

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年9月17日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	グローバル・ナビ
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券の金額】	継続募集額(2019年9月18日から2020年3月16日まで) 3兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

グローバル・ナビ

愛称として「世界の潮流」という名称を用いることがあります。

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

（イ）追加型株式投資信託（契約型）の受益権です。

（ロ）当初元本は1口当たり1円です。

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

3兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

（イ）発行価格は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額です。

なお、ファンドの基準価額については1万口当たりの価額を発表します。

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

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

（５）【申込手数料】

申込手数料は、取得申込受付日の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および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)が含まれます。

* 消費税率が10%になった場合は、2.75%となります。

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

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

(6) 【申込単位】

お申込単位は、販売会社またはお申込コースにより異なります。

お申込コースには、収益の分配時に分配金を受け取るコース(「分配金受取コース」)と、分配金が税引き後無手数料で再投資されるコース(「分配金再投資コース」)の2コースがあります。ただし、販売会社によっては、どちらか一方のみの取り扱いとなる場合があります。また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定時定額購入(積立)をすることができる場合があります。

詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

(7) 【申込期間】

2019年9月18日から2020年3月16日までです。

申込期間は上記期間終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

申し込みの取扱場所(販売会社)については、下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

インターネットホームページ

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

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

(イ) 申込証拠金

ありません。

(ロ) 日本以外の地域における発行

ありません。

(ハ) 振替受益権について

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

a. ファンドの目的及び基本的性格

当ファンドは、追加型投信／内外／資産複合に属し、主としてマザーファンド受益証券（以下「マザーファンド」という場合があります。）および上場投資信託証券（以下「ETF」という場合があります。）に投資し、安定した収益の確保と投資信託財産の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5,000億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、以下のよう分類・区分されます。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型	国内	株式
	海外	債券
追加型	内外	不動産投信
		その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類の定義

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の投資信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (含む日本)	ファミリーファンド
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年2回 年4回 年6回(隔月) 年12回(毎月) 日々 その他()	日本 北米 欧州 アジア オセアニア	ファンド・オブ・ファンズ
不動産投信		中南米	為替ヘッジ
その他資産 ()		アフリカ 中近東(中東)	
資産複合 (株式 一般、その他 資産(株式 一般、債 券 一般、不動産投 信)(資産配分変更 型))		エマージング	あり(部分ヘッジ) なし

(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

資産複合(株式 一般、 その他資産(株式 一 般、債券 一般、不動産 投信)(資産配分変更 型))	目論見書または投資信託約款において、複数資産(株式 一般、投資信託証券への投資を通じて実質的に株式 一般、債券 一般、不動産投信)を投資対象とするものをいう。 資産配分変更型とは、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、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。

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。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジあり (部分ヘッジ) ^(注)	目論見書または投資信託約款において、一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

(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。

商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご参照ください。

b. ファンドの特色

1. 国内外の株式、債券、REIT^{*1}に分散投資を行います。

当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

投資信託証券への投資を通じて、国内外の株式、債券およびREITに実質的に投資することにより、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指します。

新興国株式については、ETF^{*2}への投資を行います。ETFについては、規模、流動性、ベンチマーク指数などを総合的に判断して、銘柄を決定します。

効率的な運用を行うことを目的として、株価指数先物取引、国債先物取引などを利用することがあります。

*1「REIT」とは、不動産投資信託証券を指します。

*2「ETF」とは、Exchange Traded Fund(取引所で売買される投資信託)の略で、取引所に上場されている投資信託のことを指します。

2. 各資産の配分比率は、世界経済、金融市場の動向などを勘案して機動的に変更します。

各マザーファンドとETFを合算した投資比率は、原則として高位を保ちますが、市場環境などを勘案して、投資比率を引き下げる場合があります。

< 当ファンドの資産配分について >

Step1 株式と債券の配分比率決定・見直し

主に株式を中心とする投資環境見通しに基づいて、株式(REITを含む)と債券(現預金などを含む)の配分比率を決定します。

配分比率は、株式比率で概ね10%~90%の範囲で、投資環境の変化に応じて機動的に見直しを行います。

＜配分比率決定・見直しのイメージ＞



Step 2 各資産の配分比率決定

Step 1の株式・債券の配分比率に基づき、各資産の魅力度評価とリスク判断に応じて、それぞれの配分比率を決定します。

株式・債券の配分比率内において、各資産の配分比率に制限はありません。

(参考)当ファンドが投資する各マザーファンドの運用方針

国内株式

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

- ・東京証券取引所第一部に上場されている株式に投資し、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。

先進国株式

新光外国株式インデックスマザーファンド

- ・主として日本を除く世界主要先進国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

国内債券

新光日本債券インデックスマザーファンド

- ・主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA - BPI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。

先進国債券

海外国債マザーファンド

- ・主として日本を除く世界主要先進国（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）が発行する公社債に投資し、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。
- ・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します。
- ・外貨建資産については、為替ヘッジを行いません。

新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

- ・主として日本を除く世界主要国の公社債に投資し、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジあり・円ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。

新興国債券

グローバル高金利通貨マザーファンド

- ・新興国を中心とする世界の国の中から、主として地域分散と金利水準の観点により選定した複数の通貨建ての国際機関債などに分散投資を行い、安定した収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
- ・通貨配分は、北米・中南米、欧州、アジア・オセアニア、中東・アフリカの4地域について、それぞれ25%程度とすることを基本とします。各地域内における通貨配分は、金利水準や金利・為替動向、流動性などを勘案して決定します。

流動性の低下、市場規模の縮小、通貨制度の変更などにより、各地域に対する通貨配分比率を25%程度にできない場合があります。

- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

国内REIT

新光J-REITマザーファンド

- ・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。

先進国REIT

新光米国REITマザーファンド

- ・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(REIT)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。
- ・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。

上記の各マザーファンドの運用方針は、各マザーファンド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、記載内容は2019年9月17日現在のものであり、今後変更になる場合があります。

(参考)当ファンドの投資対象候補であるETFの概要(2019年9月17日現在)

新興国株式

下記の投資対象候補およびその概要は2019年9月17日現在のものであり、今後予告なく変更する場合があります。

名称：iシェアーズ・コア MSCI エマージング・マーケット ETF

投資目的：MSCIエマージング・マーケットIMIインデックスと同等水準の投資成果を目指しています。
運用会社：ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ
上場取引所：NYSEアーカ取引所

分配方針

原則として、年1回(毎年12月15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、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します。ただし、分配対象額が少額の場合などには、分配を行わないことがあります。

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。

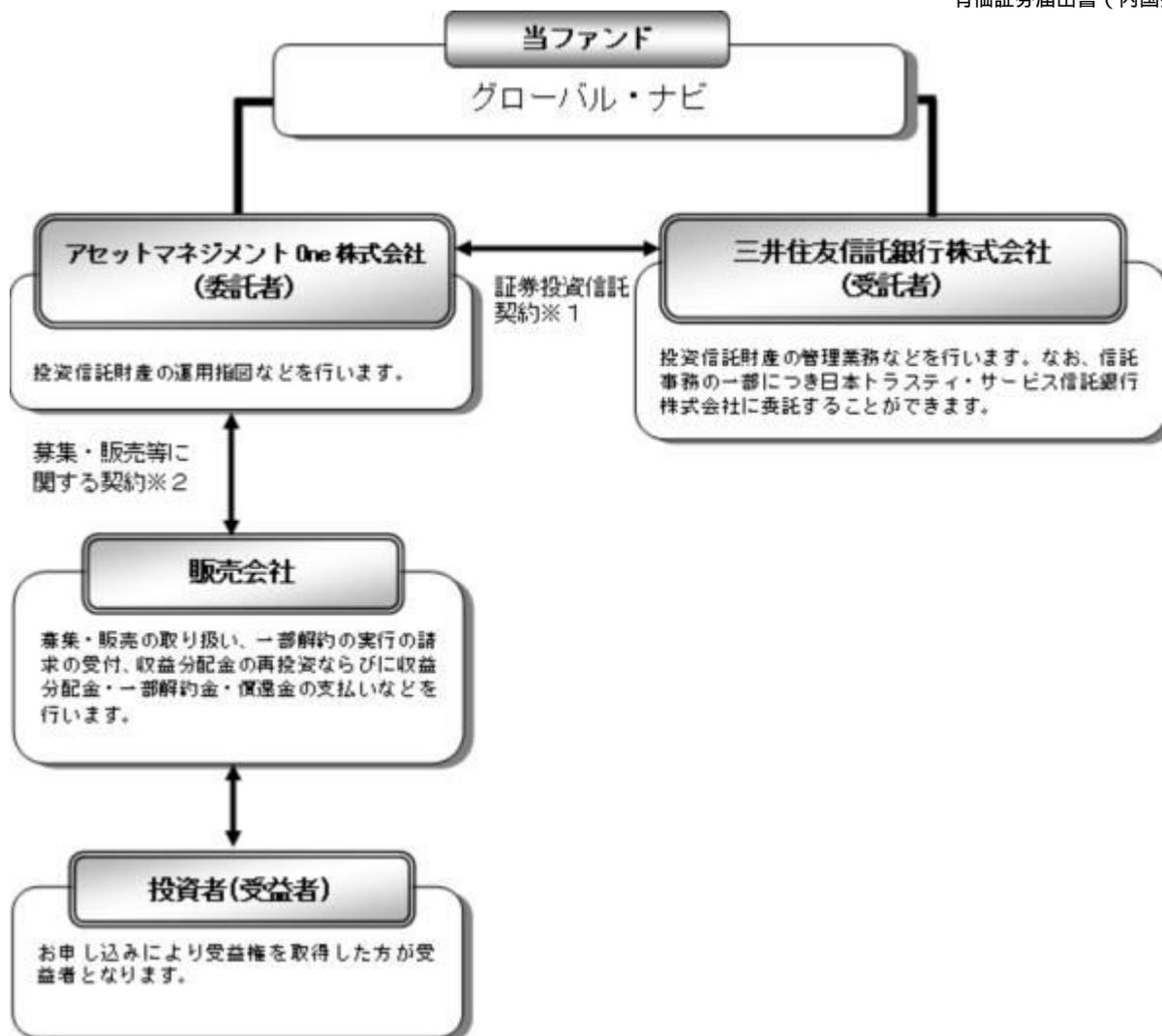
将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

(2)【ファンドの沿革】

2014年1月6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。

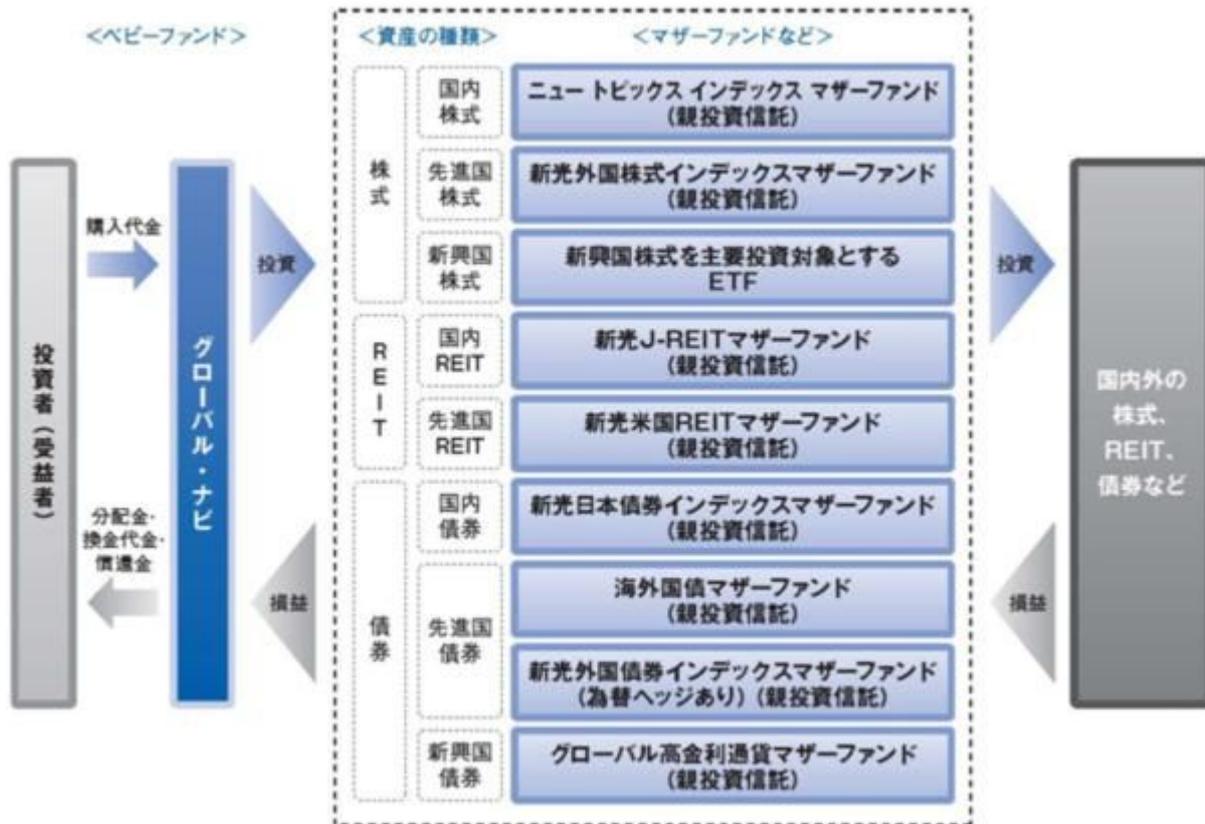
2 募集・販売等に関する契約

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。

当ファンドの運用は「ファミリーファンド方式」で行います。

「ファミリーファンド方式」とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をベビーファンド（当ファンド）としてとりまとめ、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行う仕組みです。マザーファンドの損益はベビーファンドに反映されます。

新興国株式については、ベビーファンド（当ファンド）から直接ETFに投資を行います。



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（2019年6月28日現在）

委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得 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 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。
1998年12月1日	
1999年10月1日	
2008年1月1日	
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

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

1：A種種類株式(15,510株)を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

a. 基本方針

当ファンドは、安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。

b. 運用の方法

(イ) 主要投資対象

ニュー トピックス インデックス マザーファンド受益証券、新光外国株式インデックス マザーファンド受益証券、新光日本債券インデックスマザーファンド受益証券、海外国債マザーファンド受益証券、新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり) 受益証券、グローバル高金利通貨マザーファンド受益証券、新光J-REITマザーファンド受益証券、新光米国REITマザーファンド受益証券、および新興国株式を主要投資対象とする上場投資信託証券(以下「新興国株ETF」といいます。)を主要投資対象とします。

(ロ) 投資態度

主としてマザーファンド受益証券、および新興国株ETFに投資することにより、実質的にわが国および海外の株式、債券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成長を目指して運用を行います。投資対象のマザーファンド、および上場投資信託証券は以下の通りとします。

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)	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)	海外国債マザーファンド受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり) 受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	グローバル高金利通貨マザーファンド受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	新光J-REITマザーファンド受益証券
内国証券投資信託(親投資信託)	新光米国REITマザーファンド受益証券
新興国株ETF	

新興国株ETFについては、規模、流動性、ベンチマーク指数等を総合的に判断して、銘柄を決定します。

各マザーファンド受益証券、および上場投資信託証券等への投資比率は、世界経済、金融市場の動向等を勘案して機動的に変更します。

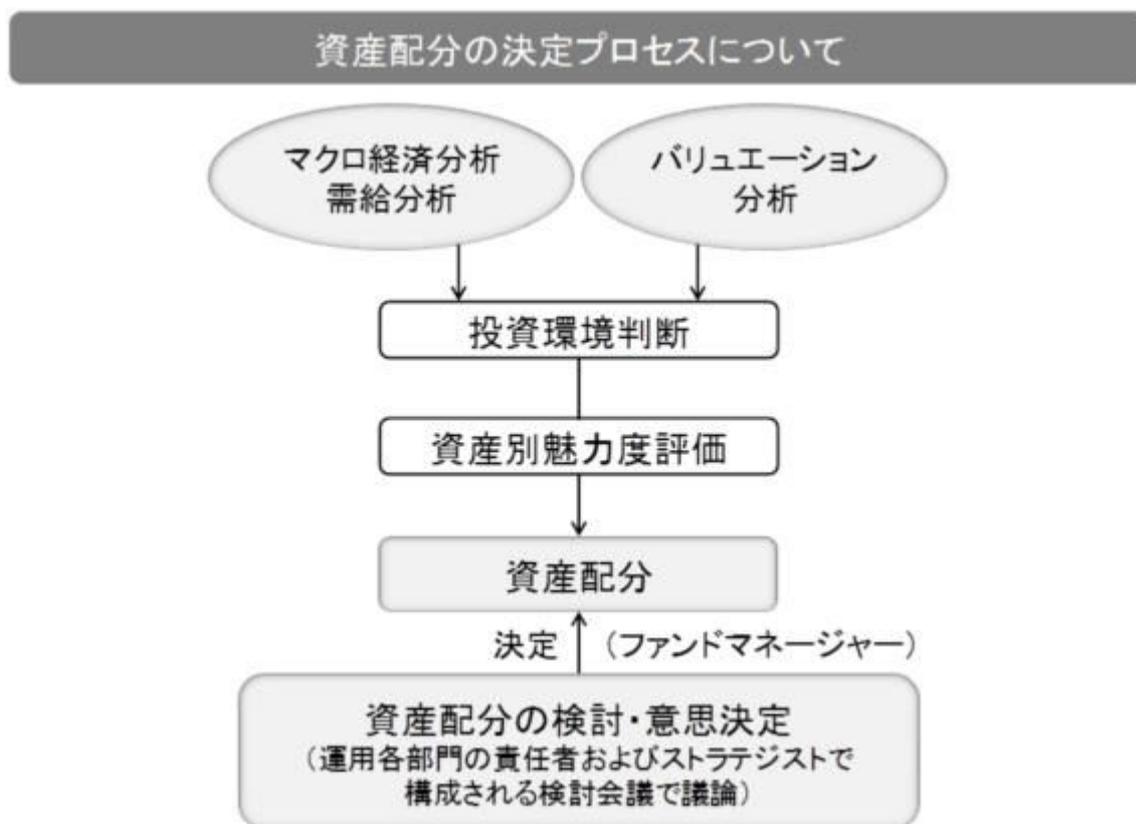
各マザーファンド受益証券と上場投資信託証券を合算した投資比率は、原則として高位を保ちますが、市場環境等を勘案して、投資比率を引き下げることがあります。

効率的な運用を行うことを目的として、株価指数先物取引、国債先物取引等を利用することがあります。

当ファンドの資金動向、市況動向等によっては、また、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。

運用プロセス

当ファンドは、以下のプロセスにより、投資信託証券への投資を通じて、国内外の株式、債券およびREITへの投資を行います。



運用プロセスは2019年6月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

各マザーファンドの運用方針

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

1. 基本方針

この投資信託は、東証株価指数に連動する投資成果をめざした運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を投資対象とします。

(2) 投資態度

投資成果を東証株価指数の動きにできるだけ連動させるため、原則として東京証券取引

所における業種別、銘柄別時価構成比を勘案しながら当社独自のポートフォリオ構築モデルにしたがい、約200銘柄以上の株式に分散投資を行います。

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

株式の組入比率は、高位を保ちます。

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、有価証券先物取引等を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、スワップ取引を行うことができます。

株式以外の資産への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。ただし、市況動向に急激な変化が生じたときならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

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

3. 収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

運用プロセス

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

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2019年6月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

新光外国株式インデックスマザーファンド**1. 基本方針**

この投資信託は、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。

2. 運用方法**(1) 投資対象**

日本を除く世界主要先進国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として日本を除く世界主要先進国の株式に投資し、MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

株式の組入比率については、原則として高位を保ちます。

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。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

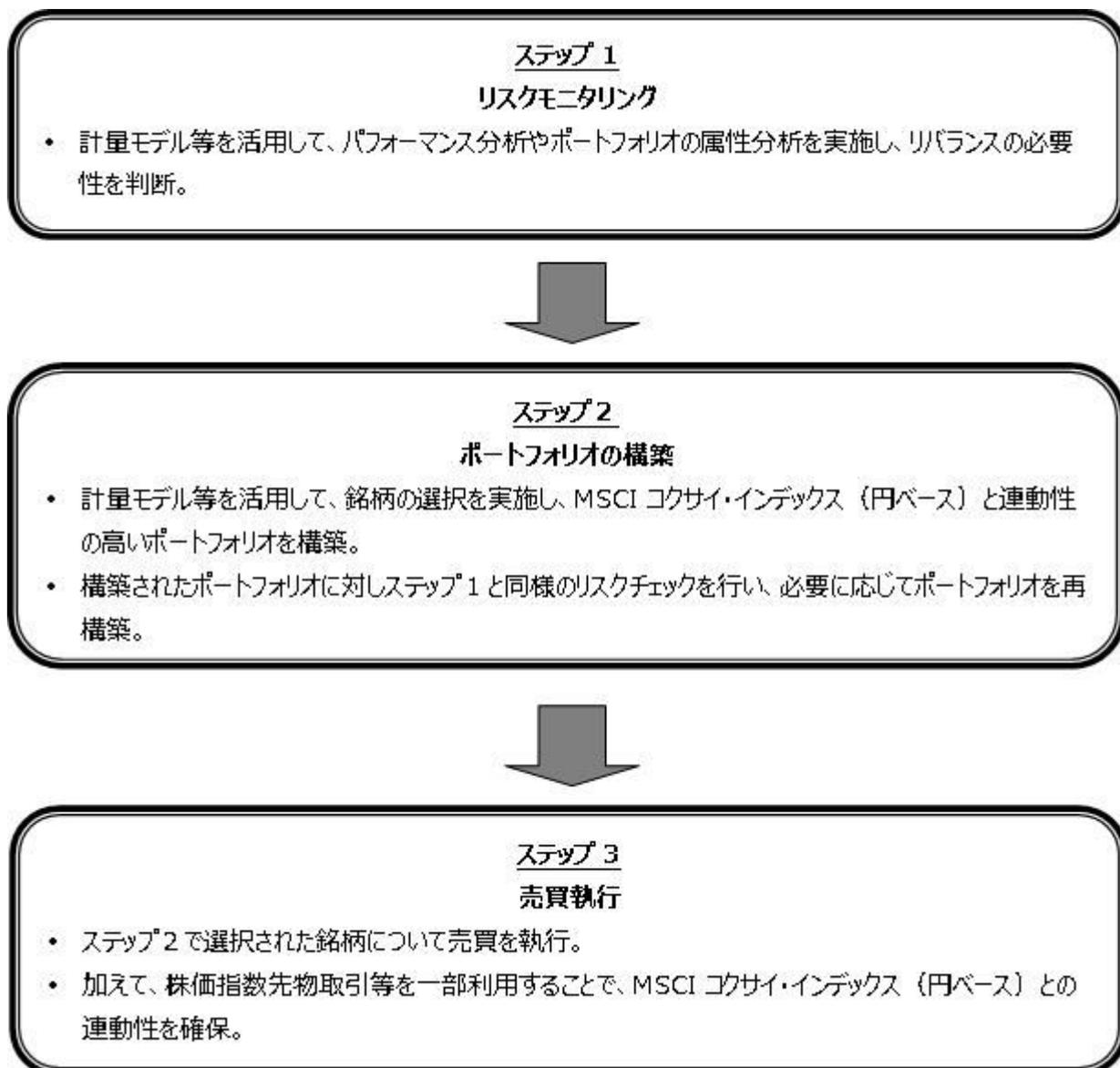
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3. 収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

運用プロセス

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。



なお、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

運用プロセスは2019年6月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

新光日本債券インデックスマザーファンド

1. 基本方針

この投資信託は、NOMURA - BPI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。

2. 運用方針

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA - BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

公社債の組入比率については、原則として高位を保ちます。

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。

(3) 投資制限

株式への投資割合は、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す。）の行使により取得したものに限り、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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5%以下とします。

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

外貨建資産への投資は行いません。

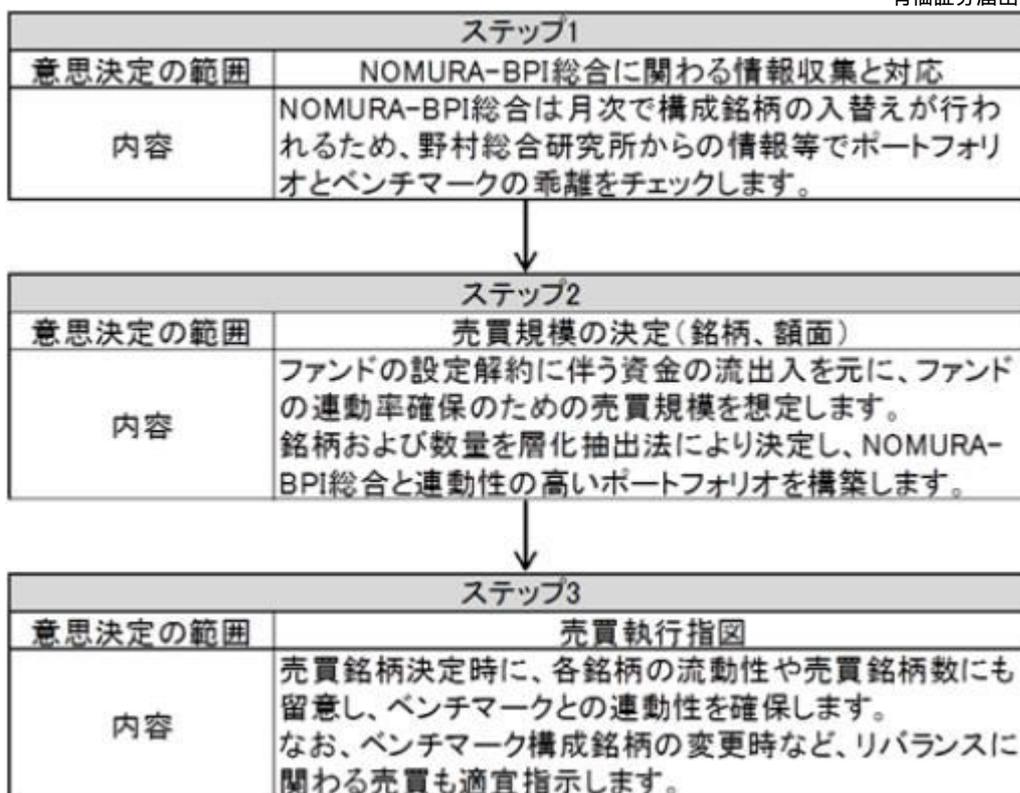
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3. 収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

運用プロセス

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-BPI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2019年6月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

海外国債マザーファンド

1. 基本方針

この投資信託は、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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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。

(2) 投資態度

FTSE世界国債インデックス（除く日本、7～10年、円ベース）をベンチマークとして、インデックスを上回る投資成果を目指す運用を行います。

債券ポートフォリオは、日本を除くG7構成国（アメリカ、イタリア、ドイツ、フランス、イギリス、カナダの6カ国）が発行する国債、政府機関債を中心に投資します。

運用にあたっては、主として以下の運用手法を用います。

(イ) 超過収益獲得の観点から

- ・通貨アロケーション： 投資環境判断に基づいて、通貨圏毎にオーバーウエイトやアンダーウエイトを行うこと。
- ・イールドカーブ戦略： 市場別のイールドカーブの形状予測に基づいて、ポートフォリオの構成を変化させること。

- ・セクターアロケーション： ある公社債と同等の格付けがありながら上乗せ金利のある他の公社債へ投資すること。アメリカを中心に、国債と格付けが同等で上乗せ金利のある政府機関債へ投資します。

(ロ) リスク管理の観点から

- ・デュレーション調整： ポートフォリオ全体のデュレーションを、ベンチマークのそれに近似させること。

外貨建資産については、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。

(3) 投資制限

株式への投資割合は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使により取得したものに限り、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には特に制限を設けません。

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

3. 収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

運用プロセス

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2019年6月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

1. 基本方針

この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・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ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

日本を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として日本を除く世界主要国の公社債に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。

公社債の組入比率については、原則として高位を保ちます。

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

(3) 投資制限

株式への投資割合は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使により取得したものに限り、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内と

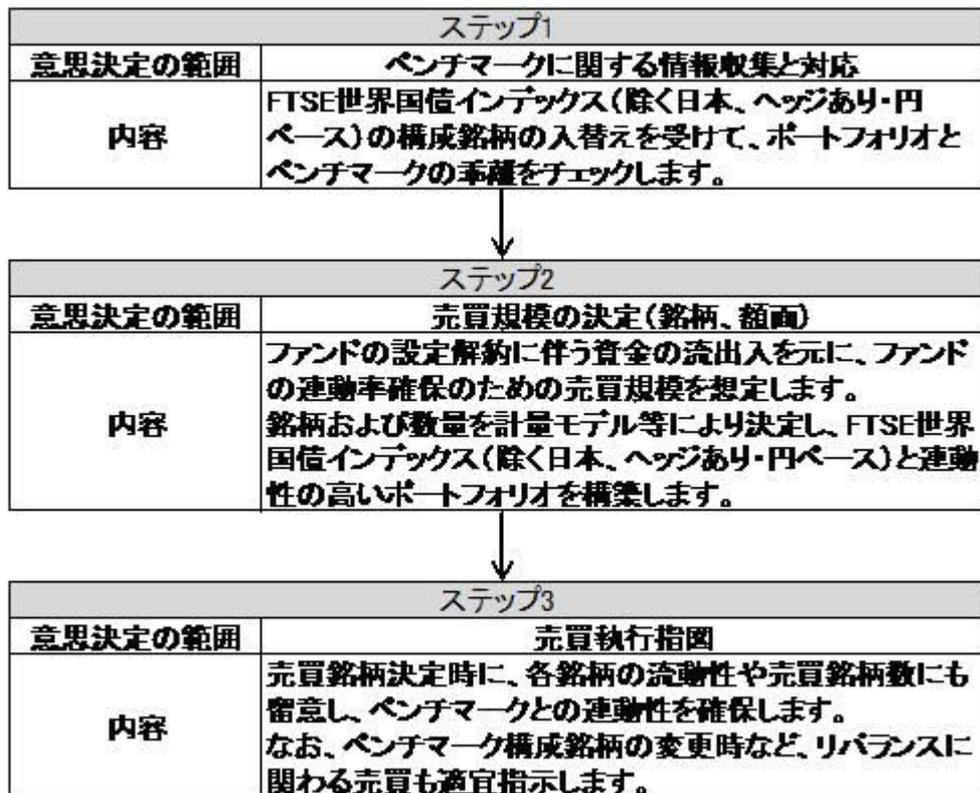
なるよう調整を行うこととします。

3. 収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

運用プロセス

新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）は、以下のプロセスにより「FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・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。



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2019年6月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

グローバル高金利通貨マザーファンド

1. 基本方針

この投資信託は、安定した収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

世界各国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

新興国を中心とする世界の国の中から主として地域分散と金利水準の観点により複数の通貨を選定し、当該通貨建ての国際機関債や政府機関債、州政府債を中心とする信用力の高い公社債に分散投資を行い、安定した収益の確保と投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

通貨配分は、北米・中南米、欧州、アジア・オセアニア、中東・アフリカの4地域についてそれぞれ25%程度とすることを基本とします。ただし、流動性の低下、市場規模

の縮小、通貨制度の変更等により、各地域に対する通貨配分比率を25%程度とできない場合があります。

各地域内における通貨配分は、金利水準や金利・為替動向、流動性等を勘案して決定します。

投資対象とする公社債は、取得時において、スタンダード・アンド・プアーズ社およびムーディーズ社のいずれかよりAA/Aa2格以上の信用格付けを付与されているものとします。

組入公社債の平均残存期間は、1～3年程度とします。

公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

ファンドの資金動向、市況動向等によっては、また、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使により取得したものに限り、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

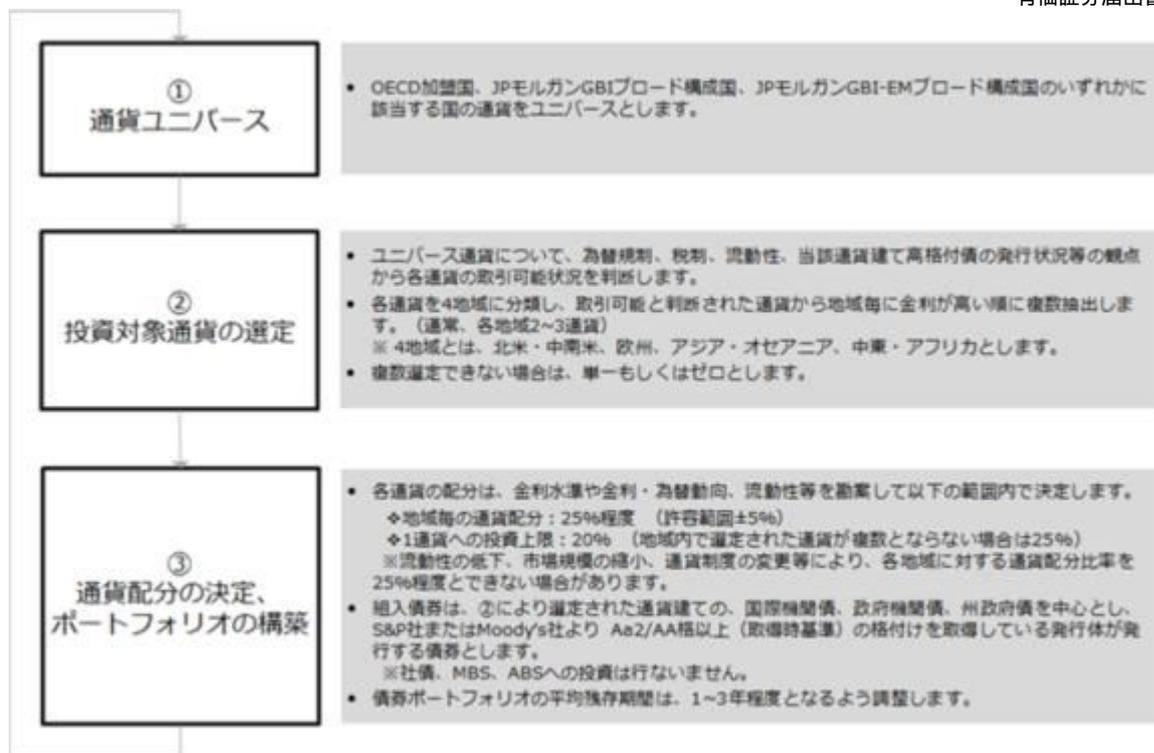
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3. 収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

運用プロセス

グローバル高金利通貨マザーファンドは、以下のプロセスにより新興国を中心とする世界の高金利通貨建債券に分散投資を行います。



※ 市場暴落時や、各国による通貨規制の強化等により特定地域において投資対象通貨が存在しなくなった場合などには、先進国通貨建ての信用力の高い債券に投資する場合があります。

運用プロセスは2019年6月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

新光J - R E I T マザーファンド

1. 基本方針

この投資信託は、東証R E I T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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託受益証券および不動産投資法人投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として東証R E I T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R E I T指数（配当込み）に連動する投資成果を目指した運用を行います。

不動産投資信託証券の組入比率は原則として高位を保ちます。

大量の追加設定・解約が発生した場合、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等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

不動産投資信託証券、新投資口予約権証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外には投資を行いません。

不動産投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の不動産投資信託証券の投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、東証R E I T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入れることができるものとします。

外貨建資産への投資は行いません。

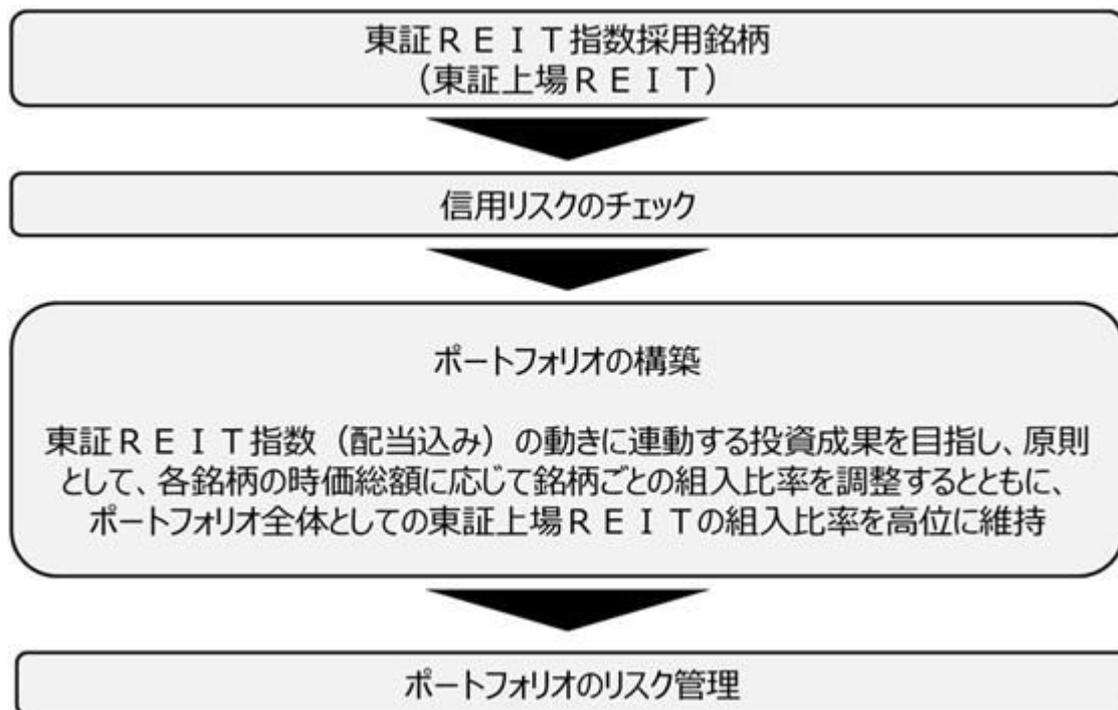
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3. 収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

運用プロセス

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



1. 原則として、東証REIT指数採用銘柄をすべてポートフォリオに組み入れます。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）の動きと当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2019年6月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

新光米国REITマザーファンド

1. 基本方針

この投資信託は、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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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。)を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として米国の取引所上場および店頭市場登録のREITに投資を行うことにより、円換算したFTSE NAREIT All Equity REITs インデックスの動きを概ね捉える投資成果を目指した運用を行います。

REITの組入比率については、原則として高位を保ちます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

大量の追加設定・解約が発生した場合、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等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

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

REITへの投資割合には制限を設けません。

同一銘柄のREITへの投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスにおける時価総額構成割合が30%を上回る銘柄については、当該構成割合以内の率を上限として投資できるものとします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

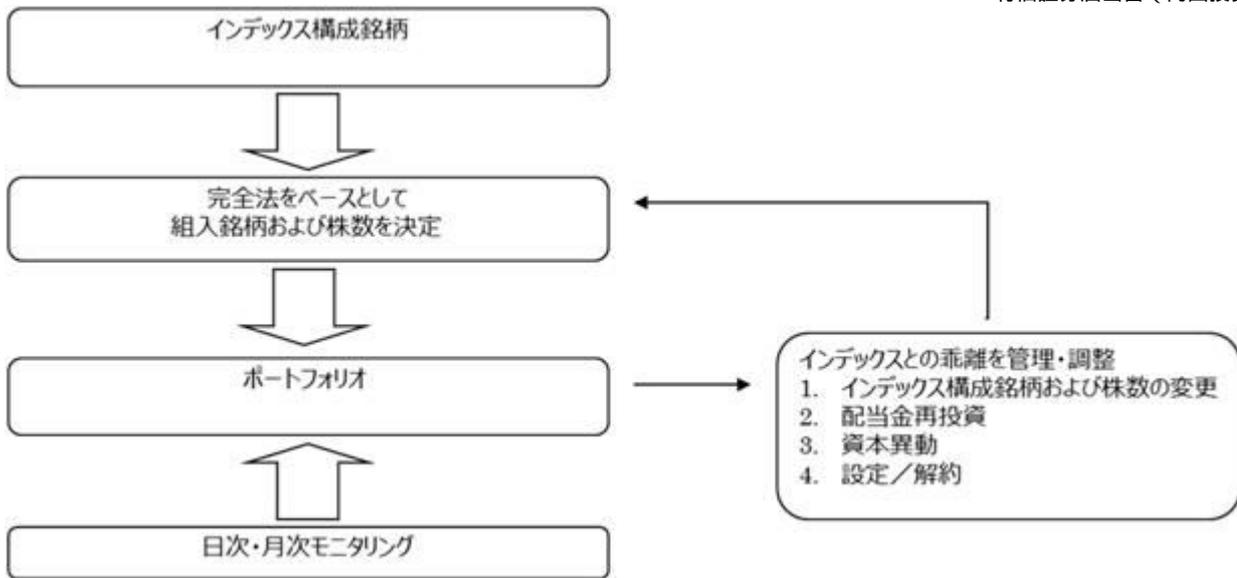
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしがたい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3. 収益分配方針

運用による収益は、信託終了時まで投資信託財産中に留保し、期中には分配を行いません。

運用プロセス

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2019年6月28日現在のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

(2) 【投資対象】

a. 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. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款に定めるものに限りません。）

ハ. 金銭債権

ニ. 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. 有価証券および金融商品の指図範囲等

(イ) 委託者は、信託金を、主として第1号から第8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（以下第1号から第8号までの親投資信託を総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに第9号から第29号までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 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
2. 新光外国株式インデックスマザーファンド受益証券
3. 新光日本債券インデックスマザーファンド受益証券
4. 海外国債マザーファンド受益証券
5. 新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）受益証券
6. グローバル高金利通貨マザーファンド受益証券
7. 新光J-REITマザーファンド受益証券
8. 新光米国REITマザーファンド受益証券
9. 株券または新株引受権証書
10. 国債証券

11. 地方債証券
12. 特別の法律により法人の発行する債券
13. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
14. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
15. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
16. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
17. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
18. コマーシャル・ペーパー
19. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
20. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第9号から第19号までの証券または証書の性質を有するもの
21. 投資信託または外国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。)
22. 投資証券、新投資口予約権証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
23. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
24. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。)
25. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
26. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
27. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
28. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
29. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第25号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、第9号の証券または証書、第20号、第25号ならびに第26号の証券または証書のうち第9号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第10号から第14号までの証券および第22号の証券のうち投資法人債券ならびに第20号、第25号および第26号の証券または証書のうち第10号から第14号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第21号および第22号の証券(新投資口予約権証券および投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

(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
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

(ハ) 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には、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。

c. 先物

(イ) 委託者は、わが国の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)。

(ロ) 委託者は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

(ハ) 委託者は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

d. スワップ

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

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

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

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

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

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

e. 金利先渡取引および為替先渡取引

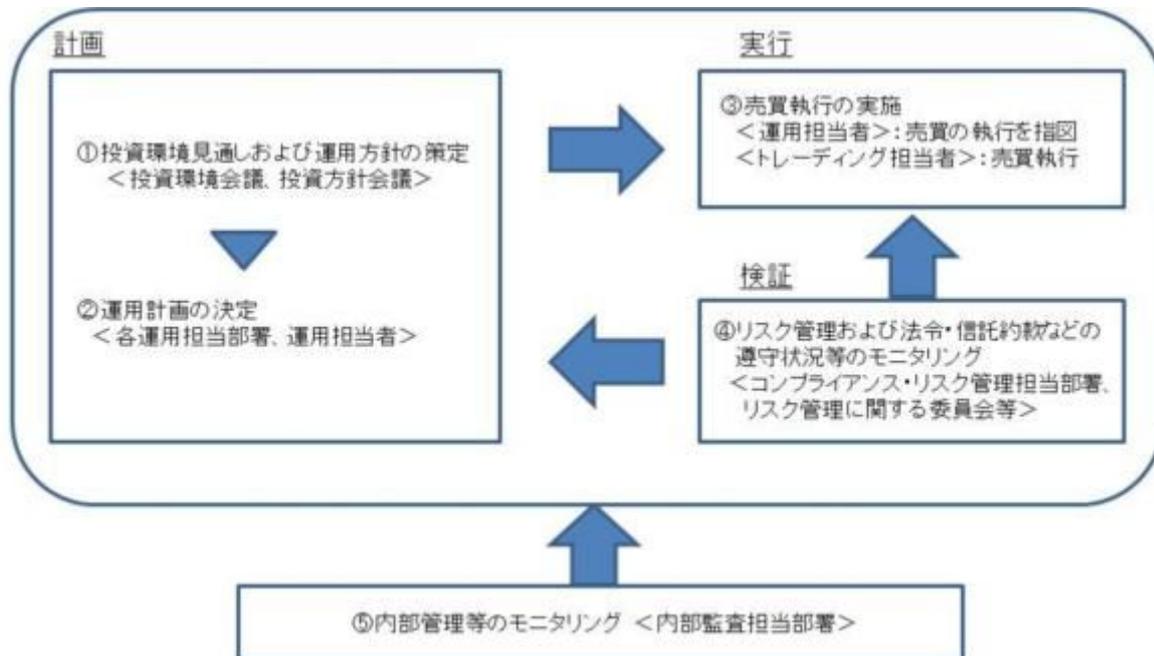
(イ) 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

- (ロ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、投資信託財産にかかる保有金利商品の時価総額とマザーファンドの投資信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が当該保有金利商品の時価総額の合計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金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、投資信託財産にかかる保有外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。))、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の時価総額とマザーファンドの投資信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、投資信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が当該保有外貨建資産の時価総額の合計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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ホ) 上記(ハ)(ニ)においてマザーファンドの投資信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの投資信託財産にかかる保有金利商品および保有外貨建資産の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの投資信託財産にかかる保有金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ヘ) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- (ト) 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受け入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受け入れの指図を行うものとします。
- f. 直物為替先渡取引
- (イ) 委託者は、投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 直物為替先渡取引の評価は、金融商品取引業者または銀行等が提示する価額もしくは価格情報会社の提供する価額で評価するものとします。

（二）委託者は、直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

（３）【運用体制】

a．ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b．ファンドの関係法人に関する管理

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

c．運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2019年6月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4)【分配方針】

- a．収益分配は年1回、原則として、12月15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、基準価額水準や市況動向などを勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合などには、分配を行わないことがあります。
 - 3．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．配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 - 2．売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- c．毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。
- d．「分配金受取コース」の受益者の分配金は原則として、決算日から起算して5営業日までに、受益者に支払われます。
- 「分配金再投資コース」の受益者の分配金は、税金を差し引いた後、別に定める契約に基づき、全額再投資されます。

(5)【投資制限】

投資信託約款に定める投資制限

a．株式等への投資割合

株式および上場投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。

b．新株引受権証券等への投資割合

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

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

c．投資信託証券への投資割合

委託者は、投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、当該投資信託証券のうち取引所金融商品市場（金融商品取引法第2条第17項に規定する金融商品市場をいいます。）または外国市場に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券の時価総額については、合計額の計算においてこれを算入しません。

d．同一銘柄への投資割合

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

(ロ) 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の上場投資信託証券の時価総額が、当該上場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。

(ハ) 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

(ニ) 委託者は、投資信託財産に属する同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

e．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。

f．投資する株式等の範囲

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

(ロ) 上記(イ)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

g．信用取引の指図範囲

- (イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
- 1．投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - 2．株式分割により取得する株券
 - 3．有償増資により取得する株券
 - 4．売出しにより取得する株券
 - 5．投資信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。以下同じ。）の新株予約権に限りません。）の行使により取得可能な株券
 - 6．投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

h．有価証券の貸し付けの指図および範囲

- (イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けの指図をすることができます。
- 1．株式の貸し付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - 2．公社債の貸し付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者はすみやかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託者は、有価証券の貸し付けにあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

i．公社債の空売りの指図範囲

- (イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算においてする投資信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（投資信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 売り付けの指図は、当該売り付け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で行うものとします。
- (ハ) 投資信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売り付け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売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

j．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) 借入れの指図は、当該借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。
- k. 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- l. 外国為替予約の指図および範囲
- (イ) 委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図することができます。
- (ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、投資信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、投資信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの投資信託財産に属する外貨建資産のうち投資信託財産に属するとみなした額(投資信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの投資信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- m. 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償還金の入金日までの間、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。
- n. 利害関係人等との取引等
- (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、投資信託財産と、受託者(第三者との間において投資信託財産のためにする取引その

他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となつて行うものを含みます。)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、約款に掲げる資産への投資等ならびに約款に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。

(ロ) 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。

(ハ) 委託者は、金融商品取引法、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、投資信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等(金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。)または委託者が運用の指図を行う他の投資信託財産との間で、約款に掲げる資産への投資等ならびに約款に掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行うことができます。

(ニ) 上記(イ)(ロ)(ハ)の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行いません。

o. 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。

p. 信用リスク集中回避のための投資制限

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

法令に定める投資制限

a. 同一の法人の発行する株式

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

(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

3【投資リスク】

(1) ファンドのもつリスク

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

a. 資産配分リスク

資産配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数または全ての資産の価値が同時に下落した場合等は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドの実質資産配分において、配分比率が大きい資産の収益率が低下した場合や、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その影響を受け、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

b. 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

株式の価格は、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変動します。一般に、株価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

REITの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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REITの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

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

外貨建資産は、為替相場の変動により円換算価格が変動します。一般に、保有外貨建資産が現地通貨ベースで値上がりした場合でも、投資先の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が下落し、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

また、当ファンドは新興国通貨建証券にも実質的に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。

当ファンドが投資対象とする「新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)」では、保有する外貨建資産について原則として為替ヘッジを行います。為替変動リスクを完全に排除できるものではなく、円と投資先の通貨の為替変動の影響を受ける場合があります。為替ヘッジを行うにあたり、円金利が当該通貨の金利より低い場合には、その金利差相当分のコストがかかります。

e. カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

金利の上昇(公社債の価格の下落)は、基準価額の下落要因となります。

公社債の価格は、金利水準の変化にともない変動します。一般に、金利が上昇した場合には公社債の価格は下落し、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

投資する有価証券の発行者の財政難・経営不安・倒産等の発生は、基準価額の下落要因となります。

有価証券などの発行体が業績悪化・経営不振あるいは倒産に陥った場合、当該有価証券の価値が大きく減少すること、もしくは無くなる場合があります。また、有価証券の信用力の低下や格付けの引き下げ、債務不履行が生じた場合には、当該有価証券の価格は下落します。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

投資資産の市場規模が小さいことなどで希望する価格で売買できない場合は、基準価額の下落要因となります。

有価証券などを売買する際、当該有価証券などの市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、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可能性があります。特に流動性の低い有価証券などを売却する場合にはその影響を受け、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

i. 他のベビーファンドの影響

当ファンドが投資対象とするマザーファンドを同じく投資対象としている他のファンド（ベビーファンド）において、設定・解約や資産構成の変更などによりマザーファンドの組入有価証券などに売買が生じた場合、その売買による組入有価証券などの価格の変化や売買手数料などの負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。これにより、マザーファンドの基準価額が下落した場合には、その影響を受け当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

j. 投資信託に関する一般的なリスクおよびその他の留意点

- (イ) 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- (ロ) 有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴いません。
- (ハ) 法令や税制が変更される場合に、投資信託を保有する受益者が不利益を被る可能性があります。
- (ニ) 投資信託財産の状況によっては、目指す運用が行われないことがあります。また、投資信託財産の減少の状況によっては、委託者が目的とする運用が困難と判断した場合、安定運用に切り替えることがあります。
- (ホ) 投資した資産の流動性が低下し、当該資産の売却・換金が困難になる場合などがあります。その結果、投資者の換金請求に伴う資金の手当てに支障が生じる場合などには、換金のお申し込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた換金のお申し込みを取り消す場合があります。
- (ヘ) 短期間に相当金額の解約申し込みがあった場合には、解約資金を手当てするために組入有価証券を市場実勢より大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となり、損失を被ることがあります。
- (ト) 証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化もしくは政策の変更などの諸事情により閉鎖されることがあります。これにより当ファンドの運用が影響を被って基準価額の下落につながる可能性があります。
- (チ) 投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

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

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払い戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額

より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

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。

MSCI コクサイ・インデックス（円ベース）について

MSCI コクサイ・インデックスは、MSCI Inc.（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。

NOMURA - BPI総合について

NOMURA - BPI総合とは、野村証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 - BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、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。

FTSE世界国債インデックスについて

FTSE世界国債インデックスは、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。

東証REIT指数（配当込み）について

東証REIT指数（配当込み）は、東京証券取引所に上場している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。

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

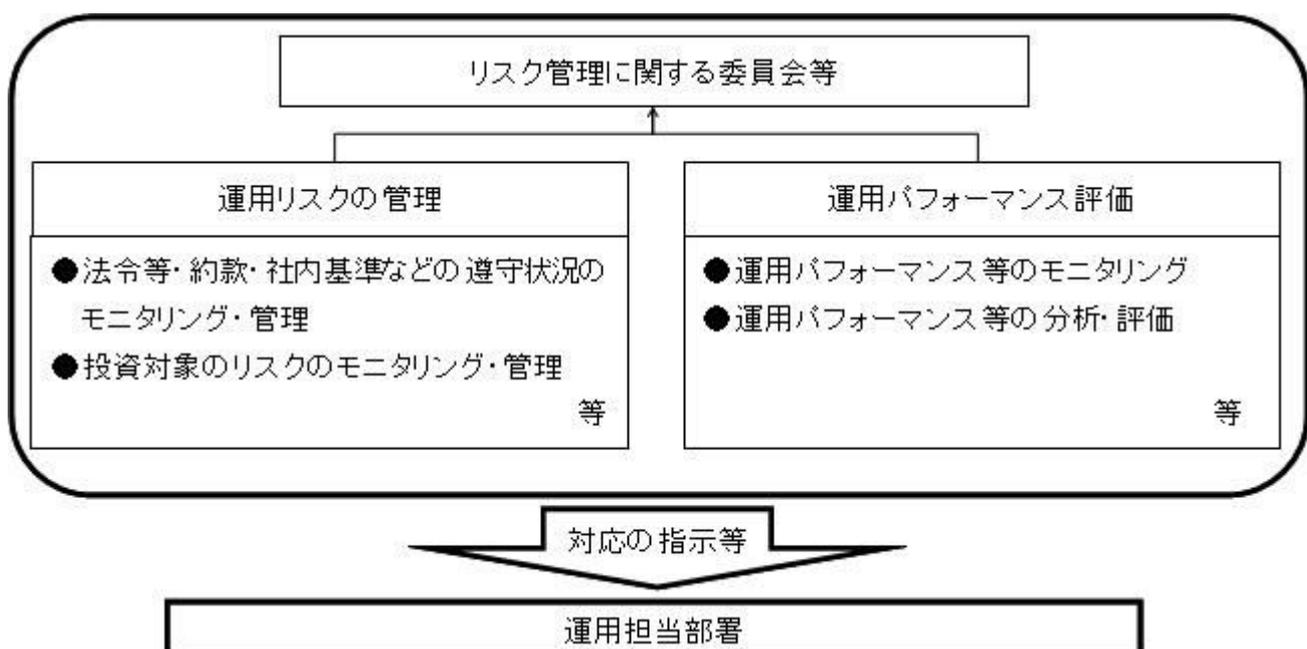
FTSE NAREIT All Equity REITs インデックスとは、ニューヨーク証券取引所、アメリカン証券取引所、NASDAQ登録のすべてのEquity（エクイティ）型REITで構成される総合収益指数であり、FTSE International Limited（以下「FTSE」といいます。）が算出、公表しています。

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

（２）リスク管理体制

委託会社におけるファンドの投資リスクに対する管理体制については、以下のとおりです。

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

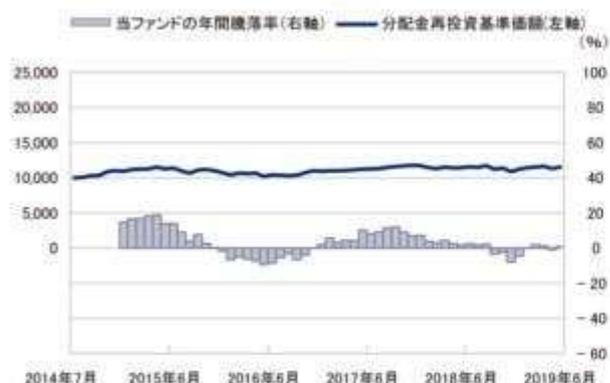


リスク管理体制は2019年6月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

2014年7月末～2019年6月末

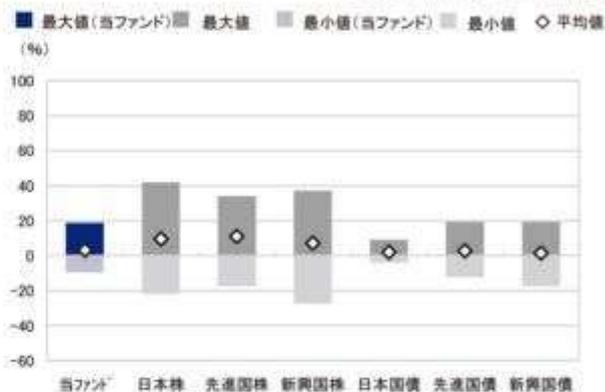


- *分配金再投資基準価額は、2014年7月末の基準価額を10,000として指数化しております。
- *年間騰落率は、2015年1月から2019年6月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

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いますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較

2014年7月末～2019年6月末



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	18.7	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値	△9.5	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	3.2	9.7	11.0	7.3	2.0	2.8	1.4

- *全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- *2014年7月から2019年6月の5年間(当ファンドは2015年1月から2019年6月)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

資産クラス	指数名	説明
日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(現東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、現東京証券取引所が有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額に加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

す。当該手数料には消費税等が含まれます。

* 消費税率が10%になった場合は、2.75%となります。

手数料について、詳しくは販売会社または下記にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

なお、「分配金再投資コース」で収益分配金を再投資する場合は無手数料です。

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

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

1 「償還乗り換え」とは、取得申込受付日前の一定期間内に既に償還となった証券投資信託の償還金等をもって、その支払いを行った販売会社でファンドの受益権を取得する場合はいいです。

2 「償還前乗り換え」とは、償還することが決定している証券投資信託の償還日前の一定期間内において、当該証券投資信託の一部解約金をもって、その支払いを行った販売会社でファンドの受益権を取得する場合はいいです。

（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が信託財産留保額として控除されます。

「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】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.5336%^{*}（税抜1.42%）

* 消費税率が10%になった場合は、年率1.562%となります。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

運用管理費用（信託報酬）は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託報酬にかかる消費税等に相当する金額とともにファンドから支払われます。

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.67%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価

販売会社	年率0.70%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.05%	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

ファンドが投資対象とするETFおよび実質的に投資対象とするREITについては、市場の需給により価格が形成されるため、その費用を表示することができません。

(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。
- b. 投資信託財産にかかる監査報酬は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに、当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額とともに投資信託財産中から支払われます。
- c. 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、先物取引・オプション取引等に要する費用ならびに特定資産の価格調査費用についても投資信託財産が負担します。
- d. 「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。

（八）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、2019年6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】

グローバル・ナビ

(令和 1年 6月28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	アメリカ	10,420,598	5.09
親投資信託受益証券	日本	183,879,801	89.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		10,129,509	4.95
純資産総額		204,429,908	100.00

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

(参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(令和 1年 6月28日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	5,806,200,630	96.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		216,831,152	3.60
純資産総額		6,023,031,782	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

(令和 1年 6月28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	2,757,742,599	59.42
	カナダ	164,525,009	3.54
	モーリシャス	400,153	0.00
	パナマ	2,484,758	0.05
	ドイツ	139,865,380	3.01
	イタリア	30,107,921	0.64
	フランス	165,118,207	3.55
	オランダ	78,699,787	1.69
	スペイン	48,061,417	1.03
	ベルギー	13,846,673	0.29
	オーストリア	3,694,057	0.07
	ルクセンブルグ	5,078,758	0.10
	フィンランド	18,945,417	0.40
	アイルランド	79,907,551	1.72
	ポルトガル	2,422,926	0.05
	イギリス	268,384,199	5.78
	スイス	163,072,122	3.51
	スウェーデン	41,854,029	0.90
	ノルウェー	10,977,421	0.23
	デンマーク	27,593,267	0.59
	ケイマン諸島	11,284,399	0.24
	リベリア	2,389,834	0.05
	オーストラリア	107,840,878	2.32
	バミューダ諸島	21,387,639	0.46
	ニュージーランド	4,504,580	0.09
	パプアニューギニア	470,152	0.01
	香港	44,173,419	0.95
	シンガポール	20,391,999	0.43
	イスラエル	7,299,903	0.15
	キュラソー	6,167,521	0.13
	ジャージー	14,421,353	0.31
	英ヴァージン諸島	656,010	0.01
	小計	4,263,769,338	91.88
投資証券	アメリカ	95,381,839	2.05
	カナダ	1,477,227	0.03
	フランス	5,605,650	0.12
	イギリス	2,096,252	0.04
	オーストラリア	5,420,683	0.11
	香港	3,508,771	0.07
	シンガポール	2,865,455	0.06
		小計	116,355,877

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		260,270,121	5.60
純資産総額		4,640,395,336	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

(令和 1年 6月28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	9,682,993,000	79.36
地方債証券	日本	988,708,400	8.10
特殊債券	日本	840,340,000	6.88
社債券	日本	516,670,000	4.23
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		172,070,626	1.41
純資産総額		12,200,782,026	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

(令和 1年 6月28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	9,008,387,582	47.91
	カナダ	453,875,410	2.41
	ドイツ	2,001,523,224	10.64
	イタリア	2,141,272,188	11.39
	フランス	3,554,498,113	18.90
	イギリス	1,291,074,054	6.86
	小計	18,450,630,571	98.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		348,494,789	1.85
純資産総額		18,799,125,360	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) 新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

(令和 1年 6月28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	2,894,147,229	44.08
	カナダ	112,974,798	1.72
	メキシコ	44,276,831	0.67

ドイツ	410,749,192	6.25
イタリア	574,089,525	8.74
フランス	605,660,871	9.22
オランダ	124,660,646	1.89
スペイン	364,544,754	5.55
ベルギー	170,482,195	2.59
オーストリア	93,081,867	1.41
フィンランド	36,187,588	0.55
アイルランド	54,421,940	0.82
イギリス	403,427,165	6.14
スウェーデン	19,592,239	0.29
ノルウェー	17,647,586	0.26
デンマーク	26,485,641	0.40
ポーランド	38,143,834	0.58
オーストラリア	126,700,332	1.93
シンガポール	23,865,163	0.36
南アフリカ	32,905,822	0.50
小計	6,174,045,218	94.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	390,469,733	5.94
純資産総額	6,564,514,951	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) グローバル高金利通貨マザーファンド

(令和 1年 6月28日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
特殊債券	国際機関	4,715,094,003	95.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		238,724,217	4.81
純資産総額		4,953,818,220	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

(令和 1年 6月28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	2,411,944,550	98.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		39,972,449	1.63
純資産総額		2,451,916,999	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

(令和1年6月28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	681,137,666	99.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,182,132	0.75
純資産総額		686,319,798	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】

グローバル・ナビ

イ.評価額上位銘柄明細

(令和1年6月28日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	ニュー トピックス インデック ス マザーファンド	19,768,186	2.0918	41,351,092	2.0681	40,882,585	19.99
2	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	12,699,221	2.2281	28,295,135	2.4243	30,786,721	15.05
3	日本	親投資信託 受益証券	海外国債マザーファンド	13,349,270	2.2590	30,156,606	2.3004	30,708,660	15.02
4	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	23,469,286	1.2857	30,176,604	1.3039	30,601,602	14.96
5	日本	親投資信託 受益証券	新光外国債券インデックスマザー ファンド(為替ヘッジあり)	14,524,950	1.3419	19,491,540	1.4092	20,468,559	10.01
6	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING MARKETS ETF	1,875	5,202.36	9,754,433	5,557.6522	10,420,598	5.09
7	日本	親投資信託 受益証券	グローバル高金利通貨マザーファ ンド	9,256,278	1.0933	10,119,889	1.1155	10,325,378	5.05
8	日本	親投資信託 受益証券	新光J-REITマザーファンド	5,208,762	1.7929	9,338,790	1.9529	10,172,191	4.97
9	日本	親投資信託 受益証券	新光米国REITマザーファンド	5,582,840	1.6844	9,403,736	1.7794	9,934,105	4.85

(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、令和1年6月28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

(令和1年6月28日現在)

種類	投資比率(%)
----	---------

投資信託受益証券	5.09
親投資信託受益証券	89.94
合計	95.04

(参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

(令和 1年 6月28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	29,200	6,821.00	199,173,200	6,688.00	195,289,600	3.24
2	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	21,500	3,849.00	82,753,500	5,165.00	111,047,500	1.84
3	日本	株式	ソニー	電気機器	17,600	5,316.55	93,571,280	5,648.00	99,404,800	1.65
4	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	178,000	564.58	100,495,240	512.00	91,136,000	1.51
5	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	17,600	4,585.35	80,702,160	5,017.00	88,299,200	1.46
6	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	22,900	4,468.53	102,329,337	3,823.00	87,546,700	1.45
7	日本	株式	キーエンス	電気機器	1,300	53,560.00	69,628,000	66,130.00	85,969,000	1.42
8	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	18,200	3,818.00	69,487,600	3,806.00	69,269,200	1.15
9	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	17,900	2,852.00	51,050,800	3,594.00	64,332,600	1.06
10	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	22,100	3,170.00	70,057,000	2,785.00	61,548,500	1.02
11	日本	株式	任天堂	その他製品	1,500	30,330.00	45,495,000	39,490.00	59,235,000	0.98
12	日本	株式	KDDI	情報・通信業	21,100	2,663.72	56,204,492	2,743.50	57,887,850	0.96
13	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	351,400	174.09	61,175,226	156.10	54,853,540	0.91
14	日本	株式	花王	化学	6,400	7,475.00	47,840,000	8,210.00	52,544,000	0.87
15	日本	株式	三菱商事	卸売業	18,100	3,091.00	55,947,100	2,840.00	51,404,000	0.85
16	日本	株式	ダイキン工業	機械	3,600	12,150.00	43,740,000	14,065.00	50,634,000	0.84
17	日本	株式	ファナック	電気機器	2,500	17,185.00	42,962,500	19,930.00	49,825,000	0.82
18	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	9,200	5,185.00	47,702,000	5,399.00	49,670,800	0.82
19	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	2,300	23,790.00	54,717,000	21,580.00	49,634,000	0.82
20	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	4,700	9,945.00	46,741,500	10,080.00	47,376,000	0.78
21	日本	株式	日本電産	電気機器	3,200	12,290.00	39,328,000	14,725.00	47,120,000	0.78
22	日本	株式	日立製作所	電気機器	11,800	3,346.00	39,482,800	3,949.00	46,598,200	0.77
23	日本	株式	信越化学工業	化学	4,500	8,610.00	38,745,000	10,035.00	45,157,500	0.74
24	日本	株式	キヤノン	電気機器	14,100	3,059.00	43,131,900	3,146.00	44,358,600	0.73
25	日本	株式	HOYA	精密機器	5,300	6,412.00	33,983,600	8,254.00	43,746,200	0.72
26	日本	株式	第一三共	医薬品	7,500	3,632.00	27,240,000	5,635.00	42,262,500	0.70
27	日本	株式	資生堂	化学	5,200	6,103.14	31,736,328	8,121.00	42,229,200	0.70
28	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	16,300	2,575.00	41,972,500	2,512.50	40,953,750	0.67
29	日本	株式	村田製作所	電気機器	8,300	4,470.38	37,104,154	4,840.00	40,172,000	0.66
30	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	3,000	11,100.00	33,300,000	13,340.00	40,020,000	0.66

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

ロ.種類別及び業種別の投資比率

(令和1年6月28日現在)

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.26
		建設業	2.69
		食料品	3.96
		繊維製品	0.61
		パルプ・紙	0.27
		化学	7.14
		医薬品	5.31
		石油・石炭製品	0.59
		ゴム製品	0.75
		ガラス・土石製品	0.84
		鉄鋼	0.87
		非鉄金属	0.74
		金属製品	0.54
		機械	5.02
		電気機器	13.13
		輸送用機器	7.57
		精密機器	2.05
		その他製品	2.09
		電気・ガス業	1.60
		陸運業	4.58
		海運業	0.15
		空運業	0.52
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	8.53
		卸売業	4.80
		小売業	4.32
		銀行業	5.65
		証券、商品先物取引業	0.72
		保険業	2.21
その他金融業	1.07		
不動産業	2.33		
サービス業	5.06		
合計		96.39	

（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

（令和 1年 6月28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	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	7,807	11,810.55	92,204,967	14,460.0285	112,889,443	2.43
2	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	5,059	22,039.82	111,499,456	21,529.9746	108,920,142	2.34
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	449	184,582.82	82,877,690	205,262.3407	92,162,791	1.98
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	2,561	15,625.23	40,016,236	20,426.2049	52,311,511	1.12
5	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	2,836	15,666.19	44,429,339	15,164.9749	43,007,869	0.92
6	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	3,477	11,995.94	41,709,915	11,731.8636	40,791,690	0.87
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	335	114,920.31	38,498,304	115,983.1194	38,854,345	0.83
8	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	323	116,091.98	37,497,711	116,049.9473	37,484,133	0.80
9	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	4,460	8,716.97	38,877,719	8,172.6378	36,449,965	0.78
10	スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	3,242	9,432.42	30,579,938	11,106.8519	36,008,414	0.77
11	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	1,849	15,514.21	28,685,783	18,456.8815	34,126,774	0.73
12	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	2,721	9,960.87	27,103,538	11,833.1863	32,198,100	0.69
13	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	1,387	23,673.91	32,835,724	22,853.6359	31,697,993	0.68
14	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORPORATION	銀行	9,708	3,074.17	29,844,050	3,040.7558	29,519,658	0.63
15	アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア・娯楽	1,919	12,621.13	24,219,950	15,015.1469	28,814,067	0.62
16	アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	7,957	3,308.07	26,322,353	3,554.9141	28,286,452	0.60
17	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	4,704	5,077.98	23,886,850	6,007.1366	28,257,571	0.60
18	アメリカ	株式	MASTERCARD INCORPORATED	ソフトウェア・サービス	1,001	22,163.78	22,185,944	28,143.9690	28,172,113	0.60
19	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	4,495	6,301.40	28,324,808	6,170.9775	27,738,544	0.59
20	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	2,083	12,881.98	26,833,170	13,270.0268	27,641,466	0.59
21	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	5,901	4,772.94	28,165,126	4,681.3197	27,624,468	0.59
22	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	1,220	20,047.86	24,458,392	22,314.6860	27,223,917	0.58
23	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	1,017	29,809.32	30,316,083	26,552.9882	27,004,389	0.58

24	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	2,757	8,069.15	22,246,672	9,036.0355	24,912,350	0.53
25	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	4,787	5,185.77	24,824,314	5,115.7133	24,488,920	0.52
26	アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	4,367	5,355.00	23,385,317	5,505.9132	24,044,323	0.51
27	アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	596	39,811.15	23,727,451	39,237.7164	23,385,679	0.50
28	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	770	27,761.60	21,376,438	30,213.5974	23,264,470	0.50
29	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	2,319	8,716.71	20,214,060	9,853.2445	22,849,674	0.49
30	アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	4,549	5,717.18	26,007,459	4,989.5990	22,697,686	0.48

(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、令和1年6月28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

(令和1年6月28日現在)

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	5.72
		素材	4.24
		資本財	6.70
		商業・専門サービス	1.19
		運輸	1.80
		自動車・自動車部品	1.04
		耐久消費財・アパレル	1.80
		消費者サービス	1.79
		メディア・娯楽	5.57
		小売	4.60
		食品・生活必需品小売り	1.42
		食品・飲料・タバコ	4.68
		家庭用品・パーソナル用品	1.99
		ヘルスケア機器・サービス	4.50
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.66
		銀行	7.36
		各種金融	4.01
		保険	3.79
		不動産	0.55
		ソフトウェア・サービス	9.07
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.04		

		電気通信サービス	2.22
		公益事業	3.29
		半導体・半導体製造装置	2.73
投資証券			2.50
合計			94.39

(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

(令和 1年 6月28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312回利付 国債(10年)	140,000,000	102.81	143,938,200	102.08	142,923,200	1.2000	2020.12.20	1.17
2	日本	国債証券	第126回利付 国債(5年)	140,000,000	100.51	140,722,400	100.46	140,649,600	0.1000	2020.12.20	1.15
3	日本	国債証券	第338回利付 国債(10年)	130,000,000	103.17	134,122,300	103.83	134,979,000	0.4000	2025.03.20	1.10
4	日本	国債証券	第332回利付 国債(10年)	120,000,000	103.45	124,147,200	103.89	124,668,000	0.6000	2023.12.20	1.02
5	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	120.13	120,130,000	122.17	122,170,000	2.1000	2029.12.28	1.00
6	日本	地方債証券	第18回東京都 公募公債(20 年)	100,000,000	119.97	119,970,000	121.26	121,260,000	2.2200	2029.03.19	0.99
7	日本	国債証券	第128回利付 国債(5年)	120,000,000	100.58	120,703,200	100.63	120,759,600	0.1000	2021.06.20	0.98
8	日本	国債証券	第127回利付 国債(5年)	120,000,000	100.54	120,649,200	100.54	120,651,600	0.1000	2021.03.20	0.98
9	日本	国債証券	第125回利付 国債(5年)	120,000,000	100.44	120,534,000	100.36	120,440,400	0.1000	2020.09.20	0.98
10	日本	国債証券	第340回利付 国債(10年)	110,000,000	102.98	113,285,700	104.17	114,590,300	0.4000	2025.09.20	0.93
11	日本	国債証券	第344回利付 国債(10年)	110,000,000	101.23	111,360,400	102.64	112,913,900	0.1000	2026.09.20	0.92
12	日本	国債証券	第343回利付 国債(10年)	110,000,000	100.79	110,877,800	102.55	112,810,500	0.1000	2026.06.20	0.92
13	日本	国債証券	第310回利付 国債(10年)	110,000,000	102.11	112,327,600	101.46	111,609,300	1.0000	2020.09.20	0.91
14	日本	社債券	第36回東日本 旅客鉄道社債	100,000,000	111.89	111,890,000	111.33	111,330,000	2.1100	2024.12.20	0.91
15	日本	地方債証券	第12回兵庫県 公募公債(15 年)	100,000,000	104.77	104,770,000	107.59	107,590,000	0.7810	2030.12.06	0.88
16	日本	国債証券	第334回利付 国債(10年)	100,000,000	103.73	103,737,000	104.33	104,330,000	0.6000	2024.06.20	0.85
17	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	104.11	104,110,000	103.89	103,890,000	0.8820	2023.06.16	0.85
18	日本	国債証券	第341回利付 国債(10年)	100,000,000	102.31	102,312,000	103.68	103,685,000	0.3000	2025.12.20	0.84
19	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	103.44	103,440,000	103.50	103,500,000	0.6450	2024.03.15	0.84

20	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	102.98	102,980,000	103.41	103,410,000	0.4840	2025.06.30	0.84
21	日本	国債証券	第325回利付国債（10年）	100,000,000	103.50	103,500,000	103.34	103,343,000	0.8000	2022.09.20	0.84
22	日本	社債券	第4回第一三共社債	100,000,000	103.23	103,230,000	103.23	103,230,000	0.8460	2023.09.15	0.84
23	日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	100,000,000	100.13	100,139,000	102.79	102,798,000	0.1000	2028.03.20	0.84
24	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	102.91	102,910,000	102.73	102,730,000	0.7150	2023.03.20	0.84
25	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	103.08	103,080,000	102.66	102,660,000	0.9000	2022.03.14	0.84
26	日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	100,000,000	103.36	103,367,000	102.61	102,612,000	1.3000	2021.03.20	0.84
27	日本	地方債証券	平成24年度第7回広島県公募債	100,000,000	102.83	102,830,000	102.55	102,550,000	0.6700	2023.03.27	0.84
28	日本	地方債証券	平成24年度第2回広島市公募債	100,000,000	102.79	102,790,000	102.47	102,470,000	0.7000	2022.12.22	0.83
29	日本	特殊債券	第327回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100.21	100,210,000	101.90	101,900,000	0.1700	2027.10.29	0.83
30	日本	地方債証券	第783回東京都公募債	100,000,000	100.32	100,328,000	101.87	101,870,000	0.2200	2028.06.20	0.83

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

ロ.種類別投資比率

(令和1年6月28日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	79.36
地方債証券	8.10
特殊債券	6.88
社債券	4.23
合計	98.58

(参考)海外国債マザーファンド

イ.評価額上位銘柄明細

(令和1年6月28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	7,000,000	11,178.09	782,466,978	11,813.1103	826,917,721	3.1250	2028.11.15	4.39
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	10,543.20	738,024,657	11,564.6881	809,528,167	2.8750	2028.05.15	4.30
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	10,513.32	735,932,689	11,450.1612	801,511,286	2.7500	2028.02.15	4.26
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,800,000	10,852.91	737,998,046	11,575.6354	787,143,212	2.8750	2028.08.15	4.18
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	10,185.14	712,960,114	11,134.3701	779,405,911	2.3750	2027.05.15	4.14

6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	11,028.68	772,007,981	11,131.8438	779,229,072	2.3750	2029.05.15	4.14
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	10,053.94	703,776,071	11,028.2643	771,978,506	2.2500	2027.08.15	4.10
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	10,032.51	702,276,103	11,024.8959	771,742,716	2.2500	2027.11.15	4.10
9	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4,000,000	18,661.59	746,463,859	18,950.4279	758,017,116	5.5000	2029.04.25	4.03
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,500,000	10,857.47	705,736,077	11,356.6870	738,184,656	2.6250	2029.02.15	3.92
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	10,103.15	606,189,402	11,035.8434	662,150,605	2.2500	2027.02.15	3.52
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	9,935.20	596,112,384	10,849.7371	650,984,231	2.0000	2026.11.15	3.46
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	9,594.38	575,663,274	10,493.5249	629,611,499	1.5000	2026.08.15	3.34
14	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4,000,000	14,540.78	581,631,516	15,234.0813	609,363,252	2.7500	2027.10.25	3.24
15	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4,300,000	12,023.61	517,015,591	12,703.4379	546,247,830	0.2500	2026.11.25	2.90
16	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,500,000	12,516.90	438,091,609	13,156.6508	460,482,781	0.7500	2028.11.25	2.44
17	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,000,000	12,693.63	380,809,161	13,420.0044	402,600,132	1.0000	2027.05.25	2.14
18	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,000,000	12,275.94	368,278,434	13,130.9280	393,927,840	0.7500	2028.05.25	2.09
19	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000	12,279.50	368,385,000	12,953.3175	388,599,525	0.2500	2027.02.15	2.06
20	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,000,000	12,654.80	379,644,281	12,795.3054	383,859,162	0.5000	2029.05.25	2.04
21	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000	15,286.75	305,735,040	16,605.9693	332,119,386	6.5000	2027.11.01	1.76
22	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,500,000	12,483.93	312,098,395	13,217.1609	330,429,024	0.5000	2027.08.15	1.75
23	イギリス	国債証券	TSY	1,800,000	17,092.41	307,663,530	17,603.8730	316,869,714	4.2500	2027.12.07	1.68
24	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000	14,570.36	291,407,385	15,192.4347	303,848,694	4.7500	2028.09.01	1.61
25	イギリス	国債証券	TSY	2,000,000	14,026.42	280,528,437	14,631.4269	292,628,539	1.6250	2028.10.22	1.55
26	イギリス	国債証券	TSY	1,400,000	19,748.89	276,484,600	20,124.2723	281,739,813	6.0000	2028.12.07	1.49
27	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000	12,630.31	252,606,227	13,095.4059	261,908,118	2.8000	2028.12.01	1.39
28	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000	12,072.98	241,459,637	12,944.4982	258,889,964	0.2500	2028.08.15	1.37
29	イギリス	国債証券	TSY	1,800,000	13,547.06	243,847,099	14,196.4514	255,536,126	1.2500	2027.07.22	1.35
30	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000	15,782.83	236,742,548	16,872.9975	253,094,963	7.2500	2026.11.01	1.34

(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、令和1年6月28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

(令和1年6月28日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	98.14
合計	98.14

(参考)新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

イ. 評価額上位銘柄明細

(令和 1年 6月28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	1,310,000	10,710.78	140,311,337	10,891.0005	142,672,107	2.6250	2020.11.15	2.17
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	10,934.71	131,216,624	11,092.2646	133,107,176	3.6250	2021.02.15	2.02
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,110,000	10,816.89	120,067,517	11,042.5801	122,572,640	3.1250	2021.05.15	1.86
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,070,000	10,533.89	112,712,729	10,859.8425	116,200,315	2.1250	2021.08.15	1.77
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	790,000	12,326.55	97,379,778	12,334.3759	97,441,570	8.0000	2021.11.15	1.48
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	700,000	10,331.67	72,321,701	10,876.6847	76,136,793	2.0000	2023.02.15	1.15
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	680,000	10,356.26	70,422,576	10,872.4741	73,932,824	2.0000	2022.11.30	1.12
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	660,000	10,514.57	69,396,213	11,101.5280	73,270,085	2.5000	2023.08.15	1.11
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	650,000	10,444.47	67,889,073	10,853.9475	70,550,659	2.0000	2022.02.15	1.07
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	610,000	10,372.63	63,273,054	11,088.0540	67,637,130	2.3750	2024.08.15	1.03
11	イギリス	国債証券	TSY	290,000	21,085.04	61,146,622	23,053.6989	66,855,727	4.2500	2049.12.07	1.01
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	580,000	10,193.70	59,123,462	10,779.8420	62,523,084	1.7500	2023.05.15	0.95
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	560,000	10,464.25	58,599,818	11,144.4755	62,409,063	2.5000	2024.05.15	0.95
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	570,000	10,208.79	58,190,109	10,741.1050	61,224,299	1.6250	2022.11.15	0.93
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	530,000	10,787.26	57,172,523	11,251.4232	59,632,543	2.7500	2024.02.15	0.90
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	540,000	10,396.68	56,142,084	10,922.1585	58,979,656	2.1250	2022.12.31	0.89
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	540,000	10,325.89	55,759,806	10,784.8946	58,238,431	1.7500	2022.05.15	0.88
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	530,000	10,101.94	53,540,303	10,880.8950	57,668,744	2.0000	2025.02.15	0.87
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	500,000	10,629.10	53,145,522	11,228.6862	56,143,431	2.7500	2023.11.15	0.85
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	510,000	10,150.58	51,767,979	10,951.6323	55,853,325	2.1250	2025.05.15	0.85
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	450,000	10,275.62	46,240,293	11,023.2115	49,604,452	2.2500	2024.11.15	0.75
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	440,000	10,363.83	45,600,895	10,869.9475	47,827,769	2.0000	2022.10.31	0.72
23	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000	13,388.15	46,858,549	13,647.8357	47,767,425	5.0000	2022.03.01	0.72
24	ドイツ	国債証券	BUNDESREP. DEUTSCHLAND	360,000	13,126.02	47,253,702	13,130.9280	47,271,341	1.5000	2022.09.04	0.72
25	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	300,000	14,834.76	44,504,292	14,847.0130	44,541,039	4.2500	2023.10.25	0.67
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	400,000	10,181.84	40,727,374	11,030.7907	44,123,163	2.2500	2025.11.15	0.67
27	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	330,000	13,503.29	44,560,882	13,242.3939	43,699,900	3.7500	2021.04.25	0.66
28	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	310,000	13,541.26	41,977,936	13,484.9241	41,803,265	3.0000	2022.04.25	0.63
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	390,000	10,356.26	40,389,417	10,695.6310	41,712,961	1.3750	2021.05.31	0.63
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	360,000	9,765.86	35,157,123	11,540.2669	41,544,961	2.8750	2046.11.15	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。

外貨建資産の単価及び金額は、令和 1年 6月28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

(令和 1年 6月28日現在)

種類	投資比率 (%)
国債証券	94.05

合計	94.05
----	-------

(参考) グローバル高金利通貨マザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

(令和 1年 6月28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	国際機関	特殊債券	INTL FINANCE CORP	14,700,000	2,968.68	436,397,269	3,037.7544	446,549,897	8.2500	2023.01.30	9.01
2	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	76,000,000	528.67	401,791,784	533.7314	405,635,864	4.7500	2021.01.19	8.18
3	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	10,500,000	2,926.80	307,314,830	2,918.7411	306,467,816	2.2500	2021.05.25	6.18
4	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	10,512,000	2,877.28	302,459,828	2,879.1561	302,656,895	1.5000	2020.07.31	6.10
5	国際機関	特殊債券	INTL FINANCE CORP	176,000,000	167.69	295,151,472	171.2565	301,411,440	6.3750	2022.04.11	6.08
6	国際機関	特殊債券	INTL FINANCE CORP	170,500,000	175.61	299,426,986	174.4029	297,356,945	11.0000	2020.01.21	6.00
7	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	37,380,000	782.80	292,610,639	787.1319	294,229,941	9.0000	2021.03.31	5.93
8	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	30,500,000	780.87	238,166,140	789.0320	240,654,760	8.3750	2022.07.29	4.85
9	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	150,000,000	154.84	232,273,650	155.8068	233,710,200	5.7500	2019.10.28	4.71
10	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	2,850,000	7,656.64	218,214,489	7,722.8534	220,101,324	2.8000	2021.01.15	4.44
11	国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	10,500,000	2,011.64	211,223,166	1,983.8907	208,308,525	27.5000	2020.09.18	4.20
12	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	22,500,000,000	0.76	172,522,350	0.7693	173,094,075	7.2000	2019.07.09	3.49
13	国際機関	特殊債券	INTL FINANCE CORP	2,150,000	7,933.99	170,580,978	7,912.1068	170,110,298	5.7500	2020.07.28	3.43
14	国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	18,000,000,000	0.77	139,140,540	0.7814	140,665,140	8.3000	2020.10.02	2.83
15	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	4,000,000	2,904.13	116,165,352	2,969.8165	118,792,660	8.0000	2022.01.31	2.39
16	国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	6,000,000	1,817.37	109,042,632	1,834.0024	110,040,144	20.0000	2019.10.16	2.22
17	国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	5,500,000	1,965.32	108,092,754	1,928.1496	106,048,228	30.0000	2020.01.15	2.14
18	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	17,580,000	556.62	97,855,076	556.9476	97,911,391	7.5000	2020.03.05	1.97
19	国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	58,000,000	151.95	88,134,258	153.4675	89,011,150	5.5000	2021.08.23	1.79
20	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	15,300,000	539.35	82,520,764	545.3086	83,432,216	4.0000	2020.02.25	1.68
21	国際機関	特殊債券	INTER-AMERICAN DEVEL BK	10,550,000,000	0.74	78,456,763	0.7542	79,577,806	5.8000	2020.09.28	1.60
22	国際機関	特殊債券	INTL FINANCE CORP	34,900,000	154.36	53,872,478	155.5713	54,294,384	6.4500	2020.08.10	1.09
23	国際機関	特殊債券	INTL FINANCE CORP	2,830,000	1,789.73	50,649,381	1,860.2664	52,645,541	10.2500	2019.07.11	1.06
24	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	6,400,000	754.07	48,260,608	757.3400	48,469,760	6.0000	2019.10.21	0.97
25	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	1,500,000	2,895.47	43,432,191	2,957.5538	44,363,307	7.5000	2022.04.13	0.89

26	国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	21,800,000	153.64	33,493,563	154.8176	33,750,258	5.1500	2020.01.20	0.68
27	国際機関	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV	3,000,000,000	0.73	22,085,910	0.7637	22,912,890	6.4500	2022.12.13	0.46
28	国際機関	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP	10,100,000	172.81	17,454,072	171.5984	17,331,448	10.0000	2019.09.16	0.34
29	国際機関	特殊債券	AFRICAN DEVELOPMENT BANK	2,900,000	528.39	15,323,379	536.5413	15,559,700	3.6500	2020.05.21	0.31

(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、令和1年6月28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

(令和1年6月28日現在)

種類	投資比率(%)
特殊債券	95.18
合計	95.18

(参考)新光J-REITマザーファンド

イ.評価額上位銘柄明細

(令和1年6月28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	241	657,691.91	158,503,750	738,000	177,858,000	7.25
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	249	595,320.8	148,234,879	656,000	163,344,000	6.66
3	日本	投資証券	野村不動産マスタ-ファンド投資法人	774	150,794.36	116,714,834	165,700	128,251,800	5.23
4	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	470	209,643.06	98,532,238	218,000	102,460,000	4.17
5	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	558	174,644.68	97,451,731	180,600	100,774,800	4.11
6	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	495	176,465.65	87,350,496	196,600	97,317,000	3.96
7	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	357	233,099.07	83,216,367	248,900	88,857,300	3.62
8	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	334	252,930.42	84,478,760	260,100	86,873,400	3.54
9	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	242	291,110.38	70,448,711	320,500	77,561,000	3.16
10	日本	投資証券	GLP投資法人	616	112,971.9	69,590,690	122,800	75,644,800	3.08
11	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	157	405,453.98	63,656,274	467,000	73,319,000	2.99
12	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	800	81,796.47	65,437,176	86,800	69,440,000	2.83
13	日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	131	476,533.68	62,425,912	469,000	61,439,000	2.50
14	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	77	712,292.09	54,846,490	771,000	59,367,000	2.42
15	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	727	74,012.4	53,807,014	80,600	58,596,200	2.38
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	83	524,115.61	43,501,595	604,000	50,132,000	2.04
17	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	858	47,019.76	40,342,954	55,800	47,876,400	1.95
18	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	57	685,003.87	39,045,220	773,000	44,061,000	1.79
19	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	285	140,514.94	40,046,757	152,600	43,491,000	1.77

20	日本	投資証券	産業ファンド投資法人	305	115,738.98	35,300,388	134,000	40,870,000	1.66
21	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	162	225,441.07	36,521,453	246,700	39,965,400	1.62
22	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	85	439,120.04	37,325,203	460,000	39,100,000	1.59
23	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	201	161,910.28	32,543,966	187,100	37,607,100	1.53
24	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	223	149,080.33	33,244,913	158,200	35,278,600	1.43
25	日本	投資証券	イオンリート投資法人	255	126,015.71	32,134,006	138,000	35,190,000	1.43
26	日本	投資証券	日本リート投資法人	80	370,081.62	29,606,529	419,000	33,520,000	1.36
27	日本	投資証券	プレミアム投資法人	236	119,011.32	28,086,671	141,800	33,464,800	1.36
28	日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	103	272,126.67	28,029,047	309,500	31,878,500	1.30
29	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	167	158,333.66	26,441,721	187,200	31,262,400	1.27
30	日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	178	162,460.69	28,918,002	175,200	31,185,600	1.27

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

ロ. 種類別投資比率

(令和 1年 6月28日現在)

種類	投資比率 (%)
投資証券	98.36
合計	98.36

(参考) 新光米国REITマザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

(令和 1年 6月28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	2,468	16,357.13	40,369,403	22,188.5713	54,761,394	7.97
2	アメリカ	投資証券	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	2,329	11,598.20	27,012,218	14,063.3615	32,753,569	4.77
3	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	3,526	6,883.46	24,271,113	8,554.2144	30,162,160	4.39
4	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP	1,726	18,829.83	32,500,295	17,238.8545	29,754,263	4.33
5	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	472	44,723.14	21,109,324	53,699.9004	25,346,353	3.69
6	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	831	21,645.30	17,987,252	25,550.5415	21,232,500	3.09
7	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	2,275	7,144.03	16,252,686	8,798.8975	20,017,492	2.91
8	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	781	19,265.30	15,046,205	21,713.2176	16,958,023	2.47
9	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	2,046	7,033.17	14,389,883	8,150.0019	16,674,904	2.42
10	アメリカ	投資証券	SBA COMMUNICATIONS CORP	629	16,804.46	10,570,006	24,234.4260	15,243,454	2.22
11	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	2,010	6,058.87	12,178,340	7,482.7815	15,040,391	2.19
12	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	1,172	12,148.73	14,238,316	12,676.1040	14,856,394	2.16
13	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	1,767	6,435.74	11,371,953	7,482.7815	13,222,075	1.92
14	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	868	12,654.54	10,984,146	13,800.3536	11,978,707	1.74
15	アメリカ	投資証券	WEYERHAEUSER COMPANY	4,180	3,054.76	12,768,932	2,799.3062	11,701,100	1.70
16	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	367	26,630.59	9,773,430	31,083.4032	11,407,609	1.66
17	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE	626	13,353.02	8,358,994	15,097.0670	9,450,764	1.37
18	アメリカ	投資証券	HCP INC	2,686	2,874.75	7,721,603	3,427.7218	9,206,861	1.34

19	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	948	7,144.97	6,773,435	8,776.2616	8,319,896	1.21
20	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS	4,173	2,054.36	8,572,876	1,941.2978	8,101,036	1.18
21	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	637	10,747.74	6,846,311	12,538.1334	7,986,791	1.16
22	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	695	9,469.00	6,580,960	11,383.7021	7,911,673	1.15
23	アメリカ	投資証券	UDR INC	1,557	4,289.53	6,678,805	4,805.2780	7,481,818	1.09
24	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	2,032	2,991.94	6,079,624	3,364.1259	6,835,904	0.99
25	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	982	7,358.83	7,226,372	6,864.0672	6,740,514	0.98
26	アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORPORATION	933	6,892.91	6,431,088	7,211.1511	6,728,004	0.98
27	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	479	10,815.06	5,180,416	13,646.2150	6,536,537	0.95
28	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	488	10,213.88	4,984,377	12,900.3073	6,295,350	0.91
29	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	2,176	2,420.05	5,266,039	2,859.6686	6,222,639	0.90
30	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	524	10,092.38	5,288,411	11,172.4332	5,854,355	0.85

(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、令和1年6月28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

(令和1年6月28日現在)

種類	投資比率(%)
投資証券	99.24
合計	99.24

【投資不動産物件】

グローバル・ナビ

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)海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

該当事項はありません。

(参考)グローバル高金利通貨マザーファンド

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】

グローバル・ナビ

該当事項はありません。

（参考）ニュー トピックス インデックス マザーファンド

（令和 1年 6月28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	11	日本円	170,973,564	170,610,000	2.83

（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

（令和 1年 6月28日現在）

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	帳簿価額 （円）	評価額	評価額 （円）	投資比率 （％）
株価指数先物 取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P500 EMINI	買建	10	米ドル	1,449,200	156,209,267	1,465,450	157,960,855	3.40
	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	193,738	15,950,449	194,360	16,001,658	0.34
	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	305,270	37,392,522	308,970	37,845,735	0.81
	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	161,825	12,216,168	165,075	12,461,511	0.26
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100 IDX	買建	1	英ポンド	72,760	9,936,833	73,395	10,023,555	0.21

（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、令和 1年 6月28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）海外国債マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

該当事項はありません。

（参考）グローバル高金利通貨マザーファンド

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。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

グローバル・ナビ

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末（平成26年12月15日）	156	156	1.0986	1.0986
第2計算期間末（平成27年12月15日）	192	192	1.1107	1.1107
第3計算期間末（平成28年12月15日）	185	185	1.1246	1.1246
第4計算期間末（平成29年12月15日）	156	156	1.1917	1.1917
第5計算期間末（平成30年12月17日）	211	211	1.1409	1.1409
平成30年 6月末日	241		1.1631	
7月末日	240		1.1758	
8月末日	235		1.1707	
9月末日	237		1.1929	

10月末日	217		1.1422
11月末日	217		1.1603
12月末日	204		1.1065
平成31年 1月末日	209		1.1406
2月末日	212		1.1646
3月末日	212		1.1746
4月末日	206		1.1844
令和 1年 5月末日	200		1.1513
6月末日	204		1.1728

【分配の推移】

グローバル・ナビ

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	平成26年 1月 6日～平成26年12月15日	0.0000
第2計算期間	平成26年12月16日～平成27年12月15日	0.0000
第3計算期間	平成27年12月16日～平成28年12月15日	0.0000
第4計算期間	平成28年12月16日～平成29年12月15日	0.0000
第5計算期間	平成29年12月16日～平成30年12月17日	0.0000

【収益率の推移】

グローバル・ナビ

期	計算期間	収益率（％）
第1計算期間	平成26年 1月 6日～平成26年12月15日	9.9
第2計算期間	平成26年12月16日～平成27年12月15日	1.1
第3計算期間	平成27年12月16日～平成28年12月15日	1.3
第4計算期間	平成28年12月16日～平成29年12月15日	6.0
第5計算期間	平成29年12月16日～平成30年12月17日	4.3
第6中間計算期間	平成30年12月18日～令和 1年 6月17日	2.2

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

(4) 【設定及び解約の実績】

グローバル・ナビ

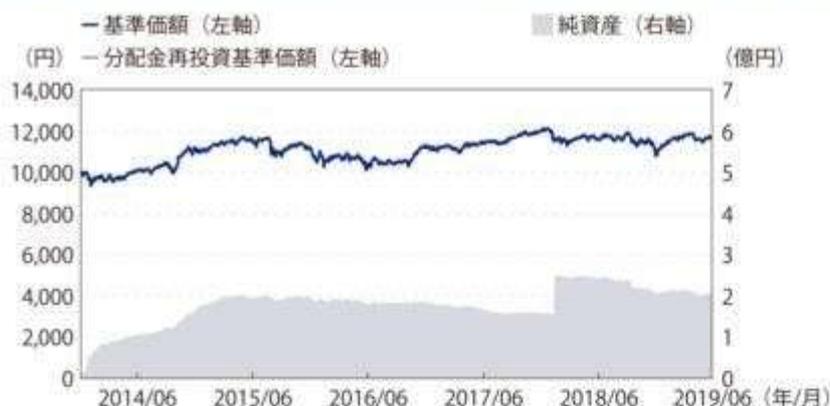
期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1計算期間	平成26年 1月 6日～平成26年12月15日	145,283,614	3,105,708

第2計算期間	平成26年12月16日～平成27年12月15日	46,534,790	15,084,083
第3計算期間	平成27年12月16日～平成28年12月15日	7,924,566	16,949,228
第4計算期間	平成28年12月16日～平成29年12月15日	1,346,866	34,711,182
第5計算期間	平成29年12月16日～平成30年12月17日	86,746,251	32,517,890
第6中間計算期間	平成30年12月18日～令和 1年 6月17日	511,555	11,761,603

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

参考情報

基準価額・純資産の推移 (2014年1月6日～2019年6月28日)



分配の推移(税引前)

2018年12月	0円
2017年12月	0円
2016年12月	0円
2015年12月	0円
2014年12月	0円
設定未累計	0円

*分配金は1万口当たりです。

*基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

*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:2014年1月6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。

主要な資産の状況

組入状況

ファンド・銘柄名	純資産比率(%)
ニュー トピックス インデックス マザーファンド	19.99
新光外国株式インデックスマザーファンド	15.05
海外国債マザーファンド	15.02
新光日本債券インデックスマザーファンド	14.96
新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	10.01
ISHARES CORE MSCI EMERGING MARKETS ETF	5.09
グローバル高金利通貨マザーファンド	5.05
新光J-REITマザーファンド	4.97
新光米国REITマザーファンド	4.85
合計	95.04

ニュー トピックス インデックス マザーファンドの組入上位5銘柄

銘柄名	業種	純資産比率(%)
トヨタ自動車	輸送用機器	3.24
ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.84
ソニー	電気機器	1.65
三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.51
日本電信電話	情報・通信業	1.46

*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、ニュー トピックス インデックス マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

新光外国株式インデックスマザーファンドの組入上位5銘柄

銘柄名	国・地域	業種	純資産比率(%)
MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	2.43
APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.34
AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	1.98
FACEBOOK INC-A	アメリカ	メディア・娯楽	1.12
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	0.92

*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、新光外国株式インデックスマザーファンドの純資産総額に対する比率です。

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

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

新光J-REITマザーファンドの組入上位5銘柄

銘柄名	純資産比率(%)
日本ビルファンド投資法人	7.25
ジャパンリアルエステイト投資法人	6.66
野村不動産マスターファンド投資法人	5.23
日本リテールファンド投資法人	4.17
ユナイテッド・アーバン投資法人	4.11

※純資産比率は、新光J-REITマザーファンドの純資産総額に対する比率です。

新光米国REITマザーファンドの組入上位5銘柄

銘柄名	純資産比率(%)
AMERICAN TOWER CORPORATION	7.97
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	4.77
PROLOGIS INC	4.39
SIMON PROPERTY GROUP	4.33
EQUINIX INC	3.69

※純資産比率は、新光米国REITマザーファンドの純資産総額に対する比率です。

新光日本債券インデックスマザーファンドの組入上位5銘柄

銘柄名	償還日	利率(%)	純資産比率(%)
第312回利付国債(10年)	2020/12/20	1.200	1.17
第126回利付国債(5年)	2020/12/20	0.100	1.15
第338回利付国債(10年)	2025/03/20	0.400	1.10
第332回利付国債(10年)	2023/12/20	0.600	1.02
第97回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2029/12/28	2.100	1.00

※純資産比率は、新光日本債券インデックスマザーファンドの純資産総額に対する比率です。

海外国債マザーファンドの組入上位5銘柄

銘柄名	償還日	利率(%)	通貨	純資産比率(%)
US TREASURY N/B	2028/11/15	3.125	米ドル	4.39
US TREASURY N/B	2028/05/15	2.875	米ドル	4.30
US TREASURY N/B	2028/02/15	2.750	米ドル	4.26
US TREASURY N/B	2028/08/15	2.875	米ドル	4.18
US TREASURY N/B	2027/05/15	2.375	米ドル	4.14

※純資産比率は、海外国債マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)の組入上位5銘柄

銘柄名	償還日	利率(%)	通貨	純資産比率(%)
US TREASURY N/B	2020/11/15	2.625	米ドル	2.17
US TREASURY N/B	2021/02/15	3.625	米ドル	2.02
US TREASURY N/B	2021/05/15	3.125	米ドル	1.86
US TREASURY N/B	2021/08/15	2.125	米ドル	1.77
US TREASURY N/B	2021/11/15	8.000	米ドル	1.48

※純資産比率は、新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)の純資産総額に対する比率です。

グローバル高金利通貨マザーファンドの組入上位5銘柄

銘柄名	償還日	利率(%)	通貨	純資産比率(%)
INTL FINANCE CORP	2023/01/30	8.250	ブラジルレアル	9.01
EUROPEAN INVESTMENT BANK	2021/01/19	4.750	メキシコペソ	8.18
EUROPEAN INVESTMENT BANK	2021/05/25	2.250	ポーランドズロチ	6.18
INTL BK RECON & DEVELOP	2020/07/31	1.500	ポーランドズロチ	6.10
INTL FINANCE CORP	2022/04/11	6.375	ロシアルーブル	6.08

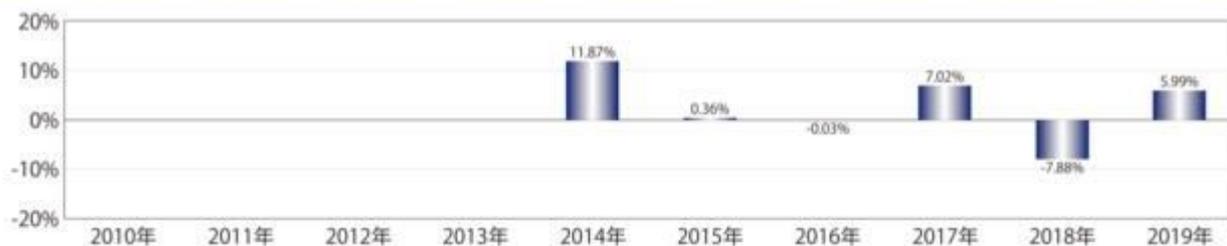
※純資産比率は、グローバル高金利通貨マザーファンドの純資産総額に対する比率です。

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

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2014年は設定日から年末までの収益率、および2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○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「グローバル・ナビ自動継続投資約款」（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およびすで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をもって一部解約の実行を請求することができます。

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

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

(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当該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、受益者の請求を受け付けた日から起算して、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。
- (ヘ) 委託者は、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受け付けないものとします。
- ・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、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には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この日が一部解約の実行の請求を受け付けられない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の実行の請求を受け付けることができる日とします。）に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記(二)の規定に準じて計算された価額とします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

アセットマネジメントOne株式会社

コールセンター 0120-104-694

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

インターネットホームページ

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

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

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

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

上場投資信託証券	計算日における取引所の最終相場
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
直物為替先渡取引	金融商品取引業者または銀行等が提示する価額もしくは価格 情報会社の提供する価額

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

当ファンドの信託期間は、投資信託契約締結日から2028年12月15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、原則として毎年12月16日から翌年12月15日までとします。

上記にかかわらず、上記の原則による該当日が休業日のとき、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30億口を下回る事となった場合、またはこの投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、もしくはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

(ロ) 委託者は、上記(イ)の事項について、下記「c. 書面決議の手続き」の規定にしています。

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

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

上記の規定にかかわらず、監督官庁がこの投資信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記「c. 書面決議の手続き」の規定における書面決議が否決となる場合を除き、当該委託者と受託者との間において存続します。

(ホ) 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委

託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申し立てることができます。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等」の規定にしたがい、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

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等

(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またはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合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。

(ロ) 委託者は、上記(イ)の事項(投資信託約款の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な約款の変更等」といいます。)について、下記「c. 書面決議の手続き」の規定にしたがいます。

(ハ) 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)および(ロ)の規定にしたがいます。

この投資信託約款は上記に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

c. 書面決議の手続き

(イ) 委託者は、上記「a. 信託の終了(投資信託契約の解約)」(イ)について、または「b. 投資信託約款の変更等」(イ)の事項のうち重大な約款の変更等について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに投資信託契約の解約の理由または重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドにかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

(ロ) 上記(イ)の書面決議において、受益者(委託者およびこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

(ハ) 上記(イ)の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

(ニ) 重大な約款の変更等における書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

(ホ) 上記(イ)から(ニ)までの規定は、委託者が投資信託契約の解約または重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドにかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、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(イ)から(ハ)までに規定する当ファンドの解約の手続きを行うことが困難な場合には適用しません。

(ヘ) 上記(イ)から(ホ)の規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合

の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

d. 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託者が投資信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、投資信託契約の解約または重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

e. 運用報告書

委託者は、毎決算時および償還時に交付運用報告書を作成し、知れ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「f. 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。

f. 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。

g. 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。

h. 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。

i. 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

j．他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

- 1．他の受益者の氏名または名称および住所
- 2．他の受益者が有する受益権の内容

k．関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

a．収益分配金請求権

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

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

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

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

b．償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

c．一部解約請求権

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

d．帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(平成29年12月16日から平成30年12月17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】

【グローバル・ナビ】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 平成29年12月15日現在	第5期 平成30年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,047,861	9,574,645
投資信託受益証券	7,756,274	10,544,710
親投資信託受益証券	140,818,880	191,374,777
派生商品評価勘定	-	43
未収入金	-	1,900,000
流動資産合計	157,623,015	213,394,175
資産合計	157,623,015	213,394,175
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	43,170	63,245
未払委託者報酬	1,182,929	1,732,804
未払利息	14	22
その他未払費用	4,918	4,889
流動負債合計	1,231,031	1,800,960
負債合計	1,231,031	1,800,960
純資産の部		
元本等		
元本	131,239,635	185,467,996
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	25,152,349	26,125,219
(分配準備積立金)	20,068,299	18,255,994
元本等合計	156,391,984	211,593,215
純資産合計	156,391,984	211,593,215
負債純資産合計	157,623,015	213,394,175

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自	平成28年12月16日 至 平成29年12月15日	自	平成29年12月16日 至 平成30年12月17日
営業収益				
受取配当金		161,682		212,159
有価証券売買等損益		12,523,412		4,008,768
為替差損益		418,351		345,250
その他収益		-		2,071
営業収益合計		12,266,743		3,449,288
営業費用				
支払利息		5,036		8,689
受託者報酬		90,664		121,298
委託者報酬		2,484,402		3,323,505
その他費用		432,186		420,672
営業費用合計		3,012,288		3,874,164
営業利益		9,254,455		7,323,452
経常利益		9,254,455		7,323,452
当期純利益		9,254,455		7,323,452
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		555,102		369,897
期首剰余金又は期首欠損金 ()		20,502,180		25,152,349
剰余金増加額又は欠損金減少額		194,876		13,652,922
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		194,876		13,652,922
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,244,060		5,726,497
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,244,060		5,726,497
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		25,152,349		26,125,219

(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5期	
	自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17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、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。
	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. 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。
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。
	計算期間に関する事項	当計算期間終了日に該当する日が休業日のため、当計算期間は平成29年12月16日から平成30年12月17日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第4期 平成29年12月15日現在		第5期 平成30年12月17日現在	
1. 計算期間末日における受益権の総数	131,239,635口	1. 計算期間末日における受益権の総数	185,467,996口
2. 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額		2. 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1917円	1口当たり純資産額	1.1409円
(1万口当たり純資産額)	(11,917円)	(1万口当たり純資産額)	(11,409円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第4期		第5期	
	自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日		自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17日	
1. その他費用	主に、海外カストディアンに対するカストディフィーであります。		同左	

2. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,572,164円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(6,127,189円)、信託約款に定める収益調整金(5,084,050円)及び分配準備積立金(11,368,946円)より分配対象収益は25,152,349円(1万口当たり1,916.48円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,234,500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(16,898,926円)及び分配準備積立金(17,021,494円)より分配対象収益は35,154,920円(1万口当たり1,895.46円)であります。分配を行っておりません。
-------------	--	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第4期 自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日	第5期 自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 また、当ファンドは、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。	同左
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、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。 また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引は為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左

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

第4期 平成29年12月15日現在	第5期 平成30年12月17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>

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

(関連当事者との取引に関する注記)

	第4期 自 平成28年12月16日 至 平成29年12月15日	第5期 自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17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4期 平成29年12月15日現在	第5期 平成30年12月17日現在
期首元本額	164,603,951円	131,239,635円
期中追加設定元本額	1,346,866円	86,746,251円
期中一部解約元本額	34,711,182円	32,517,890円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第4期 平成29年12月15日現在	第5期 平成30年12月17日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
投資信託受益証券	1,754,744	1,664,378
親投資信託受益証券	8,878,449	2,263,504
合計	10,633,193	3,927,882

3 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

種類	第4期 平成29年12月15日現在				第5期 平成30年12月17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								
買建	-	-	-	-	113,407	-	113,450	43
米ドル	-	-	-	-	113,407	-	113,450	43
合計	-	-	-	-	113,407	-	113,450	43

時価の算定方法

為替予約取引

1) 期末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。

期末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。

期末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。

- ・ 期末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。
- ・ 期末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) 期末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、期末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。

(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

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
日本円	親投資信託受益証券	海外国債マザーファンド	14,537,879	32,843,976	
		ニュー トピックス インデックス マザーファンド	20,108,161	42,110,510	
		新光外国株式インデックスマザーファンド	14,052,870	31,530,424	

		新光日本債券インデックスマザーファンド	25,057,761	31,853,425	
		新光J-REITマザーファンド	5,982,541	10,720,115	
		新光米国REITマザーファンド	6,190,194	10,489,902	
		新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)	15,824,980	21,197,560	
		グローバル高金利通貨マザーファンド	9,725,378	10,628,865	
日本円建小計			111,479,764	191,374,777	
米ドル	投資信託受益証券	ISHARES CORE MSCI EMERGING MARKETS ETF	1,930	92,929.50	
米ドル建小計			1,930	92,929.50	(10,544,710)
合計				201,919,487	(10,544,710)

(注1) 券面総額欄の数値は、口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	組入投資信託 受益証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	投資信託受益証券 1銘柄	5.0%	5.2%

(注1) 組入投資信託受益証券時価比率は、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。

(参考)

当ファンドは、「ニュー トピックス インデックス マザーファンド」、「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」、「海外国債マザーファンド」、「新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)」、「グローバル高金利通貨マザーファンド」、「新光J-REITマザーファンド」及び「新光米国REIT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「親投資信託受益証券」は、これら同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。

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12月17日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	203,571,488
株式	6,855,639,880
派生商品評価勘定	9,352
未収配当金	934,670
前払金	930,000
流動資産合計	7,061,085,390
資産合計	
7,061,085,390	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	703,240
未払解約金	5,070,000
未払利息	471
流動負債合計	5,773,711
負債合計	
5,773,711	
純資産の部	
元本等	
元本	3,369,016,755
剰余金	
剰余金又は欠損金()	3,686,294,924
元本等合計	7,055,311,679
純資産合計	
7,055,311,679	
負債純資産合計	
7,061,085,390	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17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12月17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	149,223,700円
2. 計算日における受益権の総数	3,369,016,755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	2.0942円
(1万口当たり純資産額)	(20,942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12月16日 至 平成30年12月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため、デリバティブ取引を行っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、株式であり、株価変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。株価指数先物取引は株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。 リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。 市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。 信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。 流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

平成30年12月17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。

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17日
	該当事項はありません。

(その他の注記)

1 元本の移動

区分	平成30年12月17日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,709,895,506円
期中追加設定元本額	445,163,109円
期中一部解約元本額	1,786,041,860円
同期末における元本の内訳	
ニュー トピックス インデックス	257,901,936円
新光7資産バランスファンド	325,349,085円
ニュー トピックス インデックス(変額年金)	108,248,398円
新光世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	552,905,787円
新光ワールドバランスファンドVA(適格機関投資家私募)	404,448,396円
新光世界バランス35VAT(適格機関投資家私募)	25,232,762円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	1,216,998,785円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	434,497,335円
グローバル・ナビ	20,108,161円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	4,762,873円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	15,670,678円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	2,892,559円
合計	3,369,016,755円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

平成30年12月17日現在

種類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	1,134,426,124
合計	1,134,426,124

(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12月17日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
	うち1年超			
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	191,253,888	-	190,560,000	693,888
東証株価指数先物	191,253,888	-	190,560,000	693,888
合計	191,253,888	-	190,560,000	693,888

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	3,030.00	303,000	
日本水産	4,100	669.00	2,742,900	
マルハニチロ	600	3,860.00	2,316,000	
カネコ種苗	100	1,357.00	135,700	
サカタのタネ	500	3,705.00	1,852,500	
ホクト	300	2,009.00	602,700	

ホクリヨウ	100	675.00	67,500
日鉄鉱業	100	4,840.00	484,000
三井松島ホールディングス	200	1,502.00	300,400
国際石油開発帝石	16,600	1,116.00	18,525,600
石油資源開発	600	2,204.00	1,322,400
K&Oエナジーグループ	200	1,610.00	322,000
ヒノキヤグループ	100	2,122.00	212,200
ショーボンドホールディングス	300	9,010.00	2,703,000
ミライト・ホールディングス	1,100	1,606.00	1,766,600
日本アクア	100	392.00	39,200
ファーストコーポレーション	100	886.00	88,600
TATERU	500	359.00	179,500
スペースバリューホールディングス	500	1,029.00	514,500
ダイセキ環境ソリューション	100	731.00	73,100
安藤・間	2,600	687.00	1,786,200
東急建設	1,200	1,057.00	1,268,400
コムシスホールディングス	1,500	2,750.00	4,125,000
ミサワホーム	300	786.00	235,800
ピーアールホールディングス	300	363.00	108,900
高松コンストラクショングループ	300	2,801.00	840,300
東建コーポレーション	100	6,570.00	657,000
ヤマウラ	200	958.00	191,600
大成建設	3,400	4,955.00	16,847,000
大林組	10,200	1,057.00	10,781,400
清水建設	10,500	912.00	9,576,000
飛島建設	300	1,488.00	446,400
長谷工コーポレーション	4,300	1,260.00	5,418,000
松井建設	400	776.00	310,400
鹿島建設	8,000	1,537.00	12,296,000
不動テトラ	300	1,800.00	540,000
大末建設	100	1,119.00	111,900
鉄建建設	200	2,768.00	553,600
西松建設	700	2,532.00	1,772,400
三井住友建設	2,500	668.00	1,670,000
大豊建設	200	3,665.00	733,000
前田建設工業	2,400	1,120.00	2,688,000
佐田建設	200	404.00	80,800
ナカノフドー建設	300	546.00	163,800
奥村組	600	3,455.00	2,073,000
東鉄工業	400	3,155.00	1,262,000
イチケン	100	2,002.00	200,200
浅沼組	100	3,030.00	303,000

戸田建設	4,000	688.00	2,752,000
熊谷組	500	3,395.00	1,697,500
青木あすなる建設	200	969.00	193,800
北野建設	100	4,055.00	405,500
矢作建設工業	500	728.00	364,000
ピーエス三菱	400	667.00	266,800
日本ハウスホールディングス	700	475.00	332,500
大東建託	1,200	15,395.00	18,474,000
新日本建設	400	1,083.00	433,200
N I P P O	900	2,066.00	1,859,400
東亜道路工業	100	3,195.00	319,500
前田道路	1,100	2,205.00	2,425,500
日本道路	100	6,160.00	616,000
東亜建設工業	300	1,438.00	431,400
若築建設	200	1,645.00	329,000
東洋建設	1,300	395.00	513,500
五洋建設	4,100	672.00	2,755,200
世紀東急工業	500	647.00	323,500
福田組	100	4,530.00	453,000
住友林業	2,400	1,511.00	3,626,400
日本基礎技術	400	356.00	142,400
巴コーポレーション	400	397.00	158,800
大和ハウス工業	9,500	3,631.00	34,494,500
ライト工業	700	1,535.00	1,074,500
積水ハウス	10,500	1,665.50	17,487,750
日特建設	300	669.00	200,700
北陸電気工事	200	962.00	192,400
ユアテック	500	932.00	466,000
四電工	100	2,621.00	262,100
中電工	400	2,370.00	948,000
関電工	1,600	1,092.00	1,747,200
きんでん	2,300	1,837.00	4,225,100
東京エネシス	400	968.00	387,200
トーエネック	100	3,145.00	314,500
住友電設	200	1,833.00	366,600
日本電設工業	600	2,353.00	1,411,800
協和エクシオ	1,300	2,650.00	3,445,000
新日本空調	300	1,973.00	591,900
九電工	700	4,195.00	2,936,500
三機工業	800	1,156.00	924,800
日揮	2,900	1,608.00	4,663,200
中外炉工業	100	2,239.00	223,900

ヤマト	300	552.00	165,600
太平電業	200	2,644.00	528,800
高砂熱学工業	900	1,898.00	1,708,200
朝日工業社	100	3,165.00	316,500
明星工業	600	774.00	464,400
大気社	500	2,998.00	1,499,000
ダイダン	200	2,536.00	507,200
日比谷総合設備	300	1,868.00	560,400
東芝プラントシステム	700	2,135.00	1,494,500
OSJBホールディングス	1,500	320.00	480,000
東洋エンジニアリング	400	741.00	296,400
千代田化工建設	2,500	312.00	780,000
新興プランテック	600	1,096.00	657,600
日本製粉	1,000	1,906.00	1,906,000
日清製粉グループ本社	3,500	2,419.00	8,466,500
昭和産業	300	3,035.00	910,500
鳥越製粉	300	879.00	263,700
中部飼料	400	1,312.00	524,800
フィード・ワン	2,100	189.00	396,900
日本甜菜製糖	200	1,866.00	373,200
三井製糖	200	2,857.00	571,400
塩水港精糖	300	238.00	71,400
日新製糖	100	2,243.00	224,300
森永製菓	800	4,925.00	3,940,000
中村屋	100	4,320.00	432,000
江崎グリコ	900	5,720.00	5,148,000
名糖産業	100	1,423.00	142,300
井村屋グループ	100	2,789.00	278,900
不二家	200	2,453.00	490,600
山崎製パン	2,500	2,438.00	6,095,000
モロゾフ	100	5,300.00	530,000
亀田製菓	200	5,110.00	1,022,000
寿スピリッツ	300	4,630.00	1,389,000
カルビー	1,400	3,640.00	5,096,000
森永乳業	600	3,375.00	2,025,000
六甲バター	200	2,253.00	450,600
ヤクルト本社	2,300	8,600.00	19,780,000
明治ホールディングス	2,200	8,990.00	19,778,000
雪印メグミルク	700	2,981.00	2,086,700
プリマハム	400	2,037.00	814,800
日本ハム	1,300	4,335.00	5,635,500
丸大食品	300	1,866.00	559,800

S Foods	300	4,525.00	1,357,500
伊藤ハム米久ホールディングス	2,000	703.00	1,406,000
サッポロホールディングス	1,100	2,471.00	2,718,100
アサヒグループホールディングス	6,400	4,533.00	29,011,200
キリンホールディングス	13,800	2,391.50	33,002,700
宝ホールディングス	2,300	1,451.00	3,337,300
オエノンホールディングス	900	373.00	335,700
養命酒製造	100	2,222.00	222,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	2,300	3,150.00	7,245,000
サントリー食品インターナショナル	2,000	4,735.00	9,470,000
ダイトーグループホールディングス	200	6,120.00	1,224,000
伊藤園	1,000	5,050.00	5,050,000
キーコーヒー	300	2,093.00	627,900
ユニカフェ	100	1,158.00	115,800
日清オイリオグループ	400	3,285.00	1,314,000
不二製油グループ本社	700	3,735.00	2,614,500
J - オイルミルズ	200	4,085.00	817,000
キッコーマン	2,000	6,730.00	13,460,000
味の素	6,800	1,998.00	13,586,400
キューピー	1,700	2,667.00	4,533,900
ハウス食品グループ本社	1,200	4,010.00	4,812,000
カゴメ	1,200	3,060.00	3,672,000
焼津水産化学工業	100	1,037.00	103,700
アリアケジャパン	300	7,820.00	2,346,000
エバラ食品工業	100	2,142.00	214,200
ニチレイ	1,600	3,200.00	5,120,000
東洋水産	1,600	4,065.00	6,504,000
イトアンド	100	1,640.00	164,000
日清食品ホールディングス	1,300	7,320.00	9,516,000
永谷園ホールディングス	200	2,617.00	523,400
一正蒲鉾	100	1,061.00	106,100
フジッコ	300	2,481.00	744,300
ロック・フィールド	300	1,683.00	504,900
日本たばこ産業	17,700	2,871.00	50,816,700
ケンコーマヨネーズ	200	2,173.00	434,600
わらべや日洋ホールディングス	200	1,890.00	378,000
なとり	200	1,814.00	362,800
イフジ産業	100	697.00	69,700
ピクルスコーポレーション	100	2,238.00	223,800
北の達人コーポレーション	1,200	391.00	469,200
ユーグレナ	1,300	651.00	846,300
ミヨシ油脂	100	1,180.00	118,000

理研ビタミン	100	3,690.00	369,000
片倉工業	400	1,159.00	463,600
グンゼ	200	4,220.00	844,000
東洋紡	1,300	1,587.00	2,063,100
ユニチカ	900	508.00	457,200
富士紡ホールディングス	200	2,813.00	562,600
倉敷紡績	300	2,685.00	805,500
シキボウ	200	1,102.00	220,400
日本毛織	1,000	873.00	873,000
帝国繊維	300	2,184.00	655,200
帝人	2,400	1,841.00	4,418,400
東レ	23,200	812.30	18,845,360
サカイオーベックス	100	2,273.00	227,300
住江織物	100	2,671.00	267,100
日本フェルト	200	463.00	92,600
アツギ	200	1,015.00	203,000
セーレン	700	1,761.00	1,232,700
ソトー	100	958.00	95,800
小松マテーレ	500	829.00	414,500
ワコールホールディングス	900	2,976.00	2,678,400
ホギメディカル	400	3,195.00	1,278,000
T S Iホールディングス	1,100	707.00	777,700
マツオカコーポレーション	100	3,215.00	321,500
ワールド	300	1,668.00	500,400
三陽商会	200	2,001.00	400,200
オンワードホールディングス	1,800	616.00	1,108,800
ルックホールディングス	100	1,020.00	102,000
ゴールドウイン	300	12,480.00	3,744,000
デサント	700	1,987.00	1,390,900
キング	200	518.00	103,600
ヤマトインターナショナル	200	435.00	87,000
特種東海製紙	200	4,280.00	856,000
王子ホールディングス	13,400	614.00	8,227,600
日本製紙	1,400	2,067.00	2,893,800
北越コーポレーション	2,000	541.00	1,082,000
中越パルプ工業	100	1,498.00	149,800
大王製紙	1,500	1,292.00	1,938,000
レンゴー	3,100	857.00	2,656,700
トーモク	200	1,690.00	338,000
ザ・パック	200	3,120.00	624,000
クラレ	5,000	1,635.00	8,175,000
旭化成	21,300	1,164.00	24,793,200

共和レザー	200	819.00	163,800
昭和電工	2,000	3,785.00	7,570,000
住友化学	23,500	558.00	13,113,000
住友精化	100	4,425.00	442,500
日産化学	1,800	6,150.00	11,070,000
クレハ	300	6,790.00	2,037,000
テイカ	200	1,810.00	362,000
石原産業	600	1,065.00	639,000
片倉コープアグリ	100	1,154.00	115,400
日東エフシー	200	766.00	153,200
日本曹達	500	2,787.00	1,393,500
東ソー	4,600	1,435.00	6,601,000
トクヤマ	900	2,582.00	2,323,800
セントラル硝子	700	2,327.00	1,628,900
東亜合成	1,900	1,233.00	2,342,700
大阪ソーダ	300	2,589.00	776,700
関東電化工業	700	847.00	592,900
デンカ	1,200	3,275.00	3,930,000
信越化学工業	5,300	9,149.00	48,489,700
日本カーバイド工業	100	1,775.00	177,500
堺化学工業	200	2,500.00	500,000
第一稀元素化学工業	200	897.00	179,400
エア・ウォーター	2,400	1,745.00	4,188,000
大陽日酸	2,500	1,969.00	4,922,500
日本化学工業	100	2,391.00	239,100
日本パーカラライジング	1,600	1,329.00	2,126,400
高压ガス工業	500	834.00	417,000
四国化成工業	500	1,159.00	579,500
ステラ ケミファ	200	2,889.00	577,800
保土谷化学工業	100	2,201.00	220,100
日本触媒	500	7,050.00	3,525,000
大日精化工業	200	2,842.00	568,400
カネカ	800	4,125.00	3,300,000
三菱瓦斯化学	3,100	1,702.00	5,276,200
三井化学	2,700	2,587.00	6,984,900
J S R	3,000	1,717.00	5,151,000
東京応化工業	500	3,160.00	1,580,000
大阪有機化学工業	300	1,209.00	362,700
三菱ケミカルホールディングス	20,000	840.50	16,810,000
K Hネオケム	500	2,391.00	1,195,500
ダイセル	4,600	1,190.00	5,474,000
住友ベークライト	500	3,900.00	1,950,000

積水化学工業	6,500	1,751.00	11,381,500
日本ゼオン	2,700	1,061.00	2,864,700
アイカ工業	900	3,630.00	3,267,000
宇部興産	1,500	2,356.00	3,534,000
積水樹脂	500	2,000.00	1,000,000
タキロンシーアイ	600	624.00	374,400
旭有機材	200	1,537.00	307,400
日立化成	1,400	1,636.00	2,290,400
ニチバン	200	1,991.00	398,200
リケンテクノス	800	463.00	370,400
大倉工業	200	2,013.00	402,600
積水化成成品工業	400	961.00	384,400
群栄化学工業	100	2,857.00	285,700
タイガースポリマー	200	655.00	131,000
ミライアル	100	951.00	95,100
ダイキアクシス	100	1,006.00	100,600
ダイキョーニシカワ	600	1,105.00	663,000
竹本容器	100	2,969.00	296,900
森六ホールディングス	200	2,811.00	562,200
日本化薬	1,900	1,436.00	2,728,400
カーリットホールディングス	300	803.00	240,900
日本精化	200	1,062.00	212,400
扶桑化学工業	300	2,172.00	651,600
トリケミカル研究所	100	4,835.00	483,500
ADEKA	1,500	1,678.00	2,517,000
日油	1,200	3,840.00	4,608,000
ハリマ化成グループ	200	1,043.00	208,600
花王	7,400	8,178.00	60,517,200
第一工業製薬	100	3,125.00	312,500
石原ケミカル	100	1,898.00	189,800
日華化学	100	1,131.00	113,100
三洋化成工業	200	5,220.00	1,044,000
有機合成薬品工業	200	223.00	44,600
大日本塗料	300	1,046.00	313,800
日本ペイントホールディングス	2,500	3,850.00	9,625,000
関西ペイント	3,400	2,071.00	7,041,400
神東塗料	200	171.00	34,200
中国塗料	1,000	979.00	979,000
日本特殊塗料	200	1,416.00	283,200
藤倉化成	400	615.00	246,000
太陽ホールディングス	200	3,360.00	672,000
DIC	1,400	3,485.00	4,879,000

サカティンクス	700	1,195.00	836,500
東洋インキSCホールディングス	600	2,662.00	1,597,200
T&K TOKA	200	1,052.00	210,400
富士フイルムホールディングス	6,300	4,495.00	28,318,500
資生堂	6,100	7,101.00	43,316,100
ライオン	4,200	2,266.00	9,517,200
高砂香料工業	200	3,610.00	722,000
マンダム	700	3,210.00	2,247,000
ミルボン	400	4,455.00	1,782,000
ファンケル	1,400	2,868.00	4,015,200
コーセー	500	17,010.00	8,505,000
コタ	100	1,434.00	143,400
ポーラ・オルビスホールディングス	1,300	2,881.00	3,745,300
ノエビアホールディングス	200	4,965.00	993,000
アジュバンコスメジャパン	100	967.00	96,700
エステー	200	2,015.00	403,000
アグロ カネショウ	100	2,042.00	204,200
コニシ	500	1,703.00	851,500
長谷川香料	400	1,542.00	616,800
星光PMC	200	791.00	158,200
小林製薬	900	7,540.00	6,786,000
荒川化学工業	300	1,472.00	441,600
メック	200	1,187.00	237,400
日本高純度化学	100	2,322.00	232,200
タカラバイオ	800	2,812.00	2,249,600
JCU	400	1,556.00	622,400
新田ゼラチン	200	710.00	142,000
デクセリアルズ	800	819.00	655,200
アース製薬	200	5,180.00	1,036,000
北興化学工業	300	482.00	144,600
大成ラミック	100	2,991.00	299,100
クミアイ化学工業	1,300	766.00	995,800
日本農薬	700	490.00	343,000
アキレス	200	2,180.00	436,000
有沢製作所	500	789.00	394,500
日東電工	2,300	5,616.00	12,916,800
レック	300	1,922.00	576,600
きもと	500	193.00	96,500
藤森工業	300	3,055.00	916,500
前澤化成工業	200	1,077.00	215,400
JSP	200	2,266.00	453,200
エフピコ	300	6,540.00	1,962,000

天馬	200	1,844.00	368,800	
信越ポリマー	500	729.00	364,500	
東リ	800	274.00	219,200	
ニフコ	1,200	2,827.00	3,392,400	
バルカー	200	2,435.00	487,000	
ユニ・チャーム	6,500	3,496.00	22,724,000	
協和発酵キリン	3,800	2,291.00	8,705,800	
武田薬品工業	12,000	3,943.00	47,316,000	代用有価証券 2,600株
アステラス製薬	28,100	1,660.50	46,660,050	
大日本住友製薬	2,300	3,725.00	8,567,500	
塩野義製薬	4,000	7,015.00	28,060,000	
田辺三菱製薬	3,200	1,680.00	5,376,000	
わかもと製薬	400	270.00	108,000	
あすか製薬	400	1,155.00	462,000	
日本新薬	800	7,700.00	6,160,000	
ビオフェルミン製薬	100	2,675.00	267,500	
中外製薬	3,200	7,280.00	23,296,000	
科研製薬	600	5,300.00	3,180,000	
エーザイ	3,700	9,572.00	35,416,400	
ロート製薬	1,600	3,400.00	5,440,000	
小野薬品工業	7,200	2,654.00	19,108,800	
久光製薬	900	6,980.00	6,282,000	
持田製薬	200	10,040.00	2,008,000	
参天製薬	5,800	1,799.00	10,434,200	
扶桑薬品工業	100	2,669.00	266,900	
ツムラ	900	3,450.00	3,105,000	
日医工	800	1,885.00	1,508,000	
キッセイ薬品工業	500	3,215.00	1,607,500	
生化学工業	600	1,455.00	873,000	
栄研化学	500	2,565.00	1,282,500	
日水製薬	100	1,153.00	115,300	
鳥居薬品	200	2,644.00	528,800	
JCRファーマ	200	5,490.00	1,098,000	
東和薬品	100	8,480.00	848,000	
富士製薬工業	200	1,858.00	371,600	
沢井製薬	600	6,080.00	3,648,000	
ゼリア新薬工業	600	2,008.00	1,204,800	
第一三共	8,700	4,047.00	35,208,900	
キョーリン製薬ホールディングス	800	2,606.00	2,084,800	
大幸薬品	100	1,893.00	189,300	
ダイト	200	3,285.00	657,000	
大塚ホールディングス	5,800	5,375.00	31,175,000	

大正製薬ホールディングス	700	12,560.00	8,792,000
ペプチドリーム	1,400	4,725.00	6,615,000
昭和シェル石油	2,900	1,540.00	4,466,000
ニチレキ	400	1,120.00	448,000
ユシロ化学工業	200	1,241.00	248,200
ビーピー・カストロール	100	1,453.00	145,300
MORESCO	100	1,615.00	161,500
出光興産	2,400	3,595.00	8,628,000
JXTGホールディングス	51,900	609.50	31,633,050
コスモエネルギーホールディングス	900	2,516.00	2,264,400
横浜ゴム	1,800	2,289.00	4,120,200
東洋ゴム工業	1,600	1,521.00	2,433,600
ブリヂストン	9,400	4,539.00	42,666,600
住友ゴム工業	2,700	1,414.00	3,817,800
藤倉ゴム工業	300	468.00	140,400
オカモト	200	5,890.00	1,178,000
フコク	100	929.00	92,900
ニッタ	300	3,685.00	1,105,500
住友理工	600	981.00	588,600
三ツ星ベルト	400	2,189.00	875,600
バンドー化学	600	1,170.00	702,000
日東紡績	500	1,866.00	933,000
AGC	3,100	3,565.00	11,051,500
日本板硝子	1,500	880.00	1,320,000
日本山村硝子	100	1,604.00	160,400
日本電気硝子	1,300	2,876.00	3,738,800
オハラ	100	1,732.00	173,200
住友大阪セメント	600	4,670.00	2,802,000
太平洋セメント	1,900	3,625.00	6,887,500
日本ヒューム	300	899.00	269,700
日本コンクリート工業	700	272.00	190,400
三谷セキサン	100	2,814.00	281,400
アジアパイルホールディングス	400	659.00	263,600
東海カーボン	2,800	1,397.00	3,911,600
日本カーボン	100	4,645.00	464,500
東洋炭素	200	2,435.00	487,000
ノリタケカンパニーリミテド	200	4,630.00	926,000
TOTO	2,300	4,060.00	9,338,000
日本碍子	3,700	1,576.00	5,831,200
日本特殊陶業	2,600	2,244.00	5,834,400
MARUWA	100	6,280.00	628,000
品川リフラクトリーズ	100	4,055.00	405,500

黒崎播磨	100	7,150.00	715,000
ヨータイ	300	620.00	186,000
イソライト工業	200	475.00	95,000
東京窯業	400	403.00	161,200
ニッカー	100	919.00	91,900
フジインコーポレーテッド	300	2,196.00	658,800
クニミネ工業	100	923.00	92,300
ニチアス	800	1,979.00	1,583,200
ニチハ	400	2,862.00	1,144,800
新日鐵住金	13,500	1,991.00	26,878,500
神戸製鋼所	5,500	828.00	4,554,000
中山製鋼所	400	509.00	203,600
合同製鐵	100	1,721.00	172,100
ジェイ エフ イー ホールディングス	8,100	1,891.50	15,321,150
日新製鋼	700	1,412.00	988,400
東京製鐵	1,600	922.00	1,475,200
共英製鋼	300	1,817.00	545,100
大和工業	600	2,722.00	1,633,200
東京鐵鋼	100	1,251.00	125,100
大阪製鐵	200	1,876.00	375,200
淀川製鋼所	400	2,356.00	942,400
丸一鋼管	1,100	3,525.00	3,877,500
モリ工業	100	2,490.00	249,000
大同特殊鋼	500	4,500.00	2,250,000
日本冶金工業	2,500	245.00	612,500
山陽特殊製鋼	400	2,556.00	1,022,400
愛知製鋼	200	3,775.00	755,000
日立金属	3,200	1,196.00	3,827,200
大平洋金属	200	2,999.00	599,800
新日本電工	1,800	235.00	423,000
栗本鐵工所	200	1,447.00	289,400
三菱製鋼	200	1,808.00	361,600
日亜鋼業	400	312.00	124,800
エンビプロ・ホールディングス	100	513.00	51,300
シンニッタン	500	380.00	190,000
新家工業	100	1,645.00	164,500
大紀アルミニウム工業所	500	591.00	295,500
日本軽金属ホールディングス	8,200	232.00	1,902,400
三井金属鉱業	800	2,344.00	1,875,200
東邦亜鉛	200	3,410.00	682,000
三菱マテリアル	2,000	3,100.00	6,200,000
住友金属鉱山	4,100	3,204.00	13,136,400

DOWAホールディングス	700	3,495.00	2,446,500
古河機械金属	500	1,244.00	622,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	300	1,951.00	585,300
東邦チタニウム	500	1,114.00	557,000
UACJ	500	2,532.00	1,266,000
CKサンエツ	100	2,604.00	260,400
古河電気工業	900	2,840.00	2,556,000
住友電気工業	11,300	1,509.50	17,057,350
フジクラ	3,600	453.00	1,630,800
タツタ電線	600	504.00	302,400
平河ビューテック	100	1,172.00	117,200
リョービ	400	2,718.00	1,087,200
アーレスティ	400	642.00	256,800
アサヒホールディングス	600	2,378.00	1,426,800
稲葉製作所	200	1,337.00	267,400
宮地エンジニアリンググループ	100	2,008.00	200,800
トーカロ	800	893.00	714,400
アルファCo	100	1,348.00	134,800
SUMCO	3,300	1,396.00	4,606,800
川田テクノロジーズ	100	7,840.00	784,000
RS Technologies	100	3,195.00	319,500
東洋製罐グループホールディングス	1,900	2,569.00	4,881,100
ホッカンホールディングス	200	1,794.00	358,800
コロナ	200	1,119.00	223,800
横河ブリッジホールディングス	600	1,756.00	1,053,600
駒井ハルテック	100	1,993.00	199,300
三和ホールディングス	3,100	1,291.00	4,002,100
文化シャッター	900	741.00	666,900
三協立山	400	1,236.00	494,400
アルインコ	200	1,017.00	203,400
LIXILグループ	4,500	1,329.00	5,980,500
日本フィルコン	200	538.00	107,600
ノーリツ	700	1,526.00	1,068,200
長府製作所	300	2,277.00	683,100
リンナイ	500	7,450.00	3,725,000
ダイニチ工業	200	701.00	140,200
日東精工	400	595.00	238,000
岡部	600	938.00	562,800
ジーテクト	300	1,528.00	458,400
東プレ	600	2,284.00	1,370,400
高周波熱錬	600	917.00	550,200
東京製綱	200	1,051.00	210,200

サンコール	200	696.00	139,200
パイオラックス	500	2,388.00	1,194,000
エイチワン	300	1,037.00	311,100
日本発條	3,000	1,015.00	3,045,000
立川ブラインド工業	100	1,177.00	117,700
三益半導体工業	200	1,315.00	263,000
日本ドライケミカル	100	1,251.00	125,100
日本製鋼所	900	1,908.00	1,717,200
三浦工業	1,300	2,718.00	3,533,400
タクマ	1,100	1,435.00	1,578,500
ツガミ	700	696.00	487,200
オークマ	400	5,100.00	2,040,000
東芝機械	300	1,947.00	584,100
アマダホールディングス	4,700	1,024.00	4,812,800
アイダエンジニアリング	800	783.00	626,400
滝澤鉄工所	100	1,429.00	142,900
F U J I	900	1,303.00	1,172,700
牧野フライス製作所	400	4,075.00	1,630,000
オーエスジー	1,500	2,150.00	3,225,000
旭ダイヤモンド工業	800	634.00	507,200
D M G 森精機	1,900	1,326.00	2,519,400
ソディック	700	736.00	515,200
ディスコ	400	13,370.00	5,348,000
日東工器	200	2,263.00	452,600
日進工具	100	2,429.00	242,900
パンチ工業	200	523.00	104,600
富士ダイス	100	662.00	66,200
東洋機械金属	200	548.00	109,600
島精機製作所	400	3,410.00	1,364,000
オプトラン	300	1,824.00	547,200
フリュー	200	1,015.00	203,000
ヤマシンフィルタ	500	756.00	378,000
日阪製作所	400	896.00	358,400
やまびこ	600	1,104.00	662,400
平田機工	100	5,340.00	534,000
ペガサスミシン製造	300	737.00	221,100
ナブテスコ	1,700	2,608.00	4,433,600
三井海洋開発	300	2,476.00	742,800
レオン自動機	300	1,549.00	464,700
S M C	900	34,620.00	31,158,000
ホソカワミクロン	100	4,355.00	435,500
ユニオンツール	100	3,150.00	315,000

オイレス工業	400	1,896.00	758,400
日精エー・エス・ピー機械	100	3,545.00	354,500
サトーホールディングス	400	2,839.00	1,135,600
技研製作所	200	3,690.00	738,000
日本エアータック	100	671.00	67,100
カワタ	100	1,455.00	145,500
日精樹脂工業	300	973.00	291,900
オカダアイヨン	100	1,643.00	164,300
小松製作所	13,800	2,571.00	35,479,800
住友重機械工業	1,700	3,670.00	6,239,000
日立建機	1,200	2,636.00	3,163,200
日工	100	2,487.00	248,700
巴工業	100	2,325.00	232,500
井関農機	300	1,665.00	499,500
TOWA	300	646.00	193,800
丸山製作所	100	1,404.00	140,400
北川鉄工所	100	2,337.00	233,700
ローツェ	100	1,581.00	158,100
クボタ	16,400	1,733.50	28,429,400
荏原実業	100	2,058.00	205,800
三菱化工機	100	1,538.00	153,800
月島機械	600	1,329.00	797,400
帝国電機製作所	200	1,410.00	282,000
新東工業	700	886.00	620,200
澁谷工業	300	3,790.00	1,137,000
アイチ コーポレーション	500	604.00	302,000
小森コーポレーション	800	1,119.00	895,200
鶴見製作所	200	1,915.00	383,000
住友精密工業	100	3,260.00	326,000
酒井重工業	100	2,473.00	247,300
荏原製作所	1,400	2,687.00	3,761,800
西島製作所	300	983.00	294,900
北越工業	300	1,143.00	342,900
ダイキン工業	4,200	12,470.00	52,374,000
オルガノ	100	2,714.00	271,400
トーヨーカネツ	100	2,358.00	235,800
栗田工業	1,700	2,847.00	4,839,900
椿本チエイン	400	4,000.00	1,600,000
大同工業	100	947.00	94,700
木村化工機	300	391.00	117,300
アネスト岩田	500	1,148.00	574,000
ダイフク	1,700	5,550.00	9,435,000

サムコ	100	927.00	92,700
加藤製作所	200	2,752.00	550,400
油研工業	100	1,890.00	189,000
タダノ	1,500	1,103.00	1,654,500
フジテック	1,100	1,273.00	1,400,300
C K D	800	1,001.00	800,800
キトー	200	1,619.00	323,800
平和	900	2,426.00	2,183,400
理想科学工業	300	1,819.00	545,700
S A N K Y O	800	4,405.00	3,524,000
日本金銭機械	300	1,040.00	312,000
マースグループホールディングス	200	2,195.00	439,000
福島工業	200	3,755.00	751,000
オーイズミ	100	451.00	45,100
ダイコク電機	100	1,594.00	159,400
竹内製作所	500	1,912.00	956,000
アマノ	900	2,368.00	2,131,200
J U K I	400	1,264.00	505,600
サンデンホールディングス	400	776.00	310,400
蛇の目マシン工業	300	538.00	161,400
マックス	500	1,405.00	702,500
グローリー	800	2,583.00	2,066,400
新晃工業	300	1,587.00	476,100
大和冷機工業	400	1,129.00	451,600
セガサミーホールディングス	3,000	1,625.00	4,875,000
日本ピストンリング	100	1,937.00	193,700
リケン	100	5,130.00	513,000
T P R	400	2,312.00	924,800
ツバキ・ナカシマ	500	1,707.00	853,500
ホシザキ	900	6,340.00	5,706,000
大豊工業	200	1,019.00	203,800
日本精工	6,300	992.00	6,249,600
N T N	6,600	349.00	2,303,400
ジェイテクト	2,900	1,306.00	3,787,400
不二越	300	4,115.00	1,234,500
日本トムソン	900	522.00	469,800
T H K	1,900	2,314.00	4,396,600
ユーシン精機	200	1,019.00	203,800
前澤給装工業	100	1,976.00	197,600
イーグル工業	400	1,306.00	522,400
前澤工業	200	364.00	72,800
日本ピラー工業	300	1,376.00	412,800

キッツ	1,200	928.00	1,113,600
マキタ	3,700	4,200.00	15,540,000
日立造船	2,400	348.00	835,200
三菱重工業	5,100	4,192.00	21,379,200
I H I	2,300	3,515.00	8,084,500
スター精密	500	1,539.00	769,500
日清紡ホールディングス	1,700	908.00	1,543,600
イビデン	1,900	1,629.00	3,095,100
コニカミノルタ	6,700	1,028.00	6,887,600
ブラザー工業	4,000	1,707.00	6,828,000
ミネベアミツミ	5,700	1,654.00	9,427,800
日立製作所	13,700	3,221.00	44,127,700
三菱電機	30,500	1,306.00	39,833,000
富士電機	2,000	3,455.00	6,910,000
東洋電機製造	100	1,350.00	135,000
安川電機	3,500	3,005.00	10,517,500
シンフォニアテクノロジー	400	1,415.00	566,000
明電舎	600	1,468.00	880,800
オリジン電気	100	1,796.00	179,600
山洋電気	100	3,780.00	378,000
デンヨー	300	1,527.00	458,100
東芝テック	400	2,683.00	1,073,200
マブチモーター	800	3,645.00	2,916,000
日本電産	3,700	13,820.00	51,134,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	200	2,053.00	410,600
トレックス・セミコンダクター	100	1,421.00	142,100
東光高岳	200	1,472.00	294,400
ダブル・スコープ	400	1,070.00	428,000
宮越ホールディングス	100	1,127.00	112,700
ダイヘン	300	2,419.00	725,700
ヤーマン	400	1,628.00	651,200
JVCケンウッド	2,300	269.00	618,700
ミマキエンジニアリング	300	928.00	278,400
第一精工	100	1,254.00	125,400
日新電機	700	909.00	636,300
大崎電気工業	600	705.00	423,000
オムロン	3,200	4,405.00	14,096,000
日東工業	500	1,846.00	923,000
I D E C	400	2,095.00	838,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	1,100	2,475.00	2,722,500
サクサホールディングス	100	1,845.00	184,500
メルコホールディングス	100	3,670.00	367,000

テクノメディカ	100	2,054.00	205,400	
日本電気	3,900	3,580.00	13,962,000	
富士通	2,900	7,225.00	20,952,500	
沖電気工業	1,300	1,315.00	1,709,500	
岩崎通信機	100	739.00	73,900	
電気興業	200	2,534.00	506,800	
サンケン電気	400	2,057.00	822,800	
ナカヨ	100	1,500.00	150,000	
アイホン	200	1,713.00	342,600	
ルネサスエレクトロニクス	3,200	514.00	1,644,800	
セイコーエプソン	3,800	1,587.00	6,030,600	
ワコム	2,200	514.00	1,130,800	
アルバック	700	3,420.00	2,394,000	
E I Z O	300	4,060.00	1,218,000	
ジャパンディスプレイ	7,200	86.00	619,200	
日本信号	800	937.00	749,600	
京三製作所	700	434.00	303,800	
能美防災	400	2,022.00	808,800	
ホーチキ	200	1,191.00	238,200	
エレコム	300	2,970.00	891,000	
パナソニック	34,800	1,087.00	37,827,600	代用有価証券 7,500株
シャープ	3,000	1,239.00	3,717,000	
アンリツ	2,000	1,668.00	3,336,000	
富士通ゼネラル	900	1,497.00	1,347,300	
ソニー	20,400	5,839.00	119,115,600	代用有価証券 3,700株
T D K	1,600	7,930.00	12,688,000	
帝国通信工業	100	1,190.00	119,000	
タムラ製作所	1,200	574.00	688,800	
アルプス電気	2,800	2,382.00	6,669,600	
パイオニア	5,100	63.00	321,300	
鈴木	100	618.00	61,800	
日本トリム	100	5,940.00	594,000	
ローランド ディー . ジー .	200	2,358.00	471,600	
フォスター電機	400	1,465.00	586,000	
S M K	100	2,282.00	228,200	
ヨコオ	200	1,413.00	282,600	
ホシデン	900	771.00	693,900	
ヒロセ電機	400	10,860.00	4,344,000	
日本航空電子工業	700	1,320.00	924,000	
T O A	300	1,090.00	327,000	
マクセルホールディングス	700	1,483.00	1,038,100	

古野電気	400	1,199.00	479,600
アルパイン	500	1,612.00	806,000
スミダコーポレーション	300	1,336.00	400,800
アイコム	200	2,127.00	425,400
リオン	100	1,945.00	194,500
本多通信工業	300	506.00	151,800
船井電機	300	622.00	186,600
横河電機	3,100	2,041.00	6,327,100
新電元工業	100	4,005.00	400,500
アズビル	2,000	2,161.00	4,322,000
東亜ディーケーケー	200	842.00	168,400
日本光電工業	1,300	3,585.00	4,660,500
チノー	100	1,303.00	130,300
共和電業	300	402.00	120,600
日本電子材料	100	667.00	66,700
堀場製作所	600	4,890.00	2,934,000
アドバンテスト	2,100	2,119.00	4,449,900
小野測器	100	652.00	65,200
エスベック	300	1,954.00	586,200
キーエンス	1,500	57,180.00	85,770,000
日置電機	200	4,040.00	808,000
シスメックス	2,400	5,535.00	13,284,000
日本マイクロニクス	500	778.00	389,000
メガチップス	200	2,606.00	521,200
O B A R A G R O U P	200	4,285.00	857,000
原田工業	100	808.00	80,800
コーセル	400	949.00	379,600
イリソ電子工業	300	4,250.00	1,275,000
オブテックスグループ	500	1,978.00	989,000
千代田インテグレ	100	2,164.00	216,400
アイ・オー・データ機器	100	1,052.00	105,200
レーザーテック	600	3,255.00	1,953,000
スタンレー電気	2,200	3,155.00	6,941,000
岩崎電気	100	1,417.00	141,700
ウシオ電機	1,900	1,177.00	2,236,300
岡谷電機産業	200	374.00	74,800
ヘリオス テクノ ホールディング	300	671.00	201,300
日本セラミック	300	2,526.00	757,800
古河電池	200	750.00	150,000
山一電機	200	1,250.00	250,000
図研	200	1,689.00	337,800
日本電子	600	1,863.00	1,117,800

カシオ計算機	2,700	1,508.00	4,071,600	
ファナック	2,900	16,910.00	49,039,000	
日本シイエムケイ	800	701.00	560,800	
エンプラス	100	3,005.00	300,500	
ローム	1,500	7,150.00	10,725,000	
浜松ホトニクス	2,200	3,765.00	8,283,000	
三井ハイテック	300	900.00	270,000	
新光電気工業	1,000	766.00	766,000	
京セラ	4,600	5,789.00	26,629,400	
太陽誘電	1,400	1,838.00	2,573,200	
村田製作所	3,200	16,340.00	52,288,000	
双葉電子工業	500	1,634.00	817,000	
ニチコン	1,000	851.00	851,000	
日本ケミコン	200	1,993.00	398,600	
K O A	500	1,346.00	673,000	
市光工業	500	586.00	293,000	
小糸製作所	1,800	5,750.00	10,350,000	
ミツバ	600	626.00	375,600	
S C R E E Nホールディングス	500	5,060.00	2,530,000	
キャノン電子	300	2,012.00	603,600	
キャノン	16,400	3,171.00	52,004,400	代用有価証券 4,100株
リコー	9,200	1,122.00	10,322,400	
象印マホービン	600	1,124.00	674,400	
東京エレクトロン	2,000	13,585.00	27,170,000	
トヨタ紡織	1,100	1,689.00	1,857,900	
ユニプレス	600	1,953.00	1,171,800	
豊田自動織機	2,500	5,370.00	13,425,000	
モリタホールディングス	500	1,960.00	980,000	
三櫻工業	400	593.00	237,200	
デンソー	6,800	5,091.00	34,618,800	
東海理化電機製作所	800	1,890.00	1,512,000	
三井E & Sホールディングス	1,100	1,136.00	1,249,600	
川崎重工業	2,400	2,499.00	5,997,600	
名村造船所	900	488.00	439,200	
三菱ロジスネクスト	400	1,122.00	448,800	
日産自動車	36,000	929.90	33,476,400	
いすゞ自動車	9,600	1,643.50	15,777,600	
トヨタ自動車	34,000	6,840.00	232,560,000	代用有価証券 9,000株
日野自動車	3,800	1,132.00	4,301,600	
三菱自動車工業	11,300	664.00	7,503,200	
エフテック	200	953.00	190,600	

ファルテック	100	892.00	89,200	
武蔵精密工業	700	1,634.00	1,143,800	
日産車体	600	906.00	543,600	
新明和工業	1,400	1,462.00	2,046,800	
極東開発工業	600	1,513.00	907,800	
日信工業	600	1,462.00	877,200	
トピー工業	300	2,401.00	720,300	
ティラド	100	2,339.00	233,900	
タチエス	500	1,478.00	739,000	
N O K	1,600	1,578.00	2,524,800	
フタバ産業	800	542.00	433,600	
K Y B	300	2,612.00	783,600	
大同メタル工業	500	836.00	418,000	
プレス工業	1,500	566.00	849,000	
ミクニ	400	523.00	209,200	
太平洋工業	600	1,486.00	891,600	
ケーヒン	700	1,835.00	1,284,500	
河西工業	400	914.00	365,600	
アイシン精機	2,500	3,990.00	9,975,000	
マツダ	9,600	1,232.50	11,832,000	
今仙電機製作所	300	1,011.00	303,300	
本田技研工業	25,700	3,050.00	78,385,000	代用有価証券 6,000株
スズキ	5,600	5,486.00	30,721,600	
S U B A R U	9,500	2,465.50	23,422,250	
安永	100	1,569.00	156,900	
ヤマハ発動機	4,300	2,324.00	9,993,200	
ショーワ	700	1,357.00	949,900	
T B K	400	419.00	167,600	
エクセディ	400	2,740.00	1,096,000	
豊田合成	1,000	2,270.00	2,270,000	
愛三工業	500	764.00	382,000	
日本プラスト	200	789.00	157,800	
ヨロズ	300	1,425.00	427,500	
エフ・シー・シー	500	2,654.00	1,327,000	
シマノ	1,200	16,240.00	19,488,000	
テイ・エス テック	700	3,185.00	2,229,500	
ジャムコ	200	2,694.00	538,800	
テルモ	4,300	6,359.00	27,343,700	
クリエートメディック	100	1,089.00	108,900	
日機装	1,000	998.00	998,000	
島津製作所	3,900	2,375.00	9,262,500	
J M S	300	546.00	163,800	

長野計器	200	831.00	166,200
ブイ・テクノロジー	100	14,250.00	1,425,000
東京計器	200	995.00	199,000
インターアクション	200	2,035.00	407,000
オーバル	300	255.00	76,500
東京精密	600	3,020.00	1,812,000
マニー	400	4,885.00	1,954,000
ニコン	5,300	1,704.00	9,031,200
トプコン	1,600	1,573.00	2,516,800
オリンパス	4,500	3,270.00	14,715,000
理研計器	300	2,076.00	622,800
タムロン	300	1,694.00	508,200
H O Y A	6,100	6,845.00	41,754,500
シード	100	1,269.00	126,900
ノーリツ鋼機	200	1,673.00	334,600
朝日インテック	1,100	4,995.00	5,494,500
シチズン時計	3,300	572.00	1,887,600
リズム時計工業	100	1,998.00	199,800
大研医器	200	688.00	137,600
メニコン	400	2,844.00	1,137,600
松風	100	1,110.00	111,000
セイコーホールディングス	500	2,311.00	1,155,500
ニプロ	2,100	1,401.00	2,942,100
中本パックス	100	1,785.00	178,500
スノーピーク	100	1,231.00	123,100
パラマウントベッドホールディングス	400	4,815.00	1,926,000
トランザクション	200	704.00	140,800
S H O - B I	100	383.00	38,300
ニホンフラッシュ	100	1,747.00	174,700
前田工織	300	2,696.00	808,800
永大産業	400	422.00	168,800
アートネイチャー	300	663.00	198,900
バンダイナムコホールディングス	3,200	4,850.00	15,520,000
アイフィスジャパン	100	660.00	66,000
共立印刷	500	224.00	112,000
S H O E I	100	4,200.00	420,000
フランスベッドホールディングス	400	945.00	378,000
パイロットコーポレーション	500	5,830.00	2,915,000
萩原工業	200	1,743.00	348,600
トッパン・フォームズ	700	923.00	646,100
フジシールインターナショナル	700	3,655.00	2,558,500
タカラトミー	1,300	1,258.00	1,635,400

廣濟堂	300	377.00	113,100
エステールホールディングス	100	667.00	66,700
タカノ	100	866.00	86,600
プロネクサス	300	1,044.00	313,200
大建工業	200	1,985.00	397,000
凸版印刷	4,300	1,766.00	7,593,800
大日本印刷	4,300	2,449.00	10,530,700
図書印刷	300	765.00	229,500
共同印刷	100	2,492.00	249,200
N I S S H A	600	1,465.00	879,000
宝印刷	200	1,813.00	362,600
アシックス	3,000	1,583.00	4,749,000
ツツミ	100	2,024.00	202,400
小松ウオール工業	100	2,017.00	201,700
ヤマハ	1,800	5,200.00	9,360,000
河合楽器製作所	100	3,275.00	327,500
クリナップ	300	684.00	205,200
ピジョン	1,800	4,930.00	8,874,000
キングジム	300	888.00	266,400
リンテック	700	2,428.00	1,699,600
イトーキ	600	604.00	362,400
任天堂	1,900	32,070.00	60,933,000
三菱鉛筆	500	2,118.00	1,059,000
タカラスタンダード	600	1,746.00	1,047,600
コクヨ	1,500	1,654.00	2,481,000
ナカバヤシ	300	541.00	162,300
グローブライド	100	2,593.00	259,300
オカムラ	1,100	1,479.00	1,626,900
美津濃	300	2,409.00	722,700
東京電力ホールディングス	24,300	763.00	18,540,900
中部電力	9,300	1,706.00	15,865,800
関西電力	12,400	1,814.50	22,499,800
中国電力	4,200	1,468.00	6,165,600
北陸電力	3,000	1,045.00	3,135,000
東北電力	7,100	1,530.00	10,863,000
四国電力	2,700	1,436.00	3,877,200
九州電力	6,300	1,388.00	8,744,400
北海道電力	2,900	827.00	2,398,300
沖縄電力	600	2,176.00	1,305,600
電源開発	2,400	2,863.00	6,871,200
エフオン	200	947.00	189,400
イーレックス	500	689.00	344,500

レノバ	300	988.00	296,400
東京瓦斯	6,000	2,956.50	17,739,000
大阪瓦斯	5,900	2,160.00	12,744,000
東邦瓦斯	1,500	4,800.00	7,200,000
北海道瓦斯	200	1,548.00	309,600
広島ガス	600	352.00	211,200
西部瓦斯	300	2,569.00	770,700
静岡ガス	900	949.00	854,100
メタウォーター	100	3,085.00	308,500
SBSホールディングス	300	1,474.00	442,200
東武鉄道	3,200	3,145.00	10,064,000
相鉄ホールディングス	1,000	3,390.00	3,390,000
東京急行電鉄	8,300	1,880.00	15,604,000
京浜急行電鉄	4,200	1,873.00	7,866,600
小田急電鉄	4,900	2,499.00	12,245,100
京王電鉄	1,700	6,640.00	11,288,000
京成電鉄	2,300	3,595.00	8,268,500
富士急行	400	3,195.00	1,278,000
新京成電鉄	100	2,117.00	211,700
東日本旅客鉄道	5,400	10,220.00	55,188,000
西日本旅客鉄道	2,700	7,985.00	21,559,500
東海旅客鉄道	2,700	23,485.00	63,409,500
西武ホールディングス	3,900	2,103.00	8,201,700
鴻池運輸	500	1,668.00	834,000
西日本鉄道	800	2,826.00	2,260,800
ハマキョウレックス	200	3,750.00	750,000
サカイ引越センター	200	5,960.00	1,192,000
近鉄グループホールディングス	2,900	4,850.00	14,065,000
阪急阪神ホールディングス	3,900	3,850.00	15,015,000
南海電気鉄道	1,300	2,976.00	3,868,800
京阪ホールディングス	1,300	4,605.00	5,986,500
神戸電鉄	100	3,980.00	398,000
名古屋鉄道	2,300	2,867.00	6,594,100
山陽電気鉄道	200	2,258.00	451,600
日本通運	1,100	6,500.00	7,150,000
ヤマトホールディングス	5,100	3,103.00	15,825,300
山九	800	5,230.00	4,184,000
丸運	200	311.00	62,200
丸全昭和運輸	200	2,824.00	564,800
センコーグループホールディングス	1,600	847.00	1,355,200
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	2,744.00	3,018,400

福山通運	400	4,585.00	1,834,000
セイノーホールディングス	2,200	1,557.00	3,425,400
エスライン	100	1,163.00	116,300
神奈川中央交通	100	3,830.00	383,000
日立物流	600	3,045.00	1,827,000
丸和運輸機関	200	3,100.00	620,000
C & F ロジホールディングス	300	1,235.00	370,500
九州旅客鉄道	2,400	3,780.00	9,072,000
S Gホールディングス	2,700	2,876.00	7,765,200
日本郵船	2,400	1,896.00	4,550,400
商船三井	1,700	2,602.00	4,423,400
川崎汽船	900	1,547.00	1,392,300
N S ユナイテッド海運	200	3,165.00	633,000
飯野海運	1,400	425.00	595,000
乾汽船	300	916.00	274,800
日本航空	5,300	3,963.00	21,003,900
A N Aホールディングス	5,300	3,995.00	21,173,500
パスコ	100	864.00	86,400
トランコム	100	6,390.00	639,000
日新	200	1,892.00	378,400
三菱倉庫	1,000	2,669.00	2,669,000
三井倉庫ホールディングス	400	1,860.00	744,000
住友倉庫	1,100	1,407.00	1,547,700
澁澤倉庫	200	1,617.00	323,400
東陽倉庫	500	294.00	147,000
日本トランスシティ	600	455.00	273,000
ケイヒン	100	1,362.00	136,200
中央倉庫	200	1,030.00	206,000
川西倉庫	100	1,480.00	148,000
安田倉庫	200	804.00	160,800
東洋埠頭	100	1,454.00	145,400
宇徳	200	514.00	102,800
上組	1,800	2,418.00	4,352,400
キムラユニティー	100	1,043.00	104,300
キューソー流通システム	100	2,315.00	231,500
近鉄エクスプレス	500	1,761.00	880,500
東海運	200	327.00	65,400
エーアイティー	200	964.00	192,800
内外トランスライン	100	1,504.00	150,400
日本コンセプト	100	1,130.00	113,000
N E C ネットズエスアイ	300	2,448.00	734,400
システナ	1,100	1,419.00	1,560,900

デジタルアーツ	200	6,350.00	1,270,000
新日鉄住金ソリューションズ	400	2,855.00	1,142,000
キューブシステム	200	703.00	140,600
コア	100	1,263.00	126,300
ソフトクリエイティブホールディングス	100	1,622.00	162,200
T I S	1,000	4,825.00	4,825,000
電算システム	100	2,350.00	235,000
グリー	1,600	465.00	744,000
コーエーテクモホールディングス	600	1,955.00	1,173,000
三菱総合研究所	100	3,395.00	339,500
A G S	200	696.00	139,200
ファインデックス	300	691.00	207,300
ヒト・コミュニケーションズ	100	1,630.00	163,000
ブレインパッド	100	6,350.00	635,000
K L a b	500	929.00	464,500
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	200	2,022.00	404,400
ネクソン	7,600	1,373.00	10,434,800
アイスタイル	800	938.00	750,400
エムアップ	100	2,052.00	205,200
エイチーム	200	1,571.00	314,200
テクノスジャパン	300	940.00	282,000
コロプラ	900	806.00	725,400
ブロードリーフ	1,500	596.00	894,000
デジタルハーツホールディングス	100	1,564.00	156,400
じげん	300	553.00	165,900
フィックスターズ	300	1,149.00	344,700
VOYAGE GROUP	200	1,102.00	220,400
オブティム	100	4,855.00	485,500
セレス	100	1,806.00	180,600
ティーガイア	300	2,200.00	660,000
豆蔵ホールディングス	200	1,080.00	216,000
テクマトリックス	200	1,891.00	378,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	7,200	217.00	1,562,400
GMOペイメントゲートウェイ	500	5,820.00	2,910,000
ザッパラス	100	393.00	39,300
インターネットイニシアティブ	500	2,597.00	1,298,500
さくらインターネット	400	512.00	204,800
ヴィンクス	100	1,443.00	144,300
GMOクラウド	100	3,485.00	348,500
SRAホールディングス	200	2,824.00	564,800
Minor iソリューションズ	100	1,676.00	167,600
朝日ネット	200	524.00	104,800

e B A S E	100	1,600.00	160,000
アバント	100	1,205.00	120,500
アドソル日進	100	1,944.00	194,400
コムチュア	200	3,455.00	691,000
サイバーコム	100	1,969.00	196,900
メディカル・データ・ビジョン	300	1,013.00	303,900
モバイルファクトリー	100	1,199.00	119,900
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	100	1,683.00	168,300
ネオジャパン	100	720.00	72,000
オープンドア	100	2,593.00	259,300
アカツキ	100	5,940.00	594,000
L I N E	900	3,655.00	3,289,500
オークネット	200	1,075.00	215,000
A O I T Y O H o l d i n g s	300	858.00	257,400
マクロミル	400	1,621.00	648,400
フェイス	100	1,038.00	103,800
野村総合研究所	1,900	4,755.00	9,034,500
サイバネットシステム	200	665.00	133,000
インテージホールディングス	400	985.00	394,000
東邦システムサイエンス	100	877.00	87,700
ソースネクスト	1,200	604.00	724,800
F I G	300	376.00	112,800
フォーカスシステムズ	200	1,061.00	212,200
クレスコ	100	3,215.00	321,500
フジ・メディア・ホールディングス	3,100	1,638.00	5,077,800
オービック	1,000	9,400.00	9,400,000
ジャストシステム	400	2,409.00	963,600
T D C ソフト	300	895.00	268,500
ヤフー	19,500	290.00	5,655,000
トレンドマイクロ	1,600	6,390.00	10,224,000
インフォメーション・ディベロプメント	100	1,332.00	133,200
日本オラクル	500	7,130.00	3,565,000
アルファシステムズ	100	2,797.00	279,700
フューチャー	400	1,662.00	664,800
C A C H o l d i n g s	200	1,014.00	202,800
ソフトバンク・テクノロジー	100	1,904.00	190,400
オービックビジネスコンサルタント	200	9,740.00	1,948,000
伊藤忠テクノソリューションズ	1,400	2,193.00	3,070,200
アイティフォー	400	727.00	290,800
エクスネット	100	908.00	90,800
大塚商会	1,600	3,410.00	5,456,000
サイボウズ	300	671.00	201,300

ソフトブレーン	200	480.00	96,000
電通国際情報サービス	200	3,105.00	621,000
デジタルガレージ	600	2,812.00	1,687,200
EMシステムズ	200	1,093.00	218,600
ウェザーニューズ	100	3,130.00	313,000
C I J	200	721.00	144,200
日本エンタープライズ	300	217.00	65,100
WOWOW	100	3,200.00	320,000
スカラ	200	787.00	157,400
ネットワンシステムズ	1,100	2,180.00	2,398,000
アルゴグラフィックス	100	4,210.00	421,000
マーベラス	500	843.00	421,500
エイベックス	500	1,550.00	775,000
日本ユニシス	900	2,815.00	2,533,500
兼松エレクトロニクス	200	3,375.00	675,000
東京放送ホールディングス	2,000	1,870.00	3,740,000
日本テレビホールディングス	2,700	1,754.00	4,735,800
朝日放送グループホールディングス	300	743.00	222,900
テレビ朝日ホールディングス	800	2,202.00	1,761,600
スカパーJ S A Tホールディングス	2,300	515.00	1,184,500
テレビ東京ホールディングス	200	2,570.00	514,000
日本BS放送	100	1,212.00	121,200
ビジョン	100	3,965.00	396,500
コネクシオ	200	1,387.00	277,400
日本通信	2,500	114.00	285,000
日本電信電話	20,500	4,727.00	96,903,500
K D D I	26,400	2,665.50	70,369,200
光通信	400	18,600.00	7,440,000
N T T ドコモ	21,500	2,572.00	55,298,000
エムティーアイ	300	555.00	166,500
G M O インターネット	1,100	1,450.00	1,595,000
アйдママーケティングコミュニケーション	100	505.00	50,500
カドカワ	900	1,239.00	1,115,100
学研ホールディングス	100	4,370.00	437,000
ゼンリン	600	2,689.00	1,613,400
アイネット	200	1,507.00	301,400
松竹	200	11,180.00	2,236,000
東宝	2,000	3,900.00	7,800,000
東映	100	13,340.00	1,334,000
エヌ・ティ・ティ・データ	8,000	1,336.00	10,688,000
ビジネスブレイン太田昭和	100	2,018.00	201,800
D T S	300	3,760.00	1,128,000

スクウェア・エニックス・ホールディングス	1,400	3,170.00	4,438,000	
シーイーシー	300	2,130.00	639,000	
カブコン	1,300	2,189.00	2,845,700	
アイ・エス・ピー	100	2,076.00	207,600	
ジャステック	200	1,009.00	201,800	
S C S K	800	4,105.00	3,284,000	
日本システムウエア	100	2,036.00	203,600	
アイネス	400	1,078.00	431,200	
T K C	300	3,895.00	1,168,500	
富士ソフト	400	4,480.00	1,792,000	
N S D	500	2,193.00	1,096,500	
コナミホールディングス	1,200	4,940.00	5,928,000	
福井コンピュータホールディングス	100	1,500.00	150,000	
J B C Cホールディングス	200	1,715.00	343,000	
ミロク情報サービス	300	2,494.00	748,200	
ソフトバンクグループ	12,500	8,540.00	106,750,000	
高千穂交易	100	999.00	99,900	
伊藤忠食品	100	5,050.00	505,000	
エレマテック	100	2,088.00	208,800	
J A L U X	100	2,724.00	272,400	
あらた	200	4,570.00	914,000	
東京エレクトロン デバイス	100	1,760.00	176,000	
フィールズ	300	888.00	266,400	
双日	16,600	408.00	6,772,800	
アルフレッサ ホールディングス	3,300	3,060.00	10,098,000	
横浜冷凍	800	968.00	774,400	
ラサ商事	200	919.00	183,800	
アルコニックス	300	1,170.00	351,000	
神戸物産	500	3,310.00	1,655,000	
あい ホールディングス	500	2,086.00	1,043,000	
ディーブイエックス	100	1,195.00	119,500	
ダイワボウホールディングス	300	5,390.00	1,617,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	800	1,475.00	1,180,000	
ラクト・ジャパン	100	7,450.00	745,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	600	1,163.00	697,800	
八洲電機	200	805.00	161,000	
メディアスホールディングス	200	744.00	148,800	
U K Cホールディングス	200	2,156.00	431,200	
ジュテックホールディングス	100	966.00	96,600	
O C H Iホールディングス	100	1,183.00	118,300	
T O K A Iホールディングス	1,600	951.00	1,521,600	
三洋貿易	200	1,809.00	361,800	

ウイン・パートナーズ	200	1,026.00	205,200
シップヘルスケアホールディングス	600	4,280.00	2,568,000
明治電機工業	100	1,764.00	176,400
デリカフーズホールディングス	100	1,421.00	142,100
コメダホールディングス	700	2,346.00	1,642,200
富士興産	100	614.00	61,400
小野建	300	1,647.00	494,100
佐島電機	200	935.00	187,000
伯東	200	1,215.00	243,000
コンドーテック	200	1,016.00	203,200
中山福	200	520.00	104,000
ナガイレーベン	400	2,681.00	1,072,400
三菱食品	300	3,065.00	919,500
松田産業	200	1,548.00	309,600
第一興商	400	5,220.00	2,088,000
メディバルホールディングス	3,200	2,522.00	8,070,400
S P K	100	2,333.00	233,300
萩原電気ホールディングス	100	2,894.00	289,400
アズワン	200	7,820.00	1,564,000
スズデン	100	1,256.00	125,600
尾家産業	100	1,329.00	132,900
シモジマ	200	1,103.00	220,600
ドウシシャ	300	1,920.00	576,000
小津産業	100	1,905.00	190,500
高速	200	1,053.00	210,600
たけびし	100	1,369.00	136,900
リックス	100	1,511.00	151,100
丸文	300	766.00	229,800
ハビネット	300	1,545.00	463,500
橋本総業ホールディングス	100	1,594.00	159,400
日本ライフライン	900	1,569.00	1,412,100
タカショー	100	472.00	47,200
エクセル	100	1,969.00	196,900
マルカキカイ	100	2,062.00	206,200
I D O M	1,000	375.00	375,000
日本エム・ディ・エム	200	1,194.00	238,800
進和	200	2,122.00	424,400
ダイトロン	100	1,323.00	132,300
シークス	400	1,562.00	624,800
田中商事	100	593.00	59,300
オーハシテクニカ	200	1,363.00	272,600
白銅	100	1,627.00	162,700

伊藤忠商事	21,000	1,996.50	41,926,500	
丸紅	29,600	825.80	24,443,680	
長瀬産業	1,700	1,570.00	2,669,000	
蝶理	200	1,745.00	349,000	
豊田通商	3,400	3,465.00	11,781,000	
三共生興	500	429.00	214,500	
兼松	1,200	1,394.00	1,672,800	
ツカモトコーポレーション	100	1,157.00	115,700	
三井物産	24,700	1,743.00	43,052,100	
日本紙パルプ商事	200	4,340.00	868,000	
日立ハイテクノロジーズ	900	3,560.00	3,204,000	
カメイ	400	1,222.00	488,800	
スターゼン	100	3,950.00	395,000	
山善	1,200	1,065.00	1,278,000	
椿本興業	100	3,265.00	326,500	
住友商事	17,800	1,665.50	29,645,900	
内田洋行	100	2,710.00	271,000	
三菱商事	21,100	3,145.00	66,359,500	代用有価証券 5,200株
第一実業	100	3,670.00	367,000	
キャノンマーケティングジャパン	900	2,030.00	1,827,000	
西華産業	200	1,550.00	310,000	
佐藤商事	300	910.00	273,000	
菱洋エレクトロ	300	1,585.00	475,500	
東京産業	300	522.00	156,600	
ユアサ商事	300	3,320.00	996,000	
神鋼商事	100	2,613.00	261,300	
小林産業	200	318.00	63,600	
阪和興業	500	2,969.00	1,484,500	
正栄食品工業	200	3,215.00	643,000	
カナデン	300	1,323.00	396,900	
菱電商事	200	1,500.00	300,000	
フルサト工業	200	1,736.00	347,200	
岩谷産業	700	3,725.00	2,607,500	
極東貿易	100	1,565.00	156,500	
イワキ	400	488.00	195,200	
三愛石油	800	1,148.00	918,400	
稲畑産業	700	1,536.00	1,075,200	
G S Iクレオス	100	1,383.00	138,300	
明和産業	300	397.00	119,100	
ワキタ	600	1,246.00	747,600	
東邦ホールディングス	900	2,887.00	2,598,300	
サンゲツ	900	2,098.00	1,888,200	

ミツウロコグループホールディングス	400	671.00	268,400
シナネンホールディングス	100	2,462.00	246,200
伊藤忠エネクス	700	1,033.00	723,100
サンリオ	900	2,365.00	2,128,500
サンワテクノス	200	1,100.00	220,000
リョーサン	300	3,010.00	903,000
新光商事	300	1,725.00	517,500
トーホー	100	2,288.00	228,800
三信電気	200	1,847.00	369,400
東陽テクニカ	300	838.00	251,400
モスフードサービス	400	3,000.00	1,200,000
加賀電子	300	2,100.00	630,000
ソーダニッカ	300	549.00	164,700
立花エレテック	200	1,617.00	323,400
フォーバル	100	932.00	93,200
PALTAC	500	5,570.00	2,785,000
三谷産業	400	291.00	116,400
太平洋興発	100	800.00	80,000
西本Wismettacホールディングス	100	4,960.00	496,000
国際紙パルプ商事	500	290.00	145,000
ヤマタネ	200	1,687.00	337,400
日鉄住金物産	200	4,730.00	946,000
泉州電業	100	2,904.00	290,400
トラスコ中山	600	3,095.00	1,857,000
オートバックスセブン	1,200	1,771.00	2,125,200
モリト	200	820.00	164,000
加藤産業	500	3,365.00	1,682,500
イノテック	200	1,024.00	204,800
イエローハット	300	2,791.00	837,300
JKホールディングス	300	575.00	172,500
日伝	200	1,580.00	316,000
杉本商事	200	1,706.00	341,200
因幡電機産業	400	4,510.00	1,804,000
バイテックホールディングス	100	2,156.00	215,600
東テク	100	2,559.00	255,900
ミスミグループ本社	3,800	2,398.00	9,112,400
タキヒヨー	100	1,907.00	190,700
スズケン	1,400	6,070.00	8,498,000
ジェコス	200	1,093.00	218,600
ルネサスイーストン	300	409.00	122,700
ローソン	800	7,350.00	5,880,000
サンエー	200	4,625.00	925,000

カワチ薬品	200	1,990.00	398,000
エービーシー・マート	500	6,310.00	3,155,000
ハードオフコーポレーション	100	862.00	86,200
アスクル	300	2,720.00	816,000
ゲオホールディングス	500	1,743.00	871,500
アダストリア	400	2,053.00	821,200
ジーフット	200	743.00	148,600
くらコーポレーション	200	5,800.00	1,160,000
キャンドウ	100	1,677.00	167,700
パルグループホールディングス	200	2,880.00	576,000
エディオン	1,300	1,132.00	1,471,600
サーラコーポレーション	600	647.00	388,200
ワッツ	100	773.00	77,300
ハローズ	100	2,425.00	242,500
あみやき亭	100	3,885.00	388,500
ひらまつ	600	352.00	211,200
大黒天物産	100	4,360.00	436,000
ハニーズホールディングス	300	821.00	246,300
アルペン	200	1,838.00	367,600
ハブ	100	966.00	96,600
クオールホールディングス	400	1,968.00	787,200
ジーンズ	200	6,400.00	1,280,000
ビックカメラ	1,600	1,558.00	2,492,800
DCMホールディングス	1,600	1,112.00	1,779,200
ペッパーフードサービス	200	3,500.00	700,000
Monotaro	1,900	3,040.00	5,776,000
アークランドサービスホールディングス	200	2,348.00	469,600
J.フロント リテイリング	3,800	1,484.00	5,639,200
ドトール・日レスホールディングス	500	2,201.00	1,100,500
マツモトキヨシホールディングス	1,200	3,880.00	4,656,000
ブロンコビリー	200	2,948.00	589,600
ZOZO	3,200	2,537.00	8,118,400
トレジャー・ファクトリー	100	704.00	70,400
物語コーポレーション	100	9,950.00	995,000
ココカラファイン	300	5,790.00	1,737,000
三越伊勢丹ホールディングス	5,600	1,306.00	7,313,600
Hamee	100	1,281.00	128,100
ウエルシアホールディングス	800	6,040.00	4,832,000
クリエイティブSDホールディングス	400	2,909.00	1,163,600
丸善CHIホールディングス	400	341.00	136,400
チムニー	100	2,687.00	268,700
シュッピン	200	823.00	164,600

ネクステージ	500	1,123.00	561,500
ジョイフル本田	900	1,574.00	1,416,600
鳥貴族	100	1,930.00	193,000
すかいらーくホールディングス	2,800	1,945.00	5,446,000
綿半ホールディングス	100	2,546.00	254,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	900	1,273.00	1,145,700
ゴルフダイジェスト・オンライン	100	763.00	76,300
B E E N O S	100	1,427.00	142,700
あさひ	200	1,384.00	276,800
日本調剤	100	3,420.00	342,000
コスモス薬品	200	20,670.00	4,134,000
トーエル	100	752.00	75,200
オンリー	100	1,045.00	104,500
セブン&アイ・ホールディングス	12,600	4,923.00	62,029,800
薬王堂	100	2,979.00	297,900
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	800	1,287.00	1,029,600
ツルハホールディングス	700	11,290.00	7,903,000
サンマルクホールディングス	200	2,732.00	546,400
フェリシモ	100	1,189.00	118,900
トリドールホールディングス	400	2,138.00	855,200
T O K Y O B A S E	300	595.00	178,500
ジャパンミート	100	2,122.00	212,200
ダイユー・リックホールディングス	200	1,024.00	204,800
パロックジャパンリミテッド	200	1,043.00	208,600
クスリのアオキホールディングス	200	8,030.00	1,606,000
スシローグローバルホールディングス	300	6,340.00	1,902,000
L I X I L ビバ	300	1,791.00	537,300
はるやまホールディングス	100	844.00	84,400
ノジマ	500	2,299.00	1,149,500
ライトオン	300	902.00	270,600
良品計画	400	28,930.00	11,572,000
三城ホールディングス	400	448.00	179,200
アドヴァン	500	971.00	485,500
アルビス	100	2,612.00	261,200
コナカ	400	471.00	188,400
G - 7ホールディングス	100	2,400.00	240,000
イオン北海道	300	804.00	241,200
ヒマラヤ	100	970.00	97,000
コーナン商事	400	2,750.00	1,100,000
エコス	100	2,107.00	210,700
ワタミ	400	1,352.00	540,800

ドンキホーテホールディングス	1,900	7,290.00	13,851,000
西松屋チェーン	700	882.00	617,400
ゼンショーホールディングス	1,400	2,837.00	3,971,800
ハークスレイ	100	1,094.00	109,400
サイゼリヤ	500	2,002.00	1,001,000
V Tホールディングス	1,000	441.00	441,000
魚力	100	1,438.00	143,800
フジ・コーポレーション	100	2,085.00	208,500
ユナイテッドアローズ	300	4,040.00	1,212,000
ハイデイ日高	400	2,336.00	934,400
コロワイド	1,000	2,621.00	2,621,000
ピーシーデポコーポレーション	400	447.00	178,800
壱番屋	200	4,605.00	921,000
P L A N T	100	1,043.00	104,300
スギホールディングス	700	4,900.00	3,430,000
スクロール	500	409.00	204,500
ヨンドシーホールディングス	300	2,359.00	707,700
ユニー・ファミリーマートホールディングス	800	17,610.00	14,088,000
木曽路	400	2,605.00	1,042,000
S R Sホールディングス	400	1,011.00	404,400
ケーヨー	600	524.00	314,400
上新電機	400	2,592.00	1,036,800
日本瓦斯	600	4,230.00	2,538,000
ロイヤルホールディングス	500	2,775.00	1,387,500
いなげや	300	1,480.00	444,000
島忠	700	3,040.00	2,128,000
チヨダ	300	1,882.00	564,600
ライフコーポレーション	200	2,503.00	500,600
リンガーハット	400	2,378.00	951,200
M r M a x H D	400	514.00	205,600
A O K Iホールディングス	600	1,364.00	818,400
オークワ	400	1,180.00	472,000
コメリ	500	2,512.00	1,256,000
青山商事	600	2,783.00	1,669,800
しまむら	300	9,390.00	2,817,000
はせがわ	200	436.00	87,200
高島屋	2,400	1,542.00	3,700,800
松屋	600	1,195.00	717,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	1,500	1,759.00	2,638,500
近鉄百貨店	100	3,620.00	362,000
パルコ	300	1,200.00	360,000
丸井グループ	2,500	2,297.00	5,742,500

アクシアル リテイリング	200	3,910.00	782,000
イオン	11,600	2,641.00	30,635,600
イズミ	600	5,800.00	3,480,000
平和堂	600	2,967.00	1,780,200
フジ	400	1,996.00	798,400
ヤオコー	300	6,410.00	1,923,000
ゼビオホールディングス	400	1,368.00	547,200
ケーズホールディングス	3,100	1,110.00	3,441,000
日産東京販売ホールディングス	400	335.00	134,000
Genky DrugStores	100	3,565.00	356,500
総合メディカルホールディングス	300	2,342.00	702,600
ブックオフグループホールディングス	200	780.00	156,000
アインホールディングス	400	8,500.00	3,400,000
元気寿司	100	4,565.00	456,500
ヤマダ電機	9,200	543.00	4,995,600
アークランドサカモト	500	1,447.00	723,500
ニトリホールディングス	1,300	14,780.00	19,214,000
グルメ杵屋	200	1,183.00	236,600
愛眼	200	307.00	61,400
ケーユーホールディングス	200	856.00	171,200
吉野家ホールディングス	1,000	1,899.00	1,899,000
松屋フーズホールディングス	100	3,840.00	384,000
サガミホールディングス	400	1,375.00	550,000
関西スーパーマーケット	200	1,020.00	204,000
王将フードサービス	200	7,920.00	1,584,000
プレナス	300	1,946.00	583,800
ミニストップ	200	2,087.00	417,400
アークス	600	2,586.00	1,551,600
パローホールディングス	600	2,755.00	1,653,000
ベルク	100	5,690.00	569,000
大庄	200	1,632.00	326,400
ファーストリテイリング	400	60,990.00	24,396,000
サンドラッグ	1,100	3,815.00	4,196,500
サクスパー ホールディングス	300	1,177.00	353,100
ヤマザワ	100	1,713.00	171,300
やまや	100	2,330.00	233,000
ベルーナ	700	1,028.00	719,600
めぶきフィナンシャルグループ	15,600	312.00	4,867,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	400	1,788.00	715,200
九州フィナンシャルグループ	4,900	475.00	2,327,500
ゆうちょ銀行	8,500	1,260.00	10,710,000
富山第一銀行	700	416.00	291,200

コンコルディア・フィナンシャルグループ	19,200	473.00	9,081,600
西日本フィナンシャルホールディングス	1,900	1,064.00	2,021,600
関西みらいフィナンシャルグループ	1,400	821.00	1,149,400
三十三フィナンシャルグループ	300	1,813.00	543,900
第四北越フィナンシャルグループ	500	3,245.00	1,622,500
新生銀行	2,200	1,397.00	3,073,400
あおぞら銀行	1,700	3,575.00	6,077,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	209,500	583.90	122,327,050
りそなホールディングス	33,000	555.00	18,315,000
三井住友トラスト・ホールディングス	5,900	4,261.00	25,139,900
三井住友フィナンシャルグループ	21,200	3,939.00	83,506,800
千葉銀行	10,700	652.00	6,976,400
群馬銀行	6,000	491.00	2,946,000
武蔵野銀行	400	2,659.00	1,063,600
千葉興業銀行	800	400.00	320,000
筑波銀行	1,300	212.00	275,600
七十七銀行	900	2,062.00	1,855,800
青森銀行	200	2,922.00	584,400
秋田銀行	200	2,307.00	461,400
山形銀行	300	2,217.00	665,100
岩手銀行	200	3,870.00	774,000
東邦銀行	2,700	324.00	874,800
東北銀行	200	1,251.00	250,200
みちのく銀行	200	1,789.00	357,800
ふくおかフィナンシャルグループ	2,400	2,477.00	5,944,800
静岡銀行	7,600	928.00	7,052,800
十六銀行	400	2,496.00	998,400
スルガ銀行	3,100	458.00	1,419,800
八十二銀行	5,400	478.00	2,581,200
山梨中央銀行	400	1,483.00	593,200
大垣共立銀行	500	2,369.00	1,184,500
福井銀行	300	1,783.00	534,900
北國銀行	300	3,905.00	1,171,500
富山銀行	100	3,580.00	358,000
滋賀銀行	600	2,665.00	1,599,000
南都銀行	400	2,325.00	930,000
百五銀行	2,700	405.00	1,093,500
京都銀行	1,100	5,020.00	5,522,000
紀陽銀行	1,100	1,603.00	1,763,300
ほくほくフィナンシャルグループ	2,000	1,330.00	2,660,000
広島銀行	4,400	621.00	2,732,400
山陰合同銀行	1,800	813.00	1,463,400

中国銀行	1,900	973.00	1,848,700
鳥取銀行	100	1,484.00	148,400
伊予銀行	4,000	611.00	2,444,000
百十四銀行	300	2,668.00	800,400
四国銀行	400	1,344.00	537,600
阿波銀行	500	2,904.00	1,452,000
大分銀行	200	3,470.00	694,000
宮崎銀行	200	3,075.00	615,000
佐賀銀行	200	1,935.00	387,000
十八銀行	200	2,724.00	544,800
沖縄銀行	300	3,480.00	1,044,000
琉球銀行	700	1,166.00	816,200
セブン銀行	10,200	340.00	3,468,000
みずほフィナンシャルグループ	408,800	179.70	73,461,360
山口フィナンシャルグループ	3,800	1,140.00	4,332,000
長野銀行	100	1,673.00	167,300
名古屋銀行	200	3,515.00	703,000
北洋銀行	4,500	305.00	1,372,500
愛知銀行	100	4,160.00	416,000
中京銀行	100	2,283.00	228,300
大光銀行	100	1,924.00	192,400
愛媛銀行	400	1,116.00	446,400
トマト銀行	100	1,201.00	120,100
京葉銀行	1,300	722.00	938,600
栃木銀行	1,600	253.00	404,800
北日本銀行	100	2,307.00	230,700
東和銀行	500	783.00	391,500
トモニホールディングス	2,300	450.00	1,035,000
フィデアホールディングス	2,900	142.00	411,800
池田泉州ホールディングス	3,200	309.00	988,800
F P G	1,000	1,153.00	1,153,000
マーキュリアインベストメント	100	797.00	79,700
S B Iホールディングス	3,600	2,436.00	8,769,600
ジャフコ	500	3,700.00	1,850,000
大和証券グループ本社	24,100	617.20	14,874,520
野村ホールディングス	55,200	461.80	25,491,360
岡三証券グループ	2,600	524.00	1,362,400
丸三証券	900	845.00	760,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	3,600	505.00	1,818,000
水戸証券	900	287.00	258,300
いちよし証券	600	860.00	516,000
松井証券	1,500	1,248.00	1,872,000

だいこう証券ビジネス	100	457.00	45,700
マネックスグループ	2,800	379.00	1,061,200
カブドットコム証券	2,200	385.00	847,000
極東証券	400	1,236.00	494,400
岩井コスモホールディングス	300	1,274.00	382,200
藍澤証券	600	746.00	447,600
かんぽ生命保険	1,100	2,601.00	2,861,100
S O M P Oホールディングス	5,900	4,005.00	23,629,500
アニコム ホールディングス	200	3,490.00	698,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	7,900	3,239.00	25,588,100
ソニーフィナンシャルホールディングス	2,500	2,245.00	5,612,500
第一生命ホールディングス	17,000	1,888.00	32,096,000
東京海上ホールディングス	10,900	5,383.00	58,674,700
T & Dホールディングス	9,300	1,451.50	13,498,950
アドバンスクリエイト	100	2,041.00	204,100
全国保証	800	3,720.00	2,976,000
アルヒ	300	2,320.00	696,000
クレディセゾン	2,100	1,293.00	2,715,300
芙蓉総合リース	300	5,900.00	1,770,000
興銀リース	600	2,549.00	1,529,400
東京センチュリー	600	4,990.00	2,994,000
日本証券金融	1,300	591.00	768,300
アイフル	4,600	300.00	1,380,000
リコーリース	200	3,320.00	664,000
イオンフィナンシャルサービス	1,900	2,096.00	3,982,400
アコム	6,000	405.00	2,430,000
ジャックス	300	1,882.00	564,600
オリエントコーポレーション	8,100	147.00	1,190,700
日立キャピタル	700	2,428.00	1,699,600
オリックス	20,100	1,725.50	34,682,550
三菱UFJリース	6,800	547.00	3,719,600
九州リースサービス	100	632.00	63,200
日本取引所グループ	8,100	1,923.00	15,576,300
イー・ギャランティ	300	1,050.00	315,000
アサックス	100	578.00	57,800
N E Cキャピタルソリューション	100	1,577.00	157,700
いちご	3,800	359.00	1,364,200
日本駐車場開発	3,600	152.00	547,200
ヒューリック	6,300	1,049.00	6,608,700
三栄建築設計	100	1,558.00	155,800
スター・マイカ	100	1,704.00	170,400
野村不動産ホールディングス	2,000	2,191.00	4,382,000

三重交通グループホールディングス	600	598.00	358,800
サムティ	400	1,294.00	517,600
ディア・ライフ	400	454.00	181,600
日本商業開発	200	1,687.00	337,400
プレサンスコーポレーション	500	1,518.00	759,000
ユニゾホールディングス	500	2,222.00	1,111,000
日本管理センター	200	975.00	195,000
サンセイランディック	100	953.00	95,300
フージャースホールディングス	700	659.00	461,300
オープンハウス	500	4,010.00	2,005,000
東急不動産ホールディングス	8,100	588.00	4,762,800
飯田グループホールディングス	2,500	2,050.00	5,125,000
ファーストブラザーズ	100	1,169.00	116,900
ハウスドゥ	100	1,151.00	115,100
シーアールイー	100	1,013.00	101,300
ケイアイスター不動産	100	1,702.00	170,200
グッドコムアセット	100	1,443.00	144,300
パーク24	1,800	3,040.00	5,472,000
パラカ	100	1,818.00	181,800
三井不動産	16,000	2,753.50	44,056,000
三菱地所	21,100	1,870.00	39,457,000
平和不動産	600	1,895.00	1,137,000
東京建物	3,300	1,278.00	4,217,400
ダイビル	900	1,235.00	1,111,500
京阪神ビルディング	500	872.00	436,000
住友不動産	6,800	4,335.00	29,478,000
テーオーシー	700	821.00	574,700
レオパレス21	3,700	480.00	1,776,000
スターツコーポレーション	400	2,532.00	1,012,800
フジ住宅	400	868.00	347,200
空港施設	400	555.00	222,000
明和地所	200	605.00	121,000
ゴールドクレスト	200	1,644.00	328,800
日本エスリード	100	1,582.00	158,200
日神不動産	400	478.00	191,200
日本エスコン	500	688.00	344,000
タカラレーベン	1,400	314.00	439,600
サンヨーハウジング名古屋	200	984.00	196,800
イオンモール	1,500	1,867.00	2,800,500
ファースト住建	100	1,235.00	123,500
カチタス	300	2,878.00	863,400
トーセイ	400	922.00	368,800

サンフロンティア不動産	400	1,165.00	466,000
エフ・ジェー・ネクスト	300	912.00	273,600
ランドビジネス	200	713.00	142,600
グランディハウス	300	398.00	119,400
日本空港ビルデング	1,000	3,895.00	3,895,000
日本工営	200	2,681.00	536,200
L I F U L L	1,000	770.00	770,000
ジェイエイシーリクルートメント	200	2,151.00	430,200
日本M&Aセンター	2,200	2,465.00	5,423,000
メンバーズ	100	966.00	96,600
タケエイ	300	750.00	225,000
トラスト・テック	100	3,085.00	308,500
コシダカホールディングス	800	1,441.00	1,152,800
パソナグループ	300	1,242.00	372,600
C D S	100	1,307.00	130,700
リンクアンドモチベーション	500	905.00	452,500
G C A	300	734.00	220,200
エス・エム・エス	1,100	1,855.00	2,040,500
パーソルホールディングス	2,900	1,873.00	5,431,700
リニカル	200	1,585.00	317,000
クックパッド	900	348.00	313,200
アイ・ケイ・ケイ	100	706.00	70,600
学情	100	1,252.00	125,200
スタジオアリス	100	2,417.00	241,700
シミックホールディングス	200	1,903.00	380,600
N J S	100	1,705.00	170,500
総合警備保障	1,200	5,380.00	6,456,000
カカコム	2,200	2,289.00	5,035,800
セントケア・ホールディング	200	544.00	108,800
ルネサンス	200	2,260.00	452,000
ディップ	500	1,997.00	998,500
オプトホールディング	200	1,718.00	343,600
ツクイ	700	871.00	609,700
キャリアデザインセンター	100	1,088.00	108,800
エムスリー	6,100	1,623.00	9,900,300
ツカダ・グローバルホールディング	200	610.00	122,000
アウトソーシング	1,500	1,229.00	1,843,500
ウェルネット	300	1,023.00	306,900
ワールドホールディングス	100	2,430.00	243,000
ディー・エヌ・エー	1,600	2,004.00	3,206,400
博報堂DYホールディングス	4,100	1,716.00	7,035,600
ぐるなび	400	725.00	290,000

エスアールジータカミヤ	300	673.00	201,900
ジャパンベストレスキューシステム	200	1,365.00	273,000
ファンコミュニケーションズ	800	627.00	501,600
ライク	100	1,487.00	148,700
WDBホールディングス	100	2,706.00	270,600
ティア	100	648.00	64,800
バリューコマース	200	1,450.00	290,000
インフォマート	1,600	1,173.00	1,876,800
J Pホールディングス	800	275.00	220,000
E P Sホールディングス	400	1,817.00	726,800
レグス	100	1,056.00	105,600
プレステージ・インターナショナル	500	1,302.00	651,000
アミューズ	200	2,482.00	496,400
ドリームインキュベータ	100	1,549.00	154,900
クイック	200	1,400.00	280,000
ケネディクス	2,700	517.00	1,395,900
電通	3,600	5,240.00	18,864,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	100	2,088.00	208,800
ぴあ	100	4,490.00	449,000
イオンファンタジー	100	3,165.00	316,500
シーティーエス	300	646.00	193,800
ネクシィーズグループ	100	1,845.00	184,500
みらかホールディングス	800	2,667.00	2,133,600
アルプス技研	300	1,873.00	561,900
ダイオーズ	100	1,402.00	140,200
日本空調サービス	300	744.00	223,200
オリエンタルランド	3,400	11,350.00	38,590,000
ダスキン	800	2,492.00	1,993,600
明光ネットワークジャパン	400	941.00	376,400
ファルコホールディングス	200	1,588.00	317,600
ラウンドワン	900	1,154.00	1,038,600
リゾートトラスト	1,200	1,658.00	1,989,600
ビー・エム・エル	400	2,968.00	1,187,200
りらいあコミュニケーションズ	500	975.00	487,500
リソー教育	1,500	390.00	585,000
ユー・エス・エス	3,600	1,975.00	7,110,000
東京個別指導学院	100	1,205.00	120,500
サイバーエージェント	1,800	4,785.00	8,613,000
楽天	13,600	845.00	11,492,000
クリーク・アンド・リバー社	200	1,052.00	210,400
テー・オー・ダブリュー	300	812.00	243,600
セントラルスポーツ	100	3,695.00	369,500

フルキャストホールディングス	300	1,996.00	598,800
エン・ジャパン	300	4,390.00	1,317,000
テクノプロ・ホールディングス	500	4,870.00	2,435,000
アイ・アールジャパンホールディングス	100	1,409.00	140,900
Keeper 技研	100	1,070.00	107,000
ファーストロジック	100	825.00	82,500
Gunosy	200	3,125.00	625,000
イー・ガーディアン	100	2,393.00	239,300
リブセンス	200	295.00	59,000
ジャパンマテリアル	800	1,067.00	853,600
ベクトル	400	1,633.00	653,200
ウチヤマホールディングス	100	464.00	46,400
ライクキッズネクスト	100	899.00	89,900
キャリアリンク	100	383.00	38,300
I B J	200	706.00	141,200
アサンテ	100	2,137.00	213,700
M&Aキャピタルパートナーズ	100	3,795.00	379,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	100	1,614.00	161,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	400	384.00	153,600
日本ビューホテル	100	1,191.00	119,100
リクルートホールディングス	20,900	2,991.50	62,522,350
エラン	100	2,750.00	275,000
土木管理総合試験所	100	588.00	58,800
日本郵政	23,900	1,301.00	31,093,900
ベルシステム24ホールディングス	500	1,390.00	695,000
鎌倉新書	200	1,492.00	298,400
LITALICO	100	1,911.00	191,100
ストライク	100	2,441.00	244,100
ソラスト	700	1,232.00	862,400
セラク	100	637.00	63,700
インソース	100	2,127.00	212,700
アイモバイル	100	882.00	88,200
キャリアインデックス	100	1,867.00	186,700
MS - Japan	100	1,440.00	144,000
グリーンズ	100	1,427.00	142,700
日総工産	100	1,962.00	196,200
キュービーネットホールディングス	100	2,010.00	201,000
スプリックス	100	1,802.00	180,200
アドバンテッジリスクマネジメント	100	1,050.00	105,000
リログループ	1,600	2,873.00	4,596,800
東祥	200	3,860.00	772,000
エイチ・アイ・エス	500	3,885.00	1,942,500

ラックランド	100	2,752.00	275,200
共立メンテナンス	400	5,160.00	2,064,000
イチネンホールディングス	300	1,291.00	387,300
建設技術研究所	200	1,498.00	299,600
スペース	200	1,182.00	236,400
長大	100	835.00	83,500
燦ホールディングス	100	2,411.00	241,100
東京テアトル	100	1,326.00	132,600
タナベ経営	100	1,489.00	148,900
ナガワ	100	5,780.00	578,000
よみうりランド	100	3,925.00	392,500
東京都競馬	200	3,025.00	605,000
常磐興産	100	1,650.00	165,000
カナモト	400	3,190.00	1,276,000
東京ドーム	1,100	930.00	1,023,000
西尾レントオール	300	3,655.00	1,096,500
トランス・コスモス	300	2,551.00	765,300
乃村工藝社	700	2,878.00	2,014,600
藤田観光	100	3,005.00	300,500
日本管財	300	2,025.00	607,500
トーカイ	300	2,803.00	840,900
セコム	3,100	9,628.00	29,846,800
セントラル警備保障	100	5,580.00	558,000
丹青社	600	1,211.00	726,600
メイテック	400	4,845.00	1,938,000
応用地質	300	1,256.00	376,800
船井総研ホールディングス	600	1,792.00	1,075,200
進学会ホールディングス	100	648.00	64,800
オオバ	200	716.00	143,200
いであ	100	1,064.00	106,400
学究社	100	1,572.00	157,200
ベネッセホールディングス	1,100	3,075.00	3,382,500
イオンディライト	400	3,810.00	1,524,000
ナック	200	1,071.00	214,200
ニチイ学館	400	1,105.00	442,000
ダイセキ	500	2,475.00	1,237,500
ステップ	100	1,328.00	132,800
合計	3,453,100		6,855,639,880

(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12月17日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	264,449,026
コール・ローン	12,955,522
株式	4,643,281,978
投資証券	118,799,918
未収入金	27,359
未収配当金	7,350,927
差入委託証拠金	68,573,806
流動資産合計	5,115,438,536
資産合計	
5,115,438,536	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	19,901,208
未払解約金	4,882,500
未払利息	29
流動負債合計	24,783,737
負債合計	
24,783,737	
純資産の部	
元本等	
元本	2,268,835,856
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,821,818,943
元本等合計	5,090,654,799
純資産合計	
5,090,654,799	
負債純資産合計	
5,115,438,536	

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17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。 投資信託受益証券

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</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、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</p> <p>原則として計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>(1) 株式及び投資証券</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>原則として、投資信託受益証券の収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p>
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成30年12月17日現在	
1. 計算日における受益権の総数	2,268,835,856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	2.2437円
(1万口当たり純資産額)	(22,437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12月16日 至 平成30年12月17日
1.金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>また、当ファンドは、信託財産の効率的な運用を行うため及び為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行っております。</p>

2.金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、株式、投資信託受益証券、投資証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。株価指数先物取引は株価の変動によるリスク、為替予約取引は為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>
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>
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>

金融商品の時価等に関する事項

平成30年12月17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。
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。
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12月16日 至 平成30年12月17日
	該当事項はありません。

(その他の注記)

1 元本の移動

区分	平成30年12月17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	3,114,466,882円
期中追加設定元本額	162,795,566円
期中一部解約元本額	1,008,426,592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	297,858,387円
新光外国株式インデックスVA	425,850,467円
新光世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	203,490,549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)	125,587,246円
新光世界バランス35VAT(適格機関投資家私募)	61,465,447円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	742,420,096円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	398,110,794円
グローバル・ナビ	14,052,870円
合計	2,268,835,856円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成30年12月17日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	288,396,093
投資証券	923,948
合計	287,472,145

(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12月17日現在		
	契約額等(円)		時価(円)
	うち1年超	評価損益(円)	
市場取引			
株価指数先物取引			

買建	355,345,732	-	337,426,913	17,918,819
S&P500 EMINI	251,075,353	-	236,199,152	14,876,201
S&P/TSE 601X	15,442,080	-	14,906,144	535,936
DJ EURO ST50	56,730,546	-	55,386,172	1,344,374
FTSE 100 IDX	20,074,779	-	19,520,637	554,142
SPI 200	12,022,974	-	11,414,808	608,166
合計	355,345,732	-	337,426,913	17,918,819

時価の算定方法

先物取引

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

先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

契約額等には手数料相当額を含んでおります。

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

種類	平成30年12月17日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	2,900,000	-	2,896,680	3,320
米ドル	2,900,000	-	2,896,680	3,320
合計	2,900,000	-	2,896,680	3,320

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	50.95	35,155.50	
	ANTERO RESOURCES CORPORATION	453	11.31	5,123.43	
	APACHE CORP	377	30.24	11,400.48	
	BAKER HUGHES A GE CO LLC	504	21.45	10,810.80	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	453	23.31	10,559.43	
	CHENIERE ENERGY INC	238	60.61	14,425.18	
	CHEVRON CORP	2,406	113.83	273,874.98	
	CONCHO RESOURCES INC	236	115.02	27,144.72	
	CONOCOPHILLIPS	1,466	64.55	94,630.30	
	CONTINENTAL RESOURCES INC	189	45.77	8,650.53	
	DEVON ENERGY CORPORATION	535	25.84	13,824.40	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	190	92.71	17,614.90	
	EOG RESOURCES INC	783	100.08	78,362.64	
	EXXON MOBIL CORP	5,317	75.58	401,858.86	
	HALLIBURTON CO	759	29.00	22,011.00	
	HELMERICH & PAYNE INC	236	58.48	13,801.28	
	HESS CORPORATION	235	50.90	11,961.50	
	HOLLYFRONTIER CORPORATION	200	54.08	10,816.00	
	KINDER MORGAN INC	2,486	16.17	40,198.62	
	MARATHON OIL CORP	798	15.04	12,001.92	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	885	59.87	52,984.95	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	479	26.68	12,779.72	
	NOBLE ENERGY INC	392	21.79	8,541.68	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,008	65.10	65,620.80	
	ONEOK INC	411	60.19	24,738.09	
	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	480	16.43	7,886.40	
	PHILLIPS 66	522	86.83	45,325.26	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	188	137.14	25,782.32	
	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	317	22.40	7,100.80	
	SCHLUMBERGER LIMITED	1,880	39.10	73,508.00	
TARGA RESOURCES CORPORATION	442	42.21	18,656.82		
TECHNIPFMC PLC	262	20.14	5,276.68		
VALERO ENERGY CORP	586	73.30	42,953.80		

WILLIAMS COS INC	1,448	23.45	33,955.60
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	267	155.41	41,494.47
ALBEMARLE CORPORATION	121	84.97	10,281.37
AVERY DENNISON CORPORATION	197	91.20	17,966.40
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	479	22.23	10,648.17
BALL CORPORATION	190	48.01	9,121.90
CELANESE CORPORATION	82	86.69	7,108.58
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	279	42.06	11,734.74
CROWN HOLDINGS INC	308	45.94	14,149.52
DOWDUPONT INC	2,827	52.78	149,209.06
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	84	71.50	6,006.00
ECOLAB INC	312	154.47	48,194.64
FMC CORPORATION	146	77.22	11,274.12
FREEMPORT-MCMORAN INC	1,575	10.57	16,647.75
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	66	135.50	8,943.00
INTERNATIONAL PAPER CO	301	43.44	13,075.44
LINDE PLC	662	156.93	103,887.66
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV-CLASS A	433	82.34	35,653.22
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	72	174.76	12,582.72
NEWMONT MINING CORP	846	33.31	28,180.26
NUCOR CORP	394	56.39	22,217.66
PACKAGING CORPORATION OF AMERICA	35	93.44	3,270.40
PPG INDUSTRIES INC	247	100.14	24,734.58
SEALED AIR CORPORATION	49	33.94	1,663.06
STEEL DYNAMICS INC	184	32.20	5,924.80
THE MOSAIC COMPANY	430	30.93	13,299.90
THE SHERWIN-WILLIAMS COMPANY	96	386.00	37,056.00
VULCAN MATERIALS CO	156	99.64	15,543.84
WESTROCK COMPANY	389	44.37	17,259.93
3M CO	771	196.10	151,193.10
A.O. SMITH CORPORATION	327	41.41	13,541.07
ACUITY BRANDS INC	98	118.35	11,598.30
ALLEGION PUBLIC LIMITED COMPANY	196	86.35	16,924.60
AMETEK INC	369	70.39	25,973.91
ARCONIC INC	810	19.74	15,989.40
BOEING CO	679	318.75	216,431.25
CATERPILLAR INC	724	126.77	91,781.48
CUMMINS INC	127	133.84	16,997.68
DEERE & CO	337	149.01	50,216.37
DOVER CORP	249	76.32	19,003.68
EATON CORPORATION PLC	554	70.58	39,101.32
EMERSON ELECTRIC CO	775	60.44	46,841.00

FASTENAL CO	249	53.87	13,413.63
FLOWSERVE CORPORATION	289	41.77	12,071.53
FLUOR CORP	308	32.90	10,133.20
FORTIVE CORPORATION	346	68.86	23,825.56
GENERAL DYNAMICS CORP	316	168.97	53,394.52
GENERAL ELECTRIC CO(US)	11,472	7.10	81,451.20
HARRIS CORPORATION	85	148.47	12,619.95
HD SUPPLY HOLDINGS INC	414	36.57	15,139.98
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	916	136.44	124,979.04
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	41	198.30	8,130.30
IDEX CORPORATION	157	132.56	20,811.92
ILLINOIS TOOL WORKS	364	131.04	47,698.56
INGERSOLL-RAND PLC	232	95.97	22,265.04
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	259	58.70	15,203.30
JARDINE MATHESON HLDGS LIMITED	400	66.45	26,580.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	500	36.58	18,290.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	1,059	31.97	33,856.23
L3 TECHNOLOGIES INC	42	191.29	8,034.18
LENNOX INTERNATIONAL INC	79	213.88	16,896.52
LOCKHEED MARTIN CORP	317	287.70	91,200.90
NORTHROP GRUMMAN CORP	205	262.71	53,855.55
PACCAR INC	378	56.57	21,383.46
PARKER HANNIFIN CORP	211	151.02	31,865.22
PENTAIR PLC	354	39.11	13,844.94
RAYTHEON COMPANY	405	169.85	68,789.25
ROCKWELL AUTOMATION INC	108	156.74	16,927.92
ROPER TECHNOLOGIES INC	122	273.84	33,408.48
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	378	42.75	16,159.50
SNAP-ON INC	10	147.32	1,473.20
STANLEY BLACK & DECKER INC	165	118.36	19,529.40
TEXTRON INC	394	49.47	19,491.18
THE MIDDLEBY CORPORATION	127	109.35	13,887.45
TRANSDIGM GROUP INC	55	346.80	19,074.00
UNITED RENTALS INC	85	105.80	8,993.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	1,013	118.80	120,344.40
WABCO HOLDINGS INC	116	102.88	11,934.08
WABTEC CORPORATION	191	73.27	13,994.57
WW GRAINGER INC	48	284.41	13,651.68
XYLEM INC	313	65.44	20,482.72
CINTAS CORPORATION	88	169.74	14,937.12
COPART INC	234	48.04	11,241.36
COSTAR GROUP INC	41	357.48	14,656.68

EQUIFAX INC	149	97.18	14,479.82
IHS MARKIT LIMITED	483	48.83	23,584.89
MANPOWER GROUP	148	68.38	10,120.24
NIELSEN HOLDINGS PLC	291	25.72	7,484.52
REPUBLIC SERVICES INC	210	74.42	15,628.20
ROBERT HALF INTL INC	118	57.76	6,815.68
ROLLINS INC	301	36.60	11,016.60
TRANSUNION	214	58.95	12,615.30
VERISK ANALYTICS INC	110	113.83	12,521.30
WASTE CONNECTIONS INC	297	76.91	22,842.27
WASTE MANAGEMENT INC	504	91.14	45,934.56
AMERCO	16	344.49	5,511.84
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	278	32.41	9,009.98
C H ROBINSON WORLDWIDE INC	95	84.65	8,041.75
CSX CORP	1,007	65.83	66,290.81
DELTA AIR LINES INC	162	53.51	8,668.62
EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON	187	70.48	13,179.76
FEDEX CORP	332	184.11	61,124.52
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	83	92.69	7,693.27
KANSAS CITY SOUTHERN	92	96.67	8,893.64
NORFOLK SOUTHERN CORP	383	150.88	57,787.04
SWIFT TRANSPORTATION COMPANY	237	26.88	6,370.56
UNION PACIFIC CORP	916	142.57	130,594.12
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	175	87.74	15,354.50
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	843	98.66	83,170.38
XPO LOGISTICS INC	139	51.55	7,165.45
APTIV PLC	441	65.95	29,083.95
AUTOLIV INC	102	73.81	7,528.62
BORGWARNER INC	67	34.63	2,320.21
FORD MOTOR CO	3,735	8.52	31,822.20
GENERAL MOTORS CO	1,648	35.10	57,844.80
HARLEY-DAVIDSON INC	391	34.72	13,575.52
TESLA INC	159	365.71	58,147.89
THE GOODYEAR TIRE & RUBBER COMPANY	517	20.78	10,743.26
DR HORTON INC	358	35.50	12,709.00
GARMIN LIMITED	262	65.14	17,066.68
HANESBRANDS INC	836	13.57	11,344.52
HASBRO INC	230	84.06	19,333.80
LEGGETT & PLATT INC	296	36.16	10,703.36
LENNAR CORPORATION-CLASS A	408	40.21	16,405.68
LULULEMON ATHLETICA INC	126	119.12	15,009.12
MATTEL INC	757	11.79	8,925.03

MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	179	37.94	6,791.26
MOHAWK INDUSTRIES INC	41	116.98	4,796.18
NEWELL BRANDS INC	515	22.08	11,371.20
NIKE INC -CL B	1,590	72.53	115,322.70
NVR INC	7	2,446.01	17,122.07
POLARIS INDUSTRIES INC	135	79.35	10,712.25
PVH CORPORATION	61	93.21	5,685.81
RALPH LAUREN CORPORATION	125	101.50	12,687.50
TAPESTRY INC	307	34.60	10,622.20
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	421	18.99	7,994.79
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	429	17.73	7,606.17
VF CORP	540	75.15	40,581.00
WHIRLPOOL CORP	53	113.20	5,999.60
ARAMARK	36	32.08	1,154.88
CARNIVAL CORP(US)	553	56.33	31,150.49
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	29	457.83	13,277.07
DARDEN RESTAURANTS INC	133	103.20	13,725.60
DOMINO'S PIZZA INC	32	249.01	7,968.32
H&R BLOCK INC	425	26.98	11,466.50
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	441	71.86	31,690.26
LAS VEGAS SANDS CORP	629	54.84	34,494.36
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	436	107.66	46,939.76
MCDONALD'S CORP	962	183.29	176,324.98
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LTD-ADR	436	17.58	7,664.88
MGM RESORTS INTERNATIONAL	480	26.46	12,700.80
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	352	47.62	16,762.24
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	186	107.09	19,918.74
STARBUCKS CORP	1,657	65.34	108,268.38
VAIL RESORTS INC	45	224.55	10,104.75
WYNN RESORTS LTD	180	106.70	19,206.00
YUM! BRANDS INC	315	91.70	28,885.50
ACTIVISION BLIZZARD INC	962	47.75	45,935.50
ALPHABET INC-CL A	369	1,051.71	388,080.99
ALPHABET INC-CL C	389	1,042.10	405,376.90
CBS CORP-CLASS B	308	48.05	14,799.40
CHARTER COMMUNICATIONS INC-CL A	225	309.42	69,619.50
COMCAST CORP-CL A	5,620	36.34	204,230.80
DISCOVERY INC-A	348	27.97	9,733.56
DISCOVERY INC-C	32	26.02	832.64
DISH NETWORK CORPORATION-A	486	30.65	14,895.90
ELECTRONIC ARTS INC	418	80.16	33,506.88
FACEBOOK INC-A	2,976	144.06	428,722.56

IAC/INTERACTIVECORP	88	183.95	16,187.60
INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC	356	22.21	7,906.76
LIBERTY BROADBAND-C	105	78.48	8,240.40
LIBERTY GLOBAL PLC-A	540	23.11	12,479.40
LIBERTY GLOBAL PLC-C	224	22.32	4,999.68
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	211	38.79	8,184.69
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	47	38.89	1,827.83
NETFLIX INC	559	266.84	149,163.56
NEWS CORPRATION-CLASS A	845	12.25	10,351.25
OMNICOM GROUP	245	75.78	18,566.10
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,666	6.17	10,279.22
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	194	103.46	20,071.24
THE WALT DISNEY CO.	1,862	112.20	208,916.40
TRIPADVISOR INC	274	60.70	16,631.80
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS A	1,361	49.06	66,770.66
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC-CLASS B	554	48.80	27,035.20
TWITTER INC	889	35.87	31,888.43
VIACOM INC-CLASS B	713	28.57	20,370.41
ZILLOW GROUP INC-C	254	32.38	8,224.52
ADVANCE AUTO PARTS INC	64	163.78	10,481.92
AMAZON.COM INC	515	1,591.91	819,833.65
AUTOZONE INC	29	871.24	25,265.96
BEST BUY CO INC	351	55.37	19,434.87
BOOKING HOLDINGS INC	58	1,807.14	104,814.12
BURLINGTON STORES INC	82	158.30	12,980.60
CARMAX INC	190	61.21	11,629.90
DOLLAR GENERAL CORPORATION	323	104.98	33,908.54
DOLLAR TREE INC	376	85.86	32,283.36
EBAY INC	1,133	28.91	32,755.03
EXPEDIA GROUP INC	150	118.36	17,754.00
GAP INC/THE	529	26.61	14,076.69
GENUINE PARTS CO	111	98.90	10,977.90
HOME DEPOT INC	1,465	172.29	252,404.85
KOHL'S CORP	158	61.24	9,675.92
L BRANDS INC	521	30.83	16,062.43
LKQ CORPORATION	82	24.60	2,017.20
LOWE'S COS INC	1,001	93.36	93,453.36
MACY'S INC	350	30.61	10,713.50
MERCADOLIBRE INC	52	326.52	16,979.04
NORDSTROM INC	106	48.61	5,152.66
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	79	348.17	27,505.43
QURATE RETAIL INC	920	20.07	18,464.40

ROSS STORES INC	417	79.21	33,030.57
TARGET CORP	687	67.17	46,145.79
TIFFANY & CO	103	82.66	8,513.98
TJX COMPANIES INC	1,640	45.22	74,160.80
TRACTOR SUPPLY COMPANY	129	89.19	11,505.51
ULTA BEAUTY INC	71	246.85	17,526.35
COSTCO WHOLESALE CORP	541	207.06	112,019.46
KROGER CO	936	29.55	27,658.80
SYSCO CORP	616	65.45	40,317.20
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,028	78.74	80,944.72
WALMART INC	1,859	91.85	170,749.15
ALTRIA GROUP INC	2,315	52.73	122,069.95
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	663	44.61	29,576.43
BROWN-FORMAN CORPORATION-CLASS B	296	47.06	13,929.76
BUNGE LIMITED	286	58.83	16,825.38
CAMPBELL SOUP COMPANY	378	39.16	14,802.48
COCA-COLA CO/THE	5,055	49.34	249,413.70
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	230	47.28	10,874.40
CONAGRA BRANDS INC	533	29.89	15,931.37
CONSTELLATION BRANDS INC-A	223	181.27	40,423.21
GENERAL MILLS INC	710	37.38	26,539.80
HERSHEY CO/THE	149	107.87	16,072.63
HORMEL FOODS CORPORATION	309	44.57	13,772.13
INGREDION INCORPORATED	61	95.68	5,836.48
KELLOGG COMPANY	297	60.36	17,926.92
KRAFT HEINZ CO/THE	728	47.46	34,550.88
LAMB WESTON HOLDING INC	175	75.83	13,270.25
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	146	151.57	22,129.22
MOLSON COORS BREWING CO-B	66	62.00	4,092.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,773	43.55	77,214.15
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	631	52.69	33,247.39
PEPSICO INC	1,748	113.95	199,184.60
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	1,914	82.50	157,905.00
THE JM SMUCKER COMPANY	187	101.91	19,057.17
TYSON FOODS INC-CL A	310	55.30	17,143.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	169	68.73	11,615.37
CLOROX COMPANY	137	164.52	22,539.24
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,040	65.17	67,776.80
COTY INC-CL A	1,073	7.31	7,843.63
ESTEE LAUDER COMPANIES INC-CL A	279	135.18	37,715.22
KIMBERLY-CLARK CORP	439	117.42	51,547.38
PROCTER & GAMBLE CO	3,163	96.64	305,672.32

ABBOTT LABORATORIES	2,154	70.76	152,417.04
ABIOMED INC	56	316.19	17,706.64
ALIGN TECHNOLOGY INC	98	215.57	21,125.86
AMERISOURCEBERGEN CORP	142	78.97	11,213.74
ANTHEM INC	345	275.58	95,075.10
BAXTER INTERNATIONAL INC.	584	65.70	38,368.80
BECTON DICKINSON & CO	366	231.45	84,710.70
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,755	35.80	62,829.00
CARDINAL HEALTH INC	179	50.06	8,960.74
CENTENE CORPORATION	270	127.53	34,433.10
CERNER CORPORATION	354	55.91	19,792.14
CIGNA CORP	343	205.37	70,441.91
CVS HEALTH CORPORATION	1,587	71.88	114,073.56
DANAHER CORP	761	100.40	76,404.40
DAVITA INC	149	58.02	8,644.98
DENTSPLY SIRONA INC	149	36.97	5,508.53
DEXCOM INC	107	120.66	12,910.62
EDWARDS LIFESCIENCES CORPORATION	254	160.13	40,673.02
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	768	98.22	75,432.96
HCA HEALTHCARE INC	332	126.73	42,074.36
HENRY SCHEIN INC	158	80.52	12,722.16
HOLOGIC INC	288	41.94	12,078.72
HUMANA INC	194	299.93	58,186.42
IDEXX LABORATORIES INC	96	190.27	18,265.92
INTUITIVE SURGICAL INC	152	491.81	74,755.12
LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	75	137.41	10,305.75
MCKESSON CORP	282	116.66	32,898.12
MEDTRONIC PLC	1,663	93.72	155,856.36
QUEST DIAGNOSTICS	46	85.48	3,932.08
RESMED INC	133	112.93	15,019.69
STRYKER CORP	453	166.56	75,451.68
TELEFLEX INC	50	247.43	12,371.50
THE COOPER COS INC	38	249.97	9,498.86
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,196	265.02	316,963.92
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	98	121.15	11,872.70
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	54	119.10	6,431.40
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	219	91.39	20,014.41
WELLCARE HEALTH PLANS INC	62	237.03	14,695.86
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	214	108.99	23,323.86
ABBVIE INC	1,836	85.61	157,179.96
AGILENT TECHNOLOGIES INC	322	69.36	22,333.92
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	282	109.43	30,859.26

ALKERMES PLC	336	32.82	11,027.52
ALLERGAN PLC	458	148.23	67,889.34
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	108	77.13	8,330.04
AMGEN INC	831	192.07	159,610.17
BIOGEN INC	239	314.55	75,177.45
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	122	93.11	11,359.42
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,160	52.12	112,579.20
CELGENE CORP	900	68.20	61,380.00
ELI LILLY & CO	1,180	111.93	132,077.40
GILEAD SCIENCES INC	1,600	65.57	104,912.00
ILLUMINA INC	208	326.46	67,903.68
INCYTE CORP	201	66.25	13,316.25
IQIVA HOLDINGS INC	194	118.02	22,895.88
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	65	140.56	9,136.40
JOHNSON & JOHNSON	3,299	133.00	438,767.00
MERCK & CO. INC.	3,405	76.48	260,414.40
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	24	587.12	14,090.88
MYLAN NV	570	29.05	16,558.50
NEKTAR THERAPEUTICS	216	36.51	7,886.16
PERRIGO CO PLC	265	56.99	15,102.35
PFIZER INC	7,180	43.80	314,484.00
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	87	381.17	33,161.79
SEATTLE GENETICS INC	219	60.48	13,245.12
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	1,204	18.46	22,225.84
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	497	234.19	116,392.43
UNITED THERAPEUTICS CORPORATION	94	107.89	10,141.66
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	354	170.06	60,201.24
WATERS CORP	70	188.97	13,227.90
ZOETIS INC	638	88.45	56,431.10
BANK OF AMERICA CORPORATION	11,775	24.48	288,252.00
BB&T CORPORATION	1,112	45.66	50,773.92
CIT GROUP INC	297	41.17	12,227.49
CITIGROUP INC	3,218	55.02	177,054.36
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	589	30.26	17,823.14
COMERICA INC	198	68.98	13,658.04
EAST WEST BANCORP INC	296	44.60	13,201.60
FIFTH THIRD BANCORP	602	23.68	14,255.36
FIRST REPUBLIC BANK/CA	130	88.96	11,564.80
HUNTINGTON BANCSHARES INC	459	12.17	5,586.03
JPMORGAN CHASE & CO	4,175	100.29	418,710.75
KEYCORP	1,329	15.13	20,107.77
M & T BANK CORP	167	147.81	24,684.27

PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	689	15.25	10,507.25
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	602	118.50	71,337.00
REGIONS FINANCIAL CORP	1,490	13.47	20,070.30
SIGNATURE BANK	119	108.90	12,959.10
SUNTRUST BANKS INC	640	52.18	33,395.20
SVB FINANCIAL GROUP	58	191.71	11,119.18
US BANCORP	1,882	48.75	91,747.50
WELLS FARGO & COMPANY	5,661	46.54	263,462.94
ZIONS BANCORPORATION	183	41.54	7,601.82
ALLY FINANCIAL INC	381	23.00	8,763.00
AMERICAN EXPRESS CO	996	105.70	105,277.20
AMERIPRISE FINANCIAL INC	242	110.19	26,665.98
BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE	1,304	48.67	63,465.68
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,624	200.00	324,800.00
BLACKROCK INC	142	382.30	54,286.60
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	606	78.73	47,710.38
CBOE GLOBAL MARKETS INC	207	100.89	20,884.23
CME GROUP INC	427	187.64	80,122.28
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	399	61.82	24,666.18
E*TRADE FINANCIAL CORP	270	43.55	11,758.50
EATON VANCE CORPORATION	260	34.95	9,087.00
FRANKLIN RESOURCES INC	237	31.37	7,434.69
GOLDMAN SACHS GROUP INC	485	172.77	83,793.45
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	729	77.10	56,205.90
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	717	17.64	12,647.88
MOODY'S CORP	273	145.52	39,726.96
MORGAN STANLEY	1,579	39.64	62,591.56
MSCI INC	74	150.45	11,133.30
NASDAQ INC	122	86.54	10,557.88
NORTHERN TRUST CORP	346	86.37	29,884.02
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	141	74.34	10,481.94
S&P GLOBAL INC	317	166.62	52,818.54
SEI INVESTMENTS COMPANY	297	48.41	14,377.77
STATE STREET CORP	490	63.53	31,129.70
SYNCHRONY FINANCIAL	776	24.10	18,701.60
T ROWE PRICE GROUP INC	258	91.97	23,728.26
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	241	48.42	11,669.22
THE CHARLES SCHWAB CORPORATION	1,480	41.19	60,961.20
VOYA FINANCIAL INC	76	41.28	3,137.28
AFLAC INC	1,110	44.61	49,517.10
ALLEGHANY CORPORATION	3	608.03	1,824.09
ALLSTATE CORP	449	79.30	35,605.70

AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	153	91.42	13,987.26
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,241	37.49	46,525.09
AON PLC	326	153.83	50,148.58
ARCH CAPITAL GROUP LTD	756	26.86	20,306.16
ARTHUR J GALLAGHER & CO	122	74.18	9,049.96
ASSURANT INC	126	90.26	11,372.76
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	156	40.28	6,283.68
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	173	31.93	5,523.89
CHUBB LIMITED	554	128.12	70,978.48
CINCINNATI FINANCIAL CORPORATION	93	79.41	7,385.13
EVEREST RE GROUP LTD	90	215.31	19,377.90
FNF GROUP	541	31.52	17,052.32
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	392	41.27	16,177.84
LINCOLN NATIONAL CORP	319	53.53	17,076.07
LOEWS CORPORATION	231	45.07	10,411.17
MARKEL CORPORATION	12	1,048.58	12,582.96
MARSH & MCLENNAN COS	602	83.00	49,966.00
METLIFE INC	1,238	38.89	48,145.82
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	457	43.62	19,934.34
PROGRESSIVE CORP	716	62.00	44,392.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	431	82.37	35,501.47
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	55	140.48	7,726.40
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	94	133.65	12,563.10
TORCHMARK CORPORATION	55	77.14	4,242.70
TRAVELERS COS INC/THE	357	120.55	43,036.35
UNUM GROUP	471	29.69	13,983.99
WILLIS TOWERS WATSON PLC	147	153.76	22,602.72
WR BERKLEY CORP	215	74.71	16,062.65
CBRE GROUP INC	542	41.04	22,243.68
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	643	6.66	4,282.38
JONES LANG LASALLE INCORPORATED	104	133.25	13,858.00
ACCENTURE PLC	783	155.53	121,779.99
ADOBE INC	633	230.00	145,590.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	210	65.10	13,671.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	34	173.18	5,888.12
ANSYS INC	90	149.71	13,473.90
AUTODESK INC	315	131.50	41,422.50
AUTOMATIC DATA PROCESSING	538	134.82	72,533.16
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	107	96.63	10,339.41
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	317	43.22	13,700.74
CDK GLOBAL INC	281	47.70	13,403.70
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	105	107.42	11,279.10

CITRIX SYSTEMS INC	136	109.14	14,843.04
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP-A	750	67.77	50,827.50
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	272	105.79	28,774.88
DXC TECHNOLOGY CO	466	56.76	26,450.16
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	438	104.59	45,810.42
FIRST DATA CORP- CLASS A	711	16.84	11,973.24
FISERV INC	477	76.28	36,385.56
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	102	176.91	18,044.82
FORTINET INC	149	72.91	10,863.59
GARTNER INC	100	139.13	13,913.00
GLOBAL PAYMENTS INC	138	101.60	14,020.80
GODADDY INC-CLASS A	165	62.60	10,329.00
INTL BUSINESS MACHINES CORPORATION	1,139	119.90	136,566.10
INTUIT INC	319	200.93	64,096.67
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	81	131.37	10,640.97
LEIDOS HOLDINGS INC	293	57.05	16,715.65
MASTERCARD INCORPORATED	1,145	195.33	223,652.85
MICROSOFT CORP	9,038	106.03	958,299.14
ORACLE CORPORATION	3,667	46.60	170,882.20
PAYCHEX INC	331	65.90	21,812.90
PAYPAL HOLDINGS INC	1,447	85.92	124,326.24
PTC INC	121	85.02	10,287.42
RED HAT INC	210	176.50	37,065.00
SABRE CORPORATION	465	23.43	10,894.95
SALESFORCE COM INC	933	137.04	127,858.32
SERVICENOW INC	270	181.98	49,134.60
SPLUNK INC	149	105.26	15,683.74
SQUARE INC - A	387	62.14	24,048.18
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	356	45.74	16,283.44
SYMANTEC CORPORATION	572	21.57	12,338.04
SYNOPSYS INC	104	87.65	9,115.60
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	141	84.63	11,932.83
VERISIGN INC	115	152.67	17,557.05
VISA INC-CLASS A SHARES	2,202	135.09	297,468.18
VMWARE INC-CLASS A	142	158.58	22,518.36
WORKDAY INC-CLASS A	171	162.03	27,707.13
WORLDPAY INC-CLASS A	325	80.17	26,055.25
AMPHENOL CORPORATION-CL A	362	83.24	30,132.88
APPLE INC	6,001	165.48	993,045.48
ARISTA NETWORKS INC	95	220.41	20,938.95
ARROW ELECTRONICS INC	201	70.41	14,152.41
CDW CORPORATION	179	87.71	15,700.09

CISCO SYSTEMS INC	5,806	45.82	266,030.92
COMMSCOPE HOLDING COMPANY INC	400	16.80	6,720.00
CORNING INC	698	31.43	21,938.14
F5 NETWORKS INC	71	165.44	11,746.24
FLEX LTD	1,195	7.73	9,237.35
FLIR SYSTEMS INC	301	43.12	12,979.12
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE COMPANY	1,917	14.22	27,259.74
HP INC	2,014	22.01	44,328.14
JUNIPER NETWORKS INC	328	27.77	9,108.56
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	221	61.49	13,589.29
MOTOROLA SOLUTIONS INC	164	126.65	20,770.60
NETAPP INC	366	61.43	22,483.38
PALO ALTO NETWORKS INC	111	184.03	20,427.33
SEAGATE TECHNOLOGY	349	38.55	13,453.95
TE CONNECTIVITY LIMITED	397	73.00	28,981.00
TRIMBLE INC	102	34.59	3,528.18
WESTERN DIGITAL CORPORATION	462	38.78	17,916.36
XEROX CORPORATION	476	24.45	11,638.20
AT&T INC	9,190	30.22	277,721.80
CENTURYLINK INC	1,073	17.00	18,241.00
SPRINT CORPORATION	1,762	5.97	10,519.14
T-MOBILE US INC	335	65.65	21,992.75
VERIZON COMMUNICATIONS INC	5,285	57.08	301,667.80
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	350	24.88	8,708.00
AES CORP	750	15.95	11,962.50
ALLIANT ENERGY CORP	230	45.32	10,423.60
AMEREN CORPORATION	284	69.81	19,826.04
AMERICAN ELECTRIC POWER COMPANY INC	636	80.01	50,886.36
AMERICAN WATER WORKS CO INC	145	97.14	14,085.30
ATMOS ENERGY CORPORATION	230	98.47	22,648.10
CENTERPOINT ENERGY INC	840	29.30	24,612.00
CMS ENERGY CORPORATION	170	52.89	8,991.30
CONSOLIDATED EDISON INC	485	83.83	40,657.55
DOMINION ENERGY INC	731	76.92	56,228.52
DTE ENERGY COMPANY	156	118.22	18,442.32
DUKE ENERGY CORPORATION	866	90.75	78,589.50
EDISON INTERNATIONAL	517	59.64	30,833.88
ENERGY CORP	94	89.78	8,439.32
EVERGY INC	314	60.54	19,009.56
EVERSOURCE ENERGY	285	69.77	19,884.45
EXELON CORP	1,272	47.06	59,860.32
FIRSTENERGY CORP	421	39.12	16,469.52

NEXTERA ENERGY INC	588	181.24	106,569.12
NISOURCE INC	714	27.49	19,627.86
NRG ENERGY INC	373	42.32	15,785.36
OGE ENERGY CORPORATION	442	41.60	18,387.20
P G & E CORPORATION	617	26.01	16,048.17
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	104	91.44	9,509.76
PPL CORPORATION	1,084	30.59	33,159.56
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	803	55.69	44,719.07
SCANA CORPORATION	300	50.98	15,294.00
SEMPRA ENERGY	313	118.49	37,087.37
SOUTHERN CO	1,343	47.33	63,564.19
UGI CORPORATION	185	57.27	10,594.95
WEC ENERGY GROUP INC	317	74.36	23,572.12
XCEL ENERGY INC	806	53.14	42,830.84
ADVANCED MICRO DEVICES INC	1,167	19.90	23,223.30
ANALOG DEVICES INC	392	87.27	34,209.84
APPLIED MATERIALS INC	1,132	32.65	36,959.80
BROADCOM INC	575	254.83	146,527.25
INTEL CORP	5,933	47.86	283,953.38
KLA-TENCOR CORPORATION	135	89.51	12,083.85
LAM RESEARCH CORP	210	135.37	28,427.70
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	834	15.38	12,826.92
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC	463	52.78	24,437.14
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	189	71.64	13,539.96
MICRON TECHNOLOGY INC	1,663	34.20	56,874.60
NVIDIA CORP	746	146.45	109,251.70
NXP SEMICONDUCTORS NV	441	77.57	34,208.37
QORVO INC	260	60.52	15,735.20
QUALCOMM INC	1,827	57.62	105,271.74
SKYWORKS SOLUTIONS INC	188	68.69	12,913.72
TEXAS INSTRUMENTS INC	1,205	94.26	113,583.30
XILINX INC	222	88.82	19,718.04
米ドル 建小計	378,265		27,714,562.15 (3,144,771,367)
カナダドル			
ARC RESOURCES LIMITED	819	8.61	7,051.59
CAMECO CORP (CA)	772	15.96	12,321.12
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,245	34.28	42,678.60
CENOVUS ENERGY INC	2,196	10.26	22,530.96
ENBRIDGE INC	2,083	42.77	89,089.91
ENCANA CORP	501	7.78	3,897.78
HUSKY ENERGY INC	825	15.37	12,680.25
IMPERIAL OIL LTD	597	34.78	20,763.66

INTER PIPELINE LIMITED	188	20.26	3,808.88
KEYERA CORP	410	28.21	11,566.10
PEMBINA PIPELINE CORPORATION	767	43.91	33,678.97
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	351	16.56	5,812.56
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	500	9.98	4,990.00
SUNCOR ENERGY INC	2,271	39.62	89,977.02
TOURMALINE OIL CORPORATION	500	16.81	8,405.00
TRANSCANADA CORPORATION	1,006	53.55	53,871.30
VERMILION ENERGY INC	154	28.92	4,453.68
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	431	51.92	22,377.52
BARRICK GOLD CORP	763	18.25	13,924.75
CCL INDUSTRIES INC - CL B	300	52.79	15,837.00
FRANCO-NEVADA CORPORATION	321	96.22	30,886.62
GOLDCORP INC	22	12.21	268.62
KINROSS GOLD CORP	2,930	3.85	11,280.50
METHANEX CORPORATION	50	68.76	3,438.00
NUTRIEN LTD	817	62.87	51,364.79
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	767	29.76	22,825.92
TURQUOISE HILL RESOURCES LIMITED	2,200	2.25	4,950.00
WEST FRASER TIMBER CO LIMITED	100	63.60	6,360.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	909	25.34	23,034.06
CAE INC	604	26.14	15,788.56
FINNING INTERNATIONAL INC	337	23.97	8,077.89
SNC-LAVALIN GROUP INC	341	47.44	16,177.04
THOMSON REUTERS CORP(CA)	3	68.55	205.65
CANADIAN NATL RAILWAY CO	928	103.56	96,103.68
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	154	245.21	37,762.34
MAGNA INTERNATIONAL INC	345	60.68	20,934.60
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	400	71.31	28,524.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	891	24.72	22,025.52
CANADIAN TIRE CORP -CL A	126	141.78	17,864.28
DOLLARAMA INC	600	31.99	19,194.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	442	67.04	29,631.68
EMPIRE COMPANY LIMITED A	450	29.03	13,063.50
GEORGE WESTON LIMITED	116	92.92	10,778.72
LOBLAW COMPANIES LTD	121	60.70	7,344.70
METRO INC	170	46.86	7,966.20
SAPUTO INC	400	40.85	16,340.00
CANOPY GROWTH CORP	278	41.47	11,528.66
BANK OF MONTREAL	748	89.90	67,245.20
BANK OF NOVA SCOTIA	1,574	72.00	113,328.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	550	107.20	58,960.00

	NATIONAL BANK OF CANADA	319	58.38	18,623.22	
	ROYAL BANK OF CANADA	1,893	94.32	178,547.76	
	TORONTO-DOMINION BANK(CA)	2,327	69.58	161,912.66	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	932	55.42	51,651.44	
	CI FINANCIAL CORPORATION	483	17.84	8,616.72	
	IGM FINANCIAL INC	193	32.43	6,258.99	
	ONEX CORPORATION	100	75.36	7,536.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	32	587.24	18,791.68	
	GREAT-WEST LIFECO INC	600	27.74	16,644.00	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL	242	44.15	10,684.30	
	INTACT FINANCIAL CORPORATION	200	99.58	19,916.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	2,098	19.69	41,309.62	
	POWER CORP OF CANADA	83	24.45	2,029.35	
	POWER FINANCIAL CORP	473	26.24	12,411.52	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	538	44.84	24,123.92	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	300	20.20	6,060.00	
	BLACKBERRY LIMITED	1,100	10.18	11,198.00	
	CGI GROUP INC -CL A	377	84.31	31,784.87	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	22	878.19	19,320.18	
	OPEN TEXT CORPORATION	478	43.80	20,936.40	
	SHOPIFY INC - CLASS A	100	187.66	18,766.00	
	BCE INC	336	56.22	18,889.92	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	341	70.74	24,122.34	
	TELUS CORPORATION	44	46.61	2,050.84	
	ALTAGAS LIMITED	279	14.52	4,051.08	
	ATCO LIMITED	194	39.98	7,756.12	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	328	32.04	10,509.12	
	EMERA INC	100	44.43	4,443.00	
	FORTIS INC	180	46.71	8,407.80	
	HYDRO ONE LIMITED	600	20.87	12,522.00	
	カナダドル 建小計	49,665		2,032,844.23 (172,385,190)	
ユーロ	ENAGAS SA	61	25.71	1,568.31	
	ENI SPA	2,829	14.14	40,024.69	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	420	14.16	5,947.20	
	KONINKLIJKE VOPAK NV	161	41.72	6,716.92	
	NESTE OYJ	153	71.84	10,991.52	
	OMV AG	89	41.89	3,728.21	
	REPSOL SA	1,726	14.79	25,527.54	
	SNAM SPA	1,629	4.04	6,590.93	
	TENARIS SA	1,045	10.00	10,450.00	
	TOTAL SA	2,951	49.10	144,894.10	

AIR LIQUIDE SA	496	107.20	53,171.20
AKZO NOBEL	400	70.38	28,152.00
ARCELORMITTAL	525	19.42	10,195.50
ARKEMA	150	78.64	11,796.00
BASF SE	1,205	60.10	72,420.50
COVESTRO AG	195	43.29	8,441.55
CRH PLC(IE)	953	22.64	21,575.92
EVONIK INDUSTRIES AG	361	22.56	8,144.16
FUCHS PETROLUB SE-PREF	159	35.28	5,609.52
IMERYS SA	82	43.50	3,567.00
KONINKLIJKE DSM NV	144	75.32	10,846.08
LANXESS AG	202	42.80	8,645.60
STORA ENSO OYJ-R SHS(FI)	1,219	10.59	12,915.30
SYMRISE AG	145	66.74	9,677.30
THYSSENKRUPP AG	814	15.60	12,702.47
UMICORE	408	35.57	14,512.56
UPM-KYMMENE OYJ	572	22.93	13,115.96
VOESTALPINE AG	261	26.54	6,926.94
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS	506	33.55	16,976.30
AIRBUS SE	819	88.67	72,620.73
ALSTOM	339	38.44	13,031.16
ANDRITZ AG	167	39.24	6,553.08
BRENTAG AG	28	37.00	1,036.00
CNH INDUSTRIAL NV	988	8.31	8,218.18
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	519	29.59	15,359.80
DASSAULT AVIATION SA	5	1,256.00	6,280.00
EIFFAGE SA	151	73.90	11,158.90
FERROVIAL SA	413	18.04	7,450.52
GEA GROUP AG	405	21.04	8,521.20
HOCHTIEF AG	43	117.80	5,065.40
KION GROUP AG	126	43.97	5,540.22
KONE OYJ-B	354	42.55	15,062.70
LEGRAND SA	422	49.69	20,969.18
LEONARDO SPA	895	8.16	7,310.36
METSO OYJ	259	23.27	6,026.93
MTU AERO ENGINES AG	56	168.50	9,436.00
OSRAM LICHT AG	172	38.32	6,591.04
PRYSMIAN SPA	432	16.60	7,171.20
REXEL SA	670	9.73	6,521.78
SAFRAN SA	368	108.20	39,817.60
SCHNEIDER ELECTRIC SE	686	61.00	41,846.00
SIEMENS AG-REG	925	100.20	92,685.00

SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	489	12.64	6,183.40
THALES SA	120	103.95	12,474.00
VINCI SA	521	73.52	38,303.92
WARTSILA OYJ-B SHARES	111	13.92	1,545.12
BUREAU VERITAS SA	569	18.45	10,498.05
EDENRED	483	32.73	15,808.59
RANDSTAD NV	263	39.95	10,506.85
SOCIETE BIC SA	66	89.15	5,883.90
TELEPERFORMANCE	57	141.90	8,088.30
WOLTERS KLUWER NV-CVA	308	53.14	16,367.12
AENA SME SA	37	140.55	5,200.35
AEROPORTS DE PARIS(ADP)	68	166.20	11,301.60
ATLANTIA SPA	913	18.14	16,566.38
BOLLORE	2,000	3.66	7,320.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	538	19.42	10,447.96
DEUTSCHE POST AG-REG	1,171	25.09	29,380.39
FRAPORT AG	95	63.42	6,024.90
GETLINK	1,034	11.40	11,787.60
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	1,306	6.91	9,027.07
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	395	74.27	29,336.65
BMW-PFD	126	65.45	8,246.70
CONTINENTAL AG	181	122.65	22,199.65
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	1,097	47.37	51,964.89
FERRARI NV	116	90.34	10,479.44
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	1,300	13.85	18,005.00
MICHELIN (CGDE)-B	272	87.10	23,691.20
NOKIAN RENKAAT OYJ	265	26.89	7,125.85
PEUGEOT SA	1,075	18.23	19,602.62
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING-PFD	92	56.26	5,175.92
RENAULT SA	94	55.65	5,231.10
VOLKSWAGEN AG-PFD	218	147.72	32,202.96
ADIDAS AG	240	195.50	46,920.00
ESSILORLUXOTTICA	329	110.05	36,206.45
HERMES INTERNATIONAL	43	485.80	20,889.40
HUGO BOSS AG-ORD	153	56.88	8,702.64
KERING	96	404.40	38,822.40
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	344	251.95	86,670.80
PUMA SE	8	456.50	3,652.00
SEB SA	50	115.60	5,780.00
ACCOR SA	378	37.77	14,277.06
PADDY POWER BETFAIR PLC	176	73.70	12,971.20
SODEXO	22	90.44	1,989.68

AXEL SPRINGER SE	99	50.95	5,044.05
EUTELSAT COMMUNICATIONS	400	18.45	7,380.00
JC DECAUX SA	170	25.90	4,403.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	515	16.19	8,340.42
PUBLICIS GROUPE	98	49.98	4,898.04
RTL GROUP SA	89	48.00	4,272.00
SES	806	17.54	14,141.27
TELENET GROUP HOLDING NV	121	43.08	5,212.68
VIVENDI	1,163	21.29	24,760.27
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	1,305	24.55	32,037.75
ZALANDO SE	198	25.53	5,054.94
CARREFOUR SA	462	14.92	6,895.35
CASINO GUICHARD PERRACHON SA	127	36.87	4,682.49
COLRUYT SA	154	62.10	9,563.40
JERONIMO MARTINS SGPS SA	577	10.31	5,951.75
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	1,520	22.68	34,481.20
METRO AG	394	11.68	4,603.89
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,046	62.27	65,134.42
DANONE	613	64.08	39,281.04
HEINEKEN HOLDING NV	98	76.55	7,501.90
HEINEKEN NV	338	80.32	27,148.16
KERRY GROUP PLC-A	153	89.80	13,739.40
PERNOD-RICARD SA	295	148.40	43,778.00
REMY COINTREAU SA	51	102.90	5,247.90
BEIERSDORF AG	52	93.70	4,872.40
HENKEL AG & CO KGAA	21	88.75	1,863.75
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	283	99.56	28,175.48
L'OREAL	310	204.30	63,333.00
UNILEVER NV-CVA	1,880	49.46	92,984.80
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	351	60.16	21,116.16
FRESENIUS SE & CO KGAA	483	42.01	20,290.83
KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,063	32.48	34,526.24
BAYER AG	1,205	63.36	76,348.80
EUROFINS SCIENTIFIC SE	24	330.00	7,920.00
GRIFOLS SA	289	23.88	6,901.32
IPSEN SA	77	119.15	9,174.55
MERCK KGAA	64	96.52	6,177.28
ORION OYJ-CLASS B	221	30.49	6,738.29
QIAGEN NV	485	30.60	14,841.00
RECORDATI SPA	215	28.60	6,149.00
SANOFI	1,354	78.24	105,936.96
UCB SA	106	74.96	7,945.76

ABN AMRO GROUP NV-CVA	624	21.51	13,422.24
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	9,049	4.71	42,647.93
BANCO DE SABADELL SA	4,349	1.08	4,712.14
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	7,632	0.00	0.00
BANCO SANTANDER SA	19,450	4.05	78,957.27
BANK OF IRELAND GROUP PLC	2,028	5.10	10,352.94
BANKIA SA	2,068	2.76	5,718.02
BANKINTER SA	1,491	7.32	10,923.06
BNP PARIBAS	1,271	41.59	52,867.24
CAIXABANK	3,872	3.39	13,126.08
COMMERZBANK AG	1,326	6.63	8,800.66
CREDIT AGRICOLE SA	1,242	10.13	12,588.91
ERSTE GROUP BANK AG	264	32.31	8,529.84
ING GROEP NV-CVA	5,265	10.21	53,797.77
INTESA SANPAOLO	20,074	2.01	40,429.03
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION LI(IE)	9,000	0.00	0.00
KBC GROEP NV	262	60.46	15,840.52
MEDIOBANCA SPA	1,301	7.62	9,916.22
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	269	24.80	6,671.20
SOCIETE GENERALE	854	29.85	25,491.90
UNICREDIT SPA	2,711	10.80	29,295.06
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	2,921	7.84	22,924.00
DEUTSCHE BOERSE AG	237	106.85	25,323.45
EURAZEO	99	63.10	6,246.90
EXOR NV	240	49.45	11,868.00
NATIXIS SA	2,082	4.54	9,466.85
WENDEL	62	102.40	6,348.80
AEGON NV	1,284	4.28	5,495.52
AGEAS	36	39.86	1,434.96
ALLIANZ SE-REG	544	176.84	96,200.96
ASSICURAZIONI GENERALI	1,691	14.38	24,325.03
AXA	2,698	19.19	51,796.20
CNP ASSURANCES	394	19.17	7,552.98
HANNOVER RUECK SE	133	118.10	15,707.30
MAPFRE SA	2,472	2.38	5,885.83
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG	191	188.20	35,946.20
NN GROUP NV	294	34.83	10,240.02
POSTE ITALIANE SPA	1,156	6.93	8,011.08
SAMPO OYJ-A SHS	427	39.06	16,678.62
SCOR SE	361	39.83	14,378.63
DEUTSCHE WOHNEN SE	227	41.77	9,481.79
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	158	144.62	22,849.96

VONOVIA SE	748	42.01	31,423.48
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	624	62.30	38,875.20
ATOS SE	97	69.20	6,712.40
CAPGEMINI SA	199	94.22	18,749.78
DASSAULT SYSTEMES SA	155	105.10	16,290.50
SAP SE	1,244	89.94	111,885.36
WIRECARD AG	189	137.20	25,930.80
INGENICO GROUP	122	57.38	7,000.36
NOKIA OYJ	7,327	5.28	38,686.56
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	3,922	15.10	59,241.81
ELISA OYJ	315	36.82	11,598.30
ILIAD SA	58	129.00	7,482.00
KONINKLIJKE KPN NV	2,756	2.62	7,231.74
ORANGE	2,214	14.54	32,191.56
PROXIMUS	337	23.39	7,882.43
TELECOM ITALIA-RSP	13,336	0.47	6,386.61
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,645	3.51	5,785.46
TELEFONICA SA	4,868	7.79	37,926.58
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	272	37.99	10,333.28
E.ON SE	2,660	9.23	24,554.46
ELECTRICITE DE FRANCE	1,126	14.24	16,034.24
ENDESA SA	703	21.07	14,812.21
ENEL SPA	10,417	5.01	52,272.50
ENGIE	2,148	12.90	27,719.94
FORTUM OYJ	437	20.31	8,875.47
IBERDROLA SA	6,721	7.03	47,248.63
INNOGY SE	307	41.10	12,617.70
NATURGY ENERGY GROUP SA	775	23.24	18,011.00
RWE AG	586	19.51	11,435.79
SUEZ	726	12.16	8,831.79
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	2,888	5.15	14,878.97
VEOLIA ENVIRONNEMENT	203	18.51	3,758.54
ASML HOLDING NV	552	144.08	79,532.16
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,204	17.63	21,232.54
STMICROELECTRONICS NV	890	12.23	10,884.70
ユーロ 建小計	250,477		4,348,378.27 (557,809,964)
英ボンド			
BP PLC	24,211	5.12	124,129.79
JOHN WOOD GROUP PLC	1,202	5.67	6,824.95
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	5,887	23.42	137,902.97
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	4,534	23.58	106,911.72
ANGLO AMERICAN PLC	1,185	16.94	20,078.64

ANTOFAGASTA PLC	904	7.78	7,033.12
BHP GROUP PLC	2,607	16.16	42,144.76
CRODA INTERNATIONAL PLC	290	46.91	13,603.90
FRESNILLO PLC	507	8.33	4,226.35
GLENCORE PLC	12,180	2.89	35,279.37
JOHNSON MATTHEY PLC	428	27.18	11,633.04
MONDI PLC	812	16.32	13,251.84
RANDGOLD RESOURCES LIMITED	208	69.42	14,439.36
RIO TINTO PLC(UK)	1,568	36.75	57,631.84
ASHTED GROUP PLC	487	17.20	8,376.40
BAE SYSTEMS PLC	5,054	4.56	23,051.29
FERGUSON PLC	267	49.43	13,199.14
MEGGITT PLC	1,716	4.74	8,140.70
MELROSE INDUSTRIES PLC	7,500	1.59	11,955.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,766	8.08	14,279.87
SMITHS GROUP PLC	875	13.72	12,005.00
THE WEIR GROUP PLC	482	13.74	6,622.68
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	580	5.31	3,082.12
EXPERIAN PLC	1,023	18.95	19,390.96
G4S PLC	3,433	1.85	6,371.64
INTERTEK GROUP PLC	157	46.35	7,276.95
RELX PLC	2,335	16.29	38,037.15
EASYJET PLC	372	11.02	4,099.44
ROYAL MAIL PLC	1,991	2.96	5,899.33
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,227	4.40	9,809.93
BERKELEY GROUP HOLDINGS PLC	303	34.32	10,398.96
BURBERRY GROUP PLC	184	17.51	3,221.84
PERSIMMON PLC	154	18.97	2,921.38
TAYLOR WIMPEY PLC	7,223	1.32	9,556.02
CARNIVAL PLC(UK)	110	43.71	4,808.10
COMPASS GROUP PLC	1,807	16.83	30,411.81
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	1,573	3.28	5,162.58
TUI AG	904	11.69	10,572.28
WHITBREAD PLC	30	44.98	1,349.40
AUTO TRADER GROUP PLC	2,260	4.48	10,131.58
INFORMA PLC	1,146	6.49	7,446.70
ITV PLC	8,015	1.29	10,407.47
PEARSON PLC	786	9.45	7,433.98
WPP PLC	1,621	8.69	14,092.97
KINGFISHER PLC	1,322	2.25	2,979.78
MARKS & SPENCER GROUP PLC	3,595	2.63	9,469.23
NEXT PLC	151	43.38	6,550.38

SAINSBURY (J) PLC	3,629	2.75	9,997.89
TESCO PLC	10,467	1.92	20,190.84
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	4,908	2.25	11,084.71
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	382	21.80	8,327.60
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC(UK)	3,072	26.60	81,715.20
COCA-COLA HBC AG-CDI	402	24.62	9,897.24
DIAGEO PLC	2,898	28.25	81,868.50
IMPERIAL BRANDS PLC	1,166	23.71	27,651.69
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	902	62.64	56,501.28
UNILEVER PLC	1,405	43.20	60,696.00
CONVATEC GROUP PLC	2,403	1.40	3,381.02
SMITH & NEPHEW PLC	250	14.85	3,713.75
ASTRAZENECA PLC	1,557	61.30	95,444.10
GLAXOSMITHKLINE PLC	5,984	14.80	88,563.20
SHIRE PLC	1,183	46.73	55,281.59
BARCLAYS PLC	21,204	1.58	33,595.61
HSBC HOLDINGS PLC(UK)	24,459	6.53	159,839.56
LLOYDS BANKING GROUP PLC	89,360	0.52	47,092.72
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC	7,280	2.11	15,404.48
STANDARD CHARTERED PLC(UK)	3,019	6.04	18,255.89
3I GROUP PLC	608	7.79	4,739.96
HARGREAVES LANSDOWN PLC	598	18.31	10,952.37
INVESTEC PLC	1,506	4.34	6,543.57
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	330	40.40	13,332.00
SCHRODERS PLC	255	23.89	6,091.95
ST JAMES'S PLACE PLC	1,167	9.36	10,925.45
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	315	2.46	775.37
ADMIRAL GROUP PLC	409	19.80	8,100.24
AVIVA PLC	3,583	3.77	13,507.91
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	3,042	3.07	9,354.15
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,842	2.29	8,805.86
PRUDENTIAL PLC	3,144	14.15	44,503.32
RSA INSURANCE GROUP PLC	651	5.06	3,297.96
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC(UK)	468	14.62	6,844.50
BT GROUP PLC	9,979	2.51	25,102.17
VODAFONE GROUP PLC	35,477	1.60	57,004.44
CENTRICA PLC	5,102	1.38	7,040.76
NATIONAL GRID PLC	4,162	8.43	35,106.47
SEVERN TRENT PLC	521	18.79	9,792.19
SSE PLC	1,359	10.89	14,806.30
UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,509	7.56	11,411.05
	381,929		2,130,144.57

英債券 建小計				(304,227,247)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	18	507.00	9,126.00
	GIVAUDAN-REG	8	2,356.00	18,848.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	532	42.03	22,359.96
	SIKA AG-BR	240	125.50	30,120.00
	ABB LIMITED-REG	2,332	19.59	45,683.88
	GEBERIT AG-REG	48	378.50	18,168.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	46	191.20	8,795.20
	SGS SA-REG	8	2,313.00	18,504.00
	KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL AG-REG	8	131.80	1,054.40
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	630	63.56	40,042.80
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	114	57.40	6,543.60
	THE SWATCH GROUP AG-B	23	290.20	6,674.60
	DUFREY AG	75	95.50	7,162.50
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	5	1,606.00	8,030.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT&SPRUENGLI AG-PC	2	6,515.00	13,030.00
	NESTLE SA-REGISTERED	3,923	83.84	328,904.32
	SONOVA HOLDING AG-REG	116	161.60	18,745.60
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	20	645.50	12,910.00
	LONZA GROUP AG-REG	118	301.50	35,577.00
	NOVARTIS AG-REG SHS	2,759	87.02	240,088.18
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	852	249.90	212,914.80
	VIFOR PHARMA AG	100	120.20	12,020.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	3,237	11.20	36,254.40
	PARGESA HOLDING SA-BR	80	69.45	5,556.00
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	16	625.00	10,000.00
	UBS GROUP AG	4,250	12.50	53,146.25
	BALOISE HOLDING AG-REG	32	140.50	4,496.00
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	34	383.40	13,035.60
	SWISS RE AG	357	89.56	31,972.92
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	174	297.60	51,782.40
SWISS PRIME SITE AG-REG	158	81.60	12,892.80	
TEMENOS AG	66	127.20	8,395.20	
SWISSCOM AG-REG	6	477.80	2,866.80	
スイスフラン 建小計		20,387		1,345,701.21 (153,019,684)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	414	234.70	97,165.80
	BOLIDEN AB	605	201.65	121,998.25
	ALFA LAVAL AB	650	194.55	126,457.50
	ASSA ABLOY AB-B	1,113	163.15	181,585.95
	ATLAS COPCO AB-A	1,106	210.50	232,813.00
	ATLAS COPCO AB-B	60	196.54	11,792.40

	EPIROC AB-A	1,106	76.60	84,719.60	
	EPIROC AB-B	60	73.80	4,428.00	
	SANDVIK AB	1,099	128.40	141,111.60	
	SKANSKA AB-B SHS	752	144.15	108,400.80	
	SKF AB-B SHARES	774	133.25	103,135.50	
	VOLVO AB-B SHS	1,351	117.60	158,877.60	
	SECURITAS AB-B SHS	693	142.80	98,960.40	
	ELECTROLUX AB-SER B	532	196.50	104,538.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	955	70.12	66,964.60	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	1,507	156.12	235,272.84	
	ICA GRUPPEN AB	185	323.00	59,755.00	
	SWEDISH MATCH AB	152	368.10	55,951.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	662	228.20	151,068.40	
	NORDEA BANK ABP	3,492	78.80	275,169.60	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	2,181	88.20	192,364.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,604	102.90	165,051.60	
	SWEDBANK AB-A SHARES	1,020	205.00	209,100.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	377	184.25	69,462.25	
	INVESTOR AB-B SHS	377	388.10	146,313.70	
	KINNEVIK AB-B	518	221.60	114,788.80	
	L E LUNDBERGFÖRETAGEN AB-B SHS	168	266.00	44,688.00	
	ERICSSON LM-B SHS	3,262	82.20	268,136.40	
	HEXAGON AB-B SHS	174	415.40	72,279.60	
	MILLICOM INTL CELLULAR -SDR	152	553.00	84,056.00	
	TELE2 AB-B SHS	828	110.65	91,618.20	
	TELIA CO AB	2,290	43.48	99,569.20	
	スウェーデンクローナ 建小計	30,219		3,977,593.99	(49,839,252)
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	1,882	194.35	365,766.70	
	YARA INTERNATIONAL ASA	393	346.20	136,056.60	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	197	270.00	53,190.00	
	MARINE HARVEST	846	186.95	158,159.70	
	ORKLA ASA	375	70.00	26,250.00	
	DNB ASA	1,551	145.50	225,670.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	459	133.60	61,322.40	
	TELENOR ASA	635	170.10	108,013.50	
	ノルウェークローネ 建小計	6,338		1,134,429.40	(14,929,090)
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	100	592.80	59,280.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	216	525.00	113,400.00	
	ISS A/S	3	190.75	572.25	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-B	13	8,888.00	115,544.00	

	DSV A/S	194	491.90	95,428.60
	PANDORA A/S	246	295.70	72,742.20
	CARLSBERG AS-B	78	719.00	56,082.00
	COLOPLAST A/S	110	631.60	69,476.00
	WILLIAM DEMANT HOLDING A/S	275	200.40	55,110.00
	GENMAB A/S	118	1,068.50	126,083.00
	H LUNDBECK A/S	142	286.50	40,683.00
	NOVO NORDISK A/S-B	2,311	310.00	716,410.00
	DANSKE BANK A/S	1,190	138.05	164,279.50
	TRYG A/S	259	165.50	42,864.50
	ORSTED A/S	337	450.10	151,683.70
	デンマーククローネ 建小計	5,592		1,879,638.75 (32,292,193)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	577	26.84	15,486.68
	OIL SEARCH LIMITED	3,032	7.20	21,830.40
	ORIGIN ENERGY LIMITED	1,276	7.00	8,932.00
	SANTOS LTD	4,195	5.50	23,072.50
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	1,349	31.16	42,034.84
	ALUMINA LIMITED	5,614	2.20	12,350.80
	AMCOR LTD	1,100	13.26	14,586.00
	BHP BILLITON LIMITED(AU)	4,312	32.40	139,708.80
	BLUESCOPE STEEL LTD	1,175	11.90	13,982.50
	BORAL LIMITED	2,577	4.97	12,807.69
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	3,444	4.12	14,189.28
	INCITEC PIVOT LIMITED	3,870	3.45	13,351.50
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	975	15.08	14,703.00
	NEWCREST MINING LIMITED	458	20.84	9,544.72
	ORICA LTD	829	16.67	13,819.43
	RIO TINTO LIMITED(AU)	201	74.57	14,988.57
	SOUTH32 LIMITED	5,656	3.28	18,551.68
	CIMIC GROUP LIMITED	223	43.04	9,597.92
	BRAMBLES LTD	267	9.90	2,643.30
	SEEK LIMITED	758	17.36	13,158.88
	AURIZON HOLDINGS LIMITED	934	4.44	4,146.96
	SYDNEY AIRPORT CO LIMITED	2,439	6.90	16,829.10
	TRANSURBAN GROUP	1,966	11.89	23,375.74
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	415	22.82	9,470.30
	CROWN RESORTS LIMITED	835	11.89	9,928.15
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	138	40.54	5,594.52
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LIMITED	123	44.00	5,412.00
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	20	4.28	85.60
	REA GROUP LIMITED	121	73.22	8,859.62

	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	1,276	3.22	4,108.72	
	WESFARMERS LIMITED	1,618	31.28	50,611.04	
	COLES GROUP LTD	1,618	11.72	18,962.96	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	1,703	28.31	48,211.93	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	1,314	8.42	11,063.88	
	TREASURY WINE ESTATES LIMITED	759	14.61	11,088.99	
	COCHLEAR LIMITED	127	170.53	21,657.31	
	RAMSAY HEALTH CARE LIMITED	313	54.43	17,036.59	
	SONIC HEALTHCARE LTD	874	22.38	19,560.12	
	CSL LIMITED	603	180.15	108,630.45	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	3,183	24.80	78,938.40	
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	888	9.56	8,489.28	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LIMITED	1,084	10.33	11,197.72	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	2,054	68.81	141,335.74	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	3,457	23.69	81,896.33	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	4,390	24.88	109,223.20	
	ASX LTD	138	59.14	8,161.32	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	1,311	9.88	12,952.68	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	375	113.18	42,442.50	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	1,758	6.96	12,235.68	
	MEDIBANK PRIVATE LIMITED	6,093	2.33	14,196.69	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	1,274	10.14	12,918.36	
	SUNCORP GROUP LIMITED	1,281	13.02	16,678.62	
	LENLEASE GROUP	1,225	11.58	14,185.50	
	COMPUTERSHARE LIMITED	1,027	17.43	17,900.61	
	TELSTRA CORPORATION	2,169	2.87	6,225.03	
	TPG TELECOM LIMITED	751	6.30	4,731.30	
	AGL ENERGY LIMITED	269	19.50	5,245.50	
	APA GROUP	2,465	8.67	21,371.55	
	AUSNET SERVICES	4,089	1.58	6,481.06	
	オーストラリアドル 建小計	98,365		1,450,781.54	(118,035,586)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LIMITED	1,535	4.84	7,429.40	
	AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LIMITED	2,108	6.97	14,692.76	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	860	11.15	9,589.00	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	4,053	4.25	17,225.25	
	MERIDIAN ENERGY LTD	2,939	3.40	9,992.60	
	ニュージーランドドル 建小計	11,495		58,929.01	(4,538,123)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LIMITED	2,534	79.20	200,692.80	
	NWS HOLDINGS LIMITED	2,500	16.94	42,350.00	
	MTR CORPORATION	2,903	41.05	119,168.15	

TECHTRONIC INDUSTRIES CO LIMITED	2,773	42.40	117,575.20	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS LIMITED	1,338	22.40	29,971.20	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	2,537	51.15	129,767.55	
MGM CHINA HOLDINGS LIMITED	2,155	13.94	30,040.70	
SANDS CHINA LIMITED	2,974	35.30	104,982.20	
SHANGRI-LA ASIA LIMITED	1,813	11.06	20,051.78	
SJM HOLDINGS LIMITED	4,000	7.28	29,120.00	
WYNN MACAU LIMITED	3,499	18.40	64,381.60	
WH GROUP LTD	18,000	5.92	106,560.00	
BANK OF EAST ASIA	2,667	25.40	67,741.80	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,684	29.90	110,151.60	
HANG SENG BANK LTD	600	178.20	106,920.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	1,066	232.20	247,525.20	
AIA GROUP LIMITED	14,751	64.05	944,801.55	
CK ASSET HOLDINGS LTD	2,534	57.45	145,578.30	
HANG LUNG GROUP LTD	2,000	21.35	42,700.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	3,864	15.90	61,437.60	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,897	39.85	75,595.45	
HYSAN DEVELOPMENT COMPANY LIMITED	1,000	38.60	38,600.00	
KERRY PROPERTIES LIMITED	1,452	28.30	41,091.60	
NEW WORLD DEVELOPMENT	11,562	10.76	124,407.12	
SINO LAND CO	6,576	13.78	90,617.28	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	2,000	113.50	227,000.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	1,000	83.55	83,550.00	
SWIRE PROPERTIES LIMITED	2,632	28.60	75,275.20	
WHARF HOLDINGS LTD	2,000	20.20	40,400.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	2,000	48.85	97,700.00	
WHEELLOCK AND COMPANY LTD	2,000	45.35	90,700.00	
HKT TRUST AND HKT LIMITED	8,080	11.90	96,152.00	
PCCW LIMITED	8,884	4.64	41,221.76	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	1,000	58.80	58,800.00	
CLP HOLDINGS LTD	1,235	88.10	108,803.50	
HK ELECTRIC INVESTMENTS AND HK ELECTRIC	6,000	7.65	45,900.00	
HONG KONG & CHINA GAS COMPANY LIMITED	8,268	16.06	132,784.08	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	2,567	54.30	139,388.10	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY LIMITED	500	77.35	38,675.00	
香港ドル 建小計	148,845		4,368,178.32 (63,425,949)	
シンガポールドル	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	2,300	2.60	5,980.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	3,600	3.46	12,456.00
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	4,369	1.21	5,286.49
	COMFORTDELGRO CORPORATION LIMITED	4,900	2.12	10,388.00

	SATS LTD	1,500	4.59	6,885.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	1,200	9.33	11,196.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	13,400	0.99	13,333.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	3,500	2.42	8,470.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LIMITED	200	35.42	7,084.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LIMITED	16,200	0.26	4,212.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	3,300	3.15	10,395.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LIMITED	1,900	23.69	45,011.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	3,300	11.12	36,696.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,500	24.28	36,420.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LIMITED	1,800	7.16	12,888.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	900	8.23	7,407.00	
	UOL GROUP LIMITED	1,100	6.06	6,666.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	7,200	3.04	21,888.00	
	シンガポールドル 建小計	72,169		262,661.49 (21,661,693)	
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	1,130	20.54	23,210.20	
	ELBIT SYSTEMS LIMITED	52	462.60	24,055.20	
	BANK HAPOLIM BM	2,357	24.60	57,982.20	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,631	23.10	37,676.10	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LIMITED	319	65.32	20,837.08	
	AZRIELI GROUP	94	185.40	17,427.60	
	NICE LIMITED	26	420.90	10,943.40	
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORPORATION LTD	4,757	3.95	18,790.15	
	イスラエルシュケル 建小計	10,366		210,921.93 (6,346,640)	
	合 計	1,464,112		4,643,281,978 (4,643,281,978)	

(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	13,190.64	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE	176	21,560.00	
		AMERICAN TOWER CORPORATION	574	95,628.40	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	2,091	21,370.02	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	219	40,931.10	
		BOSTON PROPERTIES INC	244	30,680.56	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	194	17,751.00	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	485	55,556.75	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	205	23,435.60	

		DUKE REALTY CORP	86	2,413.16
		EQUINIX INC	101	39,076.90
		EQUITY RESIDENTIAL	583	40,775.02
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	62	16,261.36
		EXTRA SPACE STORAGE INC	56	5,449.92
		FEDERAL REALTY INVESTMENT	12	1,570.92
		HCP INC	200	5,790.00
		HOST HOTELS & RESORTS	641	11,396.98
		INVITATION HOMES INC	494	10,556.78
		IRON MOUNTAIN INC	554	19,401.08
		KIMCO REALTY CORPORATION	940	15,463.00
		LIBERTY PROPERTY TRUST	325	15,057.25
		MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	54	5,476.14
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	325	16,461.25
		PROLOGIS INC	644	41,737.64
		PUBLIC STORAGE	185	37,641.95
		REALTY INCOME CORP	325	21,560.50
		REGENCY CENTERS CORPORATION	54	3,321.00
		SBA COMMUNICATIONS CORP	80	13,800.00
		SIMON PROPERTY GROUP	399	72,881.34
		SL GREEN REALTY CORPORATION	17	1,517.76
		THE MACERICH COMPANY	270	12,897.90
		UDR INC	68	2,856.68
		VENTAS INC	563	35,221.28
		VEREIT INC	2,155	16,895.20
		VORNADO REALTY TRUST	162	11,074.32
		WELLTOWER INC	581	42,029.54
		WEYERHAEUSER COMPANY	1,194	28,691.82
		WP CAREY INC	221	15,598.18
米ドル建小計			16,271	882,978.94 (100,191,620)
カナダドル	投資証券	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST UTS	300	6,426.00
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	297	7,318.08
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	100	3,201.00
カナダドル建小計			697	16,945.08 (1,436,942)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	76	6,486.60
		GECINA SA	93	11,392.50
		ICADE	85	5,635.50
ユーロ建小計			254	23,514.60 (3,016,452)
英ポンド	投資証券	HAMMERSON PLC	1,755	6,163.56

		SEGRO PLC	2,136	12,892.89
英ポンド建小計			3,891	19,056.45 (2,721,642)
オーストラリアドル	投資証券	DEXUS	583	6,465.47
		GOODMAN GROUP	310	3,388.30
		GPT GROUP	956	5,305.80
		MIRVAC GROUP	8,197	18,853.10
		SCENTRE GROUP	4,823	19,099.08
		VICINITY CENTRES	1,672	4,480.96
オーストラリアドル建小計			16,541	57,592.71 (4,685,742)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	2,607	205,561.95
香港ドル建小計			2,607	205,561.95 (2,984,759)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,500	14,300.00
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	4,769	8,488.82
		CAPITALAND MALL TRUST	5,700	12,882.00
		SUNTEC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,500	9,955.00
シンガポールドル建小計			21,469	45,625.82 (3,762,761)
合計				118,799,918 (118,799,918)

(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 569銘柄	61.8%		66.0%
	投資証券 38銘柄		2.0%	2.1%
カナダドル	株式 80銘柄	3.4%		3.6%
	投資証券 3銘柄		0.0%	0.0%
ユーロ	株式 213銘柄	11.0%		11.7%
	投資証券 3銘柄		0.1%	0.1%
英ポンド	株式 88銘柄	6.0%		6.4%
	投資証券 2銘柄		0.1%	0.1%
スイスフラン	株式 33銘柄	3.0%		3.2%
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%		0.7%

オーストラリアドル	株式	59銘柄	2.3%		2.5%
	投資証券	6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	39銘柄	1.2%		1.3%
	投資証券	1銘柄		0.1%	0.1%
シンガポールドル	株式	18銘柄	0.4%		0.5%
	投資証券	4銘柄		0.1%	0.1%
イスラエルシケル	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12月17日現在

資産の部		
流動資産		
コール・ローン		108,247,270
国債証券		9,913,221,100
地方債証券		984,800,600
特殊債証券		849,299,000
社債証券		517,080,000
未収利息		35,631,758
前払費用		420,396
流動資産合計		12,408,700,124
資産合計		12,408,700,124
負債の部		
流動負債		
未払解約金		25,958,200
未払利息		250
流動負債合計		25,958,450
負債合計		25,958,450
純資産の部		
元本等		
元本		9,741,019,132
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		2,641,722,542
元本等合計		12,382,741,674
純資産合計		12,382,741,674
負債純資産合計		12,408,700,124

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 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。

(貸借対照表に関する注記)

平成30年12月17日現在	
1. 計算日における受益権の総数	9,741,019,132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	1.2712円
(1万口当たり純資産額)	(12,712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12月16日 至 平成30年12月17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。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券であり、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。

区分	自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17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>
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。

金融商品の時価等に関する事項

平成30年12月17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	
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。

（関連当事者との取引に関する注記）

区分	自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17日
	該当事項はありません。

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成30年12月17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	11,271,523,135円
期中追加設定元本額	1,831,862,226円
期中一部解約元本額	3,362,366,229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)	118,221,735円
新光7資産バランスファンド	577,583,847円
日本債券ファンド	3,590,261,319円
新光日本債券インデックスVA	29,190,354円
新光世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	736,968,512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)	670,055,658円
新光世界バランス35VAT(適格機関投資家私募)	87,971,578円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	2,698,781,522円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	1,206,926,846円
グローバル・ナビ	25,057,761円
合計	9,741,019,132円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成30年12月17日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	80,829,700
地方債証券	4,062,400
特殊債証券	2,398,000
社債証券	1,420,000
合計	88,710,100

(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123回利付国債(5年)	160,000,000	160,552,000	
	第124回利付国債(5年)	150,000,000	150,610,500	
	第125回利付国債(5年)	120,000,000	120,570,000	
	第126回利付国債(5年)	140,000,000	140,746,200	
	第127回利付国債(5年)	120,000,000	120,718,800	
	第128回利付国債(5年)	120,000,000	120,799,200	
	第129回利付国債(5年)	60,000,000	60,431,400	
	第130回利付国債(5年)	80,000,000	80,615,200	
	第131回利付国債(5年)	60,000,000	60,499,800	
	第132回利付国債(5年)	110,000,000	110,968,000	
	第133回利付国債(5年)	50,000,000	50,472,000	
	第134回利付国債(5年)	90,000,000	90,906,300	
	第135回利付国債(5年)	90,000,000	90,981,900	
	第136回利付国債(5年)	50,000,000	50,566,500	
	第137回利付国債(5年)	50,000,000	50,574,500	
	第1回利付国債(40年)	10,000,000	14,248,700	
	第2回利付国債(40年)	20,000,000	27,592,800	
	第3回利付国債(40年)	20,000,000	27,728,200	
	第4回利付国債(40年)	30,000,000	41,785,200	
	第5回利付国債(40年)	30,000,000	40,194,300	
	第6回利付国債(40年)	30,000,000	39,455,400	
	第7回利付国債(40年)	30,000,000	37,735,500	
	第8回利付国債(40年)	30,000,000	34,959,900	
	第9回利付国債(40年)	40,000,000	33,900,000	
	第10回利付国債(40年)	40,000,000	40,114,000	
	第11回利付国債(40年)	10,000,000	9,667,800	
	第306回利付国債(10年)	150,000,000	152,953,500	
	第308回利付国債(10年)	140,000,000	143,092,600	
	第309回利付国債(10年)	20,000,000	20,381,400	
	第310回利付国債(10年)	110,000,000	112,256,100	
	第311回利付国債(10年)	50,000,000	50,849,500	
	第312回利付国債(10年)	140,000,000	143,844,400	
	第313回利付国債(10年)	100,000,000	103,299,000	
	第315回利付国債(10年)	80,000,000	82,735,200	
	第317回利付国債(10年)	50,000,000	51,736,500	
	第318回利付国債(10年)	80,000,000	82,557,600	
	第319回利付国債(10年)	30,000,000	31,131,900	
	第320回利付国債(10年)	50,000,000	51,735,500	
	第321回利付国債(10年)	50,000,000	51,879,000	
	第322回利付国債(10年)	20,000,000	20,686,200	
	第323回利付国債(10年)	40,000,000	41,472,000	

第324回利付国債(10年)	50,000,000	51,664,000	
第325回利付国債(10年)	100,000,000	103,569,000	
第326回利付国債(10年)	60,000,000	62,042,400	
第327回利付国債(10年)	50,000,000	51,903,500	
第328回利付国債(10年)	70,000,000	72,246,300	
第329回利付国債(10年)	70,000,000	72,998,800	
第330回利付国債(10年)	70,000,000	73,150,000	
第332回利付国債(10年)	120,000,000	124,476,000	
第333回利付国債(10年)	80,000,000	83,132,000	
第334回利付国債(10年)	100,000,000	104,104,000	
第335回利付国債(10年)	80,000,000	82,970,400	
第336回利付国債(10年)	30,000,000	31,153,200	
第337回利付国債(10年)	30,000,000	30,789,900	
第338回利付国債(10年)	70,000,000	72,338,000	
第339回利付国債(10年)	90,000,000	93,097,800	
第340回利付国債(10年)	110,000,000	113,895,100	
第341回利付国債(10年)	100,000,000	102,967,000	
第342回利付国債(10年)	90,000,000	91,448,100	
第343回利付国債(10年)	110,000,000	111,746,800	
第344回利付国債(10年)	110,000,000	111,675,300	
第345回利付国債(10年)	120,000,000	121,789,200	
第346回利付国債(10年)	110,000,000	111,551,000	
第347回利付国債(10年)	80,000,000	81,059,200	
第348回利付国債(10年)	70,000,000	70,861,000	
第349回利付国債(10年)	80,000,000	80,902,400	
第350回利付国債(10年)	100,000,000	100,971,000	
第351回利付国債(10年)	60,000,000	60,483,600	
第352回利付国債(10年)	20,000,000	20,136,000	
第5回利付国債(30年)	20,000,000	24,968,200	
第7回利付国債(30年)	20,000,000	25,472,000	
第10回利付国債(30年)	20,000,000	22,308,600	
第11回利付国債(30年)	20,000,000	24,008,600	
第12回利付国債(30年)	10,000,000	12,596,900	
第13回利付国債(30年)	20,000,000	24,935,600	
第15回利付国債(30年)	20,000,000	26,518,600	
第17回利付国債(30年)	20,000,000	26,313,800	
第19回利付国債(30年)	20,000,000	26,085,000	
第20回利付国債(30年)	10,000,000	13,381,800	
第21回利付国債(30年)	10,000,000	13,077,300	
第22回利付国債(30年)	10,000,000	13,432,400	
第23回利付国債(30年)	10,000,000	13,446,300	
第24回利付国債(30年)	20,000,000	26,940,600	

第26回利付国債(30年)	30,000,000	40,001,700	
第27回利付国債(30年)	30,000,000	40,672,200	
第28回利付国債(30年)	30,000,000	40,787,400	
第29回利付国債(30年)	20,000,000	26,904,800	
第30回利付国債(30年)	40,000,000	53,240,400	
第31回利付国債(30年)	30,000,000	39,478,800	
第32回利付国債(30年)	40,000,000	53,574,400	
第33回利付国債(30年)	50,000,000	64,087,500	
第34回利付国債(30年)	40,000,000	53,032,000	
第35回利付国債(30年)	50,000,000	64,402,500	
第36回利付国債(30年)	50,000,000	64,547,000	
第37回利付国債(30年)	50,000,000	63,581,000	
第38回利付国債(30年)	30,000,000	37,581,900	
第39回利付国債(30年)	30,000,000	38,290,500	
第40回利付国債(30年)	20,000,000	25,091,800	
第41回利付国債(30年)	20,000,000	24,649,400	
第42回利付国債(30年)	30,000,000	36,993,300	
第43回利付国債(30年)	30,000,000	37,012,800	
第44回利付国債(30年)	30,000,000	37,031,400	
第45回利付国債(30年)	30,000,000	35,632,800	
第46回利付国債(30年)	40,000,000	47,518,000	
第47回利付国債(30年)	30,000,000	36,361,200	
第48回利付国債(30年)	30,000,000	34,929,000	
第49回利付国債(30年)	40,000,000	46,570,800	
第50回利付国債(30年)	20,000,000	20,318,200	
第51回利付国債(30年)	30,000,000	26,708,700	
第52回利付国債(30年)	30,000,000	28,147,500	
第53回利付国債(30年)	30,000,000	28,858,200	
第54回利付国債(30年)	40,000,000	40,466,000	
第55回利付国債(30年)	30,000,000	30,316,500	
第56回利付国債(30年)	30,000,000	30,282,900	
第57回利付国債(30年)	30,000,000	30,249,000	
第58回利付国債(30年)	40,000,000	40,286,400	
第59回利付国債(30年)	30,000,000	29,424,300	
第60回利付国債(30年)	20,000,000	20,629,400	
第45回利付国債(20年)	30,000,000	30,967,200	
第47回利付国債(20年)	50,000,000	52,085,500	
第48回利付国債(20年)	30,000,000	31,607,700	
第50回利付国債(20年)	30,000,000	31,400,100	
第51回利付国債(20年)	10,000,000	10,543,600	
第52回利付国債(20年)	20,000,000	21,249,600	
第53回利付国債(20年)	10,000,000	10,679,200	

第55回利付国債(20年)	10,000,000	10,703,200	
第57回利付国債(20年)	30,000,000	32,160,600	
第58回利付国債(20年)	20,000,000	21,544,600	
第59回利付国債(20年)	10,000,000	10,743,300	
第63回利付国債(20年)	20,000,000	21,763,600	
第64回利付国債(20年)	10,000,000	10,974,100	
第69回利付国債(20年)	30,000,000	33,546,600	
第70回利付国債(20年)	20,000,000	22,811,400	
第72回利付国債(20年)	20,000,000	22,593,000	
第76回利付国債(20年)	30,000,000	33,828,000	
第78回利付国債(20年)	20,000,000	22,648,200	
第81回利付国債(20年)	10,000,000	11,440,100	
第84回利付国債(20年)	10,000,000	11,493,600	
第88回利付国債(20年)	30,000,000	35,457,000	
第90回利付国債(20年)	40,000,000	47,154,400	
第92回利付国債(20年)	50,000,000	58,782,000	
第94回利付国債(20年)	30,000,000	35,388,600	
第95回利付国債(20年)	20,000,000	24,013,800	
第97回利付国債(20年)	40,000,000	47,872,800	
第99回利付国債(20年)	40,000,000	47,671,600	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	36,123,000	
第103回利付国債(20年)	30,000,000	36,505,500	
第105回利付国債(20年)	30,000,000	36,058,200	
第108回利付国債(20年)	40,000,000	47,414,400	
第110回利付国債(20年)	10,000,000	12,090,900	
第111回利付国債(20年)	30,000,000	36,682,200	
第112回利付国債(20年)	20,000,000	24,246,000	
第113回利付国債(20年)	50,000,000	60,803,000	
第114回利付国債(20年)	10,000,000	12,190,400	
第116回利付国債(20年)	30,000,000	37,009,800	
第117回利付国債(20年)	40,000,000	48,901,200	
第118回利付国債(20年)	10,000,000	12,140,200	
第121回利付国債(20年)	20,000,000	24,099,000	
第123回利付国債(20年)	50,000,000	61,570,500	
第125回利付国債(20年)	30,000,000	37,398,900	
第128回利付国債(20年)	20,000,000	24,251,200	
第130回利付国債(20年)	20,000,000	24,040,200	
第132回利付国債(20年)	40,000,000	47,665,600	
第133回利付国債(20年)	20,000,000	24,086,600	
第134回利付国債(20年)	40,000,000	48,230,800	
第135回利付国債(20年)	10,000,000	11,928,700	
第136回利付国債(20年)	20,000,000	23,599,400	

第137回利付国債(20年)	30,000,000	35,846,100	
第138回利付国債(20年)	10,000,000	11,678,600	
第139回利付国債(20年)	20,000,000	23,619,400	
第140回利付国債(20年)	60,000,000	71,760,600	
第141回利付国債(20年)	40,000,000	47,913,200	
第142回利付国債(20年)	20,000,000	24,227,600	
第143回利付国債(20年)	40,000,000	47,398,400	
第144回利付国債(20年)	20,000,000	23,424,200	
第145回利付国債(20年)	60,000,000	72,025,800	
第146回利付国債(20年)	50,000,000	60,103,500	
第147回利付国債(20年)	60,000,000	71,302,200	
第148回利付国債(20年)	60,000,000	70,449,600	
第149回利付国債(20年)	60,000,000	70,509,600	
第150回利付国債(20年)	60,000,000	69,615,000	
第151回利付国債(20年)	50,000,000	56,484,000	
第152回利付国債(20年)	60,000,000	67,738,200	
第153回利付国債(20年)	50,000,000	57,232,500	
第154回利付国債(20年)	60,000,000	67,696,800	
第155回利付国債(20年)	50,000,000	54,733,000	
第156回利付国債(20年)	50,000,000	49,719,000	
第157回利付国債(20年)	60,000,000	57,472,800	
第158回利付国債(20年)	60,000,000	60,393,600	
第159回利付国債(20年)	40,000,000	40,863,200	
第160回利付国債(20年)	50,000,000	51,845,500	
第161回利付国債(20年)	50,000,000	50,889,500	
第162回利付国債(20年)	50,000,000	50,813,500	
第163回利付国債(20年)	40,000,000	40,553,200	
第164回利付国債(20年)	50,000,000	49,694,500	
第165回利付国債(20年)	40,000,000	39,682,400	
第166回利付国債(20年)	40,000,000	41,105,600	
国債証券 小計	9,120,000,000	9,913,221,100	
地方債証券			
第18回東京都公募公債(20年)	100,000,000	120,650,000	
第783回東京都公募公債	100,000,000	100,690,000	
第200回神奈川県公募公債	35,000,000	36,372,000	
第218回神奈川県公募公債	100,000,000	101,210,000	
第412回大阪府公募公債(10年)	50,000,000	49,990,000	
第12回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	105,660,000	
平成24年度第3回広島県公募公債	66,000,000	68,052,600	
平成24年度第7回広島県公募公債	100,000,000	102,870,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(30年)	10,000,000	12,873,000	
第105回共同発行市場公募地方債	50,000,000	51,620,000	
第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,000,000	

	第485回名古屋市公募公債(10年)	30,000,000	30,993,000	
	平成24年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,820,000	
地方債証券 小計		941,000,000	984,800,600	
特殊債券	第97回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,030,000	
	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,960,000	
	第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,370,000	
	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	101,030,000	
	第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,050,000	
	第49回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,160,000	
	第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,600,000	
	い第782号農林債	10,000,000	10,039,000	
	第317回信金中金債(5年)	100,000,000	100,060,000	
特殊債券 小計		810,000,000	849,299,000	
社債券	第4回第一三共社債	100,000,000	103,370,000	
	第11回ブリヂストン社債	100,000,000	100,660,000	
	第44回ホンダファイナンス社債	100,000,000	99,910,000	
	第47回野村ホールディングス社債	100,000,000	100,980,000	
	第36回東日本旅客鉄道社債	100,000,000	112,160,000	
社債券 小計		500,000,000	517,080,000	
合計		11,371,000,000	12,264,400,700	

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。

海外国債マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

平成30年12月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	20,202,410
コール・ローン	216,880,326
国債証券	19,358,442,350
未収利息	85,816,079
前払費用	10,301,171
流動資産合計	19,691,642,336
資産合計	19,691,642,336
負債の部	
流動負債	

平成30年12月17日現在	
未払利息	502
流動負債合計	502
負債合計	502
純資産の部	
元本等	
元本	8,716,097,955
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	10,975,543,879
元本等合計	19,691,641,834
純資産合計	19,691,641,834
負債純資産合計	19,691,642,336

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17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12月17日現在	
1. 計算日における受益権の総数	8,716,097,955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	2.2592円
(1万口当たり純資産額)	(22,592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12月16日 至 平成30年12月17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。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、国債証券であり、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引は為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。 リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。 市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。 信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。 流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

平成30年12月17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 国債証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17日
	該当事項はありません。

(その他の注記)

1 元本の移動

区分	平成30年12月17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	10,153,812,287円
期中追加設定元本額	58,891,339円
期中一部解約元本額	1,496,605,671円
同期末における元本の内訳	
海外国債ファンド	6,340,432,674円
海外国債ファンド(3ヵ月決算型)	1,073,809,873円
新光7資産バランスファンド	315,027,481円
海外国債ファンド(1年決算型)	23,851,519円
海外国債ファンド(変額年金)	948,438,529円
グローバル・ナビ	14,537,879円
合計	8,716,097,955円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成30年12月17日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	327,453,293
合計	327,453,293

(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-2.875%-20/10/31	2,000,000.00	2,004,375.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	5,000,000.00	4,820,703.14	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	8,000,000.00	7,380,625.03	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	8,000,000.00	7,360,625.03	
		US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	8,000,000.00	7,268,750.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	8,000,000.00	7,521,875.04	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	8,000,000.00	7,650,000.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	8,000,000.00	7,716,875.04	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	8,000,000.00	7,623,125.04	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	8,000,000.00	7,607,500.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	8,000,000.00	7,911,250.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	7,000,000.00	6,990,156.25	
		US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	1,000,000.00	998,437.50	
米ドル建小計			87,000,000.00	82,854,297.07 (9,401,477,088)	
カナダドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	1,000,000.00	960,760.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	1,500,000.00	1,374,810.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	1,000,000.00	991,900.00	
カナダドル建小計			3,500,000.00	3,327,470.00 (282,169,456)	
ユーロ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	5,400,000.00	5,609,412.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-26/08/15	3,500,000.00	3,495,730.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	3,000,000.00	3,043,050.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	1,000,000.00	1,547,520.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15	2,500,000.00	2,579,900.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	1,000,000.00	1,493,860.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-28/02/15	2,500,000.00	2,569,625.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	900,000.00	1,287,144.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-28/08/15	2,000,000.00	1,998,900.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-25/12/01	1,000,000.00	971,700.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-26/03/01	2,000,000.00	2,258,200.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%-26/06/01	2,000,000.00	1,881,600.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	2,000,000.00	2,657,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%-26/12/01	2,500,000.00	2,276,500.00			

		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%-27/06/01	2,000,000.00	1,925,200.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%-27/08/01	2,000,000.00	1,895,400.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	2,000,000.00	2,581,200.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-28/02/01	2,000,000.00	1,883,800.00	
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	2,400,000.00	2,521,200.00	
		FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	3,200,000.00	3,948,160.00	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	3,100,000.00	3,135,340.00	
		FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	4,300,000.00	4,240,660.00	
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	4,000,000.00	4,162,800.00	
		FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	4,000,000.00	4,769,200.00	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	3,000,000.00	3,012,900.00	
ユーロ建小計			63,300,000.00	67,746,801.00 (8,690,559,632)	
英ポンド	国債証券	TSY-1.5%-26/07/22	1,700,000.00	1,758,395.00	
		TSY-1.25%-27/07/22	1,800,000.00	1,816,020.00	
		TSY-4.25%-27/12/07	1,800,000.00	2,281,680.00	
		TSY-1.625%-28/10/22	1,000,000.00	1,035,350.00	
英ポンド建小計			6,300,000.00	6,891,445.00 (984,236,174)	
合計				19,358,442,350 (19,358,442,350)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	債券 13銘柄	47.7%	48.6%
カナダドル	債券 3銘柄	1.4%	1.5%
ユーロ	債券 25銘柄	44.1%	44.9%
英ポンド	債券 4銘柄	5.0%	5.1%

（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。

新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

平成30年12月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	259,219,575
コール・ローン	4,244,945
国債証券	8,164,809,676
派生商品評価勘定	39,512,646
未収利息	69,949,558
前払費用	1,046,404
差入委託証拠金	2,033
流動資産合計	8,538,784,837
資産合計	8,538,784,837
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,111,941
未払解約金	700,000
未払利息	9
流動負債合計	8,811,950
負債合計	8,811,950
純資産の部	
元本等	
元本	6,368,058,840
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,161,914,047
元本等合計	8,529,972,887
純資産合計	8,529,972,887
負債純資産合計	8,538,784,837

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17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12月17日現在	
1. 計算日における受益権の総数	6,368,058,840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	1.3395円
(1万口当たり純資産額)	(13,395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12月16日 至 平成30年12月17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。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが投資している有価証券は、国債証券であり、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引は為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスクの管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。 リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。 市場リスク 市場の変動率とファンドの基準価額の変動率を継続的に相対比較することやベンチマーク等と比較すること等により分析しております。 信用リスク 組入銘柄の格付やその他発行体情報等を継続的に収集し分析しております。 流動性リスク 市場流動性の状況を把握し、組入銘柄の一定期間における出来高や組入比率等を継続的に測定すること等により分析しております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

平成30年12月17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>国債証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりま す。</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

	自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17日
	該当事項はありません。

(その他の注記)

1 元本の移動

区分	平成30年12月17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	10,375,372,024円
期中追加設定元本額	185,801,961円
期中一部解約元本額	4,193,115,145円
同期末における元本の内訳	
新光ワールドバランスファンドVA(適格機関投資家私募)	1,908,153,956円
新光世界バランス35VAT(適格機関投資家私募)	83,841,370円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	3,213,924,502円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	1,146,314,032円
グローバル・ナビ	15,824,980円
合計	6,368,058,840円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成30年12月17日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	119,394,722
合計	119,394,722

(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

(通貨関連)

種類	平成30年12月17日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	8,444,596,601	-	8,413,195,896	31,400,705
米ドル	3,868,215,743	-	3,875,775,560	7,559,817
カナダドル	171,105,481	-	170,058,688	1,046,793
メキシコペソ	70,108,355	-	70,635,600	527,245
ユーロ	3,336,874,270	-	3,313,657,480	23,216,790
英ポンド	554,538,098	-	546,516,194	8,021,904
スウェーデンクローナ	34,584,157	-	34,609,036	24,879
ノルウェークローネ	23,271,259	-	23,037,898	233,361
デンマーククローネ	50,323,759	-	49,928,516	395,243
ポーランドズロチ	58,010,864	-	57,568,917	441,947
オーストラリアドル	185,614,281	-	182,094,858	3,519,423
シンガポールドル	36,618,292	-	36,503,844	114,448
南アフリカランド	55,332,042	-	52,809,305	2,522,737
合計	8,444,596,601	-	8,413,195,896	31,400,705

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

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-1.375%-20/02/29	290,000.00	285,242.18	

US TREASURY N/B-3.5%-20/05/15	1,800,000.00	1,818,000.00	
US TREASURY N/B-2.625%-20/08/15	1,600,000.00	1,596,624.99	
US TREASURY N/B-2.625%-20/11/15	1,310,000.00	1,306,929.68	
US TREASURY N/B-3.625%-21/02/15	1,410,000.00	1,436,217.18	
US TREASURY N/B-3.125%-21/05/15	1,330,000.00	1,342,780.46	
US TREASURY N/B-1.375%-21/05/31	390,000.00	377,477.34	
US TREASURY N/B-2.125%-21/08/15	1,210,000.00	1,191,093.75	
US TREASURY N/B-2.875%-21/10/15	210,000.00	210,787.50	
US TREASURY N/B-8.0%-21/11/15	950,000.00	1,088,492.18	
US TREASURY N/B-2.0%-21/11/15	230,000.00	225,435.93	
US TREASURY N/B-2.0%-22/02/15	990,000.00	968,498.43	
US TREASURY N/B-1.75%-22/05/15	800,000.00	774,437.49	
US TREASURY N/B-2.0%-22/10/31	440,000.00	428,140.61	
US TREASURY N/B-1.625%-22/11/15	870,000.00	834,180.46	
US TREASURY N/B-2.0%-22/11/30	680,000.00	661,246.87	
US TREASURY N/B-2.125%-22/12/31	540,000.00	527,259.37	
US TREASURY N/B-2.0%-23/02/15	810,000.00	786,142.97	
US TREASURY N/B-1.75%-23/05/15	750,000.00	719,121.09	
US TREASURY N/B-2.75%-23/05/31	320,000.00	320,250.00	
US TREASURY N/B-2.75%-23/07/31	100,000.00	100,039.06	
US TREASURY N/B-2.5%-23/08/15	660,000.00	652,678.12	
US TREASURY N/B-2.875%-23/09/30	190,000.00	191,083.59	
US TREASURY N/B-2.875%-23/10/31	270,000.00	271,603.12	
US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	690,000.00	690,215.62	
US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	700,000.00	699,507.81	
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	640,000.00	631,200.00	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	690,000.00	675,175.78	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	590,000.00	572,484.37	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	530,000.00	505,901.56	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	510,000.00	489,560.15	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	140,000.00	133,098.43	
US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	60,000.00	60,721.87	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	460,000.00	443,504.68	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	400,000.00	369,031.25	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	230,000.00	277,581.25	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	290,000.00	266,822.65	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	590,000.00	536,070.30	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	490,000.00	460,714.84	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	340,000.00	325,125.00	
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	280,000.00	270,090.62	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	250,000.00	238,222.65	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	390,000.00	370,865.62	

		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	100,000.00	125,453.12
		US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	370,000.00	365,895.30
		US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	280,000.00	279,606.24
		US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	150,000.00	149,765.62
		US TREASURY N/B-5.25%-29/02/15	100,000.00	120,453.12
		US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	100,000.00	124,898.43
		US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	90,000.00	108,569.53
		US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	50,000.00	60,949.21
		US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	110,000.00	117,657.03
		US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	100,000.00	120,125.00
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	160,000.00	198,762.50
		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	70,000.00	84,202.34
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	120,000.00	135,000.00
		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	120,000.00	142,153.12
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	100,000.00	120,617.18
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	160,000.00	176,800.00
		US TREASURY N/B-3.125%-41/11/15	100,000.00	100,117.18
		US TREASURY N/B-3.0%-42/05/15	150,000.00	146,929.68
		US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	200,000.00	187,078.12
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	280,000.00	267,596.87
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	110,000.00	121,721.87
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	330,000.00	358,127.33
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	30,000.00	31,263.28
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	20,000.00	19,971.87
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	390,000.00	380,676.55
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	440,000.00	429,343.74
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	400,000.00	390,156.25
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	430,000.00	378,601.56
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	470,000.00	446,500.00
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	160,000.00	155,612.50
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	500,000.00	462,265.61
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	80,000.00	73,950.00
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	160,000.00	155,437.50
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	110,000.00	109,432.81
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	110,000.00	106,871.87
米ドル建小計			33,070,000.00	32,882,219.15 (3,731,145,406)
カナダ ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-21/06/01	200,000.00	205,778.00
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-22/06/01	320,000.00	327,360.00
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-23/06/01	100,000.00	97,718.00
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	100,000.00	102,291.00
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	150,000.00	151,689.00

		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	150,000.00	144,114.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	10,000.00	9,165.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	150,000.00	200,680.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	40,000.00	57,554.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	80,000.00	112,863.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	60,000.00	77,869.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	120,000.00	149,078.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	60,000.00	66,150.00	
カナダドル建小計			1,540,000.00	1,702,312.10	(144,356,066)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-21/06/10	1,700,000.00	1,618,298.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-6.5%-22/06/09	1,800,000.00	1,677,636.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	1,440,000.00	1,516,276.80	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	2,700,000.00	2,470,905.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	1,000,000.00	966,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	1,316,000.00	1,397,749.92	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	1,900,000.00	1,759,324.00	
メキシコペソ建小計			11,856,000.00	11,406,189.72	(64,330,910)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-3.75%-20/09/28	100,000.00	107,690.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-21/09/28	20,000.00	22,618.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-22/03/28	240,000.00	274,584.00	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-23/06/22	100,000.00	110,910.00	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	100,000.00	113,850.00	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	110,000.00	113,795.00	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	150,000.00	156,060.00	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	210,000.00	301,035.00	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	190,000.00	293,778.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	100,000.00	150,970.00	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	70,000.00	101,521.00	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	40,000.00	38,864.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%- 20/04/30	330,000.00	349,734.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.5%- 21/04/30	220,000.00	249,304.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.85%- 22/01/31	250,000.00	295,625.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.4%- 23/01/31	200,000.00	242,420.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%- 24/01/31	140,000.00	170,282.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%- 24/04/30	170,000.00	198,781.00			

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	30,000.00	33,579.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	250,000.00	262,975.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	160,000.00	199,264.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	230,000.00	311,397.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	140,000.00	141,890.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	60,000.00	60,216.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	30,000.00	40,230.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	190,000.00	271,472.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	180,000.00	185,580.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	100,000.00	147,990.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	40,000.00	42,020.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	110,000.00	144,837.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	80,000.00	115,616.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	100,000.00	141,580.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	70,000.00	105,959.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	50,000.00	53,645.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%- 48/10/31	20,000.00	20,402.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	50,000.00	57,215.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.0%- 20/07/04	350,000.00	369,946.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 21/01/04	410,000.00	436,674.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.25%- 21/09/04	290,000.00	312,370.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 22/09/04	450,000.00	483,066.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 24/01/04	280,000.00	372,705.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	200,000.00	213,828.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	100,000.00	104,023.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	120,000.00	128,826.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	140,000.00	145,429.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	170,000.00	169,792.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	100,000.00	154,752.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	10,000.00	10,319.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	50,000.00	51,392.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	200,000.00	286,032.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	150,000.00	241,104.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	120,000.00	195,398.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	70,000.00	110,102.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	40,000.00	67,152.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	110,000.00	198,704.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	40,000.00	61,375.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	90,000.00	124,496.10
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	160,000.00	224,529.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	40,000.00	43,747.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 20/09/01	190,000.00	200,869.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/03/01	290,000.00	308,357.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 21/08/01	300,000.00	320,220.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 22/03/01	400,000.00	444,760.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.5%- 22/11/01	300,000.00	342,180.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 23/05/01	230,000.00	255,346.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 23/08/01	240,000.00	270,192.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	140,000.00	155,946.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	160,000.00	172,400.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	230,000.00	264,707.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	150,000.00	142,140.00

BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	180,000.00	174,906.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	90,000.00	101,619.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	150,000.00	199,335.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	210,000.00	271,026.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	80,000.00	75,352.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	140,000.00	162,862.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	190,000.00	229,045.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	50,000.00	52,070.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	220,000.00	283,514.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	70,000.00	59,493.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	50,000.00	63,785.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	30,000.00	27,471.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	170,000.00	204,493.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	170,000.00	185,436.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	120,000.00	145,488.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	110,000.00	133,210.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	80,000.00	95,136.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	80,000.00	76,840.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	90,000.00	79,092.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	110,000.00	107,877.00
FINNISH GOVERNMENT-1.625%-22/09/15	100,000.00	107,200.00
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	80,000.00	100,272.00
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	80,000.00	96,712.00
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	30,000.00	29,958.00
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	20,000.00	26,660.00
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-20/04/25	400,000.00	422,120.00
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-20/10/25	330,000.00	348,645.00
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-20/11/25	10,000.00	10,131.00
FRANCE (GOVT OF)-3.75%-21/04/25	380,000.00	417,772.00
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-22/04/25	440,000.00	486,200.00

FRANCE (GOVT OF) -2.25%-22/10/25	340,000.00	372,470.00
FRANCE (GOVT OF) -4.25%-23/10/25	360,000.00	436,248.00
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-24/11/25	250,000.00	275,900.00
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-25/05/25	180,000.00	183,618.00
FRANCE (GOVT OF) -6.0%-25/10/25	130,000.00	181,077.00
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-25/11/25	150,000.00	157,575.00
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	210,000.00	259,098.00
FRANCE (GOVT OF) -0.25%-26/11/25	170,000.00	167,654.00
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-27/05/25	170,000.00	176,919.00
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	200,000.00	238,460.00
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/05/25	130,000.00	130,559.00
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/11/25	90,000.00	90,225.00
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	160,000.00	236,912.00
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	150,000.00	177,045.00
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-31/05/25	190,000.00	202,331.00
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	190,000.00	307,686.00
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	100,000.00	154,440.00
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-36/05/25	120,000.00	119,784.00
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	130,000.00	192,075.00
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-39/06/25	40,000.00	42,640.00
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	170,000.00	271,898.00
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	120,000.00	164,364.00
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-48/05/25	90,000.00	97,020.00
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	110,000.00	177,518.00
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	50,000.00	81,830.00
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-66/05/25	30,000.00	28,998.00
IRELAND GOVERNMENT BOND-4.5%-20/04/18	30,000.00	32,004.00
IRELAND GOVERNMENT BOND-5.0%-20/10/18	100,000.00	110,150.00
IRELAND GOVERNMENT BOND-0.8%-22/03/15	100,000.00	103,030.00
IRELAND GOVERNMENT BOND-3.4%-24/03/18	60,000.00	69,978.00
IRELAND GOVERNMENT BOND-5.4%-25/03/13	70,000.00	91,259.00
IRELAND GOVERNMENT BOND-0.9%-28/05/15	30,000.00	29,853.00
IRELAND GOVERNMENT BOND-2.4%-30/05/15	80,000.00	90,352.00
IRELAND GOVERNMENT BOND-1.7%-37/05/15	40,000.00	40,556.00
IRELAND GOVERNMENT BOND-2.0%-45/02/18	30,000.00	31,356.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.5%-20/07/15	100,000.00	106,592.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.25%-22/07/15	110,000.00	120,593.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-23/01/15	70,000.00	81,840.50
NETHERLANDS GOVERNMENT-1.75%-23/07/15	150,000.00	163,995.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	40,000.00	40,278.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	70,000.00	70,945.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	100,000.00	102,500.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	40,000.00	41,524.00

		NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	110,000.00	161,447.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	70,000.00	87,276.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	70,000.00	108,171.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	70,000.00	112,595.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	70,000.00	101,024.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	20,000.00	18,724.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	20,000.00	22,920.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.9%-20/07/15	100,000.00	107,090.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.5%-21/09/15	100,000.00	111,050.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.4%-22/11/22	100,000.00	114,600.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	90,000.00	98,271.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	100,000.00	109,550.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	40,000.00	42,772.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	40,000.00	41,280.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	110,000.00	164,417.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	80,000.00	120,896.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	30,000.00	42,375.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	20,000.00	34,768.00	
ユーロ建小計			21,700,000.00	25,634,668.00 (3,288,415,211)	
英債券	国債証券	TSY-1.5%-21/01/22	10,000.00	10,162.00	
		TSY-3.75%-21/09/07	170,000.00	183,838.00	
		TSY-4.0%-22/03/07	200,000.00	220,600.00	
		TSY-1.75%-22/09/07	100,000.00	103,500.00	
		TSY-2.25%-23/09/07	150,000.00	159,615.00	
		TSY-2.75%-24/09/07	100,000.00	110,190.00	
		TSY-5.0%-25/03/07	100,000.00	124,430.00	
		TSY-2.0%-25/09/07	140,000.00	149,464.00	
		TSY-4.25%-27/12/07	120,000.00	152,112.00	
		TSY-6.0%-28/12/07	150,000.00	217,327.50	
		TSY-4.25%-32/06/07	90,000.00	120,793.50	
		TSY-4.5%-34/09/07	90,000.00	126,742.50	
		TSY-4.25%-36/03/07	60,000.00	83,541.00	
		TSY-4.75%-38/12/07	130,000.00	197,359.50	
		TSY-4.25%-40/12/07	80,000.00	116,580.00	
		TSY-4.5%-42/12/07	70,000.00	107,348.50	
		TSY-3.25%-44/01/22	120,000.00	154,878.00	
		TSY-3.5%-45/01/22	120,000.00	162,150.00	
		TSY-4.25%-46/12/07	110,000.00	169,185.50	
		TSY-4.25%-49/12/07	500,000.00	794,100.00	
		TSY-3.75%-52/07/22	10,000.00	15,125.50	
		TSY-4.25%-55/12/07	40,000.00	67,766.00	

		TSY-1.75%-57/07/22	20,000.00	20,289.00	
		TSY-4.0%-60/01/22	10,000.00	16,850.50	
		TSY-2.5%-65/07/22	60,000.00	75,909.00	
		TSY-3.5%-68/07/22	60,000.00	96,327.00	
英債券建小計			2,810,000.00	3,756,184.00	(536,458,198)
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-22/06/01	670,000.00	756,738.20	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	900,000.00	1,034,487.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	80,000.00	84,327.20	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	130,000.00	133,338.40	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	260,000.00	368,232.80	
スウェーデンクローナ建小計			2,040,000.00	2,377,123.60	(29,785,358)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	890,000.00	955,993.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	10,000.00	10,071.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	90,000.00	88,731.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	180,000.00	179,532.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	140,000.00	141,750.00	
ノルウェークローネ建小計			1,310,000.00	1,376,077.50	(18,109,179)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-3.0%-21/11/15	700,000.00	771,540.00	
		KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	200,000.00	217,180.00	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	200,000.00	224,240.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	860,000.00	1,493,992.00	
デンマーククローネ建小計			1,960,000.00	2,706,952.00	(46,505,435)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-22/09/23	400,000.00	453,680.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	300,000.00	323,940.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	350,000.00	364,035.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	200,000.00	196,560.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	170,000.00	165,546.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	100,000.00	124,690.00	
ポーランドズロチ建小計			1,520,000.00	1,628,451.00	(48,674,400)
オーストラリアドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-20/11/21	20,000.00	19,902.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-21/05/15	300,000.00	326,550.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.75%-22/07/15	200,000.00	225,880.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-5.5%-23/04/21	70,000.00	79,933.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	200,000.00	205,780.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	100,000.00	105,760.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	200,000.00	225,440.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	160,000.00	188,512.00	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	60,000.00	61,548.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	220,000.00	216,656.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	250,000.00	267,625.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	50,000.00	61,369.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	60,000.00	60,288.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	70,000.00	79,783.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	100,000.00	100,260.00	
オーストラリアドル建小計			2,060,000.00	2,225,286.20 (181,049,285)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-23/07/01	80,000.00	82,421.60	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	10,000.00	10,481.30	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	100,000.00	110,023.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	100,000.00	105,407.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	30,000.00	30,783.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	20,000.00	20,469.60	
シンガポールドル建小計			340,000.00	359,585.50 (29,655,016)	
南アフリカランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%-26/12/21	830,000.00	890,233.10	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%-31/02/28	760,000.00	608,950.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%-32/03/31	210,000.00	184,023.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%-36/03/31	3,600,000.00	2,493,252.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%-41/02/28	1,100,000.00	744,480.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%-44/01/31	500,000.00	432,525.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%-48/02/28	600,000.00	517,920.00	
南アフリカランド建小計			7,600,000.00	5,871,383.10 (46,325,212)	
合計				8,164,809,676 (8,164,809,676)	

有価証券明細表注記

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	債券 78銘柄	43.7%	45.7%
カナダドル	債券 13銘柄	1.7%	1.8%

メキシコペソ	債券	7銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	債券	161銘柄	38.6%	40.3%
英ポンド	債券	26銘柄	6.3%	6.6%
スウェーデンクローナ	債券	5銘柄	0.3%	0.4%
ノルウェークローネ	債券	5銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	債券	4銘柄	0.5%	0.6%
ポーランドズロチ	債券	6銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	債券	15銘柄	2.1%	2.2%
シンガポールドル	債券	6銘柄	0.3%	0.4%
南アフリカランド	債券	7銘柄	0.5%	0.6%

（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

「注記表（デリバティブ取引等関係）」に記載しております。

グローバル高金利通貨マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

平成30年12月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,017,134
コール・ローン	16,360,158
特殊債券	5,035,560,256
派生商品評価勘定	37,715
未収入金	57,044,388
未収利息	158,599,721
前払費用	27,890,434
流動資産合計	5,297,509,806
資産合計	
5,297,509,806	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	384,038
未払利息	37
流動負債合計	384,075
負債合計	
384,075	
純資産の部	
元本等	
元本	4,846,635,350
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	450,490,381
元本等合計	5,297,125,731
純資産合計	
5,297,125,731	

平成30年12月17日現在

負債純資産合計

5,297,509,806

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>特殊債券</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>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

平成30年12月17日現在	
1. 計算日における受益権の総数	4,846,635,350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	1.0929円
(1万口当たり純資産額)	(10,929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12月16日 至 平成30年12月17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>
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、特殊債券であり、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>

区分	自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17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: 20px;">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: 20px;">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: 20px;">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>
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>

金融商品の時価等に関する事項

平成30年12月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<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>
2. 時価の算定方法	<p>特殊債券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17日	
	該当事項はありません。

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成30年12月17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	5,816,620,140円
期中追加設定元本額	5,620,807円
期中一部解約元本額	975,605,597円
同期末における元本の内訳	
高金利通貨ファンド	4,836,909,972円
グローバル・ナビ	9,725,378円
合計	4,846,635,350円

2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	平成30年12月17日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	
特殊債券		45,163,094
合計		45,163,094

(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 (通貨関連)

種類	平成30年12月17日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	41,952,420	-	41,889,644	62,776
米ドル	41,952,420	-	41,889,644	62,776
売建	102,394,290	-	102,677,837	283,547
米ドル	43,425,319	-	43,402,707	22,612
インドルピー	41,952,420	-	42,273,682	321,262
南アフリカランド	17,016,551	-	17,001,448	15,103
合計	144,346,710	-	144,567,481	346,323

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

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
メキシコペソ	特殊債券	AFRICAN DEVELOPMENT BANK-3.65%-20/05/21	2,900,000.00	2,663,650.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK-4.0%-20/02/25	20,500,000.00	19,315,100.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK-4.75%-21/01/19	76,000,000.00	69,889,600.00	
		INTL BK RECON & DEVELOP-7.5%-20/03/05	17,580,000.00	17,212,578.00	
メキシコペソ建小計			116,980,000.00	109,080,928.00 (615,216,433)	
ブラジルレアル	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK-7.5%-22/04/13	1,500,000.00	1,516,155.00	
		INTL BK RECON & DEVELOP-8.0%-22/01/31	5,300,000.00	5,419,780.00	
		INTL FINANCE CORP-10.0%-19/06/14	14,800,000.00	15,063,440.00	
ブラジルレアル建小計			21,600,000.00	21,999,375.00 (637,761,881)	
英ポンド	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK-2.25%-20/03/07	220,000.00	223,498.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK-5.375%-21/06/07	1,730,000.00	1,907,844.00	
英ポンド建小計			1,950,000.00	2,131,342.00 (304,398,264)	
トルコリラ	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV-20.0%-19/10/16	6,000,000.00	5,785,200.00	
		EUROPEAN BK RECON & DEV-30.0%-20/01/15	5,500,000.00	5,888,300.00	
		EUROPEAN BK RECON & DEV-27.5%-20/09/18	10,500,000.00	11,408,250.00	
		INTL FINANCE CORP-10.25%-19/07/11	7,430,000.00	6,915,398.20	
トルコリラ建小計			29,430,000.00	29,997,148.20 (634,139,712)	
ポーランドズロチ	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP-1.5%-20/07/31	11,212,000.00	11,141,476.52	
ポーランドズロチ建小計			11,212,000.00	11,141,476.52 (333,018,733)	
ロシアルーブル	特殊債券	INTL BK RECON & DEVELOP-10.0%-19/09/16	10,100,000.00	10,247,460.00	

		INTL FINANCE CORP-11.0%-20/01/21	186,500,000.00	191,983,100.00	
		INTL FINANCE CORP-6.375%-22/04/11	176,000,000.00	168,995,200.00	
ロシアルーブル建小計			372,600,000.00	371,225,760.00	(631,083,792)
オーストラリアドル	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK-2.8%-21/01/15	2,850,000.00	2,878,186.50	
		INTL FINANCE CORP-5.75%-20/07/28	2,150,000.00	2,268,035.00	
オーストラリアドル建小計			5,000,000.00	5,146,221.50	(418,696,581)
インドネシアルピア	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV-8.3%-20/10/02	18,000,000,000.00	17,989,200,000.00	
		EUROPEAN BK RECON & DEV-6.45%-22/12/13	3,000,000,000.00	2,827,500,000.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK-7.2%-19/07/09	26,300,000,000.00	26,115,900,000.00	
		INTER-AMERICAN DEVEL BK-5.8%-20/09/28	10,550,000,000.00	10,104,790,000.00	
インドネシアルピア建小計			57,850,000,000.00	57,037,390,000.00	(444,891,642)
インドルピー	特殊債券	EUROPEAN BK RECON & DEV-5.15%-20/01/20	21,800,000.00	21,194,178.00	
		INTL BK RECON & DEVELOP-5.75%-19/10/28	150,000,000.00	147,300,000.00	
		INTL FINANCE CORP-7.8%-19/06/03	55,000,000.00	54,978,000.00	
		INTL FINANCE CORP-6.45%-20/08/10	34,900,000.00	34,181,060.00	
インドルピー建小計			261,700,000.00	257,653,238.00	(409,668,648)
南アフリカランド	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK-7.5%-19/01/30	25,700,000.00	25,687,150.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK-6.0%-19/10/21	6,400,000.00	6,312,320.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK-9.0%-21/03/31	12,480,000.00	12,712,128.00	
		EUROPEAN INVESTMENT BANK-8.375%-22/07/29	12,500,000.00	12,581,250.00	
		INTL BK RECON & DEVELOP-0.5%-19/03/28	20,000,000.00	19,600,000.00	
南アフリカランド建小計			77,080,000.00	76,892,848.00	(606,684,570)
合計				5,035,560,256	(5,035,560,256)

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
----	-----	--------------	-------------------------

メキシコペソ	債券	4銘柄	11.6%	12.2%
ブラジルリアル	債券	3銘柄	12.0%	12.7%
英ポンド	債券	2銘柄	5.7%	6.0%
トルコリラ	債券	4銘柄	12.0%	12.6%
ポーランドズロチ	債券	1銘柄	6.3%	6.6%
ロシアルーブル	債券	3銘柄	11.9%	12.5%
オーストラリアドル	債券	2銘柄	7.9%	8.3%
インドネシアルピア	債券	4銘柄	8.4%	8.8%
インドルピー	債券	4銘柄	7.7%	8.1%
南アフリカランド	債券	5銘柄	11.5%	12.0%

（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

「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J-REITマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

平成30年12月17日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	20,015,437
投資証券	2,272,528,220
未収配当金	14,714,152
流動資産合計	2,307,257,809
資産合計	
2,307,257,809	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	150,000
未払利息	46
流動負債合計	150,046
負債合計	
150,046	
純資産の部	
元本等	
元本	1,287,527,799
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,019,579,964
元本等合計	2,307,107,763
純資産合計	
2,307,107,763	
負債純資産合計	
2,307,257,809	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17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12月17日現在	
1. 計算日における受益権の総数	1,287,527,799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	1.7919円
(1万口当たり純資産額)	(17,919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12月16日 至 平成30年12月17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。
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。

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>
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。

金融商品の時価等に関する事項

平成30年12月17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	
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。	

（関連当事者との取引に関する注記）

	<p>自 平成29年12月16日</p> <p>至 平成30年12月17日</p>
	該当事項はありません。

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成30年12月17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	1,458,049,378円
期中追加設定元本額	175,142,451円
期中一部解約元本額	345,664,030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	400,082,645円
グローバル・ナビ	5,982,541円
新光J-REITオープン（年2回決算型）	881,462,613円

合計	1,287,527,799円
----	----------------

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成30年12月17日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		66,590,283
合計		66,590,283

(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	85	46,325,000	
	MCUBS MidCity投資法人	289	26,934,800	
	森ヒルズリート投資法人	294	41,130,600	
	産業ファンド投資法人	299	33,727,200	
	アドバンス・レジデンス投資法人	250	77,375,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	152	25,733,600	
	アクティブア・プロパティーズ投資法人	123	57,256,500	
	GLP投資法人	635	71,945,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	98	28,567,000	
	日本プロロジスリート投資法人	344	81,837,600	
	星野リゾート・リート投資法人	39	20,553,000	
	Oneリート投資法人	37	9,697,700	
	イオンリート投資法人	263	33,742,900	

ヒューリックリート投資法人	207	35,334,900	
日本リート投資法人	83	31,540,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	1,519	24,805,270	
日本ヘルスケア投資法人	12	1,984,800	
積水ハウス・リート投資法人	661	46,798,800	
ト・セイ・リート投資法人	49	5,409,600	
ケネディクス商業リート投資法人	94	23,678,600	
ヘルスケア&メディカル投資法人	34	3,899,800	
サムティ・レジデンシャル投資法人	51	4,559,400	
野村不動産マスタ-ファンド投資法人	760	111,112,000	
いちごホテルリート投資法人	45	6,124,500	
ラサ-ルロジボ-リート投資法人	193	20,805,400	
スタ-アジア不動産投資法人	80	8,600,000	
マリモ地方創生リート投資法人	22	2,426,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	44	14,080,000	
大江戸温泉リート投資法人	41	3,403,000	
さくら総合リート投資法人	55	4,790,500	
投資法人みらい	69	13,116,900	
森トラスト・ホテルリート投資法人	60	7,860,000	
三菱地所物流リート投資法人	27	6,655,500	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	26	2,743,000	
ザイマックス・リート投資法人	24	2,724,000	
タカラレーベン不動産投資法人	38	3,363,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	40	3,420,000	
日本ビルファンド投資法人	248	174,096,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	256	160,256,000	
日本リテールファンド投資法人	484	109,335,600	
オリックス不動産投資法人	511	94,483,900	
日本プライムリアルティ投資法人	162	72,171,000	
プレミア投資法人	244	30,353,600	
東急リアル・エステート投資法人	172	28,448,800	
グローバル・ワン不動産投資法人	164	20,040,800	
ユナイテッド・アーバン投資法人	565	99,553,000	
森トラスト総合リート投資法人	183	29,957,100	
インヴィンシブル投資法人	897	44,087,550	
フロンティア不動産投資法人	87	38,976,000	
平和不動産リート投資法人	160	19,520,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	169	38,498,200	
福岡リート投資法人	133	22,756,300	
ケネディクス・オフィス投資法人	79	57,512,000	
いちごオフィスリート投資法人	213	20,597,100	
大和証券オフィス投資法人	59	41,595,000	

阪急阪神リート投資法人	115	16,951,000	
スタートプロシード投資法人	40	6,728,000	
大和ハウスリート投資法人	321	79,961,100	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	742	62,624,800	
日本賃貸住宅投資法人	288	24,566,400	
ジャパンエクセレント投資法人	230	35,397,000	
合計	13,664	2,272,528,220	

(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12月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,488,179
コール・ローン	1,921,526
投資証券	733,497,568
未収配当金	1,718,117
流動資産合計	738,625,390
資産合計	738,625,390
負債の部	
流動負債	
未払解約金	200,000
未払利息	4
流動負債合計	200,004
負債合計	200,004
純資産の部	
元本等	
元本	435,741,944
剰余金	
剰余金又は欠損金()	302,683,442
元本等合計	738,425,386
純資産合計	738,425,386
負債純資産合計	738,625,390

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17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。 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、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。 配当株式 配当株式は原則として、株式（投資証券を含む）の配当落ち日において、その数量に相当する発行価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12月17日現在	
1. 計算日における受益権の総数	435,741,944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	1.6946円
(1万口当たり純資産額)	(16,946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12月16日 至 平成30年12月17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。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドの投資している金融商品は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが投資している有価証券は、株式、投資証券であり、株価変動リスク、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドが利用しているデリバティブ取引は、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>
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>
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>

金融商品の時価等に関する事項

平成30年12月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
2. 時価の算定方法	ん。
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。	

（関連当事者との取引に関する注記）

	<p>自 平成29年12月16日 至 平成30年12月17日</p>
	該当事項はありません。

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	平成30年12月17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	501,678,356円
期中追加設定元本額	4,506,184円
期中一部解約元本額	70,442,596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	429,551,750円
グローバル・ナビ	6,190,194円
合計	435,741,944円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	平成30年12月17日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	20,408,719
合計	20,408,719

(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	14,120.96	
		AGREE REALTY CORPORATION	200	11,974.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	485	9,210.15	
		ALEXANDER'S INC	16	4,933.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE	669	81,952.50	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	236	9,843.56	

AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	871	37,792.69
AMERICAN FINANCE TRUST INC	333	4,368.96
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	1,653	34,084.86
AMERICAN TOWER CORPORATION	2,811	468,312.60
AMERICOLD REALTY TRUST	532	14,417.20
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	998	47,075.66
APPLE HOSPITALITY REIT INC	1,335	20,959.50
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	300	4,569.00
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	547	2,357.57
AVALONBAY COMMUNITIES INC	884	165,219.60
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	200	1,926.00
BOSTON PROPERTIES INC	989	124,356.86
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	200	2,036.00
BRANDYWINE REALTY	1,087	14,837.55
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	1,929	31,751.34
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	968	15,913.92
CAMDEN PROPERTY TRUST	568	51,972.00
CARETRUST REIT INC	500	10,220.00
CATCHMARK TIMBER TRUST INC	300	2,364.00
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	1,314	3,271.86
CEDAR REALTY TRUST INC	700	2,401.00
CHATHAM LODGING TRUST	300	5,667.00
CHESAPEAKE LODGING TRUST	366	10,277.28
CITY OFFICE REIT INC	210	2,282.70
CLIPPER REALTY INC	111	1,408.59
COLONY CAPITAL INC	3,002	16,901.26
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	756	15,475.32
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	100	3,059.00
CORECIVIC INC	755	15,862.55
COREENERGY INFRASTRUCTURE TRUST INC	100	3,718.00
COREPOINT LODGING INC	263	3,103.40
CORESITE REALTY CORPORATION	233	22,577.70
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	653	14,633.73
COUSINS PROPERTIES INC	2,673	22,292.82
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORPORATION	2,653	303,901.15
CUBESMART	1,162	36,475.18
CYRUSONE INC	662	39,276.46
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	1,231	12,199.21
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,316	150,445.12
DOUGLAS EMMETT INC	1,027	36,417.42
DUKE REALTY CORP	2,284	64,089.04
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	373	6,512.58

EASTGROUP PROPERTIES	232	23,151.28
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	944	14,509.28
EPR PROPERTIES	471	33,285.57
EQUINIX INC	508	196,545.20
EQUITY COMMONWEALTH	751	23,446.22
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	541	54,635.59
EQUITY RESIDENTIAL	2,298	160,722.12
ESSEX PROPERTY TRUST INC	421	110,419.88
EXTRA SPACE STORAGE INC	772	75,131.04
FARMLAND PARTNERS INC	229	1,193.09
FEDERAL REALTY INVESTMENT	466	61,004.06
FIRST INDUSTRIAL REALTY	763	24,011.61
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	431	11,805.09
FRANKLIN STREET PROPERTIES	800	5,600.00
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	347	3,431.83
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	1,289	44,934.54
GETTY REALTY CORP	201	6,423.96
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	200	3,768.00
GLADSTONE LAND CORPORATION	54	679.32
GLOBAL MEDICAL REIT INC	100	908.00
GLOBAL NET LEASE INC	436	8,449.68
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	661	5,069.87
HCP INC	2,978	86,213.10
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	760	23,005.20
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	1,304	35,599.20
HERSHA HOSPITALITY TRUST	275	5,029.75
HIGHWOODS PROPERTIES INC	650	26,832.00
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	1,041	27,097.23
HOST HOTELS & RESORTS	4,637	82,445.86
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	986	29,658.88
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	500	5,160.00
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	146	2,937.52
INFREIT INC	300	6,372.00
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,000	5,230.00
INVITATION HOMES INC	1,910	40,816.70
IRON MOUNTAIN INC	1,818	63,666.36
JBG SMITH PROPERTIES	656	24,547.52
KILROY REALTY CORP	620	40,845.60
KIMCO REALTY CORPORATION	2,600	42,770.00
KITE REALTY GROUP TRUST	509	8,459.58
LAMAR ADVERTISING COMPANY	533	37,683.10
LEXINGTON REALTY TRUST	1,370	12,014.90

LIBERTY PROPERTY TRUST	943	43,689.19
LIFE STORAGE INC	293	29,683.83
LTC PROPERTIES INC	241	10,611.23
MACK-CALI REALTY CORP	633	13,406.94
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	200	1,412.00
MEDICAL PROPERTIES TRUST	2,320	39,092.00
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	718	72,812.38
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT COR- CL A	500	6,880.00
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	247	19,589.57
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	979	49,586.35
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	325	9,506.25
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	600	2,838.00
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	127	4,479.29
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	275	4,383.50
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	1,253	45,985.10
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	100	2,644.00
OUTFRONT MEDIA INC	858	16,602.30
PARAMOUNT GROUP INC	1,326	18,325.32
PARK HOTELS & RESORTS INC	1,285	37,072.25
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	868	28,565.88
PENN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	500	3,830.00
PHYSICIANS REALTY TRUST	1,120	19,286.40
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC-A	785	14,067.20
POTLATCHDELTIC CORP	417	14,123.79
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	259	3,820.25
PROLOGIS INC	4,011	259,952.91
PS BUSINESS PARKS INC/CA	123	17,210.16
PUBLIC STORAGE	951	193,499.97
QTS REALTY TRUST INC-CL A	314	12,622.80
RAYONIER INC	825	24,609.75
REALTY INCOME CORP	1,857	123,193.38
REGENCY CENTERS CORPORATION	972	59,778.00
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	771	13,631.28
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	1,401	17,568.54
RETAIL VALUE INC	108	2,948.40
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	550	17,281.00
RLJ LODGING TRUST	1,105	20,707.70
RPT REALTY	505	7,181.10
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	284	20,266.24
SABRA HEALTH CARE REIT INC	1,131	21,172.32
SAFETY INCOME & GROWTH INC	73	1,403.79
SAUL CENTERS INC	81	4,300.29

SBA COMMUNICATIONS CORP	729	125,752.50
SELECT INCOME REIT	550	9,751.50
SENIOR HOUSING PROPERTIES	1,504	19,762.56
SIMON PROPERTY GROUP	1,974	360,570.84
SITE CENTERS CORP	947	11,884.85
SL GREEN REALTY CORPORATION	535	47,764.80
SPIRIT MTA REIT	326	2,898.14
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	547	21,606.50
STAG INDUSTRIAL INC	669	17,347.17
STORE CAPITAL CORPORATION	1,184	36,526.40
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	637	6,631.17
SUN COMMUNITIES INC	533	57,297.50
SUNSTONE HOTEL INVESTORS	1,434	20,635.26
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	566	13,334.96
TAUBMAN CENTERS INC	365	18,534.70
TERRENO REALTY CORP	364	13,704.60
THE GEO GROUP INC	772	17,354.56
THE MACERICH COMPANY	870	41,559.90
TIER REIT INC	367	8,081.34
UDR INC	1,680	70,576.80
UMH PROPERTIES INC	200	2,608.00
UNITI GROUP INC	1,054	18,202.58
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	100	6,859.00
URBAN EDGE PROPERTIES	671	12,601.38
URSTADT BIDDLE PROPERTIES INC	229	4,834.19
VENTAS INC	2,280	142,636.80
VEREIT INC	6,202	48,623.68
VICI PROPERTIES INC	2,538	52,384.32
VORNADO REALTY TRUST	1,092	74,649.12
WASHINGTON PRIME GROUP INC	1,151	7,078.65
WASHINGTON REAL ESTATE INV	501	12,910.77
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	764	21,613.56
WELLTOWER INC	2,384	172,458.56
WEYERHAEUSER COMPANY	4,850	116,545.50
WHITESTONE REIT	283	4,007.28
WINTHROP REALTY LIQUIDATING TRUST	300	84.00
WP CAREY INC	677	47,782.66
XENIA HOTELS & RESORTS INC	659	12,837.32
米ドル建小計	153,597	6,464,242.25 (733,497,568)
合計		733,497,568 (733,497,568)

（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

- 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	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 170銘柄	99.3%	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。

【中間財務諸表】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期中間計算期間(平成30年12月18日から令和1年6月17日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【グローバル・ナビ】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第6期中間計算期間末 令和 1年 6月17日現在
資産の部	
流動資産	
預金	5,162
コール・ローン	11,354,861
投資信託受益証券	10,097,230
親投資信託受益証券	183,326,579
流動資産合計	204,783,832
資産合計	204,783,832
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	55,929
未払委託者報酬	1,532,413
未払利息	23
その他未払費用	4,181
流動負債合計	1,592,546
負債合計	1,592,546
純資産の部	
元本等	
元本	174,217,948
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	28,973,338
（分配準備積立金）	17,129,635
元本等合計	203,191,286
純資産合計	203,191,286
負債純資産合計	204,783,832

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期中間計算期間
	自 平成30年12月18日
	至 令和 1年 6月17日
営業収益	
受取配当金	164,422
有価証券売買等損益	6,727,871
為替差損益	430,953
営業収益合計	6,461,340
営業費用	
支払利息	3,666
受託者報酬	55,929
委託者報酬	1,532,413
その他費用	171,560
営業費用合計	1,763,568
営業利益	4,697,772
経常利益	4,697,772
中間純利益	4,697,772
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	300,907
期首剰余金又は期首欠損金()	26,125,219
剰余金増加額又は欠損金減少額	78,446
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	78,446
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,627,192
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,627,192
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金()	28,973,338

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第6期中間計算期間 自 平成30年12月18日 至 令和 1年 6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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>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。</p>
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。
4. その他中間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> <p>計算期間に関する事項 前計算期間終了日に該当する日が休業日のため、当中間計算期間は平成30年12月18日から令和 1年 6月17日までとなっております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

第6期中間計算期間末 令和 1年 6月17日現在	
1. 中間計算期間末日における受益権の総数	174,217,948口
2. 中間計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1663円
(1万口当たり純資産額)	(11,663円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第6期中間計算期間末
令和 1年 6月17日現在

1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額

中間貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませ

2. 時価の算定方法

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。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	第6期中間計算期間末 令和 1年 6月17日現在
期首元本額	185,467,996円
期中追加設定元本額	511,555円
期中一部解約元本額	11,761,603円

2 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「ニュー トピックス インデックス マザーファンド」、「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」、「海外国債マザーファンド」、「新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）」、「グローバル高金利通貨マザーファンド」、「新光」- 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、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、これら同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。

ニュー トピックス インデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

令和 1年 6月17日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	128,303,071
株式	5,897,897,450
未収配当金	52,586,577
前払金	2,090,000
流動資産合計	6,080,877,098
資産合計	6,080,877,098
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,643,564
未払解約金	1,000,000
未払利息	268
流動負債合計	3,643,832
負債合計	3,643,832
純資産の部	
元本等	
元本	2,964,690,550
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,112,542,716
元本等合計	6,077,233,266
純資産合計	6,077,233,266
負債純資産合計	6,080,877,098

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12月18日 至 令和 1年 6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所及び外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所及び外国金融商品市場の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

令和 1年 6月17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	141,958,000円
2. 計算日における受益権の総数	

2,964,690,550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

2.0499円

(1万口当たり純資産額)

(20,499円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

令和1年6月17日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は、原則としてすべて時価評価されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ

2. 時価の算定方法

株式

「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

派生商品評価勘定

「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

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

(その他の注記)

1 元本の移動

区分	令和1年6月17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	3,369,016,755円
期中追加設定元本額	108,264,046円
期中一部解約元本額	512,590,251円
同期末における元本の内訳	
ニュー トピックス インデックス	243,656,247円
新光7資産バランスファンド	325,349,085円
ニュー トピックス インデックス(変額年金)	108,084,102円
新光世界バランスファンド35VA(適格機関投資家私募)	442,541,727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)	158,418,274円
新光世界バランス35VAT(適格機関投資家私募)	3,043,807円
ワールドバランスファンド30VA(適格機関投資家私募)	1,203,844,970円
ワールドバランスファンド30VA2(適格機関投資家私募)	437,201,093円
グローバル・ナビ	19,964,718円
太陽財形株投 太陽一般財形 30	5,136,236円
太陽財形株投 太陽一般財形 50	14,543,927円
太陽財形株投 太陽年金・住宅財形 30	2,906,364円
合計	2,964,690,550円

2 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

種類	令和 1年 6月17日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	171,493,564	-	168,850,000	2,643,564
東証株価指数先物	171,493,564	-	168,850,000	2,643,564
合計	171,493,564	-	168,850,000	2,643,564

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。

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)

令和 1年 6月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	244,653,465
コール・ローン	4,970,215
株式	4,219,065,080
投資証券	119,405,953
派生商品評価勘定	781,713
未収入金	139,071
未収配当金	7,707,961
差入委託証拠金	103,473,735
流動資産合計	4,700,197,193
資産合計	4,700,197,193
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	318,469
未払解約金	2,508,200
未払利息	10
流動負債合計	2,826,679
負債合計	2,826,679
純資産の部	

令和 1年 6月17日現在

元本等	
元本	1,956,453,449
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,740,917,065
元本等合計	4,697,370,514
純資産合計	4,697,370,514
負債純資産合計	4,700,197,193

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12月18日 至 令和 1年 6月17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。 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	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。 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、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。
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)

令和 1年 6月17日現在	
1. 計算日における受益権の総数	1,956,453,449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	2.4010円
(1万口当たり純資産額)	(24,010円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

令和 1年 6月17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。

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。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

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

(その他の注記)

1 元本の移動

区分	令和 1年 6月17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	2,268,835,856円
期中追加設定元本額	97,270,315円
期中一部解約元本額	409,652,722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	280,104,464円
新光外国株式インデックスVA	390,319,719円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	152,115,182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）	45,815,884円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	6,548,916円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	692,343,623円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	376,194,070円
グローバル・ナビ	13,011,591円
合計	1,956,453,449円

2 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

種類	令和 1年 6月17日現在	
	契約額等（円）	

		うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	352,404,437	-	352,868,892	464,455
S&P500 EMINI	251,952,115	-	251,639,174	312,941
S&P/TSE 601X	15,692,778	-	15,769,080	76,302
DJ EURO ST50	53,312,031	-	53,312,031	-
FTSE 100 IDX	19,899,860	-	19,898,492	1,368
SPI 200	11,547,653	-	12,250,115	702,462
合計	352,404,437	-	352,868,892	464,455

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せん。

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。

換算において円未満の端数を切り捨てております。そのため、貸借対照表の派生商品評価勘定と端数分が一致しないことがあります。

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	令和 1年 6月17日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	5,836,409	-	5,837,620	1,211
米ドル	4,124,540	-	4,128,480	3,940
カナダドル	323,980	-	323,960	20
ユーロ	976,967	-	974,960	2,007
英ポンド	410,922	-	410,220	702
合計	5,836,409	-	5,837,620	1,211

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。

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)

令和 1年 6月17日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	225,076,271
国債証券	9,617,496,000
地方債証券	988,710,900
特殊債券	849,768,000
社債券	516,380,000
未収利息	32,948,884
前払費用	693,275
流動資産合計	12,231,073,330
資産合計	12,231,073,330
負債の部	
流動負債	
未払解約金	32,040,100
未払利息	471
流動負債合計	32,040,571
負債合計	32,040,571
純資産の部	
元本等	
元本	9,370,926,597
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,828,106,162
元本等合計	12,199,032,759
純資産合計	12,199,032,759
負債純資産合計	12,231,073,330

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12月18日 至 令和 1年 6月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券

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。

（貸借対照表に関する注記）

令和 1年 6月17日現在	
1. 計算日における受益権の総数	9,370,926,597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	1.3018円
(1万口当たり純資産額)	(13,018円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

令和 1年 6月17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
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。	
社債券	
「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりま	
す。	
3.	金融商品の時価等に関する事項についての補足説明
市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。	

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	令和 1年 6月17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	9,741,019,132円
期中追加設定元本額	941,906,819円
期中一部解約元本額	1,311,999,354円
同期末における元本の内訳	
One DC 国内債券インデックスファンド	127,567,388円

新光7資産バランスファンド	534,618,453円
日本債券ファンド	4,092,731,204円
新光世界バランスファンド35VA（適格機関投資家私募）	564,115,570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）	251,124,029円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	9,402,900円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	2,585,807,021円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	1,182,551,434円
グローバル・ナビ	23,008,598円
合計	9,370,926,597円

2 デリバティブ取引等関係 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

海外国債マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

令和1年6月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	16,053,491
コール・ローン	144,519,477
国債証券	18,525,925,315
未収利息	84,099,176
前払費用	10,647,380
流動資産合計	18,781,244,839
資産合計	18,781,244,839
負債の部	
流動負債	
未払利息	302
流動負債合計	302
負債合計	302
純資産の部	
元本等	
元本	8,205,697,328
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	10,575,547,209
元本等合計	18,781,244,537
純資産合計	18,781,244,537
負債純資産合計	18,781,244,839

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12月18日 至 令和 1年 6月17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）

令和 1年 6月17日現在	
1. 計算日における受益権の総数	8,205,697,328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	2.2888円
(1万口当たり純資産額)	(22,888円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

令和 1年 6月17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	
国債証券	「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	令和 1年 6月17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	8,716,097,955円
期中追加設定元本額	572,163円
期中一部解約元本額	510,972,790円

同期末における元本の内訳	
海外国債ファンド	5,986,297,817円
海外国債ファンド（3ヵ月決算型）	1,031,784,059円
新光7資産バランスファンド	306,277,426円
海外国債ファンド（1年決算型）	22,153,010円
海外国債ファンド（変額年金）	845,922,839円
グローバル・ナビ	13,262,177円
合計	8,205,697,328円

2 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

新光外国債券インデックスマザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

令和1年6月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	129,205,723
コール・ローン	3,361,965
国債証券	6,585,630,394
派生商品評価勘定	21,551,672
未収入金	84,406,614
未収利息	52,043,409
前払費用	827,000
差入委託証拠金	1,947
流動資産合計	6,877,028,724
資産合計	
6,877,028,724	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,277,255
未払金	155,002
未払解約金	81,900,000
未払利息	7
流動負債合計	87,332,264
負債合計	
87,332,264	
純資産の部	
元本等	
元本	4,847,369,282
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,942,327,178
元本等合計	6,789,696,460
純資産合計	
6,789,696,460	
負債純資産合計	
6,877,028,724	

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12月18日 至 令和 1年 6月17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）

令和 1年 6月17日現在	
1. 計算日における受益権の総数	4,847,369,282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	1.4007円
(1万口当たり純資産額)	(14,007円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

令和 1年 6月17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	
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。
派生商品評価勘定	「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価に近似していることから、当該帳簿価額を時価としておりま
	す。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	
	市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。
	また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	令和 1年 6月17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	6,368,058,840円
期中追加設定元本額	48,740,834円
期中一部解約元本額	1,569,430,392円
同期末における元本の内訳	
新光ワールドバランスファンドVA（適格機関投資家私募）	700,136,936円
新光世界バランス35VAT（適格機関投資家私募）	8,837,918円
ワールドバランスファンド30VA（適格機関投資家私募）	3,011,661,359円
ワールドバランスファンド30VA2（適格機関投資家私募）	1,112,315,224円
グローバル・ナビ	14,417,845円
合計	4,847,369,282円

2 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

種類	令和 1年 6月17日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	6,817,142,248	-	6,800,867,831	16,274,417
米ドル	3,248,371,287	-	3,231,785,415	16,585,872
カナダドル	136,657,793	-	137,183,676	525,883
メキシコペソ	58,858,223	-	59,640,744	782,521
ユーロ	2,596,556,101	-	2,599,751,287	3,195,186
英ポンド	441,813,128	-	438,554,825	3,258,303
スウェーデンクローナ	24,087,476	-	24,061,030	26,446
ノルウェークローネ	20,291,683	-	20,346,052	54,369
デンマーククローネ	35,797,968	-	35,845,248	47,280
ポーランドズロチ	42,807,723	-	43,223,180	415,457
オーストラリアドル	140,968,936	-	139,668,062	1,300,874
シンガポールドル	29,411,044	-	29,455,436	44,392
南アフリカランド	41,520,886	-	41,352,876	168,010
合計	6,817,142,248	-	6,800,867,831	16,274,417

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はありません。

グローバル高金利通貨マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

令和 1年 6月17日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	18,302,026
特殊債券	4,655,322,873
未収入金	59,172,861
未収利息	174,191,782
前払費用	23,077,272
流動資産合計	4,930,066,814
資産合計	4,930,066,814
負債の部	
流動負債	
前受金	50,244,994
未払利息	38
流動負債合計	50,245,032
負債合計	50,245,032
純資産の部	
元本等	
元本	4,440,952,144
剰余金	
剰余金又は欠損金()	438,869,638
元本等合計	4,879,821,782
純資産合計	4,879,821,782
負債純資産合計	4,930,066,814

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12月18日 至 令和 1年 6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	特殊債券

<p>2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法</p> <p>3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</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> <p>為替予約取引</p> <p>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> <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>当ファンドの外貨建取引等の処理基準については、投資信託財産計算規則第60条及び第61条によっております。</p>
--	---

（貸借対照表に関する注記）

令和 1年 6月17日現在	
1. 計算日における受益権の総数	4,440,952,144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	1.0988円
(1万口当たり純資産額)	(10,988円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

令和 1年 6月17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>特殊債券</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>3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p> <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>

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	令和 1年 6月17日現在
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,846,635,350円
期中追加設定元本額	434,757円
期中一部解約元本額	406,117,963円
同期末における元本の内訳	
高金利通貨ファンド	4,431,695,866円
グローバル・ナビ	9,256,278円

合計	4,440,952,144円
----	----------------

2 デリバティブ取引等関係 取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

新光J-REITマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

令和 1年 6月17日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	20,837,401
投資証券	2,513,223,400
未収入金	14,058,403
未収配当金	16,712,431
流動資産合計	2,564,831,635
資産合計	2,564,831,635
負債の部	
流動負債	
未払解約金	16,000,000
未払利息	43
流動負債合計	16,000,043
負債合計	16,000,043
純資産の部	
元本等	
元本	1,309,357,090
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,239,474,502
元本等合計	2,548,831,592
純資産合計	2,548,831,592
負債純資産合計	2,564,831,635

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12月18日 至令和1年6月17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)

令和 1年 6月17日現在	
1. 計算日における受益権の総数	1,309,357,090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	1.9466円
(1万口当たり純資産額)	(19,466円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

令和 1年 6月17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	
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。	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	
市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。	

(その他の注記)

1 元本の移動

区分	令和 1年 6月17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	1,287,527,799円
期中追加設定元本額	135,134,904円
期中一部解約元本額	113,305,613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	347,396,522円
グローバル・ナビ	5,260,084円
新光J-REITオープン(年2回決算型)	956,700,484円
合計	1,309,357,090円

2 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

新光米国REITマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

令和 1年 6月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,409,205
コール・ローン	1,069,656
投資証券	703,747,433
未収配当金	1,764,108
流動資産合計	707,990,402
資産合計	707,990,402
負債の部	
流動負債	
未払利息	2
流動負債合計	2
負債合計	2
純資産の部	
元本等	
元本	385,701,200
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	322,289,200
元本等合計	707,990,400
純資産合計	707,990,400
負債純資産合計	707,990,402

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12月18日 至 令和 1年 6月17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。 配当株式 配当株式は原則として、株式（投資証券を含む）の配当落ち日において、その数量に相当する発行価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）

令和 1年 6月17日現在	
1. 計算日における受益権の総数	385,701,200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	1.8356円
(1万口当たり純資産額)	(18,356円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

令和 1年 6月17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	
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。	
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	
市場価額がない、又は市場価格を時価と見なせない場合には、経営者により合理的に算定された価額で評価する場合があります。	

（その他の注記）

1 元本の移動

区分	令和 1年 6月17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	435,741,944円
期中追加設定元本額	630,912円
期中一部解約元本額	50,671,656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	380,118,360円
グローバル・ナビ	5,582,840円
合計	385,701,200円

2 デリバティブ取引等関係

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

グローバル・ナビ

(令和 1年 6月28日現在)

資産総額	204,524,493円
負債総額	94,585円
純資産総額(-)	204,429,908円
発行済口数	174,303,135口
1口当たり純資産額(/)	1.1728円
(1万口当たり純資産額)	(11,728円)

(参考) ニュー トピックス インデックス マザーファンド

(令和 1年 6月28日現在)

資産総額	6,055,972,497円
負債総額	32,940,715円
純資産総額(-)	6,023,031,782円
発行済口数	2,912,387,791口
1口当たり純資産額(/)	2.0681円
(1万口当たり純資産額)	(20,681円)

(参考) 新光外国株式インデックスマザーファンド

(令和 1年 6月28日現在)

資産総額	4,658,599,346円
負債総額	18,204,010円
純資産総額(-)	4,640,395,336円
発行済口数	1,914,128,069口
1口当たり純資産額(/)	2.4243円
(1万口当たり純資産額)	(24,243円)

(参考) 新光日本債券インデックスマザーファンド

(令和 1年 6月28日現在)

資産総額	12,232,882,430円
負債総額	32,100,404円

純資産総額(-)	12,200,782,026円
発行済口数	9,356,985,324口
1口当たり純資産額(/)	1.3039円
(1万口当たり純資産額)	(13,039円)

(参考) 海外国債マザーファンド

(令和1年6月28日現在)

資産総額	18,799,125,890円
負債総額	530円
純資産総額(-)	18,799,125,360円
発行済口数	8,172,121,379口
1口当たり純資産額(/)	2.3004円
(1万口当たり純資産額)	(23,004円)

(参考) 新光外国債券インデックスマザーファンド(為替ヘッジあり)

(令和1年6月28日現在)

資産総額	6,626,817,855円
負債総額	62,302,904円
純資産総額(-)	6,564,514,951円
発行済口数	4,658,184,158口
1口当たり純資産額(/)	1.4092円
(1万口当たり純資産額)	(14,092円)

(参考) グローバル高金利通貨マザーファンド

(令和1年6月28日現在)

資産総額	4,953,818,262円
負債総額	42円
純資産総額(-)	4,953,818,220円
発行済口数	4,440,952,144口
1口当たり純資産額(/)	1.1155円
(1万口当たり純資産額)	(11,155円)

(参考) 新光J-REITマザーファンド

(令和1年6月28日現在)

資産総額	2,451,917,043円
------	----------------

負債総額	44円
純資産総額（ - ）	2,451,916,999円
発行済口数	1,255,498,095口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9529円
（1万口当たり純資産額）	（19,529円）

（参考）新光米国REITマザーファンド

（令和1年6月28日現在）

資産総額	686,319,800円
負債総額	2円
純資産総額（ - ）	686,319,798円
発行済口数	385,701,200口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7794円
（1万口当たり純資産額）	（17,794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。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2019年6月28日現在）

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

直近5力年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2019年6月28日現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1.投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年6月28日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,148,126,943,859
追加型株式投資信託	868	13,507,046,429,619
単位型公社債投資信託	45	133,655,540,124
単位型株式投資信託	164	1,255,969,173,901
合計	1,103	16,044,798,087,503

3【委託会社等の経理状況】

- 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第34期事業年度（自2018年4月1日至2019年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：千円）

	第33期 （2018年3月31日現在）	第34期 （2019年3月31日現在）
（資産の部）		
流動資産		
現金・預金	49,071,217	41,087,475
金銭の信託	12,083,824	18,773,228
有価証券	-	153,518
未収委託者報酬	11,769,015	12,438,085

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

(単位：千円)

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

本社移転費用引当金		156,587	-
	流動負債計	22,211,034	19,917,766
固定負債			
退職給付引当金		1,637,133	1,895,158
時効後支払損引当金		199,026	177,851
	固定負債計	1,836,160	2,073,009
負債合計		24,047,195	21,990,776
(純資産の部)			
株主資本			
資本金		2,000,000	2,000,000
資本剰余金		19,552,957	19,552,957
資本準備金		2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金		17,124,479	17,124,479
利益剰余金		44,349,855	45,949,372
利益準備金		123,293	123,293
その他利益剰余金		44,226,562	45,826,079
別途積立金		24,580,000	31,680,000
研究開発積立金		300,000	-
運用責任準備積立金		200,000	-
繰越利益剰余金		19,146,562	14,146,079
	株主資本計	65,902,812	67,502,329
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金		795,002	846,755
	評価・換算差額等計	795,002	846,755
純資産合計		66,697,815	68,349,085
負債・純資産合計		90,745,010	90,339,861

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:千円)

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

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

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

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

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

表示方法の変更

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

（損益計算書関係）

1. 関係会社に対する事項

（千円）

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

2. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2017年6月21日 定時株主総会	普通株式	3,200,000	80,000	2017年3月31日	2017年6月22日
	A種種類 株式				

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

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月20日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018年6月21日
	A種種 類株式					

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

合計	40,000	-	-	40,000
----	--------	---	---	--------

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2018年6月20日 定時株主総会	普通株式	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018年6月21日
	A種種類 株式				

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第33期(2018年3月31日現在)

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

第34期(2019年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	41,087,475	41,087,475	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	18,773,228	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	12,438,085	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	3,295,109	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	1,488,684	1,488,684	-
資産計	77,082,582	77,082,582	-
(1) 未払手数料	4,883,723	4,883,723	-
負債計	4,883,723	4,883,723	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第33期(2018年3月31日現在)

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

第34期(2019年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	41,087,475	-	-	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	153,518	1,995	996	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. 其他有価証券

第33期(2018年3月31日現在)

(千円)

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

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

第34期(2019年3月31日現在)

(千円)

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

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額276,674千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第33期(自2017年4月1日至2018年3月31日)

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

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

第34期(自2018年4月1日至2019年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
----	-------------	-----------------	-----------------

株式	394,222	353,644	-
投資信託	-	-	-

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	1.00% ~ 4.42%

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

(2) 退職給付費用

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

4. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

未払給与	9,186	7,961
受取負担金	-	138,994
運用受託報酬	-	102,490
資産除去債務	90,524	10,152
減価償却超過額(一括償却資産)	11,331	4,569
減価償却超過額	176,791	125,839
繰延資産償却超過額(税法上)	34,977	135,542
退職給付引当金	501,290	580,297
時効後支払損引当金	60,941	54,458
ゴルフ会員権評価損	13,173	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
本社移転費用引当金	47,947	-
その他	29,193	29,494
繰延税金資産小計	1,981,254	2,069,527
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,981,254	2,069,527
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	281,720	321,067
繰延税金負債合計	281,720	321,067
繰延税金資産の純額	1,699,533	1,748,459

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

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

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451,657千円

うち現金・預金 11,605,537千円

うち金銭の信託 11,792,364千円

b.負債の額	負債合計	9,256,209千円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539,592千円

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。

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

(2) 損益計算書項目

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

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

のれんの償却額	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,233,360千円	5,241,252千円

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	6,048,352	未払手数料	915,980
								子会社株式の取得	1,270,000	-	-
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251億円	証券業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	10,215,017	未払手数料	1,670,194

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2) 子会社株式の取得は、独立した第三者機関により算定された価格を基礎として協議の上、合理的に決定しております。

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	1,667,445円37銭	1,708,727円13銭
1株当たり当期純利益金額	391,255円29銭	352,987円92銭

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

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

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株

(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
2018年6月20日付で、総則の「目的」に関する事項の定款の変更を行いました。
委託会社は、株式会社みずほ銀行から、みずほグローバルオルタナティブインベストメンツ株式会社(以下「MGAI」といいます。)の発行済株式の全てについて2018年11月1日付で譲り受け、MGAIを100%子会社(新商号:アセットマネジメントOneオルタナティブインベストメンツ株式会社)としました。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

- (1) 三井住友信託銀行株式会社(「受託者」)

a. 資本金の額

2019年3月末日現在、342,037百万円

b. 事業の内容

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

(2) 販売会社

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

販売会社一覧表 (資本金の額は2019年3月末日現在)

名称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
大山日ノ丸証券株式会社	215	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。
みずほ証券株式会社	125,167	同上

2【関係業務の概要】

「受託者」は以下の業務を行います。

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

「販売会社」は以下の業務を行います。

- (1) 募集・販売の取り扱い
- (2) 受益者に対する一部解約事務
- (3) 受益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【その他】

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

独立監査人の監査報告書

2019年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成31年2月8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」に掲げられているグローバル・ナビの平成29年12月16日から平成30年12月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバル・ナビの平成30年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

令和1年8月9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」に掲げられているグローバル・ナビの平成30年12月18日から令和1年6月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、グローバル・ナビの令和1年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年12月18日から令和1年6月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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