	2,325.00	697,500
小津産業	100	1,973.00	197,300
高速	200	1,116.00	223,200
たけびし	100	1,556.00	155,600
リックス	100	1,589.00	158,900
丸文	300	787.00	236,100
ハピネット	200	1,793.00	358,600
橋本総業ホールディングス	100	1,454.00	145,400
日本ライフライン	800	2,027.00	1,621,600
エクセル	100	2,023.00	202,300
マルカキカイ	100	2,455.00	245,500
I D O M	900	356.00	320,400
日本エム・ディ・エム	200	1,345.00	269,000
進和	200	2,258.00	451,600
ダイトロン	100	2,009.00	200,900
シークス	400	1,618.00	647,200
田中商事	100	659.00	65,900
オーハシテクニカ	200	1,467.00	293,400
白銅	100	1,834.00	183,400
伊藤忠商事	21,600	2,151.00	46,461,600
丸紅	24,200	950.30	22,997,260
長瀬産業	1,800	1,805.00	3,249,000
蝶理	200	1,992.00	398,400
豊田通商	3,300	4,125.00	13,612,500
三共生興	500	458.00	229,000
兼松	1,300	1,574.00	2,046,200
三井物産	24,300	1,967.00	47,798,100
日本紙パルプ商事	200	4,125.00	825,000
日立ハイテクノロジーズ	1,000	3,655.00	3,655,000
カメイ	400	1,343.00	537,200
スターゼン	100	4,595.00	459,500
山善	1,100	1,300.00	1,430,000
椿本興業	100	3,170.00	317,000

住友商事	18,600	1,785.50	33,210,300	
内田洋行	100	2,792.00	279,200	
三菱商事	20,700	3,377.00	69,903,900	代用有価証券 5,200株
第一実業	100	3,725.00	372,500	
キャノンマーケティングジャパン	800	2,211.00	1,768,800	
西華産業	200	1,853.00	370,600	
佐藤商事	300	1,098.00	329,400	
菱洋エレクトロ	300	1,690.00	507,000	
東京産業	300	782.00	234,600	
ユアサ商事	300	3,795.00	1,138,500	
小林産業	200	322.00	64,400	
阪和興業	600	3,770.00	2,262,000	
正栄食品工業	200	4,115.00	823,000	
カナデン	300	1,144.00	343,200	
菱電商事	200	1,596.00	319,200	
フルサト工業	200	1,701.00	340,200	
岩谷産業	700	3,900.00	2,730,000	
極東貿易	100	2,015.00	201,500	
イワキ	400	574.00	229,600	
三愛石油	800	1,306.00	1,044,800	
稲畑産業	700	1,618.00	1,132,600	
明和産業	300	466.00	139,800	
ワキタ	600	1,255.00	753,000	
東邦ホールディングス	900	3,030.00	2,727,000	
サンゲツ	1,000	2,117.00	2,117,000	
ミツウロコグループホールディングス	400	741.00	296,400	
シナネンホールディングス	100	2,639.00	263,900	
伊藤忠エネクス	700	1,103.00	772,100	
サンリオ	800	2,405.00	1,924,000	
サンワテクノス	200	1,244.00	248,800	
リョーサン	300	3,630.00	1,089,000	
新光商事	300	1,544.00	463,200	
トーヨー	100	2,262.00	226,200	
三信電気	300	1,906.00	571,800	
東陽テクニカ	300	905.00	271,500	
モスフードサービス	400	3,035.00	1,214,000	
加賀電子	300	2,473.00	741,900	
ソーダニッカ	300	643.00	192,900	
立花エレテック	200	1,746.00	349,200	
フォーバル	100	1,036.00	103,600	
PALTA C	400	5,290.00	2,116,000	
三谷産業	300	335.00	100,500	

ヤマタネ	100	1,834.00	183,400
日鉄住金物産	200	4,935.00	987,000
トラスコ中山	600	2,926.00	1,755,600
オートバックスセブン	1,200	1,942.00	2,330,400
モリト	200	850.00	170,000
加藤産業	500	3,610.00	1,805,000
イノテック	300	1,284.00	385,200
イエローハット	300	2,798.00	839,400
J Kホールディングス	300	722.00	216,600
日伝	200	1,900.00	380,000
杉本商事	200	1,965.00	393,000
因幡電機産業	400	4,555.00	1,822,000
バイテックホールディングス	100	2,357.00	235,700
ミスミグループ本社	3,400	2,471.00	8,401,400
タキヒヨー	100	1,945.00	194,500
スズケン	1,300	5,280.00	6,864,000
ジェコス	200	1,140.00	228,000
ルネサスイーストン	300	512.00	153,600
ローソン	700	7,120.00	4,984,000
サンエー	200	4,745.00	949,000
カワチ薬品	200	2,170.00	434,000
エービーシー・マート	500	6,470.00	3,235,000
ハードオフコーポレーション	100	964.00	96,400
アスクル	300	3,080.00	924,000
ゲオホールディングス	500	1,726.00	863,000
アダストリア	500	1,874.00	937,000
ジーフット	200	752.00	150,400
くらコーポレーション	200	6,720.00	1,344,000
キャンドウ	100	1,705.00	170,500
パルグループホールディングス	200	3,235.00	647,000
エディオン	1,100	1,256.00	1,381,600
サーラコーポレーション	600	667.00	400,200
ワッツ	100	911.00	91,100
ハローズ	100	2,439.00	243,900
あみやき亭	100	4,090.00	409,000
ひらまつ	400	445.00	178,000
大黒天物産	100	4,530.00	453,000
ハニーズホールディングス	300	913.00	273,900
アルペン	200	1,935.00	387,000
クオールホールディングス	300	2,487.00	746,100
ジンズ	200	6,500.00	1,300,000
ビックカメラ	1,600	1,480.00	2,368,000

DCMホールディングス	1,600	1,082.00	1,731,200
ペッパーフードサービス	200	3,620.00	724,000
MonotaRO	1,900	2,997.00	5,694,300
アークランドサービスホールディングス	200	2,340.00	468,000
J.フロント リテイリング	3,500	1,489.00	5,211,500
ドトール・日レスホールディングス	500	2,107.00	1,053,500
マツモトキヨシホールディングス	1,200	4,000.00	4,800,000
ブロンコビリー	200	3,025.00	605,000
ZOZO	2,900	3,030.00	8,787,000
トレジャー・ファクトリー	100	728.00	72,800
物語コーポレーション	100	10,850.00	1,085,000
ココカラファイン	300	6,160.00	1,848,000
三越伊勢丹ホールディングス	5,500	1,258.00	6,919,000
ウエルシアホールディングス	800	6,230.00	4,984,000
クリエイティブSDホールディングス	400	2,830.00	1,132,000
丸善CHIホールディングス	300	354.00	106,200
チムニー	100	2,835.00	283,500
シュッピン	200	1,339.00	267,800
ネクステージ	500	910.00	455,000
ジョイフル本田	900	1,680.00	1,512,000
鳥貴族	100	2,142.00	214,200
すかいらーくホールディングス	2,700	1,734.00	4,681,800
綿半ホールディングス	100	2,504.00	250,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,000	1,244.00	1,244,000
あさひ	200	1,381.00	276,200
日本調剤	100	3,690.00	369,000
コスモス薬品	100	23,400.00	2,340,000
トーエル	100	906.00	90,600
セブン&アイ・ホールディングス	12,300	4,836.00	59,482,800
薬王堂	100	3,805.00	380,500
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	800	1,231.00	984,800
ツルハホールディングス	600	11,900.00	7,140,000
サンマルクホールディングス	200	2,678.00	535,600
フェリシモ	100	1,325.00	132,500
トリドールホールディングス	400	2,030.00	812,000
TOKYO BASE	300	704.00	211,200
クスリのアオキホールディングス	200	8,400.00	1,680,000
スシローグローバルホールディングス	300	5,910.00	1,773,000
LIXILピバ	400	1,814.00	725,600
はるやまホールディングス	100	901.00	90,100
ノジマ	500	2,611.00	1,305,500

カップ・クリエイト	400	1,362.00	544,800
ライトオン	200	962.00	192,400
良品計画	400	31,400.00	12,560,000
三城ホールディングス	400	486.00	194,400
アドヴァン	300	1,064.00	319,200
アルビス	100	2,993.00	299,300
コナカ	400	497.00	198,800
G-7ホールディングス	100	2,553.00	255,300
イオン北海道	300	804.00	241,200
ヒマラヤ	100	981.00	98,100
コーナン商事	400	2,900.00	1,160,000
エコス	100	2,041.00	204,100
ワタミ	300	1,382.00	414,600
ドンキホーテホールディングス	1,900	6,780.00	12,882,000
西松屋チェーン	600	1,070.00	642,000
ゼンショーホールディングス	1,500	2,147.00	3,220,500
ハークスレイ	100	1,061.00	106,100
サイゼリヤ	500	2,092.00	1,046,000
V Tホールディングス	1,000	471.00	471,000
魚力	100	1,425.00	142,500
フジ・コーポレーション	100	2,180.00	218,000
ユナイテッドアローズ	400	4,690.00	1,876,000
ハイデイ日高	400	2,337.00	934,800
京都きもの友禅	200	505.00	101,000
コロワイド	1,000	2,805.00	2,805,000
ピーシーデポコーポレーション	400	584.00	233,600
壱番屋	200	4,460.00	892,000
P L A N T	100	1,189.00	118,900
スギホールディングス	600	5,230.00	3,138,000
スクロール	500	637.00	318,500
ヨンドシーホールディングス	300	2,451.00	735,300
ユニー・ファミリーマートホールディングス	900	13,170.00	11,853,000
木曽路	400	2,761.00	1,104,400
ケーヨー	500	550.00	275,000
上新電機	300	2,928.00	878,400
日本瓦斯	500	4,485.00	2,242,500
ロイヤルホールディングス	500	2,864.00	1,432,000
いなげや	300	1,591.00	477,300
島忠	700	3,050.00	2,135,000
チヨダ	300	2,202.00	660,600
ライフコーポレーション	200	2,796.00	559,200
リンガーハット	400	2,357.00	942,800

MrMaxHD	400	526.00	210,400
AOKIホールディングス	600	1,533.00	919,800
オークワ	400	1,175.00	470,000
コメリ	500	2,578.00	1,289,000
青山商事	600	3,465.00	2,079,000
しまむら	300	9,630.00	2,889,000
はせがわ	200	474.00	94,800
高島屋	2,300	1,723.00	3,962,900
松屋	600	1,072.00	643,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,400	1,715.00	2,401,000
近鉄百貨店	100	3,640.00	364,000
パルコ	300	1,185.00	355,500
丸井グループ	2,700	2,494.00	6,733,800
アクシアル リテイリング	200	3,715.00	743,000
イオン	11,300	2,650.00	29,945,000
イズミ	500	5,990.00	2,995,000
平和堂	600	2,947.00	1,768,200
フジ	400	2,102.00	840,800
ヤオコー	300	6,310.00	1,893,000
ゼビオホールディングス	400	1,649.00	659,600
ケーズホールディングス	2,600	1,450.00	3,770,000
日産東京販売ホールディングス	400	341.00	136,400
Genky DrugStores	100	3,610.00	361,000
総合メディカルホールディングス	300	2,419.00	725,700
ブックオフグループホールディングス	200	738.00	147,600
アインホールディングス	400	8,940.00	3,576,000
元気寿司	100	6,380.00	638,000
ヤマダ電機	10,100	531.00	5,363,100
アークランドサカモト	500	1,540.00	770,000
ニトリホールディングス	1,200	15,045.00	18,054,000
ケーユーホールディングス	200	960.00	192,000
吉野家ホールディングス	1,000	1,849.00	1,849,000
松屋フーズホールディングス	100	3,595.00	359,500
サガミホールディングス	400	1,343.00	537,200
関西スーパーマーケット	200	1,083.00	216,600
王将フードサービス	200	7,990.00	1,598,000
プレナス	300	1,783.00	534,900
ミニストップ	200	2,128.00	425,600
アークス	600	2,689.00	1,613,400
パローホールディングス	700	2,462.00	1,723,400
ベルク	100	5,790.00	579,000
大庄	200	1,694.00	338,800

ファーストリテイリング	400	56,470.00	22,588,000
サンドラッグ	1,100	4,030.00	4,433,000
サクスパー ホールディングス	300	993.00	297,900
ヤマザワ	100	1,681.00	168,100
やまや	100	2,676.00	267,600
ペルーナ	700	1,172.00	820,400
じもとホールディングス	2,000	160.00	320,000
めぶきフィナンシャルグループ	15,300	368.00	5,630,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	400	1,908.00	763,200
九州フィナンシャルグループ	4,800	510.00	2,448,000
ゆうちょ銀行	8,400	1,329.00	11,163,600
富山第一銀行	700	436.00	305,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	17,600	534.00	9,398,400
西日本フィナンシャルホールディングス	1,900	1,142.00	2,169,800
関西みらいフィナンシャルグループ	1,300	946.00	1,229,800
三十三フィナンシャルグループ	200	2,075.00	415,000
第四北越フィナンシャルグループ	500	4,285.00	2,142,500
新生銀行	2,400	1,741.00	4,178,400
あおぞら銀行	1,800	3,910.00	7,038,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	205,300	688.20	141,287,460
りそなホールディングス	32,400	613.80	19,887,120
三井住友トラスト・ホールディングス	5,800	4,630.00	26,854,000
三井住友フィナンシャルグループ	22,100	4,457.00	98,499,700
千葉銀行	10,400	757.00	7,872,800
群馬銀行	5,900	547.00	3,227,300
武蔵野銀行	500	3,060.00	1,530,000
千葉興業銀行	800	466.00	372,800
筑波銀行	1,200	263.00	315,600
七十七銀行	900	2,426.00	2,183,400
青森銀行	200	3,125.00	625,000
秋田銀行	200	2,728.00	545,600
山形銀行	300	2,320.00	696,000
岩手銀行	200	4,460.00	892,000
東邦銀行	2,600	403.00	1,047,800
東北銀行	200	1,302.00	260,400
みちのく銀行	200	1,781.00	356,200
ふくおかフィナンシャルグループ	2,400	2,995.00	7,188,000
静岡銀行	7,400	1,006.00	7,444,400
十六銀行	400	2,720.00	1,088,000
スルガ銀行	3,000	525.00	1,575,000
八十二銀行	5,300	497.00	2,634,100
山梨中央銀行	400	1,741.00	696,400



大垣共立銀行	500	2,683.00	1,341,500
福井銀行	300	2,078.00	623,400
北國銀行	300	3,985.00	1,195,500
清水銀行	100	2,027.00	202,700
富山銀行	100	3,835.00	383,500
滋賀銀行	600	2,712.00	1,627,200
南都銀行	300	2,689.00	806,700
百五銀行	2,800	424.00	1,187,200
京都銀行	1,100	5,360.00	5,896,000
紀陽銀行	1,100	1,634.00	1,797,400
ほくほくフィナンシャルグループ	2,000	1,474.00	2,948,000
広島銀行	4,400	738.00	3,247,200
山陰合同銀行	1,700	898.00	1,526,600
中国銀行	2,000	1,057.00	2,114,000
鳥取銀行	100	1,624.00	162,400
伊予銀行	4,200	686.00	2,881,200
百十四銀行	300	2,995.00	898,500
四国銀行	500	1,245.00	622,500
阿波銀行	500	3,065.00	1,532,500
大分銀行	200	3,800.00	760,000
宮崎銀行	200	3,040.00	608,000
佐賀銀行	200	2,209.00	441,800
十八銀行	200	3,500.00	700,000
沖縄銀行	300	3,860.00	1,158,000
琉球銀行	600	1,275.00	765,000
セブン銀行	11,100	350.00	3,885,000
みずほフィナンシャルグループ	400,700	194.20	77,815,940
高知銀行	100	1,046.00	104,600
山口フィナンシャルグループ	3,700	1,192.00	4,410,400
長野銀行	100	1,672.00	167,200
名古屋銀行	200	3,660.00	732,000
北洋銀行	4,400	354.00	1,557,600
愛知銀行	100	4,575.00	457,500
中京銀行	100	2,294.00	229,400
大光銀行	100	2,060.00	206,000
愛媛銀行	400	1,162.00	464,800
トマト銀行	100	1,405.00	140,500
京葉銀行	1,300	851.00	1,106,300
栃木銀行	1,500	348.00	522,000
北日本銀行	100	2,513.00	251,300
東和銀行	500	990.00	495,000
福島銀行	300	607.00	182,100

大東銀行	100	1,036.00	103,600
トモニホールディングス	2,400	451.00	1,082,400
フィデアホールディングス	2,900	157.00	455,300
池田泉州ホールディングス	3,100	354.00	1,097,400
F P G	900	1,113.00	1,001,700
S B Iホールディングス	3,300	3,100.00	10,230,000
ジャフコ	400	4,275.00	1,710,000
大和証券グループ本社	25,200	680.40	17,146,080
野村ホールディングス	50,700	555.00	28,138,500
岡三証券グループ	2,500	553.00	1,382,500
丸三証券	900	912.00	820,800
東洋証券	1,100	236.00	259,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	3,300	623.00	2,055,900
光世証券	100	1,129.00	112,900
水戸証券	900	356.00	320,400
いちよし証券	600	1,007.00	604,200
松井証券	1,400	1,192.00	1,668,800
マネックスグループ	3,000	493.00	1,479,000
カブドットコム証券	1,900	389.00	739,100
極東証券	400	1,353.00	541,200
岩井コスモホールディングス	300	1,514.00	454,200
藍澤証券	600	735.00	441,000
かんぽ生命保険	1,100	2,762.00	3,038,200
S O M P Oホールディングス	5,800	4,741.00	27,497,800
アニコム ホールディングス	200	3,455.00	691,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	7,700	3,542.00	27,273,400
ソニーフィナンシャルホールディングス	2,400	2,534.00	6,081,600
第一生命ホールディングス	16,700	2,343.50	39,136,450
東京海上ホールディングス	11,100	5,543.00	61,527,300
T & Dホールディングス	9,100	1,930.00	17,563,000
全国保証	800	4,315.00	3,452,000
クレディセゾン	2,200	1,776.00	3,907,200
芙蓉総合リース	300	6,470.00	1,941,000
興銀リース	600	2,926.00	1,755,600
東京センチュリー	600	6,390.00	3,834,000
日本証券金融	1,200	654.00	784,800
アイフル	4,900	329.00	1,612,100
リコーリース	200	3,450.00	690,000
イオンフィナンシャルサービス	2,100	2,219.00	4,659,900
アコム	5,900	429.00	2,531,100
ジャックス	400	2,205.00	882,000
オリエントコーポレーション	6,400	178.00	1,139,200

日立キャピタル	800	2,913.00	2,330,400
オリックス	19,700	1,833.50	36,119,950
三菱UFJリース	7,500	612.00	4,590,000
日本取引所グループ	8,500	1,918.00	16,303,000
イー・ギャランティ	300	1,242.00	372,600
アサックス	100	586.00	58,600
NECキャピタルソリューション	100	1,842.00	184,200
いちご	4,200	362.00	1,520,400
日本駐車場開発	3,600	163.00	586,800
ヒューリック	6,200	1,009.00	6,255,800
三栄建築設計	100	1,590.00	159,000
スター・マイカ	100	1,613.00	161,300
野村不動産ホールディングス	2,000	2,195.00	4,390,000
三重交通グループホールディングス	600	515.00	309,000
日本商業開発	200	1,737.00	347,400
プレサンスコーポレーション	400	1,341.00	536,400
ユニゾホールディングス	400	2,169.00	867,600
日本管理センター	200	1,279.00	255,800
サンセイランディック	100	1,140.00	114,000
フージャースホールディングス	700	672.00	470,400
オープンハウス	500	5,030.00	2,515,000
東急不動産ホールディングス	7,100	649.00	4,607,900
飯田グループホールディングス	2,500	2,029.00	5,072,500
ムゲンエステート	200	652.00	130,400
ファーストブラザーズ	100	1,285.00	128,500
シーアールイー	100	912.00	91,200
ケイアイスター不動産	100	2,100.00	210,000
パーク24	1,700	3,225.00	5,482,500
パラカ	100	2,052.00	205,200
三井不動産	14,700	2,601.00	38,234,700
三菱地所	21,900	1,828.50	40,044,150
平和不動産	500	2,066.00	1,033,000
東京建物	3,200	1,180.00	3,776,000
ダイビル	800	1,135.00	908,000
京阪神ビルディング	500	814.00	407,000
住友不動産	7,100	4,017.00	28,520,700
大京	500	2,178.00	1,089,000
テーオーシー	1,000	791.00	791,000
レオパレス21	3,500	571.00	1,998,500
スターツコーポレーション	400	2,360.00	944,000
フジ住宅	400	804.00	321,600
空港施設	300	620.00	186,000

明和地所	200	632.00	126,400
ゴールドクレスト	200	1,813.00	362,600
日本エスリード	100	1,473.00	147,300
日神不動産	400	528.00	211,200
日本エスコン	500	717.00	358,500
タカラレーベン	1,400	318.00	445,200
サンヨーハウジング名古屋	200	1,027.00	205,400
イオンモール	1,900	2,067.00	3,927,300
ファースト住建	100	1,408.00	140,800
トーセイ	400	996.00	398,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,800	1,678.00	3,020,400
サンフロンティア不動産	400	1,131.00	452,400
エフ・ジェー・ネクスト	200	839.00	167,800
グランディハウス	300	464.00	139,200
日本空港ビルデング	900	4,545.00	4,090,500
日本工営	200	2,697.00	539,400
L I F U L L	1,000	584.00	584,000
ジェイエイシーリクルートメント	200	2,310.00	462,000
日本M&Aセンター	2,000	3,090.00	6,180,000
タケエイ	300	782.00	234,600
トラスト・テック	100	3,735.00	373,500
コシダカホールディングス	800	1,376.00	1,100,800
パソナグループ	300	1,509.00	452,700
リンクアンドモチベーション	500	1,205.00	602,500
G C A	300	914.00	274,200
エス・エム・エス	1,100	2,015.00	2,216,500
パーソルホールディングス	2,600	2,401.00	6,242,600
リニカル	200	1,681.00	336,200
クックパッド	900	433.00	389,700
アイ・ケイ・ケイ	100	768.00	76,800
学情	100	1,541.00	154,100
スタジオアリス	100	2,601.00	260,100
シミックホールディングス	200	2,232.00	446,400
N J S	100	1,735.00	173,500
総合警備保障	1,100	4,990.00	5,489,000
カカクコム	2,200	2,147.00	4,723,400
セントケア・ホールディング	100	644.00	64,400
ルネサンス	100	2,567.00	256,700
ディップ	400	2,611.00	1,044,400
ツクイ	700	1,049.00	734,300
エムスリー	6,000	2,232.00	13,392,000
ツカダ・グローバルホールディング	200	619.00	123,800

アウトソーシング	1,500	1,560.00	2,340,000
ウェルネット	300	1,106.00	331,800
ワールドホールディングス	100	2,900.00	290,000
ディー・エヌ・エー	1,500	1,933.00	2,899,500
博報堂DYホールディングス	4,000	1,991.00	7,964,000
ぐるなび	500	911.00	455,500
エスアールジータカミヤ	300	632.00	189,600
ファンコミュニケーションズ	800	642.00	513,600
ライク	100	1,681.00	168,100
WDBホールディングス	100	3,235.00	323,500
ティア	100	825.00	82,500
バリューコマース	200	2,223.00	444,600
インフォマート	1,600	1,250.00	2,000,000
J Pホールディングス	900	308.00	277,200
E P Sホールディングス	400	2,198.00	879,200
レグス	100	1,238.00	123,800
プレステージ・インターナショナル	600	1,330.00	798,000
アミューズ	200	2,963.00	592,600
クイック	200	1,927.00	385,400
ケネディクス	2,700	605.00	1,633,500
電通	3,500	5,660.00	19,810,000
ぴあ	100	5,500.00	550,000
イオンファンタジー	100	3,815.00	381,500
シーティーエス	300	665.00	199,500
ネクシィーズグループ	100	2,233.00	223,300
みらかホールディングス	900	2,913.00	2,621,700
アルプス技研	300	2,442.00	732,600
ダイオーズ	100	1,305.00	130,500
日本空調サービス	300	791.00	237,300
オリエンタルランド	3,400	10,820.00	36,788,000
ダスキン	800	2,692.00	2,153,600
明光ネットワークジャパン	400	1,000.00	400,000
ファルコホールディングス	100	1,738.00	173,800
ラウンドワン	900	1,391.00	1,251,900
リゾートトラスト	1,200	1,710.00	2,052,000
ビー・エム・エル	400	3,290.00	1,316,000
りらいあコミュニケーションズ	500	1,345.00	672,500
リソー教育	500	1,086.00	543,000
ユー・エス・エス	3,500	2,013.00	7,045,500
東京個別指導学院	100	1,404.00	140,400
サイバーエージェント	1,800	5,520.00	9,936,000
楽天	13,300	772.60	10,275,580

クリーク・アンド・リバー社	100	1,102.00	110,200
テー・オー・ダブリュー	300	832.00	249,600
セントラルスポーツ	100	4,160.00	416,000
フルキャストホールディングス	300	2,269.00	680,700
テクノプロ・ホールディングス	500	6,110.00	3,055,000
ジャパンマテリアル	800	1,498.00	1,198,400
ベクトル	300	2,064.00	619,200
ウチヤマホールディングス	100	500.00	50,000
I B J	200	790.00	158,000
アサンテ	100	2,360.00	236,000
M & A キャピタルパートナーズ	100	6,090.00	609,000
日本ビューホテル	100	1,362.00	136,200
リクルートホールディングス	22,000	3,311.00	72,842,000
日本郵政	16,200	1,360.00	22,032,000
ベルシステム24ホールディングス	500	1,619.00	809,500
ストライク	100	3,485.00	348,500
ソラスト	500	1,323.00	661,500
リログループ	1,600	2,897.00	4,635,200
東祥	200	4,780.00	956,000
エイチ・アイ・エス	500	3,635.00	1,817,500
共立メンテナンス	500	4,835.00	2,417,500
イチネンホールディングス	300	1,410.00	423,000
建設技術研究所	200	1,601.00	320,200
スペース	200	1,306.00	261,200
燦ホールディングス	100	2,664.00	266,400
タナベ経営	100	1,722.00	172,200
ナガワ	100	5,180.00	518,000
よみうりランド	100	4,290.00	429,000
東京都競馬	200	4,065.00	813,000
常磐興産	100	1,742.00	174,200
カナモト	400	3,985.00	1,594,000
東京ドーム	1,200	998.00	1,197,600
西尾レントオール	300	3,775.00	1,132,500
トランス・コスモス	300	2,772.00	831,600
乃村工藝社	700	2,663.00	1,864,100
藤田観光	100	3,435.00	343,500
KNT-CTホールディングス	200	1,235.00	247,000
日本管財	300	2,063.00	618,900
トーカイ	300	2,475.00	742,500
セコム	3,000	9,332.00	27,996,000
セントラル警備保障	100	5,250.00	525,000
丹青社	600	1,178.00	706,800

メイテック	300	5,050.00	1,515,000	
応用地質	300	1,400.00	420,000	
船井総研ホールディングス	600	2,378.00	1,426,800	
進学会ホールディングス	100	617.00	61,700	
いであ	100	1,119.00	111,900	
ベネッセホールディングス	1,000	3,160.00	3,160,000	
イオンディライト	400	3,750.00	1,500,000	
ナック	200	1,045.00	209,000	
ニチイ学館	500	964.00	482,000	
ダイセキ	500	2,858.00	1,429,000	
ステップ	100	1,570.00	157,000	
合 計	3,376,400		7,176,270,630	

## (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30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	208,853,046	171,416,882
コール・ローン	26,312,022	5,049,900
株式	5,975,147,722	5,088,024,233
投資信託受益証券	432,069	-
投資証券	137,541,724	112,941,116
派生商品評価勘定	2,892,010	-
未収入金	58,684	-
未収配当金	8,136,772	5,114,809
差入委託証拠金	63,243,517	58,100,898
流動資産合計	6,422,617,566	5,440,647,838
<b>資産合計</b>		
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	3,021,158	11,139,214
未払解約金	20,068,000	5,910,000
未払利息	59	11
流動負債合計	23,089,217	17,049,225
負債合計	23,089,217	17,049,225

平成30年 4月20日現在

平成30年10月22日現在

純資産の部		
元本等		
元本	2,814,681,019	2,303,822,605
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	3,584,847,330	3,119,776,008
元本等合計	6,399,528,349	5,423,598,613
純資産合計	6,399,528,349	5,423,598,613
負債純資産合計	6,422,617,566	5,440,647,838

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22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 (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。 (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 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30年 4月20日現在		平成30年10月22日現在	
1. 計算日における受益権の総数	2,814,681,019口	1. 計算日における受益権の総数	2,303,822,605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	2.2736円	1口当たり純資産額	2.3542円
(1万口当たり純資産額)	(22,736円)	(1万口当たり純資産額)	(23,542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10月21日 至 平成30年 4月20日	自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため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。	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、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。 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。	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30年 4月20日現在	平成30年10月22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>

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

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

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

## ( その他の注記 )

## 1 元本の移動

区分	平成30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	3,364,583,423円	2,814,681,019円
期中追加設定元本額	92,883,764円	37,321,147円
期中一部解約元本額	642,786,168円	548,179,561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	316,216,743円	297,858,387円
新光外国株式インデックスVA	551,653,419円	455,565,594円
新光世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	325,591,338円	211,993,951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)	279,336,775円	143,360,607円
新光世界バランス35VAT(適格機関投資家私募)	89,805,424円	67,589,562円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	804,269,269円	724,716,280円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	431,157,671円	388,825,269円
グローバル・ナビ	16,650,380円	13,912,955円
合計	2,814,681,019円	2,303,822,605円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	平成30年 4月20日現在	平成30年10月22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	137,953,997	100,556,352
投資信託受益証券	116,078	-
投資証券	15,503,616	7,157,977
合計	122,334,303	93,398,375

(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30年 4月20日現在				平成30年10月22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								
株値指数先物取引								
買建	283,104,967	-	282,967,075	137,892	241,890,832	-	230,761,101	11,129,731
S&P500 EMINI	189,160,232	-	188,145,352	1,014,880	164,011,544	-	155,658,037	8,353,507
S&P/TSE 601X	15,562,561	-	15,393,133	169,428	16,214,141	-	15,697,968	516,173
DJ EURO ST50	44,293,559	-	45,270,416	976,857	38,692,061	-	37,273,201	1,418,860
FTSE 100 IDX	21,663,058	-	22,011,124	348,066	10,667,926	-	10,315,510	352,416
SPI 200	12,425,557	-	12,147,050	278,507	12,305,160	-	11,816,385	488,775
合計	283,104,967	-	282,967,075	137,892	241,890,832	-	230,761,101	11,129,731

## 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はありません。

(通貨関連)

種類	平成30年 4月20日現在				平成30年10月22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	-	-	-	-	5,350,000	-	5,359,483	9,483
米ドル	-	-	-	-	3,040,000	-	3,044,059	4,059
英ポンド	-	-	-	-	1,110,000	-	1,113,944	3,944
スイスフラン	-	-	-	-	1,200,000	-	1,201,480	1,480
合計	-	-	-	-	5,350,000	-	5,359,483	9,483

## 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	690	66.00	45,540.00	
	ANTERO RESOURCES CORPORATION	453	18.21	8,249.13	
	APACHE CORP	377	42.10	15,871.70	
	BAKER HUGHES A GE CO LLC	504	29.94	15,089.76	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	1,029	23.97	24,665.13	
	CHENIERE ENERGY INC	238	64.32	15,308.16	

CHEVRON CORP	2,406	118.14	284,244.84
CONCHO RESOURCES INC	236	147.54	34,819.44
CONOCOPHILLIPS	1,466	72.49	106,270.34
CONTINENTAL RESOURCES INC	189	59.13	11,175.57
DEVON ENERGY CORPORATION	535	34.94	18,692.90
DIAMONDBACK ENERGY INC	190	127.10	24,149.00
EOG RESOURCES INC	783	117.67	92,135.61
EQT CORPORATION	382	46.38	17,717.16
EXXON MOBIL CORP	5,317	81.97	435,834.49
HALLIBURTON CO	759	37.54	28,492.86
HELMERICH & PAYNE INC	236	66.15	15,611.40
HESS CORPORATION	235	63.56	14,936.60
HOLLYFRONTIER CORPORATION	200	63.17	12,634.00
KINDER MORGAN INC	2,486	17.98	44,698.28
MARATHON OIL CORP	798	20.67	16,494.66
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	885	73.92	65,419.20
NATIONAL OILWELL VARCO INC	479	40.40	19,351.60
NEWFIELD EXPLORATION CO	440	23.62	10,392.80
NOBLE ENERGY INC	392	29.22	11,454.24
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,008	72.18	72,757.44
ONEOK INC	411	67.79	27,861.69
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	480	28.09	13,483.20
PHILLIPS 66	522	102.77	53,645.94
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	270	166.78	45,030.60
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	317	23.53	7,459.01
SCHLUMBERGER LIMITED	1,880	58.47	109,923.60
TARGA RESOURCES CORPORATION	442	56.56	24,999.52
TECHNIPFMC PLC	262	29.34	7,687.08
VALERO ENERGY CORP	586	92.76	54,357.36
WILLIAMS COS INC	1,448	26.74	38,719.52
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	267	155.40	41,491.80
ALBEMARLE CORPORATION	241	95.63	23,046.83
AVERY DENNISON CORPORATION	197	97.58	19,223.26
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	479	25.50	12,214.50
BALL CORPORATION	190	45.93	8,726.70
CELANESE CORPORATION	82	99.62	8,168.84
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	279	50.64	14,128.56
CROWN HOLDINGS INC	308	45.39	13,980.12
DOWDUPONT INC	3,128	57.49	179,828.72
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	84	80.77	6,784.68
ECOLAB INC	312	148.55	46,347.60
FMC CORPORATION	146	81.35	11,877.10

FREEMPORT-MCMORAN INC	1,575	12.02	18,931.50
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	66	139.12	9,181.92
INTERNATIONAL PAPER CO	301	42.24	12,714.24
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV-CLASS A	433	93.59	40,524.47
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	72	161.67	11,640.24
NEWMONT MINING CORP	846	32.19	27,232.74
NUCOR CORP	394	58.39	23,005.66
PACKAGING CORPORATION OF AMERICA	35	87.92	3,077.20
PPG INDUSTRIES INC	247	101.39	25,043.33
PRAXAIR INC	321	159.85	51,311.85
SEALED AIR CORPORATION	49	32.10	1,572.90
STEEL DYNAMICS INC	498	41.03	20,432.94
THE MOSAIC COMPANY	736	33.16	24,405.76
THE SHERWIN-WILLIAMS COMPANY	96	403.38	38,724.48
VULCAN MATERIALS CO	156	92.84	14,483.04
WESTROCK COMPANY	389	42.48	16,524.72
3M CO	771	199.85	154,084.35
A.O. SMITH CORPORATION	327	45.18	14,773.86
ACUITY BRANDS INC	98	123.94	12,146.12
AGCO CORPORATION	132	54.39	7,179.48
ALLEGION PUBLIC LIMITED COMPANY	196	81.79	16,030.84
AMETEK INC	369	70.61	26,055.09
ARCONIC INC	810	21.88	17,722.80
BOEING CO	716	356.26	255,082.16
CATERPILLAR INC	839	131.32	110,177.48
CUMMINS INC	127	139.96	17,774.92
DEERE & CO	337	145.91	49,171.67
DOVER CORP	249	82.41	20,520.09
EATON CORPORATION PLC	554	77.29	42,818.66
EMERSON ELECTRIC CO	775	72.27	56,009.25
FASTENAL CO	249	52.00	12,948.00
FLOWSERVE CORPORATION	289	49.80	14,392.20
FLUOR CORP	308	46.66	14,371.28
FORTIVE CORPORATION	346	79.79	27,607.34
GENERAL DYNAMICS CORP	316	190.26	60,122.16
GENERAL ELECTRIC CO(US)	11,472	12.56	144,088.32
HARRIS CORPORATION	85	168.93	14,359.05
HD SUPPLY HOLDINGS INC	414	38.12	15,781.68
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	916	153.47	140,578.52
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	41	234.42	9,611.22
IDEX CORPORATION	157	132.86	20,859.02
ILLINOIS TOOL WORKS	364	127.03	46,238.92

INGERSOLL-RAND PLC	232	93.83	21,768.56
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	259	72.28	18,720.52
JARDINE MATHESON HLDGS LIMITED	400	58.90	23,560.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	500	33.63	16,815.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	1,059	32.93	34,872.87
L3 TECHNOLOGIES INC	42	215.23	9,039.66
LENNOX INTERNATIONAL INC	79	193.12	15,256.48
LOCKHEED MARTIN CORP	355	328.14	116,489.70
NORTHROP GRUMMAN CORP	205	307.67	63,072.35
PACCAR INC	558	60.23	33,608.34
PARKER HANNIFIN CORP	211	157.87	33,310.57
PENTAIR PLC	354	38.41	13,597.14
RAYTHEON COMPANY	405	191.01	77,359.05
ROCKWELL AUTOMATION INC	108	163.70	17,679.60
ROCKWELL COLLINS INC.	267	131.50	35,110.50
ROPER TECHNOLOGIES INC	162	278.01	45,037.62
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	378	43.21	16,333.38
SNAP-ON INC	10	150.51	1,505.10
STANLEY BLACK & DECKER INC	252	118.10	29,761.20
TEXTRON INC	394	56.75	22,359.50
THE MIDDLEBY CORPORATION	127	114.67	14,563.09
TRANSDIGM GROUP INC	55	337.19	18,545.45
UNITED RENTALS INC	85	117.12	9,955.20
UNITED TECHNOLOGIES CORP	913	128.68	117,484.84
WABCO HOLDINGS INC	116	105.89	12,283.24
WABTEC CORPORATION	191	95.79	18,295.89
WW GRAINGER INC	48	276.28	13,261.44
XYLEM INC	313	69.27	21,681.51
CINTAS CORPORATION	88	178.66	15,722.08
COPART INC	234	49.28	11,531.52
COSTAR GROUP INC	41	383.49	15,723.09
EQUIFAX INC	149	123.56	18,410.44
IHS MARKIT LIMITED	483	52.05	25,140.15
MANPOWER GROUP	148	75.39	11,157.72
NIELSEN HOLDINGS PLC	291	26.95	7,842.45
REPUBLIC SERVICES INC	210	72.10	15,141.00
ROBERT HALF INTL INC	118	61.72	7,282.96
ROLLINS INC	201	56.89	11,434.89
STERICYCLE INC	188	53.05	9,973.40
TRANSUNION	214	68.17	14,588.38
VERISK ANALYTICS INC	110	116.14	12,775.40
WASTE CONNECTIONS INC	297	77.09	22,895.73



WASTE MANAGEMENT INC	504	90.44	45,581.76
AMERCO	16	328.29	5,252.64
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	278	32.04	8,907.12
C H ROBINSON WORLDWIDE INC	95	90.86	8,631.70
CSX CORP	1,193	67.94	81,052.42
DELTA AIR LINES INC	375	53.39	20,021.25
EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON	24	66.26	1,590.24
FEDEX CORP	332	219.80	72,973.60
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	83	111.63	9,265.29
KANSAS CITY SOUTHERN	92	106.12	9,763.04
NORFOLK SOUTHERN CORP	383	163.92	62,781.36
SWIFT TRANSPORTATION COMPANY	237	30.41	7,207.17
UNION PACIFIC CORP	1,053	148.70	156,581.10
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	175	87.43	15,300.25
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	843	116.49	98,201.07
XPO LOGISTICS INC	139	94.70	13,163.30
APTIV PLC	441	74.29	32,761.89
AUTOLIV INC	102	79.98	8,157.96
BORGWARNER INC	67	36.68	2,457.56
FORD MOTOR CO	3,735	8.50	31,747.50
GENERAL MOTORS CO	1,648	31.20	51,417.60
HARLEY-DAVIDSON INC	391	39.57	15,471.87
TESLA INC	189	260.00	49,140.00
THE GOODYEAR TIRE & RUBBER COMPANY	517	20.27	10,479.59
DR HORTON INC	358	35.92	12,859.36
GARMIN LIMITED	262	61.97	16,236.14
HANESBRANDS INC	836	16.32	13,643.52
HASBRO INC	230	98.04	22,549.20
LEGGETT & PLATT INC	296	38.28	11,330.88
LENNAR CORPORATION-CLASS A	408	40.83	16,658.64
LULULEMON ATHLETICA INC	126	136.77	17,233.02
MATTEL INC	757	14.22	10,764.54
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	179	58.06	10,392.74
MOHAWK INDUSTRIES INC	41	150.31	6,162.71
NEWELL BRANDS INC	990	16.95	16,780.50
NIKE INC -CL B	1,742	74.21	129,273.82
NVR INC	7	2,170.00	15,190.00
POLARIS INDUSTRIES INC	135	90.33	12,194.55
PVH CORPORATION	61	121.21	7,393.81
RALPH LAUREN CORPORATION	125	123.48	15,435.00
TAPESTRY INC	307	42.51	13,050.57
TOLL BROTHERS INC	357	30.02	10,717.14

UNDER ARMOUR INC-CLASS A	421	18.20	7,662.20
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	429	16.80	7,207.20
VF CORP	540	77.76	41,990.40
WHIRLPOOL CORP	53	106.89	5,665.17
ARAMARK	36	38.25	1,377.00
CARNIVAL CORP(US)	553	57.23	31,648.19
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	29	428.54	12,427.66
DARDEN RESTAURANTS INC	133	106.33	14,141.89
DOMINO'S PIZZA INC	32	267.75	8,568.00
H&R BLOCK INC	425	25.81	10,969.25
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	441	70.66	31,161.06
LAS VEGAS SANDS CORP	629	55.66	35,010.14
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	436	112.04	48,849.44
MCDONALD'S CORP	1,087	167.49	182,061.63
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LTD-ADR	436	17.78	7,752.08
MGM RESORTS INTERNATIONAL	480	26.65	12,792.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	352	49.00	17,248.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	186	115.18	21,423.48
STARBUCKS CORP	1,949	58.66	114,328.34
VAIL RESORTS INC	82	246.43	20,207.26
WYNN RESORTS LTD	180	110.20	19,836.00
YUM! BRANDS INC	315	89.40	28,161.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	962	69.75	67,099.50
ALPHABET INC-CL A	381	1,105.18	421,073.58
ALPHABET INC-CL C	405	1,096.46	444,066.30
CBS CORP-CLASS B	308	57.20	17,617.60
CHARTER COMMUNICATIONS INC-CL A	225	321.34	72,301.50
COMCAST CORP-CL A	6,176	35.98	222,212.48
DISCOVERY INC-A	348	33.40	11,623.20
DISCOVERY INC-C	32	30.21	966.72
DISH NETWORK CORPORATION-A	486	34.91	16,966.26
ELECTRONIC ARTS INC	418	102.11	42,681.98
FACEBOOK INC-A	3,068	154.05	472,625.40
IAC/INTERACTIVECORP	88	195.64	17,216.32
INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC	356	24.65	8,775.40
LIBERTY BROADBAND-C	237	83.26	19,732.62
LIBERTY GLOBAL PLC-A	540	26.01	14,045.40
LIBERTY GLOBAL PLC-C	224	25.34	5,676.16
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	211	41.99	8,859.89
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	47	42.01	1,974.47
NETFLIX INC	559	332.67	185,962.53
NEWS CORPRATION-CLASS A	845	13.13	11,094.85

OMNICOM GROUP	86	77.07	6,628.02
SIRIUS XM HOLDINGS INC	3,387	6.01	20,355.87
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	194	122.45	23,755.30
THE WALT DISNEY CO.	1,862	118.90	221,391.80
TRIPADVISOR INC	274	46.60	12,768.40
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS A	1,361	45.84	62,388.24
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS B	554	45.53	25,223.62
TWITTER INC	889	28.83	25,629.87
VIACOM INC-CLASS B	713	33.23	23,692.99
ZILLOW GROUP INC-C	254	39.22	9,961.88
ADVANCE AUTO PARTS INC	64	164.33	10,517.12
AMAZON.COM INC	526	1,764.03	927,879.78
AUTOZONE INC	29	725.80	21,048.20
BEST BUY CO INC	351	70.79	24,847.29
BOOKING HOLDINGS INC	64	1,805.74	115,567.36
CARMAX INC	190	68.65	13,043.50
DOLLAR GENERAL CORPORATION	435	109.55	47,654.25
DOLLAR TREE INC	376	84.51	31,775.76
EBAY INC	1,133	28.75	32,573.75
EXPEDIA GROUP INC	150	118.32	17,748.00
GAP INC/THE	529	25.28	13,373.12
GENUINE PARTS CO	111	101.34	11,248.74
HOME DEPOT INC	1,465	179.85	263,480.25
KOHL'S CORP	158	71.26	11,259.08
L BRANDS INC	521	29.64	15,442.44
LKQ CORPORATION	82	27.76	2,276.32
LOWE'S COS INC	1,133	99.59	112,835.47
MACY'S INC	350	32.34	11,319.00
MERCADOLIBRE INC	52	301.87	15,697.24
NORDSTROM INC	106	59.44	6,300.64
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	79	339.87	26,849.73
QURATE RETAIL INC	920	22.15	20,378.00
ROSS STORES INC	417	94.69	39,485.73
TARGET CORP	687	82.02	56,347.74
TIFFANY & CO	103	107.01	11,022.03
TJX COMPANIES INC	820	107.26	87,953.20
TRACTOR SUPPLY COMPANY	129	86.86	11,204.94
ULTA BEAUTY INC	71	270.78	19,225.38
COSTCO WHOLESALE CORP	541	229.67	124,251.47
KROGER CO	936	27.56	25,796.16
SYSCO CORP	616	71.10	43,797.60
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,171	77.35	90,576.85

WALMART INC	1,859	97.15	180,601.85
ALTRIA GROUP INC	2,527	61.95	156,547.65
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	902	49.54	44,685.08
BROWN-FORMAN CORPORATION-CLASS B	296	48.09	14,234.64
BUNGE LIMITED	286	67.43	19,284.98
CAMPBELL SOUP COMPANY	378	37.93	14,337.54
COCA-COLA CO/THE	5,055	46.33	234,198.15
CONAGRA BRANDS INC	189	35.84	6,773.76
CONSTELLATION BRANDS INC-A	223	222.93	49,713.39
GENERAL MILLS INC	710	44.54	31,623.40
HERSHEY CO/THE	149	106.58	15,880.42
HORMEL FOODS CORPORATION	309	41.73	12,894.57
INGREDION INCORPORATED	160	102.60	16,416.00
KELLOGG COMPANY	297	71.17	21,137.49
KRAFT HEINZ CO/THE	728	57.56	41,903.68
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	233	140.65	32,771.45
MOLSON COORS BREWING CO-B	66	59.90	3,953.40
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	2,102	41.80	87,863.60
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	631	52.11	32,881.41
PEPSICO INC	1,913	110.29	210,984.77
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	2,093	88.83	185,921.19
THE JM SMUCKER COMPANY	187	104.98	19,631.26
TYSON FOODS INC-CL A	310	62.43	19,353.30
CHURCH & DWIGHT CO INC	169	60.33	10,195.77
CLOROX COMPANY	137	152.57	20,902.09
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,040	64.52	67,100.80
COTY INC-CL A	1,073	10.53	11,298.69
ESTEE LAUDER COMPANIES INC-CL A	355	125.45	44,534.75
KIMBERLY-CLARK CORP	439	110.23	48,390.97
PROCTER & GAMBLE CO	3,163	87.30	276,129.90
ABBOTT LABORATORIES	2,154	67.59	145,588.86
ABIOMED INC	56	362.42	20,295.52
AETNA INC	429	200.19	85,881.51
ALIGN TECHNOLOGY INC	98	312.79	30,653.42
AMERISOURCEBERGEN CORP	142	92.80	13,177.60
ANTHEM INC	345	279.15	96,306.75
BAXTER INTERNATIONAL INC.	584	69.46	40,564.64
BECTON DICKINSON & CO	366	238.09	87,140.94
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,755	36.54	64,127.70
CARDINAL HEALTH INC	179	53.19	9,521.01
CENTENE CORPORATION	270	142.78	38,550.60
CERNER CORPORATION	354	62.98	22,294.92

CIGNA CORP	343	210.00	72,030.00
CVS HEALTH CORPORATION	1,403	74.18	104,074.54
DANAHER CORP	887	100.39	89,045.93
DAVITA INC	149	67.65	10,079.85
DENTSPLY SIRONA INC	149	36.28	5,405.72
EDWARDS LIFESCIENCES CORPORATION	333	145.42	48,424.86
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	768	95.30	73,190.40
HCA HEALTHCARE INC	332	133.71	44,391.72
HENRY SCHEIN INC	158	82.51	13,036.58
HOLOGIC INC	554	40.83	22,619.82
HUMANA INC	194	328.38	63,705.72
IDEXX LABORATORIES INC	96	218.40	20,966.40
INTUITIVE SURGICAL INC	152	504.26	76,647.52
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	75	172.60	12,945.00
MCKESSON CORP	282	132.39	37,333.98
MEDTRONIC PLC	1,825	93.94	171,440.50
QUEST DIAGNOSTICS	46	102.50	4,715.00
RESMED INC	133	102.98	13,696.34
STRYKER CORP	453	168.94	76,529.82
TELEFLEX INC	50	243.39	12,169.50
THE COOPER COS INC	38	254.21	9,659.98
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,236	265.30	327,910.80
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	98	125.79	12,327.42
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	54	104.19	5,626.26
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	219	91.63	20,066.97
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	214	124.40	26,621.60
ABBVIE INC	2,037	87.97	179,194.89
AGILENT TECHNOLOGIES INC	322	64.47	20,759.34
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	282	125.89	35,500.98
ALKERMES PLC	336	40.16	13,493.76
ALLERGAN PLC	458	189.53	86,804.74
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	108	76.65	8,278.20
AMGEN INC	831	201.80	167,695.80
BIOGEN INC	291	320.41	93,239.31
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	122	103.22	12,592.84
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,160	54.30	117,288.00
CELGENE CORP	900	82.41	74,169.00
ELI LILLY & CO	1,348	111.92	150,868.16
GILEAD SCIENCES INC	1,600	73.27	117,232.00
ILLUMINA INC	208	313.10	65,124.80
INCYTE CORP	201	66.06	13,278.06
IQIVA HOLDINGS INC	194	126.89	24,616.66

JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	65	155.99	10,139.35
JOHNSON & JOHNSON	3,403	139.05	473,187.15
MERCK & CO. INC.	3,405	72.35	246,351.75
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	24	558.34	13,400.16
MYLAN NV	570	32.21	18,359.70
NEKTAR THERAPEUTICS	216	48.19	10,409.04
PERRIGO CO PLC	265	71.89	19,050.85
PFIZER INC	7,499	44.50	333,705.50
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	87	389.83	33,915.21
SEATTLE GENETICS INC	219	71.80	15,724.20
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	1,204	21.43	25,801.72
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	497	227.15	112,893.55
UNITED THERAPEUTICS CORPORATION	94	122.95	11,557.30
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	354	175.69	62,194.26
WATERS CORP	70	185.42	12,979.40
ZOETIS INC	638	91.47	58,357.86
BANK OF AMERICA CORPORATION	12,361	28.32	350,063.52
BB&T CORPORATION	1,112	48.92	54,399.04
CIT GROUP INC	297	48.35	14,359.95
CITIGROUP INC	3,218	68.86	221,591.48
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	589	36.37	21,421.93
COMERICA INC	198	84.41	16,713.18
EAST WEST BANCORP INC	296	53.84	15,936.64
FIFTH THIRD BANCORP	602	26.33	15,850.66
FIRST REPUBLIC BANK/CA	130	89.88	11,684.40
HUNTINGTON BANCSHARES INC	459	14.20	6,517.80
JPMORGAN CHASE & CO	4,379	107.91	472,537.89
KEYCORP	1,329	17.84	23,709.36
M & T BANK CORP	167	162.63	27,159.21
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	1,078	9.81	10,575.18
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	689	16.04	11,051.56
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	602	125.16	75,346.32
REGIONS FINANCIAL CORP	1,490	16.90	25,181.00
SIGNATURE BANK	119	112.80	13,423.20
SUNTRUST BANKS INC	640	62.79	40,185.60
SVB FINANCIAL GROUP	58	281.84	16,346.72
US BANCORP	1,882	52.50	98,805.00
WELLS FARGO & COMPANY	5,911	52.89	312,632.79
ZIONS BANCORPORATION	415	46.97	19,492.55
ALLY FINANCIAL INC	381	25.94	9,883.14
AMERICAN EXPRESS CO	996	106.73	106,303.08
AMERIPRISE FINANCIAL INC	242	135.86	32,878.12

BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	1,304	47.40	61,809.60
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,624	209.83	340,763.92
BLACKROCK INC	174	401.65	69,887.10
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	606	91.63	55,527.78
CBOE GLOBAL MARKETS INC	207	104.20	21,569.40
CME GROUP INC	427	182.65	77,991.55
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	399	76.03	30,335.97
E*TRADE FINANCIAL CORP	270	49.08	13,251.60
EATON VANCE CORPORATION	260	45.83	11,915.80
FRANKLIN RESOURCES INC	237	29.76	7,053.12
GOLDMAN SACHS GROUP INC	485	226.96	110,075.60
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	729	74.29	54,157.41
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	717	21.44	15,372.48
MOODY'S CORP	273	159.77	43,617.21
MORGAN STANLEY	1,923	46.42	89,265.66
MSCI INC	74	153.86	11,385.64
NASDAQ INC	247	80.72	19,937.84
NORTHERN TRUST CORP	346	93.14	32,226.44
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	141	86.36	12,176.76
S&P GLOBAL INC	317	188.34	59,703.78
SEI INVESTMENTS COMPANY	297	54.59	16,213.23
STATE STREET CORP	490	72.90	35,721.00
SYNCHRONY FINANCIAL	776	31.36	24,335.36
T ROWE PRICE GROUP INC	258	100.06	25,815.48
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	241	50.48	12,165.68
THE CHARLES SCHWAB CORPORATION	1,738	46.83	81,390.54
VOYA FINANCIAL INC	76	46.65	3,545.40
AFLAC INC	1,110	44.47	49,361.70
ALLEGHANY CORPORATION	3	614.82	1,844.46
ALLSTATE CORP	449	97.32	43,696.68
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	153	102.22	15,639.66
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,241	47.20	58,575.20
AON PLC	326	151.10	49,258.60
ARCH CAPITAL GROUP LTD	756	27.71	20,948.76
ARTHUR J GALLAGHER & CO	122	72.67	8,865.74
ASSURANT INC	126	106.17	13,377.42
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	156	48.74	7,603.44
AXIS CAPITAL HOLDINGS LIMITED	196	55.85	10,946.60
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	173	41.98	7,262.54
CHUBB LIMITED	665	128.28	85,306.20
CINCINNATI FINANCIAL CORPORATION	93	76.31	7,096.83
EVEREST RE GROUP LTD	90	216.18	19,456.20

FNF GROUP	541	34.89	18,875.49
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	392	46.64	18,282.88
LINCOLN NATIONAL CORP	319	64.00	20,416.00
LOEWS CORPORATION	231	47.00	10,857.00
MARKEL CORPORATION	12	1,120.52	13,446.24
MARSH & MCLENNAN COS	602	80.46	48,436.92
METLIFE INC	1,238	43.84	54,273.92
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	457	53.56	24,476.92
PROGRESSIVE CORP	716	70.55	50,513.80
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	431	97.60	42,065.60
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	142	137.05	19,461.10
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	94	132.34	12,439.96
TORCHMARK CORPORATION	55	86.03	4,731.65
TRAVELERS COS INC/THE	357	126.07	45,006.99
UNUM GROUP	471	37.65	17,733.15
WILLIS TOWERS WATSON PLC	147	139.98	20,577.06
WR BERKLEY CORP	215	73.93	15,894.95
CBRE GROUP INC	542	39.55	21,436.10
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	643	6.09	3,915.87
JONES LANG LASALLE INCORPORATED	104	133.02	13,834.08
ACCENTURE PLC	870	158.28	137,703.60
ADOBE INC	633	245.03	155,103.99
AKAMAI TECHNOLOGIES	210	64.24	13,490.40
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	34	216.18	7,350.12
ANSYS INC	90	150.58	13,552.20
AUTODESK INC	315	133.18	41,951.70
AUTOMATIC DATA PROCESSING	625	143.41	89,631.25
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	107	116.96	12,514.72
CA INC	140	43.96	6,154.40
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	572	40.11	22,942.92
CDK GLOBAL INC	281	57.28	16,095.68
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	105	110.27	11,578.35
CITRIX SYSTEMS INC	136	100.70	13,695.20
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP-A	750	73.69	55,267.50
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	272	93.78	25,508.16
DXC TECHNOLOGY CO	466	88.30	41,147.80
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	438	103.75	45,442.50
FIRST DATA CORP- CLASS A	711	23.41	16,644.51
FISERV INC	477	78.53	37,458.81
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	102	204.09	20,817.18
FORTINET INC	149	81.20	12,098.80
GARTNER INC	100	146.24	14,624.00



GLOBAL PAYMENTS INC	138	116.50	16,077.00
GODADDY INC-CLASS A	165	74.80	12,342.00
INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION	1,139	129.10	147,044.90
INTUIT INC	319	211.10	67,340.90
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	159	152.95	24,319.05
LEIDOS HOLDINGS INC	293	67.57	19,798.01
MASTERCARD INCORPORATED	1,219	203.06	247,530.14
MICROSOFT CORP	9,389	108.66	1,020,208.74
ORACLE CORPORATION	4,193	47.59	199,544.87
PAYCHEX INC	331	67.94	22,488.14
PAYPAL HOLDINGS INC	1,447	84.78	122,676.66
RED HAT INC	293	120.12	35,195.16
SABRE CORPORATION	465	24.90	11,578.50
SALESFORCE COM INC	933	140.49	131,077.17
SERVICENOW INC	270	177.15	47,830.50
SPLUNK INC	149	94.80	14,125.20
SQUARE INC - A	387	74.07	28,665.09
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	356	50.29	17,903.24
SYMANTEC CORPORATION	572	19.67	11,251.24
SYNOPSIS INC	104	88.10	9,162.40
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	141	92.91	13,100.31
VERISIGN INC	115	141.39	16,259.85
VISA INC-CLASS A SHARES	2,326	140.08	325,826.08
VMWARE INC-CLASS A	142	140.46	19,945.32
WORKDAY INC-CLASS A	171	127.70	21,836.70
WORLDPAY INC-CLASS A	325	95.16	30,927.00
AMPHENOL CORPORATION-CL A	503	82.97	41,733.91
APPLE INC	6,339	219.31	1,390,206.09
ARISTA NETWORKS INC	95	229.76	21,827.20
ARROW ELECTRONICS INC	201	68.22	13,712.22
AVNET INC	282	41.03	11,570.46
CDW CORPORATION	179	80.70	14,445.30
CISCO SYSTEMS INC	6,110	45.34	277,027.40
COMMSCOPE HOLDING COMPANY INC	400	25.59	10,236.00
CORNING INC	698	30.78	21,484.44
F5 NETWORKS INC	71	165.73	11,766.83
FLEX LTD	1,195	11.87	14,184.65
FLIR SYSTEMS INC	301	55.86	16,813.86
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE COMPANY	1,917	15.44	29,598.48
HP INC	2,014	23.84	48,013.76
JUNIPER NETWORKS INC	757	28.41	21,506.37
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	221	61.78	13,653.38

MOTOROLA SOLUTIONS INC	164	123.36	20,231.04
NETAPP INC	366	77.57	28,390.62
PALO ALTO NETWORKS INC	111	193.51	21,479.61
SEAGATE TECHNOLOGY	349	43.81	15,289.69
TE CONNECTIVITY LIMITED	397	77.55	30,787.35
TRIMBLE INC	102	38.08	3,884.16
WESTERN DIGITAL CORPORATION	462	56.54	26,121.48
XEROX CORPORATION	476	26.87	12,790.12
AT&T INC	9,190	32.87	302,075.30
CENTURYLINK INC	1,073	21.99	23,595.27
SPRINT CORPORATION	1,762	6.46	11,382.52
T-MOBILE US INC	335	69.75	23,366.25
VERIZON COMMUNICATIONS INC	5,285	54.90	290,146.50
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	350	31.96	11,186.00
AES CORP	1,458	14.98	21,840.84
ALLIANT ENERGY CORP	503	44.05	22,157.15
AMEREN CORPORATION	134	66.05	8,850.70
AMERICAN ELECTRIC POWER COMPANY INC	636	73.26	46,593.36
AMERICAN WATER WORKS CO INC	145	91.94	13,331.30
ATMOS ENERGY CORPORATION	230	97.07	22,326.10
CENTERPOINT ENERGY INC	840	28.12	23,620.80
CMS ENERGY CORPORATION	170	50.68	8,615.60
CONSOLIDATED EDISON INC	485	77.38	37,529.30
DOMINION ENERGY INC	731	73.50	53,728.50
DTE ENERGY COMPANY	156	112.94	17,618.64
DUKE ENERGY CORPORATION	866	82.75	71,661.50
EDISON INTERNATIONAL	517	70.31	36,350.27
ENTERGY CORP	94	84.12	7,907.28
EVERGY INC	314	57.02	17,904.28
EVERSOURCE ENERGY	285	63.33	18,049.05
EXELON CORP	1,272	44.13	56,133.36
FIRSTENERGY CORP	421	38.85	16,355.85
NEXTERA ENERGY INC	686	173.46	118,993.56
NISOURCE INC	714	25.40	18,135.60
OGE ENERGY CORPORATION	442	37.77	16,694.34
P G & E CORPORATION	617	48.85	30,140.45
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	246	85.15	20,946.90
PPL CORPORATION	1,084	31.22	33,842.48
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	803	54.88	44,068.64
SCANA CORPORATION	300	40.89	12,267.00
SEMPRA ENERGY	313	116.61	36,498.93
SOUTHERN CO	1,343	45.07	60,529.01

	UGI CORPORATION	383	55.97	21,436.51	
	WEC ENERGY GROUP INC	317	70.57	22,370.69	
	XCEL ENERGY INC	806	49.13	39,598.78	
	ADVANCED MICRO DEVICES INC	1,167	23.66	27,611.22	
	ANALOG DEVICES INC	392	82.33	32,275.32	
	APPLIED MATERIALS INC	1,519	34.29	52,086.51	
	BROADCOM INC	575	228.28	131,261.00	
	INTEL CORP	5,933	44.00	261,052.00	
	KLA-TENCOR CORPORATION	135	90.81	12,259.35	
	LAM RESEARCH CORP	210	145.20	30,492.00	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	834	17.76	14,811.84	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC	463	51.14	23,677.82	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	189	67.03	12,668.67	
	MICRON TECHNOLOGY INC	1,663	40.45	67,268.35	
	NVIDIA CORP	746	229.17	170,960.82	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	441	77.70	34,265.70	
	QORVO INC	260	72.35	18,811.00	
	QUALCOMM INC	1,827	65.36	119,412.72	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	188	85.16	16,010.08	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	1,205	98.26	118,403.30	
	XILINX INC	222	74.10	16,450.20	
	米ドル 建小計	395,236		30,770,116.58 (3,461,330,414)	
カナダドル	ARC RESOURCES LIMITED	819	13.22	10,827.18	
	CAMECO CORP (CA)	772	15.09	11,649.48	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,245	37.17	46,276.65	
	CENOVUS ENERGY INC	2,196	11.15	24,485.40	
	CRESCENT POINT ENERGY CORPORATION	1,193	6.92	8,255.56	
	ENBRIDGE INC	2,083	42.88	89,319.04	
	ENCANA CORP	501	14.71	7,369.71	
	HUSKY ENERGY INC	825	20.08	16,566.00	
	IMPERIAL OIL LTD	597	43.81	26,154.57	
	INTER PIPELINE LIMITED	188	22.49	4,228.12	
	KEYERA CORP	410	34.91	14,313.10	
	PEMBINA PIPELINE CORPORATION	767	44.83	34,384.61	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	351	22.03	7,732.53	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	500	14.44	7,220.00	
	SUNCOR ENERGY INC	2,271	46.85	106,396.35	
	TOURMALINE OIL CORPORATION	500	19.94	9,970.00	
	TRANSCANADA CORPORATION	1,006	53.43	53,750.58	
	VERMILION ENERGY INC	154	37.99	5,850.46	
	AGNICO EAGLE MINES LIMITED	431	48.53	20,916.43	

BARRICK GOLD CORP	763	17.29	13,192.27
CCL INDUSTRIES INC - CL B	300	55.83	16,749.00
FRANCO-NEVADA CORPORATION	321	85.00	27,285.00
GOLDCORP INC	22	14.27	313.94
KINROSS GOLD CORP	2,930	3.83	11,221.90
METHANEX CORPORATION	50	95.75	4,787.50
NUTRIEN LTD	817	73.22	59,820.74
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	767	30.61	23,477.87
TURQUOISE HILL RESOURCES LIMITED	2,200	2.36	5,192.00
WEST FRASER TIMBER CO LIMITED	100	66.85	6,685.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	909	22.81	20,734.29
CAE INC	604	24.02	14,508.08
FINNING INTERNATIONAL INC	337	29.76	10,029.12
SNC-LAVALIN GROUP INC	341	46.91	15,996.31
CANADIAN NATL RAILWAY CO	928	111.10	103,100.80
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	154	261.11	40,210.94
LINAMAR CORPORATION	100	53.03	5,303.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	345	62.31	21,496.95
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	400	75.32	30,128.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	891	25.20	22,453.20
CANADIAN TIRE CORP -CL A	126	150.43	18,954.18
DOLLARAMA INC	600	39.96	23,976.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	442	61.31	27,099.02
EMPIRE COMPANY LIMITED A	450	23.40	10,530.00
GEORGE WESTON LIMITED	100	92.02	9,202.00
LOBLAW COMPANIES LTD	121	65.91	7,975.11
METRO INC	513	41.28	21,176.64
SAPUTO INC	400	39.54	15,816.00
BANK OF MONTREAL	748	103.69	77,560.12
BANK OF NOVA SCOTIA	1,574	71.17	112,021.58
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	550	115.74	63,657.00
NATIONAL BANK OF CANADA	619	61.02	37,771.38
ROYAL BANK OF CANADA	1,893	99.00	187,407.00
TORONTO-DOMINION BANK(CA)	2,327	74.04	172,291.08
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	932	54.94	51,204.08
CI FINANCIAL CORPORATION	483	18.97	9,162.51
IGM FINANCIAL INC	193	32.16	6,206.88
ONEX CORPORATION	100	83.81	8,381.00
THOMSON REUTERS CORP(CA)	4	61.06	244.24
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	32	648.70	20,758.40
GREAT-WEST LIFECO INC	600	29.91	17,946.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL	242	47.40	11,470.80

	INTACT FINANCIAL CORPORATION	200	100.72	20,144.00
	MANULIFE FINANCIAL CORP	2,098	20.86	43,764.28
	POWER CORP OF CANADA	729	27.38	19,960.02
	POWER FINANCIAL CORP	473	28.55	13,504.15
	SUN LIFE FINANCIAL INC	538	49.34	26,544.92
	FIRST CAPITAL REALTY INC	300	19.35	5,805.00
	BLACKBERRY LIMITED	1,100	12.22	13,442.00
	CGI GROUP INC -CL A	377	78.77	29,696.29
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	22	886.24	19,497.28
	OPEN TEXT CORPORATION	478	44.59	21,314.02
	SHOPIFY INC - CLASS A	100	166.07	16,607.00
	BCE INC	336	53.45	17,959.20
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	341	66.82	22,785.62
	TELUS CORPORATION	44	45.69	2,010.36
	ALTAGAS LIMITED	279	21.24	5,925.96
	ATCO LIMITED	194	36.85	7,148.90
	CANADIAN UTILITIES LTD A	328	30.35	9,954.80
	EMERA INC	100	39.23	3,923.00
	FORTIS INC	180	42.61	7,669.80
	HYDRO ONE LIMITED	600	19.44	11,664.00
	カナダドル 建小計	51,954		2,188,483.30 (187,771,867)
ユーロ	ENAGAS SA	61	23.17	1,413.37
	ENI SPA	2,829	15.39	43,538.31
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,109	15.64	17,344.76
	KONINKLIJKE VOPAK NV	161	41.36	6,658.96
	NESTE OYJ	153	70.48	10,783.44
	OMV AG	89	48.97	4,358.33
	REPSOL SA	1,726	16.01	27,641.89
	SNAM SPA	4,670	3.65	17,050.17
	TENARIS SA	1,045	14.00	14,635.22
	TOTAL SA	2,951	52.83	155,901.33
	AIR LIQUIDE SA	496	105.70	52,427.20
	AKZO NOBEL	400	74.22	29,688.00
	ARCELORMITTAL	525	23.75	12,471.37
	ARKEMA	150	93.16	13,974.00
	BASF SE	1,205	67.65	81,518.25
	COVESTRO AG	195	57.56	11,224.20
	CRH PLC(IE)	953	24.43	23,281.79
	EVONIK INDUSTRIES AG	361	27.07	9,772.27
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	159	45.26	7,196.34
	IMERYS SA	82	55.50	4,551.00

K+S AG	439	16.88	7,412.51
KONINKLIJKE DSM NV	144	78.64	11,324.16
LANXESS AG	202	56.14	11,340.28
LINDE AG - TENDER	222	211.30	46,908.60
STORA ENSO OYJ-R SHS(FI)	1,219	13.90	16,950.19
SYMRISE AG	145	70.54	10,228.30
THYSSENKRUPP AG	814	19.34	15,742.76
UMICORE	408	41.02	16,736.16
UPM-KYMMENE OYJ	572	30.08	17,205.76
VOESTALPINE AG	261	35.30	9,213.30
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS	506	32.45	16,419.70
AIRBUS SE	819	97.95	80,221.05
ALSTOM	339	38.11	12,919.29
ANDRITZ AG	167	45.76	7,641.92
BRENTAG AG	28	47.00	1,316.00
CNH INDUSTRIAL NV	988	9.14	9,036.24
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	519	32.11	16,667.68
DASSAULT AVIATION SA	5	1,455.00	7,275.00
EIFFAGE SA	151	88.80	13,408.80
FERROVIAL SA	413	18.19	7,512.47
GEA GROUP AG	405	25.91	10,493.55
HOCHTIEF AG	43	130.70	5,620.10
KION GROUP AG	126	44.59	5,618.34
KONE OYJ-B	354	40.95	14,496.30
LEGRAND SA	422	56.48	23,834.56
LEONARDO SPA	895	9.93	8,889.14
MAN SE	81	90.95	7,366.95
METSO OYJ	259	27.74	7,184.66
MTU AERO ENGINES AG	56	175.30	9,816.80
OSRAM LICHT AG	172	32.44	5,579.68
PRYSMIAN SPA	432	17.18	7,423.92
REXEL SA	670	11.05	7,406.85
SAFRAN SA	368	107.50	39,560.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	686	60.04	41,187.44
SIEMENS AG-REG	925	100.10	92,592.50
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	489	9.73	4,758.94
THALES SA	120	116.25	13,950.00
VINCI SA	521	77.64	40,450.44
WARTSILA OYJ-B SHARES	111	14.12	1,567.87
BUREAU VERITAS SA	569	19.45	11,069.89
EDENRED	483	31.79	15,354.57
RANDSTAD NV	263	42.84	11,266.92

SOCIETE BIC SA	66	74.80	4,936.80
TELEPERFORMANCE	57	159.70	9,102.90
WOLTERS KLUWER NV-CVA	308	52.40	16,139.20
AENA SME SA	37	141.60	5,239.20
AEROPORTS DE PARIS(ADP)	68	185.00	12,580.00
ATLANTIA SPA	913	17.75	16,205.75
BOLLORE	2,000	3.73	7,464.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	538	17.95	9,657.10
DEUTSCHE POST AG-REG	1,171	28.89	33,830.19
FRAPORT AG	95	66.16	6,285.20
GETLINK	1,034	10.76	11,125.84
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	1,306	6.31	8,243.47
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	395	74.64	29,482.80
BMW-PFD	126	65.00	8,190.00
CONTINENTAL AG	181	131.50	23,801.50
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	1,312	51.39	67,423.68
FERRARI NV	116	101.60	11,785.60
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	1,300	13.44	17,474.60
MICHELIN (CGDE)-B	272	87.74	23,865.28
NOKIAN RENKAAT OYJ	265	31.59	8,371.35
PEUGEOT SA	1,075	20.16	21,672.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING-PFD	92	55.00	5,060.00
RENAULT SA	94	66.77	6,276.38
SCHAEFFLER AG	367	9.30	3,415.30
VOLKSWAGEN AG-PFD	218	143.98	31,387.64
ADIDAS AG	240	202.80	48,672.00
HERMES INTERNATIONAL	43	490.80	21,104.40
HUGO BOSS AG-ORD	153	60.00	9,180.00
KERING	96	360.20	34,579.20
LUXOTTICA GROUP SPA	62	53.88	3,340.56
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	344	263.25	90,558.00
PUMA SE	8	424.00	3,392.00
SEB SA	50	137.20	6,860.00
ACCOR SA	378	40.90	15,460.20
PADDY POWER BETFAIR PLC	176	76.40	13,446.40
SODEXO	22	86.78	1,909.16
AXEL SPRINGER SE	99	57.95	5,737.05
EUTELSAT COMMUNICATIONS	400	22.17	8,868.00
JC DECAUX SA	170	29.38	4,994.60
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	515	20.52	10,567.80
PUBLICIS GROUPE	98	54.20	5,311.60
RTL GROUP SA	89	60.25	5,362.25

SES	806	20.40	16,442.40
TELENET GROUP HOLDING NV	121	46.86	5,670.06
VIVENDI	1,635	21.87	35,757.45
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	1,305	24.35	31,776.75
ZALANDO SE	198	34.33	6,797.34
CARREFOUR SA	462	17.12	7,909.44
CASINO GUICHARD PERRACHON SA	127	41.46	5,265.42
COLRUYT SA	154	50.14	7,721.56
JERONIMO MARTINS SGPS SA	577	11.45	6,606.65
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	1,520	20.05	30,483.60
METRO AG	394	13.39	5,277.63
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,046	73.18	76,546.28
DANONE	613	63.80	39,109.40
HEINEKEN HOLDING NV	223	77.20	17,215.60
HEINEKEN NV	338	79.80	26,972.40
KERRY GROUP PLC-A	153	88.85	13,594.05
PERNOD-RICARD SA	295	132.20	38,999.00
REMY COINTREAU SA	51	104.80	5,344.80
BEIERSDORF AG	52	93.52	4,863.04
HENKEL AG & CO KGAA	21	86.00	1,806.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	283	96.34	27,264.22
L'OREAL	359	191.30	68,676.70
UNILEVER NV-CVA	1,880	47.33	88,980.40
ESSILORLUXOTTICA	329	117.20	38,558.80
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	351	70.10	24,605.10
FRESENIUS SE & CO KGAA	483	59.84	28,902.72
KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,063	34.74	36,933.93
BAYER AG	1,205	77.59	93,495.95
EUROFINS SCIENTIFIC SE	24	412.00	9,888.00
GRIFOLS SA	289	23.17	6,696.13
IPSEN SA	77	126.20	9,717.40
MERCK KGAA	64	93.72	5,998.08
ORION OYJ-CLASS B	221	31.09	6,870.89
QIAGEN NV	485	31.47	15,262.95
RECORDATI SPA	215	30.16	6,484.40
SANOFI	1,354	77.80	105,341.20
UCB SA	106	72.90	7,727.40
ABN AMRO GROUP NV-CVA	624	22.22	13,865.28
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	9,049	5.20	47,109.09
BANCO DE SABADELL SA	4,349	1.17	5,114.42
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,632	0.00	0.00
BANCO SANTANDER SA	22,003	4.12	90,762.37



BANK OF IRELAND GROUP PLC	2,028	6.19	12,553.32
BANKIA SA	2,068	2.97	6,152.30
BANKINTER SA	1,491	7.40	11,045.32
BNP PARIBAS	1,556	48.72	75,816.10
CAIXABANK	3,872	3.66	14,190.88
COMMERZBANK AG	1,326	8.66	11,483.16
CREDIT AGRICOLE SA	1,242	11.89	14,769.86
ERSTE GROUP BANK AG	264	36.24	9,567.36
ING GROEP NV-CVA	5,265	10.55	55,566.81
INTESA SANPAOLO	20,074	1.98	39,830.83
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION LI(IE)	9,000	0.00	0.00
KBC GROEP NV	446	63.20	28,187.20
MEDIOBANCA SPA	1,301	7.87	10,249.27
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	269	23.95	6,442.55
SOCIETE GENERALE	854	34.45	29,420.30
UNICREDIT SPA	2,711	11.53	31,257.83
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	2,921	9.49	27,740.73
DEUTSCHE BOERSE AG	237	113.55	26,911.35
EURAZEO	99	63.45	6,281.55
EXOR NV	240	49.24	11,817.60
NATIXIS SA	2,082	5.19	10,818.07
WENDEL	62	112.10	6,950.20
AEGON NV	1,284	5.35	6,871.96
AGEAS	36	44.74	1,610.64
ALLIANZ SE-REG	544	185.20	100,748.80
ASSICURAZIONI GENERALI	1,691	14.05	23,758.55
AXA	2,698	22.37	60,354.26
CNP ASSURANCES	394	19.40	7,643.60
HANNOVER RUECK SE	133	121.10	16,106.30
MAPFRE SA	2,472	2.53	6,271.46
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	191	189.65	36,223.15
NN GROUP NV	619	38.59	23,887.21
POSTE ITALIANE SPA	1,156	6.27	7,248.12
SAMPO OYJ-A SHS	710	40.05	28,435.50
SCOR SE	361	41.21	14,876.81
DEUTSCHE WOHNEN SE	227	41.36	9,388.72
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	158	161.30	25,485.40
VONOVIA SE	748	41.13	30,765.24
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	624	72.88	45,477.12
ATOS SE	97	92.58	8,980.26
CAPGEMINI SA	199	103.90	20,676.10
DASSAULT SYSTEMES SA	155	115.70	17,933.50

	SAP SE	1,244	95.30	118,553.20
	WIRECARD AG	189	174.00	32,886.00
	INGENICO GROUP	122	66.76	8,144.72
	NOKIA OYJ	7,327	4.86	35,638.52
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	3,922	14.65	57,476.91
	ELISA OYJ	315	35.47	11,173.05
	ILIAD SA	58	108.00	6,264.00
	KONINKLIJKE KPN NV	7,012	2.40	16,863.86
	ORANGE	2,214	14.05	31,106.70
	PROXIMUS	337	22.96	7,737.52
	TELECOM ITALIA-RSP	13,336	0.42	5,723.81
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,645	3.78	6,224.68
	TELEFONICA SA	4,868	6.97	33,939.69
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	272	36.64	9,966.08
	E.ON SE	2,660	8.60	22,876.00
	ELECTRICITE DE FRANCE	1,126	15.39	17,329.14
	ENDESA SA	703	18.35	12,900.05
	ENEL SPA	10,417	4.43	46,147.31
	ENGIE	2,148	11.73	25,206.78
	FORTUM OYJ	983	19.64	19,306.12
	IBERDROLA SA	6,721	6.27	42,194.43
	INNOGY SE	307	38.74	11,893.18
	NATURGY ENERGY GROUP SA	775	22.48	17,422.00
	RWE AG	1,083	17.99	19,488.58
	SUEZ	726	12.58	9,136.71
	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	2,888	4.56	13,192.38
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	203	16.85	3,421.56
	ASML HOLDING NV	552	153.82	84,908.64
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,869	17.59	32,885.05
	STMICROELECTRONICS NV	890	13.94	12,406.60
	ユーロ 建小計	265,833		4,789,381.65 (619,458,622)
英債券	BP PLC	24,211	5.57	134,976.32
	JOHN WOOD GROUP PLC	1,202	7.30	8,781.81
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	5,887	25.21	148,411.27
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	4,534	25.69	116,478.46
	ANGLO AMERICAN PLC	1,185	16.37	19,407.93
	ANTOFAGASTA PLC	904	7.68	6,942.72
	BHP BILLITON PLC(UK)	2,607	15.39	40,121.73
	CRODA INTERNATIONAL PLC	290	47.22	13,693.80
	FRESNILLO PLC	507	8.87	4,500.13
	GLENCORE PLC	17,077	3.08	52,656.92

JOHNSON MATTHEY PLC	428	29.14	12,471.92
MONDI PLC	812	18.11	14,705.32
RANDGOLD RESOURCES LIMITED	208	62.68	13,037.44
RIO TINTO PLC(UK)	1,568	36.77	57,655.36
ASHTREAD GROUP PLC	487	19.00	9,253.00
BAE SYSTEMS PLC	5,054	5.39	27,281.49
FERGUSON PLC	267	53.26	14,220.42
MEGGITT PLC	1,716	5.16	8,864.85
MELROSE INDUSTRIES PLC	7,500	1.64	12,330.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,766	8.72	15,399.52
SMITHS GROUP PLC	875	12.95	11,331.25
THE WEIR GROUP PLC	482	15.44	7,442.08
TRAVIS PERKINS PLC	553	9.70	5,364.10
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	580	6.19	3,593.68
EXPERIAN PLC	1,023	17.90	18,316.81
G4S PLC	3,433	2.16	7,418.71
INTERTEK GROUP PLC	357	45.10	16,100.70
RELX PLC	2,902	15.16	43,994.32
EASYJET PLC	372	10.68	3,972.96
ROYAL MAIL PLC	1,991	3.44	6,857.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,227	4.91	10,947.93
BERKELEY GROUP HOLDINGS PLC	303	32.59	9,874.77
BURBERRY GROUP PLC	184	16.71	3,075.56
PERSIMMON PLC	154	21.62	3,329.48
TAYLOR WIMPEY PLC	7,223	1.51	10,935.62
CARNIVAL PLC(UK)	110	43.25	4,757.50
COMPASS GROUP PLC	1,807	14.93	26,987.54
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	1,573	3.25	5,123.26
TUI AG	904	13.10	11,846.92
WHITBREAD PLC	30	45.35	1,360.50
AUTO TRADER GROUP PLC	2,260	3.88	8,780.10
INFORMA PLC	1,146	7.31	8,386.42
ITV PLC	8,015	1.53	12,295.01
PEARSON PLC	786	8.74	6,875.92
WPP PLC	1,621	10.33	16,753.03
KINGFISHER PLC	1,322	2.41	3,196.59
MARKS & SPENCER GROUP PLC	3,595	2.84	10,231.37
NEXT PLC	309	50.92	15,734.28
SAINSBURY (J) PLC	3,629	3.04	11,035.78
TESCO PLC	10,467	2.14	22,462.18
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	4,908	2.50	12,277.36
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	382	23.00	8,786.00

	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC(UK)	3,072	32.99	101,360.64
	COCA-COLA HBC AG-CDI	402	23.79	9,563.58
	DIAGEO PLC	2,898	27.01	78,274.98
	IMPERIAL BRANDS PLC	1,166	25.89	30,187.74
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	902	67.14	60,560.28
	UNILEVER PLC	1,689	41.10	69,426.34
	CONVATEC GROUP PLC	2,403	1.55	3,736.66
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	845	3.64	3,078.33
	SMITH & NEPHEW PLC	250	12.69	3,172.50
	ASTRAZENECA PLC	1,557	59.34	92,392.38
	GLAXOSMITHKLINE PLC	5,984	15.57	93,206.78
	SHIRE PLC	1,183	45.08	53,329.64
	BARCLAYS PLC	21,204	1.63	34,651.57
	HSBC HOLDINGS PLC(UK)	27,039	6.20	167,749.95
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	89,360	0.56	50,157.76
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	7,280	2.35	17,137.12
	STANDARD CHARTERED PLC(UK)	4,421	5.46	24,143.08
	3I GROUP PLC	608	8.44	5,133.95
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	598	17.99	10,761.01
	INVESTEC PLC	1,506	4.80	7,230.30
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	330	43.91	14,490.30
	SCHRODERS PLC	255	27.96	7,129.80
	ST JAMES'S PLACE PLC	1,167	10.35	12,084.28
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	360	2.58	930.60
	ADMIRAL GROUP PLC	409	20.03	8,192.27
	AVIVA PLC	3,583	4.18	14,994.85
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	3,042	3.23	9,831.74
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,842	2.39	9,216.95
	PRUDENTIAL PLC	3,144	14.99	47,144.28
	RSA INSURANCE GROUP PLC	2,255	5.48	12,357.40
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC(UK)	468	13.42	6,280.56
	BT GROUP PLC	9,979	2.46	24,598.23
	VODAFONE GROUP PLC	35,477	1.52	54,088.23
	CENTRICA PLC	5,102	1.49	7,612.18
	NATIONAL GRID PLC	4,162	8.27	34,453.03
	SEVERN TRENT PLC	521	18.84	9,818.24
	SSE PLC	1,359	11.50	15,628.50
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,509	7.18	10,837.63
	英ボンド 建小計	395,064		2,295,578.80 (337,082,790)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	18	532.50	9,585.00
	GIVAUDAN-REG	8	2,304.00	18,432.00

	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	810	43.17	34,967.70
	SIKA AG-BR	240	121.20	29,088.00
	ABB LIMITED-REG	2,332	20.99	48,948.68
	GEBERIT AG-REG	48	428.10	20,548.80
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	46	218.80	10,064.80
	SGS SA-REG	8	2,278.00	18,224.00
	KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL AG-REG	8	134.40	1,075.20
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	630	70.40	44,352.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	114	63.80	7,273.20
	THE SWATCH GROUP AG-B	63	327.80	20,651.40
	DUFREY AG	75	106.20	7,965.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	5	1,936.00	9,680.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT&SPRUENGLI AG-PC	2	6,770.00	13,540.00
	NESTLE SA-REGISTERED	3,923	82.04	321,842.92
	SONOVA HOLDING AG-REG	116	158.90	18,432.40
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	20	684.00	13,680.00
	LONZA GROUP AG-REG	118	325.40	38,397.20
	NOVARTIS AG-REG SHS	2,759	87.04	240,143.36
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	930	244.95	227,803.50
	VIFOR PHARMA AG	100	144.20	14,420.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	3,237	13.15	42,566.55
	PARGESA HOLDING SA-BR	80	71.10	5,688.00
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	16	707.50	11,320.00
	UBS GROUP AG	4,250	13.86	58,905.00
	BALOISE HOLDING AG-REG	111	145.40	16,139.40
	SWISS RE AG	357	90.96	32,472.72
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	174	307.40	53,487.60
	SWISS PRIME SITE AG-REG	158	80.30	12,687.40
	TEMENOS AG	66	138.40	9,134.40
	SWISSCOM AG-REG	6	450.40	2,702.40
	スイスフラン 建小計	20,828		1,414,218.63 (159,566,288)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	414	279.10	115,547.40
	BOLIDEN AB	605	235.65	142,568.25
	ALFA LAVAL AB	650	223.70	145,405.00
	ASSA ABLOY AB-B	1,113	175.05	194,830.65
	ATLAS COPCO AB-A	1,106	213.00	235,578.00
	ATLAS COPCO AB-B	60	198.58	11,914.80
	EPIROC AB-A	1,106	89.80	99,318.80
	EPIROC AB-B	60	82.71	4,962.60
	SANDVIK AB	1,099	136.30	149,793.70
	SKANSKA AB-B SHS	752	144.25	108,476.00

	SKF AB-B SHARES	774	147.75	114,358.50
	VOLVO AB-B SHS	1,351	133.85	180,831.35
	SECURITAS AB-B SHS	693	145.60	100,900.80
	ELECTROLUX AB-SER B	532	178.85	95,148.20
	HUSQVARNA AB-B SHS	955	64.28	61,387.40
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	1,507	163.50	246,394.50
	ICA GRUPPEN AB	185	279.60	51,726.00
	SWEDISH MATCH AB	152	442.40	67,244.80
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	662	217.40	143,918.80
	NORDEA BANK ABP	3,492	84.19	293,991.48
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	2,181	91.96	200,564.76
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,604	104.00	166,816.00
	SWEDBANK AB-A SHARES	1,020	194.35	198,237.00
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	377	184.70	69,631.90
	INVESTOR AB-B SHS	377	388.00	146,276.00
	KINNEVIK AB-B	518	253.00	131,054.00
	L E LUNDBERGFÖRETAGEN AB-B SHS	168	271.80	45,662.40
	ERICSSON LM-B SHS	3,262	84.94	277,074.28
	HEXAGON AB-B SHS	174	458.90	79,848.60
	MILLICOM INTL CELLULAR -SDR	152	536.00	81,472.00
	TELE2 AB-B SHS	828	111.65	92,446.20
	TELIA CO AB	5,333	40.30	214,919.90
	スウェーデンクローナ 建小計	33,262		4,268,300.07 (53,353,750)
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	1,882	223.10	419,874.20
	YARA INTERNATIONAL ASA	393	375.00	147,375.00
	SCHIBSTED ASA-B SHS	197	271.50	53,485.50
	MARINE HARVEST	846	202.90	171,653.40
	ORKLA ASA	375	66.30	24,862.50
	DNB ASA	1,551	163.40	253,433.40
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	459	127.50	58,522.50
	TELENOR ASA	635	152.75	96,996.25
	ノルウェークローネ 建小計	6,338		1,226,202.75 (16,774,453)
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	100	693.60	69,360.00
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	216	414.30	89,488.80
	ISS A/S	3	219.30	657.90
	A P MOLLER - MAERSK A/S-B	13	8,250.00	107,250.00
	DSV A/S	194	540.40	104,837.60
	PANDORA A/S	246	422.00	103,812.00
	CARLSBERG AS-B	78	748.20	58,359.60
	COLOPLAST A/S	110	643.20	70,752.00

	WILLIAM DEMANT HOLDING A/S	275	213.00	58,575.00
	GENMAB A/S	118	922.40	108,843.20
	H LUNDBECK A/S	142	408.70	58,035.40
	NOVO NORDISK A/S-B	2,311	282.15	652,048.65
	DANSKE BANK A/S	1,190	131.20	156,128.00
	TRYG A/S	259	157.10	40,688.90
	ORSTED A/S	337	419.90	141,506.30
	デンマーククローネ 建小計	5,592		1,820,343.35 (31,564,753)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	577	30.17	17,408.09
	OIL SEARCH LIMITED	3,032	8.56	25,953.92
	ORIGIN ENERGY LIMITED	1,276	7.90	10,080.40
	SANTOS LTD	4,195	7.10	29,784.50
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	1,349	36.17	48,793.33
	ALUMINA LIMITED	5,614	2.65	14,877.10
	BHP BILLITON LIMITED(AU)	4,312	33.10	142,727.20
	BLUESCOPE STEEL LTD	1,175	15.72	18,471.00
	BORAL LIMITED	2,577	6.09	15,693.93
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	3,444	3.88	13,362.72
	INCITEC PIVOT LIMITED	3,870	3.86	14,938.20
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	975	19.22	18,739.50
	NEWCREST MINING LIMITED	458	20.67	9,466.86
	ORICA LTD	829	16.86	13,976.94
	RIO TINTO LIMITED(AU)	201	77.45	15,567.45
	SOUTH32 LIMITED	5,656	3.76	21,266.56
	CIMIC GROUP LIMITED	223	46.70	10,414.10
	BRAMBLES LTD	267	10.59	2,827.53
	SEEK LIMITED	758	19.13	14,500.54
	AURIZON HOLDINGS LIMITED	4,539	4.16	18,882.24
	SYDNEY AIRPORT CO LIMITED	2,439	6.62	16,146.18
	TRANSURBAN GROUP	1,966	11.05	21,724.30
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	415	29.50	12,242.50
	CROWN RESORTS LIMITED	835	13.10	10,938.50
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	138	54.85	7,569.30
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LIMITED	123	51.19	6,296.37
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	20	4.81	96.20
REA GROUP LIMITED	121	71.79	8,686.59	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	1,276	3.43	4,376.68	
WESFARMERS LIMITED	1,618	47.30	76,531.40	
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,703	28.10	47,854.30	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	1,314	9.91	13,021.74	
TREASURY WINE ESTATES LIMITED	759	16.34	12,402.06	

	COCHLEAR LIMITED	127	183.54	23,309.58
	HEALTHSCOPE LTD	3,707	1.80	6,691.13
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	313	54.06	16,920.78
	SONIC HEALTHCARE LTD	874	23.59	20,617.66
	CSL LIMITED	603	188.06	113,400.18
	AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	3,183	26.04	82,885.32
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	888	10.65	9,457.20
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	1,084	10.34	11,208.56
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	2,054	67.92	139,507.68
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	3,457	25.67	88,741.19
	WESTPAC BANKING CORPORATION	4,390	26.85	117,871.50
	ASX LTD	428	59.42	25,431.76
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	1,311	11.57	15,168.27
	MACQUARIE GROUP LIMITED	375	116.87	43,826.25
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	1,802	7.20	12,974.40
	MEDIBANK PRIVATE LIMITED	6,093	2.82	17,182.26
	SUNCORP GROUP LIMITED	1,281	14.07	18,023.67
	LENDLEASE GROUP	1,225	17.81	21,817.25
	COMPUTERSHARE LIMITED	1,027	19.86	20,396.22
	TELSTRA CORPORATION	2,169	3.17	6,875.73
	TPG TELECOM LIMITED	751	7.64	5,737.64
	AGL ENERGY LIMITED	269	19.18	5,159.42
	APA GROUP	2,465	9.80	24,157.00
	AUSNET SERVICES	4,089	1.68	6,869.52
	オーストラリアドル 建小計	102,019		1,569,848.40 (125,273,902)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LIMITED	1,535	6.10	9,363.50
	AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LIMITED	2,108	6.91	14,566.28
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	860	12.00	10,320.00
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	4,053	3.90	15,806.70
	MERIDIAN ENERGY LTD	2,939	3.11	9,140.29
	ニュージーランドドル 建小計	11,495		59,196.77 (4,384,112)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED	2,534	80.40	203,733.60
	NWS HOLDINGS LIMITED	2,500	15.64	39,100.00
	MTR CORPORATION	2,903	38.90	112,926.70
	LI & FUNG LIMITED	14,000	1.63	22,820.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LIMITED	2,773	42.70	118,407.10
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS LIMITED	1,338	21.20	28,365.60
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	2,537	45.60	115,687.20
	MGM CHINA HOLDINGS LIMITED	2,155	12.48	26,894.40
	SANDS CHINA LIMITED	2,974	33.80	100,521.20



	SHANGRI-LA ASIA LIMITED	1,813	10.98	19,906.74
	SJM HOLDINGS LIMITED	4,000	6.87	27,480.00
	WYNN MACAU LIMITED	3,499	16.92	59,203.08
	WH GROUP LTD	18,000	5.90	106,200.00
	BANK OF EAST ASIA	2,667	25.85	68,941.95
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,684	33.50	123,414.00
	HANG SENG BANK LTD	600	201.00	120,600.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	1,066	209.00	222,794.00
	AIA GROUP LIMITED	14,751	62.30	918,987.30
	CK ASSET HOLDINGS LTD	2,534	54.60	138,356.40
	HANG LUNG GROUP LTD	2,000	19.58	39,160.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	3,864	14.32	55,332.48
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,897	37.70	71,516.90
	HYSAN DEVELOPMENT COMPANY LIMITED	1,000	37.80	37,800.00
	KERRY PROPERTIES LIMITED	1,452	25.00	36,300.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	11,562	10.00	115,620.00
	SINO LAND CO	6,576	12.60	82,857.60
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	2,000	103.40	206,800.00
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	1,000	83.40	83,400.00
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	2,632	27.00	71,064.00
	WHARF HOLDINGS LTD	2,000	19.26	38,520.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	2,000	47.05	94,100.00
	WHELOCK AND COMPANY LTD	2,000	41.80	83,600.00
	HKT TRUST AND HKT LIMITED	8,080	10.98	88,718.40
	PCCW LIMITED	8,884	4.54	40,333.36
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	1,000	59.50	59,500.00
	CLP HOLDINGS LTD	1,235	88.60	109,421.00
	HK ELECTRIC INVESTMENTS AND HK ELECTRIC	6,000	7.59	45,540.00
	HONG KONG & CHINA GAS COMPANY LIMITED	8,268	15.02	124,185.36
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	2,567	53.00	136,051.00
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY LIMITED	500	78.20	39,100.00
	香港ドル 建小計	162,845		4,233,259.37 (60,747,271)
シンガポールドル	SEBACORP INDUSTRIES LTD	2,300	2.93	6,739.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	3,600	3.42	12,312.00
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	4,369	1.18	5,155.42
	COMFORTDELGRO CORPORATION LIMITED	4,900	2.21	10,829.00
	SATS LTD	1,500	4.85	7,275.00
	SINGAPORE AIRLINES LTD	1,200	9.31	11,172.00
	GENTING SINGAPORE LTD	13,400	0.93	12,529.00
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	3,500	2.62	9,170.00
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LIMITED	200	29.50	5,900.00

	GOLDEN AGRI-RESOURCES LIMITED	16,200	0.24	3,888.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	3,300	3.01	9,933.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LIMITED	1,900	24.26	46,094.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	3,300	10.71	35,343.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,500	25.33	37,995.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LIMITED	1,800	6.93	12,474.00	
	CAPITALAND LTD	5,700	3.11	17,727.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	900	8.28	7,452.00	
	UOL GROUP LIMITED	1,100	6.18	6,798.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	7,200	3.17	22,824.00	
	シンガポールドル 建小計	77,869		281,609.42 (22,987,776)	
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	1,130	22.66	25,605.80	
	ELBIT SYSTEMS LIMITED	52	447.50	23,270.00	
	BANK HAPOLIM BM	2,357	25.74	60,669.18	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	3,201	23.32	74,647.32	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LIMITED	319	63.39	20,221.41	
	AZRIELI GROUP	94	181.60	17,070.40	
	NICE LIMITED	26	393.00	10,218.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORPORATION LTD	4,757	4.12	19,622.62	
	イスラエルシュケル 建小計	11,936		251,324.73 (7,728,235)	
	合 計	1,540,271		5,088,024,233 (5,088,024,233)	

(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	投資証券	AGNC INVESTMENT CORP	732	13,044.24	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE	176	21,545.92	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	574	86,186.10	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	2,091	20,826.36	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	219	38,975.43	
		BOSTON PROPERTIES INC	244	28,535.80	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	194	18,045.88	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	485	51,861.05	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	205	23,078.90	
		DUKE REALTY CORP	86	2,384.78	
		EQUINIX INC	101	41,845.31	
		EQUITY RESIDENTIAL	583	37,819.21	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	62	15,229.68	

		EXTRA SPACE STORAGE INC	56	4,882.08	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT	12	1,474.80	
		HCP INC	200	5,280.00	
		HOST HOTELS & RESORTS	641	12,243.10	
		INVITATION HOMES INC	494	10,813.66	
		IRON MOUNTAIN INC	554	17,827.72	
		KIMCO REALTY CORPORATION	940	14,222.20	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	325	13,201.50	
		MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	54	5,368.14	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	325	14,872.00	
		PROLOGIS INC	644	40,951.96	
		PUBLIC STORAGE	185	36,992.60	
		REALTY INCOME CORP	135	7,897.50	
		REGENCY CENTERS CORPORATION	54	3,426.30	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	80	12,350.40	
		SIMON PROPERTY GROUP	399	69,733.23	
		SL GREEN REALTY CORPORATION	17	1,578.28	
		THE MACERICH COMPANY	270	13,915.80	
		UDR INC	68	2,678.52	
		VENTAS INC	563	31,494.22	
		VEREIT INC	2,155	15,559.10	
		VORNADO REALTY TRUST	162	11,067.84	
		WELLTOWER INC	581	37,457.07	
		WEYERHAEUSER COMPANY	1,194	34,076.76	
米ドル建小計			15,860	818,743.44	(92,100,449)
カナダドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST UTS	300	5,895.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	297	7,157.70	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	100	3,022.00	
カナダドル建小計			697	16,074.70	(1,379,209)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	76	6,653.80	
		GECINA SA	93	12,462.00	
		ICADE	85	6,315.50	
ユーロ建小計			254	25,431.30	(3,289,284)
英ポンド	投資証券	HAMMERSON PLC	1,755	7,850.11	
		SEGRO PLC	2,136	13,537.96	
英ポンド建小計			3,891	21,388.07	(3,140,624)
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS	2,141	21,838.20	
		GOODMAN GROUP	310	3,199.20	

		GPT GROUP	3,978	20,088.90
		MIRVAC GROUP	8,197	18,443.25
		VICINITY CENTRES	7,444	19,801.04
オーストラリアドル建小計			22,070	83,370.59 (6,652,973)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	2,607	190,702.05
香港ドル建小計			2,607	190,702.05 (2,736,574)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,500	14,080.00
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	4,769	8,154.99
		CAPITALAND MALL TRUST	5,700	12,426.00
		SUNTEC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,500	9,955.00
シンガポールドル建小計			21,469	44,615.99 (3,642,003)
合計				112,941,116 (112,941,116)

(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	組入株式 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 573銘柄	63.8%		66.6%
	投資証券 37銘柄		1.7%	1.8%
カナダドル	株式 81銘柄	3.5%		3.6%
	投資証券 3銘柄		0.0%	0.0%
ユーロ	株式 218銘柄	11.4%		11.9%
	投資証券 3銘柄		0.1%	0.1%
英ポンド	株式 90銘柄	6.2%		6.5%
	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 32銘柄	1.0%		1.0%
ノルウェークローネ	株式 8銘柄	0.3%		0.3%
デンマーククローネ	株式 15銘柄	0.6%		0.6%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	2.3%		2.4%
	投資証券 5銘柄		0.1%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	0.1%		0.1%
香港ドル	株式 40銘柄	1.1%		1.2%
	投資証券 1銘柄		0.1%	0.1%
シンガポールドル	株式 19銘柄	0.4%		0.4%

	投資証券	4銘柄		0.1%	0.1%
イスラエルシュケル	株式	8銘柄	0.1%		0.1%

(注1) 組入株式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30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	193,765,584	193,305,077
国債証券	10,053,096,900	10,073,012,300
地方債証券	961,230,400	959,839,900
特殊債券	951,479,000	947,390,000
社債券	516,900,000	514,950,000
未収利息	21,742,872	21,692,801
前払費用	155,338	360,535
流動資産合計	12,698,370,094	12,710,550,613
資産合計	12,698,370,094	12,710,550,613
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	20,293,000	11,237,200
未払利息	439	446
流動負債合計	20,293,439	11,237,646
負債合計	20,293,439	11,237,646
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	10,004,472,192	10,102,807,715
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	2,673,604,463	2,596,505,252
元本等合計	12,678,076,655	12,699,312,967
純資産合計	12,678,076,655	12,699,312,967
負債純資産合計	12,698,370,094	12,710,550,613

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22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30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
1. 計算日における受益権の総数 <span style="float: right;">10,004,472,192口</span>	1. 計算日における受益権の総数 <span style="float: right;">10,102,807,715口</span>
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 (1万口当たり純資産額)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)
1.2672円 (12,672円)	1.2570円 (12,570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10月21日 至 平成30年 4月20日	自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	<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、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。</p>	同左

区分	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日	自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22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 style="padding-left: 2em;">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 style="padding-left: 2em;">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 style="padding-left: 2em;">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>	同左

金融商品の時価等に関する事項

平成30年 4月20日現在	平成30年10月22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 style="text-align: center;">同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p>

平成30年 4月20日現在	平成30年10月22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。 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。 特殊債証券 「(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。 社債証券 「(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10月21日 至 平成30年 4月20日	自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22日
	該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

## 1 元本の移動

区分	平成30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	11,455,970,078円	10,004,472,192円
期中追加設定元本額	525,791,328円	1,468,612,412円
期中一部解約元本額	1,977,289,214円	1,370,276,889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)	117,344,683円	120,241,683円
新光7資産バランスファンド	628,025,669円	577,583,847円
日本債券ファンド	2,362,872,180円	3,627,539,623円
新光日本債券インデックスVA	46,237,428円	29,954,797円
新光世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	1,129,713,335円	797,891,591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)	1,492,803,356円	821,216,800円
新光世界バランス35VAT(適格機関投資家私募)	122,900,694円	109,106,017円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	2,821,466,745円	2,742,348,077円



区分	平成30年 4月20日現在	平成30年10月22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）	1,254,303,009円	1,250,500,932円
グローバル・ナビ	28,805,093円	26,424,348円
合計	10,004,472,192円	10,102,807,715円

## 2 有価証券関係

### 売買目的有価証券

種類	平成30年 4月20日現在	平成30年10月22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	534,800	147,875,300
地方債証券	3,716,300	7,856,800
特殊債券	3,751,000	7,840,000
社債券	1,776,000	3,726,000
合計	9,778,100	167,298,100

(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122回利付国債（5年）	70,000,000	70,194,600	
	第123回利付国債（5年）	160,000,000	160,528,000	
	第124回利付国債（5年）	150,000,000	150,573,000	
	第125回利付国債（5年）	120,000,000	120,516,000	
	第126回利付国債（5年）	140,000,000	140,681,800	
	第127回利付国債（5年）	120,000,000	120,621,600	
	第128回利付国債（5年）	120,000,000	120,670,800	
	第129回利付国債（5年）	60,000,000	60,358,800	
	第130回利付国債（5年）	80,000,000	80,506,400	
	第131回利付国債（5年）	60,000,000	60,409,800	

第132回利付国債(5年)	110,000,000	110,766,700	
第133回利付国債(5年)	50,000,000	50,362,500	
第134回利付国債(5年)	90,000,000	90,675,900	
第135回利付国債(5年)	90,000,000	90,695,700	
第136回利付国債(5年)	50,000,000	50,397,000	
第1回利付国債(40年)	10,000,000	13,841,800	
第2回利付国債(40年)	20,000,000	26,749,600	
第3回利付国債(40年)	20,000,000	26,825,800	
第4回利付国債(40年)	30,000,000	40,392,300	
第5回利付国債(40年)	30,000,000	38,824,500	
第6回利付国債(40年)	30,000,000	38,031,000	
第7回利付国債(40年)	30,000,000	36,297,600	
第8回利付国債(40年)	30,000,000	33,560,700	
第9回利付国債(40年)	40,000,000	32,280,000	
第10回利付国債(40年)	40,000,000	38,305,200	
第11回利付国債(40年)	10,000,000	9,213,200	
第305回利付国債(10年)	60,000,000	60,999,000	
第306回利付国債(10年)	150,000,000	153,241,500	
第308回利付国債(10年)	140,000,000	143,325,000	
第309回利付国債(10年)	20,000,000	20,408,600	
第310回利付国債(10年)	110,000,000	112,357,300	
第311回利付国債(10年)	50,000,000	50,880,000	
第312回利付国債(10年)	140,000,000	143,999,800	
第313回利付国債(10年)	100,000,000	103,413,000	
第315回利付国債(10年)	80,000,000	82,792,800	
第317回利付国債(10年)	50,000,000	51,758,000	
第318回利付国債(10年)	80,000,000	82,579,200	
第319回利付国債(10年)	30,000,000	31,140,600	
第320回利付国債(10年)	50,000,000	51,742,500	
第321回利付国債(10年)	50,000,000	51,870,500	
第322回利付国債(10年)	20,000,000	20,679,800	
第323回利付国債(10年)	40,000,000	41,452,800	
第324回利付国債(10年)	50,000,000	51,632,500	
第325回利付国債(10年)	100,000,000	103,471,000	
第326回利付国債(10年)	60,000,000	61,952,400	
第327回利付国債(10年)	50,000,000	51,836,000	
第328回利付国債(10年)	70,000,000	72,088,100	
第329回利付国債(10年)	70,000,000	72,845,500	
第330回利付国債(10年)	70,000,000	72,963,800	
第332回利付国債(10年)	120,000,000	124,033,200	
第333回利付国債(10年)	80,000,000	82,773,600	
第334回利付国債(10年)	100,000,000	103,570,000	

第335回利付国債(10年)	120,000,000	123,691,200	
第336回利付国債(10年)	30,000,000	30,942,600	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,573,000	
第338回利付国債(10年)	70,000,000	71,816,500	
第339回利付国債(10年)	90,000,000	92,365,200	
第340回利付国債(10年)	110,000,000	112,961,200	
第341回利付国債(10年)	100,000,000	102,001,000	
第342回利付国債(10年)	90,000,000	90,465,300	
第343回利付国債(10年)	110,000,000	110,503,800	
第344回利付国債(10年)	110,000,000	110,389,400	
第345回利付国債(10年)	120,000,000	120,340,800	
第346回利付国債(10年)	110,000,000	110,182,600	
第347回利付国債(10年)	80,000,000	80,068,000	
第348回利付国債(10年)	70,000,000	70,000,000	
第349回利付国債(10年)	80,000,000	79,927,200	
第350回利付国債(10年)	100,000,000	99,767,000	
第351回利付国債(10年)	60,000,000	59,799,600	
第5回利付国債(30年)	20,000,000	24,693,600	
第7回利付国債(30年)	20,000,000	25,167,200	
第10回利付国債(30年)	20,000,000	21,966,600	
第11回利付国債(30年)	20,000,000	23,665,400	
第12回利付国債(30年)	10,000,000	12,426,900	
第13回利付国債(30年)	20,000,000	24,591,000	
第15回利付国債(30年)	20,000,000	26,150,000	
第17回利付国債(30年)	20,000,000	25,913,800	
第19回利付国債(30年)	20,000,000	25,654,000	
第20回利付国債(30年)	10,000,000	13,169,600	
第21回利付国債(30年)	10,000,000	12,864,800	
第22回利付国債(30年)	10,000,000	13,202,300	
第23回利付国債(30年)	10,000,000	13,223,500	
第24回利付国債(30年)	20,000,000	26,487,800	
第26回利付国債(30年)	30,000,000	39,276,000	
第27回利付国債(30年)	30,000,000	39,917,400	
第28回利付国債(30年)	30,000,000	40,011,600	
第29回利付国債(30年)	40,000,000	52,711,200	
第30回利付国債(30年)	40,000,000	52,078,000	
第31回利付国債(30年)	30,000,000	38,595,000	
第32回利付国債(30年)	40,000,000	52,352,800	
第33回利付国債(30年)	50,000,000	62,585,000	
第34回利付国債(30年)	40,000,000	51,821,200	
第35回利付国債(30年)	50,000,000	62,833,000	
第36回利付国債(30年)	50,000,000	62,945,000	

第37回利付国債(30年)	50,000,000	61,971,500	
第38回利付国債(30年)	30,000,000	36,573,600	
第39回利付国債(30年)	30,000,000	37,256,700	
第40回利付国債(30年)	20,000,000	24,407,400	
第41回利付国債(30年)	30,000,000	35,955,900	
第42回利付国債(30年)	30,000,000	35,966,400	
第43回利付国債(30年)	30,000,000	35,977,500	
第44回利付国債(30年)	30,000,000	35,987,400	
第45回利付国債(30年)	30,000,000	34,580,100	
第46回利付国債(30年)	40,000,000	46,104,000	
第47回利付国債(30年)	30,000,000	35,311,800	
第48回利付国債(30年)	40,000,000	45,164,000	
第49回利付国債(30年)	40,000,000	45,153,200	
第50回利付国債(30年)	40,000,000	39,293,200	
第51回利付国債(30年)	30,000,000	25,757,100	
第52回利付国債(30年)	30,000,000	27,171,600	
第53回利付国債(30年)	30,000,000	27,852,900	
第54回利付国債(30年)	40,000,000	39,094,800	
第55回利付国債(30年)	40,000,000	39,044,000	
第56回利付国債(30年)	30,000,000	29,244,600	
第57回利付国債(30年)	30,000,000	29,205,600	
第58回利付国債(30年)	40,000,000	38,888,800	
第59回利付国債(30年)	30,000,000	28,362,900	
第45回利付国債(20年)	30,000,000	31,070,700	
第47回利付国債(20年)	50,000,000	52,228,000	
第48回利付国債(20年)	30,000,000	31,699,800	
第50回利付国債(20年)	30,000,000	31,457,400	
第51回利付国債(20年)	10,000,000	10,562,900	
第52回利付国債(20年)	20,000,000	21,288,200	
第53回利付国債(20年)	10,000,000	10,697,100	
第55回利付国債(20年)	10,000,000	10,716,300	
第57回利付国債(20年)	30,000,000	32,190,600	
第58回利付国債(20年)	20,000,000	21,557,200	
第59回利付国債(20年)	10,000,000	10,742,700	
第63回利付国債(20年)	20,000,000	21,747,600	
第64回利付国債(20年)	10,000,000	10,965,100	
第69回利付国債(20年)	30,000,000	33,477,600	
第70回利付国債(20年)	20,000,000	22,754,200	
第72回利付国債(20年)	20,000,000	22,501,800	
第76回利付国債(20年)	30,000,000	33,651,000	
第78回利付国債(20年)	20,000,000	22,514,800	
第81回利付国債(20年)	10,000,000	11,370,100	

第84回利付国債(20年)	40,000,000	45,645,200	
第88回利付国債(20年)	30,000,000	35,162,400	
第90回利付国債(20年)	40,000,000	46,756,800	
第92回利付国債(20年)	50,000,000	58,257,500	
第94回利付国債(20年)	30,000,000	35,074,200	
第95回利付国債(20年)	20,000,000	23,807,200	
第97回利付国債(20年)	40,000,000	47,438,800	
第99回利付国債(20年)	40,000,000	47,238,800	
第100回利付国債(20年)	50,000,000	59,700,000	
第103回利付国債(20年)	30,000,000	36,226,200	
第105回利付国債(20年)	30,000,000	35,747,100	
第108回利付国債(20年)	40,000,000	47,004,400	
第110回利付国債(20年)	10,000,000	11,979,400	
第111回利付国債(20年)	30,000,000	36,355,800	
第112回利付国債(20年)	20,000,000	24,028,000	
第113回利付国債(20年)	50,000,000	60,239,000	
第114回利付国債(20年)	10,000,000	12,073,900	
第116回利付国債(20年)	30,000,000	36,649,500	
第117回利付国債(20年)	40,000,000	48,420,800	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	12,016,300	
第121回利付国債(20年)	50,000,000	59,610,000	
第123回利付国債(20年)	50,000,000	60,915,000	
第125回利付国債(20年)	30,000,000	36,994,200	
第128回利付国債(20年)	50,000,000	59,901,500	
第130回利付国債(20年)	20,000,000	23,743,200	
第132回利付国債(20年)	40,000,000	47,059,200	
第133回利付国債(20年)	20,000,000	23,782,600	
第134回利付国債(20年)	40,000,000	47,640,000	
第135回利付国債(20年)	10,000,000	11,781,400	
第136回利付国債(20年)	20,000,000	23,290,600	
第137回利付国債(20年)	30,000,000	35,370,900	
第138回利付国債(20年)	10,000,000	11,529,000	
第139回利付国債(20年)	20,000,000	23,319,400	
第140回利付国債(20年)	60,000,000	70,837,200	
第141回利付国債(20年)	40,000,000	47,252,800	
第142回利付国債(20年)	20,000,000	23,896,000	
第143回利付国債(20年)	40,000,000	46,728,800	
第144回利付国債(20年)	20,000,000	23,090,800	
第145回利付国債(20年)	60,000,000	70,996,200	
第146回利付国債(20年)	50,000,000	59,229,000	
第147回利付国債(20年)	60,000,000	70,240,200	
第148回利付国債(20年)	60,000,000	69,375,600	

	第149回利付国債（20年）	60,000,000	69,366,600	
	第150回利付国債（20年）	60,000,000	68,462,400	
	第151回利付国債（20年）	50,000,000	55,481,500	
	第152回利付国債（20年）	60,000,000	66,519,000	
	第153回利付国債（20年）	50,000,000	56,193,500	
	第154回利付国債（20年）	60,000,000	66,444,600	
	第155回利付国債（20年）	50,000,000	53,696,000	
	第156回利付国債（20年）	50,000,000	48,654,000	
	第157回利付国債（20年）	60,000,000	56,212,800	
	第158回利付国債（20年）	60,000,000	59,077,200	
	第159回利付国債（20年）	60,000,000	59,950,800	
	第160回利付国債（20年）	50,000,000	50,702,500	
	第161回利付国債（20年）	50,000,000	49,749,500	
	第162回利付国債（20年）	50,000,000	49,620,500	
	第163回利付国債（20年）	40,000,000	39,591,600	
	第164回利付国債（20年）	50,000,000	48,498,500	
	第165回利付国債（20年）	40,000,000	38,684,400	
国債証券 小計		9,360,000,000	10,073,012,300	
地方債証券	第18回東京都公募公債（20年）	100,000,000	119,640,000	
	第678回東京都公募公債	80,000,000	81,272,000	
	第200回神奈川県公募公債	35,000,000	36,333,500	
	第218回神奈川県公募公債	100,000,000	100,320,000	
	第412回大阪府公募公債（10年）	50,000,000	49,405,000	
	第12回兵庫県公募公債（15年）	100,000,000	104,260,000	
	平成24年度第3回広島県公募公債	66,000,000	68,039,400	
	平成24年度第7回広島県公募公債	100,000,000	102,770,000	
	平成24年度第1回福岡県公募公債（30年）	10,000,000	12,555,000	
	第105回共同発行市場公募地方債	50,000,000	51,660,000	
	第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,920,000	
	第485回名古屋市公募公債（10年）	30,000,000	30,915,000	
	平成24年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,750,000	
地方債証券 小計		921,000,000	959,839,900	
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	119,810,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,840,000	
	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	102,720,000	
	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	99,880,000	
	第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,070,000	
	第49回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,070,000	
	第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,300,000	
	い第782号農林債	10,000,000	10,040,000	

	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	101,700,000	
特殊債券 小計		910,000,000	947,390,000	
社債券	第4回第一三共社債	100,000,000	103,150,000	
	第11回ブリヂストン社債	100,000,000	99,450,000	
	第44回ホンダファイナンス社債	100,000,000	99,740,000	
	第47回野村ホールディングス社債	100,000,000	100,870,000	
	第36回東日本旅客鉄道社債	100,000,000	111,740,000	
社債券 小計		500,000,000	514,950,000	
	合計	11,691,000,000	12,495,192,200	

## 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30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	37,314,268	19,684,955
投資証券	2,311,780,890	2,254,891,750
未収入金	53,840	7,658,090
未収配当金	18,638,399	18,873,575
流動資産合計	2,367,787,397	2,301,108,370
資産合計	2,367,787,397	2,301,108,370
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	11,587,380	-
未払解約金	-	7,440,000
未払利息	84	45
流動負債合計	11,587,464	7,440,045
負債合計	11,587,464	7,440,045
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,431,530,602	1,324,954,715
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	924,669,331	968,713,610
元本等合計	2,356,199,933	2,293,668,325
純資産合計	2,356,199,933	2,293,668,325
負債純資産合計	2,367,787,397	2,301,108,370

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22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. 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。

## (貸借対照表に関する注記)

平成30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
1. 計算日における受益権の総数 1,431,530,602口	1. 計算日における受益権の総数 1,324,954,715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 1.6459円 (1万口当たり純資産額) (16,459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 1.7311円 (1万口当たり純資産額) (17,311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10月21日 至 平成30年 4月20日	自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、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30年 4月20日現在	平成30年10月22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 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。 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 同左</p> <p>2.時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成29年10月21日 至 平成30年 4月20日	自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22日
--	--------------------------------	--------------------------------

	該当事項はありません。	同左
--	-------------	----

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

区分	平成30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	1,584,079,714円	1,431,530,602円
期中追加設定元本額	46,835,847円	100,114,354円
期中一部解約元本額	199,384,959円	206,690,241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	462,104,698円	426,161,221円
グローバル・ナビ	7,493,159円	6,384,474円
新光J-REITオープン(年2回決算型)	961,932,745円	892,409,020円
合計	1,431,530,602円	1,324,954,715円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	平成30年 4月20日現在	平成30年10月22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	84,122,557	139,309,699
合計	84,122,557	139,309,699

(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	88	45,848,000	
	MCUBS MidCity投資法人	297	25,749,900	
	森ヒルズリート投資法人	302	42,370,600	
	産業ファンド投資法人	307	35,182,200	
	アドバンス・レジデンス投資法人	257	74,221,600	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	156	26,894,400	
	アクティブア・プロパティーズ投資法人	126	60,543,000	
	GLP投資法人	653	73,527,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	100	26,860,000	
	日本プロロジスリート投資法人	353	82,001,900	
	星野リゾート・リート投資法人	40	21,920,000	
	Oneリート投資法人	38	9,541,800	
	イオンリート投資法人	270	33,912,000	
	ヒューリックリート投資法人	190	30,324,000	
	日本リート投資法人	85	31,152,500	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1,561	25,366,250	
	日本ヘルスケア投資法人	12	2,142,000	
	積水ハウス・リート投資法人	680	49,708,000	
	ト・セイ・リート投資法人	42	4,821,600	
	ケネディクス商業リート投資法人	97	23,105,400	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	35	3,965,500	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	53	4,785,900	
	野村不動産マスタ・ファンド投資法人	781	117,384,300	
	いちごホテルリート投資法人	46	6,394,000	
	ラサ・ルロジボ・リート投資法人	199	20,934,800	
	スタ・アジア不動産投資法人	82	8,659,200	
	マリモ地方創生リート投資法人	23	2,569,100	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	45	15,142,500	
	大江戸温泉リート投資法人	43	3,710,900	
	さくら総合リート投資法人	57	5,073,000	
	投資法人みらい	61	11,400,900	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	62	8,518,800	
	三菱地所物流リート投資法人	28	7,078,400	
	CREロジスティクスファンド投資法人	26	2,834,000	
	ザイマックス・リート投資法人	24	2,740,800	
	タカラレーベン不動産投資法人	39	3,447,600	
	日本ビルファンド投資法人	255	166,005,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	263	155,170,000	
	日本リートールファンド投資法人	498	103,683,600	
	オリックス不動産投資法人	525	91,980,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	167	66,967,000	
	プレミア投資法人	250	29,375,000	

東急リアル・エステート投資法人	177	27,824,400	
グローバル・ワン不動産投資法人	168	19,185,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	581	101,500,700	
森トラスト総合リート投資法人	188	30,362,000	
インヴィンシブル投資法人	922	43,057,400	
フロンティア不動産投資法人	90	39,375,000	
平和不動産リート投資法人	164	18,335,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	174	39,150,000	
福岡リート投資法人	136	23,677,600	
ケネディクス・オフィス投資法人	81	57,429,000	
いちごオフィスリート投資法人	219	20,367,000	
大和証券オフィス投資法人	61	41,419,000	
阪急阪神リート投資法人	109	15,412,600	
スタートアップリート投資法人	42	7,165,200	
大和ハウスリート投資法人	330	83,820,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	763	62,413,400	
日本賃貸住宅投資法人	296	26,432,800	
ジャパンエクセレント投資法人	236	34,951,600	
合計	13,953	2,254,891,750	

(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30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	5,106,373	7,897,089
コール・ローン	2,826,437	3,193,377
投資証券	725,699,828	703,233,813
未収配当金	639,624	642,112
流動資産合計	734,272,262	714,966,391
資産合計	734,272,262	714,966,391
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	-	5,222,051
未払利息	6	7
流動負債合計	6	5,222,058
負債合計	6	5,222,058

平成30年 4月20日現在

平成30年10月22日現在

純資産の部		
元本等		
元本	505,327,422	436,400,776
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	228,944,834	273,343,557
元本等合計	734,272,256	709,744,333
純資産合計	734,272,256	709,744,333
負債純資産合計	734,272,262	714,966,391

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22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30年 4月20日現在		平成30年10月22日現在	
1. 計算日における受益権の総数	505,327,422口	1. 計算日における受益権の総数	436,400,776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	1.4531円	1口当たり純資産額	1.6264円
(1万口当たり純資産額)	(14,531円)	(1万口当たり純資産額)	(16,264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10月21日 至 平成30年 4月20日	自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22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30年 4月20日現在	平成30年10月22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10月21日 至 平成30年 4月20日	自 平成30年 4月21日 至 平成30年10月22日
	該当事項はありません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

区分	平成30年 4月20日現在	平成30年10月22日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	501,859,495円	505,327,422円
期中追加設定元本額	4,170,992円	438,422円
期中一部解約元本額	703,065円	69,365,068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	429,551,750円
グローバル・ナビ	8,373,386円	6,849,026円
合計	505,327,422円	436,400,776円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	平成30年 4月20日現在	平成30年10月22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	68,905,487	27,695,066
合計	68,905,487	27,695,066

(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	512	14,259.20	
		AGREE REALTY CORPORATION	200	10,808.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	485	9,763.05	
		ALEXANDER'S INC	16	5,280.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE	649	79,450.58	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	236	8,682.44	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	871	35,101.30	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	333	4,691.97	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	1,653	34,316.28	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	2,780	417,417.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST	532	12,996.76	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	998	43,143.54	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	1,335	21,853.95	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	300	4,494.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	547	3,003.03	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	874	155,545.78	



BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	200	1,782.00	
BOSTON PROPERTIES INC	978	114,377.10	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	200	2,158.00	
BRANDYWINE REALTY	1,087	15,631.06	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1,929	30,092.40	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	968	19,069.60	
CAMDEN PROPERTY TRUST	568	52,835.36	
CARETRUST REIT INC	500	8,695.00	
CATCHMARK TIMBER TRUST INC	300	2,862.00	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	1,314	4,480.74	
CEDAR REALTY TRUST INC	700	2,758.00	
CHATHAM LODGING TRUST	300	5,880.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	366	10,833.60	
CITY OFFICE REIT INC	210	2,452.80	
CLIPPER REALTY INC	111	1,444.11	
COLONY CAPITAL INC	3,002	17,561.70	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	756	16,563.96	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	100	2,922.00	
CORECIVIC INC	755	17,636.80	
COREENERGY INFRASTRUCTURE TRUST INC	100	3,612.00	
CORESITE REALTY CORPORATION	218	22,855.12	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	653	18,453.78	
COUSINS PROPERTIES INC	2,673	22,373.01	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	2,624	280,584.32	
CUBESMART	1,162	32,547.62	
CYRUSONE INC	627	39,043.29	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	1,231	12,913.19	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,286	144,777.88	
DOUGLAS EMMETT INC	1,027	37,762.79	
DUKE REALTY CORP	2,209	61,255.57	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	373	6,803.52	
EASTGROUP PROPERTIES	232	22,137.44	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	944	15,245.60	
EPR PROPERTIES	471	32,070.39	
EQUINIX INC	502	207,983.62	
EQUITY COMMONWEALTH	751	22,139.48	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	541	51,054.17	
EQUITY RESIDENTIAL	2,245	145,633.15	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	416	102,186.24	
EXTRA SPACE STORAGE INC	752	65,559.36	
FARMLAND PARTNERS INC	229	1,559.49	
FEDERAL REALTY INVESTMENT	452	55,550.80	

FIRST INDUSTRIAL REALTY	763	23,385.95	
FOREST CITY REALTY TRUST- A	1,361	34,242.76	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	380	9,807.80	
FRANKLIN STREET PROPERTIES	800	5,824.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	347	3,532.46	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	1,289	44,547.84	
GETTY REALTY CORP	201	5,491.32	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	200	3,694.00	
GLADSTONE LAND CORPORATION	54	651.78	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	100	912.00	
GLOBAL NET LEASE INC	436	8,567.40	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	661	6,477.80	
HCP INC	2,978	78,619.20	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	760	21,530.80	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	1,304	33,812.72	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	275	5,373.50	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	650	29,282.50	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	1,041	27,628.14	
HOST HOTELS & RESORTS	4,637	88,566.70	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	986	30,605.44	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	500	4,915.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	146	3,168.20	
INFREIT INC	300	6,309.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,000	5,460.00	
INVITATION HOMES INC	1,910	41,809.90	
IRON MOUNTAIN INC	1,759	56,604.62	
JBG SMITH PROPERTIES	656	24,134.24	
KILROY REALTY CORP	620	43,784.40	
KIMCO REALTY CORPORATION	2,600	39,338.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	509	7,976.03	
LAMAR ADVERTISING COMPANY	533	40,097.59	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	704	22,577.28	
LEXINGTON REALTY TRUST	1,370	10,768.20	
LIBERTY PROPERTY TRUST	943	38,304.66	
LIFE STORAGE INC	293	27,105.43	
LTC PROPERTIES INC	241	10,469.04	
MACK-CALI REALTY CORP	633	12,837.24	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	200	1,720.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	2,320	34,150.40	
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	718	71,376.38	
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT COR- CL A	500	7,740.00	
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	247	17,974.19	

NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	979	44,799.04	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	325	8,359.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	600	3,444.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	127	4,351.02	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	275	3,643.75	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	1,253	41,286.35	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	100	2,546.00	
OUTFRONT MEDIA INC	858	16,164.72	
PARAMOUNT GROUP INC	1,326	19,041.36	
PARK HOTELS & RESORTS INC	1,285	37,817.55	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	418	13,350.92	
PENN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	500	4,560.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	1,120	18,648.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC-A	785	14,349.80	
POTLATCHDELTIC CORP	391	14,283.23	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	259	4,257.96	
PROLOGIS INC	3,967	252,261.53	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	123	15,285.21	
PUBLIC STORAGE	940	187,962.40	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	314	12,858.30	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	600	7,800.00	
RAYONIER INC	825	25,434.75	
REALTY INCOME CORP	1,837	107,464.50	
REGENCY CENTERS CORPORATION	941	59,706.45	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	771	14,016.78	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	1,401	16,643.88	
RETAIL VALUE INC	108	3,196.80	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	550	17,193.00	
RLJ LODGING TRUST	1,105	21,514.35	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	284	21,973.08	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	1,131	24,655.80	
SAFETY INCOME & GROWTH INC	73	1,209.61	
SAUL CENTERS INC	81	4,187.70	
SBA COMMUNICATIONS CORP	721	111,307.98	
SELECT INCOME REIT	550	10,950.50	
SENIOR HOUSING PROPERTIES	1,504	25,598.08	
SIMON PROPERTY GROUP	1,953	341,325.81	
SITE CENTERS CORP	947	11,534.46	
SL GREEN REALTY CORPORATION	519	48,183.96	
SPIRIT MTA REIT	326	3,683.80	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	2,736	21,614.40	
STAG INDUSTRIAL INC	602	15,802.50	

	STORE CAPITAL CORPORATION	1,140	32,683.80
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	637	7,669.48
	SUN COMMUNITIES INC	516	51,465.84
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS	1,434	20,993.76
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	566	12,452.00
	TAUBMAN CENTERS INC	365	19,772.05
	TERRENO REALTY CORP	364	13,125.84
	THE GEO GROUP INC	772	18,589.76
	THE MACERICH COMPANY	870	44,839.80
	TIER REIT INC	367	8,290.53
	UDR INC	1,636	64,442.04
	UMH PROPERTIES INC	200	2,932.00
	UNITI GROUP INC	1,054	20,890.28
	UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	100	7,074.00
	URBAN EDGE PROPERTIES	671	13,775.63
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES INC	229	4,536.49
	VENTAS INC	2,255	126,144.70
	VEREIT INC	6,202	44,778.44
	VICI PROPERTIES INC	2,301	49,793.64
	VORNADO REALTY TRUST	1,092	74,605.44
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	1,151	7,458.48
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	501	14,173.29
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	764	21,353.80
	WELLTOWER INC	2,358	152,020.26
	WEYERHAEUSER COMPANY	4,737	135,193.98
	WHITESTONE REIT	283	3,727.11
	WINTHROP REALTY LIQUIDATING TRUST	300	204.00
	WP CAREY INC	677	44,086.24
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	659	14,063.06
米ドル建小計		156,019	6,251,522.92 (703,233,813)
合計			703,233,813 (703,233,813)

(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 171銘柄	99.1%	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10月31日現在）

資産総額	5,058,483,987円
負債総額	1,720,400円
純資産総額（ - ）	5,056,763,587円
発行済口数	5,683,975,562口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8897円
（1万口当たり純資産額）	（8,897円）

#### （参考）海外国債マザーファンド

（平成30年10月31日現在）

資産総額	20,002,373,691円
負債総額	187,825,205円
純資産総額（ - ）	19,814,548,486円
発行済口数	8,931,211,079口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2186円
（1万口当たり純資産額）	（22,186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10月31日現在）

資産総額	7,844,501,008円
負債総額	349,083,876円
純資産総額（ - ）	7,495,417,132円
発行済口数	3,467,664,192口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1615円
（1万口当たり純資産額）	（21,615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10月31日現在）

資産総額	5,370,392,433円
負債総額	18,468,743円

純資産総額( - )	5,351,923,690円
発行済口数	2,328,110,701口
1口当たり純資産額( / )	2.2988円
(1万口当たり純資産額)	(22,988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10月31日現在)

資産総額	12,714,463,943円
負債総額	146,215,451円
純資産総額( - )	12,568,248,492円
発行済口数	9,967,077,534口
1口当たり純資産額( / )	1.2610円
(1万口当たり純資産額)	(12,610円)

## (参考) 新光J-REITマザーファンド

(平成30年10月31日現在)

資産総額	2,296,631,499円
負債総額	8,596,511円
純資産総額( - )	2,288,034,988円
発行済口数	1,333,127,035口
1口当たり純資産額( / )	1.7163円
(1万口当たり純資産額)	(17,163円)

## (参考) 新光米国REITマザーファンド

(平成30年10月31日現在)

資産総額	725,519,210円
負債総額	7円
純資産総額( - )	725,519,203円
発行済口数	436,400,776口
1口当たり純資産額( / )	1.6625円
(1万口当たり純資産額)	(16,625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】

##### (1) 資本金の額（2018年10月31日現在）

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

直近5力年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構（2018年10月31日現在）

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1.投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

###### 2.運用計画、売買計画の決定

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2018年10月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	1,187,081,738,031
追加型株式投資信託	854	12,790,313,997,301
単位型公社債投資信託	48	185,032,179,480
単位型株式投資信託	151	1,090,851,077,839
合計	1,091	15,253,278,992,651

## 3【委託会社等の経理状況】

1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

3．委託会社は、第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、第34期中間会計期間（自平成30年4月1日至平成30年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

### （1）【貸借対照表】

（単位：千円）

	第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	1,156,953
器具備品	1	656,235	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	2	1
投資有価証券売却益		-		479,323
関係会社株式売却益	1	-	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	3	36,992
固定資産売却損	4	10,323	4	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	5	-
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			
	資本剰余金		利益剰余金	
				その他利益剰余金

	資本金	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	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 準備金	利益剰余金			
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金

当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	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 其他有価証券	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 其他有価証券	1,448,968	1,448,968	-
資産計	78,947,251	78,947,251	-
(1) 未払手数料	4,629,133	4,629,133	-
負債計	4,629,133	4,629,133	-

## (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 その他有価証券」には含めておりません。

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第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 その他有価証券(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 その他有価証券(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. その他有価証券

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	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。

### (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

	第34期中間会計期間末 (平成30年9月30日現在)
(資産の部)	
流動資産	
現金・預金	34,067,025
金銭の信託	18,936,052
未収委託者報酬	12,755,452
未収運用受託報酬	3,856,616
未収投資助言報酬	346,291

未収収益		58,816
前払費用		722,476
その他		443,661
	流動資産計	71,186,392
固定資産		
有形固定資産		1,564,959
建物	1	1,139,616
器具備品	1	425,343
無形固定資産		2,666,559
ソフトウェア		875,280
ソフトウェア仮勘定		1,787,307
電話加入権		3,931
電信電話専用施設利用権		40
投資その他の資産		8,242,396
投資有価証券		2,436,769
関係会社株式		3,229,196
長期差入保証金		1,318,800
繰延税金資産		1,167,835
その他		89,794
	固定資産計	12,473,915
資産合計		83,660,307

(単位：千円)

	第34期中間会計期間末 (平成30年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	2,420,695
未払金	5,448,301
未払収益分配金	1,091
未払償還金	48,968
未払手数料	4,999,441
その他未払金	398,799
未払費用	6,877,637
未払法人税等	3,090,099
未払消費税等	599,967
前受収益	70,778
賞与引当金	1,310,878
役員賞与引当金	25,584
	流動負債計
	19,843,940



固定負債		
退職給付引当金		1,739,495
時効後支払損引当金		177,842
	固定負債計	1,917,338
	負債合計	21,761,279
	(純資産の部)	
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		19,552,957
資本準備金		2,428,478
その他資本剰余金		17,124,479
利益剰余金		39,054,769
利益準備金		123,293
その他利益剰余金		38,931,475
別途積立金		31,680,000
繰越利益剰余金		7,251,475
	株主資本計	60,607,726
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		1,291,302
	評価・換算差額等計	1,291,302
	純資産合計	61,899,028
	負債・純資産合計	83,660,307

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日至平成30年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	42,913,511	
運用受託報酬	8,532,726	
投資助言報酬	628,443	
その他営業収益	58,808	
	営業収益計	52,133,489
営業費用		
支払手数料	18,339,539	
広告宣伝費	179,085	
公告費	125	
調査費	12,096,339	
調査費	4,887,455	
委託調査費	7,208,884	
委託計算費	514,718	
営業雑経費	613,114	
通信費	23,463	
印刷費	467,622	
協会費	31,454	
諸会費	17,206	
支払販売手数料	73,367	

営業費用計		31,742,923
一般管理費		
給料	4,854,622	
役員報酬	92,217	
給料・手当	4,634,136	
賞与	128,268	
交際費	26,068	
寄付金	5,806	
旅費交通費	164,824	
租税公課	284,716	
不動産賃借料	779,131	
退職給付費用	256,835	
固定資産減価償却費	1 294,442	
福利厚生費	22,384	
修繕費	12,644	
賞与引当金繰入額	1,310,878	
役員賞与引当金繰入額	25,584	
機器リース料	60	
事務委託費	1,757,115	
事務用消耗品費	70,698	
器具備品費	3,043	
諸経費	98,264	
一般管理費計		9,967,124
営業利益		10,423,441

(単位：千円)

		第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日至平成30年9月30日)	
営業外収益			
受取利息		887	
受取配当金		49,212	
時効成立分配金・償還金		8,482	
時効後支払損引当金戻入額		19,806	
雑収入		12,895	
営業外収益計			91,283
営業外費用			
為替差損		19,977	
金銭の信託運用損		23,814	
雑損失		3,708	
営業外費用計			47,500
経常利益			10,467,225
特別損失			
固定資産除却損		18,830	
特別損失計			18,830
税引前中間純利益			10,448,394
法人税、住民税及び事業税			2,910,819
法人税等調整額			312,661
法人税等合計			3,223,481
中間純利益			7,224,913

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間(自平成30年4月1日至平成30年9月30日)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562
当中間期変動額									
剰余金の配当									12,520,000
中間純利益									7,224,913
別途積立金の積立						7,100,000			
研究開発積立金の取崩							300,000		
運用責任準備積立金の取崩								200,000	
繰越利益剰余金の取崩									6,600,000
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)									
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	7,100,000	300,000	200,000	11,895,086
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	-	-	7,251,475

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815
当中間期変動額					
剰余金の配当	12,520,000	12,520,000			12,520,000
中間純利益	7,224,913	7,224,913			7,224,913
別途積立金の積立	7,100,000	7,100,000			7,100,000
研究開発積立金の取崩	300,000	300,000			300,000
運用責任準備積立金の取崩	200,000	200,000			200,000
繰越利益剰余金の取崩	6,600,000	6,600,000			6,600,000
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)			496,300	496,300	496,300

当中間期変動額 合計	5,295,086	5,295,086	496,300	496,300	4,798,786
当中間期末残高	39,054,769	60,607,726	1,291,302	1,291,302	61,899,028

## 重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <p>建物 … 6～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

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

## 表示方法の変更

<p>第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)</p>
<p>「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。</p>

## 注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第34期中間会計期間末 (平成30年9月30日現在)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	建物	184,810千円
	器具備品	860,618千円

(中間損益計算書関係)

項目	第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)
----	--

1.減価償却実施額	有形固定資産	...	112,547千円
	無形固定資産	...	181,894千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第34期中間会計期間（自平成30年4月1日 至平成30年9月30日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

（金融商品関係）

第34期中間会計期間末（平成30年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

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

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

	中間貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）
（1）現金・預金	34,067,025	34,067,025	-
（2）金銭の信託	18,936,052	18,936,052	-
（3）未収委託者報酬	12,755,452	12,755,452	-
（4）未収運用受託報酬	3,856,616	3,856,616	-
（5）有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	2,164,304	2,164,304	-
資産計	71,779,451	71,779,451	-
（1）未払手数料	4,999,441	4,999,441	-
負債計	4,999,441	4,999,441	-

（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

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	272,464
関係会社株式	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 その他有価証券」には含めておりません。

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

## (有価証券関係)

第34期中間会計期間末  
(平成30年9月30日現在)

## 1. 子会社株式

関係会社株式（中間貸借対照表計上額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. その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	1,976,064	146,101	1,829,962
投資信託	184,247	153,000	31,247
小計	2,160,311	299,101	1,861,209
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,993	4,000	6
小計	3,993	4,000	6
合計	2,164,304	303,101	1,861,202

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額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。

## （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IA種類株式15,510株を交付しました。

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

### (1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成30年4月1日から平成30年9月30日まで

### (2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

### (3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

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

a. 資産の額 資産合計 40,451,657千円

うち現金・預金 11,605,537千円

うち金銭の信託 11,792,364千円

b. 負債の額 負債合計 9,256,209千円

うち未払手数料及び未払費用 4,539,592千円

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

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

加重平均償却期間

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産		- 千円
固定資産	109,432,950千円	
資産合計	109,432,950千円	
流動負債	- 千円	
固定負債	11,942,856千円	
負債合計	11,942,856千円	
純資産	97,490,094千円	

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額68,602,354千円及び顧客関連資産の金額42,580,212千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益		- 千円
営業利益	4,521,569千円	
経常利益	4,521,569千円	
税引前中間純利益	4,521,569千円	
中間純利益	3,720,565千円	
1株当たり中間純利益	93,014円14銭	

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,620,626千円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

第34期中間会計期間（自平成30年4月1日 至平成30年9月30日）

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,547,475円72銭
1株当たり中間純利益金額	180,622円83銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)
中間純利益金額	7,224,913千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	7,224,913千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)

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

(重要な後発事象)

第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)
--

アセットマネジメントOne株式会社(取締役社長:菅野 暁、以下「AM-One」)は、平成30年6月1日に株式会社みずほ銀行(頭取:藤原 弘治)と締結した株式譲渡基本合意書に基づき、平成30年11月1日に株式譲渡契約を締結の上、同日付でみずほグローバルオルタナティブインベストメンツ株式会社(取締役社長:安藤 学、以下「MGAI」)の発行済株式の全てを取得し、子会社化しました。本再編に伴いMGAIは、商号をアセットマネジメントOneオルタナティブインベストメンツ株式会社(取締役社長:安藤 学、以下「AMOAI」)に改称しました。

#### 1. 株式取得の目的

本再編により、AM-OneとAMOAI(旧MGAI)は両社のオルタナティブ投資のゲートキーピング( )に係る機能について一体運営を行ない、ゲートキーピング能力と受託体制の強化を実現するとともに、株式会社みずほフィナンシャルグループ及び第一生命ホールディングス株式会社とも連携し、お客さまの多様なニーズに応えるものであります。

( ) 外部の運用会社およびファンドを調査し、優良なファンドを選定・管理すること

#### 2. 株式取得対象会社の概要

- (1) 商号 :アセットマネジメントOneオルタナティブインベストメンツ株式会社
- (2) 事業内容:投資運用業務、投資助言・代理業務
- (3) 資本金 :10億円(平成30年11月1日現在)

#### 3. 株式取得の時期

平成30年11月1日

#### 4. 取得する株式の数、取得原価及び取得後の議決権比率

- (1) 取得株式数 :20,000株
- (2) 取得原価 :12億7千万円
- (3) 取得後の議決権比率 :100%

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

## 5【その他】

### (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2018年6月20日付で、総則の「目的」に関する事項の定款の変更を行いました。

委託会社は、株式会社みずほ銀行から、みずほグローバルオルタナティブインベストメンツ株式会社(以下「MGAI」といいます。 )の発行済株式の全てについて2018年11月1日付で譲り受け、MGAIを100%子会社(新商号:アセットマネジメントOneオルタナティブインベストメンツ株式会社)としました。

### (2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 三井住友信託銀行株式会社(「受託者」)

##### a. 資本金の額

2018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

2018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2018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 <sup>(注)</sup>	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
SMB C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、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
-------	------

2018年 4月27日	臨時報告書
2018年 7月20日	有価証券届出書
2018年 7月20日	有価証券報告書
2018年 7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) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。



## 独立監査人の監査報告書

平成30年12月7日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている新光7資産バランスファンドの平成30年4月21日から平成30年10月22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10月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成30年11月30日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

### EY新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 中間監査意見

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

#### 利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。